공시일	2026-10-27
기준일	2026-10-26

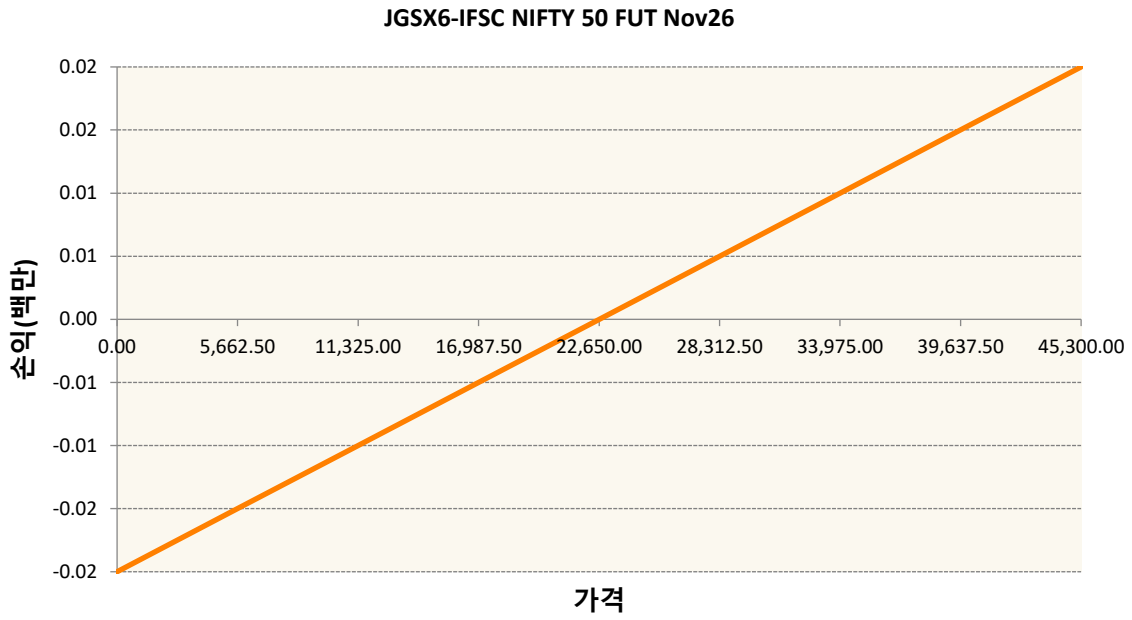
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	300	0	300	

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	2026-10-27
기준일	2026-10-26

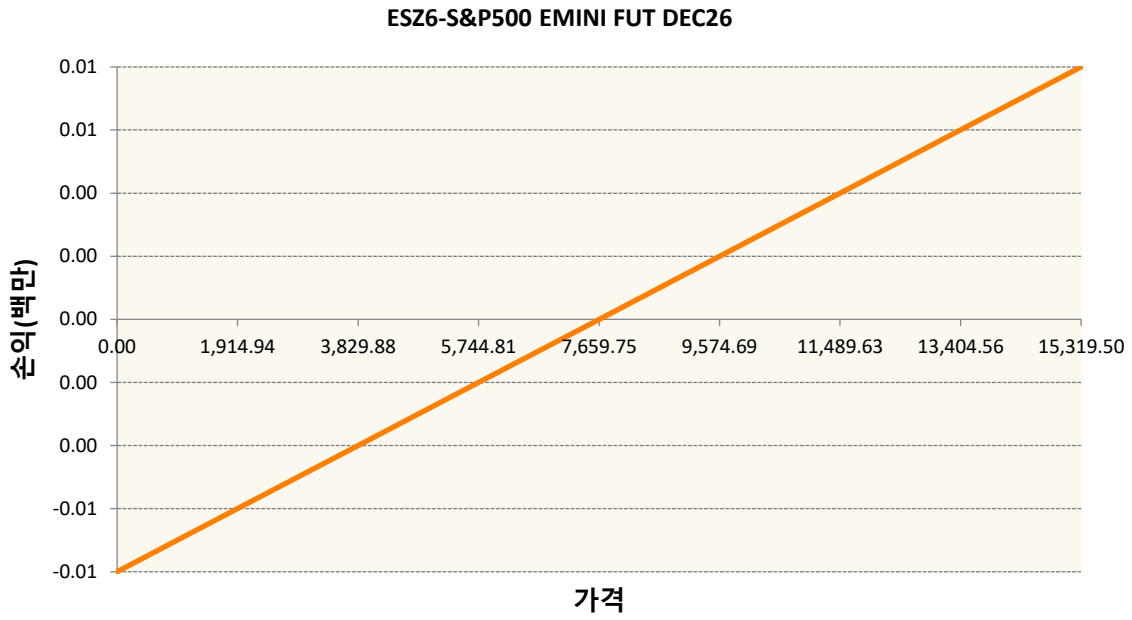
SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	530	0	530	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

ESZ6	S&P500 EMINI FUT DEC26	42

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

(단위:백만원)

25

공시일	2026-10-27
기준일	2026-10-26

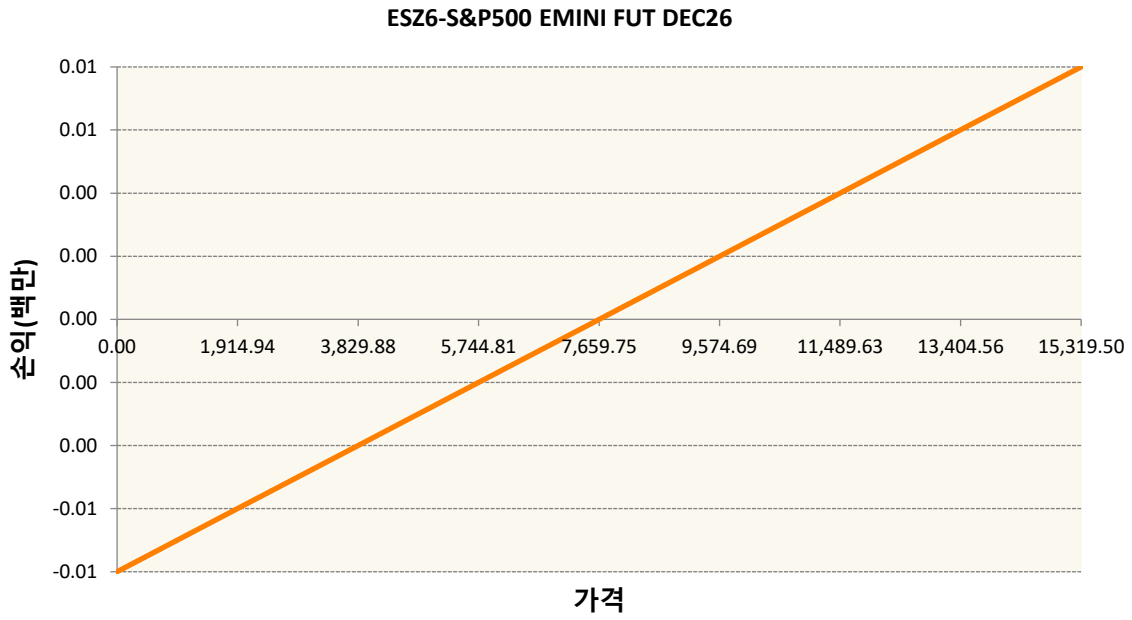
SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	529	0	529	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

ESZ6	S&P500 EMINI FUT DEC26	42

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

(단위:백만원)

25

공시일	2026-10-27
기준일	2026-10-26

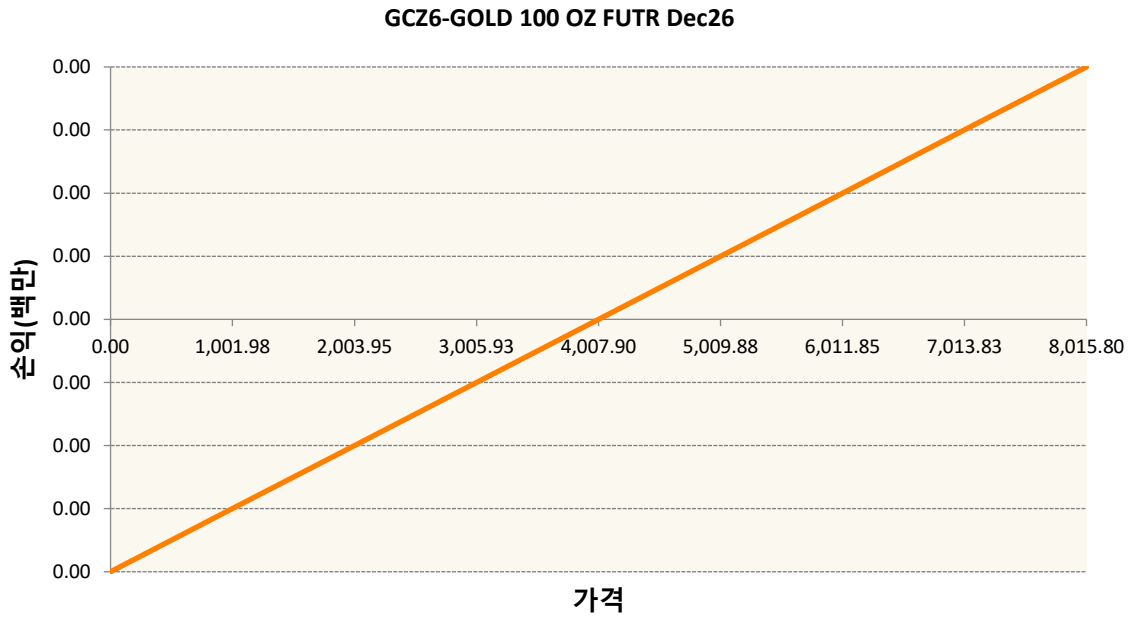
SOL골드커버드콜액티브특별자산상장지수(금

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			5,726	0	5,726	
누계	실물자산	옵션	0	0	0	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

AOGLDUSAC	GLD US 10/30/26 C375 EQUITY	2
GCZ6	GOLD 100 OZ FUTR Dec26	458

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

(단위:백만원)

586

공시일	2026-10-27
기준일	2026-10-26

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)

AOPLTRAC2(PLTR US 10/30/26 C202.5 EQUITY	123
AOPLTRAP2(PLTR US 10/30/26 P202.5 EQUITY	16

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

(단위:백만원)

483

공시일	2026-10-27
기준일	2026-10-26

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)

AOTLTUSAC(TLT US 10/30/26 C82 EQUITY	4

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

(단위:백만원)

2

공시일	2026-10-27
기준일	2026-10-26

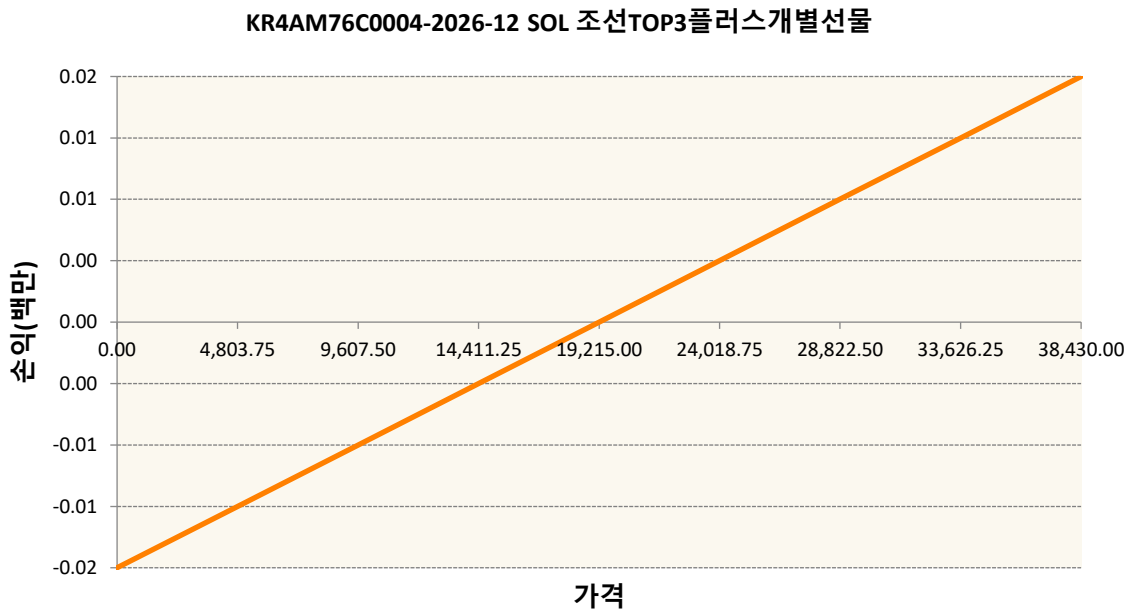
SOL조선TOP3플러스레버리지상장지수(주식)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	192	-192	장내
누계	유가증권	선물	5,597	0	5,597	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4AM76C0004	2026-12 SOL 조선TOP3플러스개별선물						4,455
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-4,455	-4,455	-4,455	-4,455	-4,455	-4,455	-4,455
-5.33%	-2,970	-2,970	-2,970	-2,970	-2,970	-2,970	-2,970
-2.67%	-1,485	-1,485	-1,485	-1,485	-1,485	-1,485	-1,485
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	1,485	1,485	1,485	1,485	1,485	1,485	1,485
5.33%	2,970	2,970	2,970	2,970	2,970	2,970	2,970
8.00%	4,455	4,455	4,455	4,455	4,455	4,455	4,455

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

7,775

공시일	2026-10-27
기준일	2026-10-26

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	2026-10-27
기준일	2026-10-26

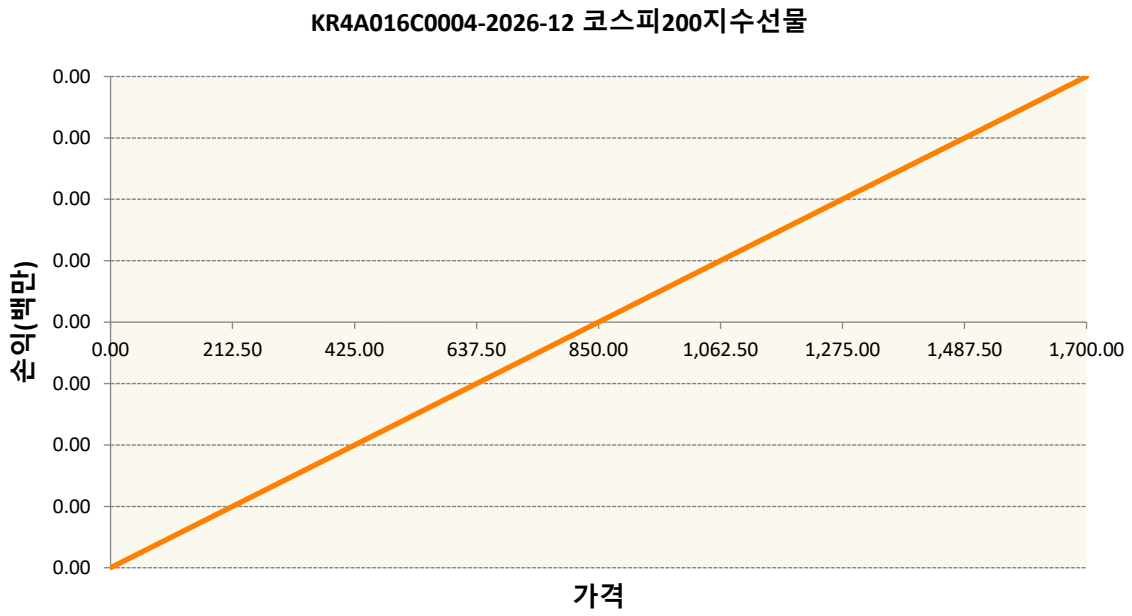
SOL 200타겟위클리커버드콜상장지수(주식)

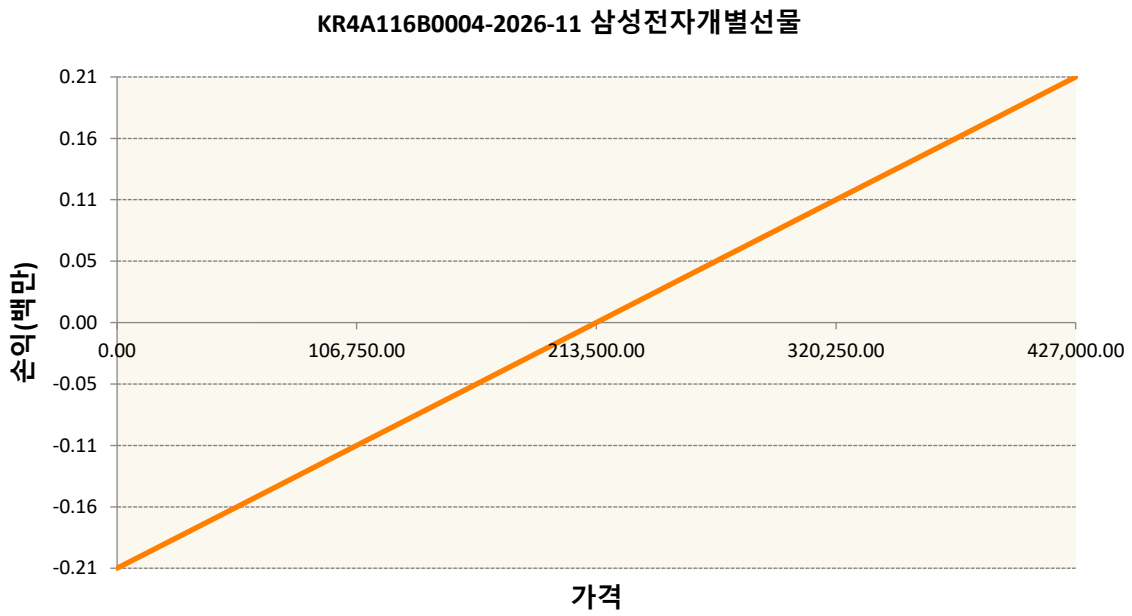
1. 계약금액

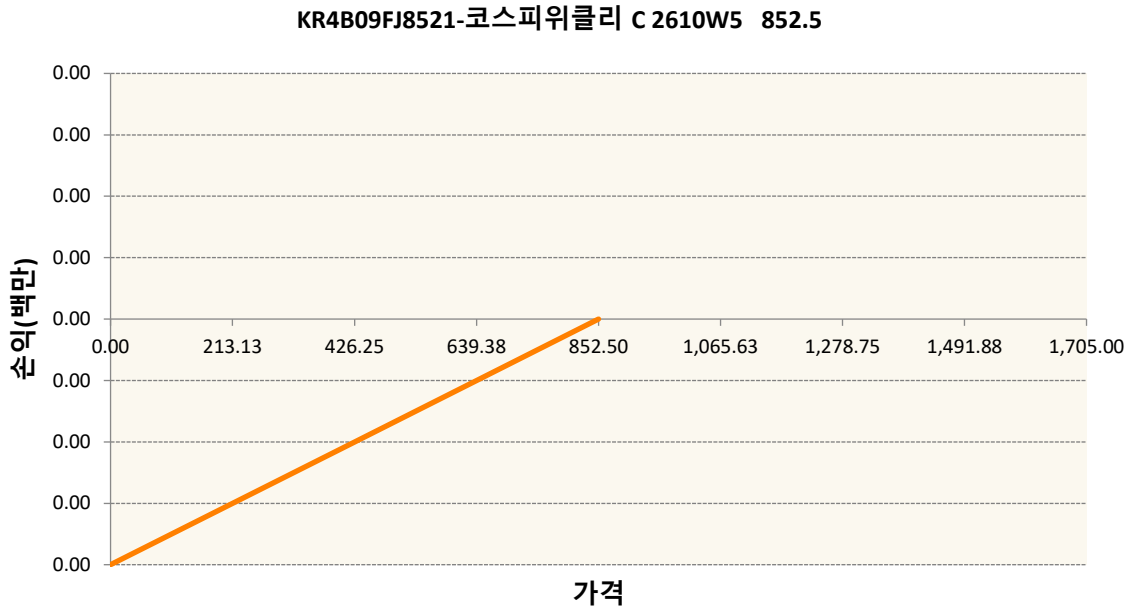
(단위:백만원)

