공시일	2026-10-21
기준일	2026-10-20

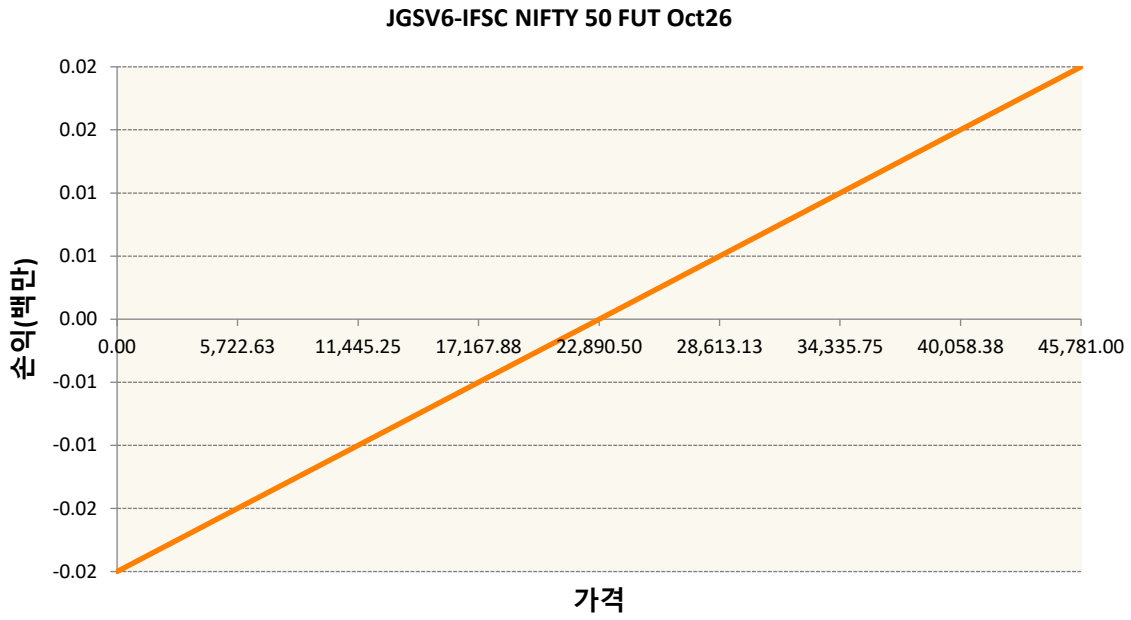
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	313	0	313	

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	2026-10-21
기준일	2026-10-20

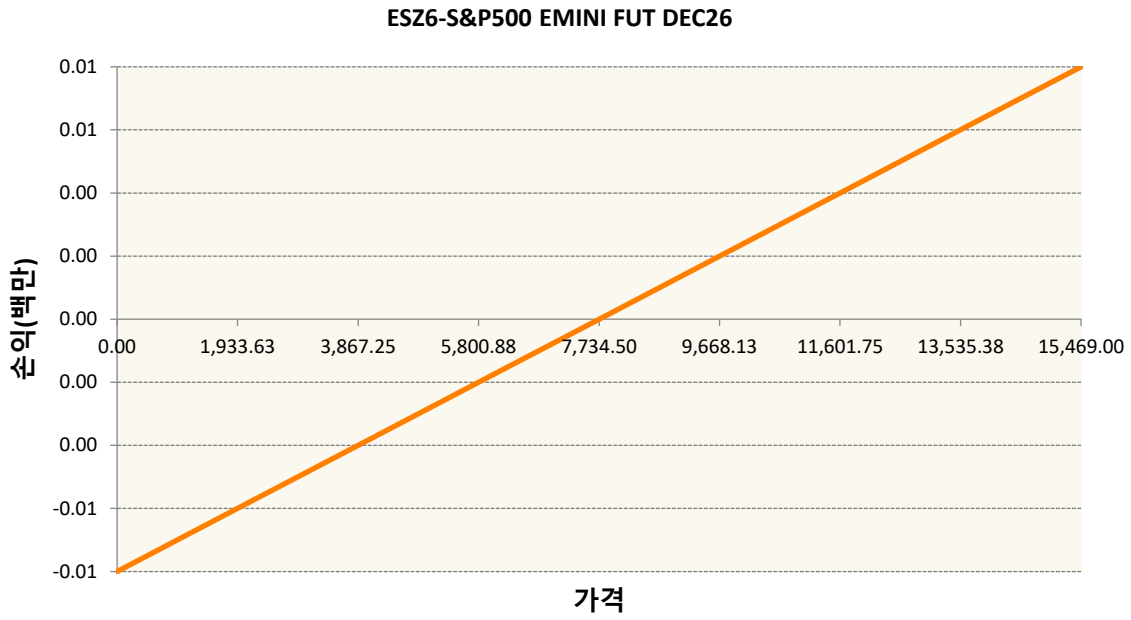
SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	535	0	535	

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	2026-10-21
기준일	2026-10-20

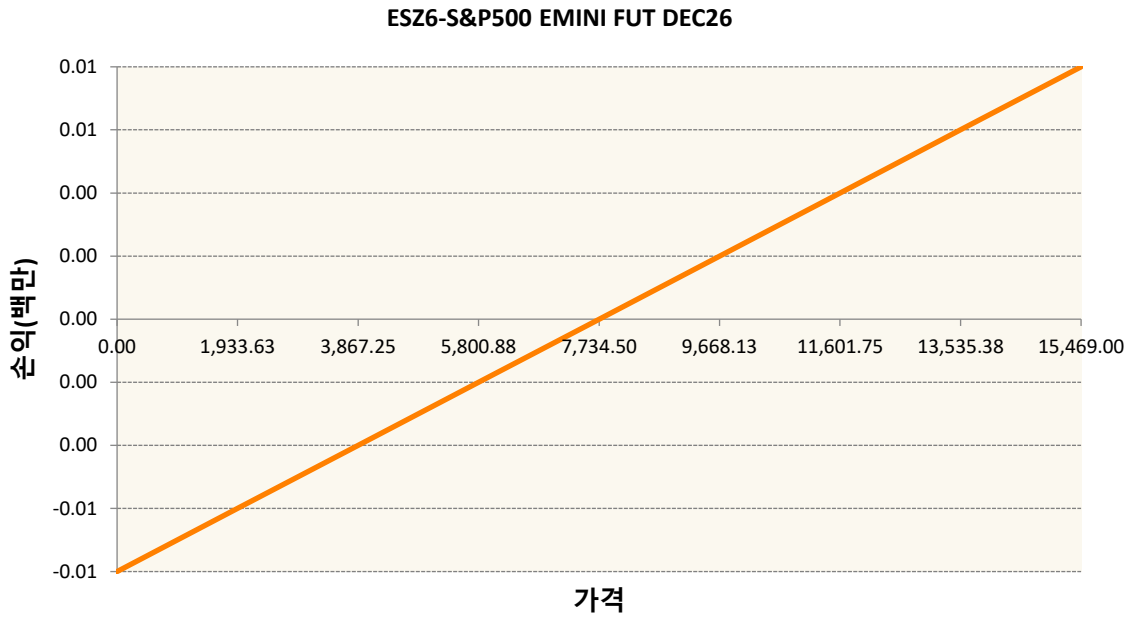
SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	534	0	534	

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	2026-10-21
기준일	2026-10-20

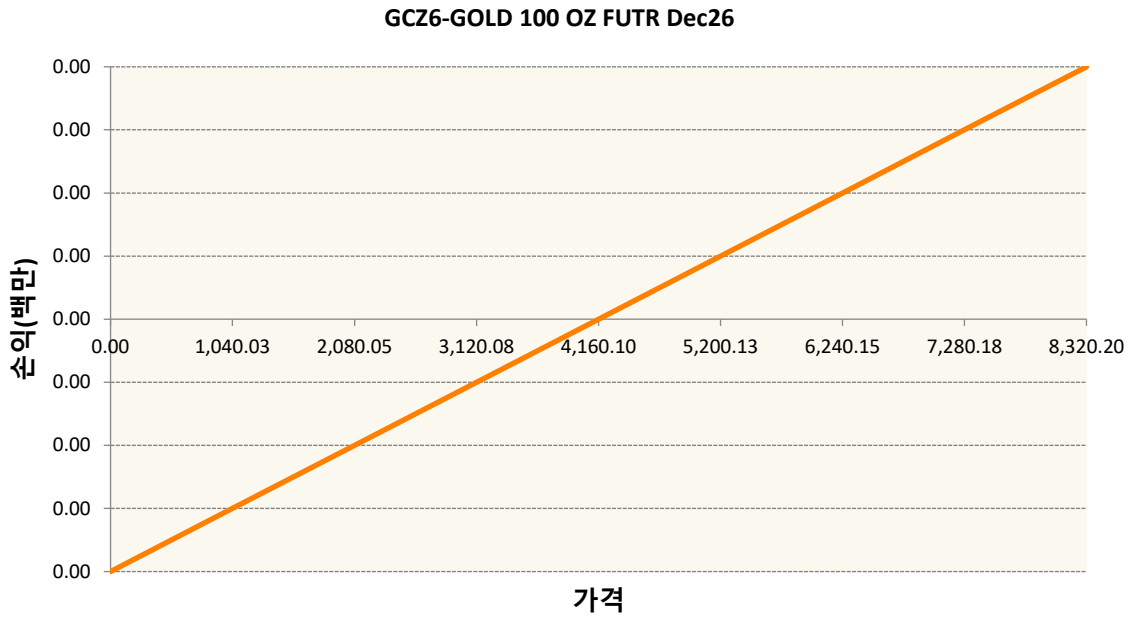
SOL골드커버드콜액티브특별자산상장지수(금

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			5,928	0	5,928	
누계	실물자산	옵션	0	0	0	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

AOGLDUSC0	GLD US 10/23/26 C387 EQUITY	3
GCZ6	GOLD 100 OZ FUTR Dec26	474

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

(단위:백만원)

607

공시일	2026-10-21
기준일	2026-10-20

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)

AOPLTRUAC PLTR US 10/23/26 C200 EQUITY	2
AOPLTRUAP PLTR US 10/23/26 P200 EQUITY	13
AOPLTRUC2(PLTR US 10/23/26 C207.5 EQUITY	0.45
AOPLTRUP2(PLTR US 10/23/26 P207.5 EQUITY	40

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

(단위:백만원)

190

공시일	2026-10-21
기준일	2026-10-20

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	4

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

(단위:백만원)

3

공시일	2026-10-21
기준일	2026-10-20

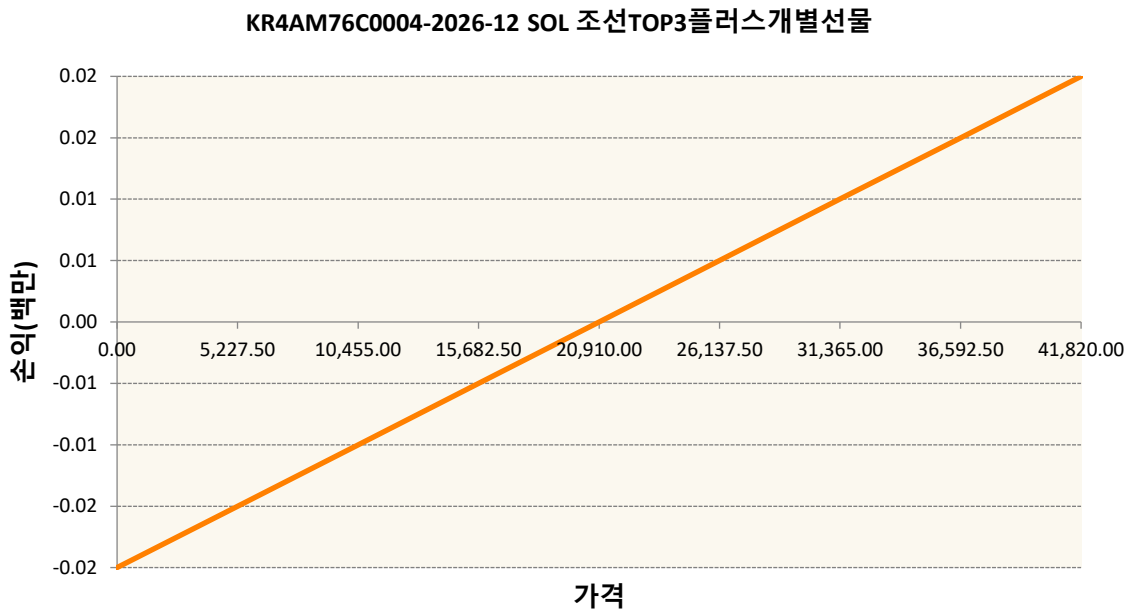
SOL조선TOP3플러스레버리지상장지수(주식)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	417	-417	장내
누계	유가증권	선물	6,406	0	6,406	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4AM76C0004	2026-12 SOL 조선TOP3플러스개별선물	5,064

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-5,064	-5,064	-5,064	-5,064	-5,064	-5,064	-5,064
-5.33%	-3,376	-3,376	-3,376	-3,376	-3,376	-3,376	-3,376
-2.67%	-1,688	-1,688	-1,688	-1,688	-1,688	-1,688	-1,688
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	1,688	1,688	1,688	1,688	1,688	1,688	1,688
5.33%	3,376	3,376	3,376	3,376	3,376	3,376	3,376
8.00%	5,064	5,064	5,064	5,064	5,064	5,064	5,064

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

8,629

공시일	2026-10-21
기준일	2026-10-20

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	2026-10-21
기준일	2026-10-20

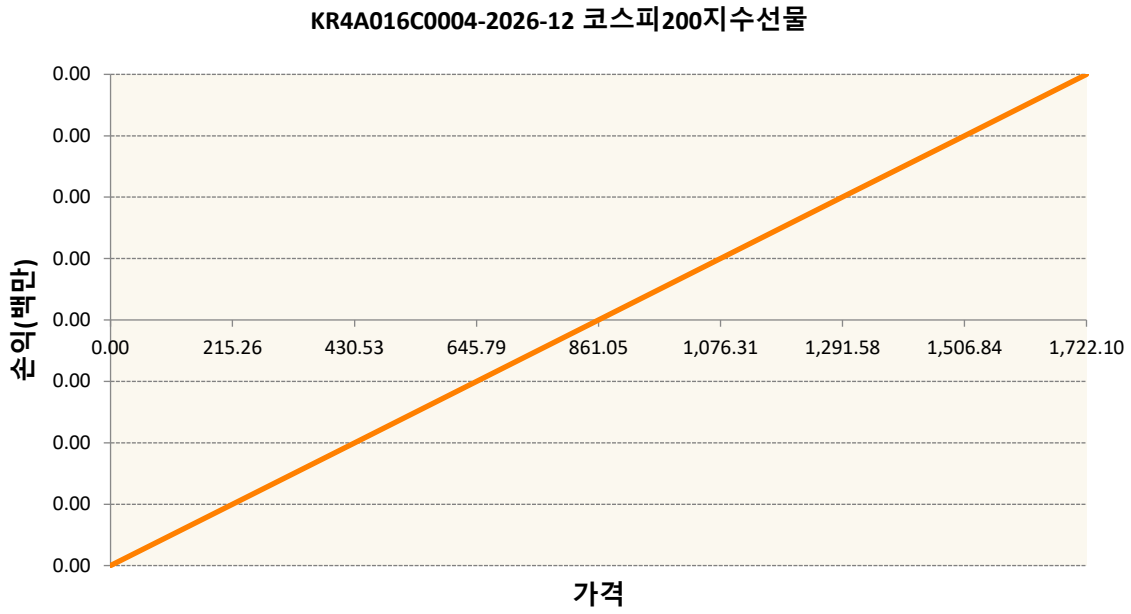
SOL 200타겟위클리커버드콜상장지수(주식)

