공시일	2026-10-28
기준일	2026-10-27

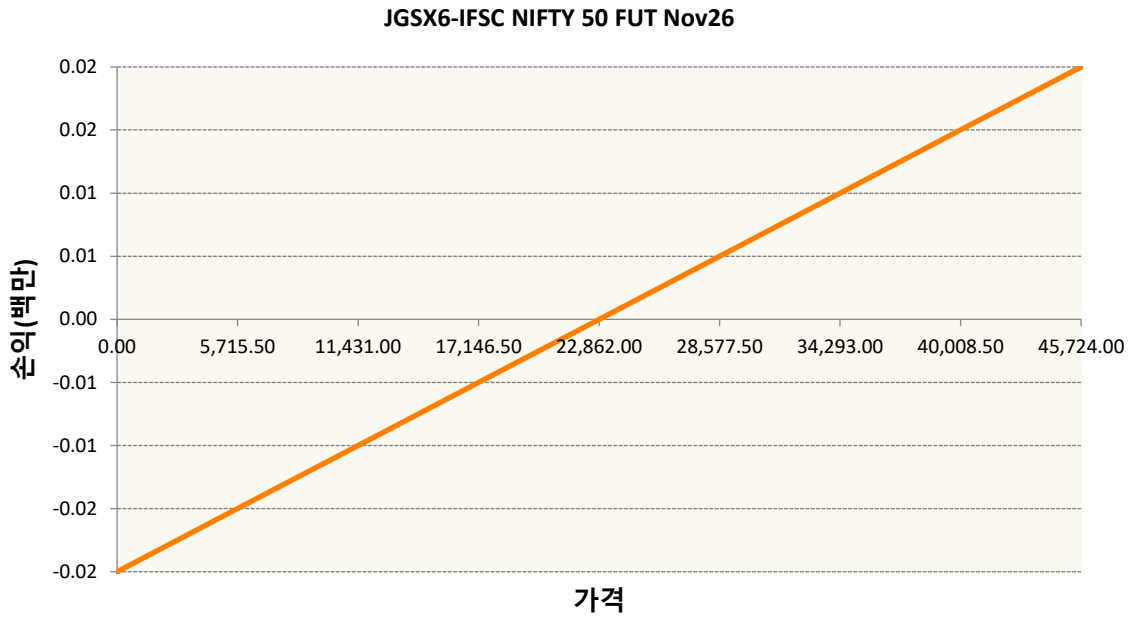
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	303	0	303	

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	2026-10-28
기준일	2026-10-27

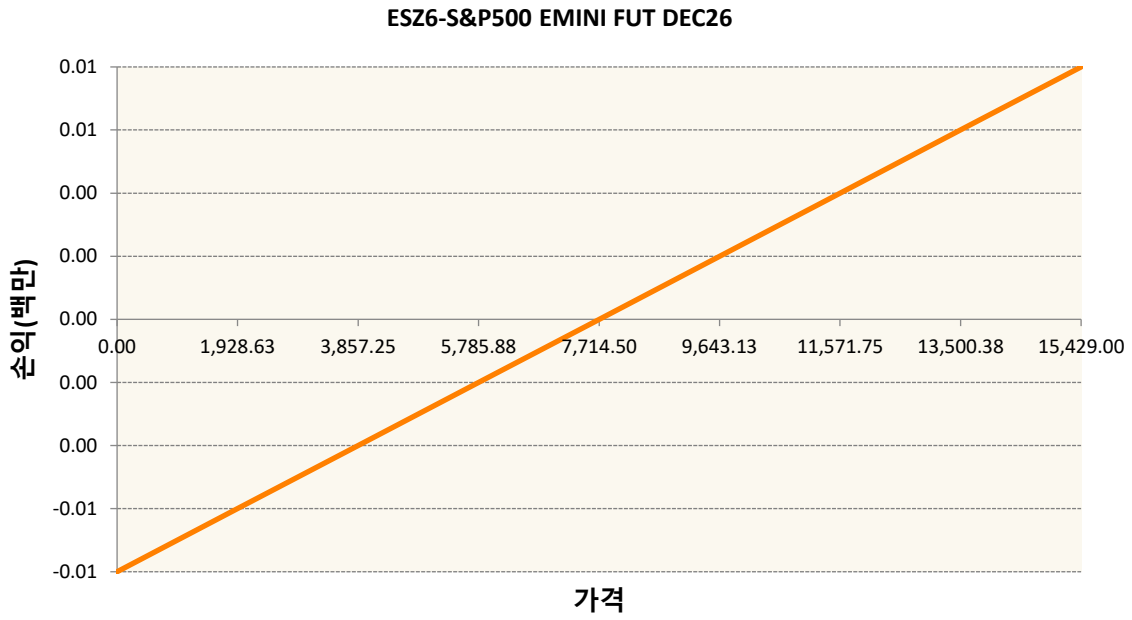
SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

