공시일	2026-10-26
기준일	2026-10-23

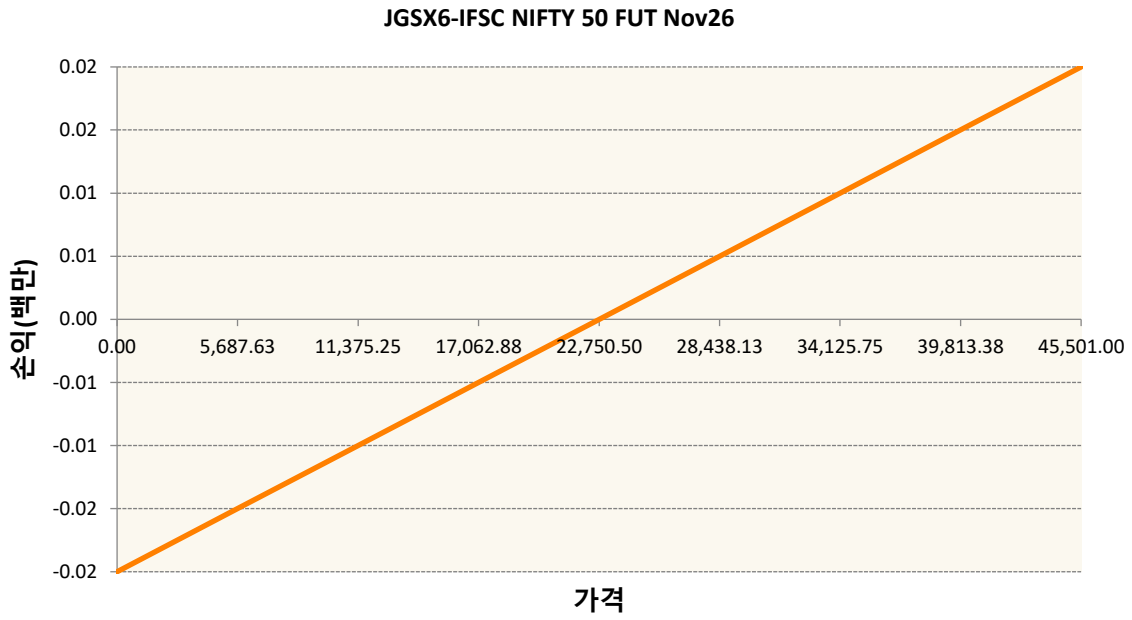
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	301	0	301	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

JGSX6	IFSC NIFTY 50 FUT Nov26	24

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

(단위:백만원)

16

공시일	2026-10-26
기준일	2026-10-23

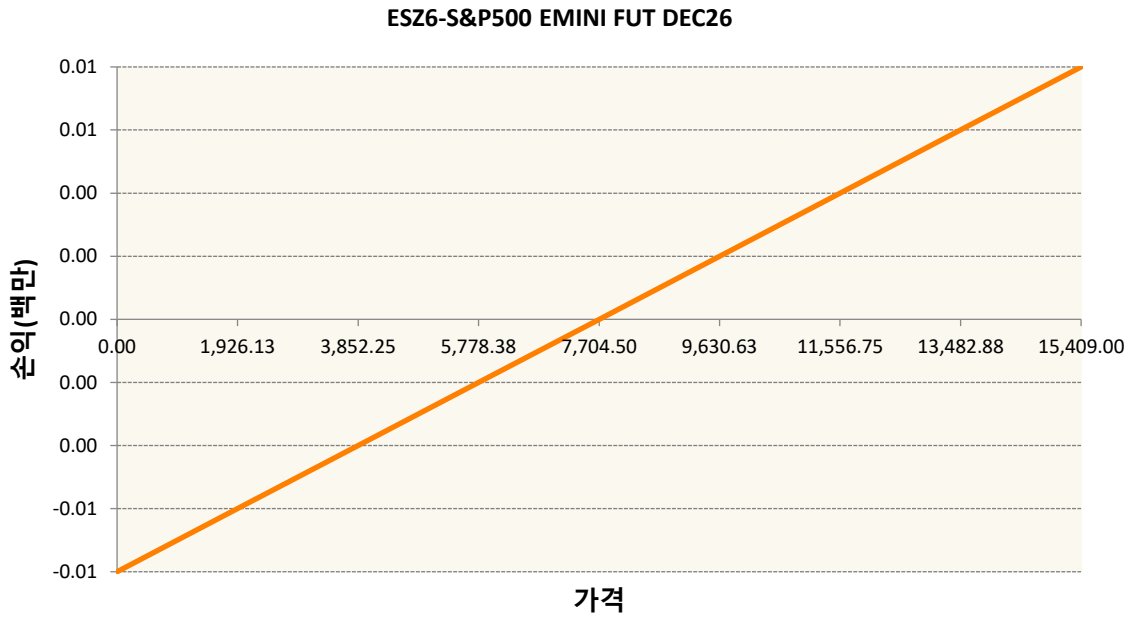
SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

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	2026-10-26
기준일	2026-10-23

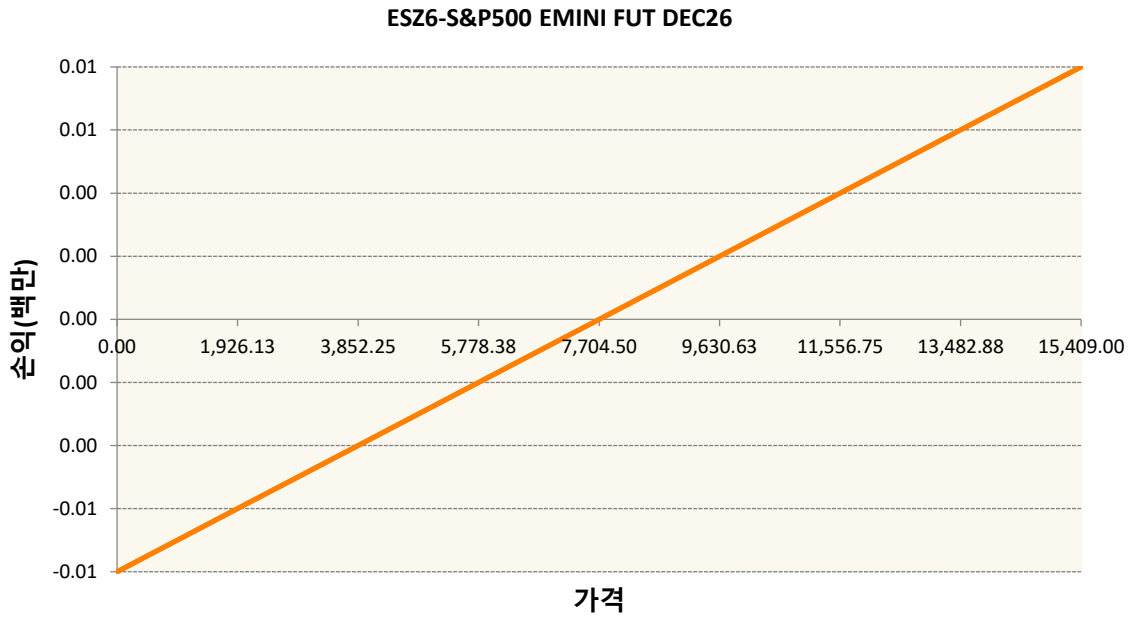
SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생

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	2026-10-26
기준일	2026-10-23

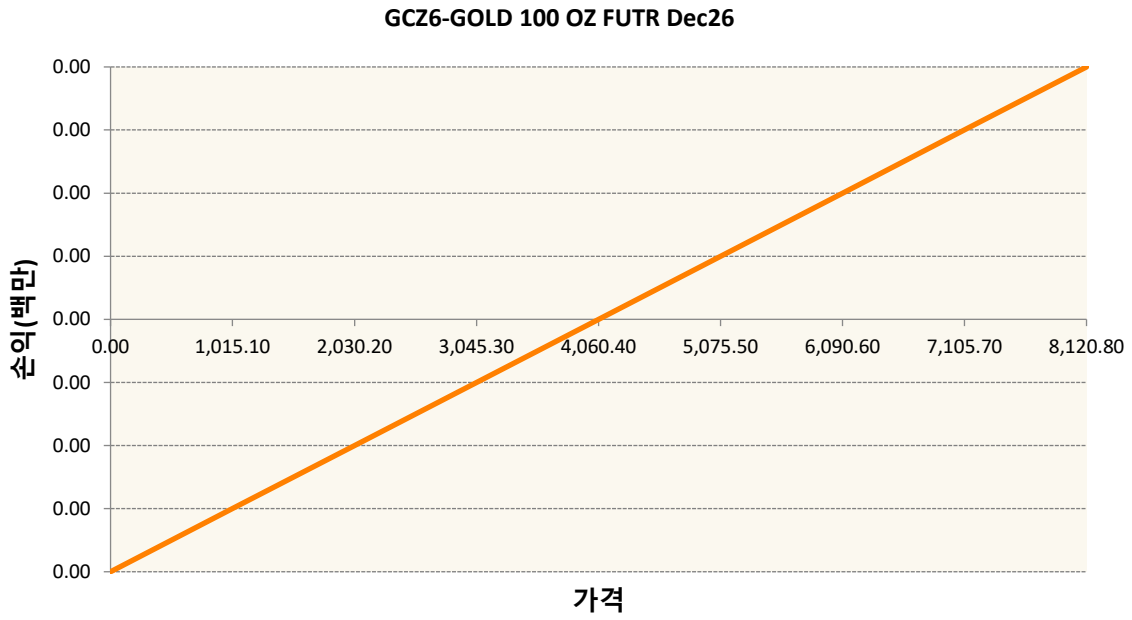
SOL골드커버드콜액티브특별자산상장지수(금

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			5,796	0	5,796	
누계	실물자산	옵션	0	0	0	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

AOGLDUSC0 GLD US 10/23/26 C387 EQUITY	4
GCZ6 GOLD 100 OZ FUTR Dec26	464

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

(단위:백만원)

595

공시일	2026-10-26
기준일	2026-10-23

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	18
AOPLTRUC2(PLTR US 10/23/26 C207.5 EQUITY	17
AOPLTRUP2(PLTR US 10/23/26 P207.5 EQUITY	41

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

(단위:백만원)

273

공시일	2026-10-26
기준일	2026-10-23

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	16

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

(단위:백만원)

9

공시일	2026-10-26
기준일	2026-10-23

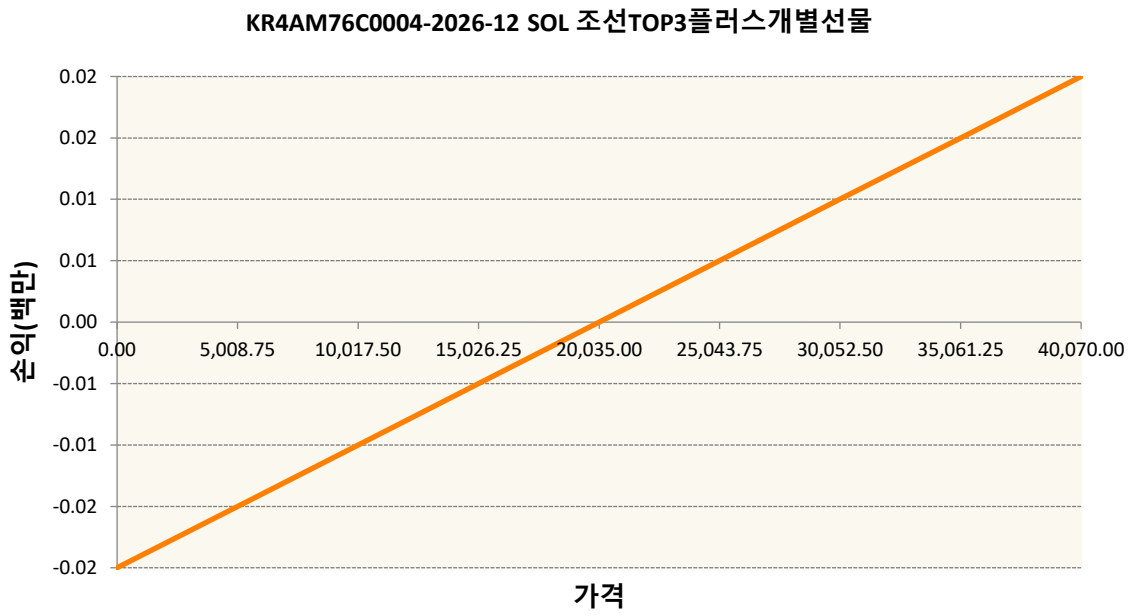
SOL조선TOP3플러스레버리지상장지수(주식)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	100	-100	장내
누계	유가증권	선물	6,036	0	6,036	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4AM76C0004	2026-12 SOL 조선TOP3플러스개별선물	4,786

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-4,786	-4,786	-4,786	-4,786	-4,786	-4,786	-4,786
-5.33%	-3,191	-3,191	-3,191	-3,191	-3,191	-3,191	-3,191
-2.67%	-1,595	-1,595	-1,595	-1,595	-1,595	-1,595	-1,595
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	1,595	1,595	1,595	1,595	1,595	1,595	1,595
5.33%	3,191	3,191	3,191	3,191	3,191	3,191	3,191
8.00%	4,786	4,786	4,786	4,786	4,786	4,786	4,786

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

8,335

공시일	2026-10-26
기준일	2026-10-23

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	2026-10-26
기준일	2026-10-23

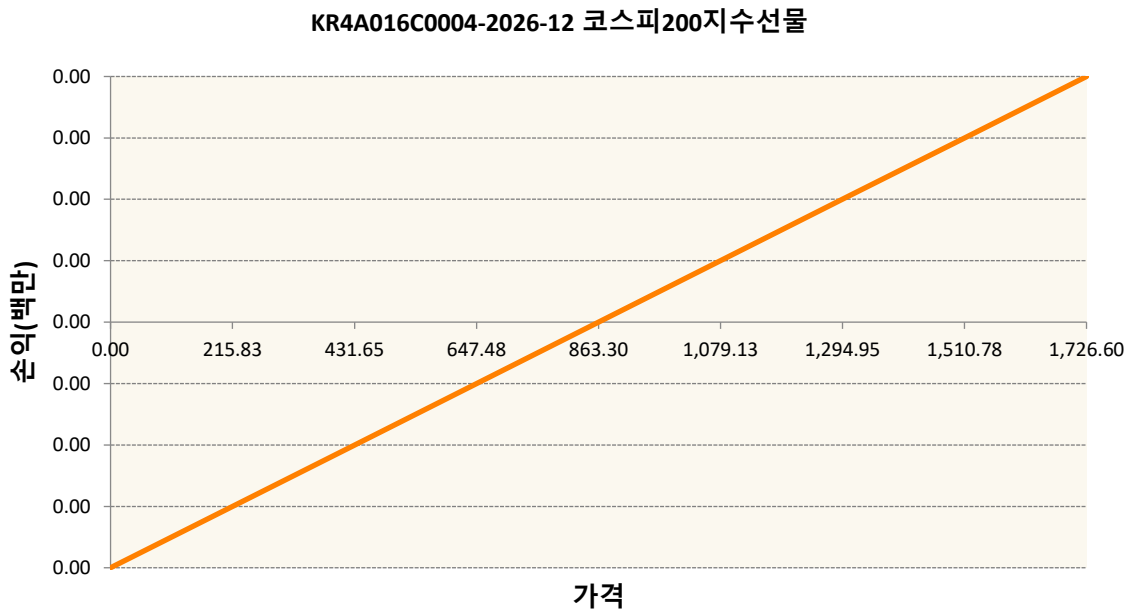
SOL 200타겟위클리커버드콜상장지수(주식)

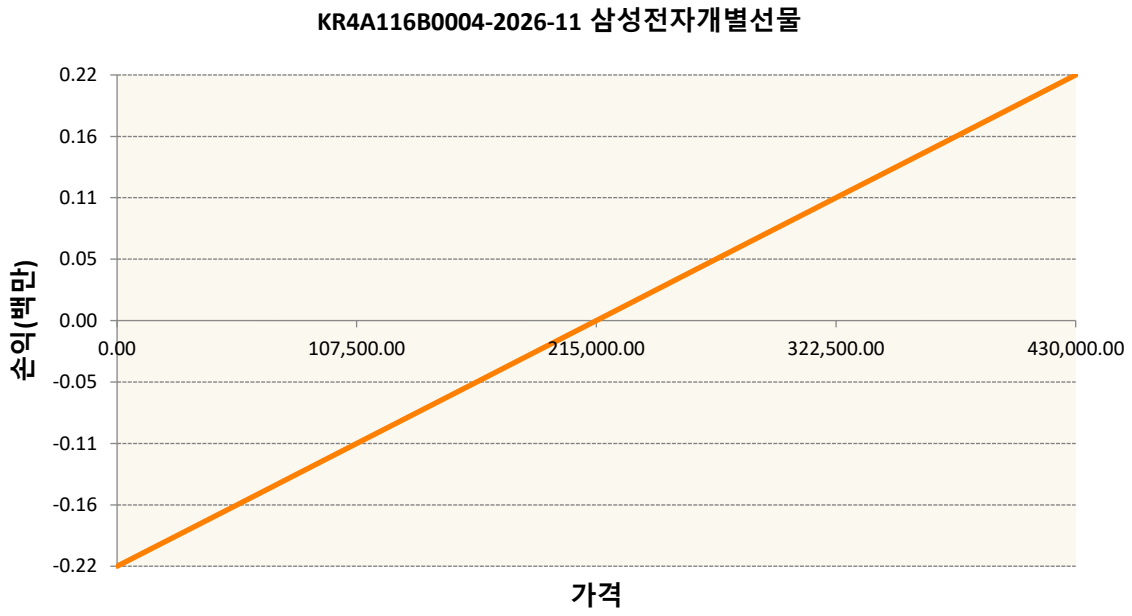
1. 계약금액

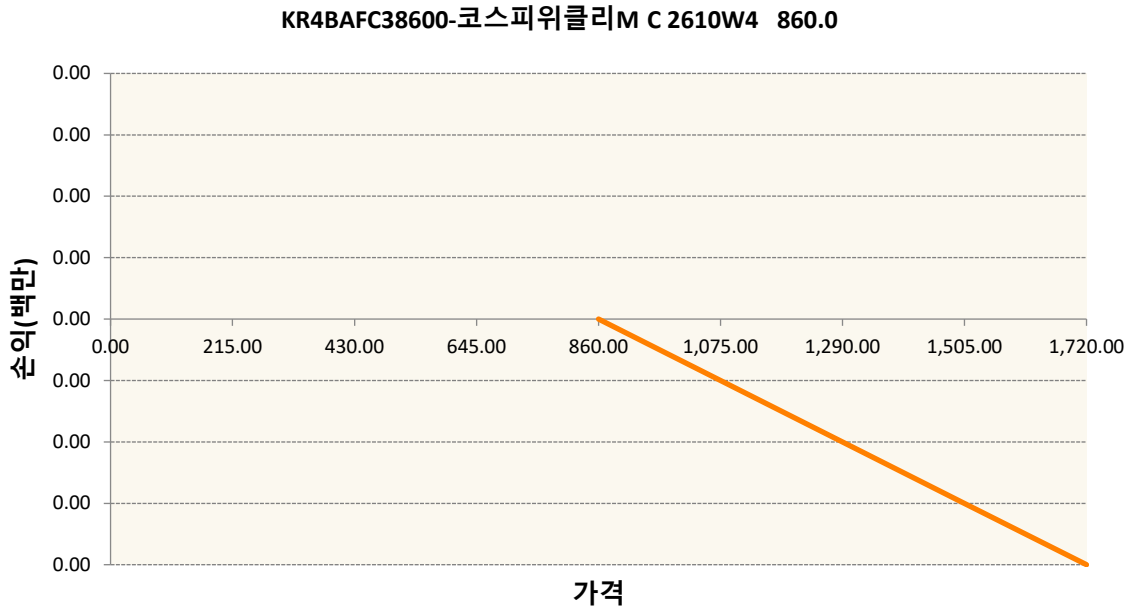
(단위:백만원)