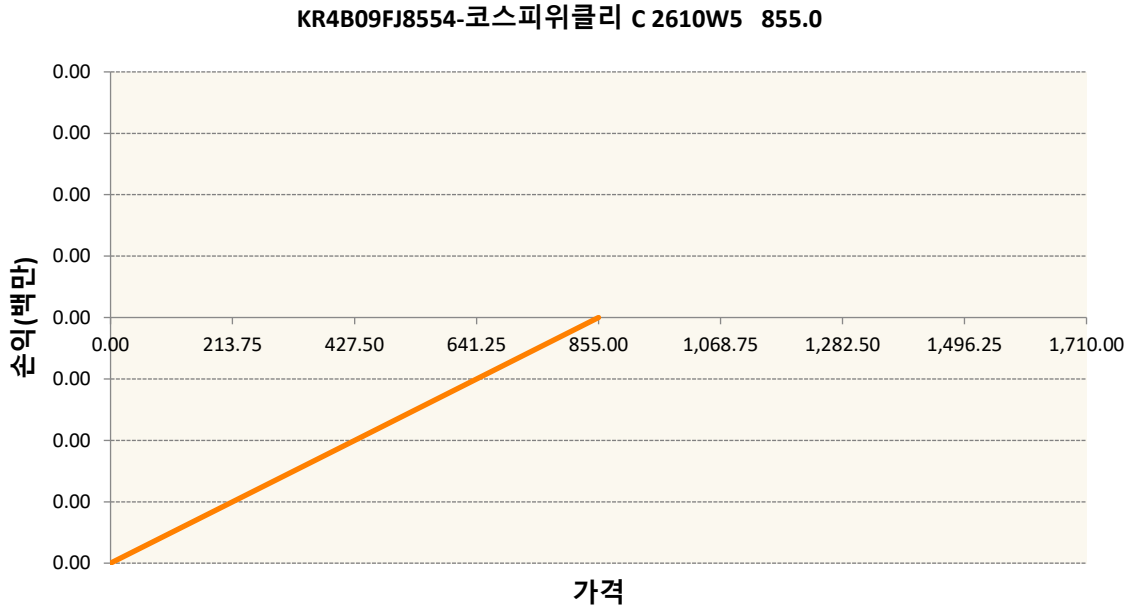
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	32,923	-32,923	장내
누계	유가증권	선물	17,054	0	17,054	장내
누계	유가증권	옵션	0	32,219	-32,219	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A016C0004	2026-12 코스피200지수선물						443
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-443	-443	-443	-443	-443	-443	-443
-5.33%	-295	-295	-295	-295	-295	-295	-295
-2.67%	-148	-148	-148	-148	-148	-148	-148
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	148	148	148	148	148	148	148
5.33%	295	295	295	295	295	295	295
8.00%	443	443	443	443	443	443	443
KR4A116B0004	2026-11 삼성전자개별선물						920
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-920	-920	-920	-920	-920	-920	-920
-5.33%	-613	-613	-613	-613	-613	-613	-613
-2.67%	-307	-307	-307	-307	-307	-307	-307
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	307	307	307	307	307	307	307
5.33%	613	613	613	613	613	613	613
8.00%	920	920	920	920	920	920	920
	KR4B09FJ8521		코스피위클리 C 2610W5	852.5			1,225
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,184	-1,187	-1,191	-1,197	-1,205	-1,214	-1,225
-5.33%	-684	-695	-708	-723	-740	-758	-778
-2.67%	-238	-262	-287	-313	-339	-367	-394
0%	94	63	31	0	-31	-63	-94
2.67%	283	257	230	203	175	146	117
5.33%	360	346	330	312	293	272	250
8.00%	382	377	370	361	351	338	324
	KR4B09FJ8554		코스피위클리 C 2610W5	855.0			822
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-798	-799	-802	-805	-810	-816	-822
-5.33%	-467	-473	-481	-490	-500	-512	-524
-2.67%	-167	-182	-197	-214	-231	-248	-266
0%	62	41	21	0	-21	-41	-62
2.67%	196	179	160	142	122	103	84
5.33%	253	244	232	220	206	192	176
8.00%	271	267	262	256	248	239	229

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

8,797

공시일	2026-10-27
기준일	2026-10-26

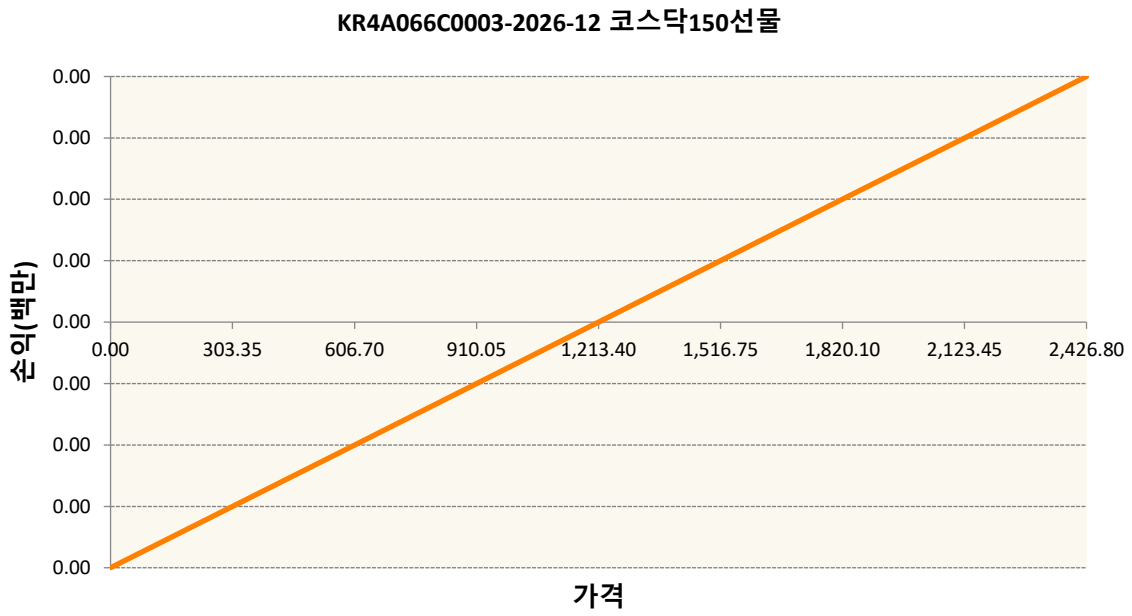
SOL코스닥150인덱스(주식-파생형)

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	485	0	485	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A066C0003 2026-12 코스닥150선물 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

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

127

공시일	2026-10-27
기준일	2026-10-26

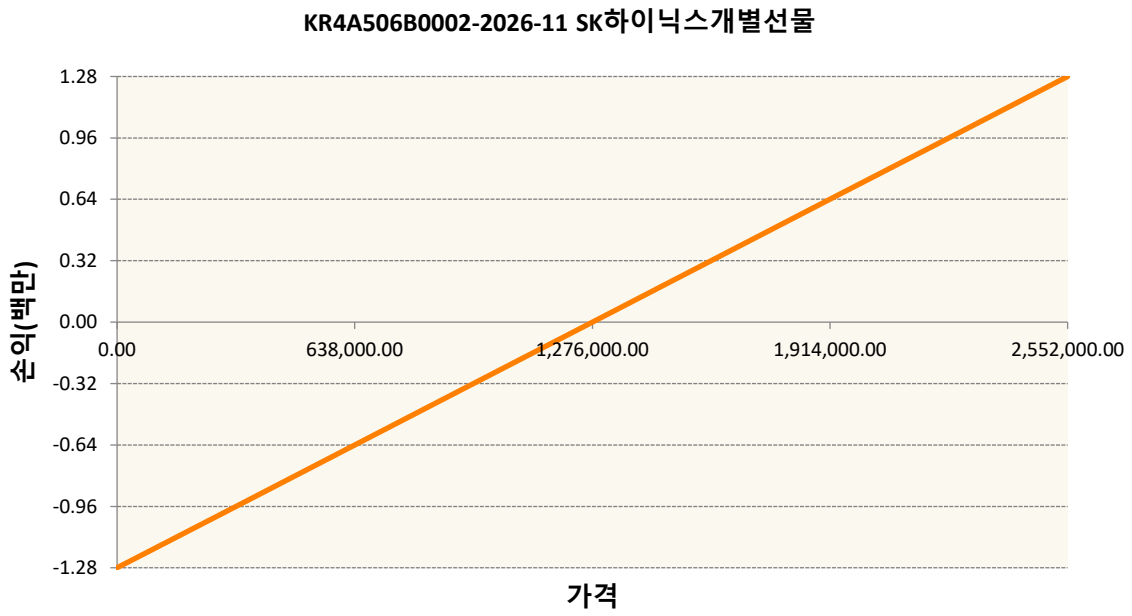
SOLSK하이닉스단일종목레버리지상장지수

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	255	-255	장내
누계	유가증권	선물	22,687	0	22,687	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A506B0002	2026-11 SK하이닉스개별선물	1,814

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,814	-1,814	-1,814	-1,814	-1,814	-1,814	-1,814
-5.33%	-1,209	-1,209	-1,209	-1,209	-1,209	-1,209	-1,209
-2.67%	-605	-605	-605	-605	-605	-605	-605
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	605	605	605	605	605	605	605
5.33%	1,209	1,209	1,209	1,209	1,209	1,209	1,209
8.00%	1,814	1,814	1,814	1,814	1,814	1,814	1,814

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

8,792

공시일	2026-10-27
기준일	2026-10-26

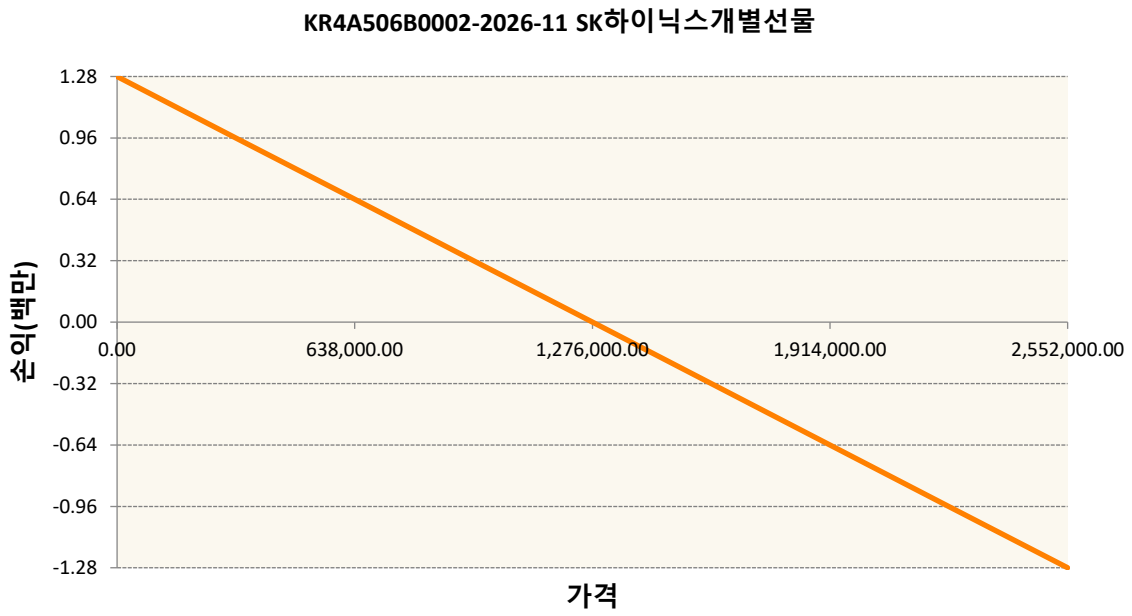
SOLSK하이닉스선물단일종목인버스2X상장지

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	2,816	5,457	-2,641	장내
누계	유가증권	선물	0	224,015	-224,015	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A506B0002	2026-11 SK하이닉스개별선물						17,907
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	17,907	17,907	17,907	17,907	17,907	17,907	17,907
-5.33%	11,938	11,938	11,938	11,938	11,938	11,938	11,938
-2.67%	5,969	5,969	5,969	5,969	5,969	5,969	5,969
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-5,969	-5,969	-5,969	-5,969	-5,969	-5,969	-5,969
5.33%	-11,938	-11,938	-11,938	-11,938	-11,938	-11,938	-11,938
8.00%	-17,907	-17,907	-17,907	-17,907	-17,907	-17,907	-17,907

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

86,809

공시일	2026-10-27
기준일	2026-10-26

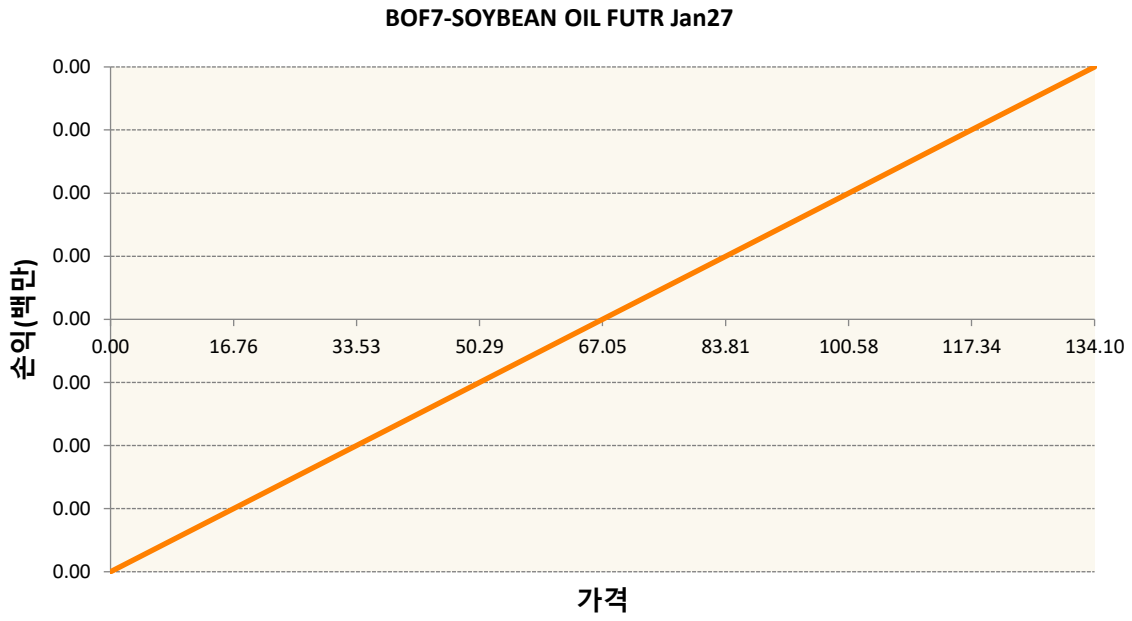
포커스농산물모(채권-파생형)

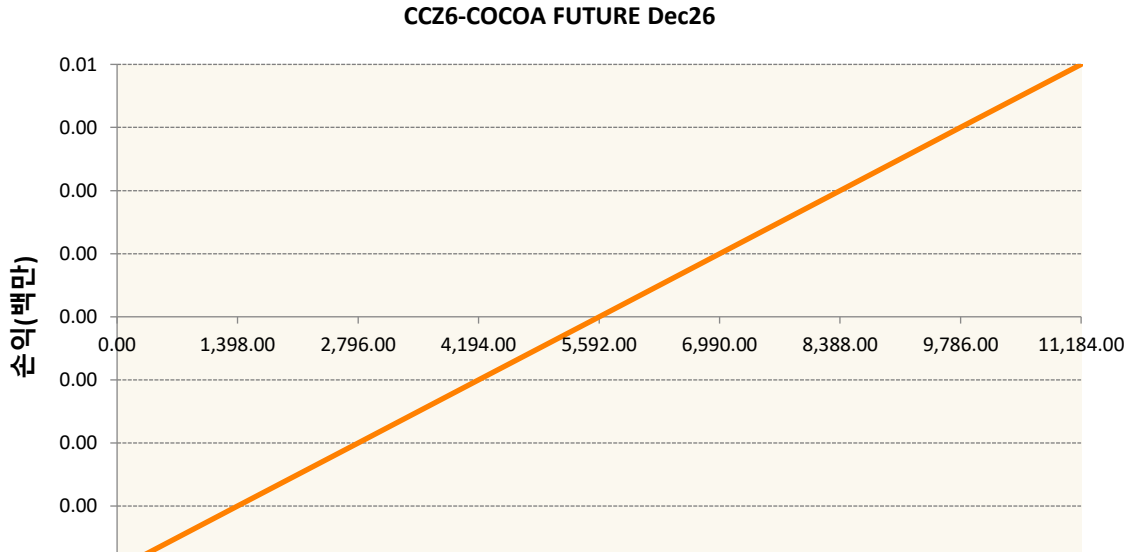
1. 계약금액

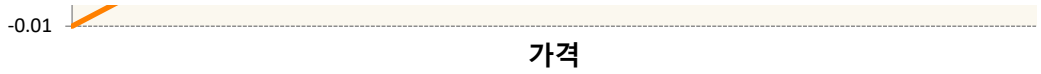
(단위:USD 백만)