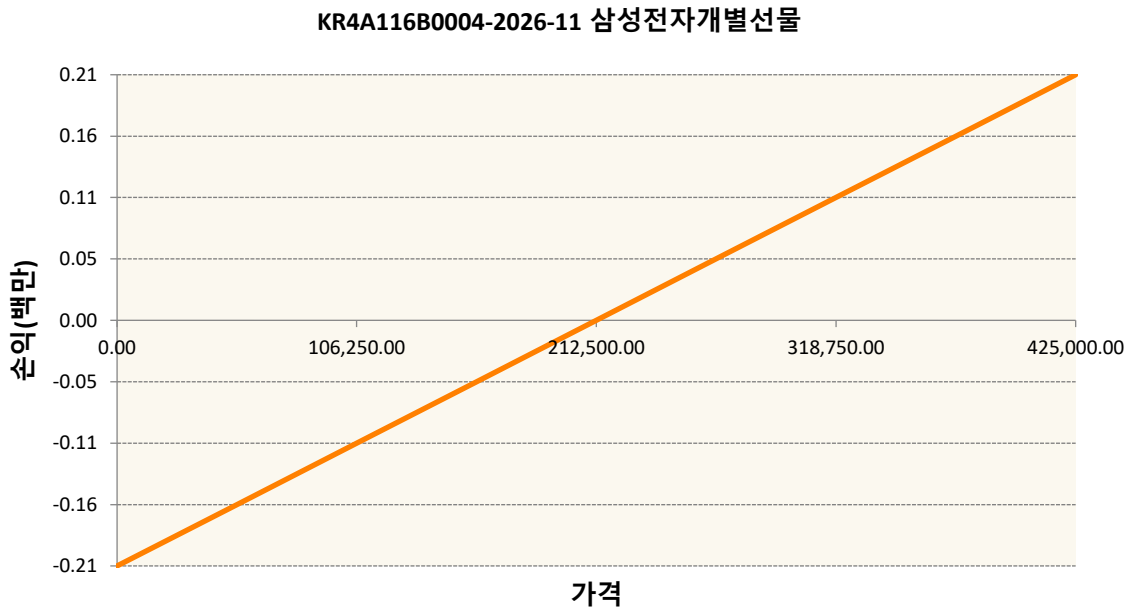
1. 계약금액

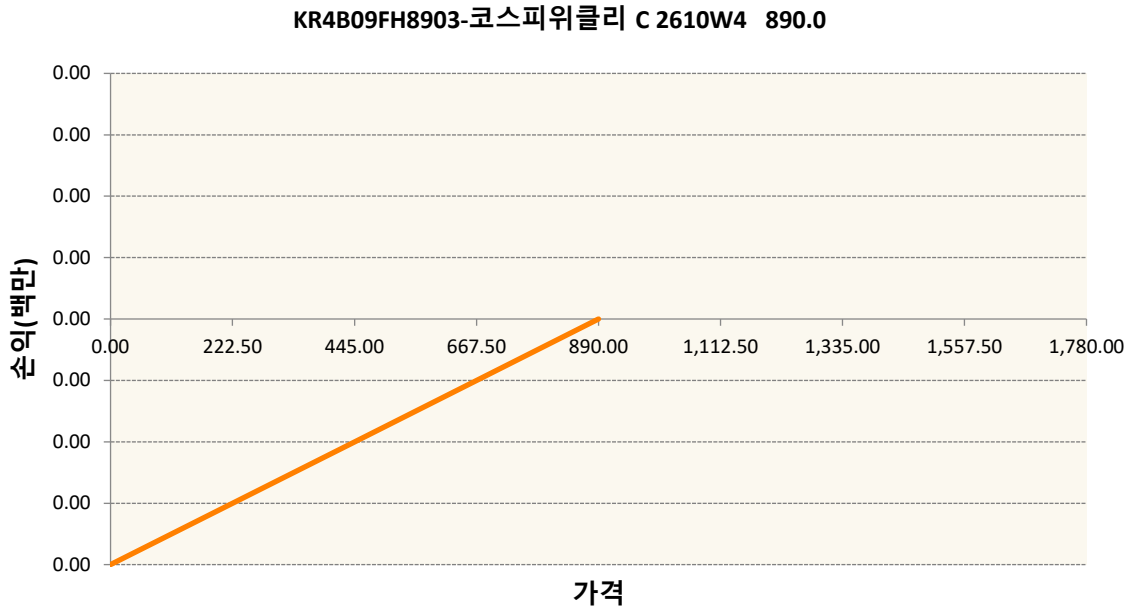
(단위:백만원)

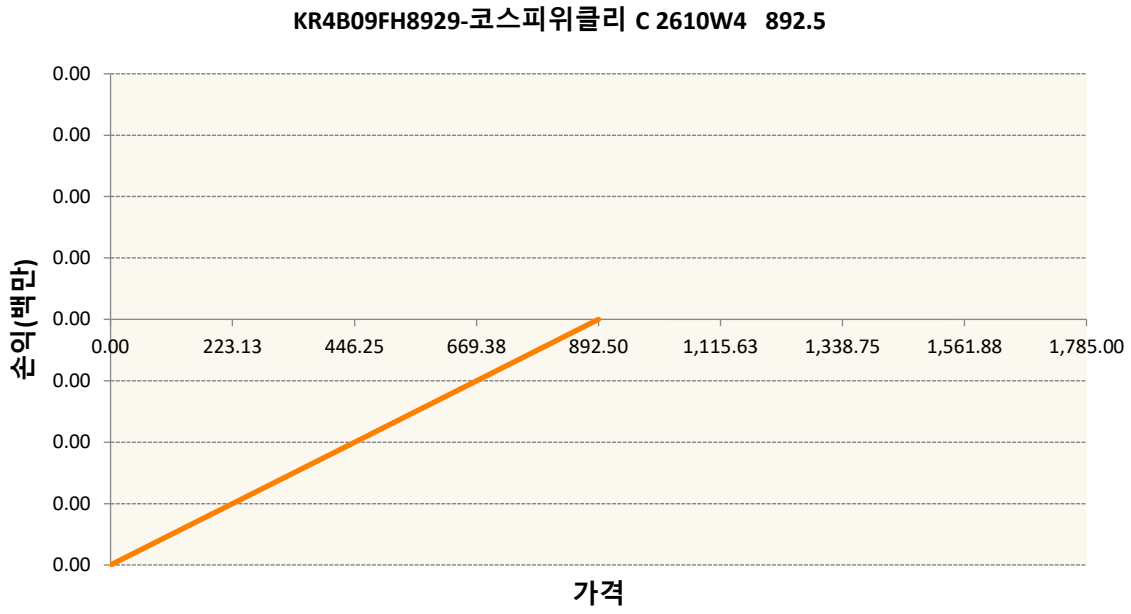
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	17,072	0	17,072	장내
누계	유가증권	옵션	0	38,313	-38,313	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

	KR4A016C0004 2026-12 코스피200지수선물						447
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-447	-447	-447	-447	-447	-447	-447
-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%	447	447	447	447	447	447	447
	KR4A116B0004 2026-11 삼성전자개별선물						914
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-914	-914	-914	-914	-914	-914	-914
-5.33%	-609	-609	-609	-609	-609	-609	-609
-2.67%	-305	-305	-305	-305	-305	-305	-305
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	305	305	305	305	305	305	305
5.33%	609	609	609	609	609	609	609
8.00%	914	914	914	914	914	914	914
	KR4B09FH8903		코스피위클리 C 2610W4	890.0			1,691
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,689	-1,689	-1,689	-1,689	-1,689	-1,690	-1,691
-5.33%	-1,099	-1,100	-1,100	-1,102	-1,104	-1,107	-1,111
-2.67%	-513	-516	-521	-527	-535	-545	-556
0%	48	34	18	0	-19	-39	-60
2.67%	503	475	448	420	392	364	335
5.33%	765	740	715	688	661	634	607
8.00%	859	848	834	819	802	783	764
	KR4B09FH8929		코스피위클리 C 2610W4	892.5			1,139
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,138	-1,138	-1,138	-1,138	-1,139	-1,139	-1,139
-5.33%	-743	-744	-744	-745	-746	-747	-750
-2.67%	-350	-352	-354	-358	-363	-369	-375
0%	29	21	11	0	-12	-25	-38
2.67%	345	327	309	291	272	254	235
5.33%	536	518	500	482	464	445	426
8.00%	608	599	589	578	566	553	539

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

10,884

공시일	2026-10-21
기준일	2026-10-20

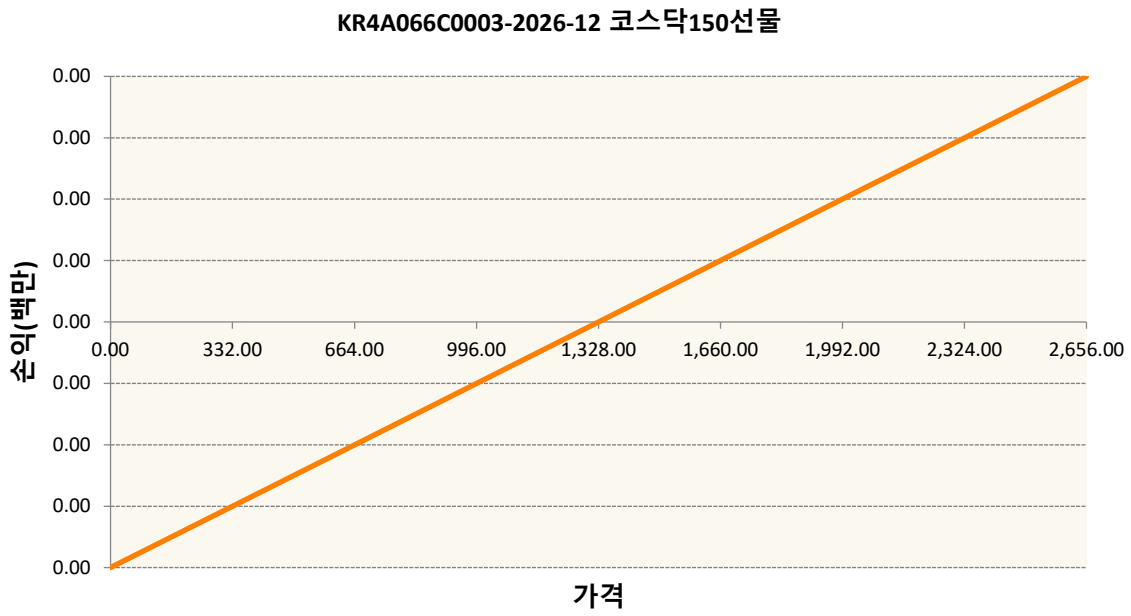
SOL코스닥150인덱스(주식-파생형)

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	544	0	544	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A066C0003	2026-12 코스닥150선물	43

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-43	-43	-43	-43	-43	-43	-43
-5.33%	-29	-29	-29	-29	-29	-29	-29
-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%	29	29	29	29	29	29	29
8.00%	43	43	43	43	43	43	43

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

142

공시일	2026-10-21
기준일	2026-10-20

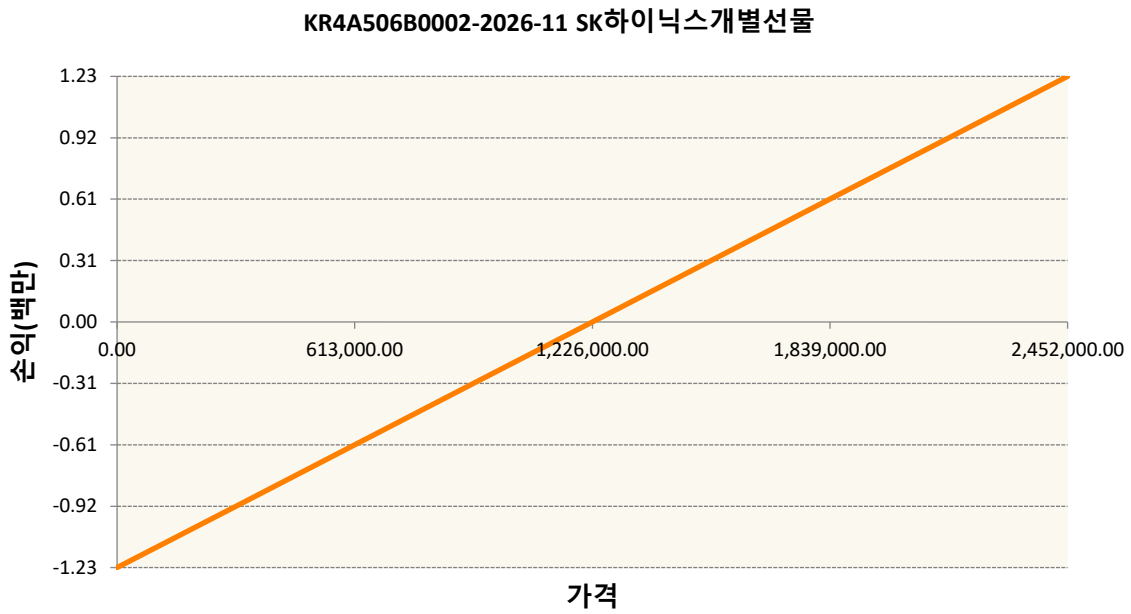
SOLSK하이닉스단일종목레버리지상장지수

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	1,219	-1,219	장내
누계	유가증권	선물	21,173	0	21,173	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A506B0002	2026-11 SK하이닉스개별선물	1,690

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,690	-1,690	-1,690	-1,690	-1,690	-1,690	-1,690
-5.33%	-1,126	-1,126	-1,126	-1,126	-1,126	-1,126	-1,126
-2.67%	-563	-563	-563	-563	-563	-563	-563
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	563	563	563	563	563	563	563
5.33%	1,126	1,126	1,126	1,126	1,126	1,126	1,126
8.00%	1,690	1,690	1,690	1,690	1,690	1,690	1,690

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

8,194

공시일	2026-10-21
기준일	2026-10-20

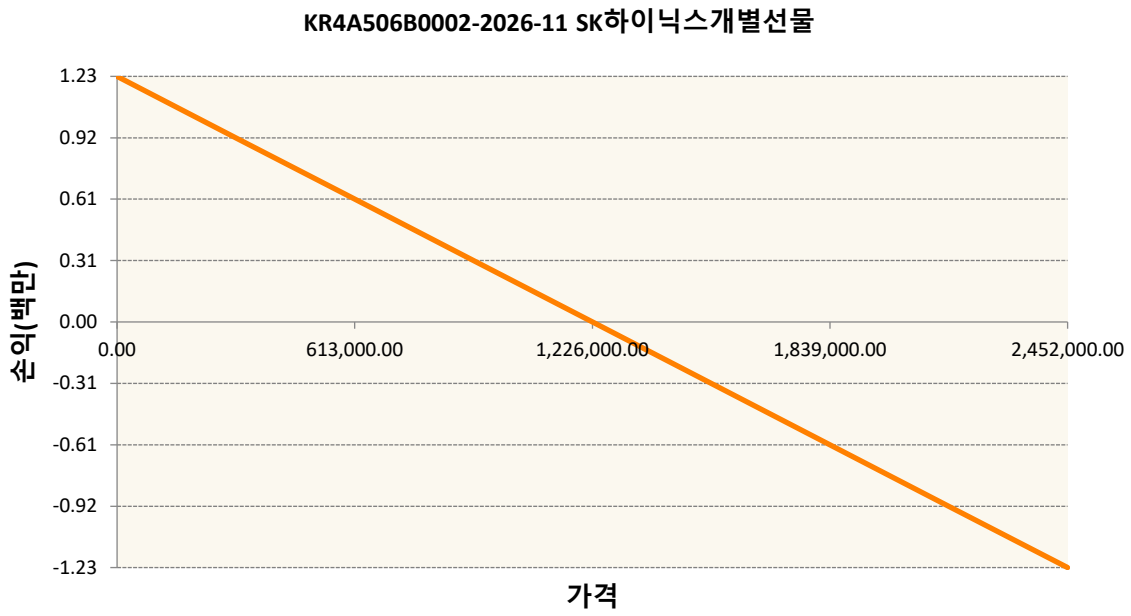
SOLSK하이닉스선물단일종목인버스2X상장지

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	7,172	22,089	-14,917	장내
누계	유가증권	선물	0	238,555	-238,555	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A506B0002	2026-11 SK하이닉스개별선물	19,038

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	19,038	19,038	19,038	19,038	19,038	19,038	19,038
-5.33%	12,692	12,692	12,692	12,692	12,692	12,692	12,692
-2.67%	6,346	6,346	6,346	6,346	6,346	6,346	6,346
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-6,346	-6,346	-6,346	-6,346	-6,346	-6,346	-6,346
5.33%	-12,692	-12,692	-12,692	-12,692	-12,692	-12,692	-12,692
8.00%	-19,038	-19,038	-19,038	-19,038	-19,038	-19,038	-19,038

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

92,325

공시일	2026-10-21
기준일	2026-10-20

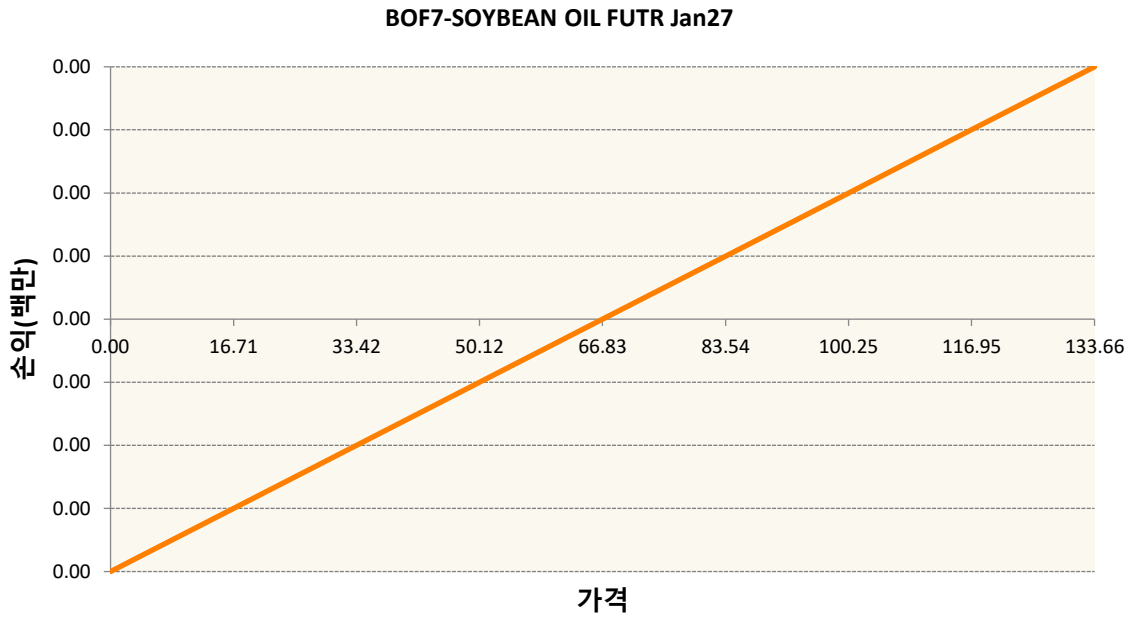
포커스농산물모(채권-파생형)