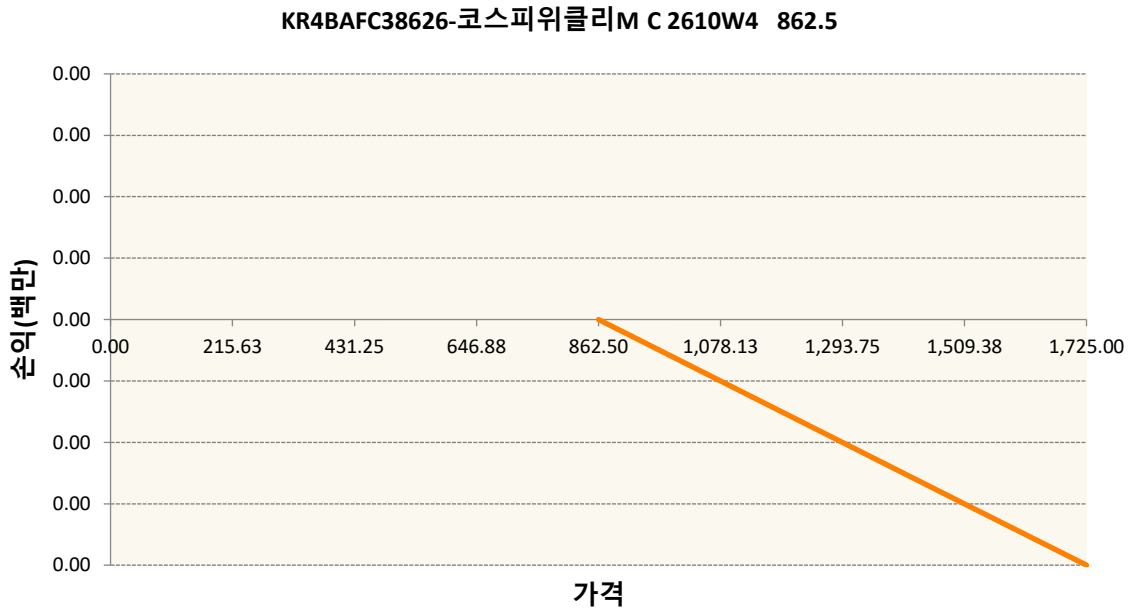
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	17,221	0	17,221	장내
누계	유가증권	옵션	0	43,050	-43,050	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4A016C0004	2026-12 코스피200지수선물						449
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-449	-449	-449	-449	-449	-449	-449
-5.33%	-299	-299	-299	-299	-299	-299	-299
-2.67%	-150	-150	-150	-150	-150	-150	-150
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	150	150	150	150	150	150	150
5.33%	299	299	299	299	299	299	299
8.00%	449	449	449	449	449	449	449
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
	KR4BAFC38600		코스피위클리M C 2610W4 860.0				1,677
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	555	550	542	532	519	504	487
-5.33%	524	506	485	461	436	408	379
-2.67%	407	372	335	298	259	221	181
0%	128	86	43	0	-43	-86	-129
2.67%	-337	-370	-405	-440	-477	-515	-554
5.33%	-939	-955	-975	-998	-1,023	-1,050	-1,079
8.00%	-1,604	-1,610	-1,618	-1,629	-1,642	-1,658	-1,677
	KR4BAFC38626		코스피위클리M C 2610W4 862.5				1,099
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	346	343	338	332	324	315	304
-5.33%	328	317	304	289	273	256	237
-2.67%	258	236	212	188	163	138	112
0%	86	57	29	0	-29	-57	-86
2.67%	-212	-235	-259	-284	-309	-335	-361
5.33%	-605	-617	-632	-648	-665	-684	-705
8.00%	-1,045	-1,050	-1,056	-1,064	-1,074	-1,086	-1,099

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

10,128

공시일	2026-10-26
기준일	2026-10-23

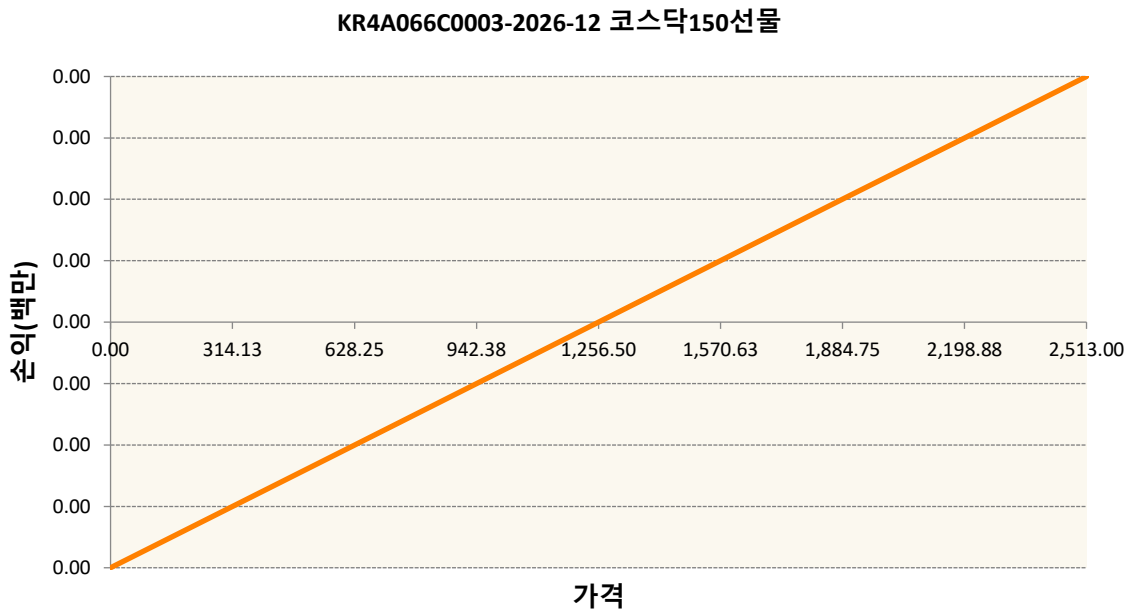
SOL코스닥150인덱스(주식-파생형)

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	503	0	503	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A066C0003 2026-12 코스닥150선물 40

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-40	-40	-40	-40	-40	-40	-40
-5.33%	-27	-27	-27	-27	-27	-27	-27
-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%	27	27	27	27	27	27	27
8.00%	40	40	40	40	40	40	40

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

132

공시일	2026-10-26
기준일	2026-10-23

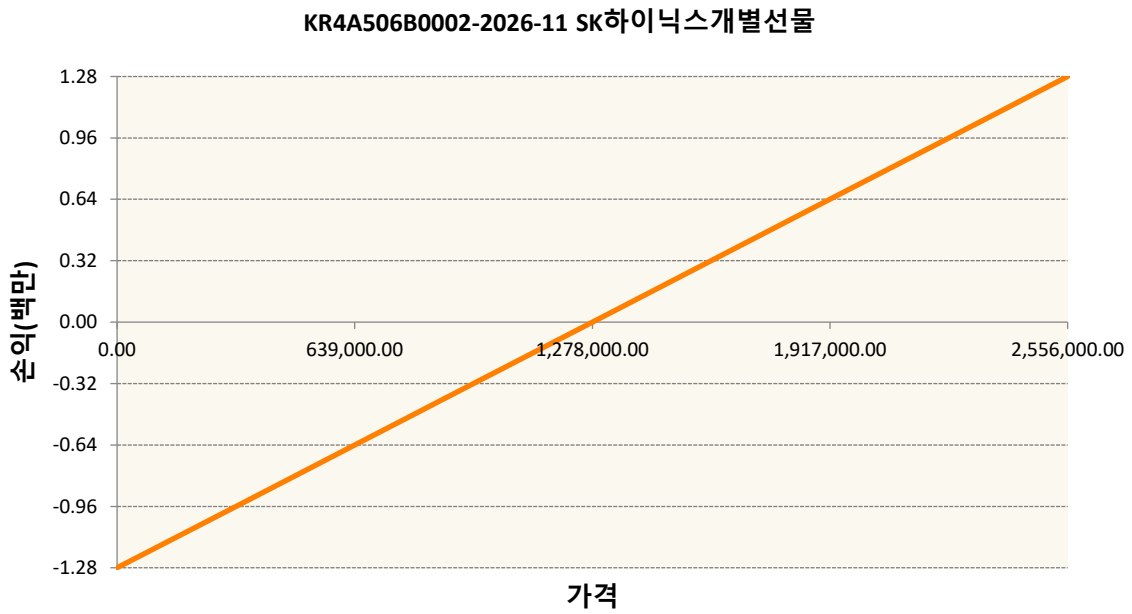
SOLSK하이닉스단일종목레버리지상장지수

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	895	736	159	장내
누계	유가증권	선물	22,978	0	22,978	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A506B0002	2026-11 SK하이닉스개별선물	1,837

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,837	-1,837	-1,837	-1,837	-1,837	-1,837	-1,837
-5.33%	-1,225	-1,225	-1,225	-1,225	-1,225	-1,225	-1,225
-2.67%	-612	-612	-612	-612	-612	-612	-612
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	612	612	612	612	612	612	612
5.33%	1,225	1,225	1,225	1,225	1,225	1,225	1,225
8.00%	1,837	1,837	1,837	1,837	1,837	1,837	1,837

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

8,927

공시일	2026-10-26
기준일	2026-10-23

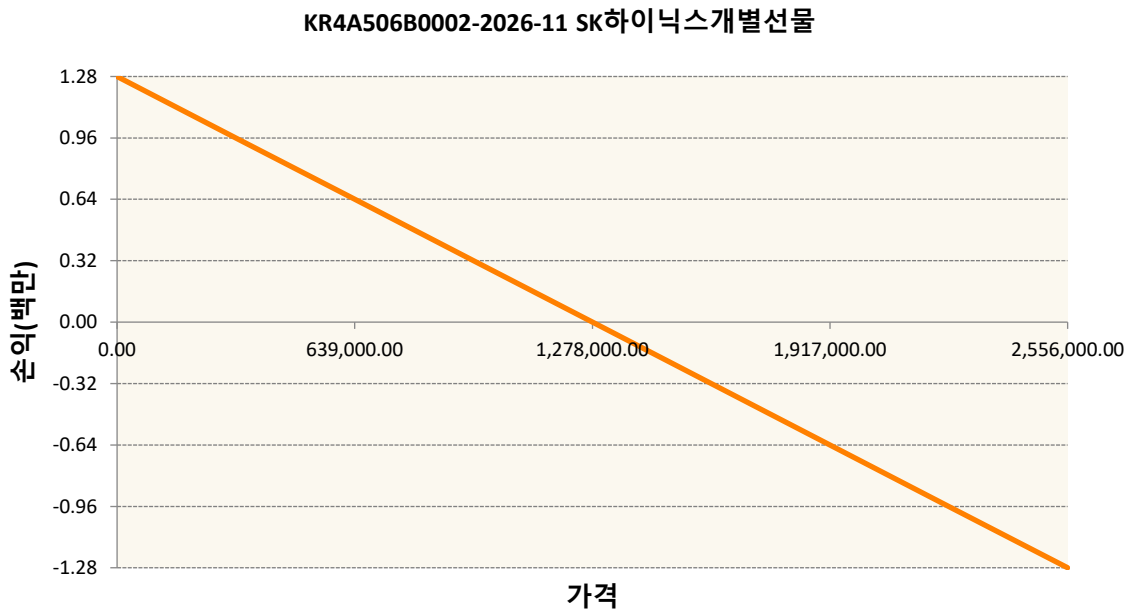
SOLSK하이닉스선물단일종목인버스2X상장지

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	34,824	17,789	17,034	장내
누계	유가증권	선물	0	221,720	-221,720	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A506B0002	2026-11 SK하이닉스개별선물	17,724

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	17,724	17,724	17,724	17,724	17,724	17,724	17,724
-5.33%	11,816	11,816	11,816	11,816	11,816	11,816	11,816
-2.67%	5,908	5,908	5,908	5,908	5,908	5,908	5,908
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-5,908	-5,908	-5,908	-5,908	-5,908	-5,908	-5,908
5.33%	-11,816	-11,816	-11,816	-11,816	-11,816	-11,816	-11,816
8.00%	-17,724	-17,724	-17,724	-17,724	-17,724	-17,724	-17,724

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

86,141

공시일	2026-10-26
기준일	2026-10-23

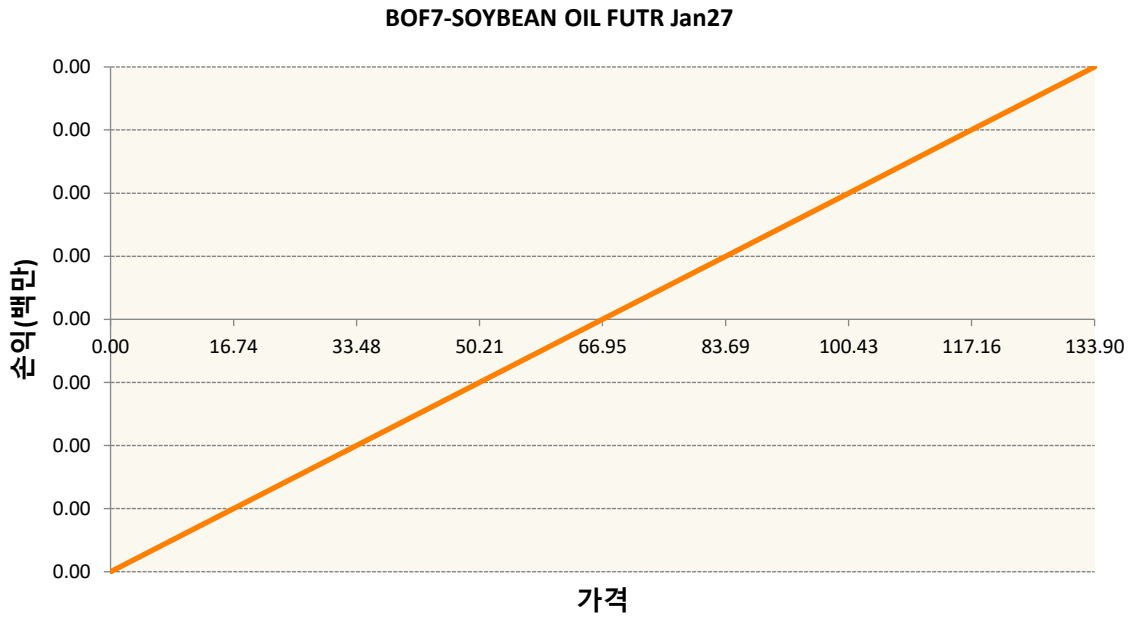
포커스농산물모(채권-파생형)

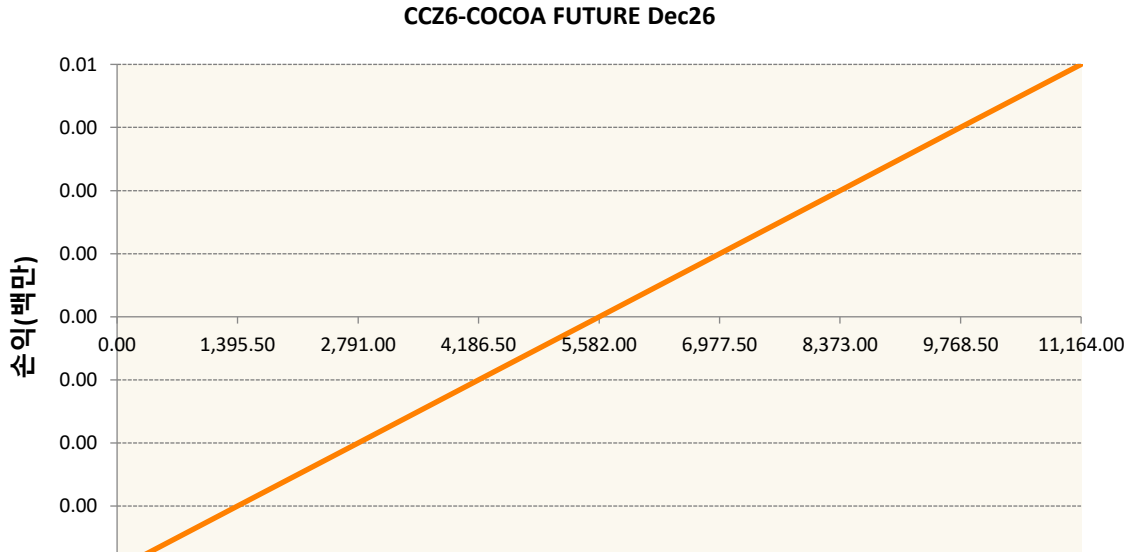
1. 계약금액

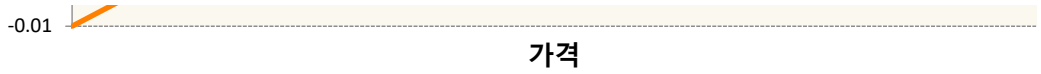
(단위:USD 백만)