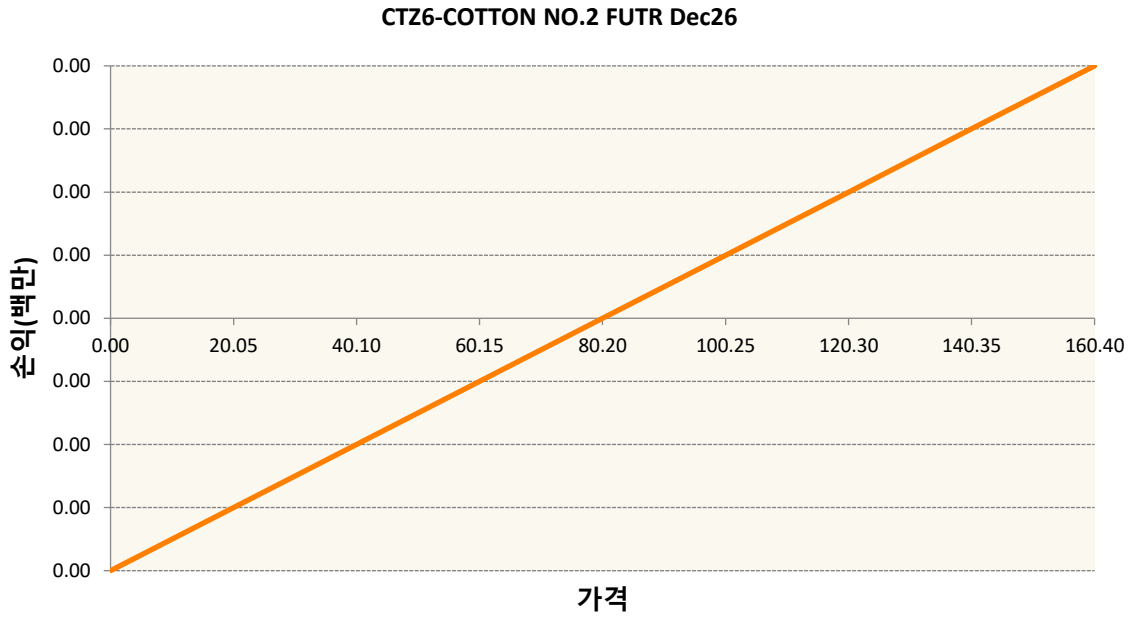
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	실물자산	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	실물자산	선물	350	0	350	
누계	유가증권	선물	2,213	0	2,213	
누계	통화	선물	0	344	-344	장내

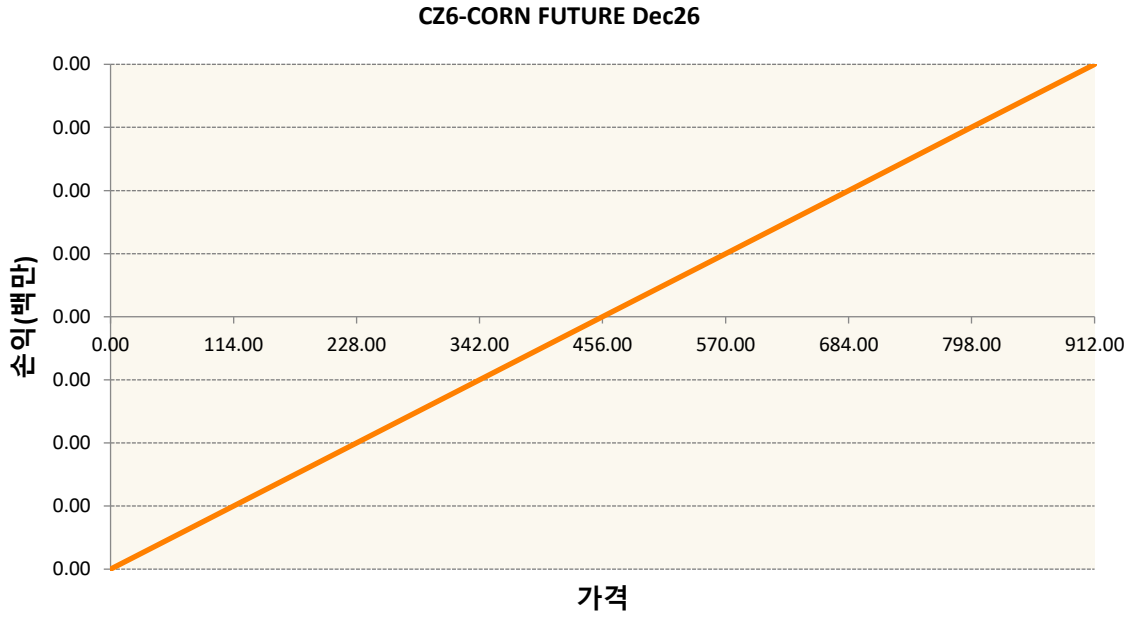
2. 만기시점의 손익구조

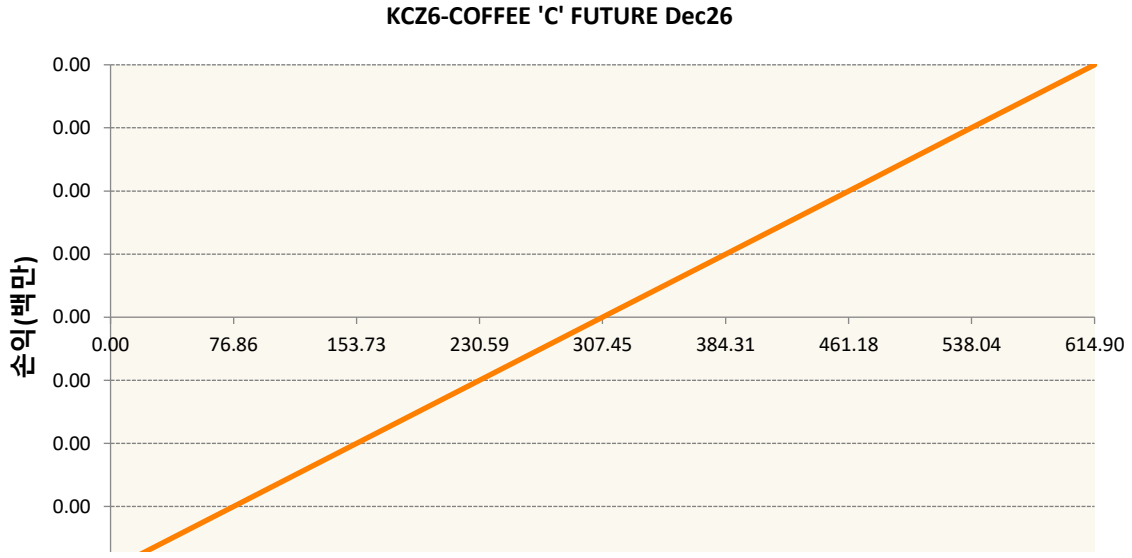


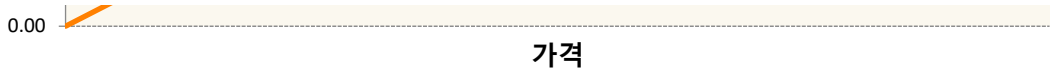



-0.01
가격

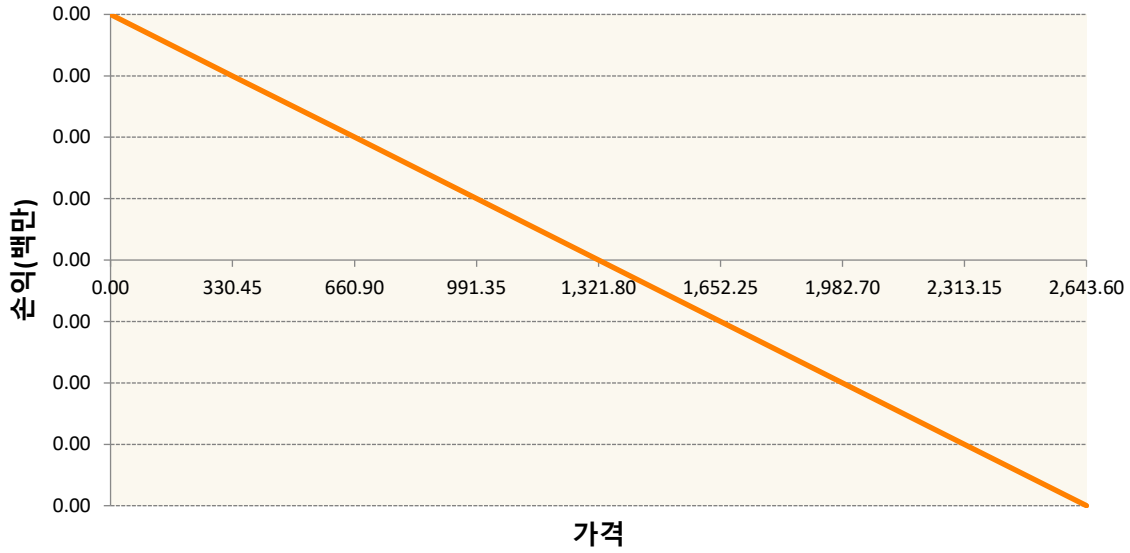

CTZ6-COTTON NO.2 FUTR Dec26
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
20.05
40.10
60.15
80.20
100.25
120.30
140.35
160.40
손익(백만)
가격


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
114.00
228.00
342.00
456.00
570.00
684.00
798.00
912.00
손익(백만)
가격

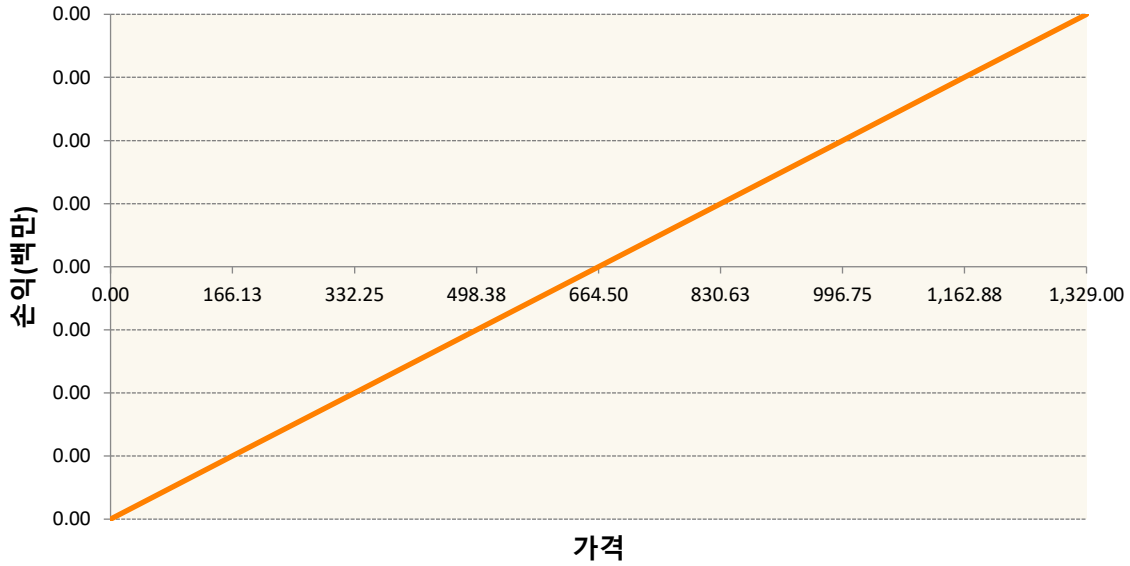

KCZ6-COFFEE 'C' FUTURE Dec26
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
76.86
153.73
230.59
307.45
384.31
461.18
538.04
614.90
손익(백만)