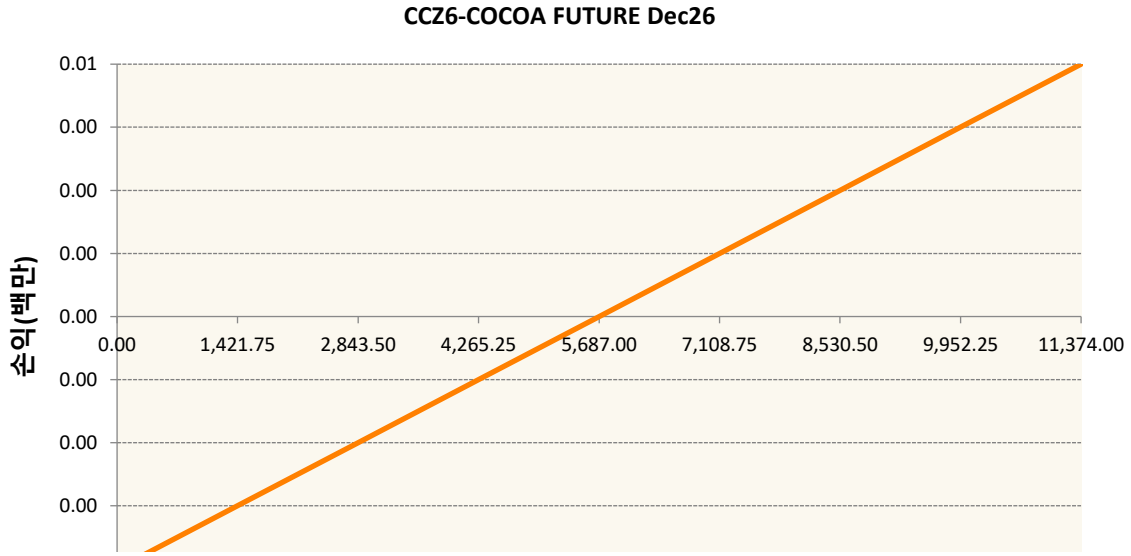
1. 계약금액

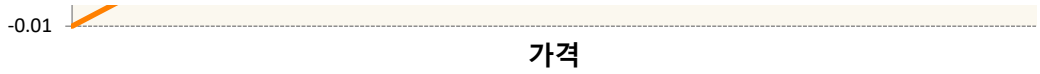
(단위:USD 백만)

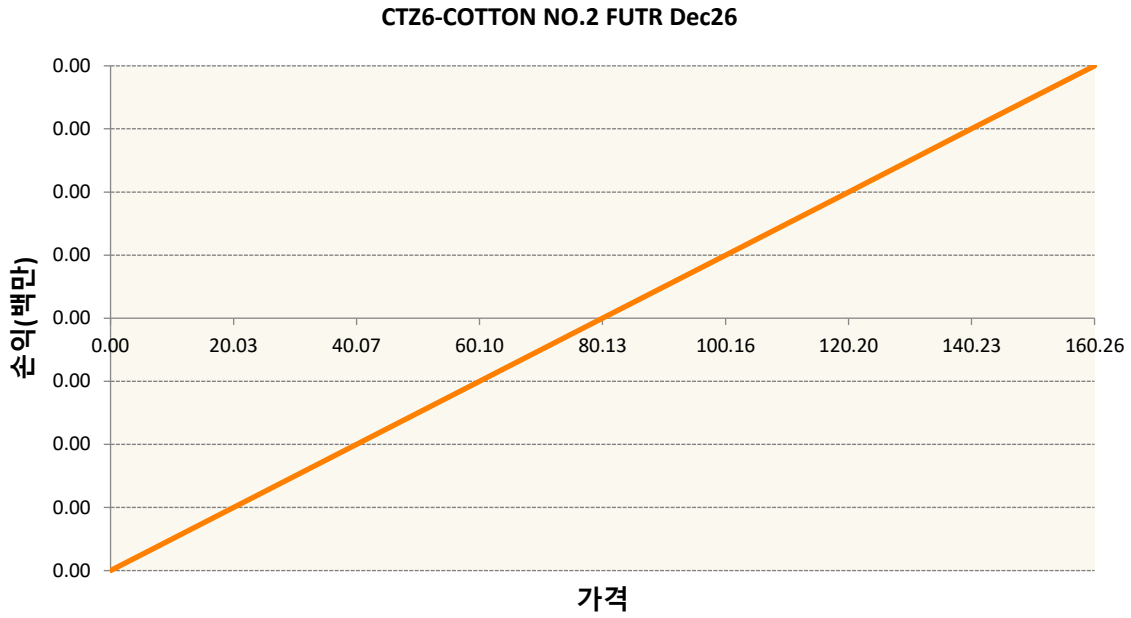
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	실물자산	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	실물자산	선물	350	0	350	
누계	유가증권	선물	2,259	0	2,259	
누계	통화	선물	0	318	-318	장내

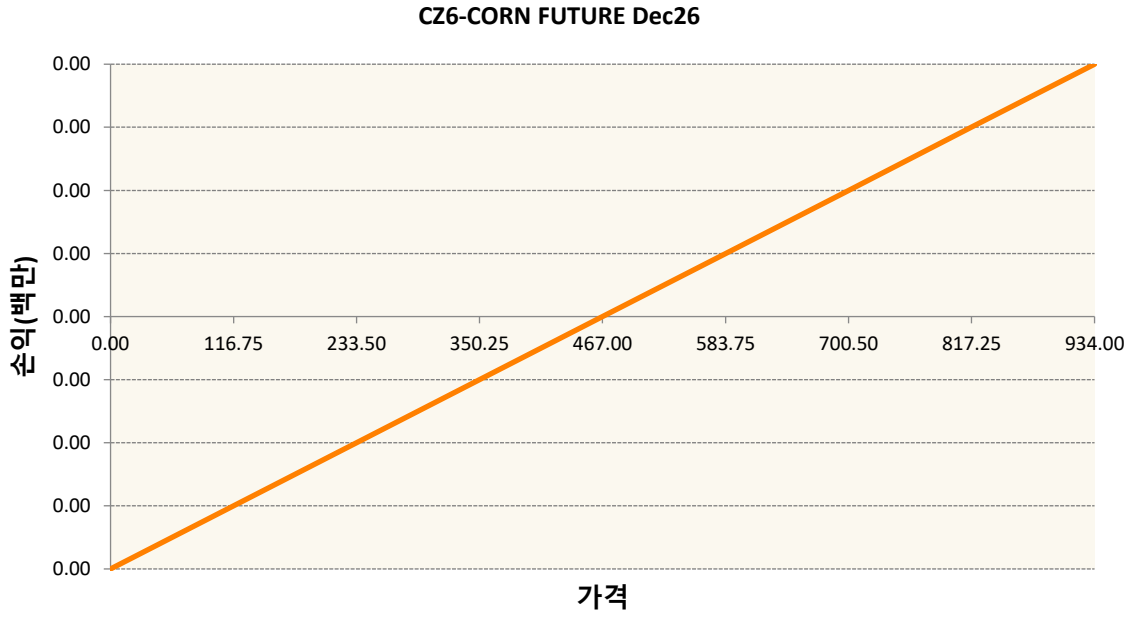
2. 만기시점의 손익구조

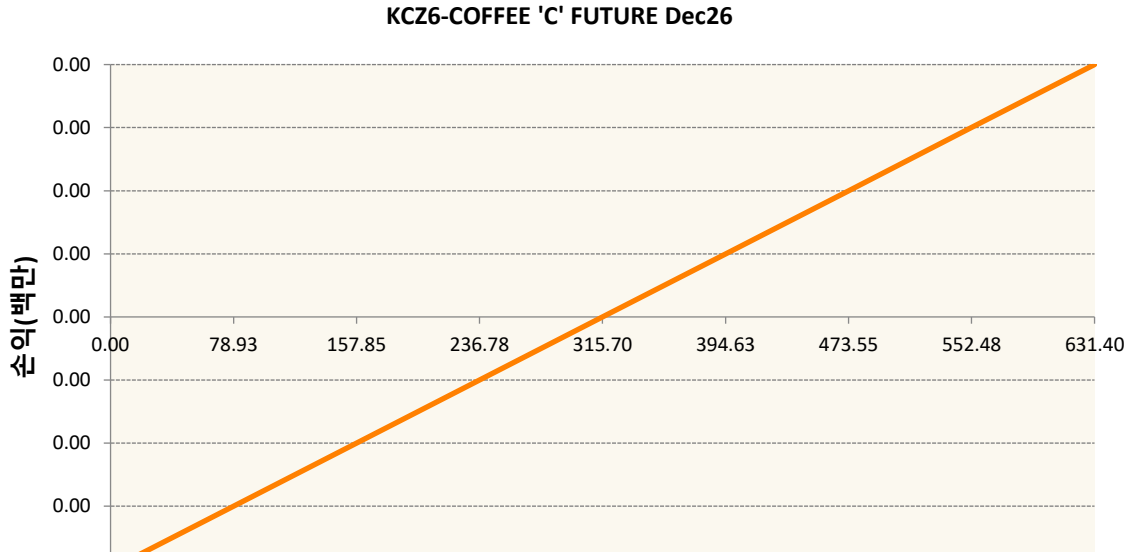


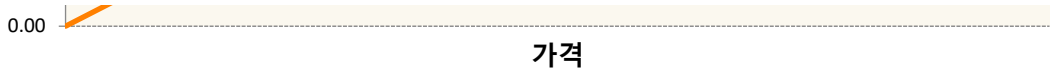



-0.01
가격

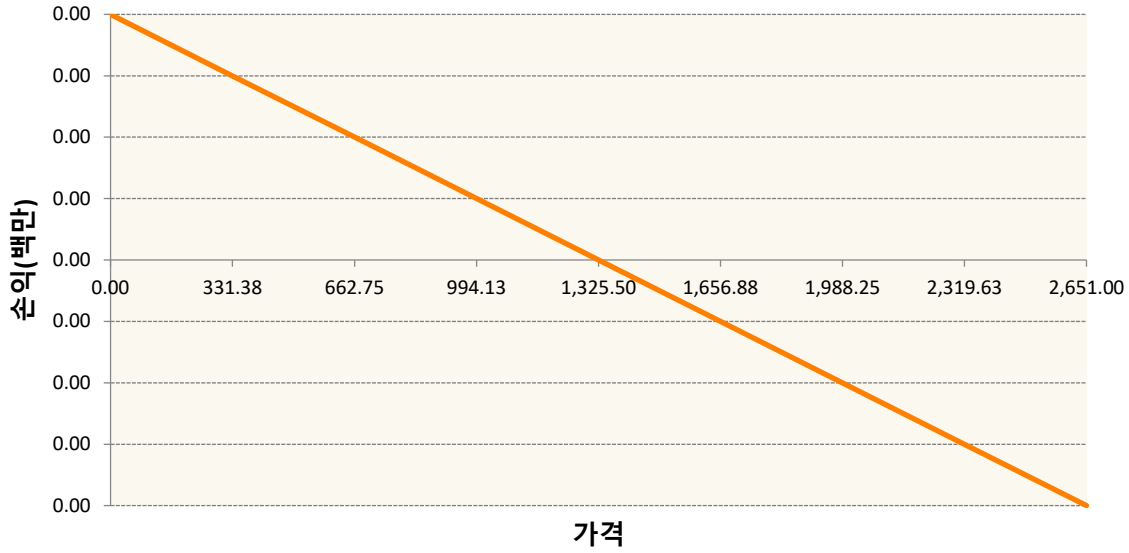

CTZ6-COTTON NO.2 FUTR Dec26
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
20.03
40.07
60.10
80.13
100.16
120.20
140.23
160.26
손익(백만)
가격


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
116.75
233.50
350.25
467.00
583.75
700.50
817.25
934.00
손익(백만)
가격

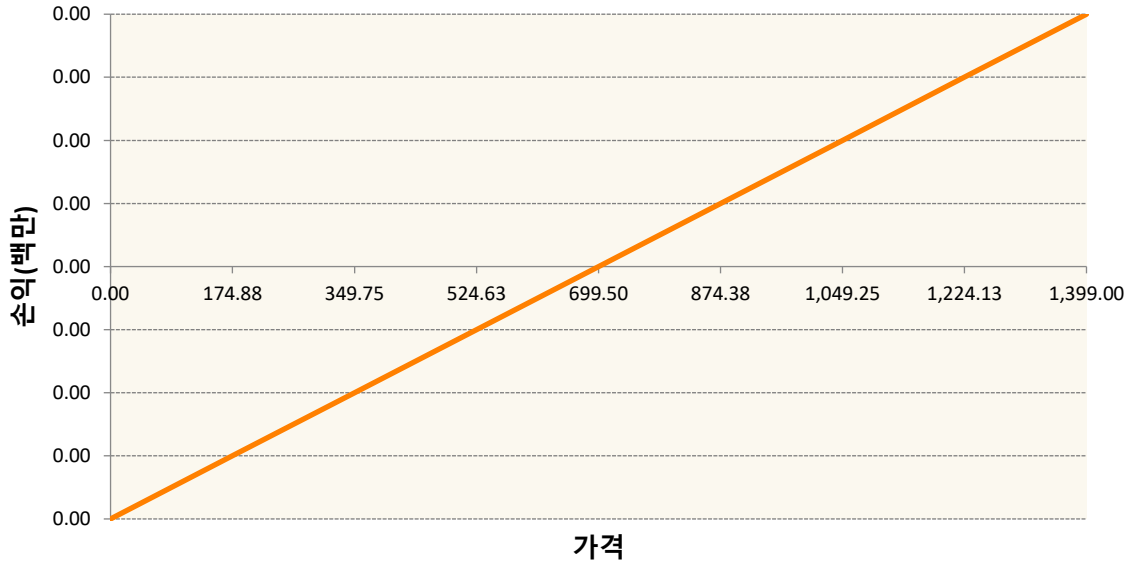

KCZ6-COFFEE 'C' FUTURE Dec26
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
78.93
157.85
236.78
315.70
394.63
473.55
552.48
631.40
손익(백만)