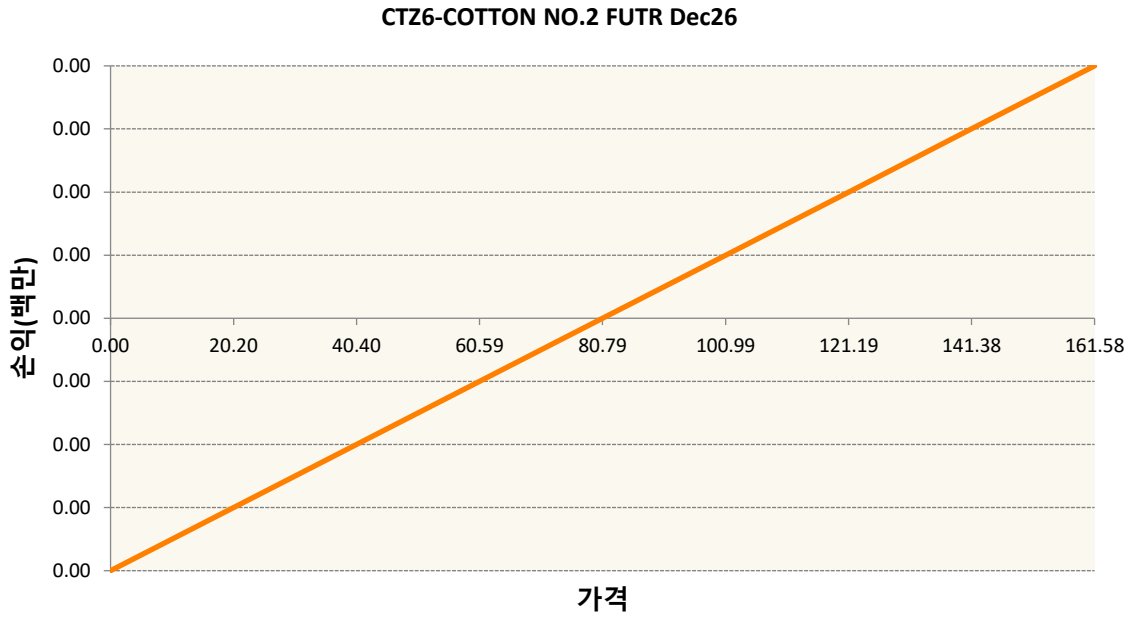
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	실물자산	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	실물자산	선물	349	0	349	
누계	유가증권	선물	2,218	0	2,218	
누계	통화	선물	0	344	-344	장내

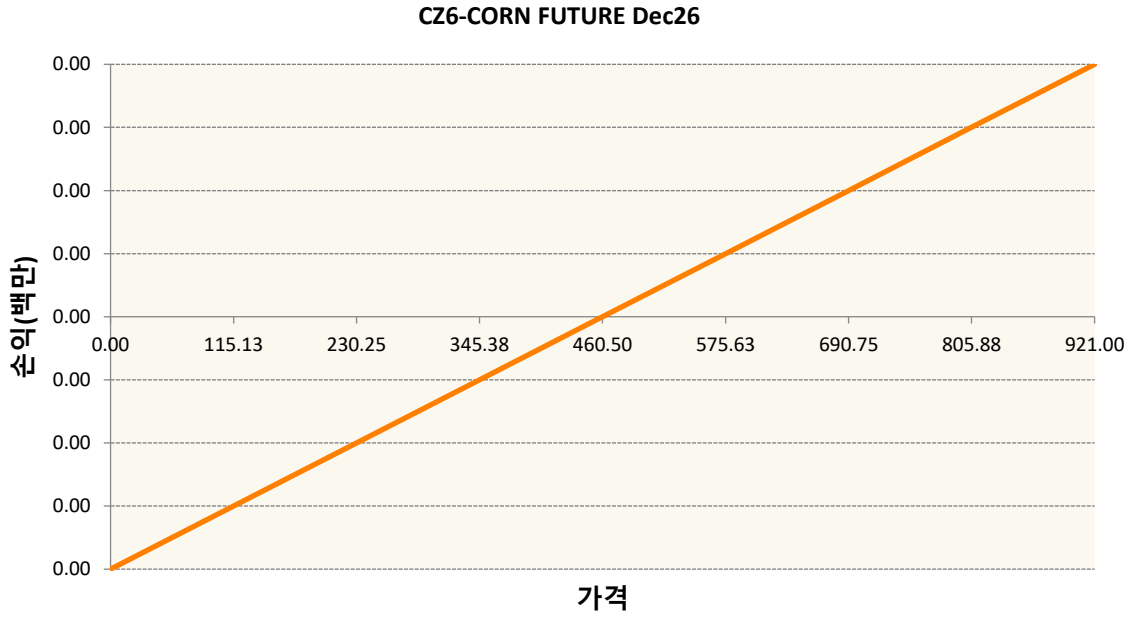
2. 만기시점의 손익구조

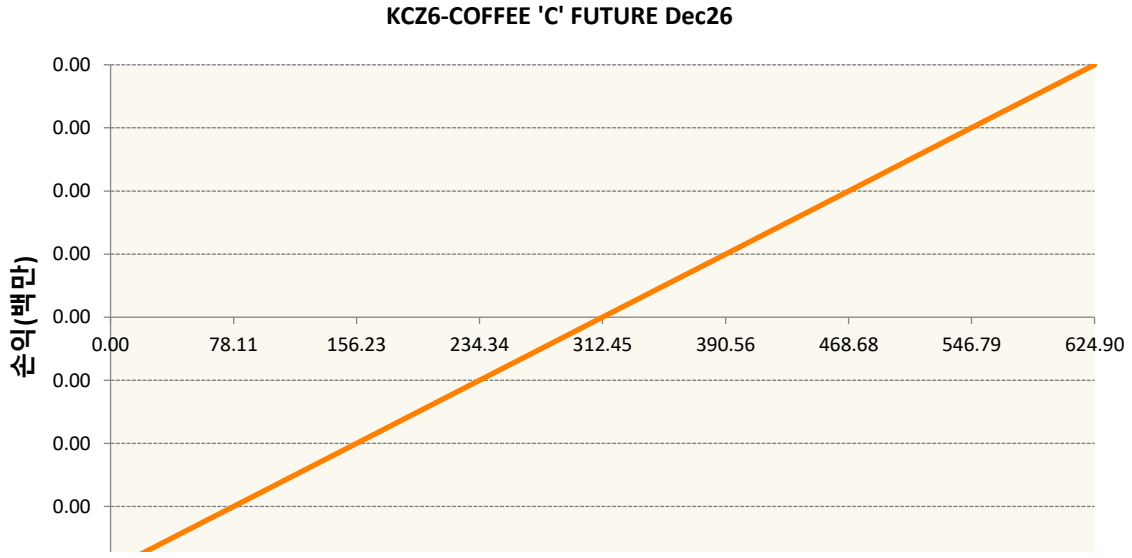


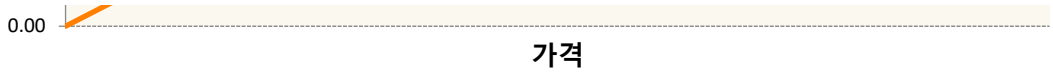


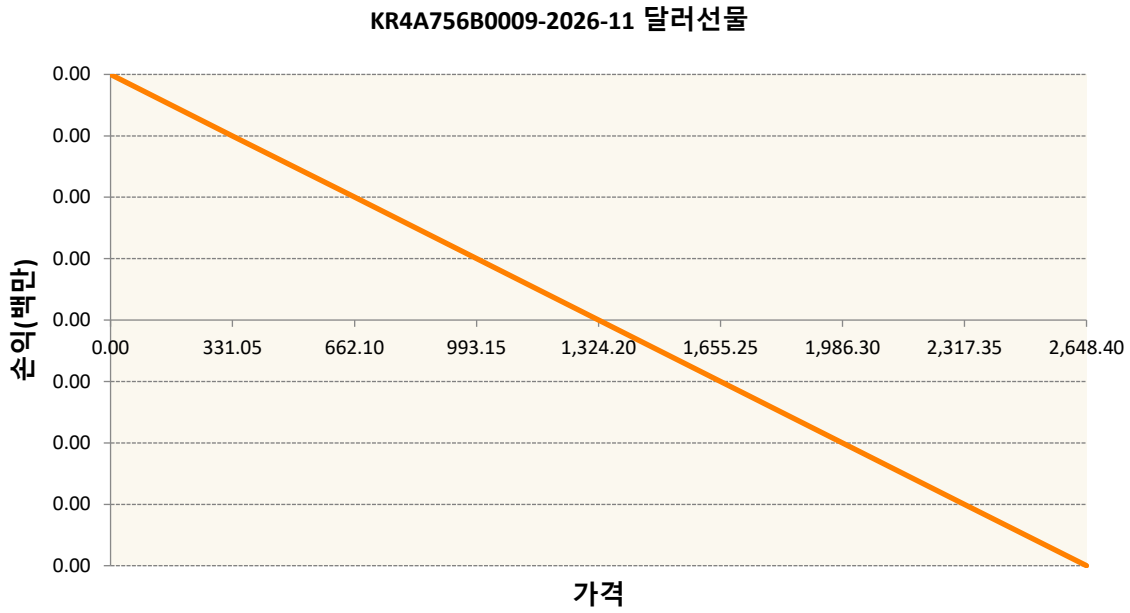

-0.01
가격

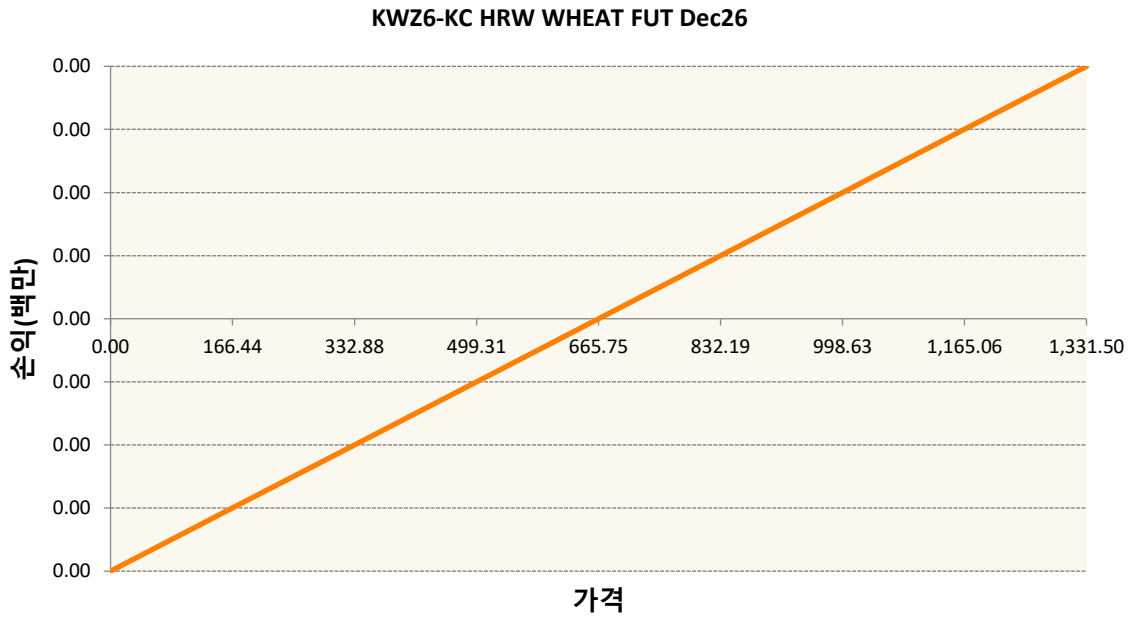

CTZ6-COTTON NO.2 FUTR Dec26
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
20.20
40.40
60.59
80.79
100.99
121.19
141.38
161.58
손익(백만)
가격

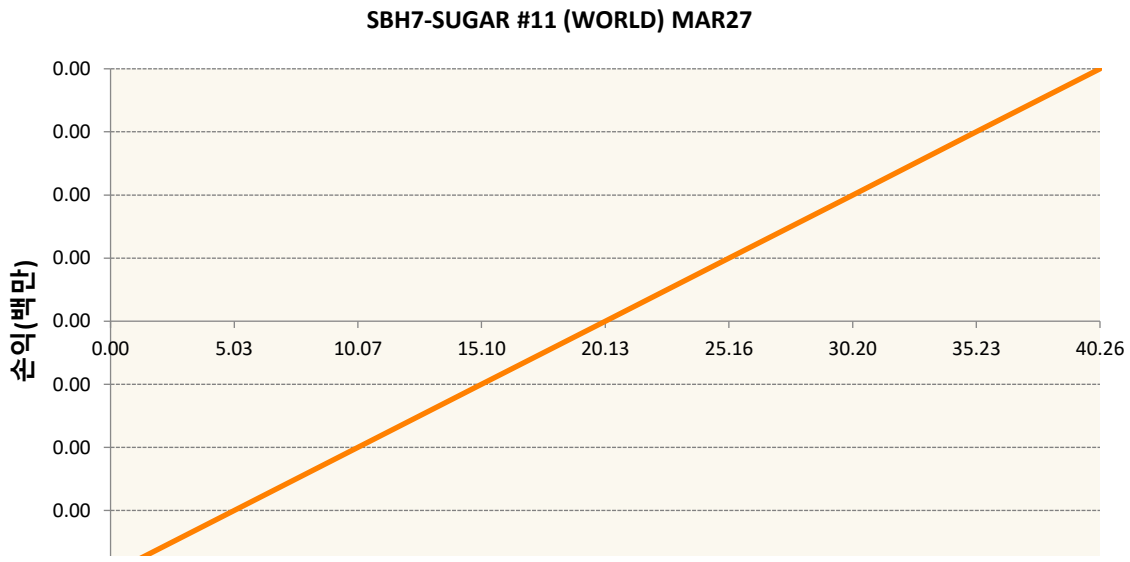

CZ6-CORN FUTURE Dec26
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
115.13
230.25
345.38
460.50
575.63
690.75
805.88
921.00
손익(백만)
가격

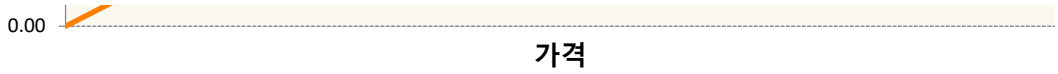

KCZ6-COFFEE 'C' FUTURE Dec26
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
78.11
156.23
234.34
312.45
390.56
468.68
546.79
624.90
손익(백만)

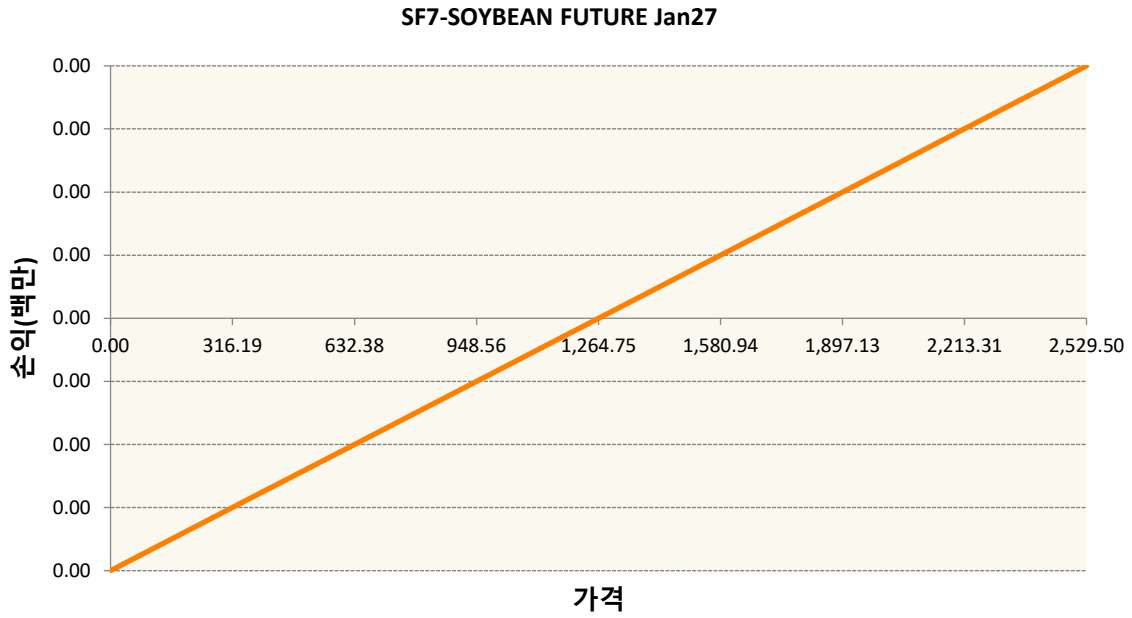

0.00
가격

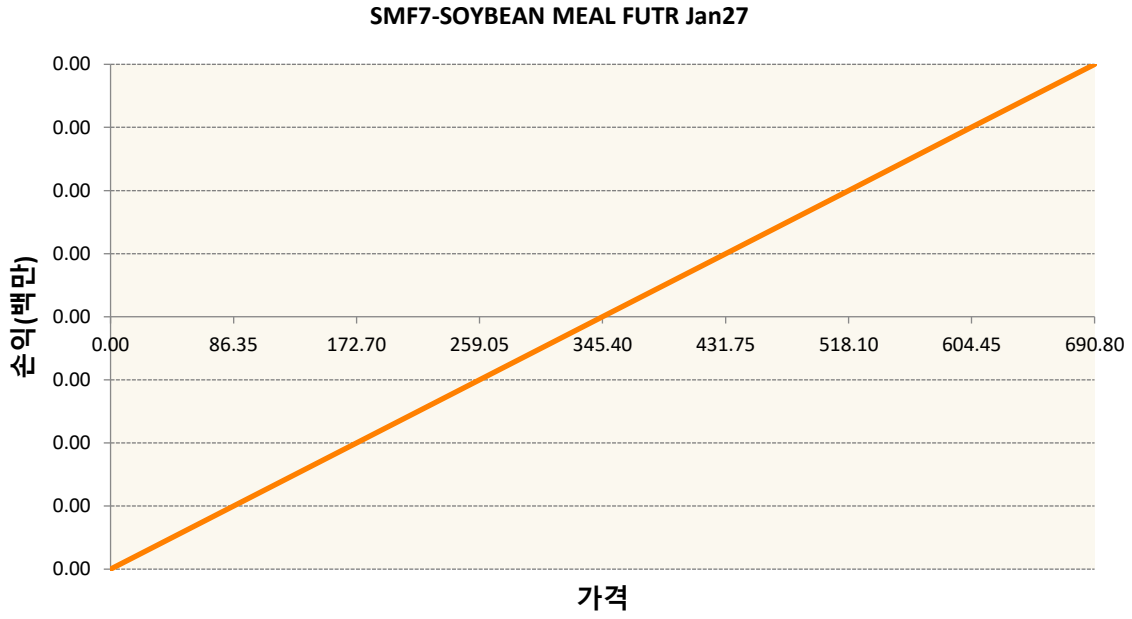

KR4A756B0009-2026-11 달러선물
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
331.05
662.10
993.15
1,324.20
1,655.25
1,986.30
2,317.35
2,648.40
손익(백만)
가격