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	2026-10-28
기준일	2026-10-27

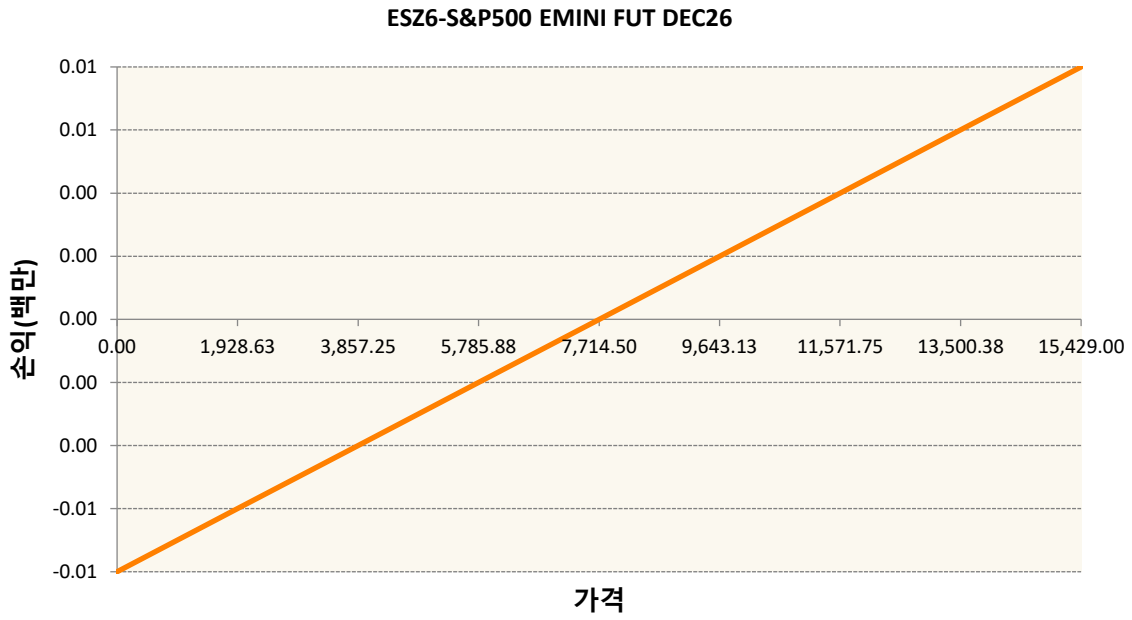
SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	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	2026-10-28
기준일	2026-10-27