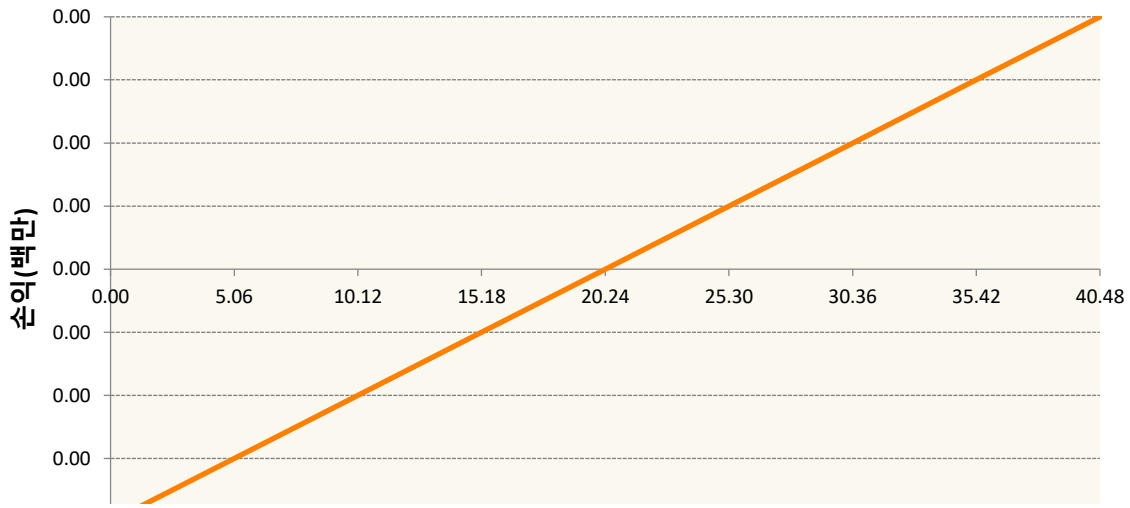
KR4A756B0009-2026-11 달러선물

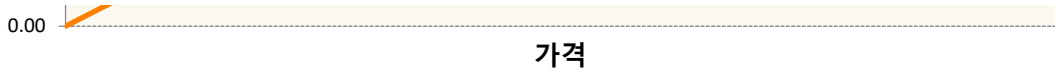


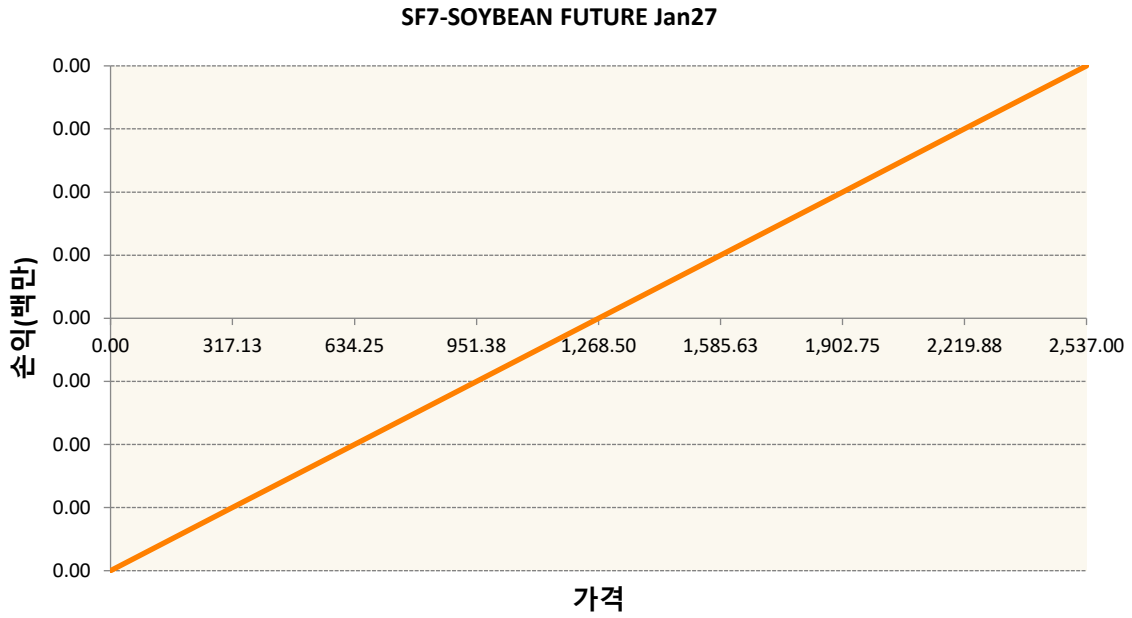
KWZ6-KC HRW WHEAT FUT Dec26

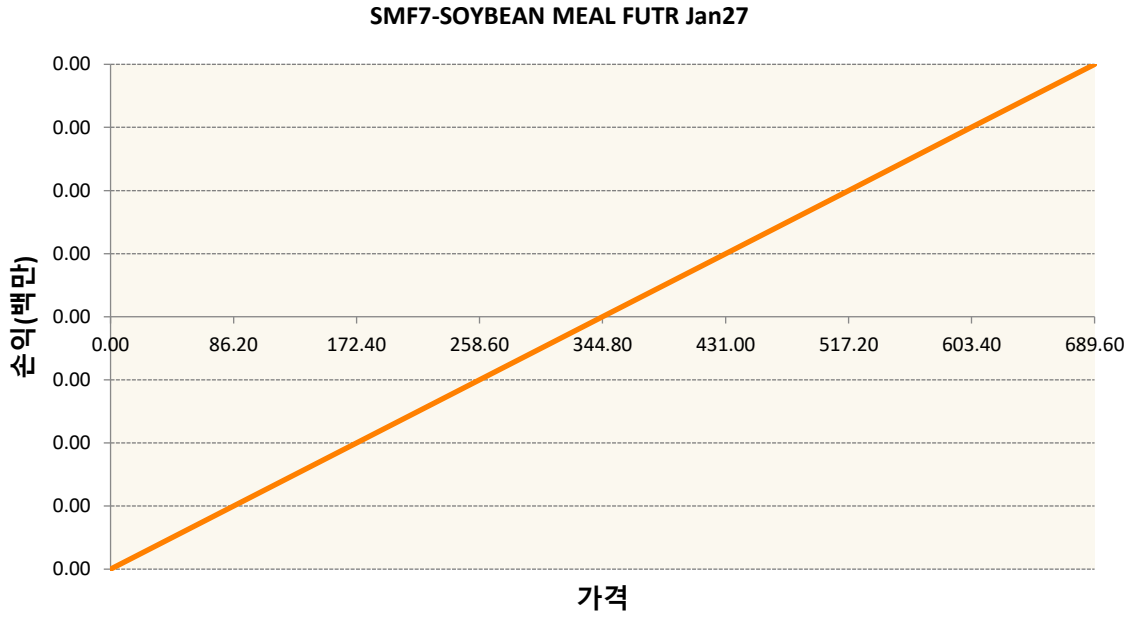


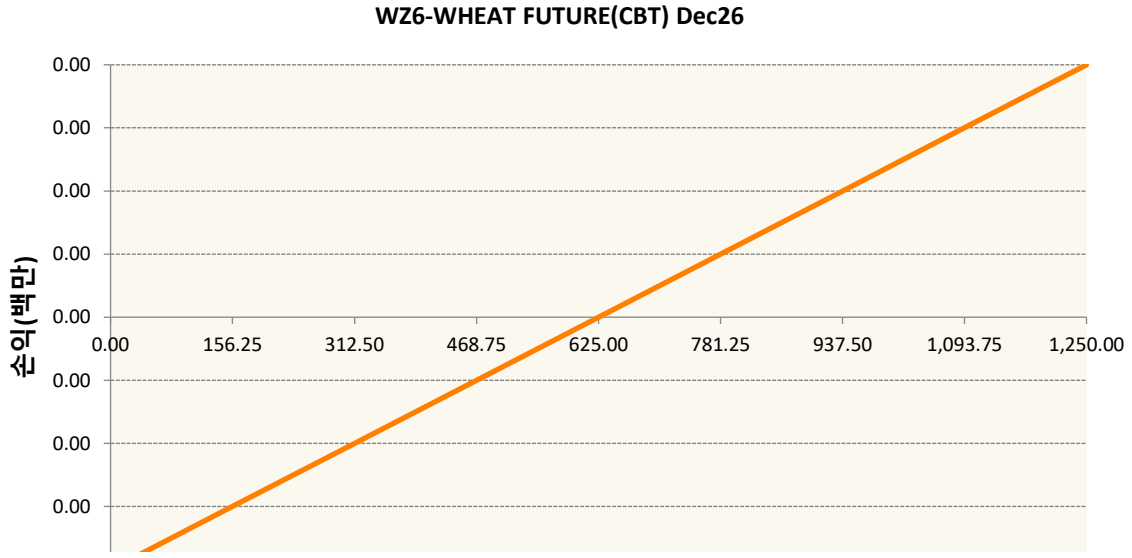
SBH7-SUGAR #11 (WORLD) MAR27




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
317.13
634.25
951.38
1,268.50
1,585.63
1,902.75
2,219.88
2,537.00
손익(백만)
가격


SMF7-SOYBEAN MEAL FUTR Jan27
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
86.20
172.40
258.60
344.80
431.00
517.20
603.40
689.60
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
156.25
312.50
468.75
625.00
781.25
937.50
1,093.75
1,250.00
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	2026-10-27
기준일	2026-10-26

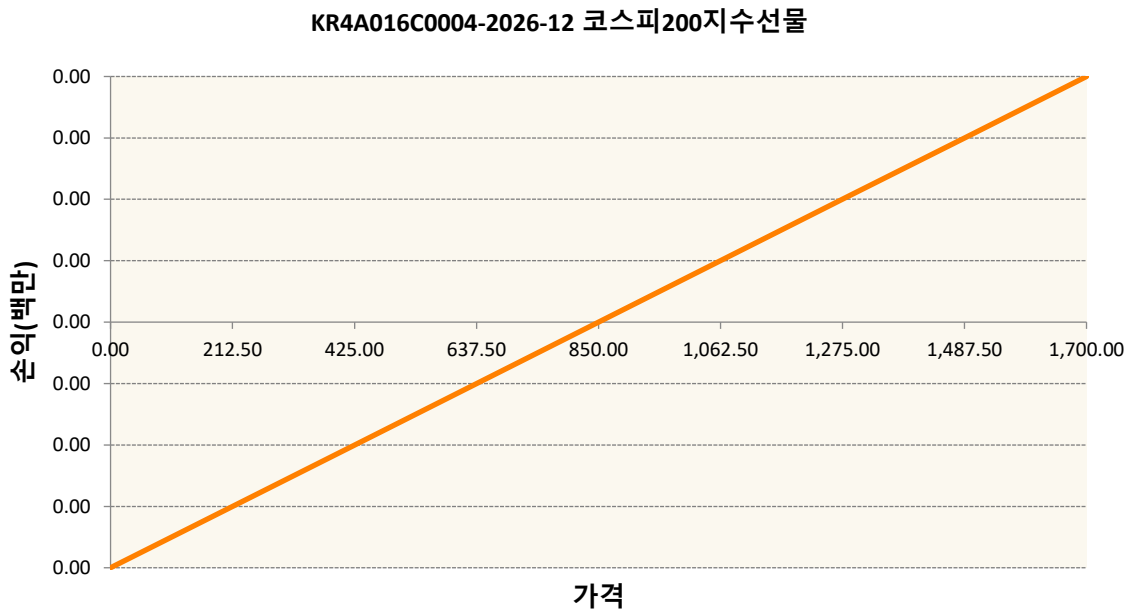
스마트인덱스모

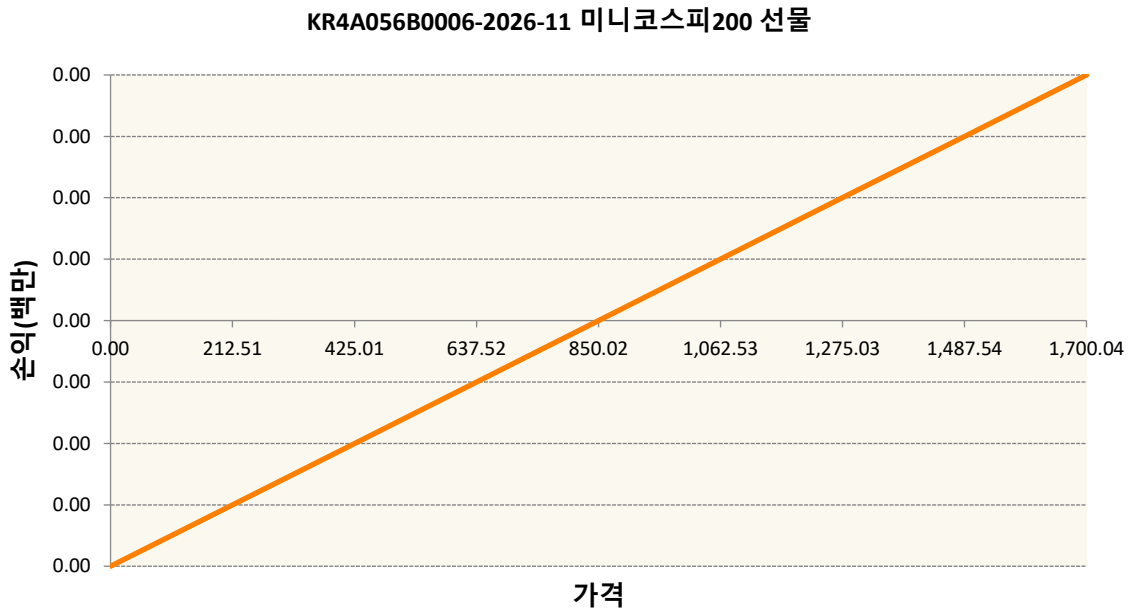
1. 계약금액

(단위:백만원)

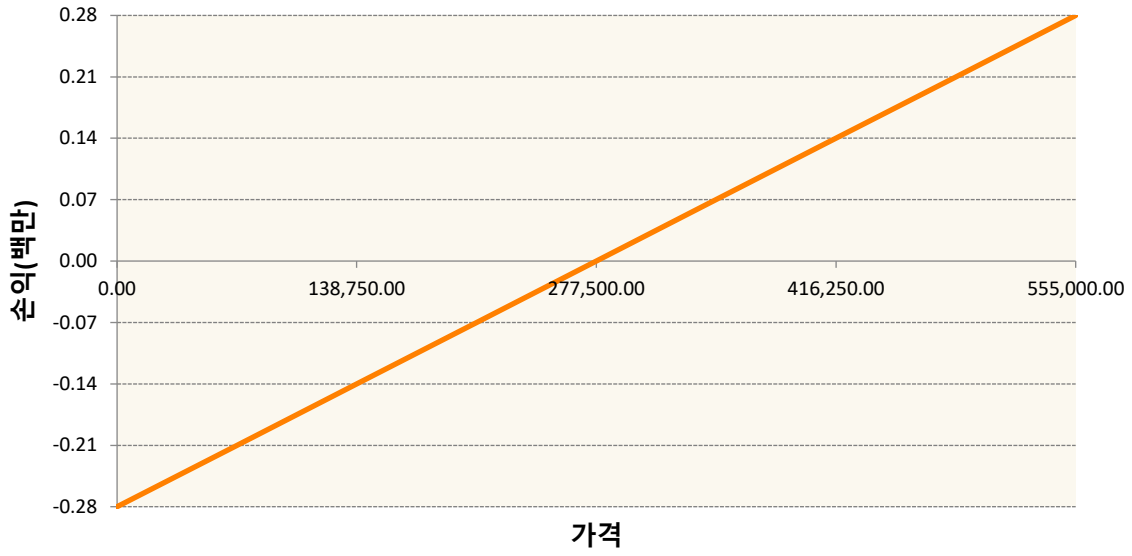
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	214	0	214	장내
누계	유가증권	선물	7,358	73	7,285	장내

2. 만기시점의 손익구조

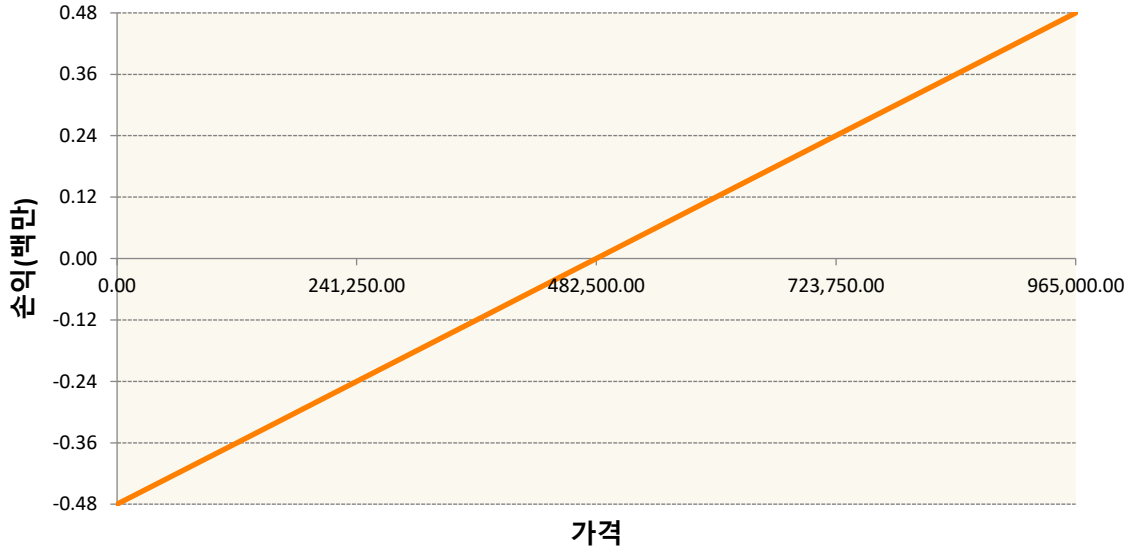




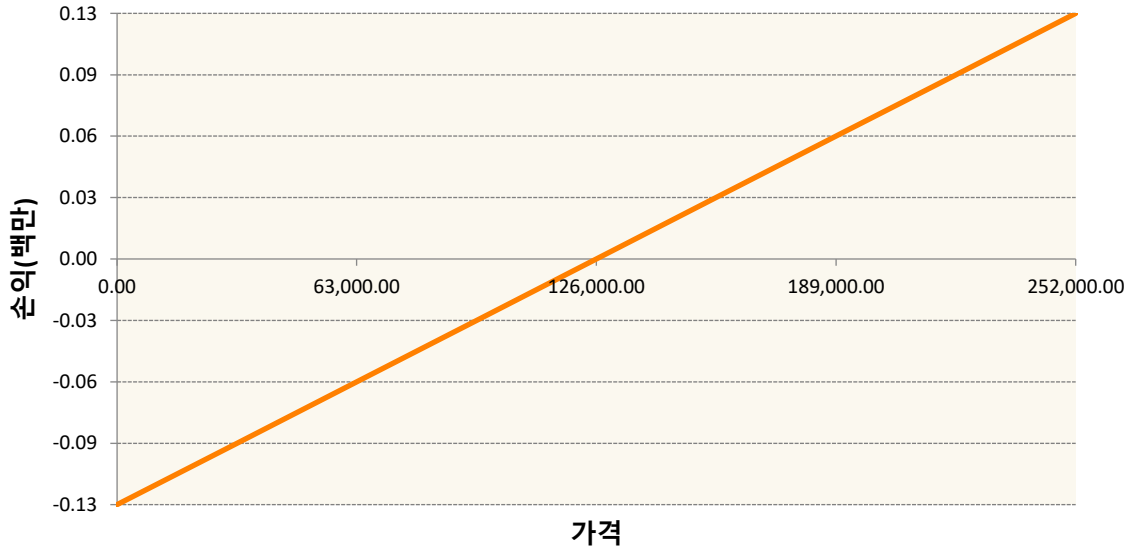
KR4A1Q6B0009-2026-11 에이피알개별선물

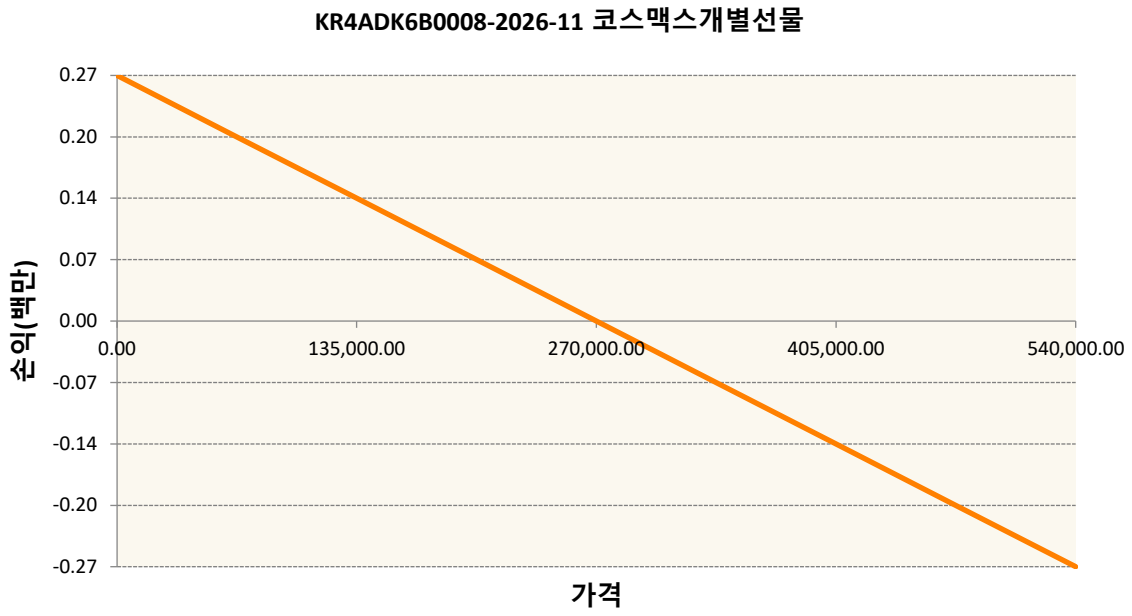


KR4A226B0001-2026-11 삼성SDI개별선물



KR4AB26B0009-2026-11 S-Oil개별선물





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A016C0004	2026-12 코스피200지수선물						460
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-460	-460	-460	-460	-460	-460	-460
-5.33%	-307	-307	-307	-307	-307	-307	-307
-2.67%	-153	-153	-153	-153	-153	-153	-153
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	153	153	153	153	153	153	153
5.33%	307	307	307	307	307	307	307
8.00%	460	460	460	460	460	460	460

KR4A056B0006	2026-11 미니코스피200 선물						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%	-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%	20	20	20	20	20	20	20

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				10
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-10	-10	-10	-10	-10	-10	-10
-5.33%	-7	-7	-7	-7	-7	-7	-7
-2.67%	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-3
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	3	3	3	3	3	3	3
5.33%	7	7	7	7	7	7	7
8.00%	10	10	10	10	10	10	10
	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)