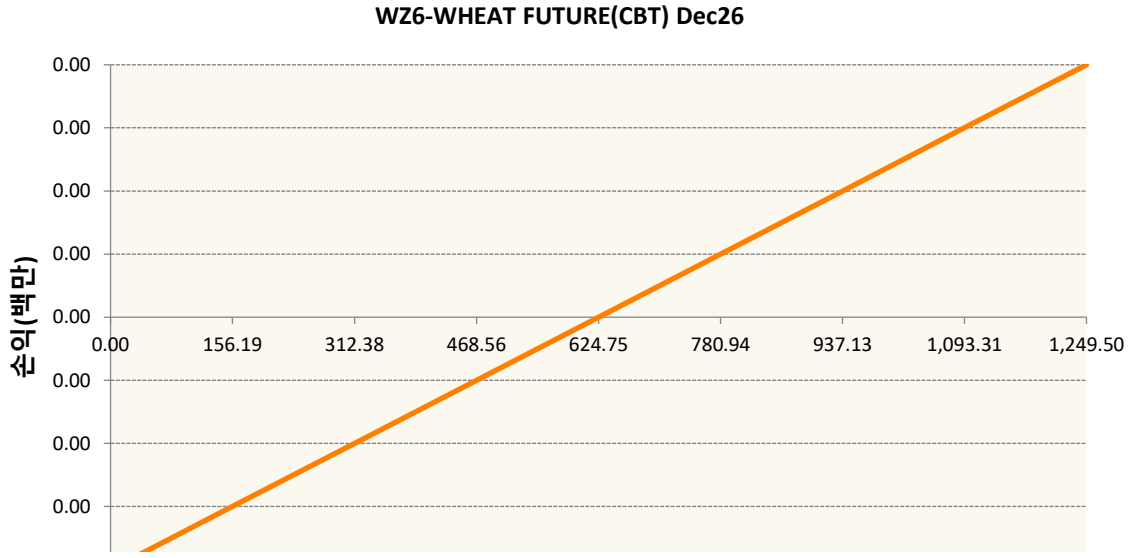

KWZ6-KC HRW WHEAT FUT Dec26
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
166.44
332.88
499.31
665.75
832.19
998.63
1,165.06
1,331.50
손익(백만)
가격


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
5.03
10.07
15.10
20.13
25.16
30.20
35.23
40.26
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
316.19
632.38
948.56
1,264.75
1,580.94
1,897.13
2,213.31
2,529.50
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
86.35
172.70
259.05
345.40
431.75
518.10
604.45
690.80
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
156.19
312.38
468.56
624.75
780.94
937.13
1,093.31
1,249.50
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	2026-10-26
기준일	2026-10-23

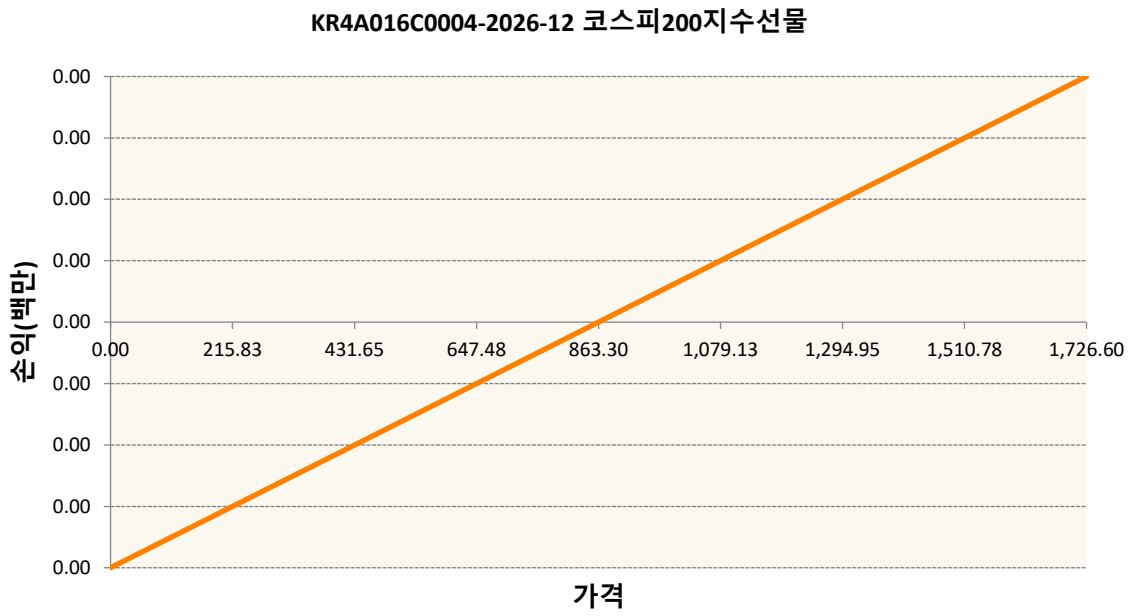
스마트인덱스모

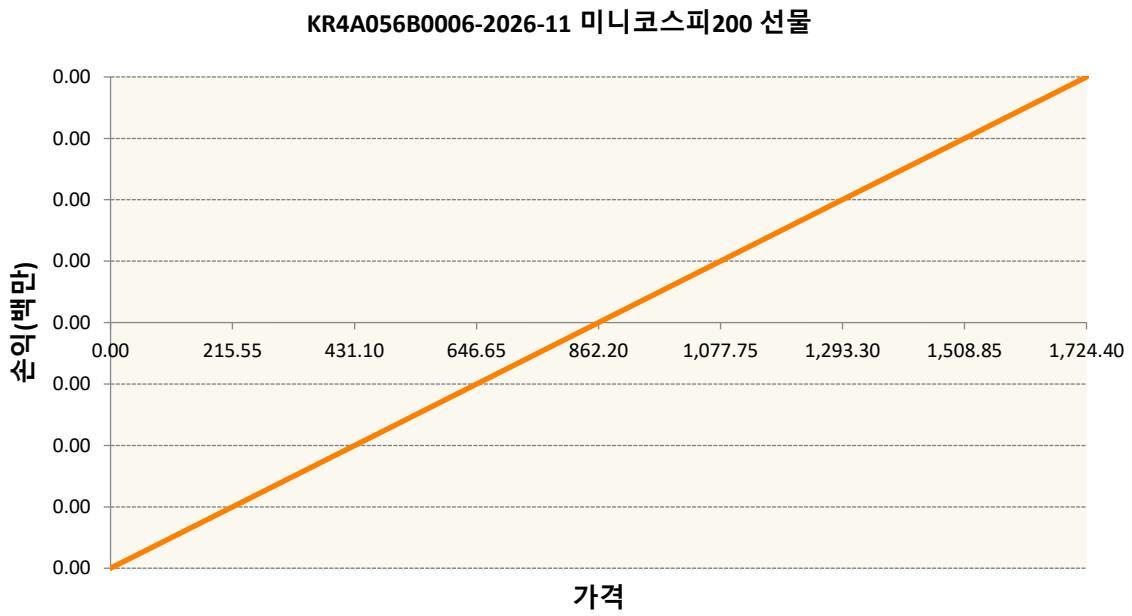
1. 계약금액

(단위:백만원)

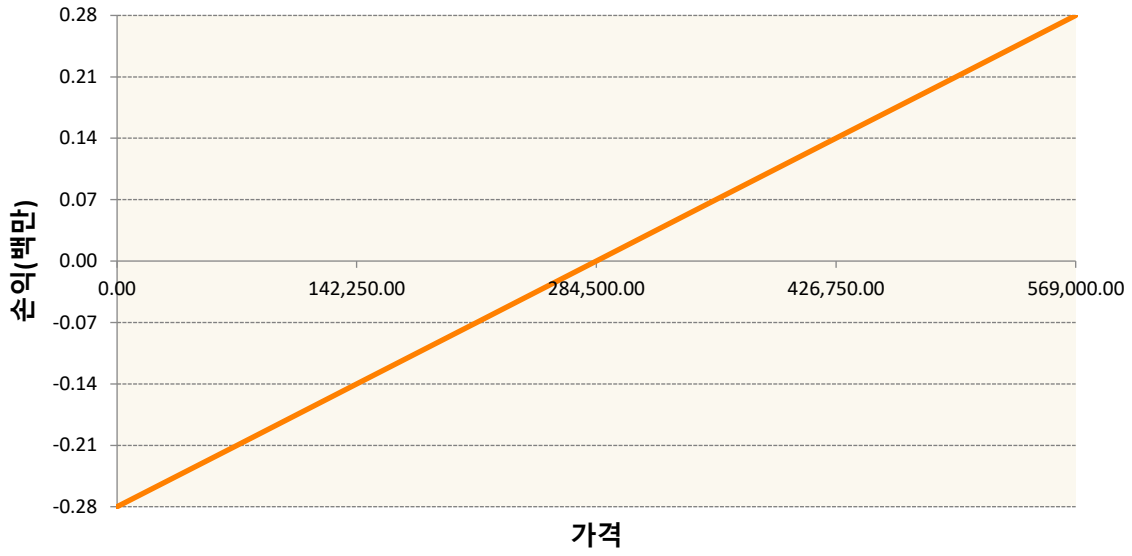
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	207	-207	장내
누계	유가증권	선물	7,260	73	7,187	장내

2. 만기시점의 손익구조

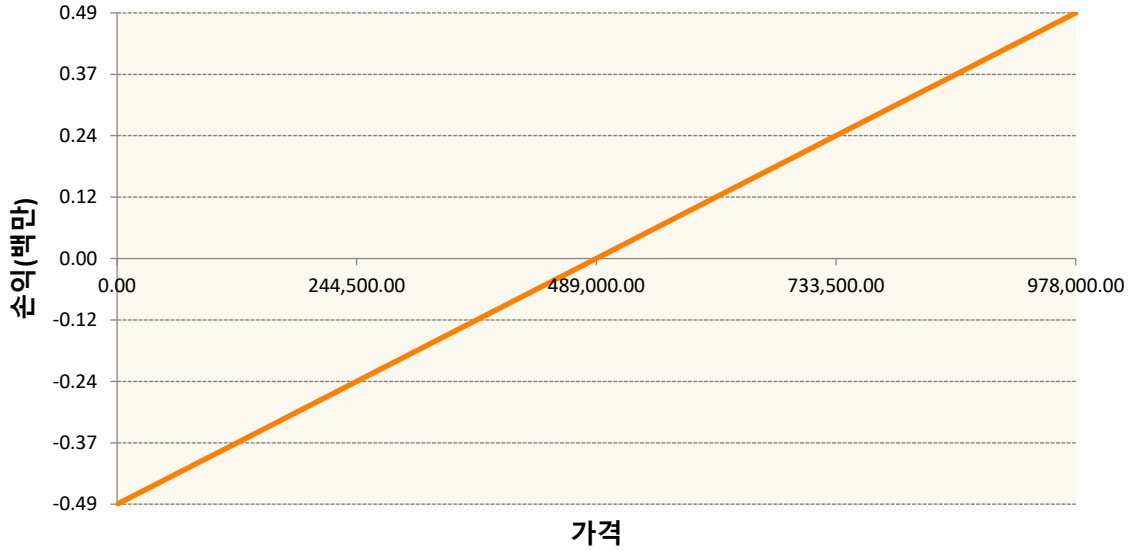




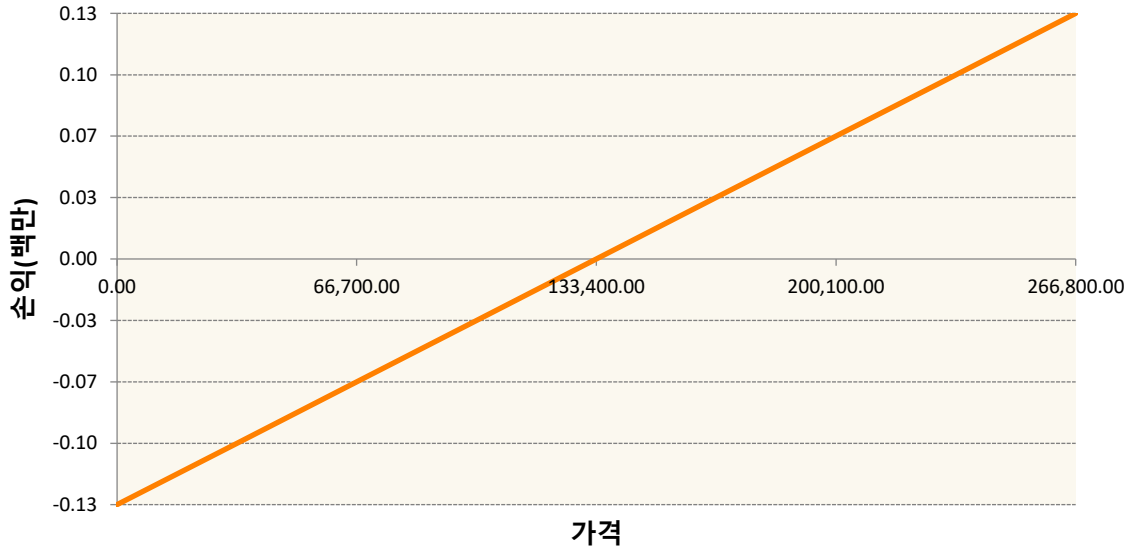
KR4A1Q6B0009-2026-11 에이피알개별선물

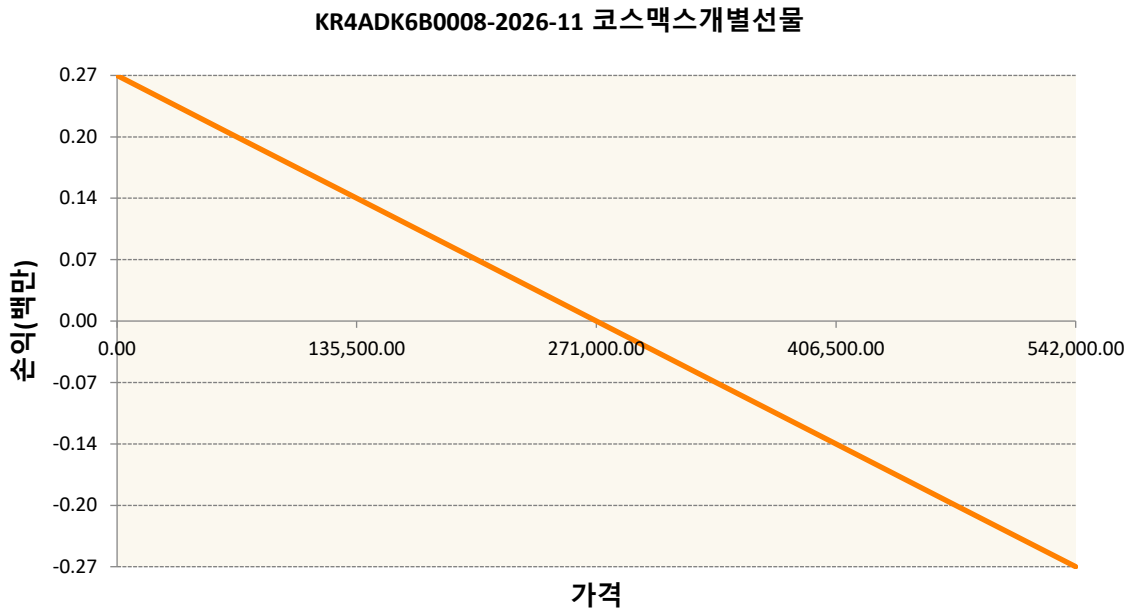


KR4A226B0001-2026-11 삼성SDI개별선물



KR4AB26B0009-2026-11 S-Oil개별선물





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A016C0004	2026-12 코스피200지수선물						449
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-449	-449	-449	-449	-449	-449	-449
-5.33%	-299	-299	-299	-299	-299	-299	-299
-2.67%	-150	-150	-150	-150	-150	-150	-150
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	150	150	150	150	150	150	150
5.33%	299	299	299	299	299	299	299
8.00%	449	449	449	449	449	449	449

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
	KR4A226B0001		2026-11 삼성SDI개별선물				16
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-16	-16	-16	-16	-16	-16	-16
-5.33%	-11	-11	-11	-11	-11	-11	-11
-2.67%	-5	-5	-5	-5	-5	-5	-5
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	5	5	5	5	5	5	5
5.33%	11	11	11	11	11	11	11
8.00%	16	16	16	16	16	16	16
	KR4AB26B0009		2026-11 S-Oil개별선물				11
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-11	-11	-11	-11	-11	-11	-11
-5.33%	-7	-7	-7	-7	-7	-7	-7
-2.67%	-4	-4	-4	-4	-4	-4	-4
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	4	4	4	4	4	4	4
5.33%	7	7	7	7	7	7	7
8.00%	11	11	11	11	11	11	11
	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)