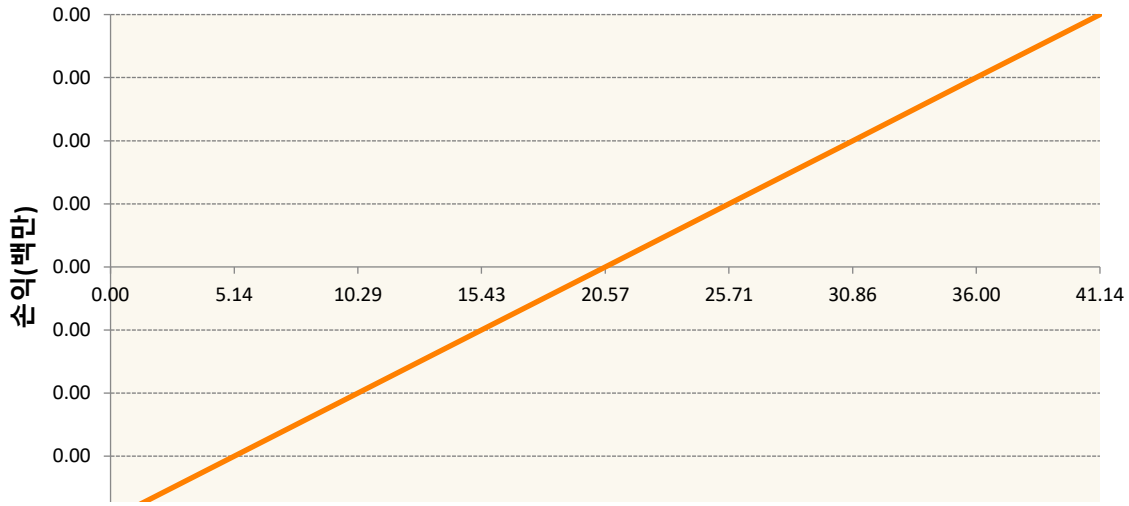
KR4A756B0009-2026-11 달러선물

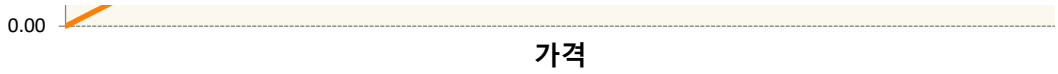


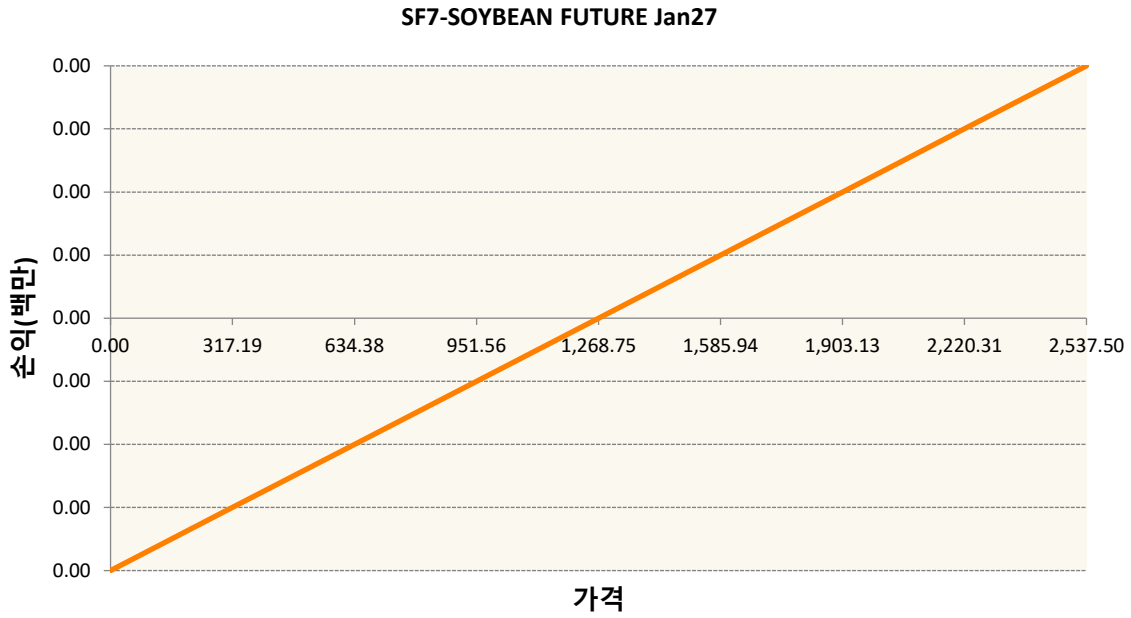
KWZ6-KC HRW WHEAT FUT Dec26

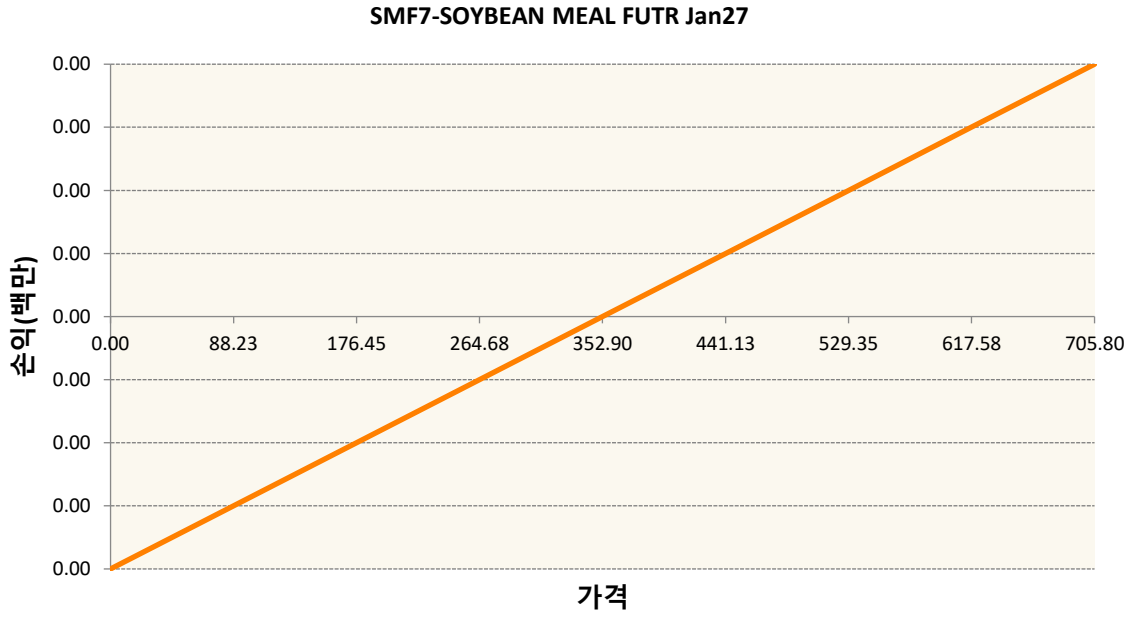


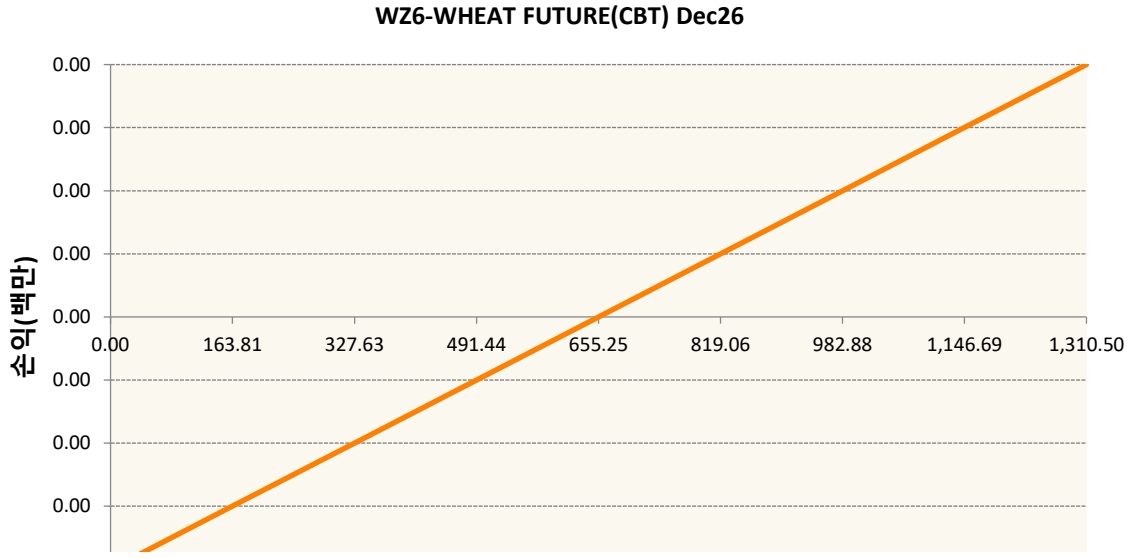
SBH7-SUGAR #11 (WORLD) MAR27




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
317.19
634.38
951.56
1,268.75
1,585.94
1,903.13
2,220.31
2,537.50
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
88.23
176.45
264.68
352.90
441.13
529.35
617.58
705.80
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
163.81
327.63
491.44
655.25
819.06
982.88
1,146.69
1,310.50
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	2026-10-21
기준일	2026-10-20

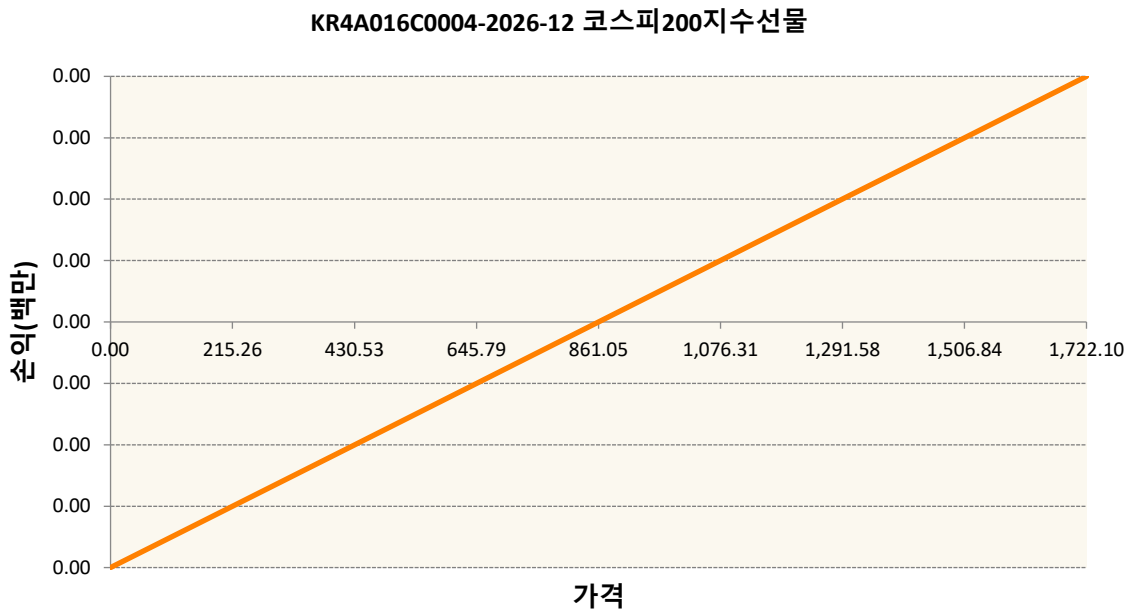
스마트인덱스모

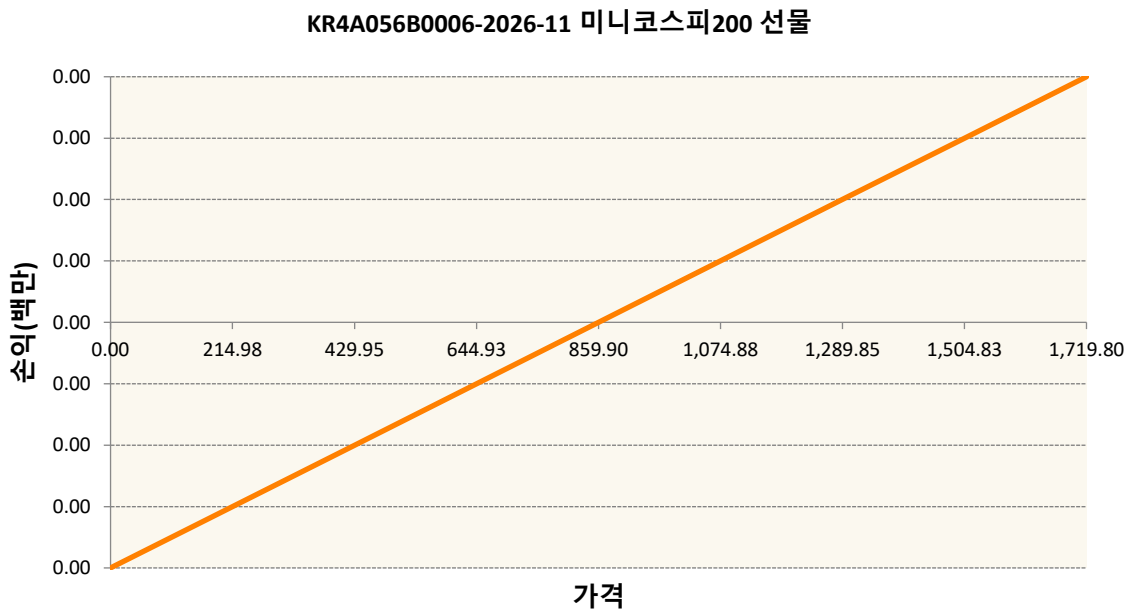
1. 계약금액

(단위:백만원)

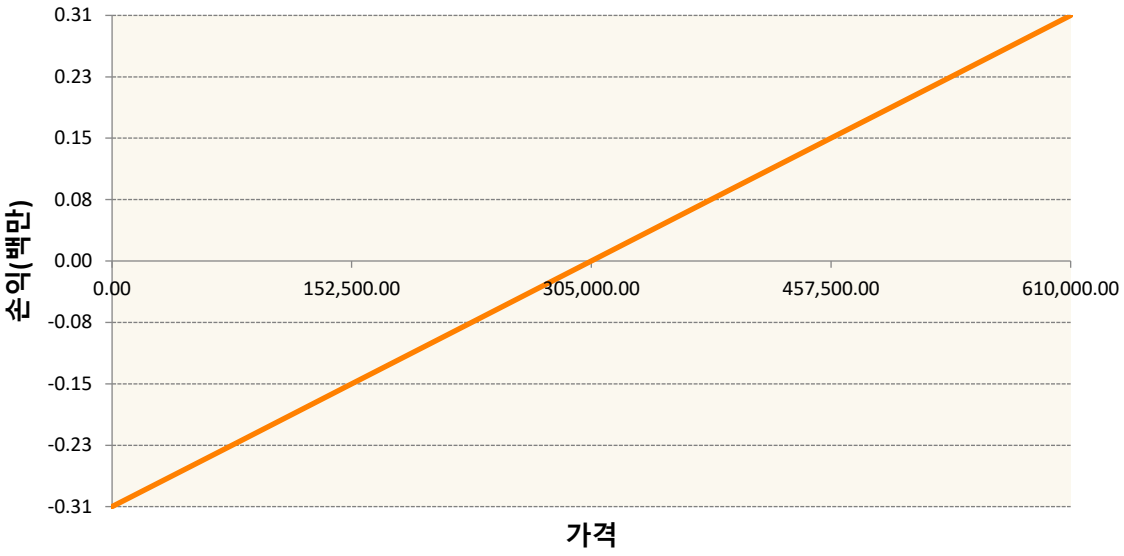
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	593	727	-133	장내
누계	유가증권	선물	7,693	73	7,621	장내

2. 만기시점의 손익구조

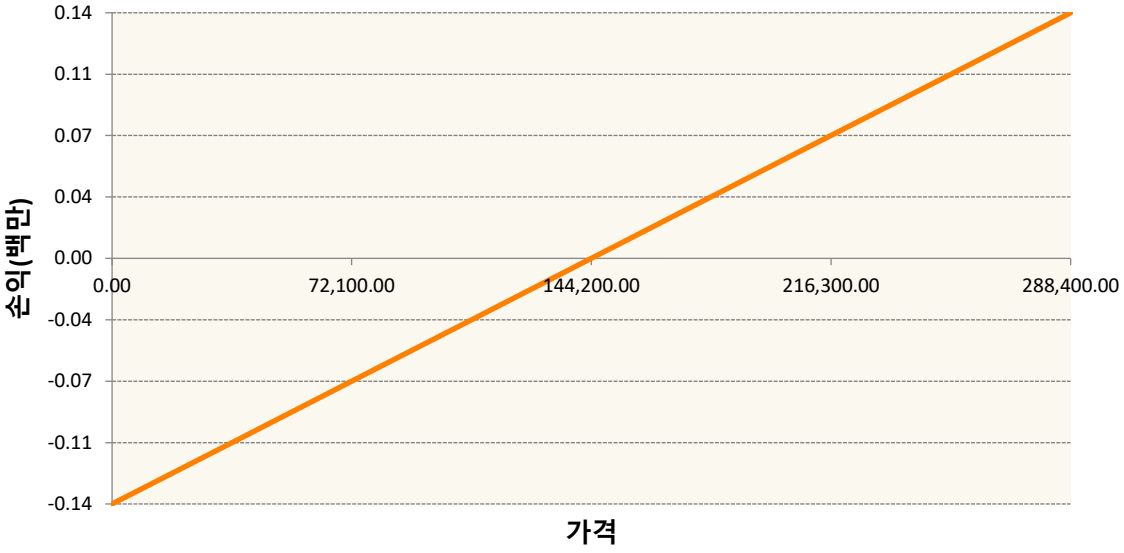




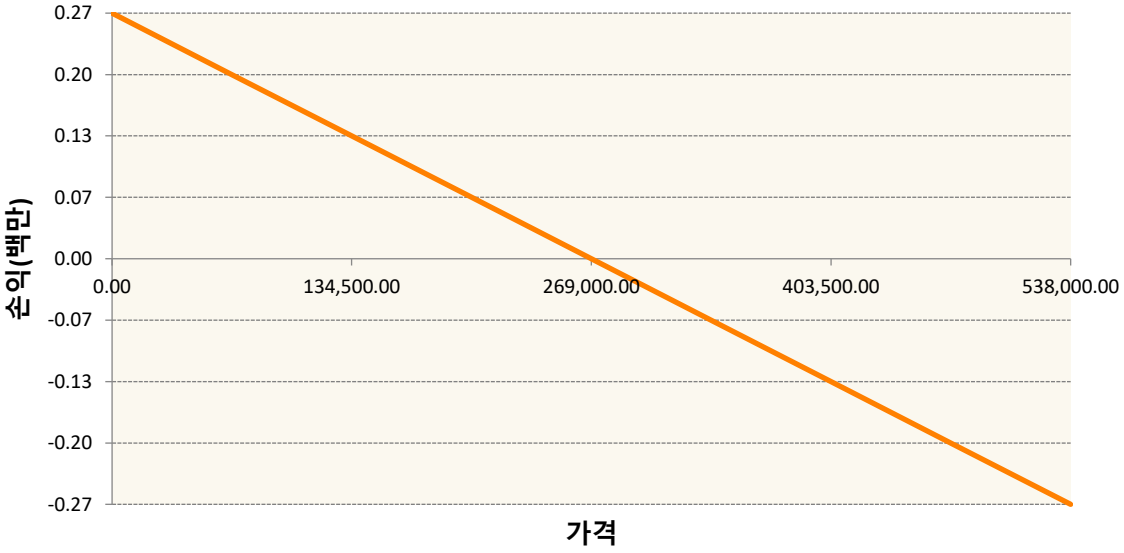
KR4A1Q6B0009-2026-11 에이피알개별선물



KR4AB26B0009-2026-11 S-Oil개별선물



KR4ADK6B0008-2026-11 코스맥스개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

	KR4A016C0004	2026-12 코스피200지수선물					412
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-412	-412	-412	-412	-412	-412	-412
-5.33%	-275	-275	-275	-275	-275	-275	-275
-2.67%	-137	-137	-137	-137	-137	-137	-137
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	137	137	137	137	137	137	137
5.33%	275	275	275	275	275	275	275
8.00%	412	412	412	412	412	412	412

	KR4A056B0006	2026-11 미니코스피200 선물					38
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-38	-38	-38	-38	-38	-38	-38
-5.33%	-25	-25	-25	-25	-25	-25	-25
-2.67%	-13	-13	-13	-13	-13	-13	-13
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	13	13	13	13	13	13	13
5.33%	25	25	25	25	25	25	25
8.00%	38	38	38	38	38	38	38