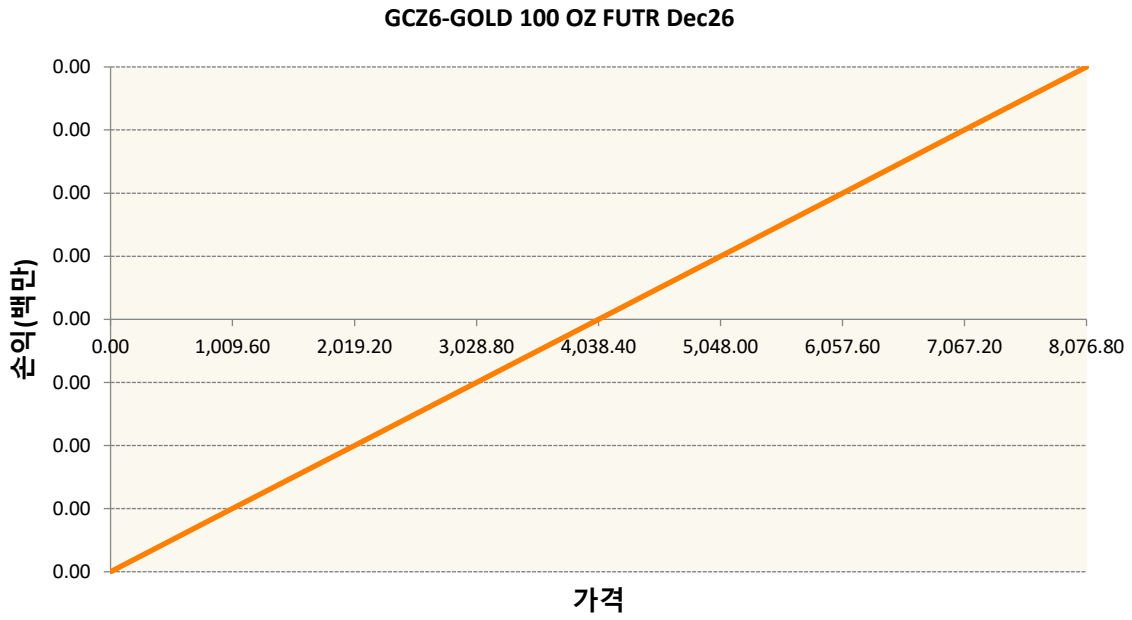
SOL골드커버드콜액티브특별자산상장지수(금

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			5,767	0	5,767	
누계	실물자산	옵션	0	0	0	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

AOGLDUSAC	GLD US 10/30/26 C375 EQUITY	3
GCZ6	GOLD 100 OZ FUTR Dec26	461

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

(단위:백만원)

591

공시일	2026-10-28
기준일	2026-10-27

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	126
AOPLTRAP2(PLTR US 10/30/26 P202.5 EQUITY	20

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

(단위:백만원)

506

공시일	2026-10-28
기준일	2026-10-27

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	3

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

(단위:백만원)

2

공시일	2026-10-28
기준일	2026-10-27

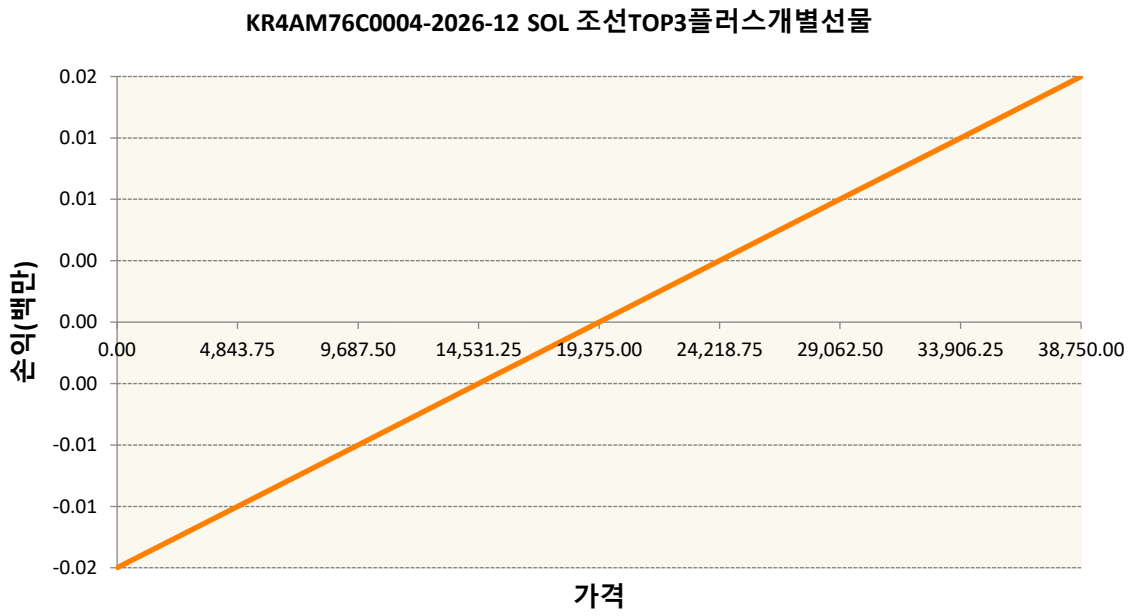
SOL조선TOP3플러스레버리지상장지수(주식)

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	5,643	0	5,643	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4AM76C0004	2026-12 SOL 조선TOP3플러스개별선물						4,483
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-4,483	-4,483	-4,483	-4,483	-4,483	-4,483	-4,483
-5.33%	-2,989	-2,989	-2,989	-2,989	-2,989	-2,989	-2,989
-2.67%	-1,494	-1,494	-1,494	-1,494	-1,494	-1,494	-1,494
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	1,494	1,494	1,494	1,494	1,494	1,494	1,494
5.33%	2,989	2,989	2,989	2,989	2,989	2,989	2,989
8.00%	4,483	4,483	4,483	4,483	4,483	4,483	4,483