1,668

공시일	2026-10-26
기준일	2026-10-23

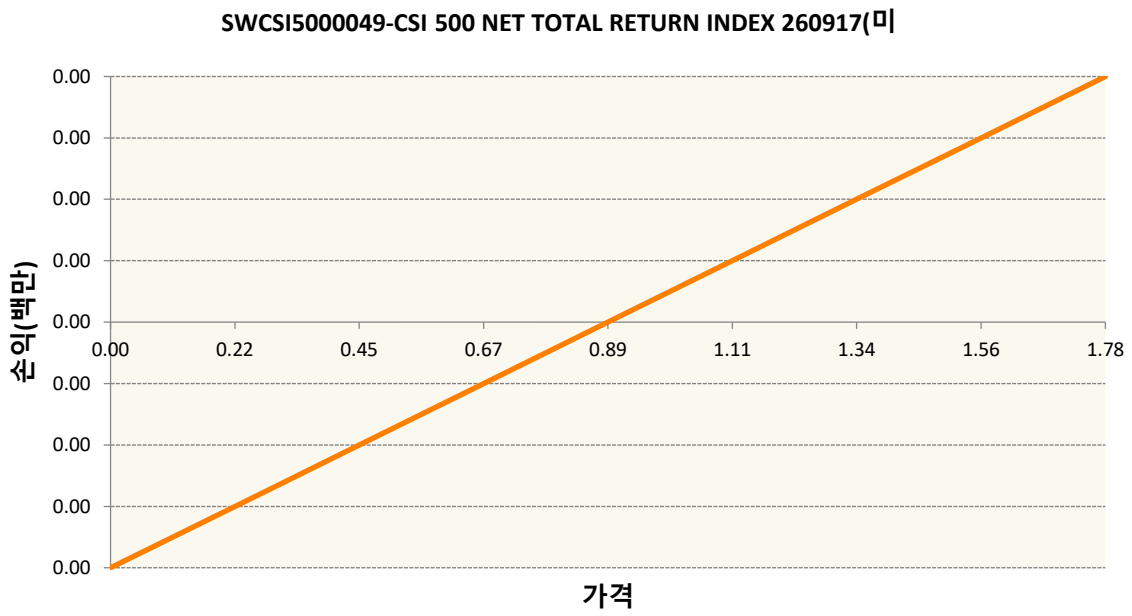
SOL차이나강소기업CSI500상장

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	4,736	0	4,736	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 CSI 500 NET TOTAL RETURN INDEX 260917(미	379

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

608

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2026-10-26
기준일	2026-10-23

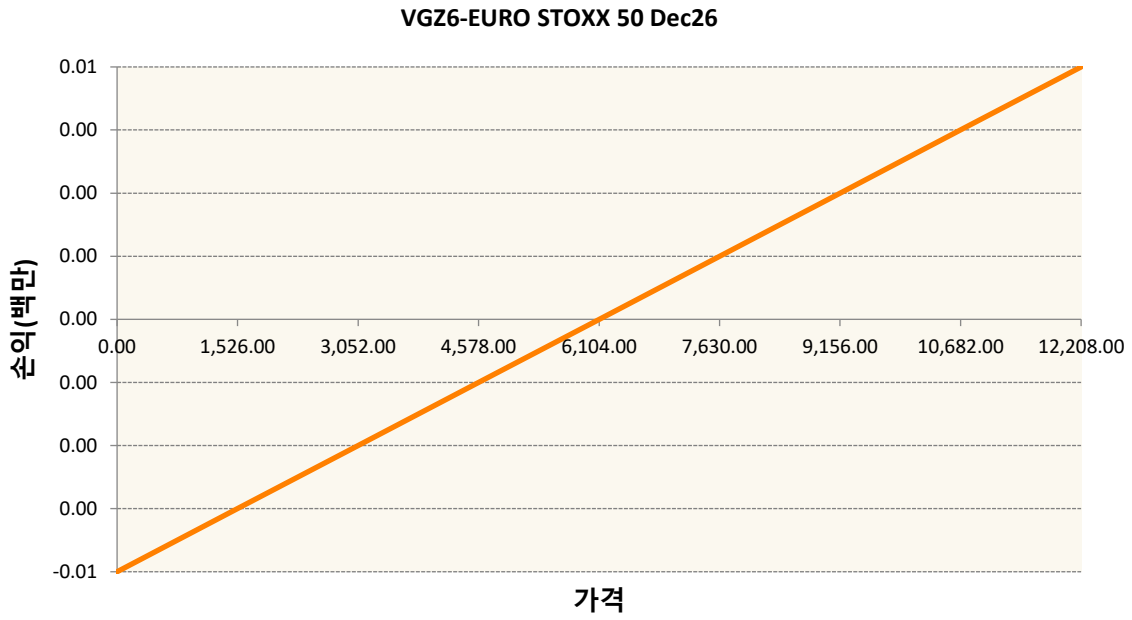
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,160	0	1,160	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGZ6	EURO STOXX 50 Dec26	93

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

(단위:백만원)

68

공시일	2026-10-26
기준일	2026-10-23

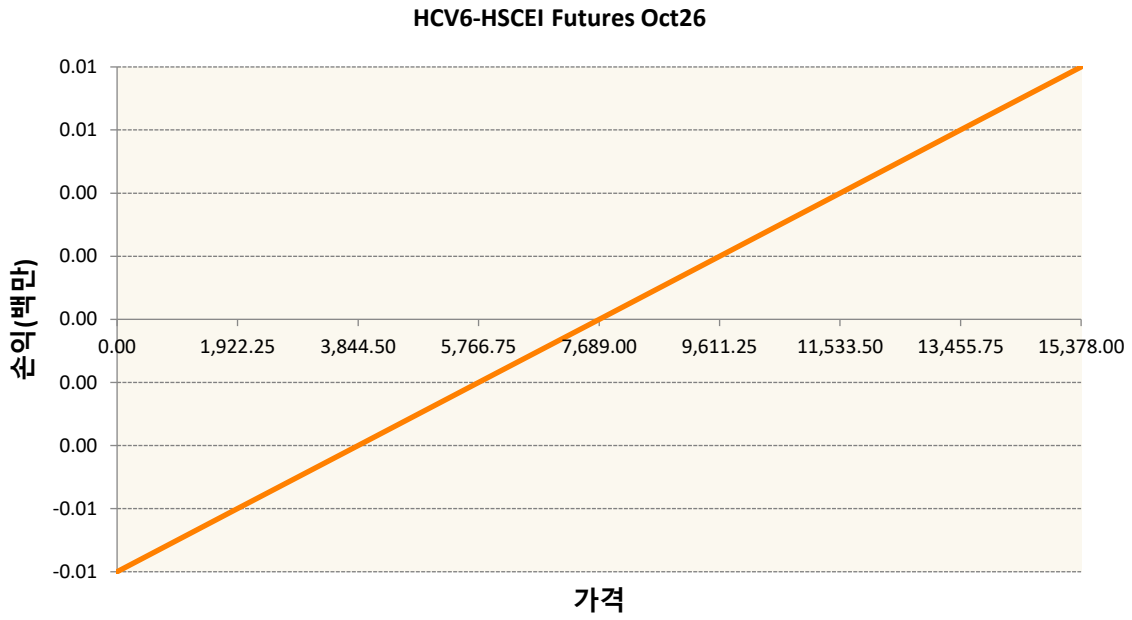
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,340	0	1,340	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCV6	HSCEI Futures Oct26	107

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

(단위:백만원)

101

공시일	2026-10-26
기준일	2026-10-23

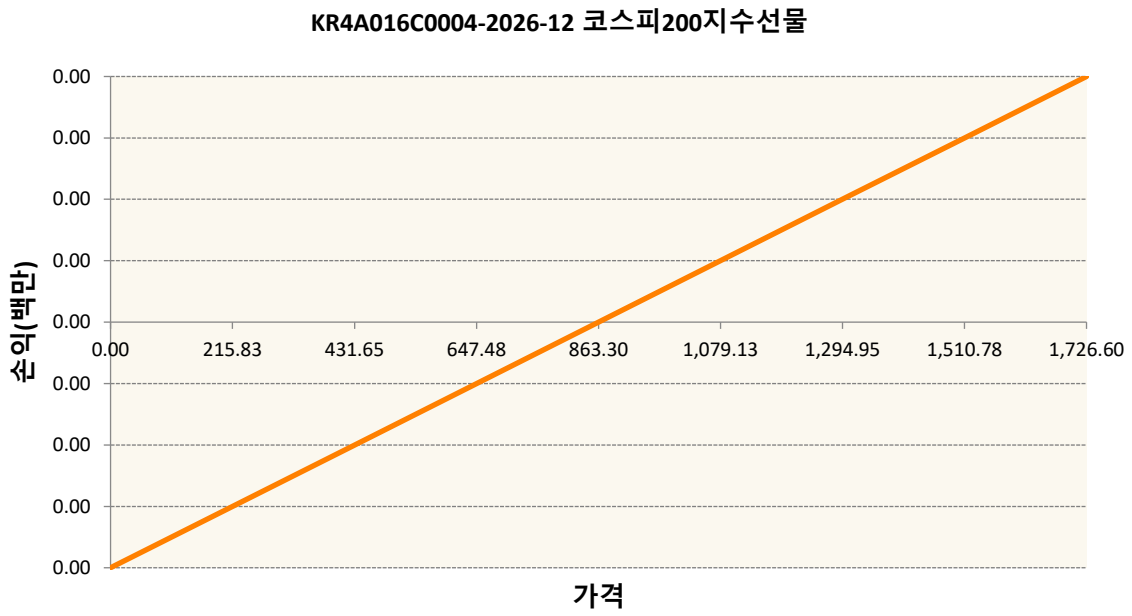
커버드콜모(주식혼합-파생형)

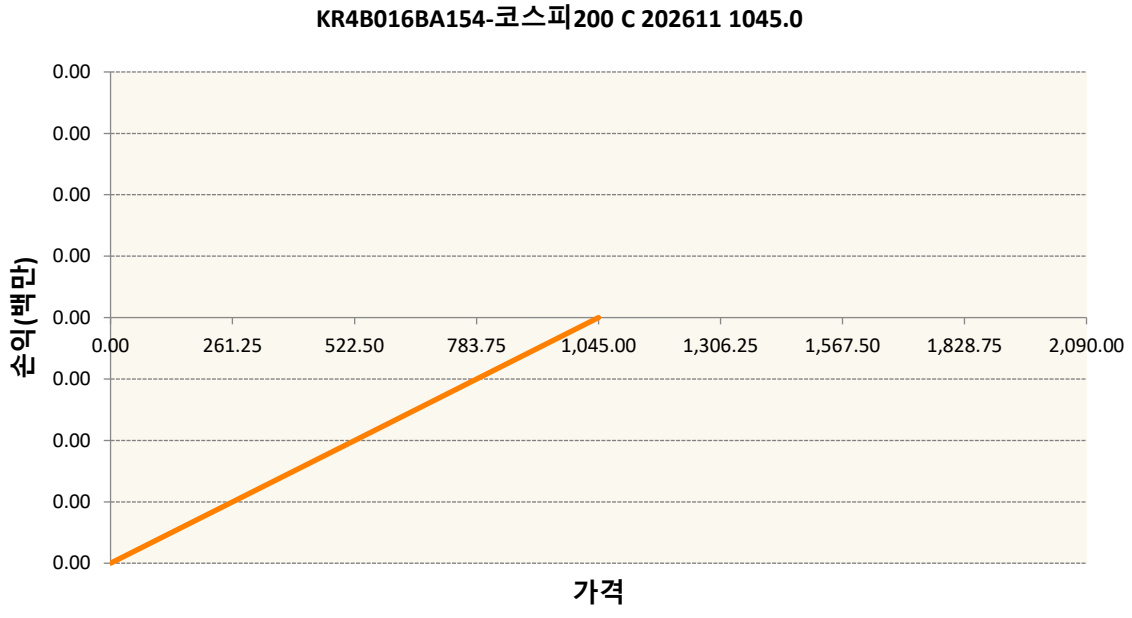
1. 계약금액

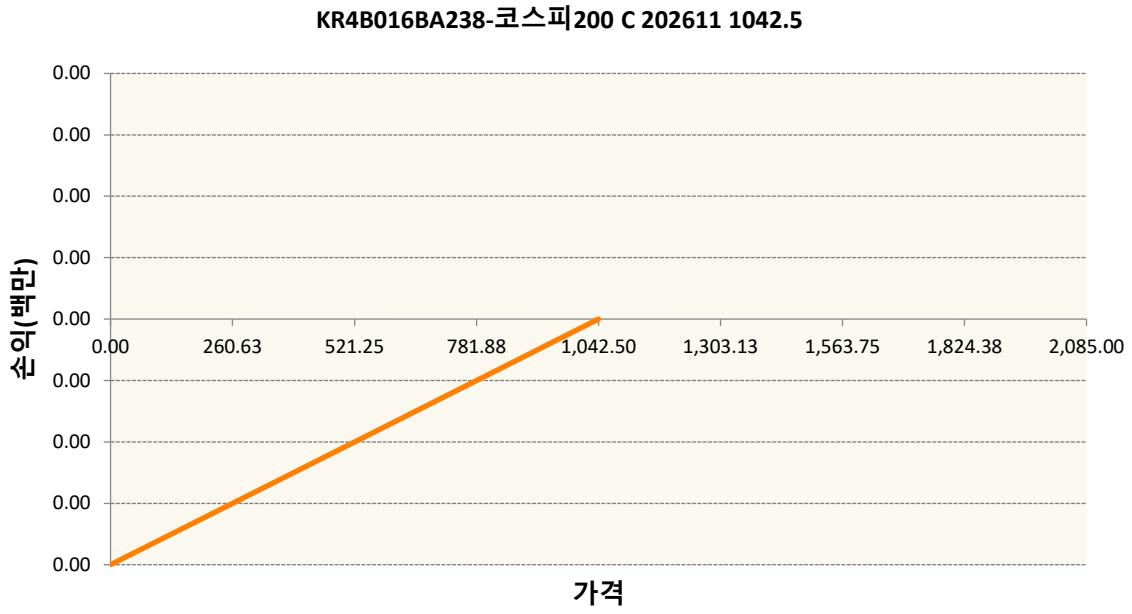
(단위:백만원)

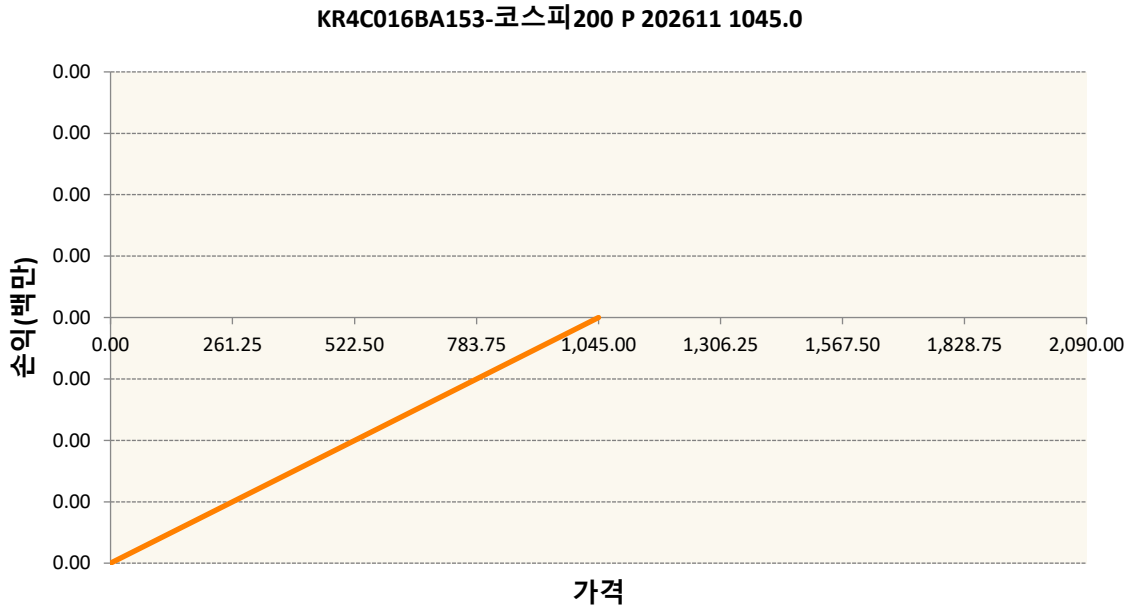
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	432	0	432	장내
누계	유가증권	옵션	0	49,876	-49,876	장내

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						1,969
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,892	-1,895	-1,901	-1,911	-1,925	-1,944	-1,969
-5.33%	-1,228	-1,235	-1,245	-1,262	-1,283	-1,311	-1,344
-2.67%	-568	-580	-598	-623	-655	-693	-737
0%	86	65	36	0	-43	-93	-149
2.67%	727	694	652	603	546	483	414
5.33%	1,350	1,301	1,244	1,180	1,108	1,032	950
8.00%	1,946	1,880	1,806	1,725	1,639	1,549	1,455
	KR4B016BA238		코스피200 C 202611 1042.5				627
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-602	-603	-605	-608	-613	-619	-627
-5.33%	-390	-393	-396	-402	-409	-418	-429
-2.67%	-180	-184	-190	-198	-209	-221	-235
0%	28	21	12	0	-14	-30	-49
2.67%	232	221	208	192	173	153	130
5.33%	430	414	396	375	352	327	300
8.00%	619	598	574	548	520	491	461
	KR4C016BA153		코스피200 P 202611 1045.0				645
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-620	-621	-623	-626	-631	-637	-645
-5.33%	-402	-404	-408	-413	-420	-429	-440
-2.67%	-186	-190	-196	-204	-214	-227	-241
0%	28	21	12	0	-14	-31	-49
2.67%	238	227	214	197	179	158	136
5.33%	442	426	408	386	363	338	311
8.00%	637	616	591	565	537	507	477