	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

	KR4AB26B0009	2026-11 S-Oil개별선물					12
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-12	-12	-12	-12	-12	-12	-12
-5.33%	-8	-8	-8	-8	-8	-8	-8
-2.67%	-4	-4	-4	-4	-4	-4	-4
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	4	4	4	4	4	4	4
5.33%	8	8	8	8	8	8	8
8.00%	12	12	12	12	12	12	12

	KR4ADK6B0008	2026-11 코스맥스개별선물					6
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	6	6	6	6	6	6	6
-5.33%	4	4	4	4	4	4	4
-2.67%	2	2	2	2	2	2	2
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-2	-2	-2	-2	-2	-2	-2
5.33%	-4	-4	-4	-4	-4	-4	-4
8.00%	-6	-6	-6	-6	-6	-6	-6

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

1,559

공시일	2026-10-21
기준일	2026-10-20

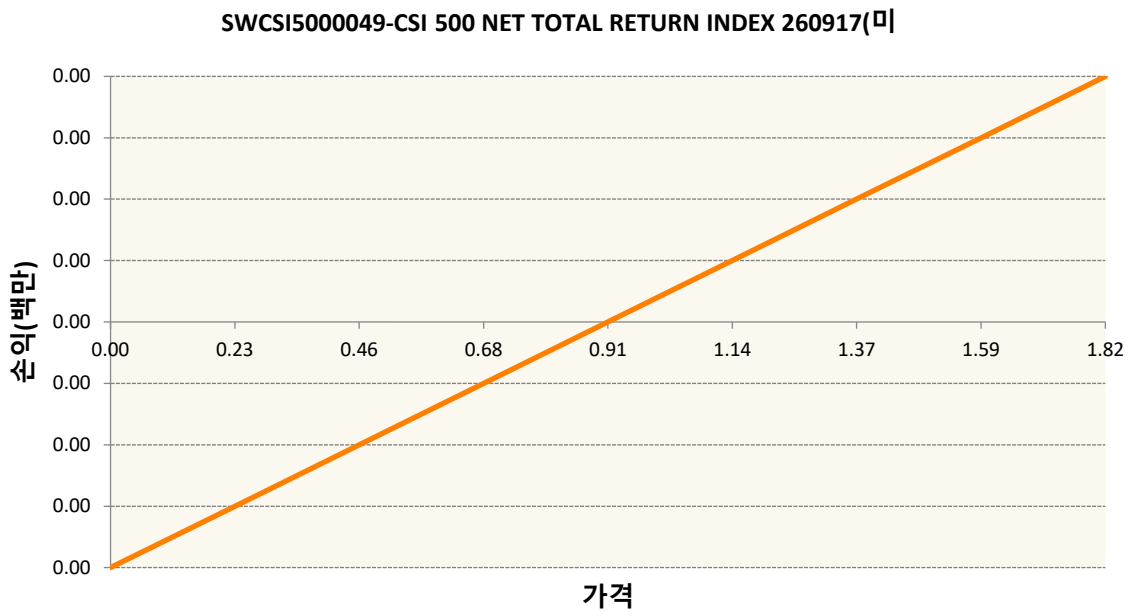
SOL차이나강소기업CSI500상장

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	4,842	0	4,842	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 CSI 500 NET TOTAL RETURN INDEX 260917(미	387

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

621

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2026-10-21
기준일	2026-10-20

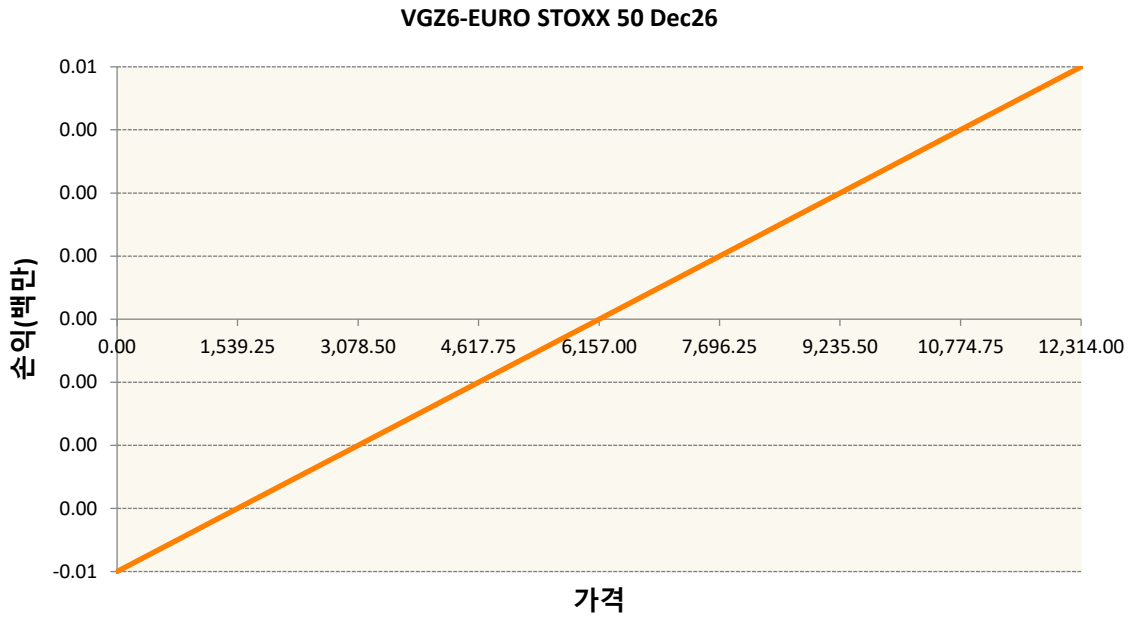
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,169	0	1,169	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGZ6	EURO STOXX 50 Dec26	94

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

(단위:백만원)

68

공시일	2026-10-21
기준일	2026-10-20

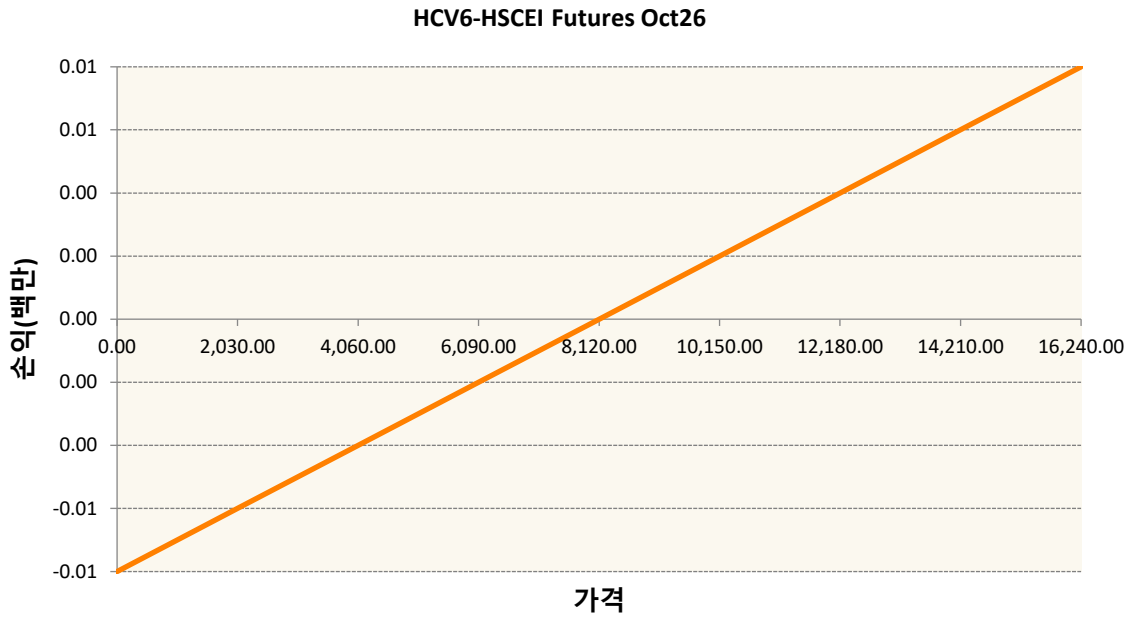
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	2026-10-21
기준일	2026-10-20

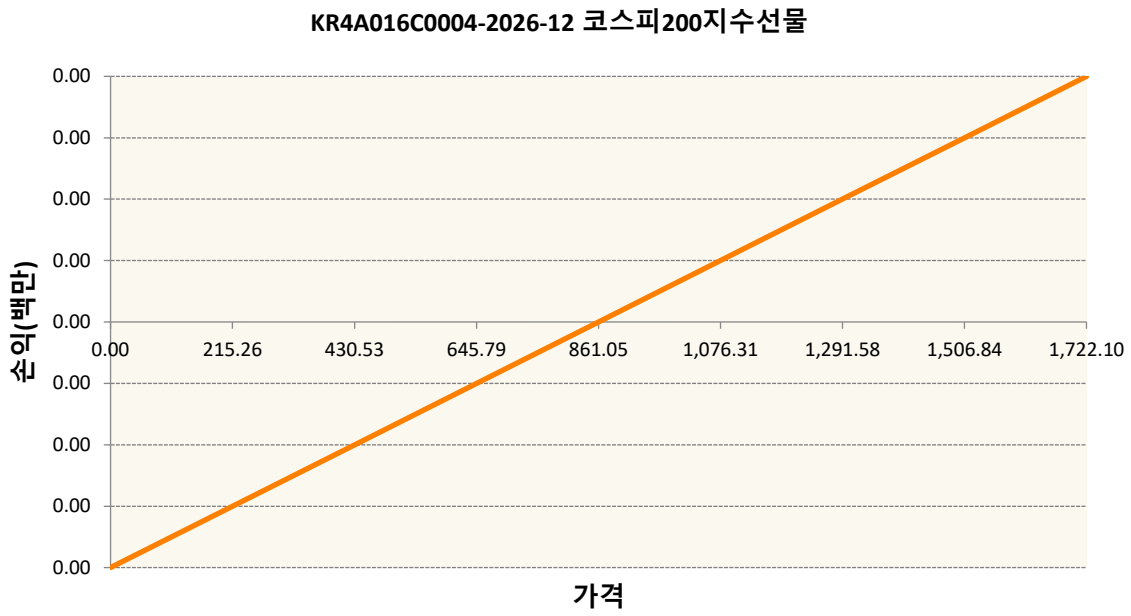
커버드콜모(주식혼합-파생형)

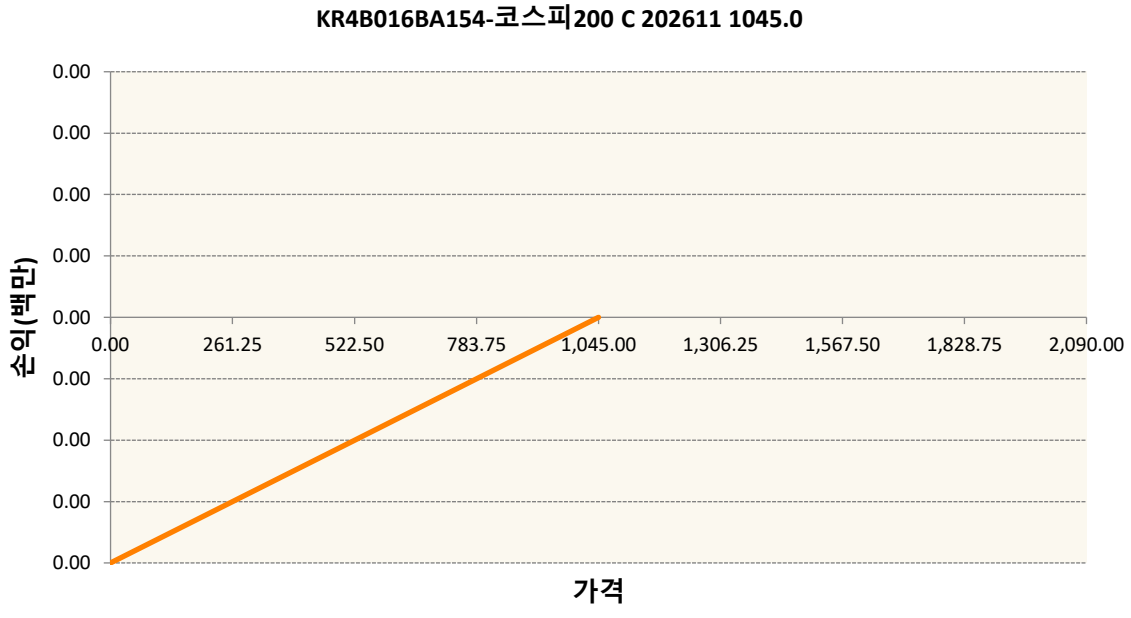
1. 계약금액

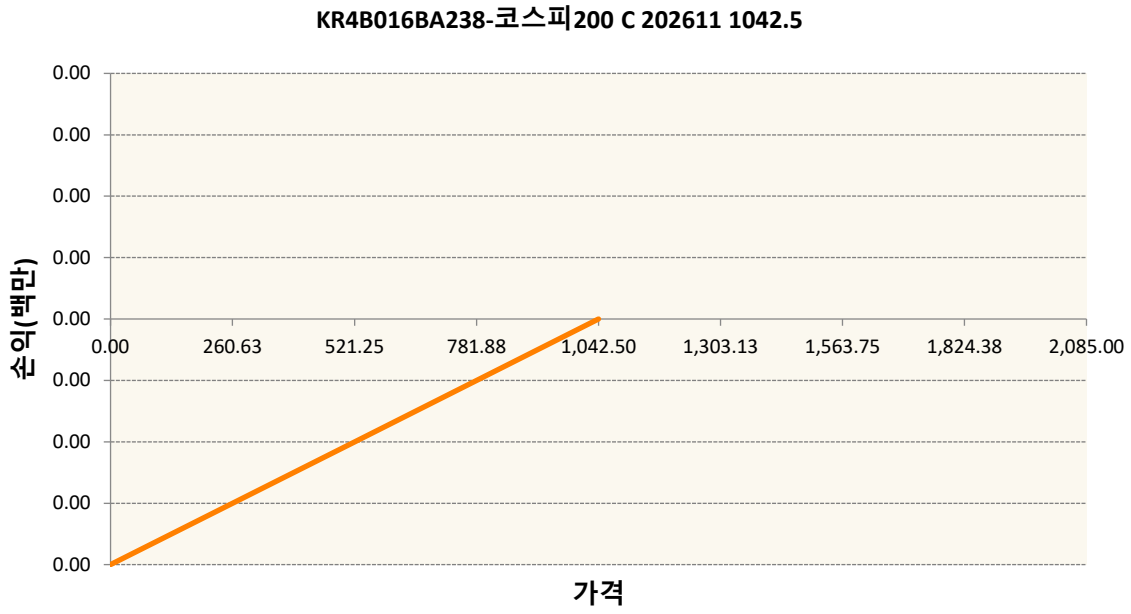
(단위:백만원)

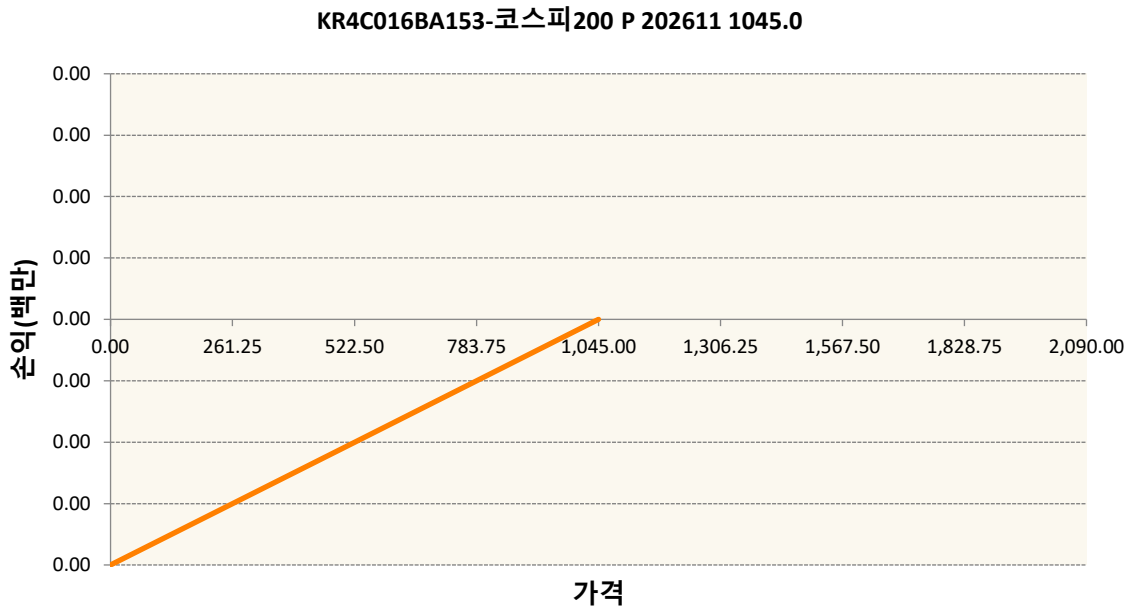
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	431	0	431	장내
누계	유가증권	옵션	0	49,876	-49,876	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A016C0004	2026-12 코스피200지수선물						34
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-34	-34	-34	-34	-34	-34	-34
-5.33%	-23	-23	-23	-23	-23	-23	-23
-2.67%	-11	-11	-11	-11	-11	-11	-11
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	11	11	11	11	11	11	11
5.33%	23	23	23	23	23	23	23
8.00%	34	34	34	34	34	34	34
KR4B016BA154	코스피200 C 202611 1045.0						1,963
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,892	-1,895	-1,900	-1,909	-1,922	-1,940	-1,963
-5.33%	-1,231	-1,237	-1,246	-1,261	-1,281	-1,307	-1,339
-2.67%	-573	-584	-600	-623	-653	-689	-730
0%	79	60	34	0	-41	-88	-142
2.67%	720	690	651	604	550	490	424
5.33%	1,344	1,299	1,245	1,184	1,116	1,042	963
8.00%	1,943	1,881	1,810	1,733	1,650	1,563	1,472
	KR4B016BA238		코스피200 C 202611 1042.5				626
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-602	-603	-605	-608	-612	-618	-626
-5.33%	-391	-393	-397	-401	-408	-417	-427
-2.67%	-182	-185	-191	-198	-208	-220	-233
0%	26	20	11	0	-13	-29	-46
2.67%	230	220	207	192	175	155	134
5.33%	429	414	396	376	354	330	305
8.00%	619	598	575	550	524	495	466
	KR4C016BA153		코스피200 P 202611 1045.0				643
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-620	-621	-622	-625	-630	-636	-643
-5.33%	-403	-405	-408	-413	-420	-428	-439
-2.67%	-188	-191	-197	-204	-214	-226	-239
0%	26	20	11	0	-13	-29	-46
2.67%	236	226	213	198	180	161	139
5.33%	440	426	408	388	365	341	315
8.00%	637	616	593	568	541	512	482