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

7,837

공시일	2026-10-28
기준일	2026-10-27

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	2026-10-28
기준일	2026-10-27

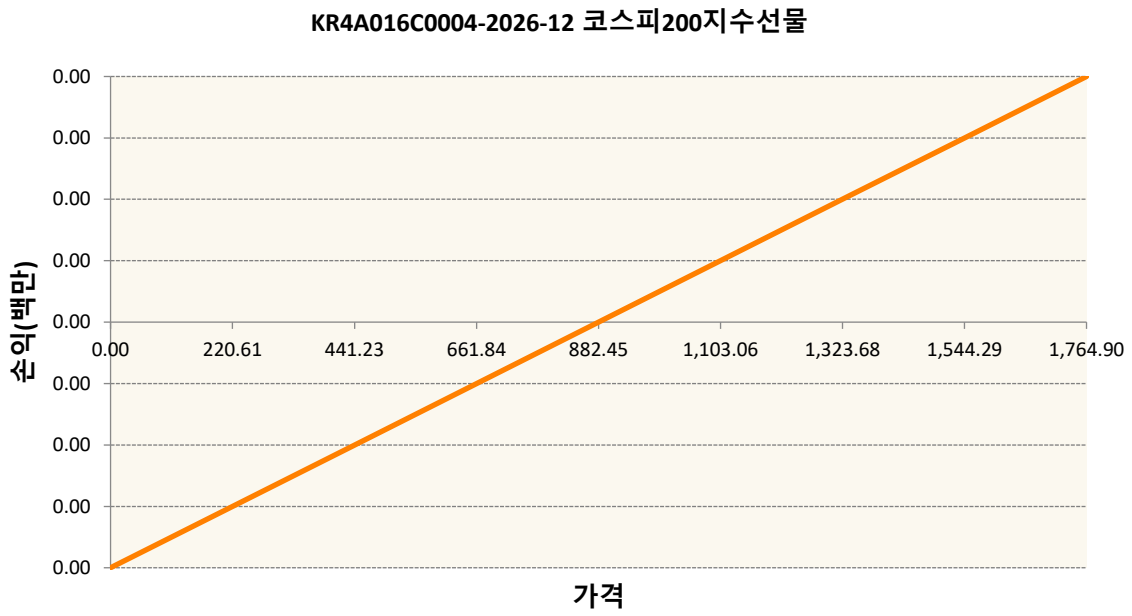
SOL 200타겟위클리커버드콜상장지수(주식)