1,706

공시일	2026-10-27
기준일	2026-10-26

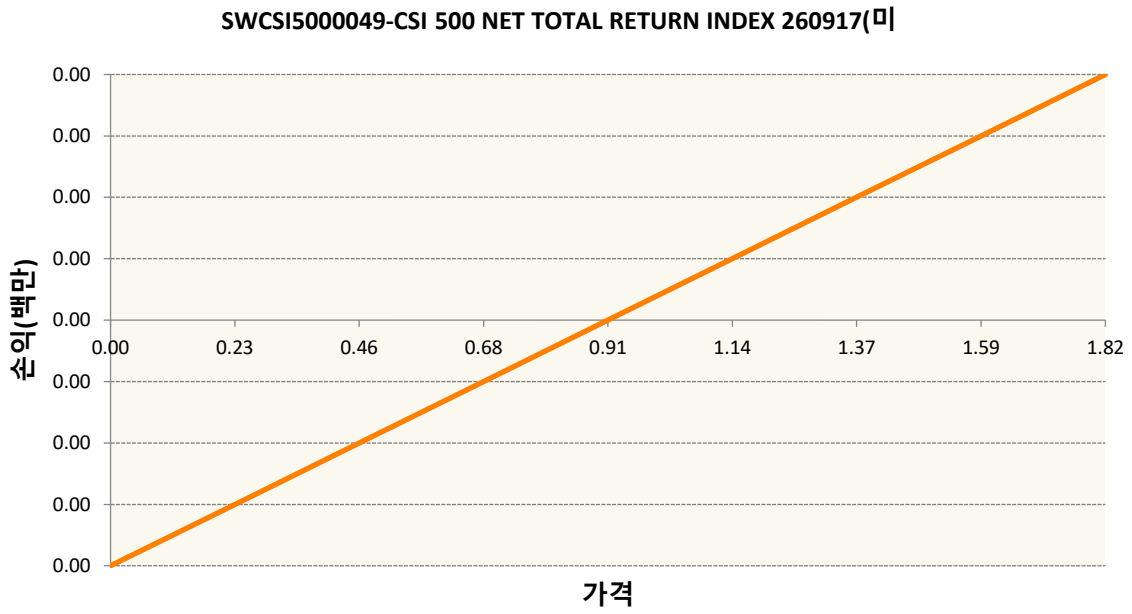
SOL차이나강소기업CSI500상장

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	388

* 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	2026-10-27
기준일	2026-10-26

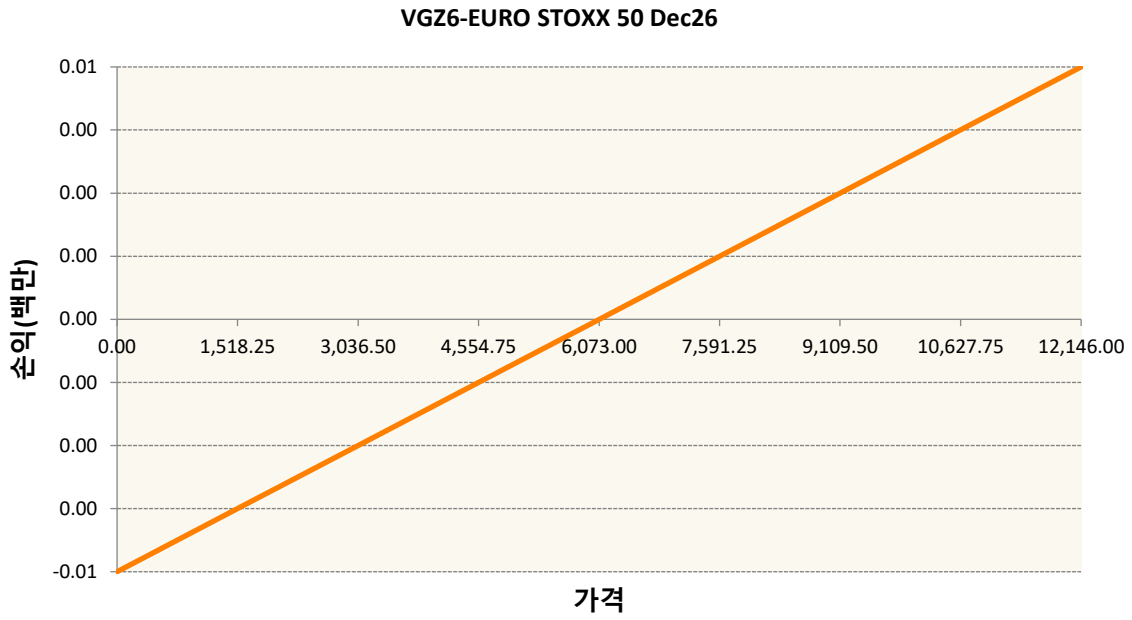
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,154	0	1,154	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGZ6	EURO STOXX 50 Dec26	92

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

(단위:백만원)

68

공시일	2026-10-27
기준일	2026-10-26

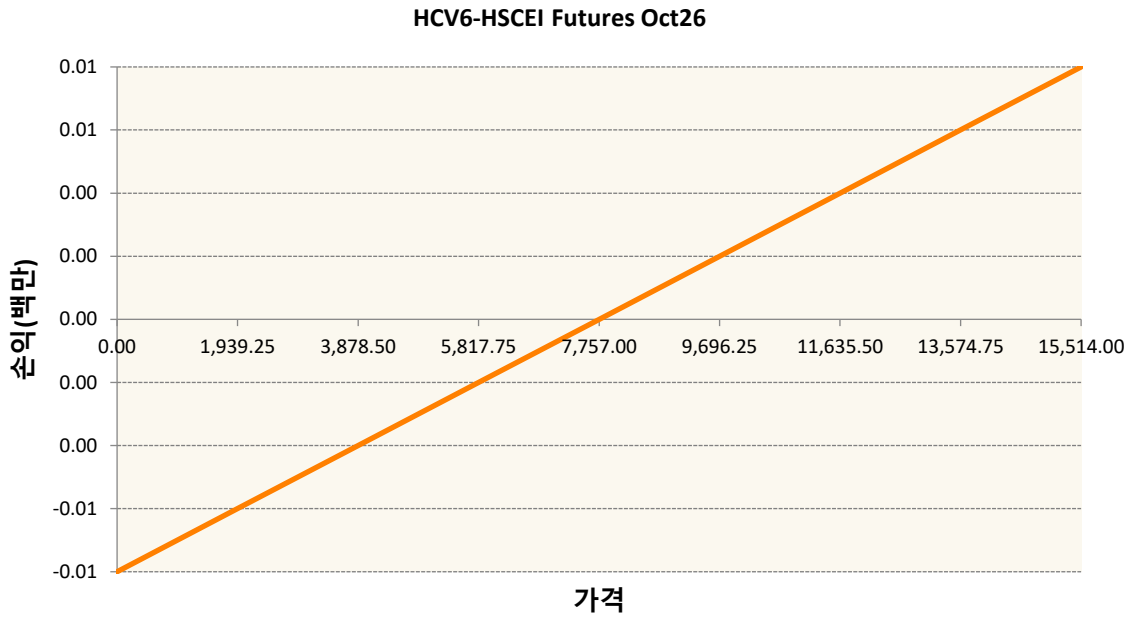
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,352	0	1,352	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCV6	HSCEI Futures Oct26	108

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

(단위:백만원)

102

공시일	2026-10-27
기준일	2026-10-26

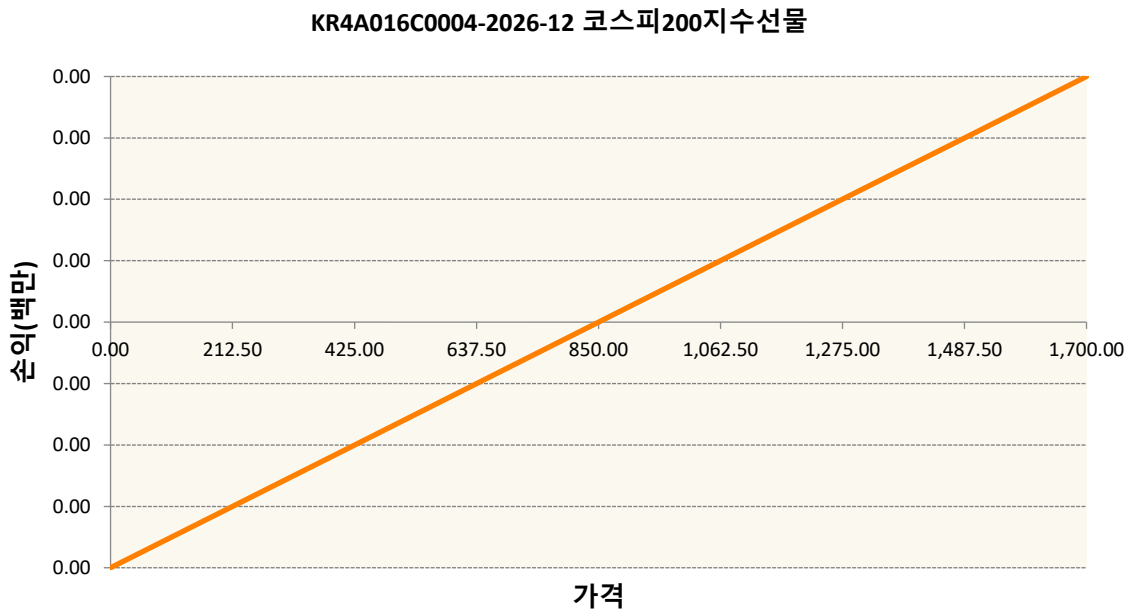
커버드콜모(주식혼합-파생형)

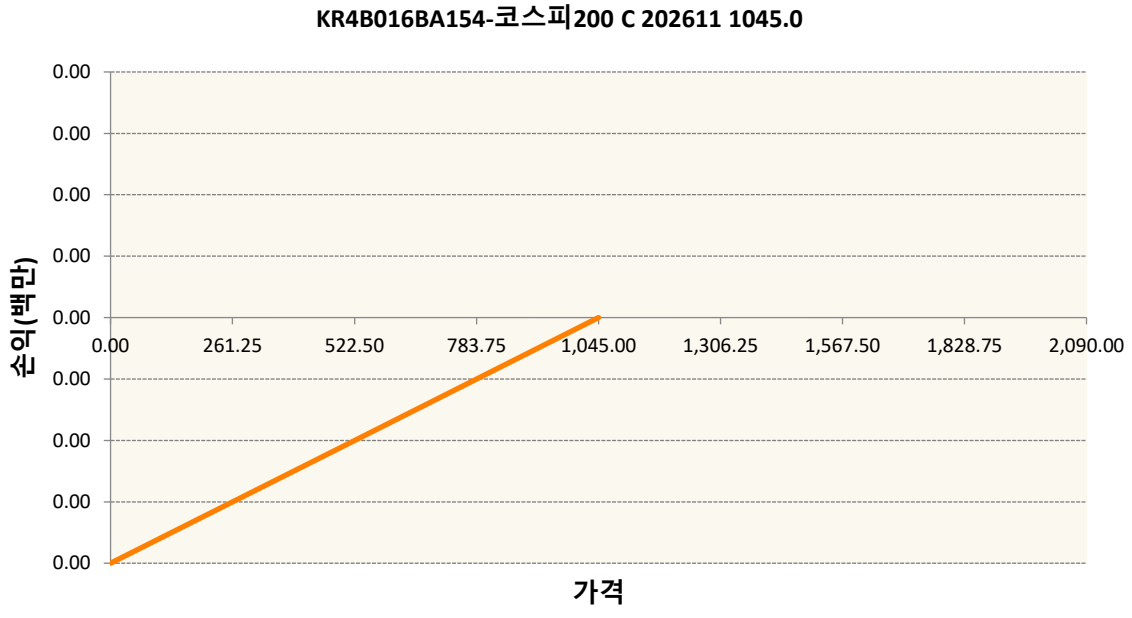
1. 계약금액

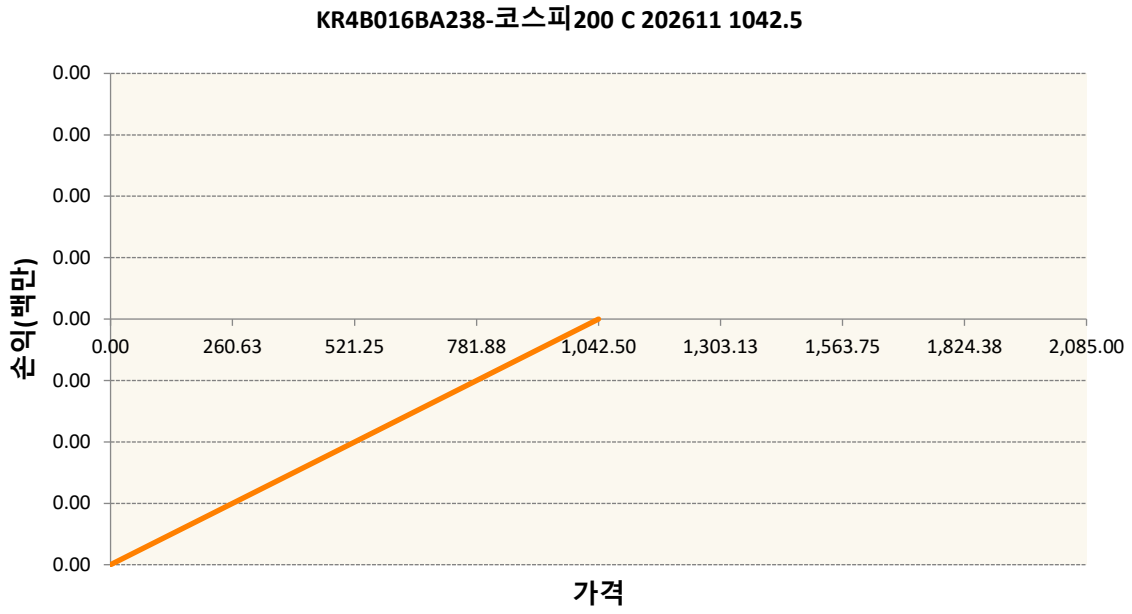
(단위:백만원)

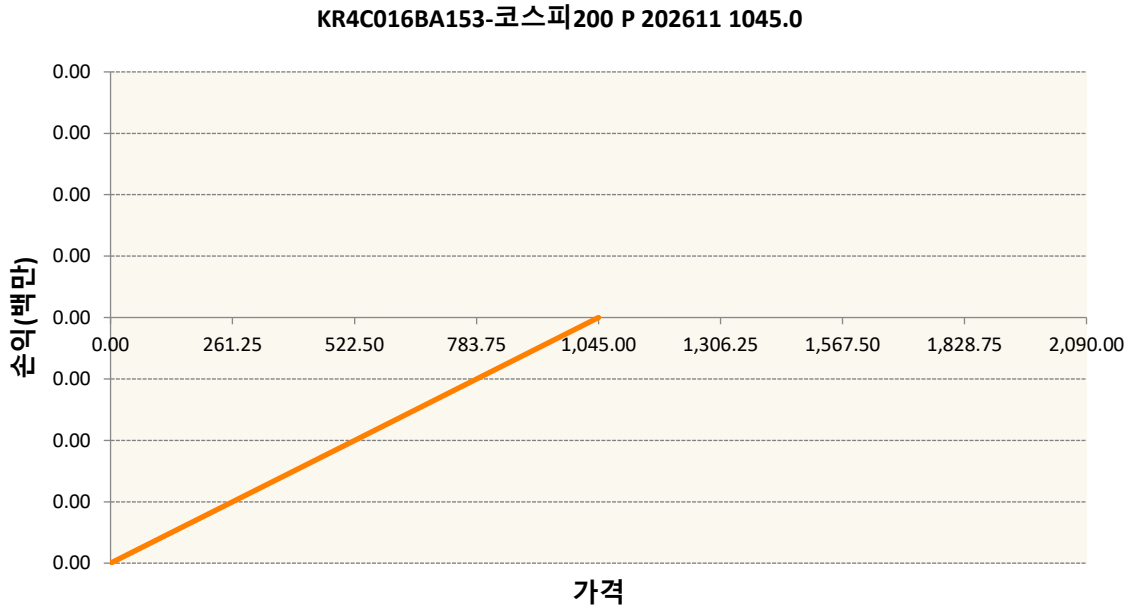
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	425	0	425	장내
누계	유가증권	옵션	0	49,876	-49,876	장내

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						1,958
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,924	-1,925	-1,927	-1,930	-1,936	-1,945	-1,958
-5.33%	-1,266	-1,268	-1,272	-1,279	-1,290	-1,304	-1,323
-2.67%	-610	-615	-623	-635	-652	-674	-701
0%	43	34	20	0	-26	-57	-94
2.67%	691	674	650	620	584	541	493
5.33%	1,327	1,299	1,264	1,221	1,171	1,116	1,056
8.00%	1,945	1,903	1,852	1,795	1,732	1,663	1,590
	KR4B016BA238		코스피200 C 202611 1042.5				624
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-613	-613	-614	-615	-617	-620	-624
-5.33%	-403	-404	-405	-408	-411	-416	-422
-2.67%	-194	-195	-198	-202	-208	-215	-224
0%	14	11	7	0	-8	-19	-31
2.67%	221	215	207	197	185	172	156
5.33%	423	414	402	388	372	354	335
8.00%	620	606	589	570	550	528	504
	KR4C016BA153		코스피200 P 202611 1045.0				641
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-630	-630	-631	-632	-634	-637	-641
-5.33%	-415	-416	-417	-419	-423	-427	-433
-2.67%	-200	-201	-204	-208	-214	-221	-230
0%	14	11	6	0	-8	-19	-31
2.67%	226	221	213	203	191	177	162
5.33%	435	426	414	400	384	366	346
8.00%	637	623	607	588	567	545	521