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

6,323

공시일	2026-10-26
기준일	2026-10-23

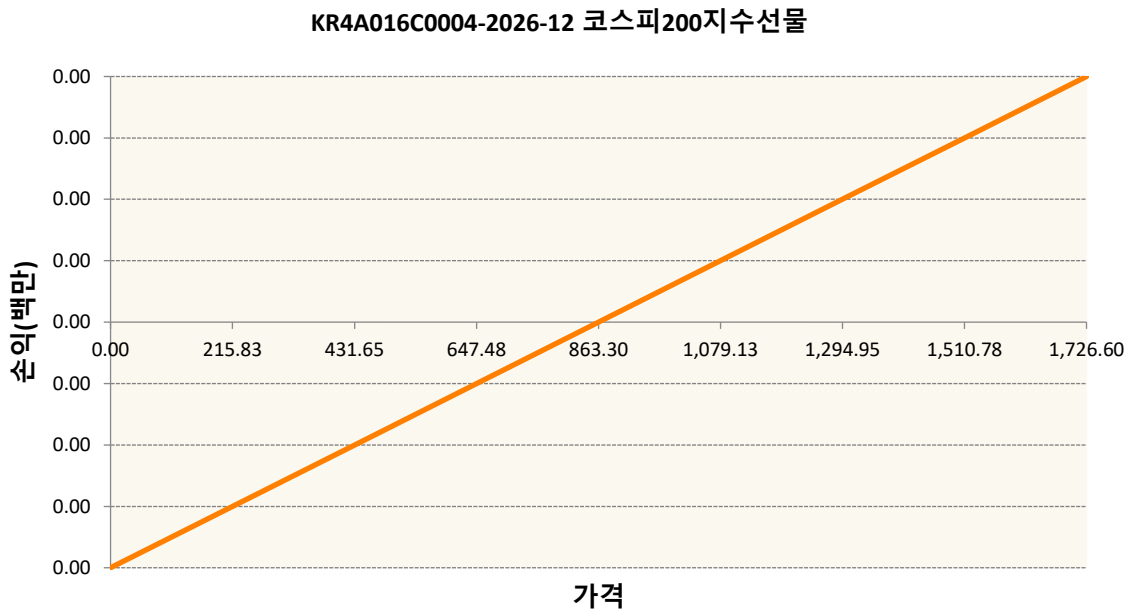
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

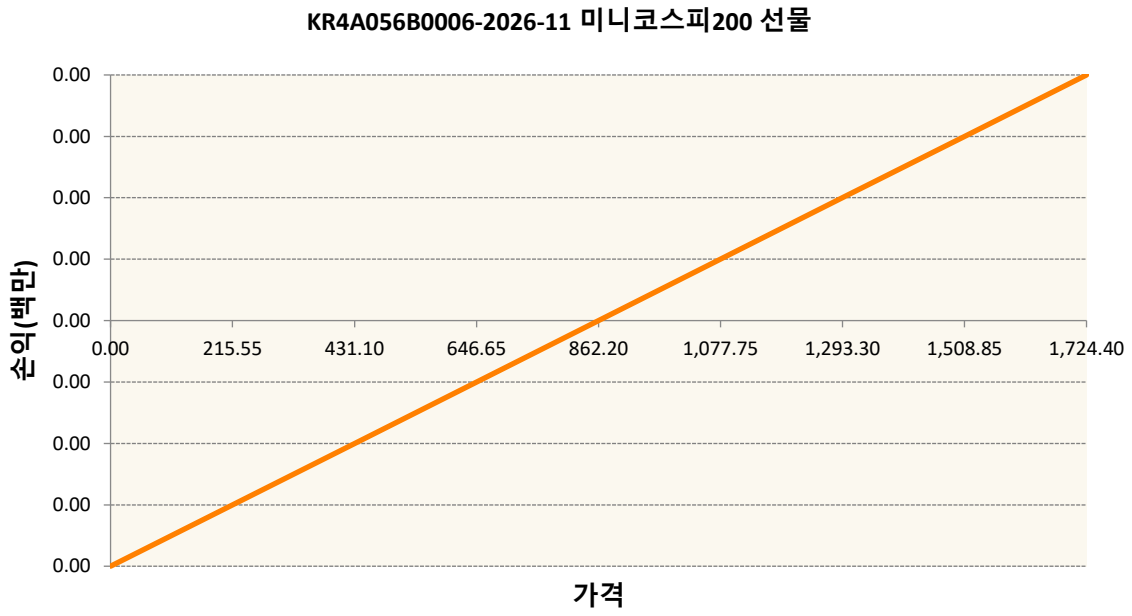
1. 계약금액

(단위:백만원)

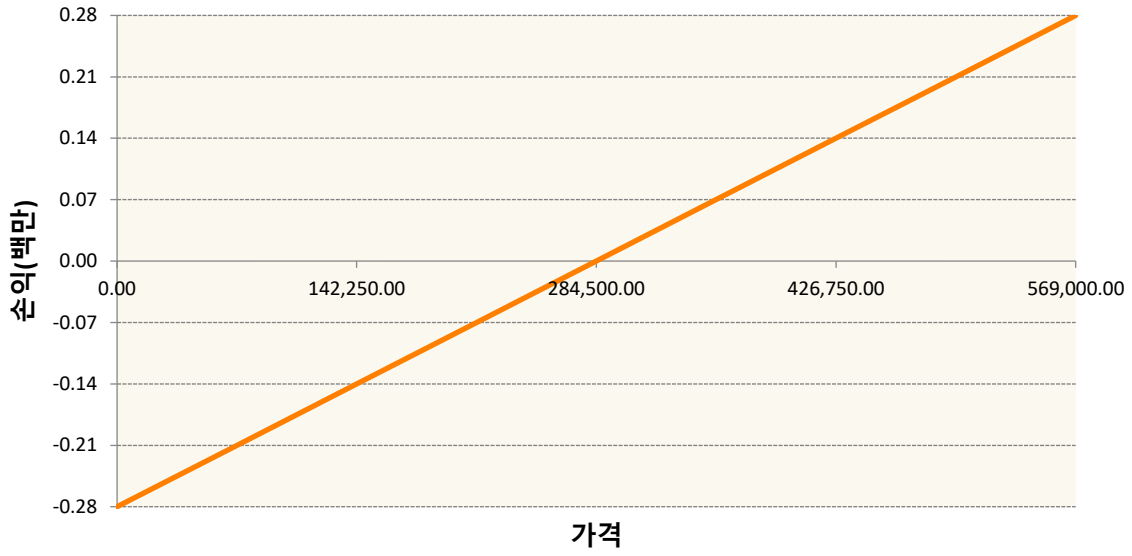
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,817	16	1,801	장내

2. 만기시점의 손익구조

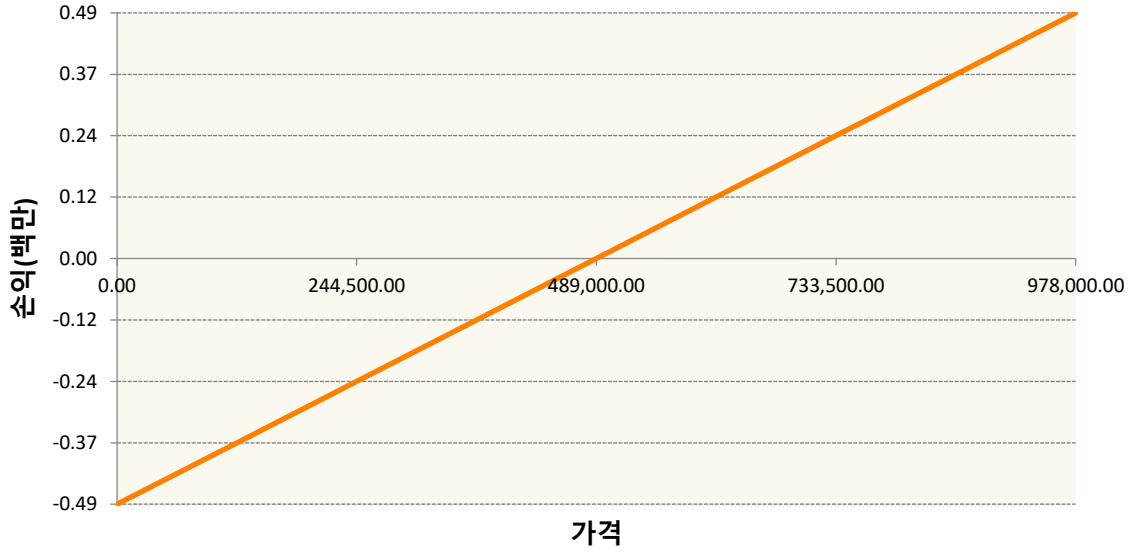




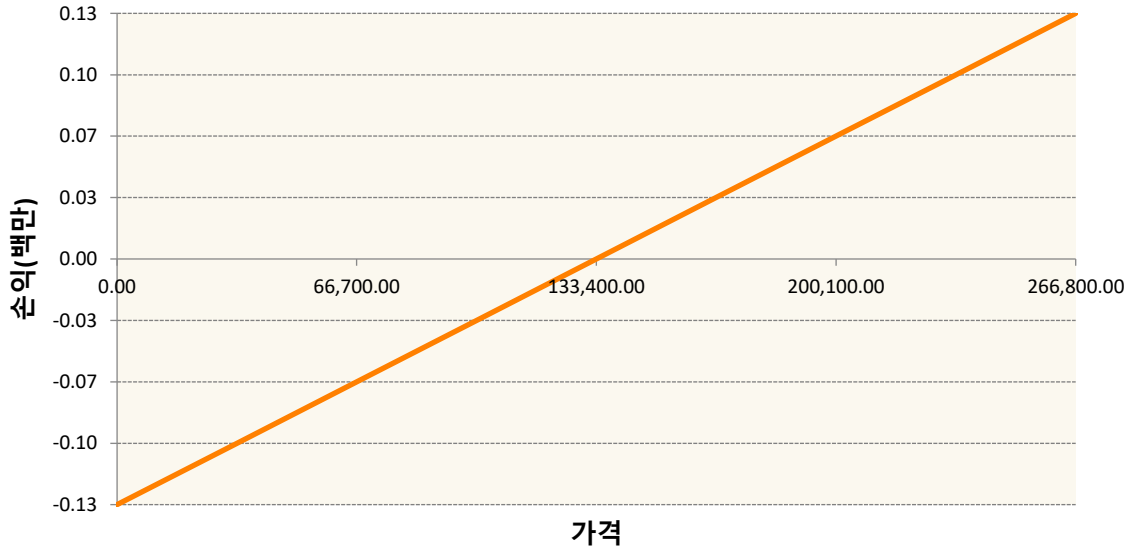
KR4A1Q6B0009-2026-11 에이피알개별선물

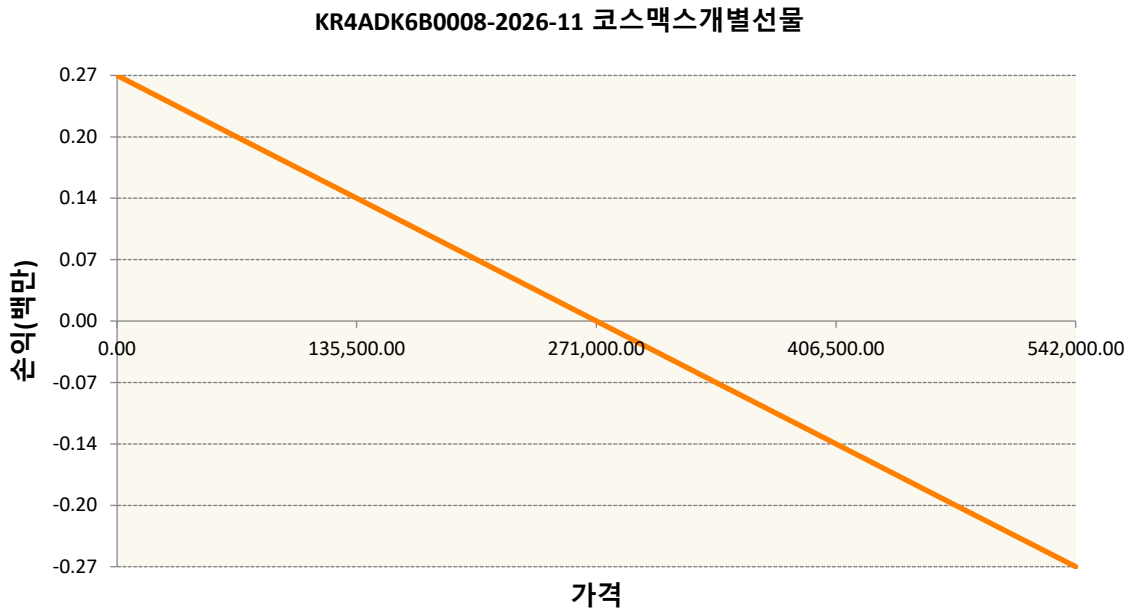


KR4A226B0001-2026-11 삼성SDI개별선물



KR4AB26B0009-2026-11 S-Oil개별선물





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%	-35	-35	-35	-35	-35	-35	-35
-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%	35	35	35	35	35	35	35
8.00%	52	52	52	52	52	52	52

KR4A056B0006	2026-11 미니코스피200 선물						17
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-17	-17	-17	-17	-17	-17	-17
-5.33%	-12	-12	-12	-12	-12	-12	-12
-2.67%	-6	-6	-6	-6	-6	-6	-6
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	6	6	6	6	6	6	6
5.33%	12	12	12	12	12	12	12
8.00%	17	17	17	17	17	17	17

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
	KR4A226B0001		2026-11 삼성SDI개별선물				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
	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)

247

공시일	2026-10-26
기준일	2026-10-23

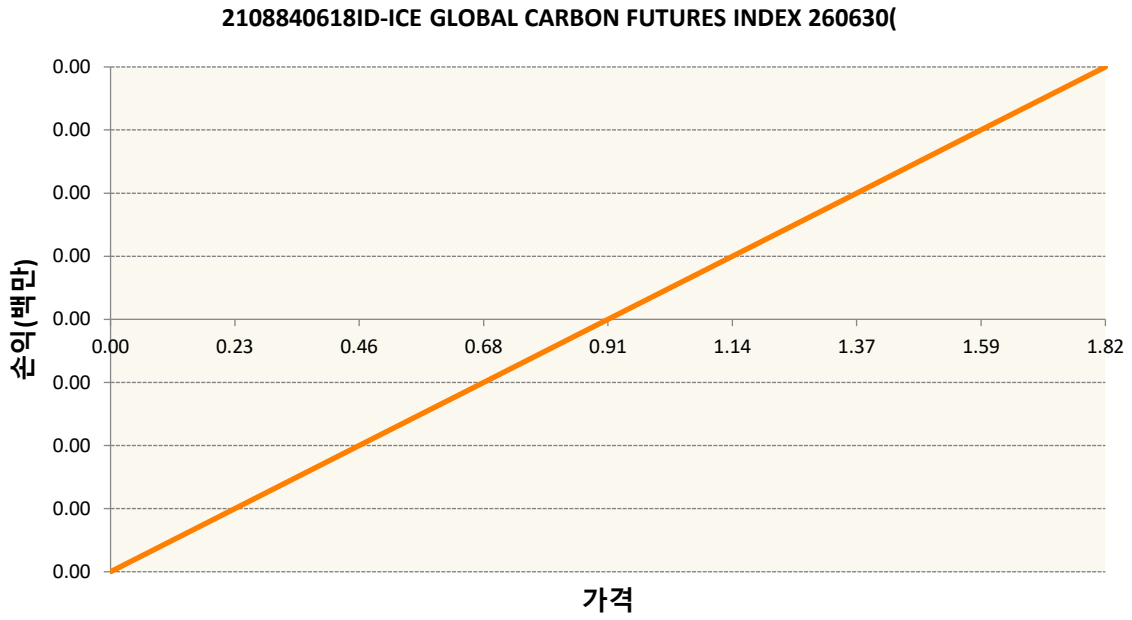
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

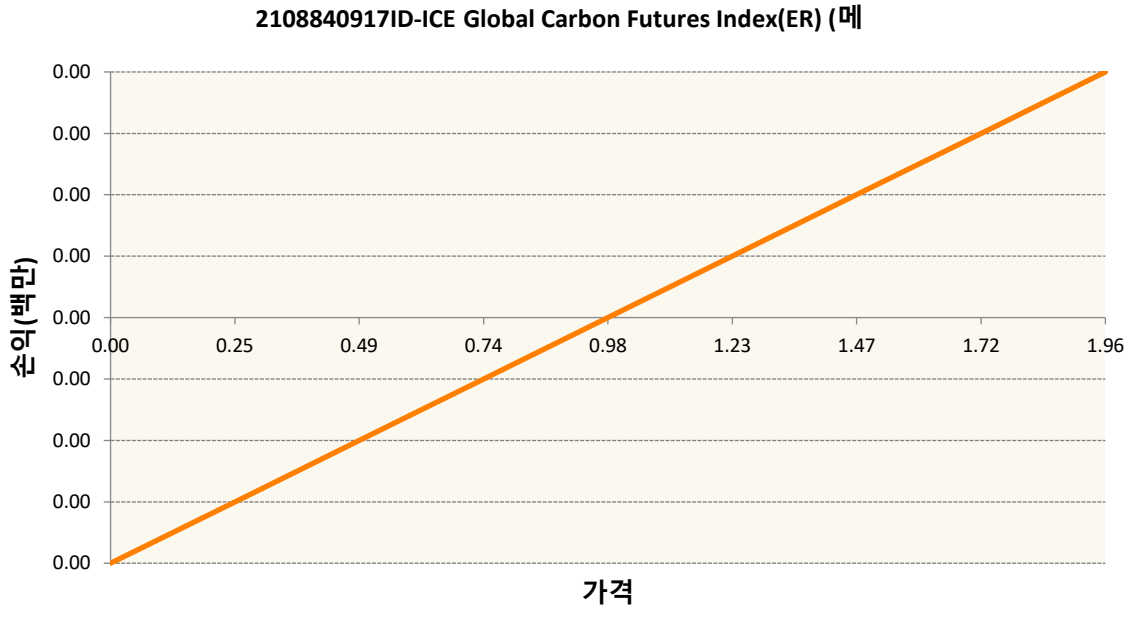
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	6,925	0	6,925	장외

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2108840618ㅣICE GLOBAL CARBON FUTURES INDEX 260630(	440
2108840917ㅣICE Global Carbon Futures Index(ER) (메	111