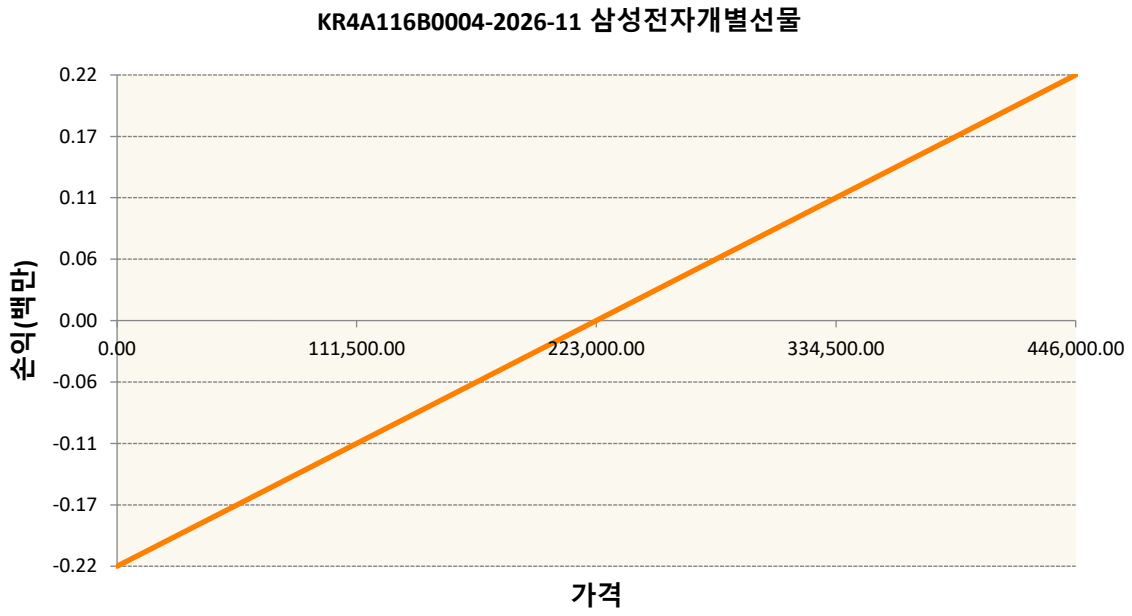
1. 계약금액

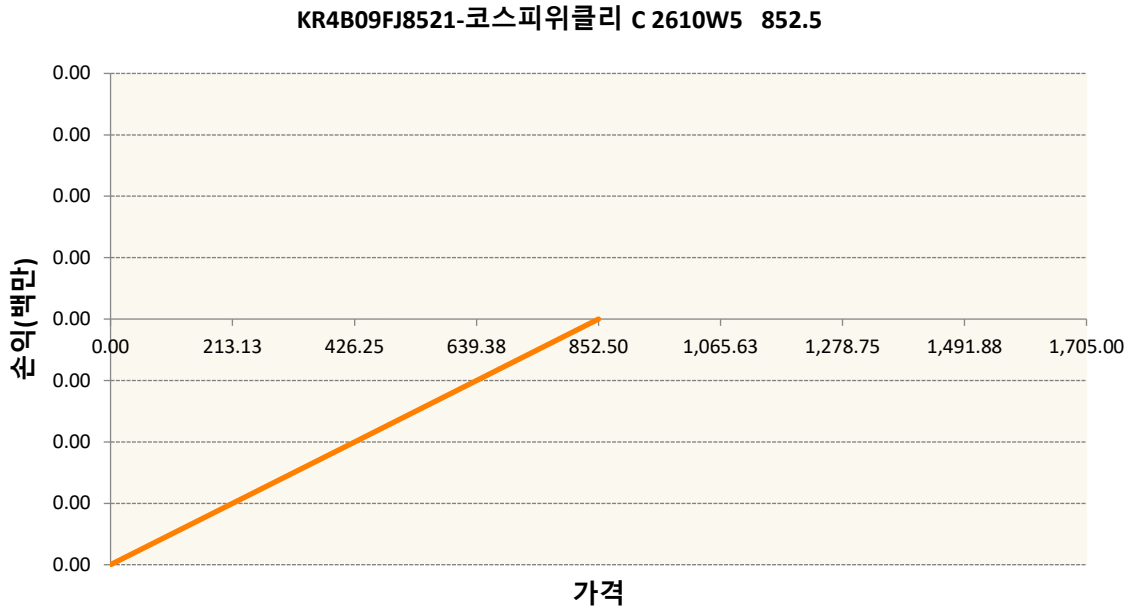
(단위:백만원)