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

6,323

공시일	2026-10-21
기준일	2026-10-20

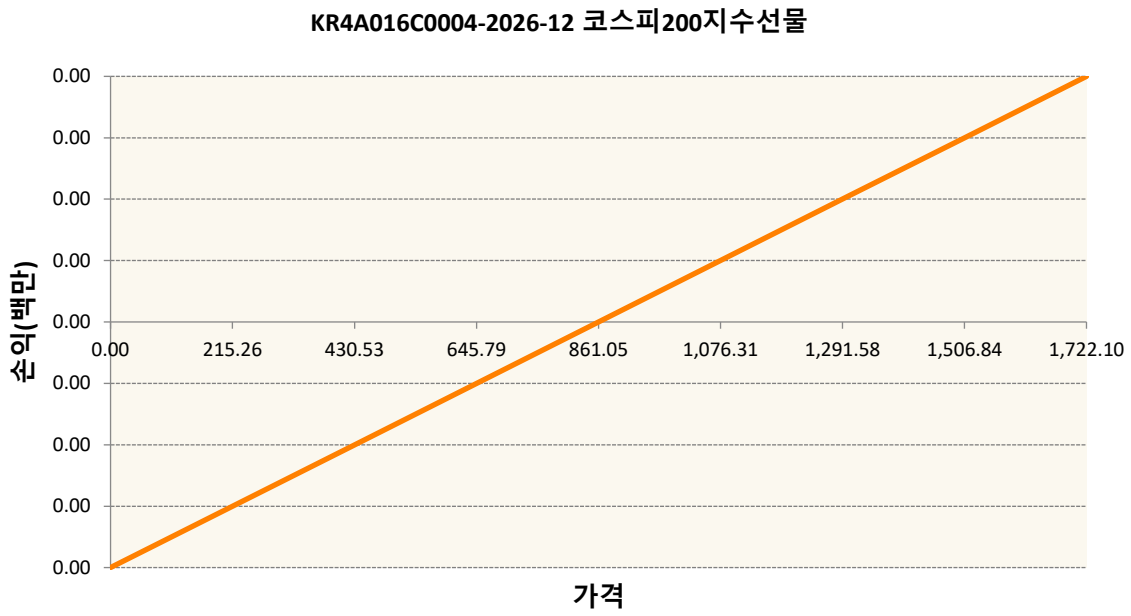
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

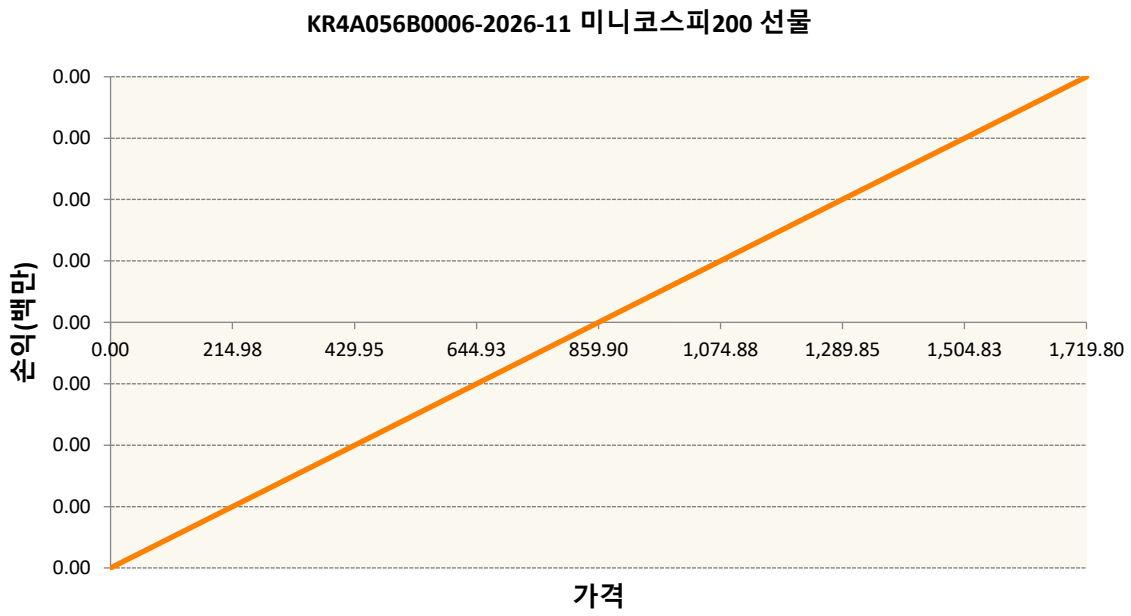
1. 계약금액

(단위:백만원)

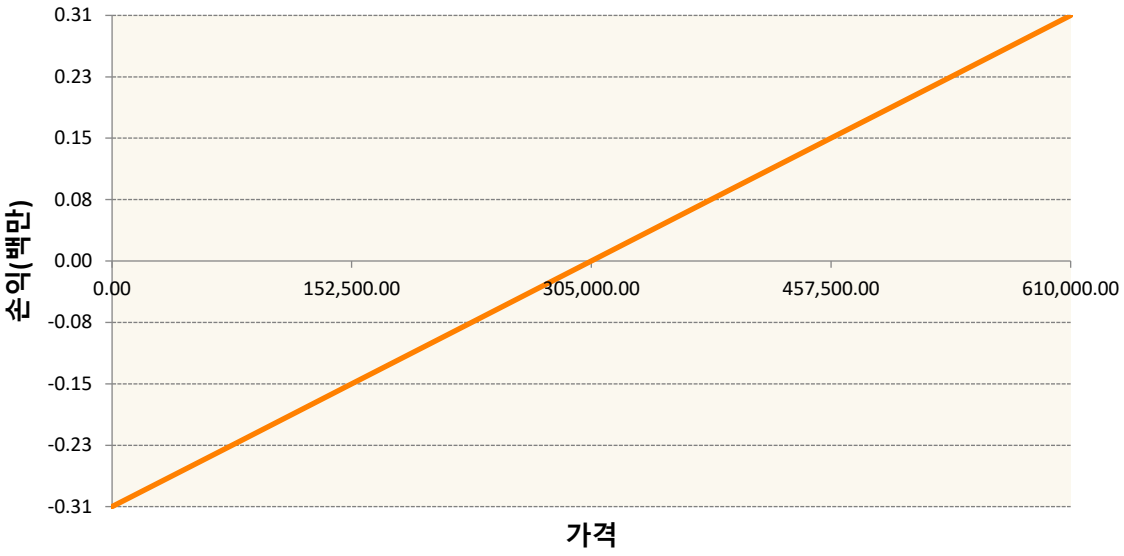
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	42	235	-192	장내
누계	유가증권	선물	1,993	16	1,977	장내

2. 만기시점의 손익구조

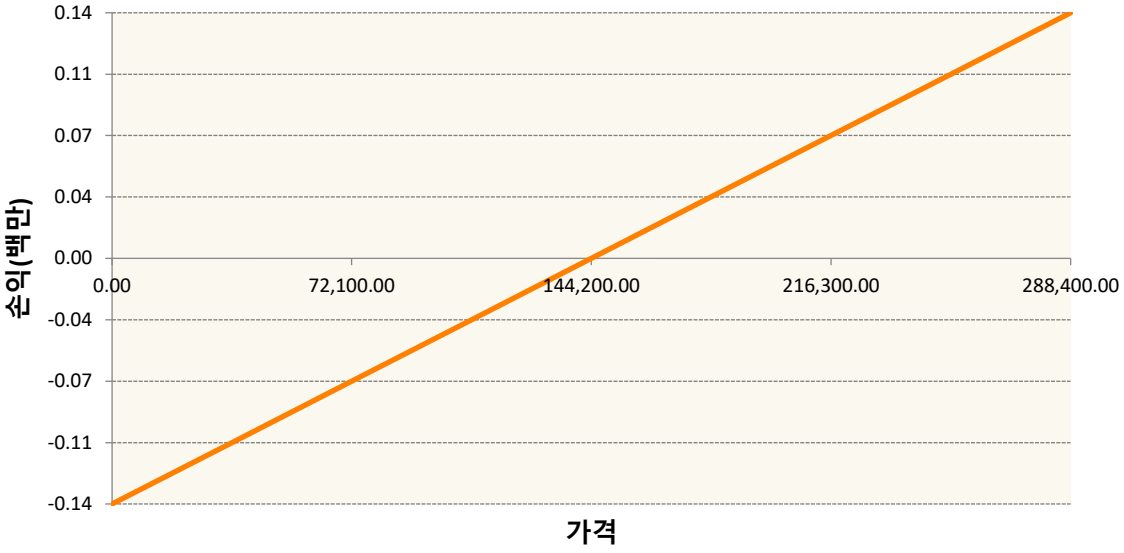




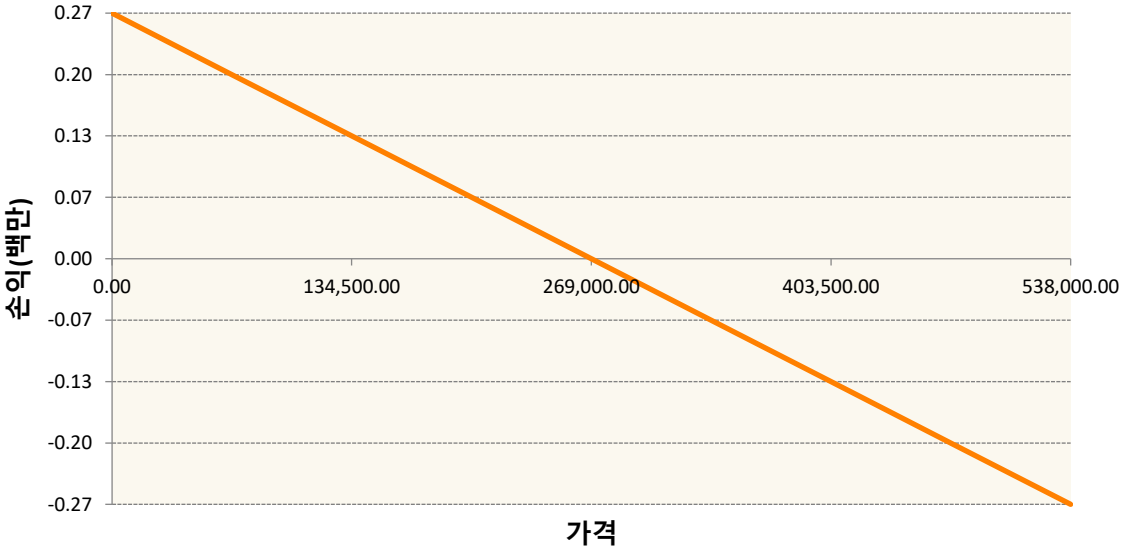
KR4A1Q6B0009-2026-11 에이피알개별선물



KR4AB26B0009-2026-11 S-Oil개별선물



KR4ADK6B0008-2026-11 코스맥스개별선물



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						21
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-21	-21	-21	-21	-21	-21	-21
-5.33%	-14	-14	-14	-14	-14	-14	-14
-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%	14	14	14	14	14	14	14
8.00%	21	21	21	21	21	21	21

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

KR4AB26B0009	2026-11 S-Oil개별선물						3
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-3
-5.33%	-2	-2	-2	-2	-2	-2	-2
-2.67%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	1	1	1	1	1	1	1
5.33%	2	2	2	2	2	2	2
8.00%	3	3	3	3	3	3	3

KR4ADK6B0008	2026-11 코스맥스개별선물						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)

250

공시일	2026-10-21
기준일	2026-10-20

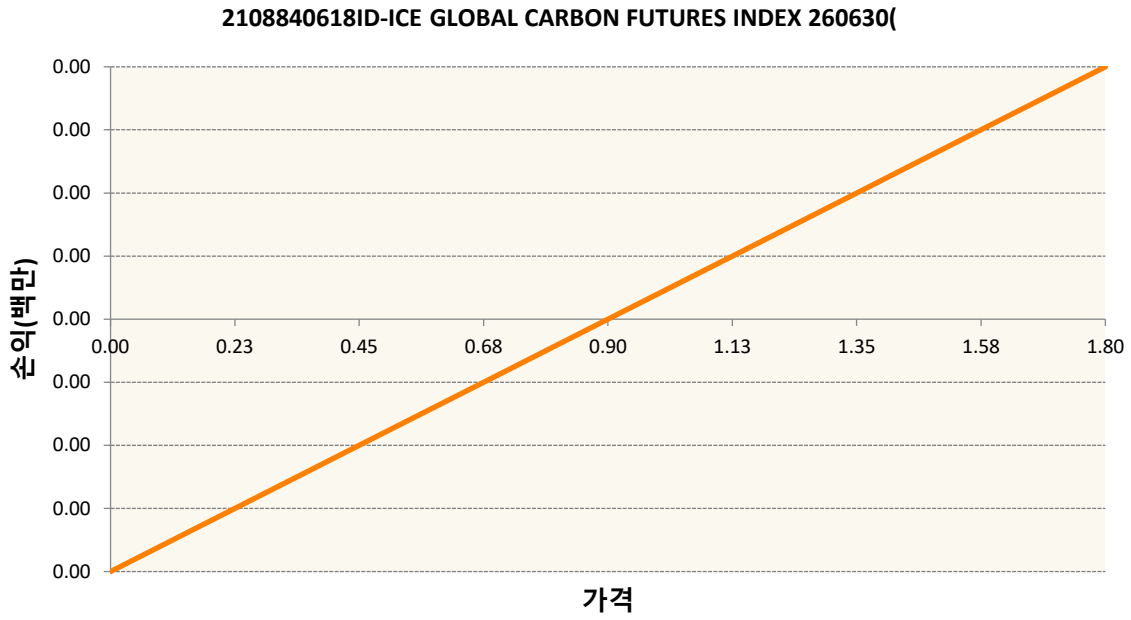
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

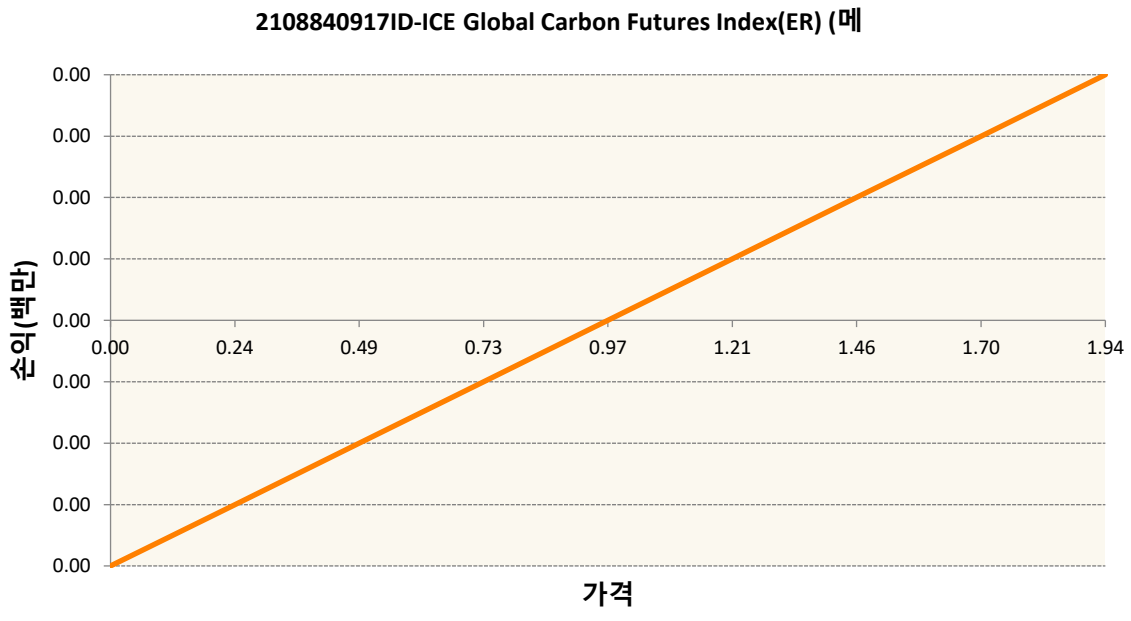
1. 계약금액

(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)