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

568

공시일	2026-10-26
기준일	2026-10-23

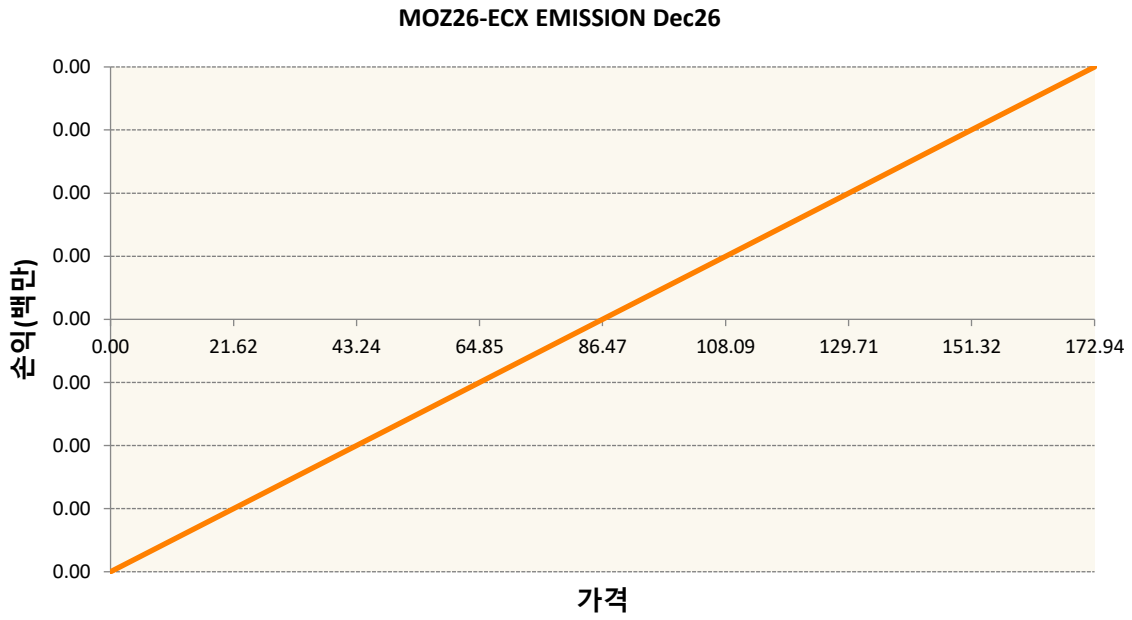
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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			6,103	0	6,103	
누계	통화	선도	0	2,465	-2,465	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213G9V	KRW/EUR 30-10-26E	197
MOZ26	ECX EMISSION Dec26	488

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

(단위:백만원)

718

공시일	2026-10-26
기준일	2026-10-23

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	-837	0	-837	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWSOL0000(CSI PHOTOVOLTAIC INDUSTRY INDEX 260325(	11
SWSOL0000(CSI PHOTOVOLTAIC INDUSTRY INDEX 260630(N	11
SWSOL0000(CSI PHOTOVOLTAIC INDUSTRY INDEX 260630(	17
SWSOL0000(CSI PHOTOVOLTAIC INDUSTRY INDEX 260923(	28

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

(단위:백만원)

103

공시일	2026-10-26
기준일	2026-10-23

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	-5,949	0	-5,949	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 251218(NH)	49
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 260714(미래)	329
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 260917(메리츠)	104

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

(단위:백만원)

909

공시일	2026-10-26
기준일	2026-10-23

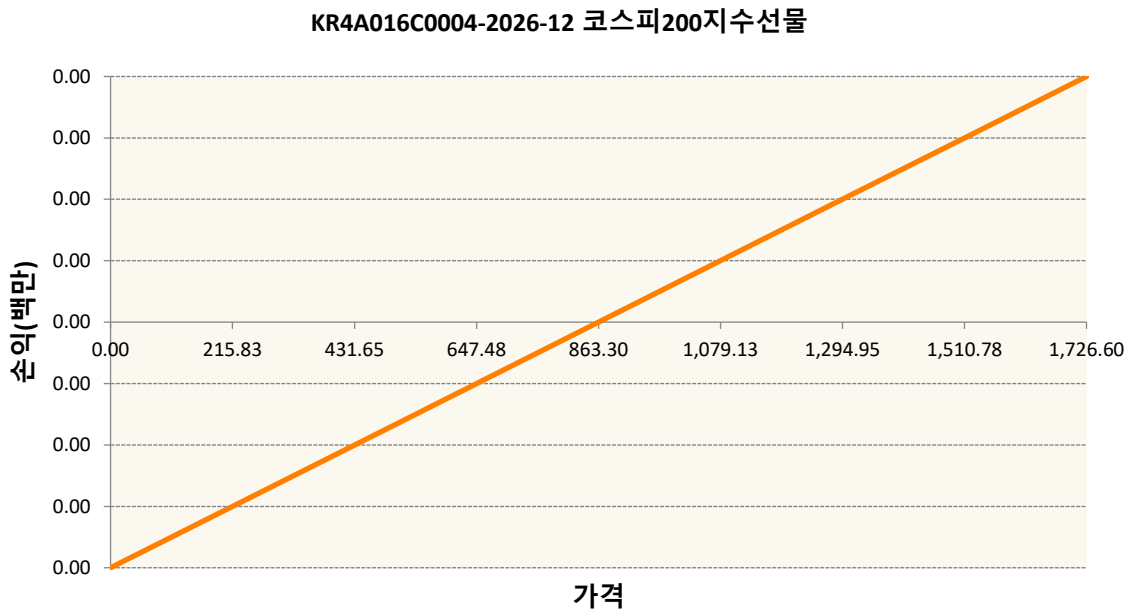
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

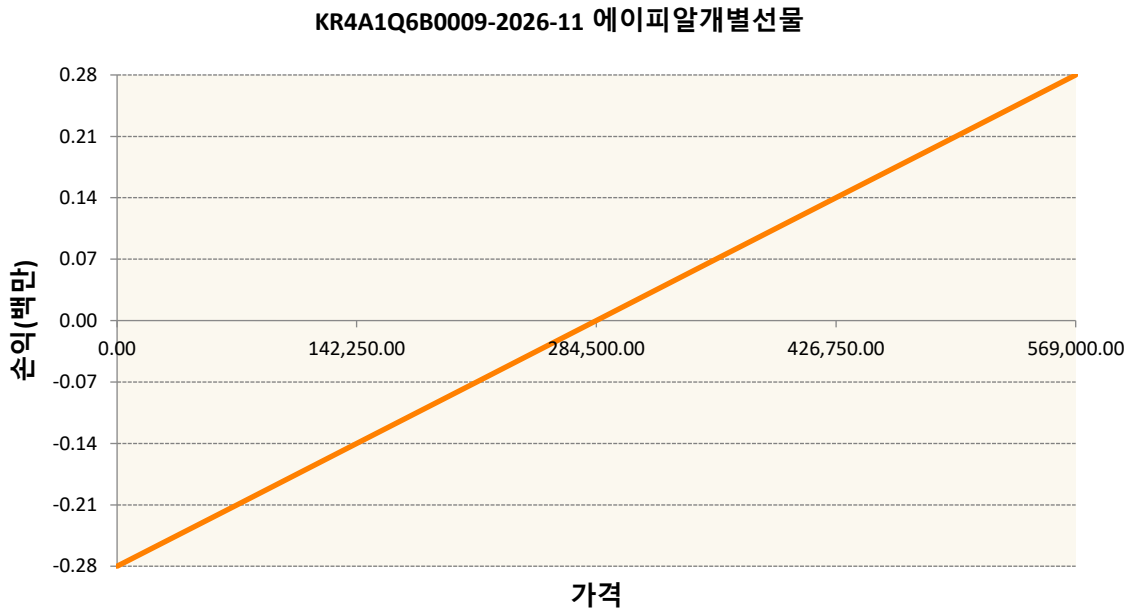
1. 계약금액

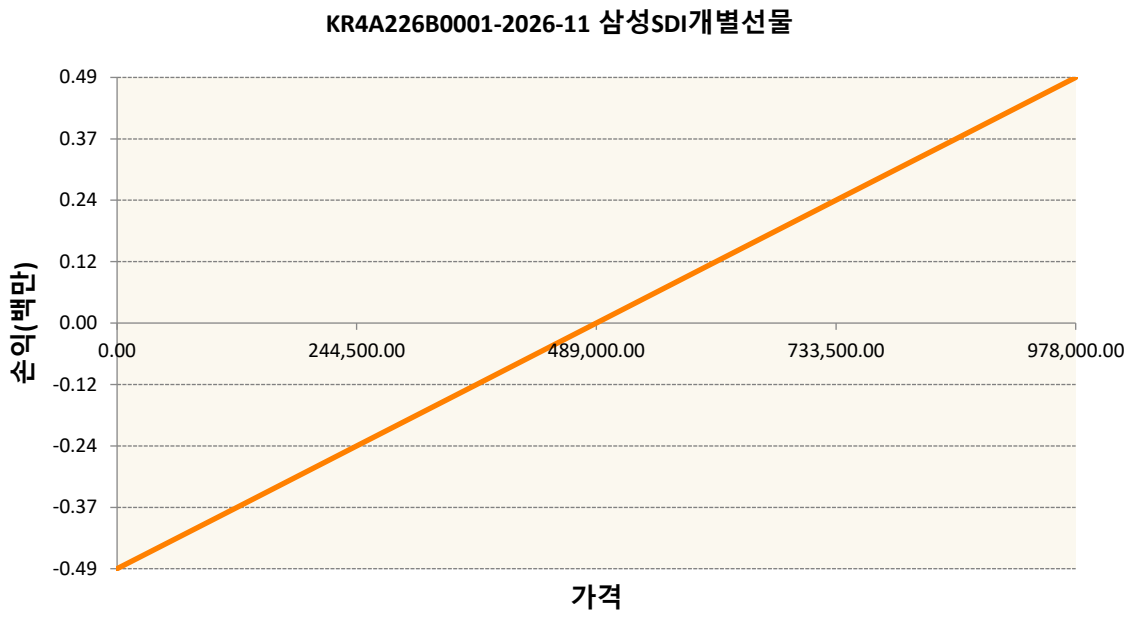
(단위:백만원)

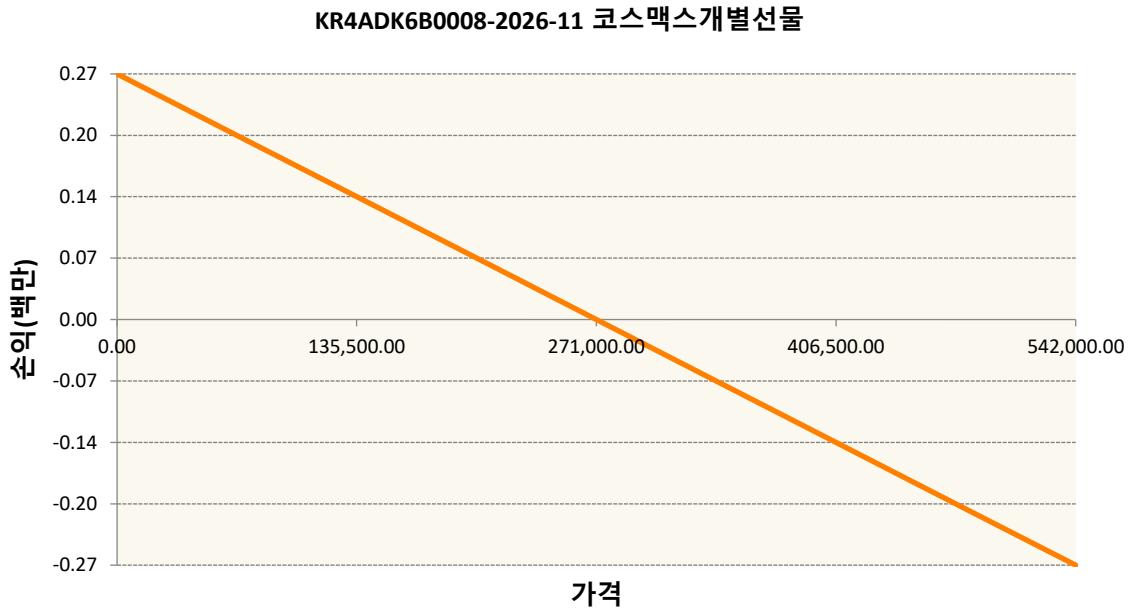
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	3,884	0	3,884	장내
누계	유가증권	선물	16,268	271	15,997	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4A016C0004	2026-12 코스피200지수선물						1,242
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,242	-1,242	-1,242	-1,242	-1,242	-1,242	-1,242
-5.33%	-828	-828	-828	-828	-828	-828	-828
-2.67%	-414	-414	-414	-414	-414	-414	-414
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	414	414	414	414	414	414	414
5.33%	828	828	828	828	828	828	828
8.00%	1,242	1,242	1,242	1,242	1,242	1,242	1,242
KR4A1Q6B0009	2026-11 에이피알개별선물						20
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-20	-20	-20	-20	-20	-20	-20
-5.33%	-13	-13	-13	-13	-13	-13	-13
-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%	13	13	13	13	13	13	13
8.00%	20	20	20	20	20	20	20
	KR4A226B0001		2026-11 삼성SDI개별선물				39
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-39	-39	-39	-39	-39	-39	-39
-5.33%	-26	-26	-26	-26	-26	-26	-26
-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%	26	26	26	26	26	26	26
8.00%	39	39	39	39	39	39	39
	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%	15	15	15	15	15	15	15
-2.67%	7	7	7	7	7	7	7
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-7	-7	-7	-7	-7	-7	-7
5.33%	-15	-15	-15	-15	-15	-15	-15
8.00%	-22	-22	-22	-22	-22	-22	-22

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

4,401

공시일	2026-10-26
기준일	2026-10-23

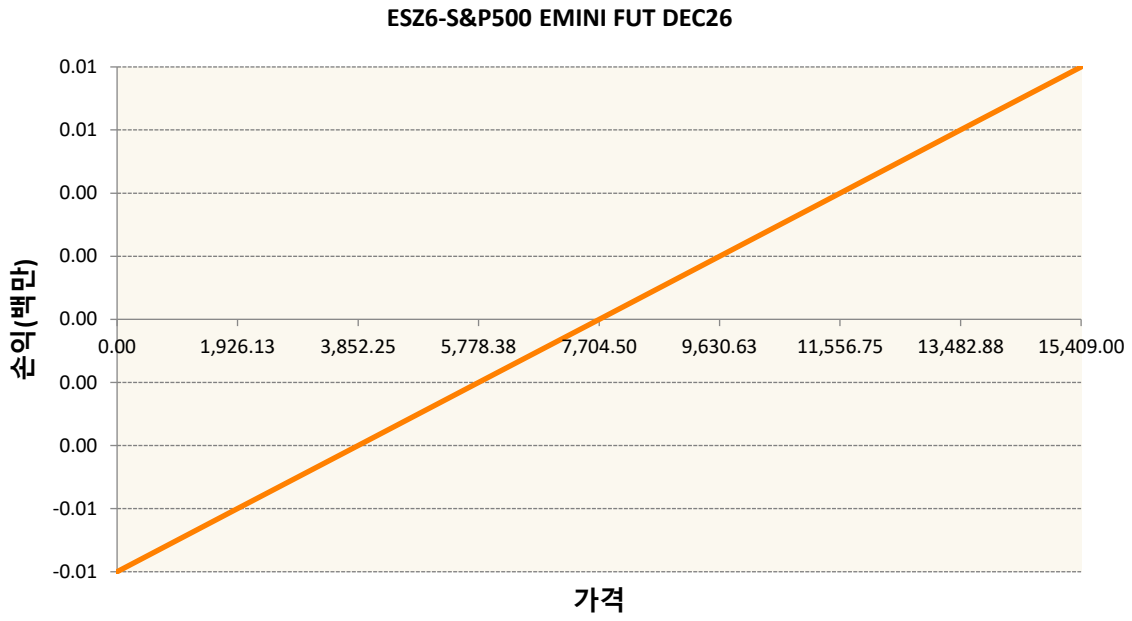
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

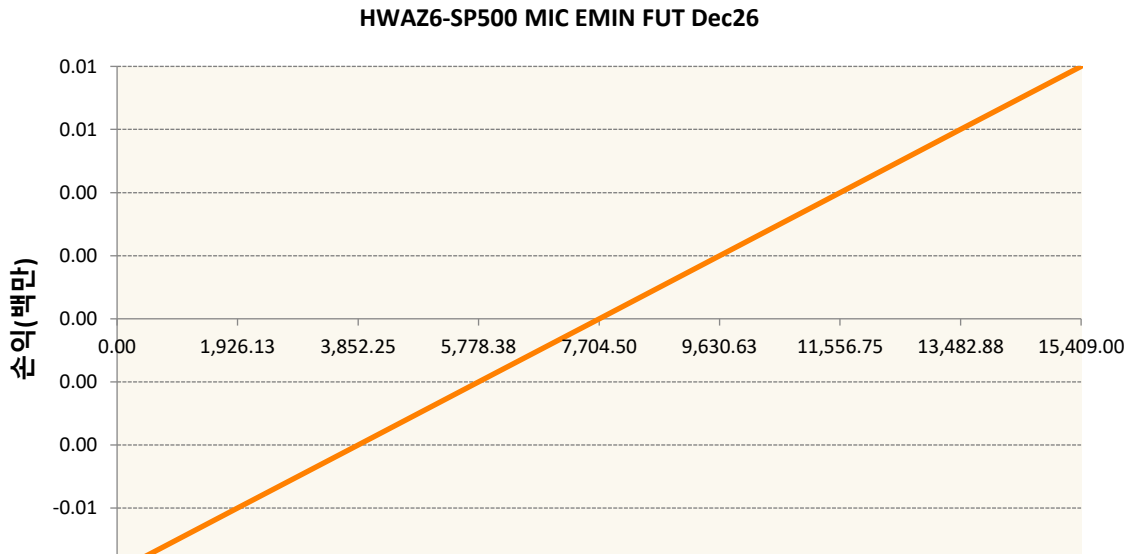
1. 계약금액

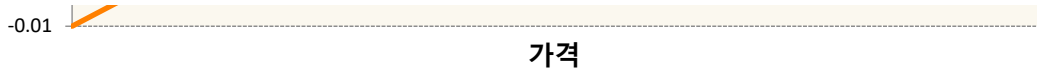
(단위:백만원)