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

6,423

공시일	2026-10-27
기준일	2026-10-26

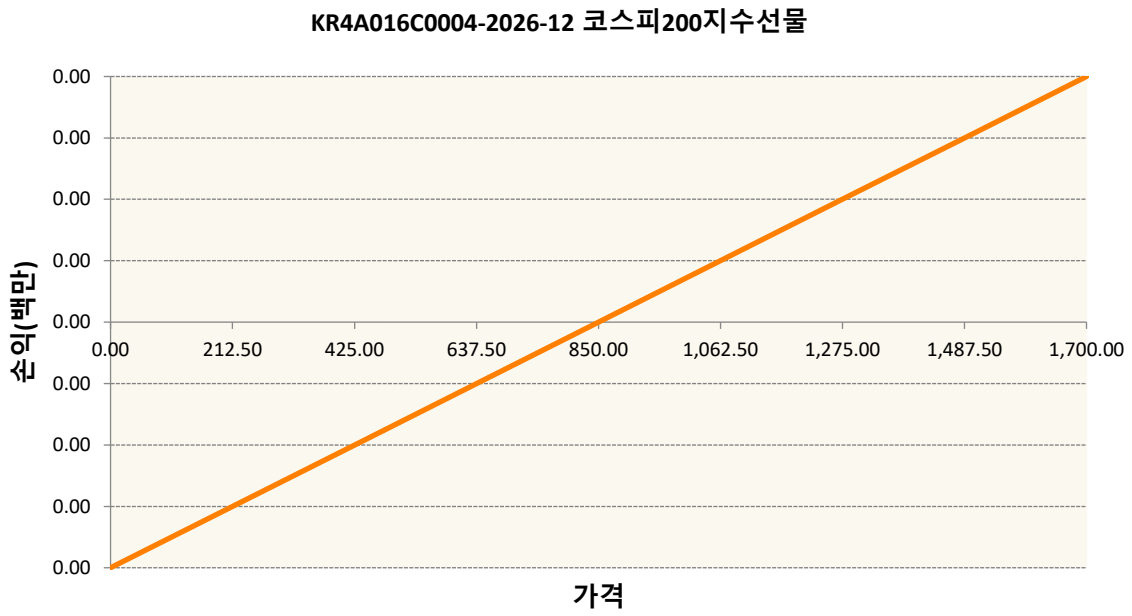
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

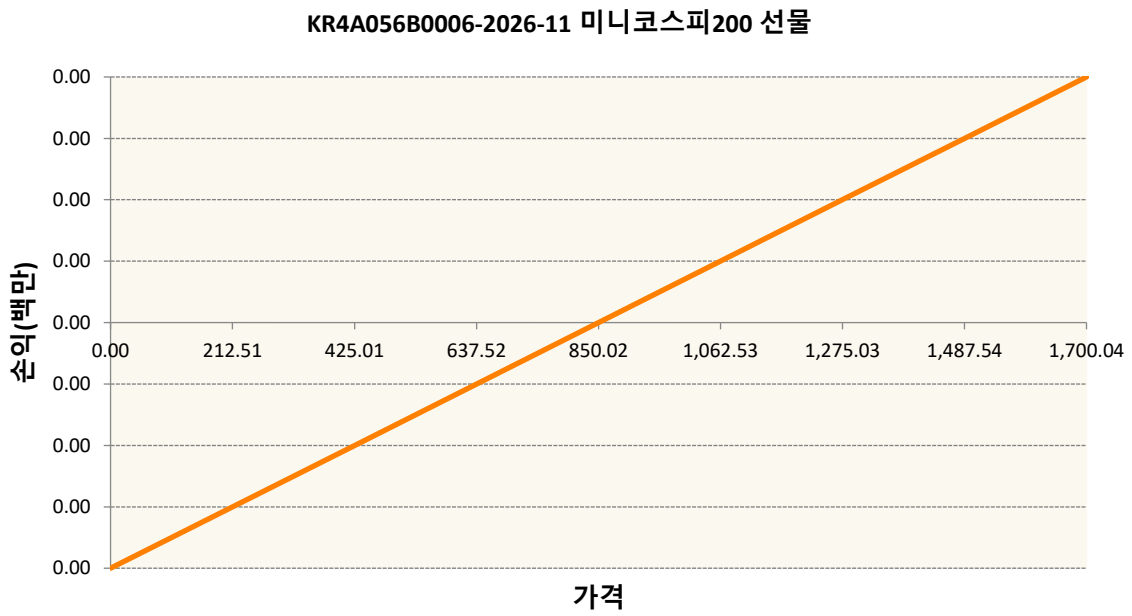
1. 계약금액

(단위:백만원)

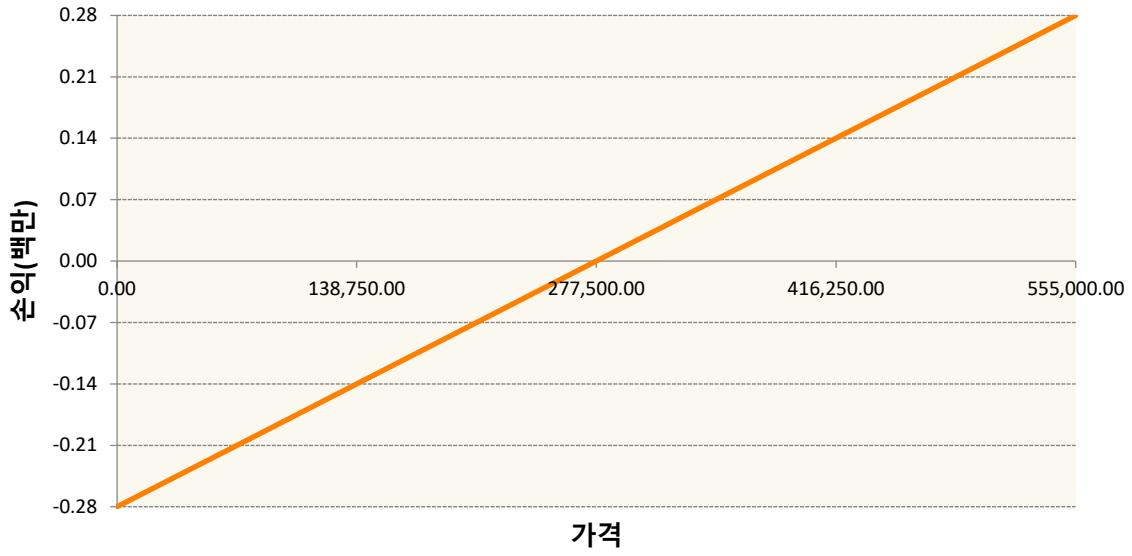
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,789	16	1,773	장내

2. 만기시점의 손익구조

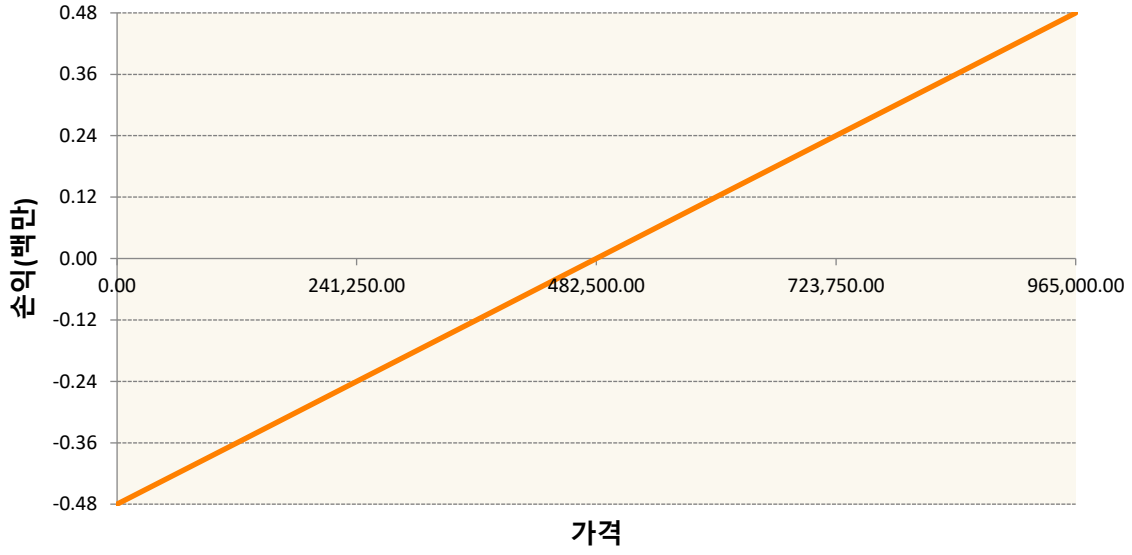




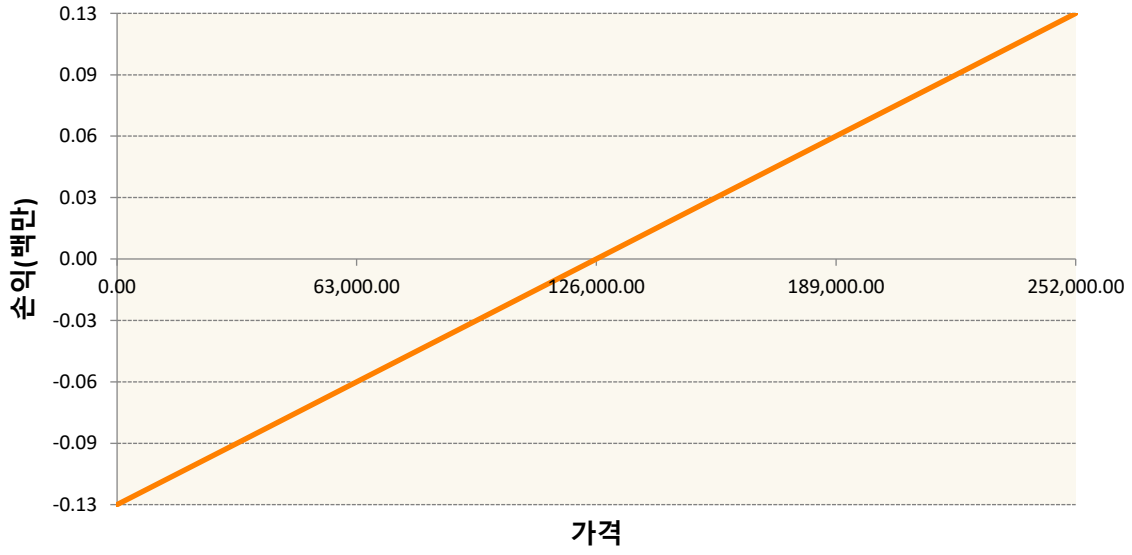
KR4A1Q6B0009-2026-11 에이피알개별선물

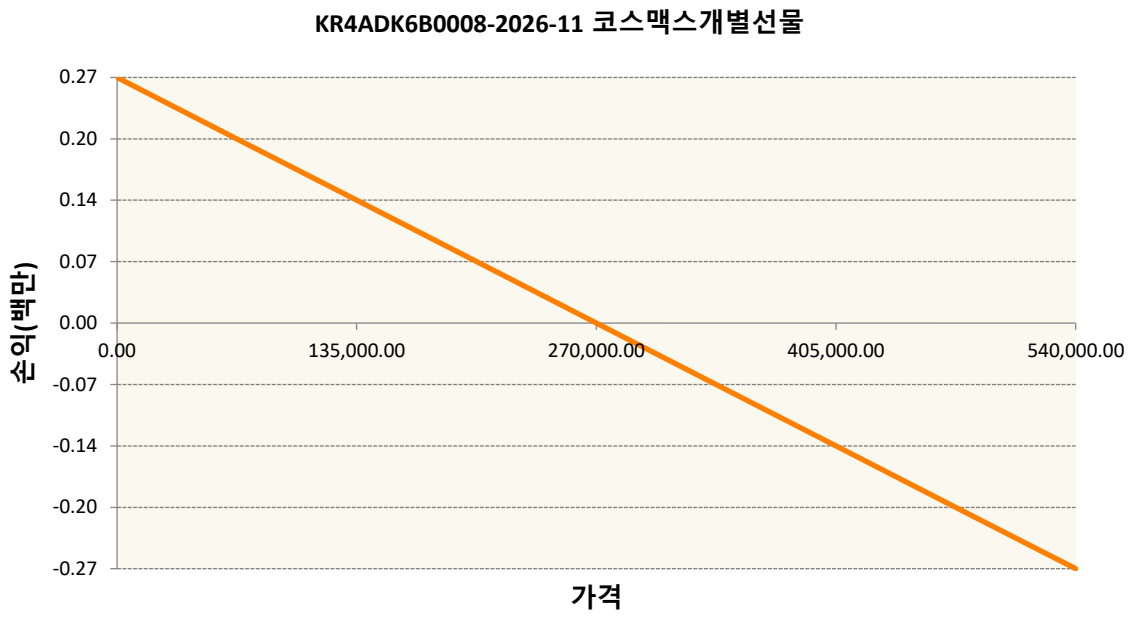


KR4A226B0001-2026-11 삼성SDI개별선물



KR4AB26B0009-2026-11 S-Oil개별선물





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A016C0004	2026-12 코스피200지수선물						51
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-51	-51	-51	-51	-51	-51	-51
-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%	51	51	51	51	51	51	51

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%	-11	-11	-11	-11	-11	-11	-11
-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%	11	11	11	11	11	11	11
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)

244

공시일	2026-10-27
기준일	2026-10-26

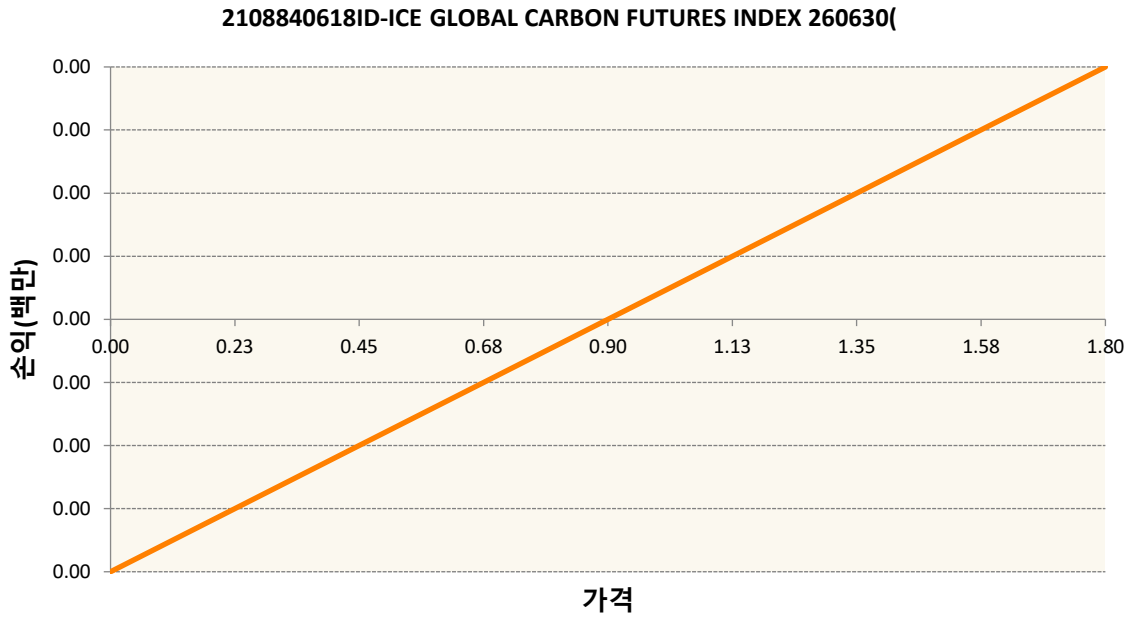
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

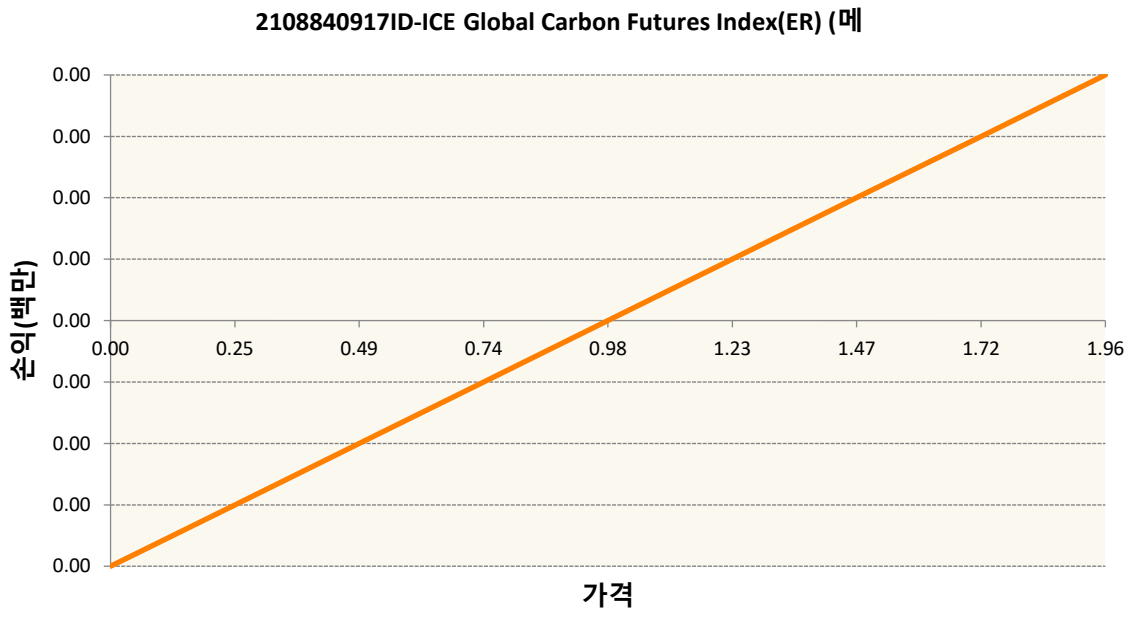
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	6,865	0	6,865	장외

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2108840618ㅣICE GLOBAL CARBON FUTURES INDEX 260630(	439
2108840917ㅣICE Global Carbon Futures Index(ER) (메	111