2108840618ICE GLOBAL CARBON FUTURES INDEX 260630(	436
2108840917ICE Global Carbon Futures Index(ER) (메	110

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

563

공시일	2026-10-21
기준일	2026-10-20

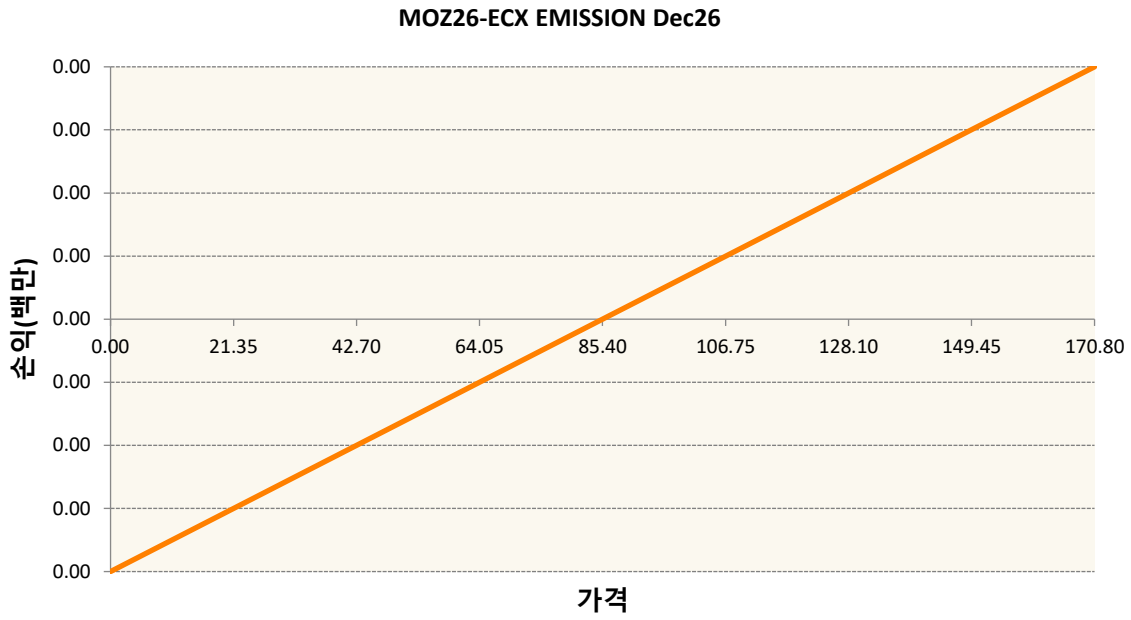
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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			6,036	0	6,036	
누계	통화	선도	0	2,476	-2,476	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)

714

공시일	2026-10-21
기준일	2026-10-20

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	-732	0	-732	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(	14
SWSOL0000(CSI PHOTOVOLTAIC INDUSTRY INDEX 260923(	24

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

(단위:백만원)

89

공시일	2026-10-21
기준일	2026-10-20

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	-5,753	0	-5,753	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 251218(NH)	45
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 260714(미래)	320
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 260917(메리츠)	95

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

(단위:백만원)

866

공시일	2026-10-21
기준일	2026-10-20

코리아인덱스(주식-파생형)(종)

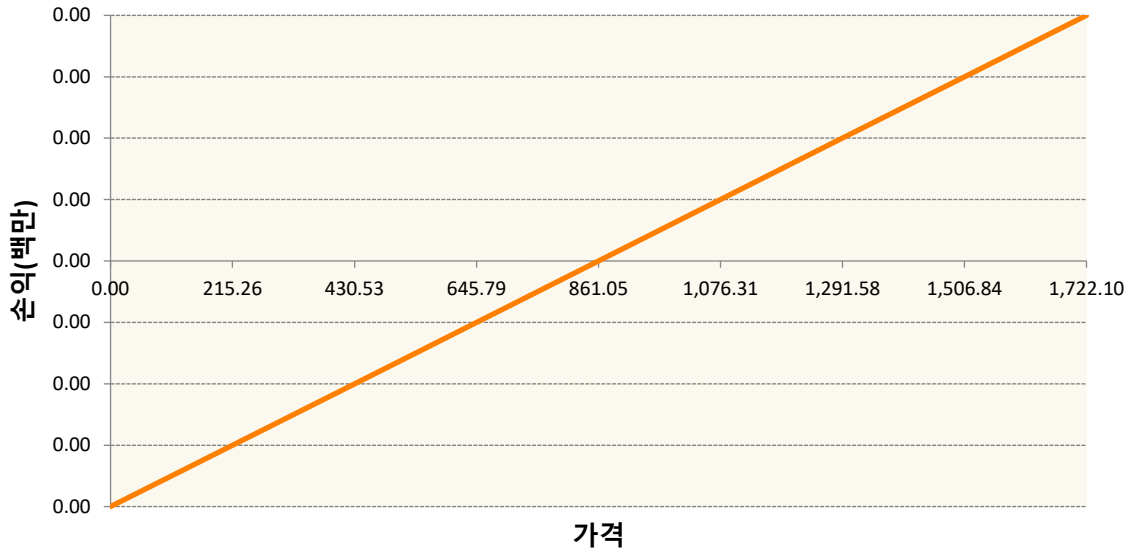
1. 계약금액

(단위:백만원)

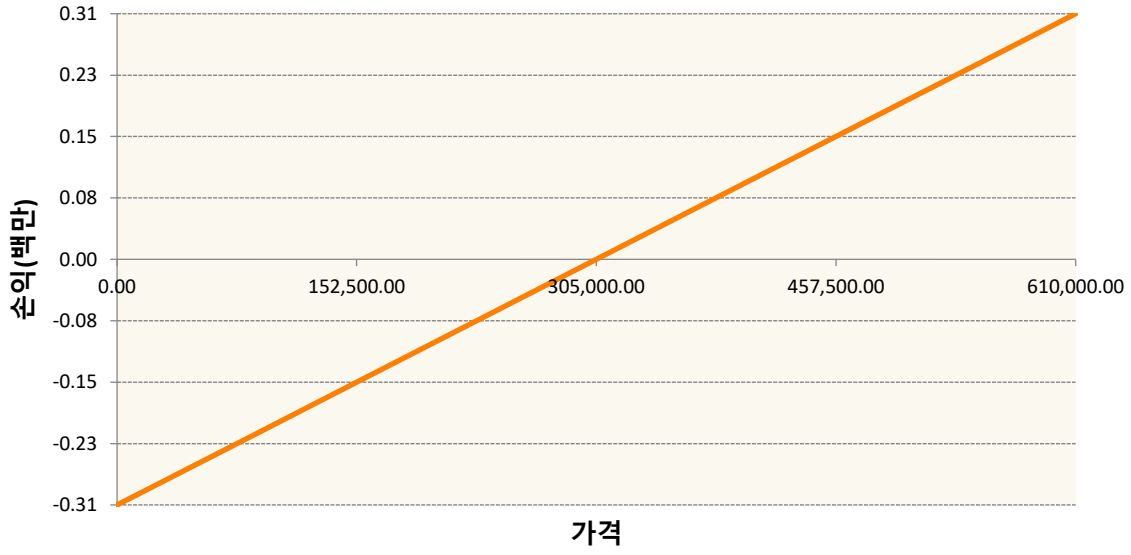
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	1,294	5,759	-4,465	장내
누계	유가증권	선물	12,317	269	12,048	장내

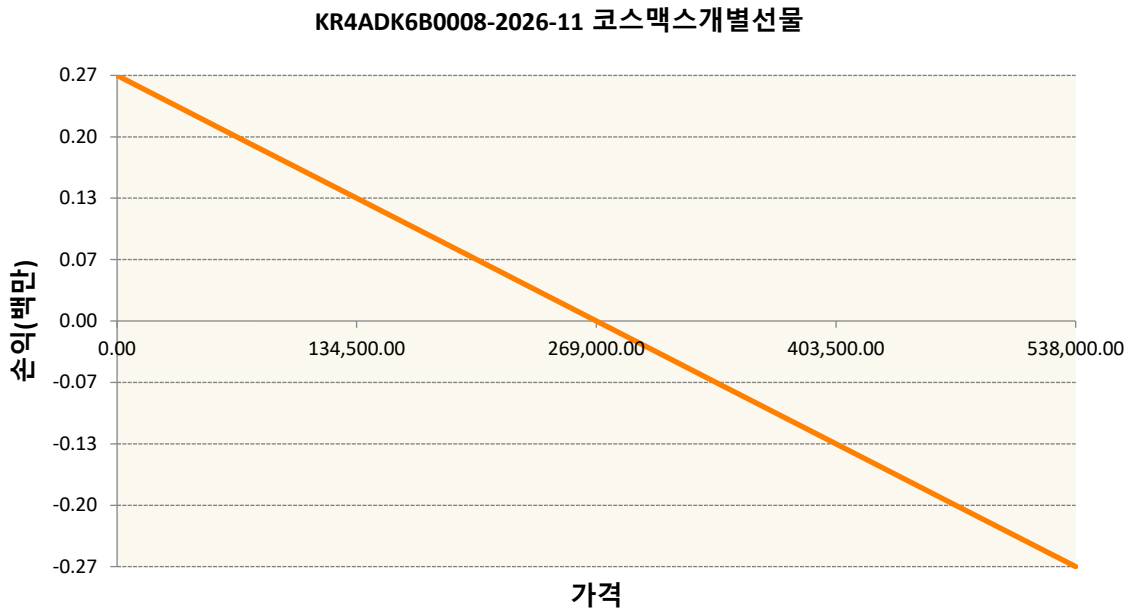
2. 만기시점의 손익구조

KR4A016C0004-2026-12 코스피200지수선물



KR4A1Q6B0009-2026-11 에이피알개별선물





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A016C0004	2026-12 코스피200지수선물						962
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-962	-962	-962	-962	-962	-962	-962
-5.33%	-641	-641	-641	-641	-641	-641	-641
-2.67%	-321	-321	-321	-321	-321	-321	-321
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	321	321	321	321	321	321	321
5.33%	641	641	641	641	641	641	641
8.00%	962	962	962	962	962	962	962

KR4A1Q6B0009	2026-11 에이피알개별선물						21
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-21	-21	-21	-21	-21	-21	-21
-5.33%	-14	-14	-14	-14	-14	-14	-14
-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%	14	14	14	14	14	14	14
8.00%	21	21	21	21	21	21	21

KR4ADK6B0008	2026-11 코스맥스개별선물						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%	14	14	14	14	14	14	14
-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%	-14	-14	-14	-14	-14	-14	-14
8.00%	-22	-22	-22	-22	-22	-22	-22

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

3,331

공시일	2026-10-21
기준일	2026-10-20

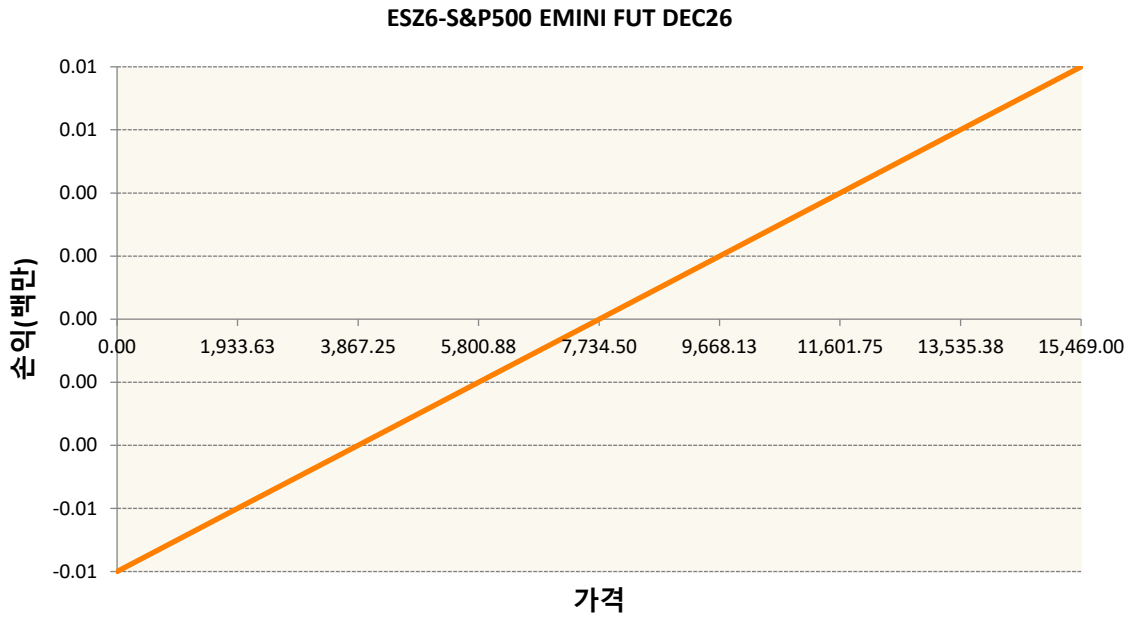
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

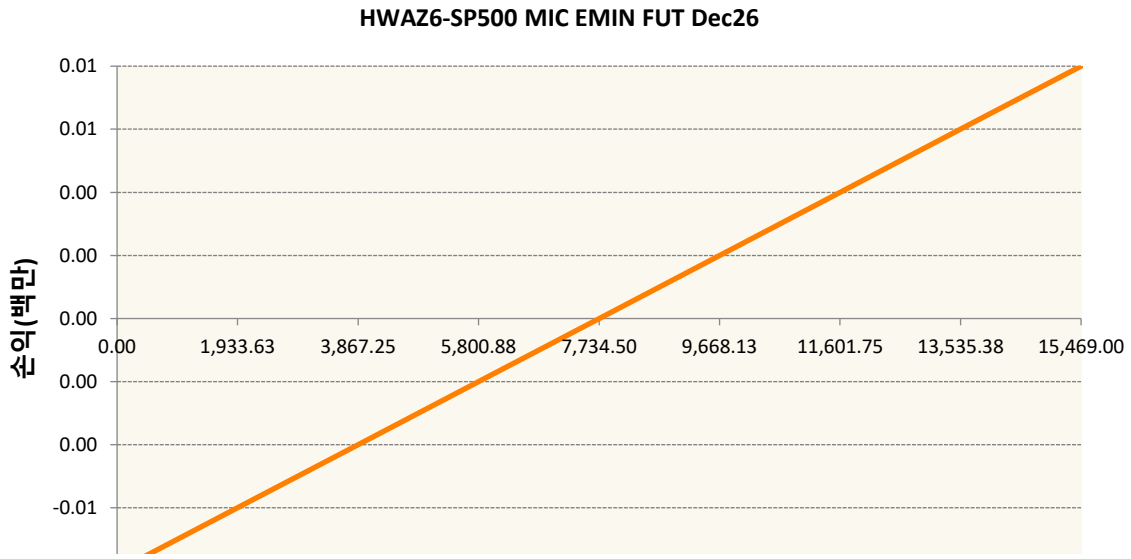
1. 계약금액

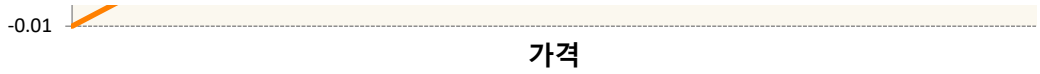
(단위:백만원)

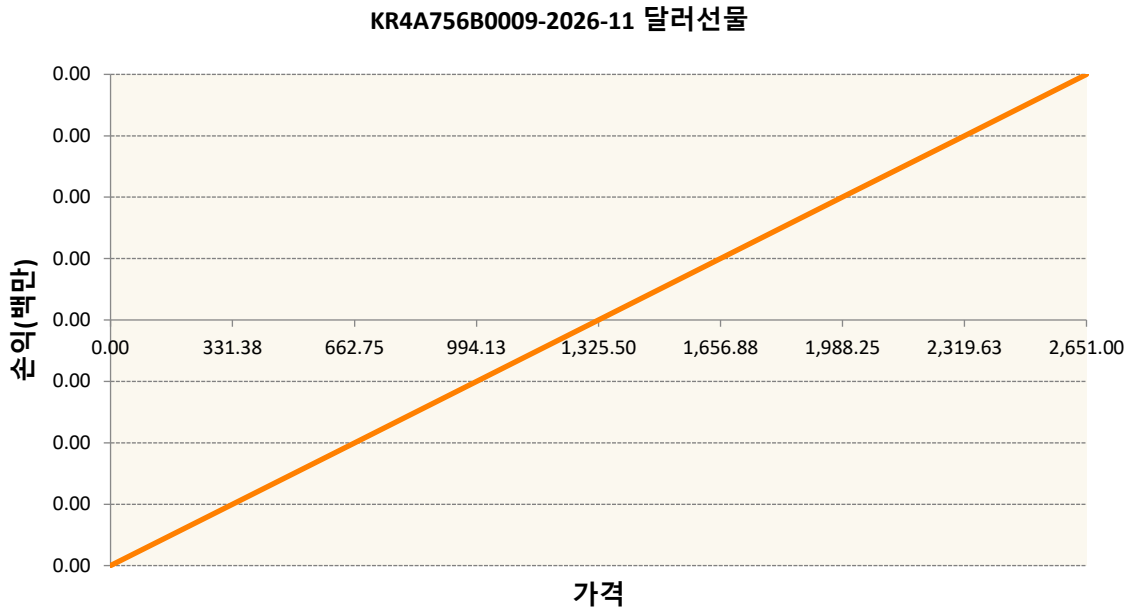
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
신규	지수	선물	0	0	0	장내
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	지수	선물	78,907	0	78,907	
누계	지수	선물	374	0	374	장내
누계	통화	선물	18,424	0	18,424	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESZ6	S&P500 EMINI FUT DEC26	6,313
HWAZ6	SP500 MIC EMIN FUT Dec26	30
KR4A756B00	2026-11 달러선물	1,474