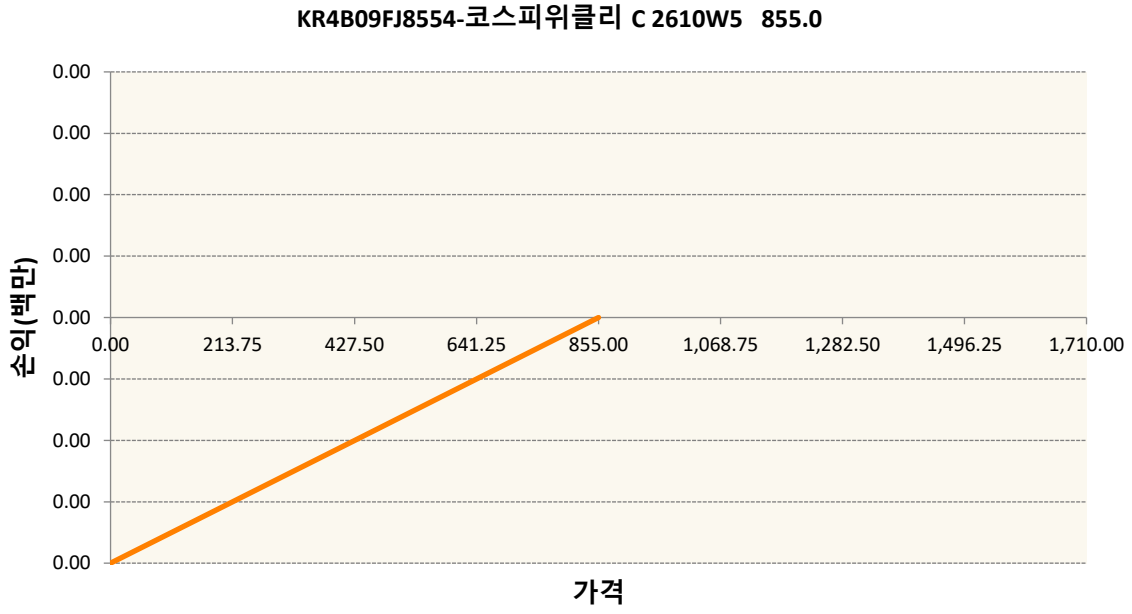
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	17,778	0	17,778	장내
누계	유가증권	옵션	0	32,219	-32,219	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A016C0004	2026-12 코스피200지수선물						458
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-458	-458	-458	-458	-458	-458	-458
-5.33%	-305	-305	-305	-305	-305	-305	-305
-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%	305	305	305	305	305	305	305
8.00%	458	458	458	458	458	458	458
KR4A116B0004	2026-11 삼성전자개별선물						959
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-959	-959	-959	-959	-959	-959	-959
-5.33%	-639	-639	-639	-639	-639	-639	-639
-2.67%	-320	-320	-320	-320	-320	-320	-320
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	320	320	320	320	320	320	320
5.33%	639	639	639	639	639	639	639
8.00%	959	959	959	959	959	959	959
	KR4B09FJ8521		코스피위클리 C 2610W5 852.5				938
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-874	-881	-889	-899	-911	-924	-938
-5.33%	-406	-425	-446	-467	-489	-512	-534
-2.67%	-88	-113	-138	-163	-189	-214	-239
0%	49	34	18	0	-19	-38	-59
2.67%	82	78	72	64	55	45	33
5.33%	87	86	85	83	80	75	70
8.00%	87	87	87	87	86	85	83
	KR4B09FJ8554		코스피위클리 C 2610W5 855.0				643
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-604	-608	-613	-619	-626	-634	-643
-5.33%	-289	-301	-314	-327	-341	-355	-370
-2.67%	-67	-83	-100	-117	-134	-151	-167
0%	35	24	12	0	-13	-27	-41
2.67%	61	58	54	48	41	33	25
5.33%	65	65	64	62	60	57	53
8.00%	66	66	65	65	65	64	62

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

7,546

공시일	2026-10-28
기준일	2026-10-27

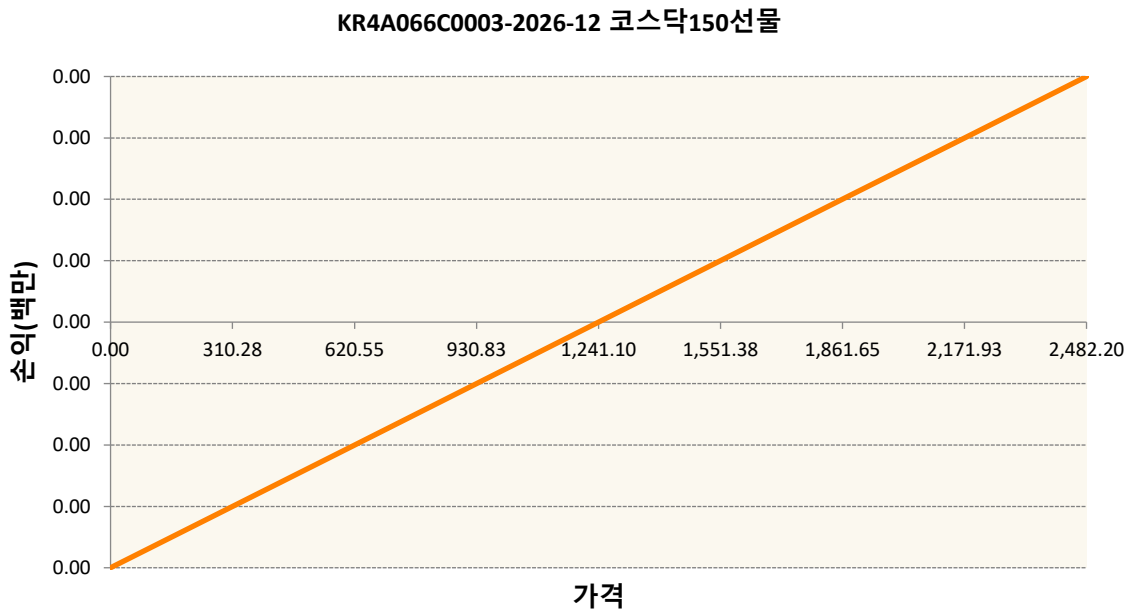
SOL코스닥150인덱스(주식-파생형)