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

567

공시일	2026-10-27
기준일	2026-10-26

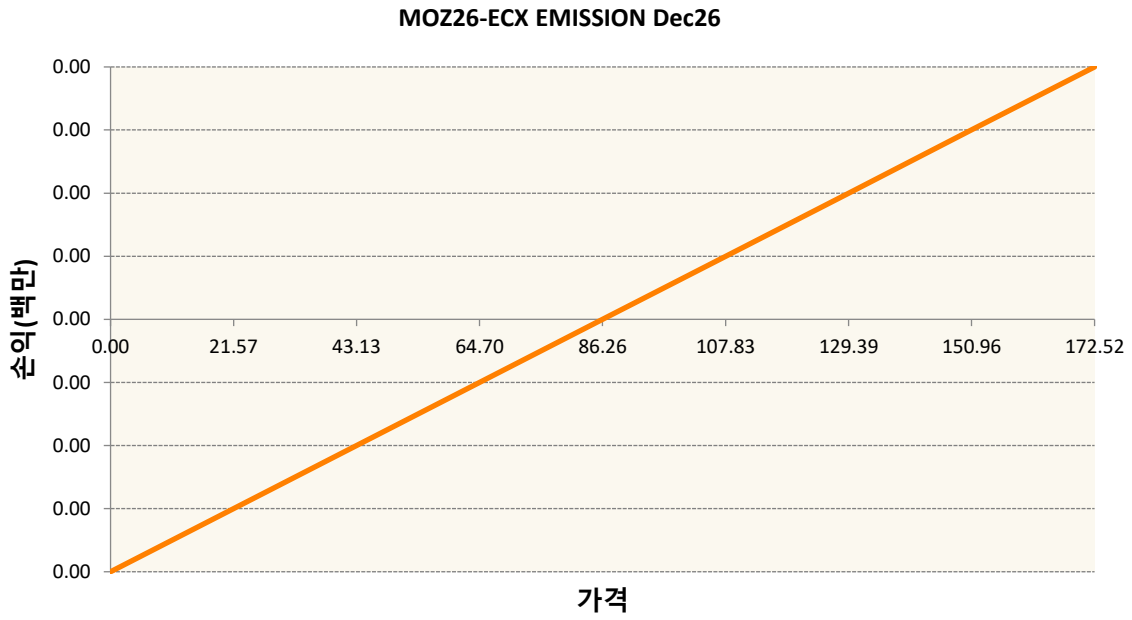
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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			6,089	0	6,089	
누계	통화	선도	0	2,464	-2,464	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213G9V	KRW/EUR 30-10-26E	197
MOZ26	ECX EMISSION Dec26	487

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

(단위:백만원)

717

공시일	2026-10-27
기준일	2026-10-26

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(	16
SWSOL0000(CSI PHOTOVOLTAIC INDUSTRY INDEX 260923(	26

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

(단위:백만원)

96

공시일	2026-10-27
기준일	2026-10-26

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	-5,649	0	-5,649	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 251218(NH)	43
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 260714(미래)	316
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 260917(메리츠)	90

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

(단위:백만원)

850

공시일	2026-10-27
기준일	2026-10-26

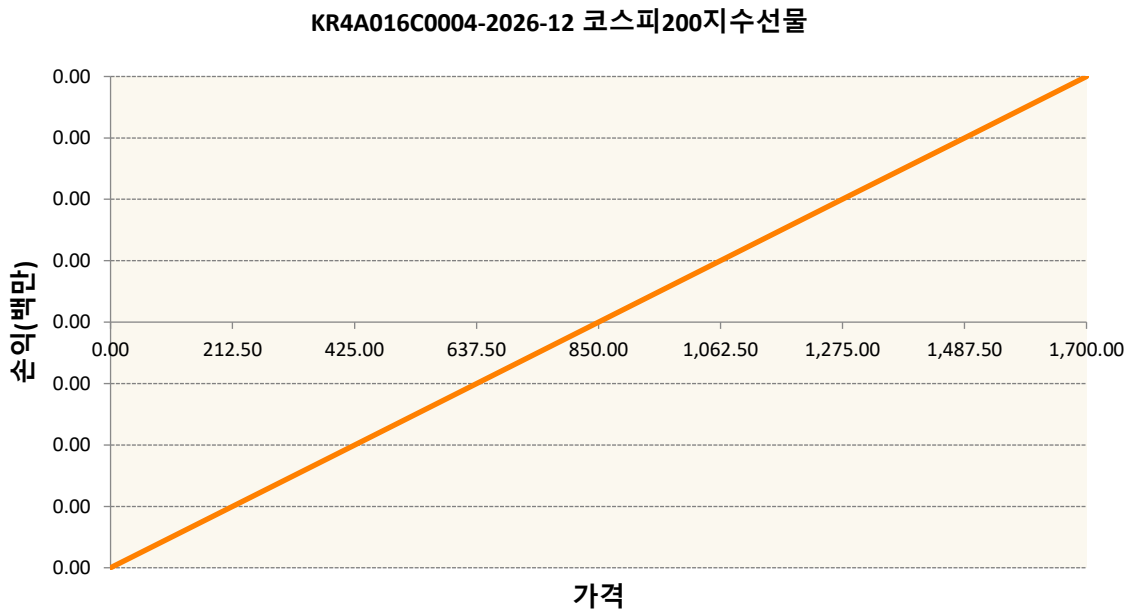
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

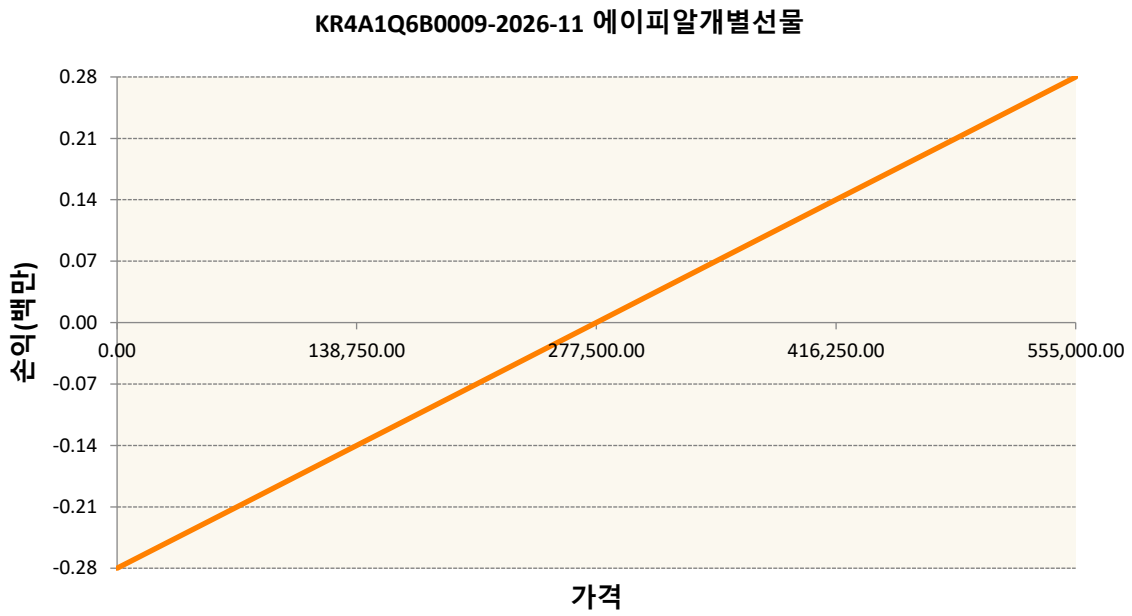
1. 계약금액

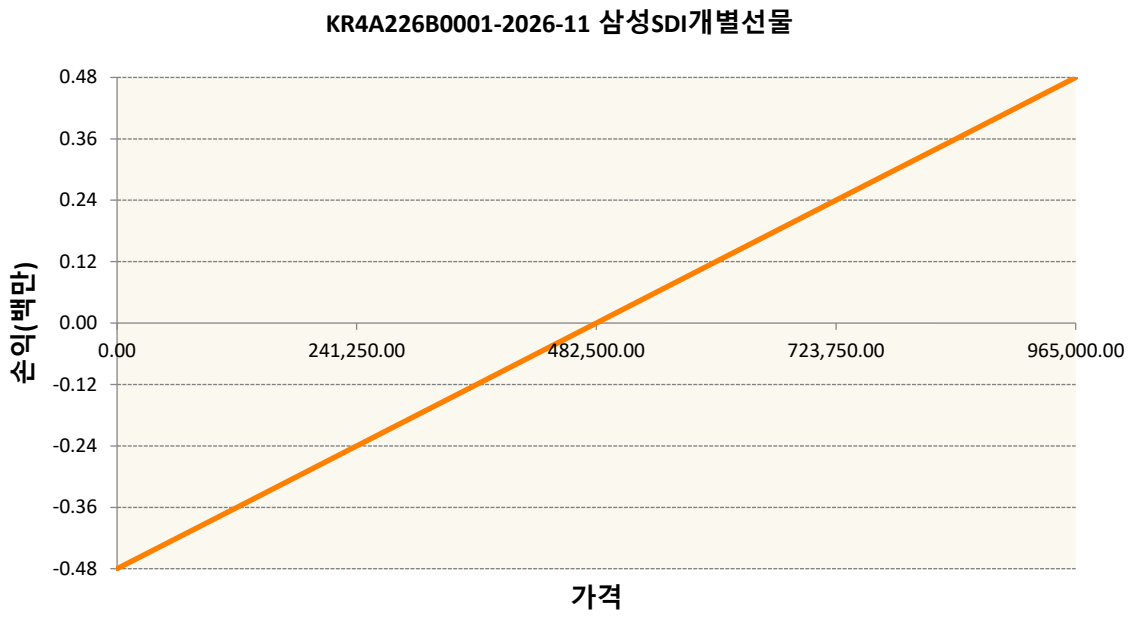
(단위:백만원)

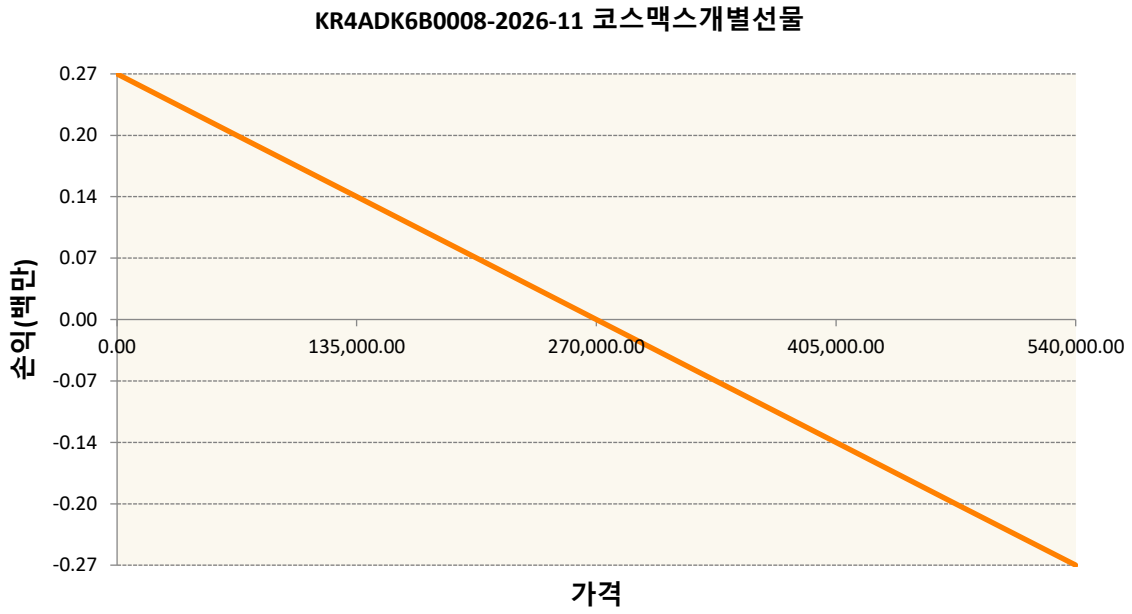
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	7,084	-7,084	장내
누계	유가증권	선물	9,004	270	8,734	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A016C0004	2026-12 코스피200지수선물						664
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-664	-664	-664	-664	-664	-664	-664
-5.33%	-443	-443	-443	-443	-443	-443	-443
-2.67%	-221	-221	-221	-221	-221	-221	-221
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	221	221	221	221	221	221	221
5.33%	443	443	443	443	443	443	443
8.00%	664	664	664	664	664	664	664
KR4A1Q6B0009	2026-11 에이피알개별선물						19
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-19	-19	-19	-19	-19	-19	-19
-5.33%	-13	-13	-13	-13	-13	-13	-13
-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%	13	13	13	13	13	13	13
8.00%	19	19	19	19	19	19	19
	KR4A226B0001		2026-11 삼성SDI개별선물				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%	-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%	38	38	38	38	38	38	38
	KR4ADK6B0008		2026-11 코스맥스개별선물				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

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

2,395

공시일	2026-10-27
기준일	2026-10-26

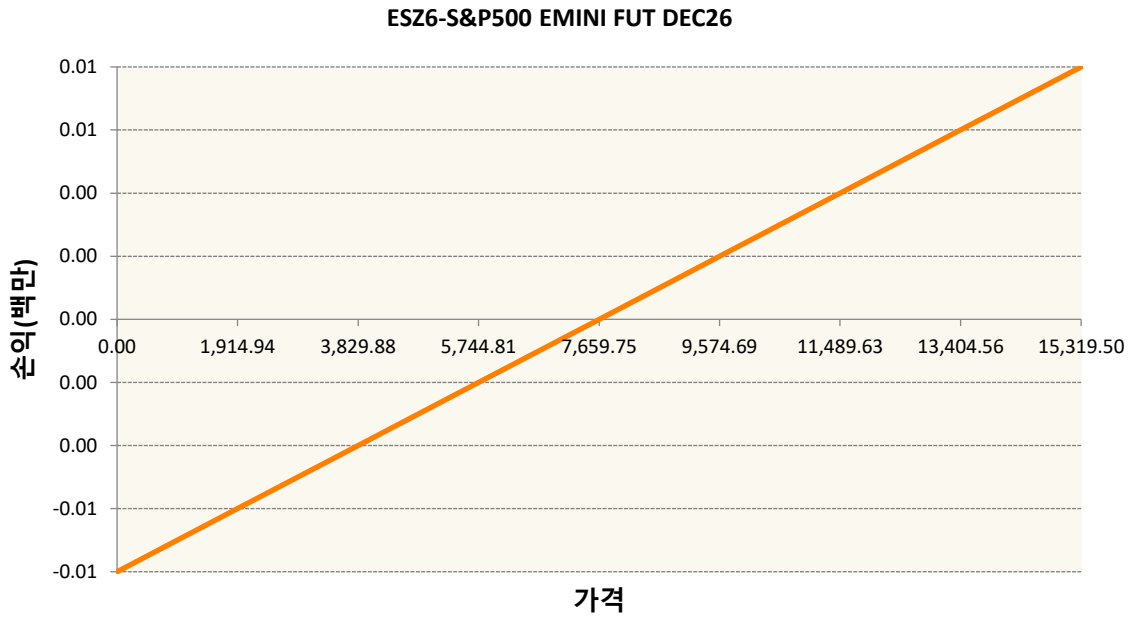
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

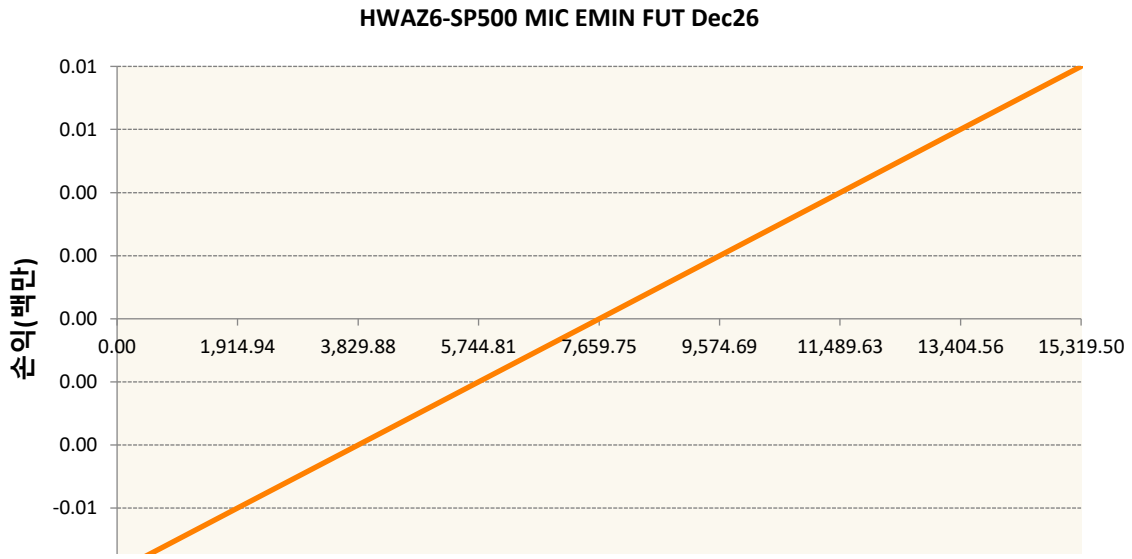
1. 계약금액

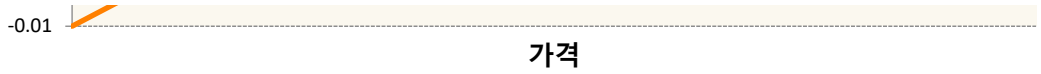
(단위:백만원)