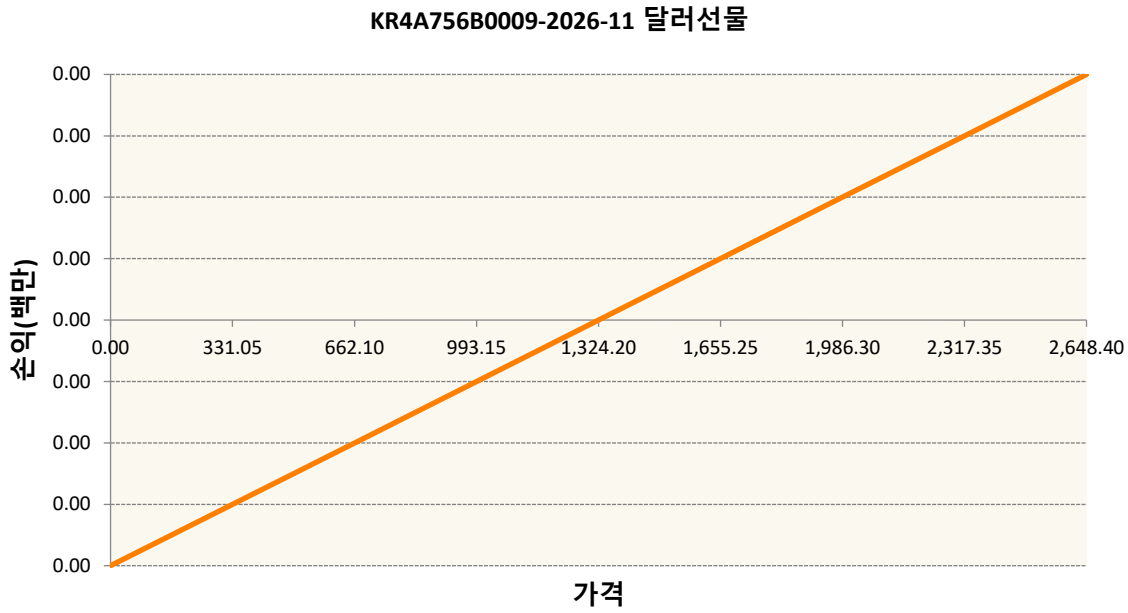
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
신규	지수	선물	0	0	0	장내
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	지수	선물	78,611	0	78,611	
누계	지수	선물	373	0	373	장내
누계	통화	선물	18,406	0	18,406	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESZ6	S&P500 EMINI FUT DEC26	6,289
HWAZ6	SP500 MIC EMIN FUT Dec26	30
KR4A756B00	2026-11 달러선물	1,473

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	3,800

공시일	2026-10-26
기준일	2026-10-23

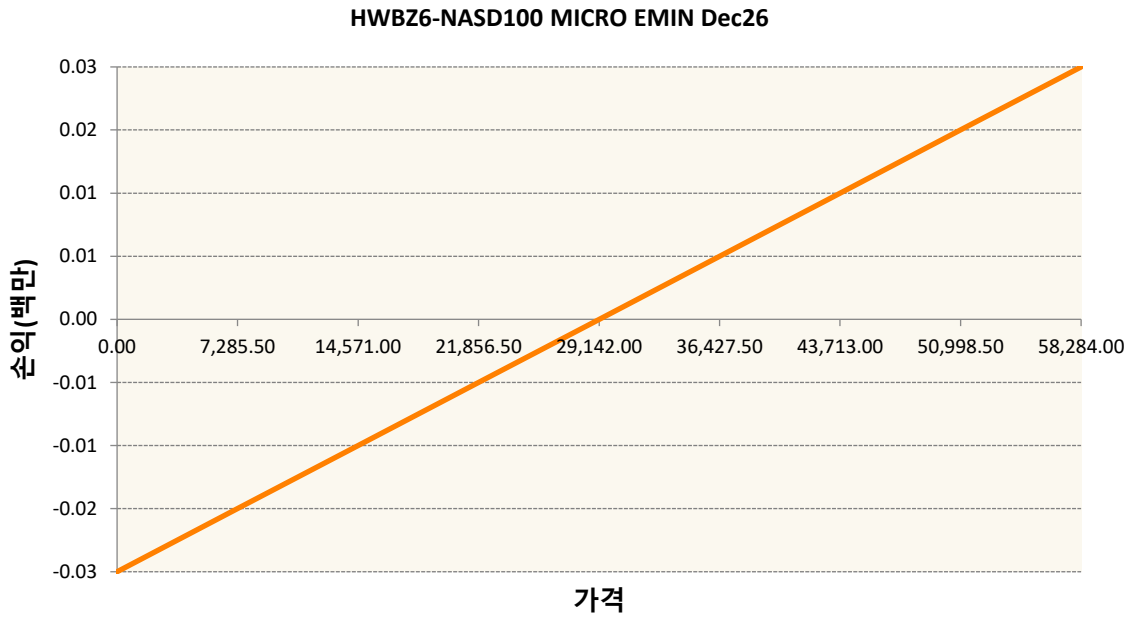
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

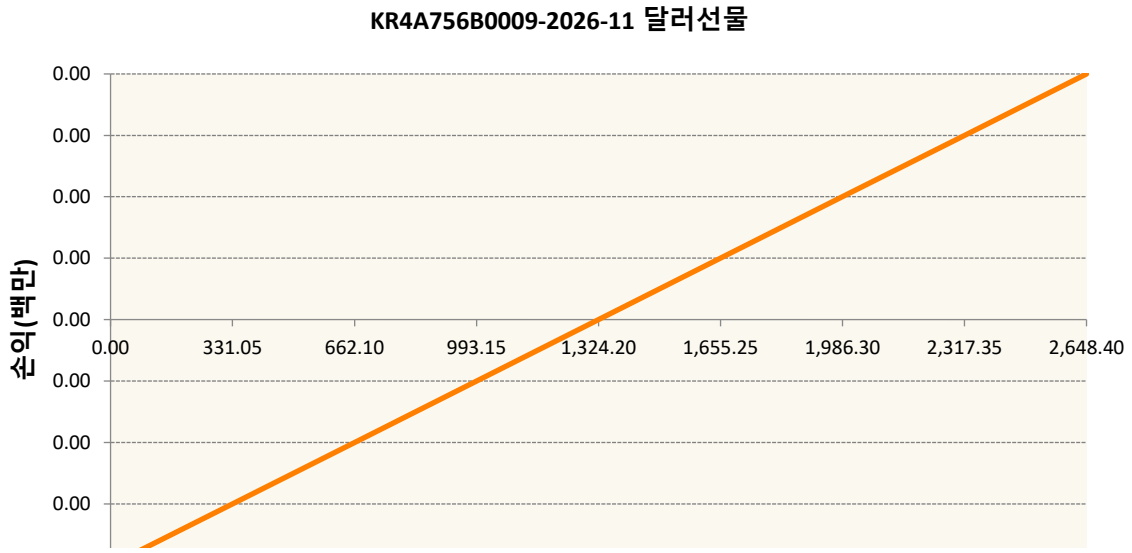
1. 계약금액

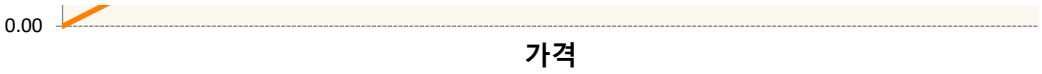
(단위:백만원)

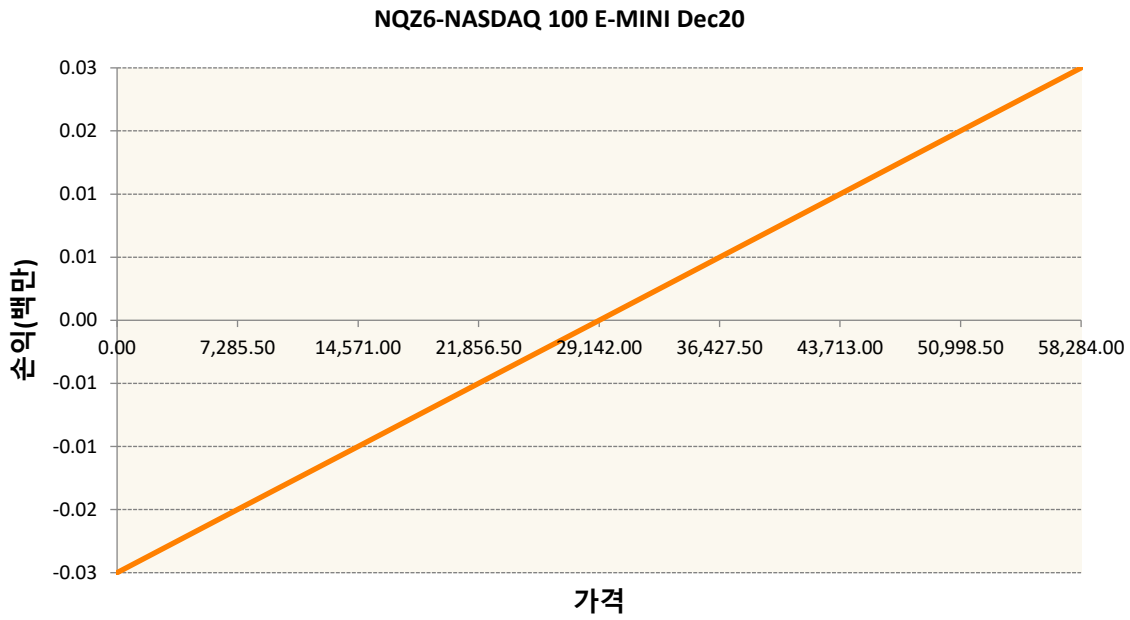
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
신규	지수	선물	0	0	0	장내
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	지수	선물	34,618	0	34,618	
누계	지수	선물	403	0	403	장내
누계	통화	선물	8,554	0	8,554	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HWBZ6	NASD100 MICRO EMIN Dec26	32
KR4A756B00	2026-11 달러선물	684
NQZ6	NASDAQ 100 E-MINI Dec20	2,769

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

(단위:백만원)

2,512

공시일	2026-10-26
기준일	2026-10-23

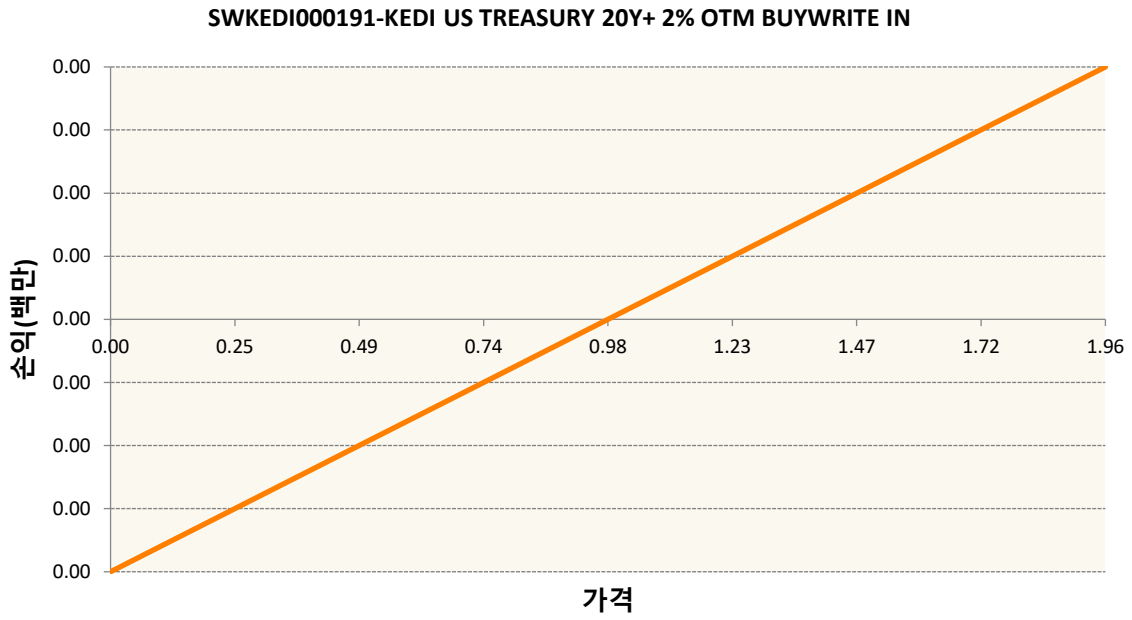
SOL미국30년국채커버드콜(합성)

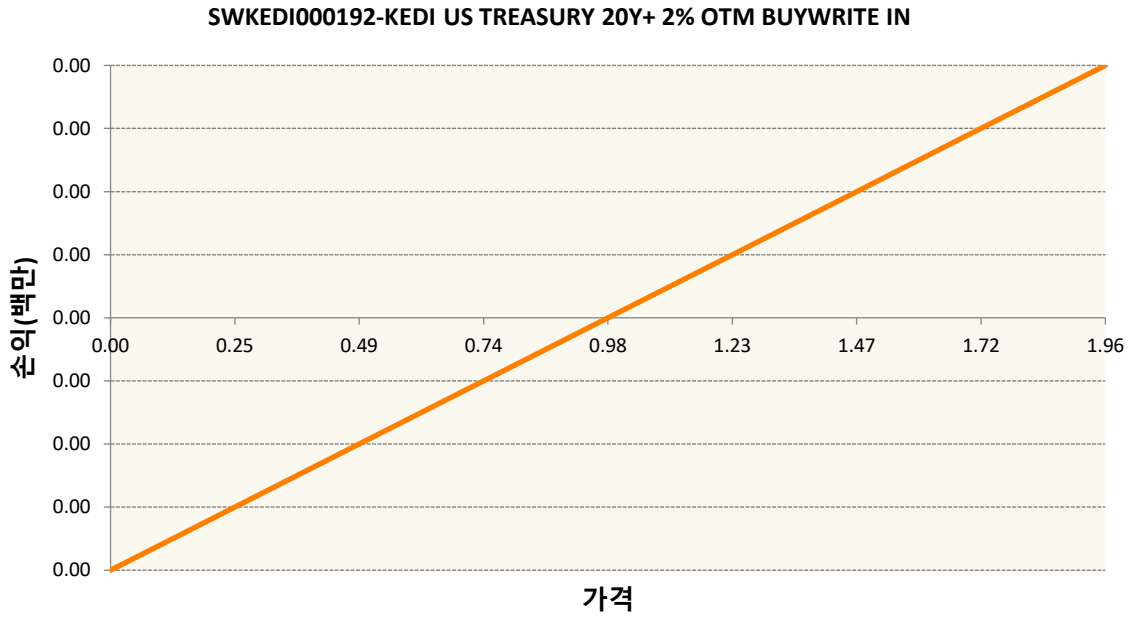
1. 계약금액

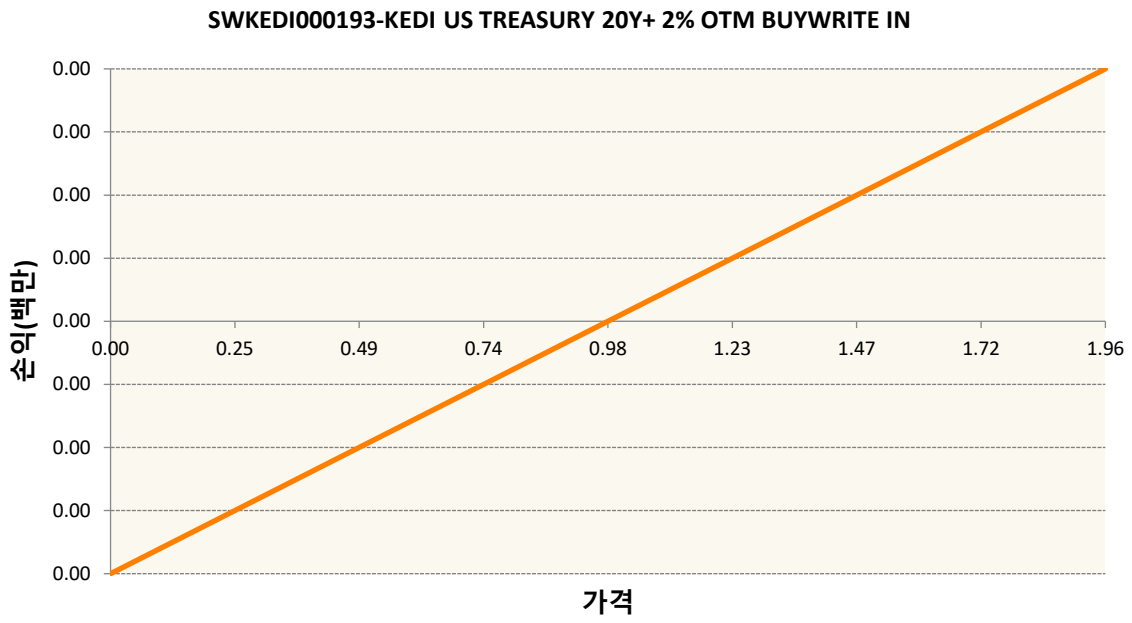
(단위:백만원)

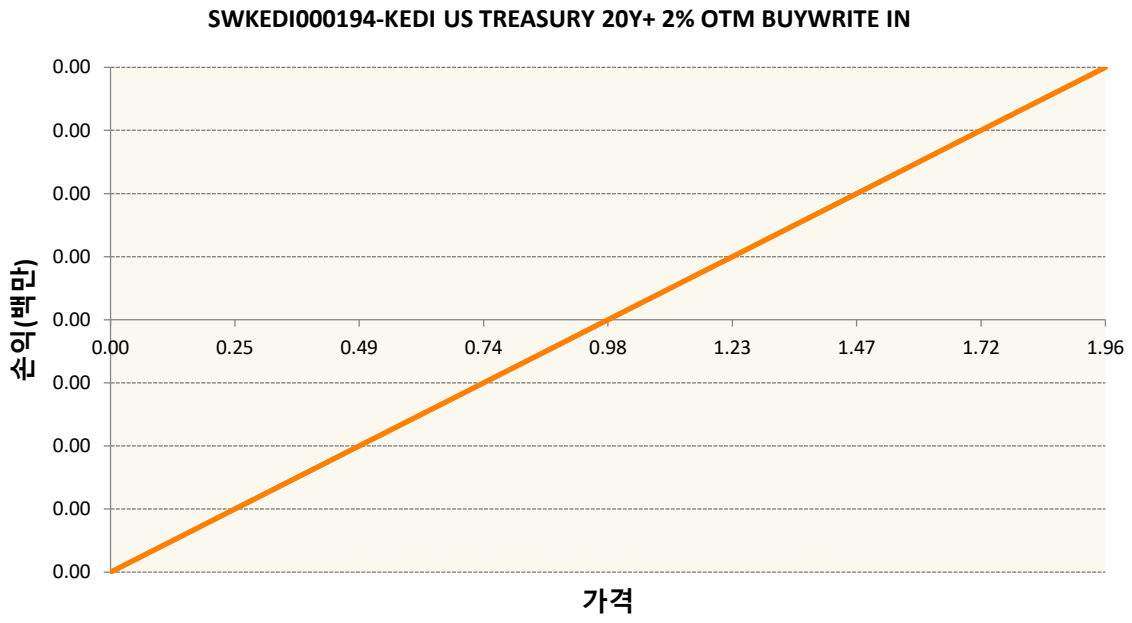
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	273,840	0	273,840	장외

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	2,662
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	4,735
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	6,883
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	7,530

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

8,597