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	496	0	496	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%	-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%	40	40	40	40	40	40	40

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

130

공시일	2026-10-28
기준일	2026-10-27

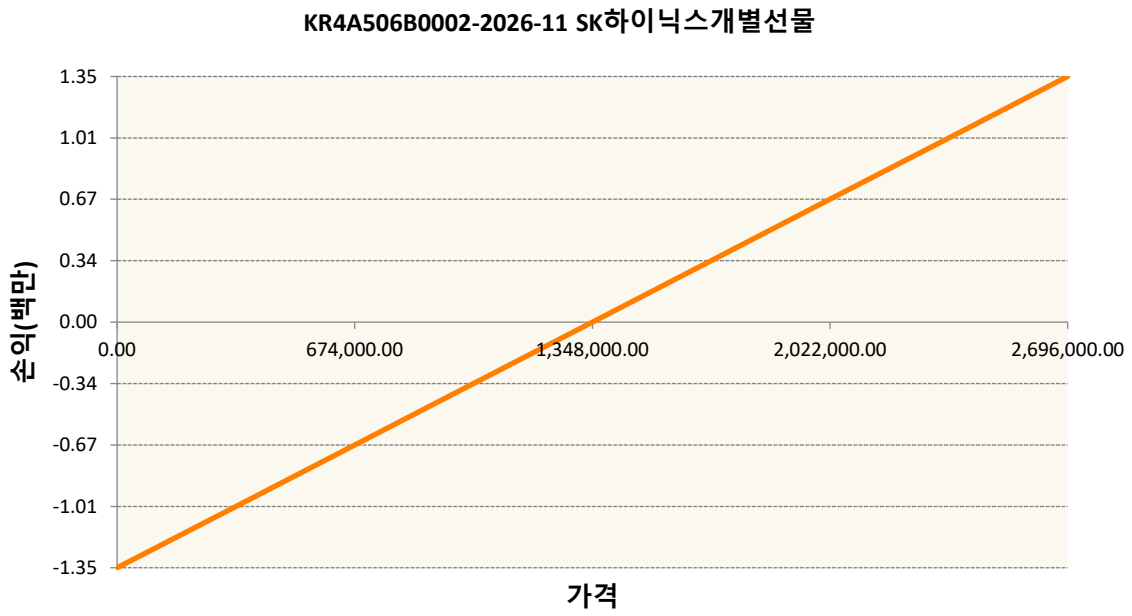
SOLSK하이닉스단일종목레버리지상장지수

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	824	0	824	장내
누계	유가증권	선물	24,790	0	24,790	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A506B0002	2026-11 SK하이닉스개별선물	1,973

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,973	-1,973	-1,973	-1,973	-1,973	-1,973	-1,973
-5.33%	-1,315	-1,315	-1,315	-1,315	-1,315	-1,315	-1,315
-2.67%	-658	-658	-658	-658	-658	-658	-658
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	658	658	658	658	658	658	658
5.33%	1,315	1,315	1,315	1,315	1,315	1,315	1,315
8.00%	1,973	1,973	1,973	1,973	1,973	1,973	1,973