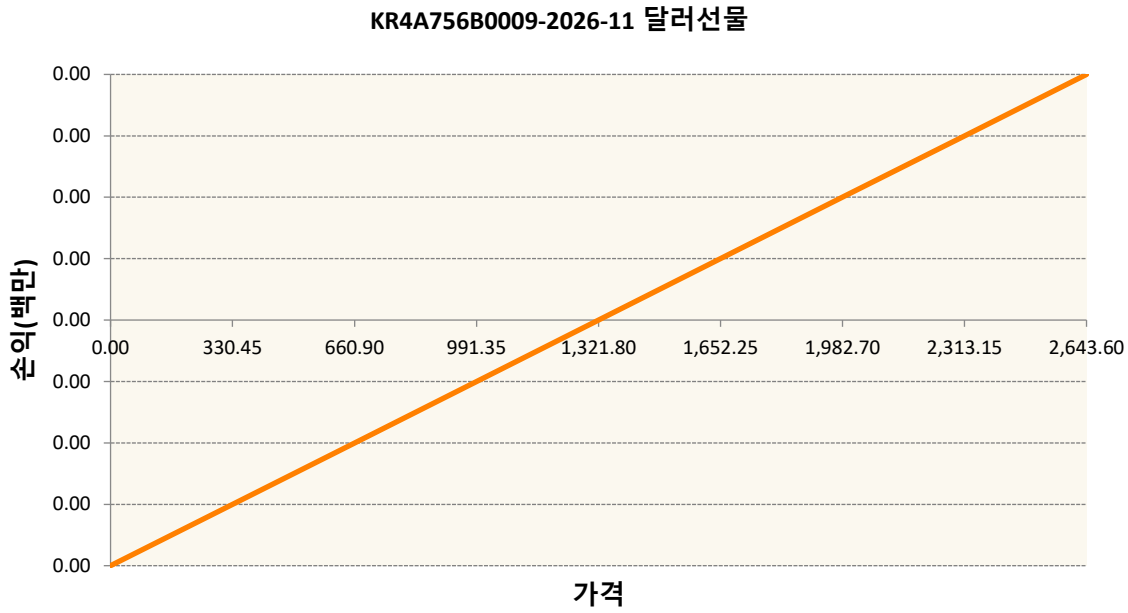
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
신규	지수	선물	0	0	0	장내
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	지수	선물	78,173	0	78,173	
누계	지수	선물	371	0	371	장내
누계	통화	선물	18,373	0	18,373	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

ESZ6	S&P500 EMINI FUT DEC26	6,254
HWAZ6	SP500 MIC EMIN FUT Dec26	30
KR4A756B00	2026-11 달러선물	1,470

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

3,758

공시일	2026-10-27
기준일	2026-10-26

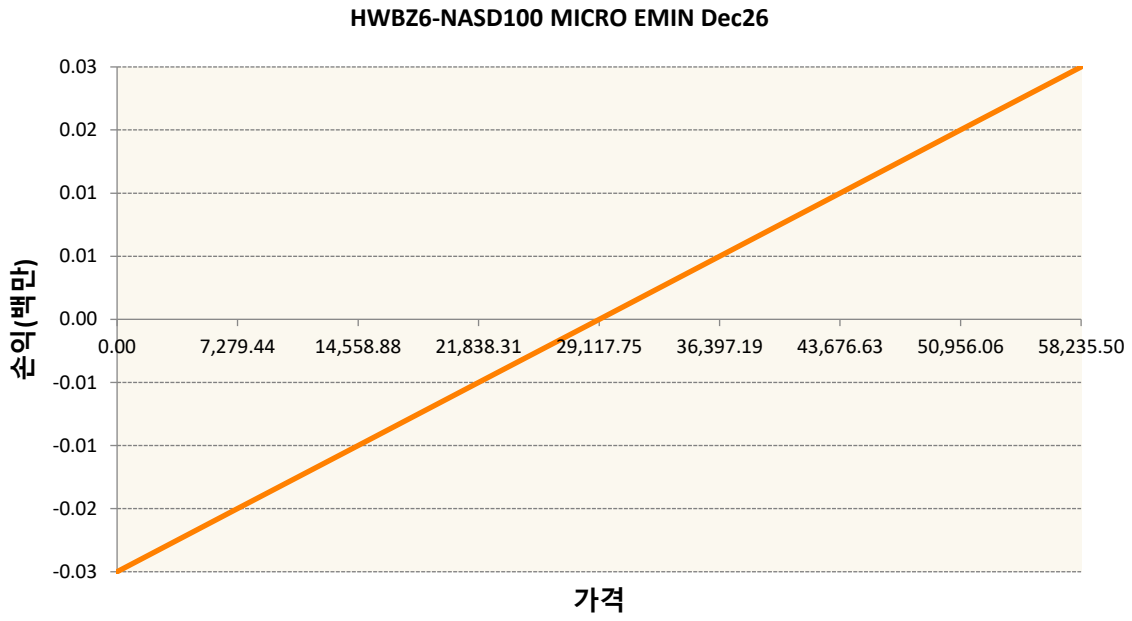
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

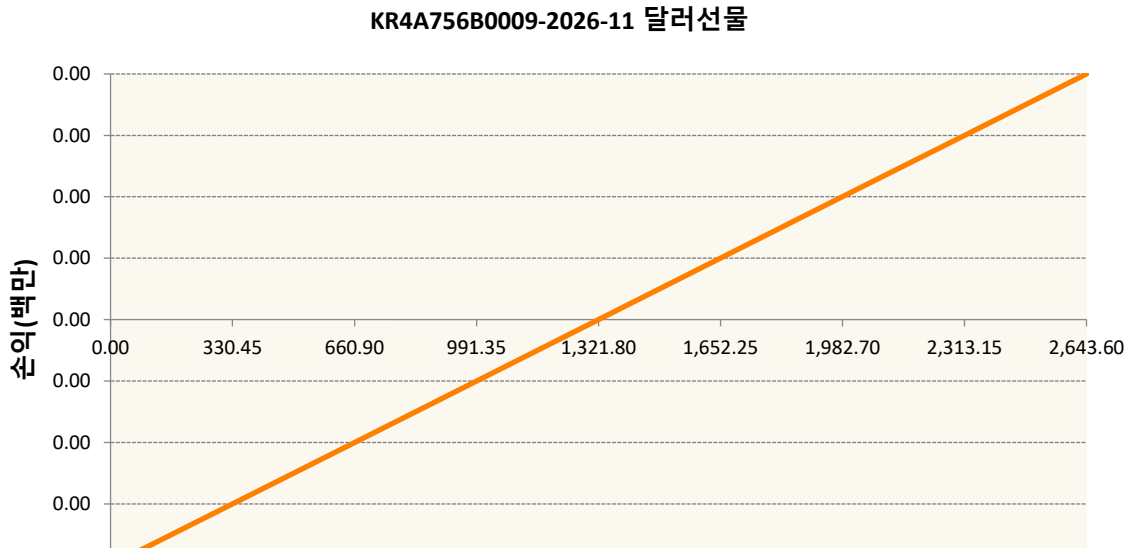
1. 계약금액

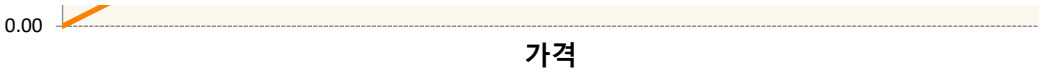
(단위:백만원)

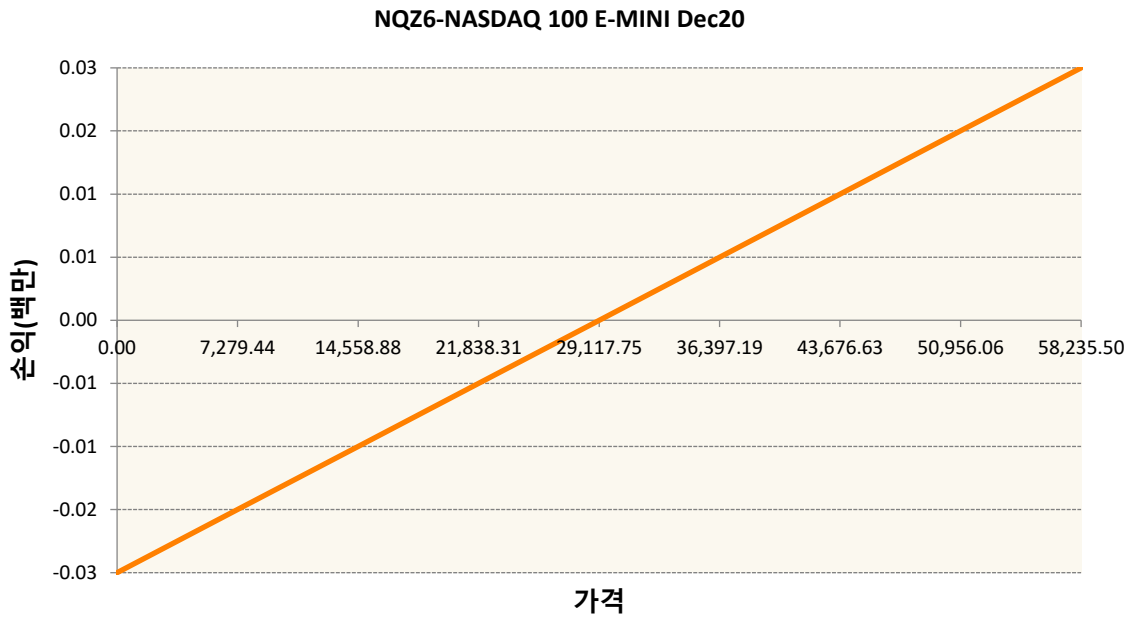
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
신규	지수	선물	0	0	0	장내
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	지수	선물	34,591	0	34,591	
누계	지수	선물	403	0	403	장내
누계	통화	선물	8,539	0	8,539	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HWBZ6	NASD100 MICRO EMIN Dec26	32
KR4A756B00	2026-11 달러선물	683
NQZ6	NASDAQ 100 E-MINI Dec20	2,767

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

2,504

공시일	2026-10-27
기준일	2026-10-26

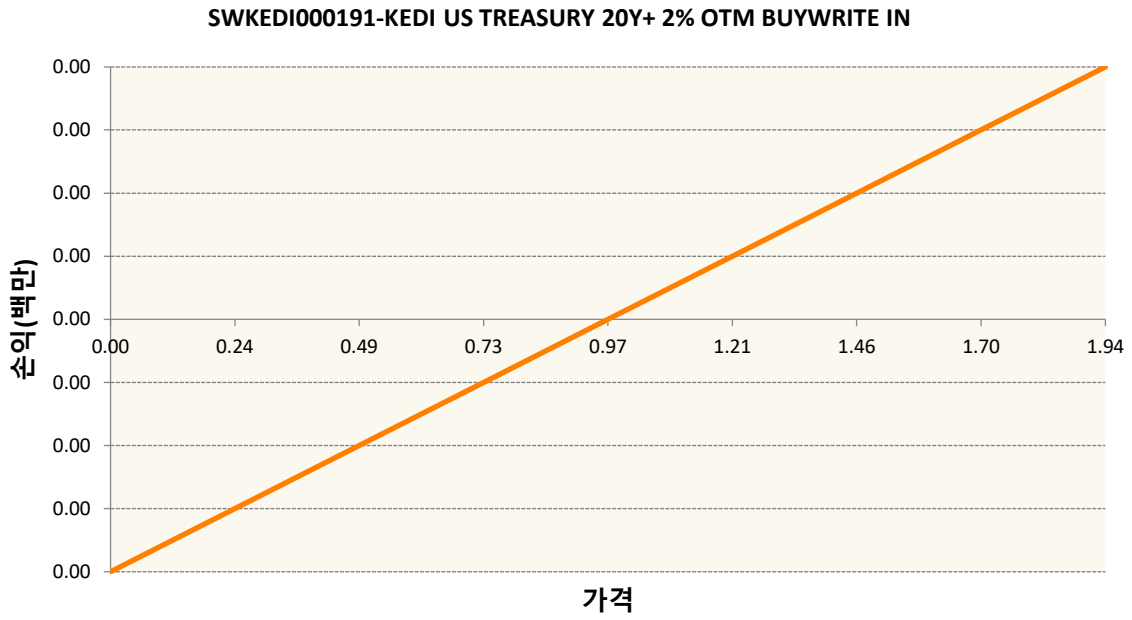
SOL미국30년국채커버드콜(합성)

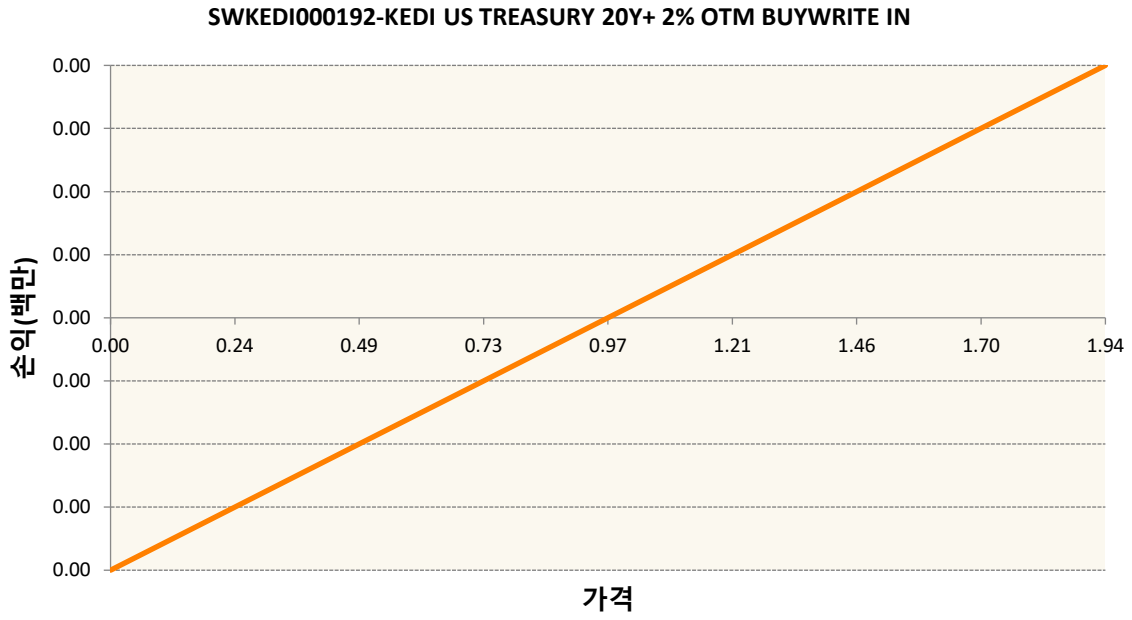
1. 계약금액

(단위:백만원)

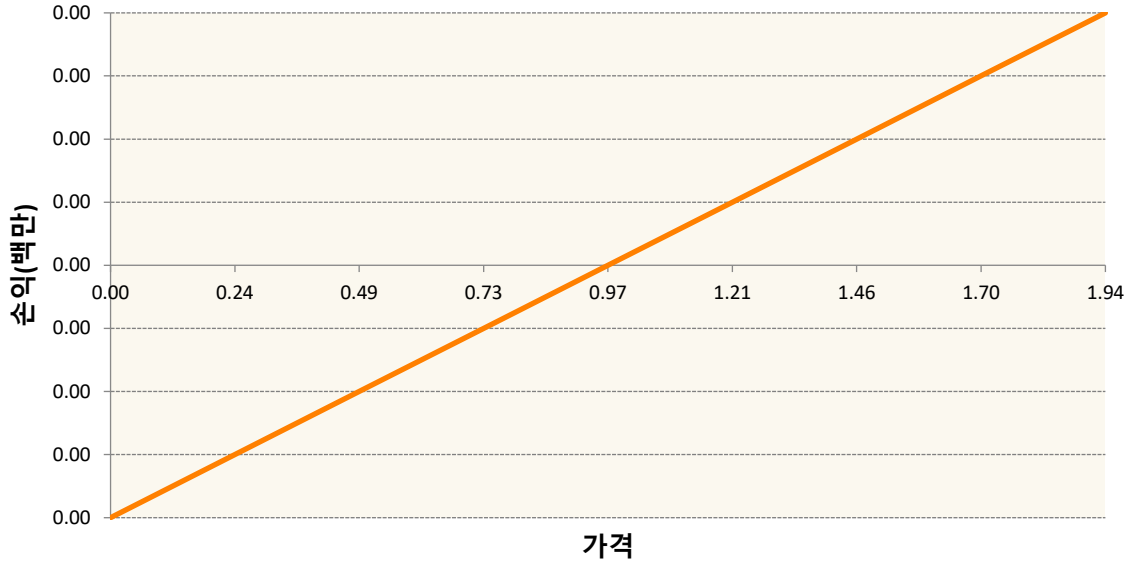
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	271,045	0	271,045	장외

2. 만기시점의 손익구조

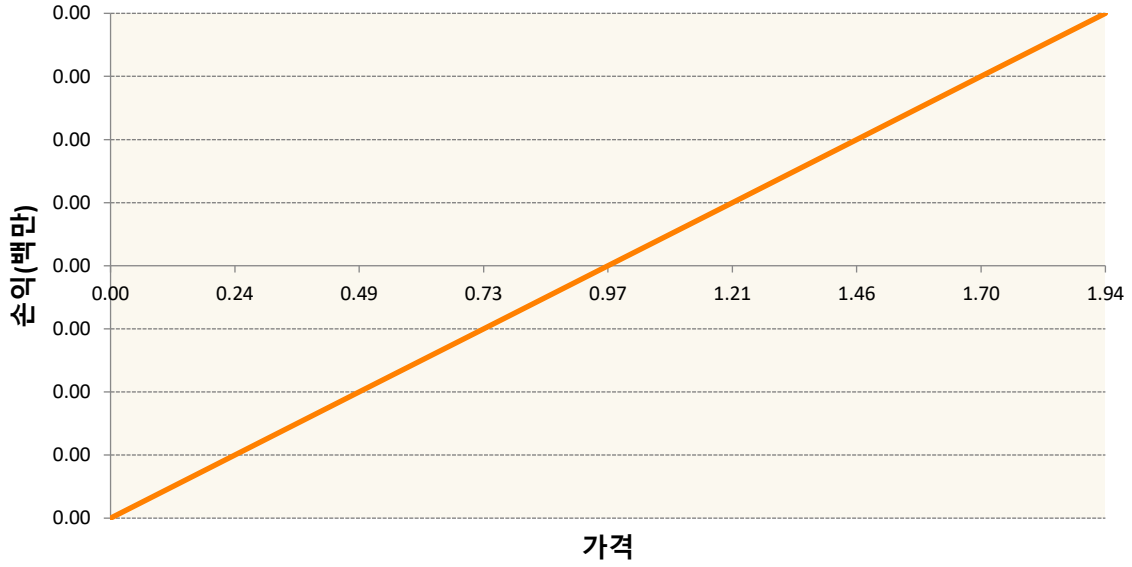




SWKEDI000193-KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN



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



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	2,656
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	4,724
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	6,867
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	7,512

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

8,576