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	3,802

공시일	2026-10-21
기준일	2026-10-20

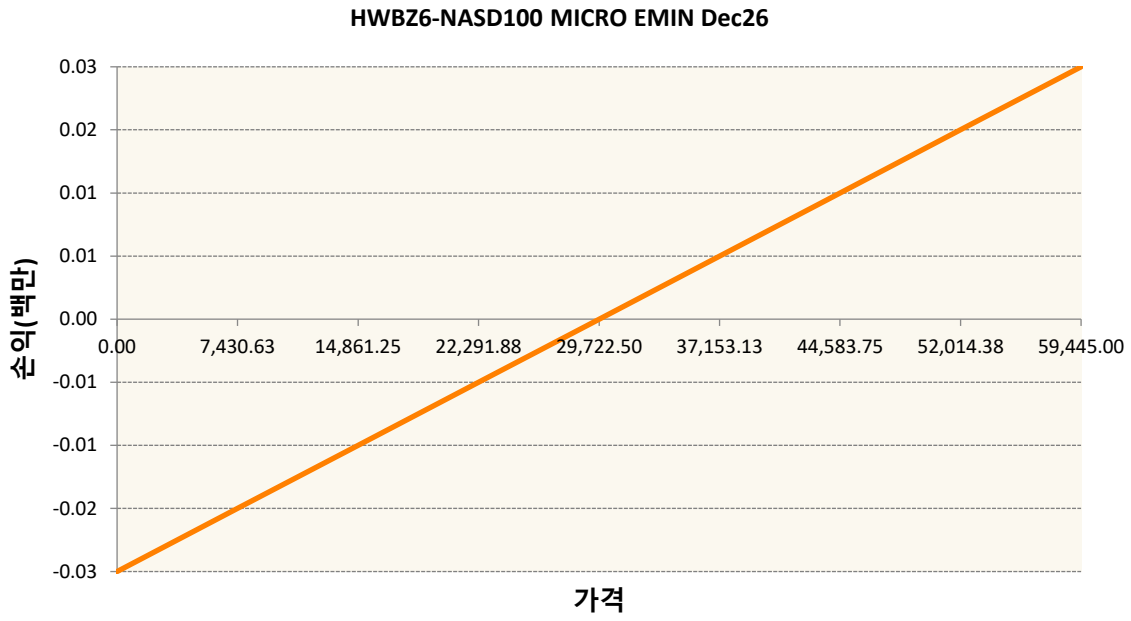
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

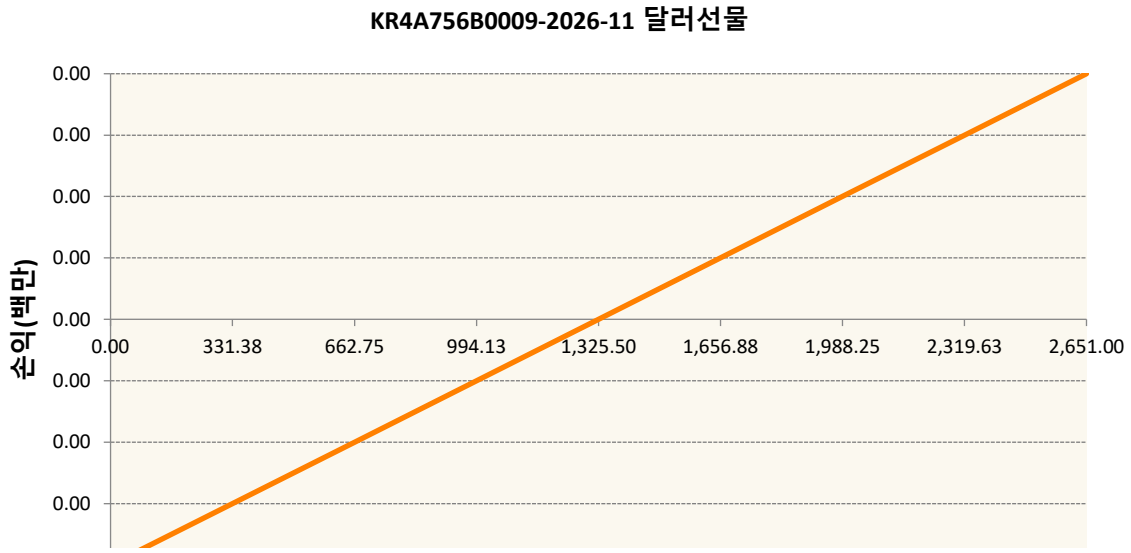
1. 계약금액

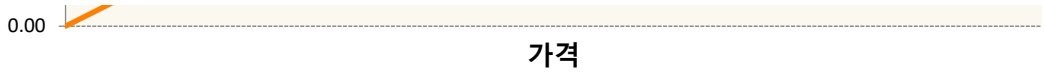
(단위:백만원)

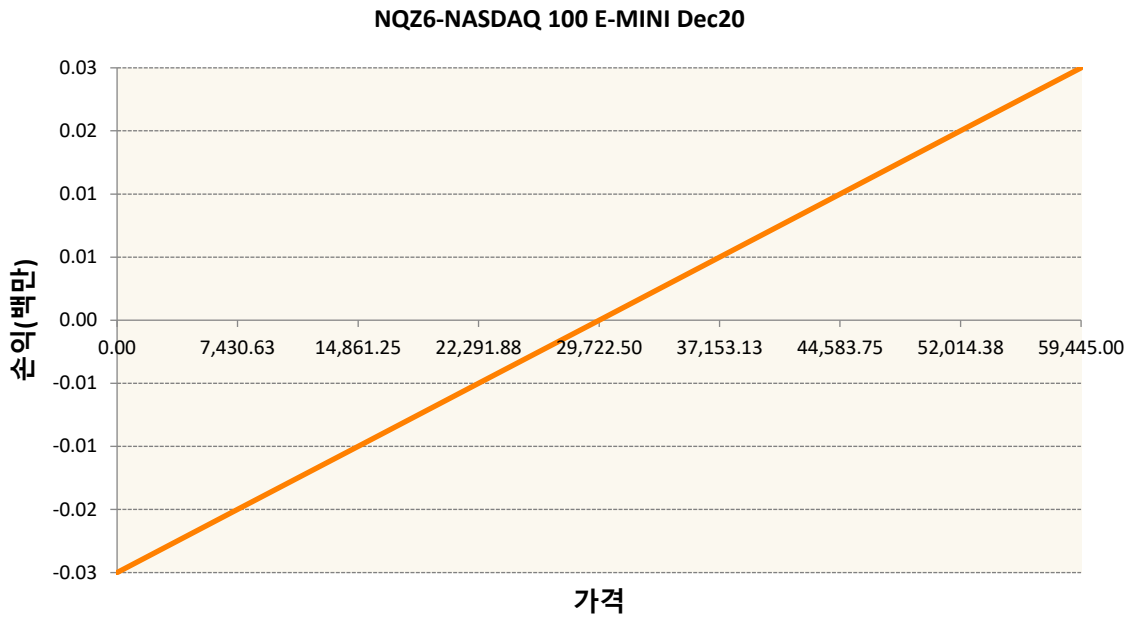
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
신규	지수	선물	0	0	0	장내
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	지수	선물	34,493	0	34,493	
누계	지수	선물	411	0	411	장내
누계	통화	선물	8,563	0	8,563	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HWBZ6	NASD100 MICRO EMIN Dec26	33
KR4A756B00	2026-11 달러선물	685
NQZ6	NASDAQ 100 E-MINI Dec20	2,759

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	2,476

공시일	2026-10-21
기준일	2026-10-20

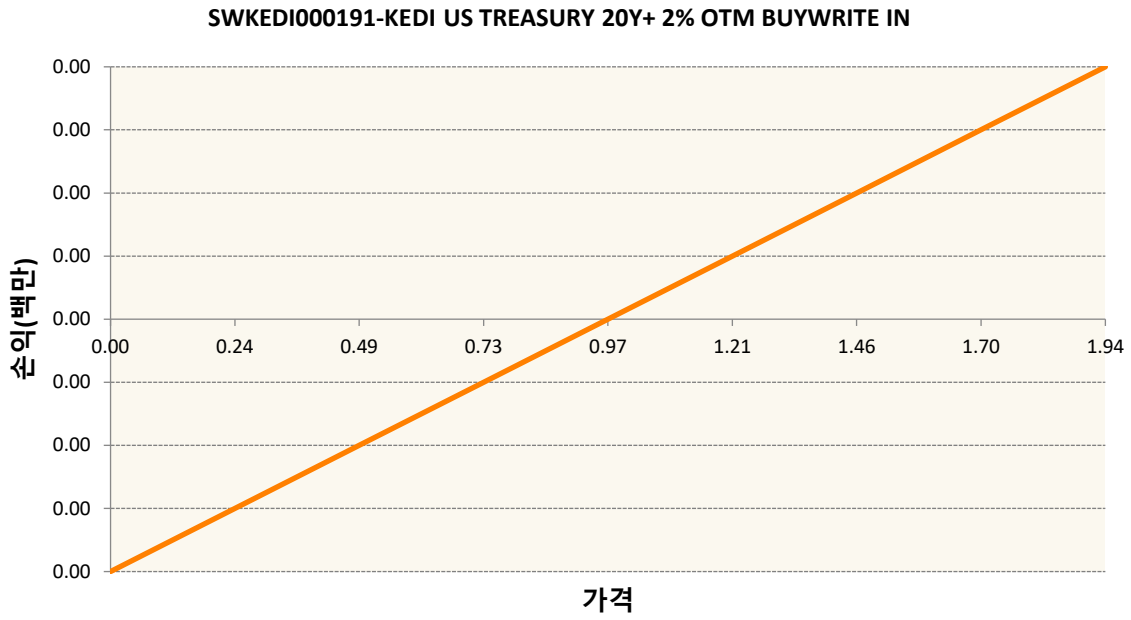
SOL미국30년국채커버드콜(합성)

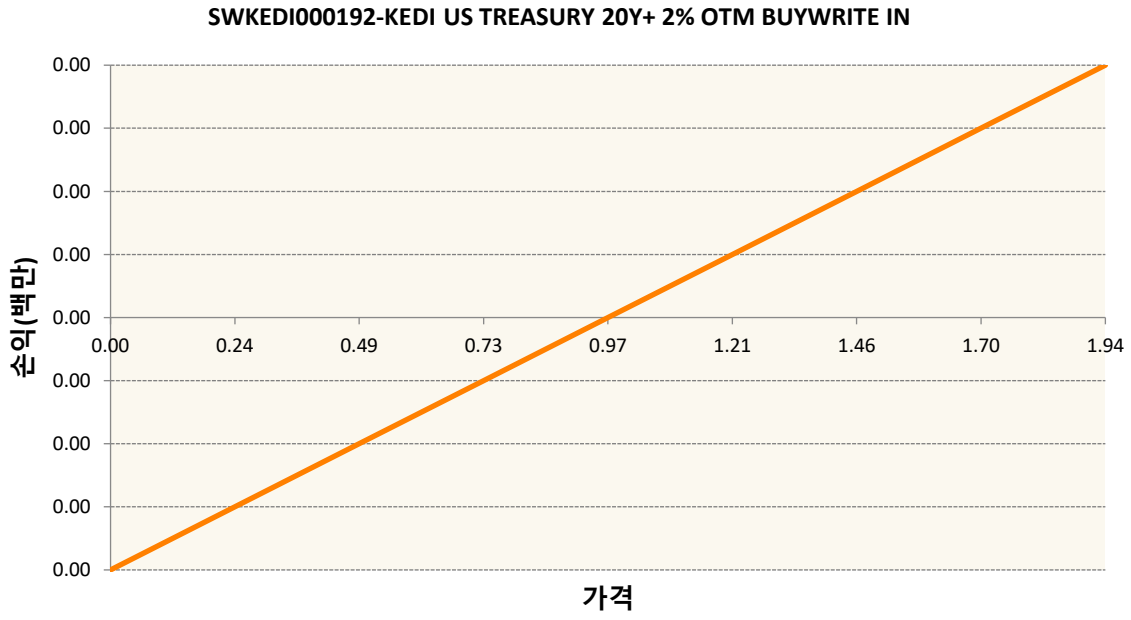
1. 계약금액

(단위:백만원)

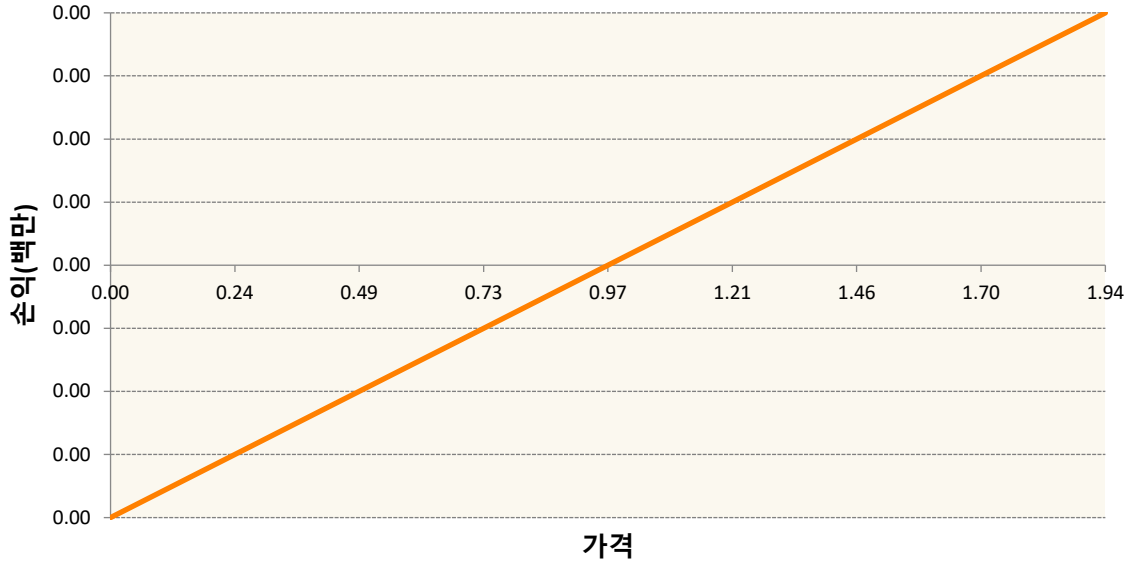
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	271,045	0	271,045	장외

2. 만기시점의 손익구조

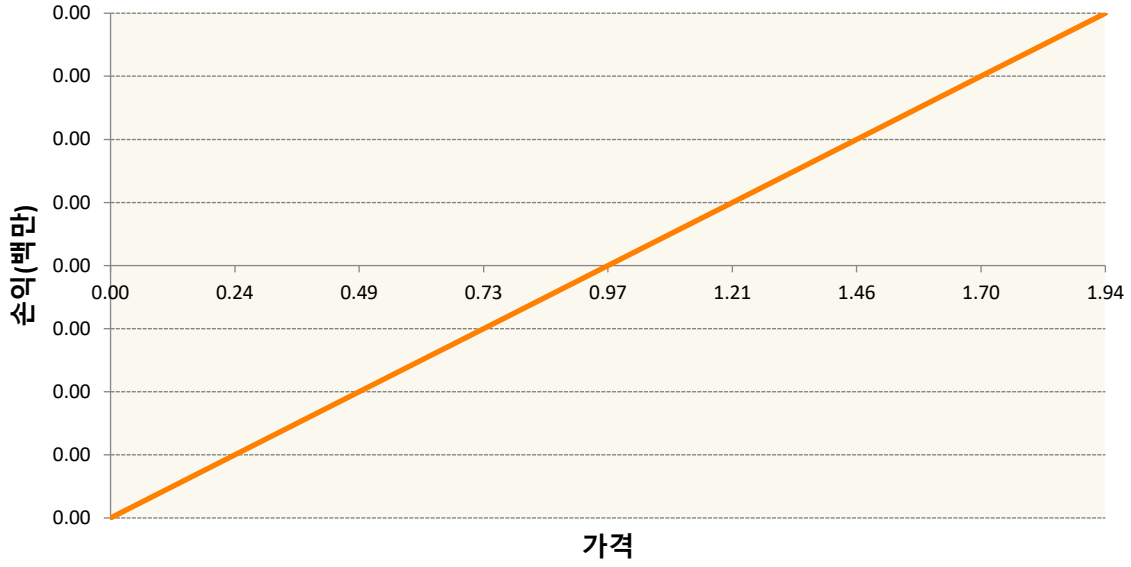




SWKEDI000193-KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN



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



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	2,633
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	4,683
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	6,808
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	7,448

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

8,545