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

9,567

공시일	2026-10-28
기준일	2026-10-27

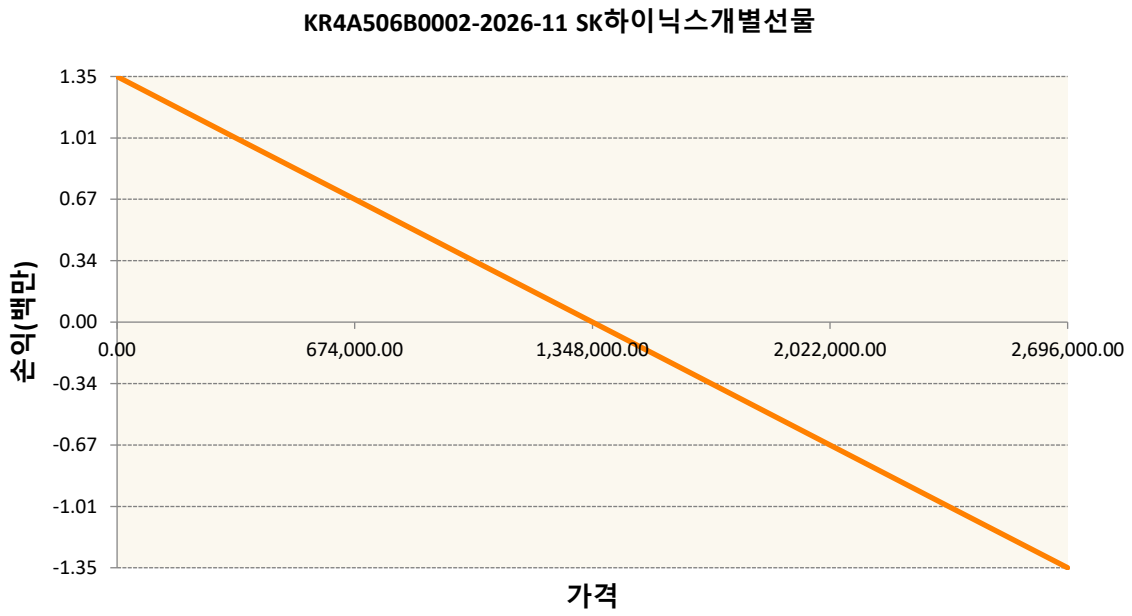
SOLSK하이닉스선물단일종목인버스2X상장지

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	38,368	9,009	29,359	장내
누계	유가증권	선물	0	207,754	-207,754	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A506B0002	2026-11 SK하이닉스개별선물	16,534

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	16,534	16,534	16,534	16,534	16,534	16,534	16,534
-5.33%	11,023	11,023	11,023	11,023	11,023	11,023	11,023
-2.67%	5,511	5,511	5,511	5,511	5,511	5,511	5,511
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-5,511	-5,511	-5,511	-5,511	-5,511	-5,511	-5,511
5.33%	-11,023	-11,023	-11,023	-11,023	-11,023	-11,023	-11,023
8.00%	-16,534	-16,534	-16,534	-16,534	-16,534	-16,534	-16,534

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

80,177

공시일	2026-10-28
기준일	2026-10-27

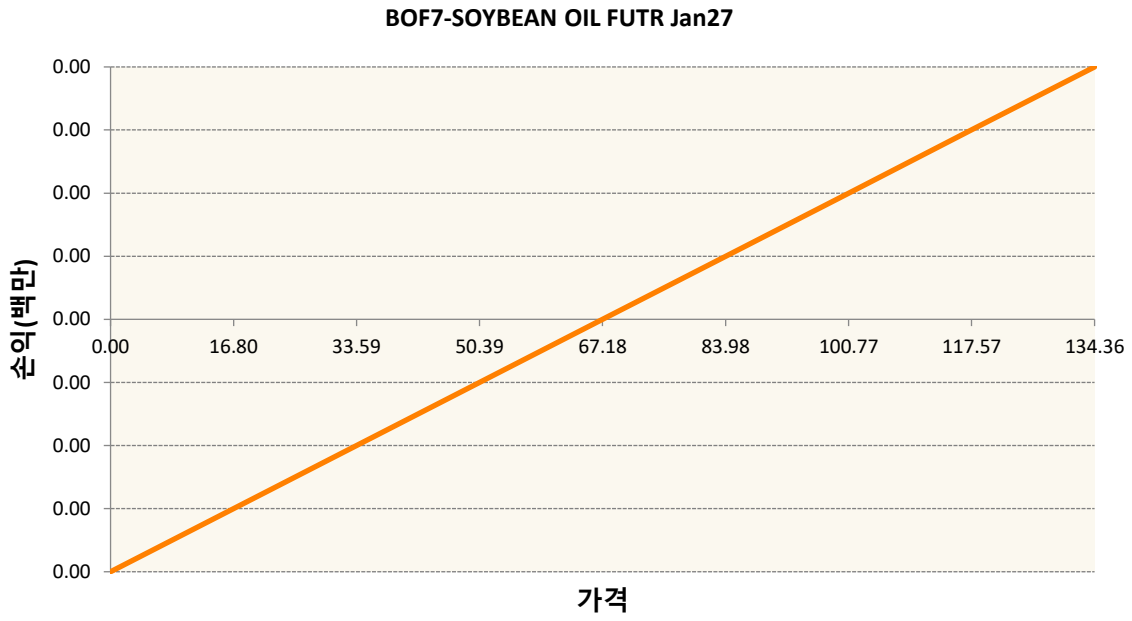
포커스농산물모(채권-파생형)

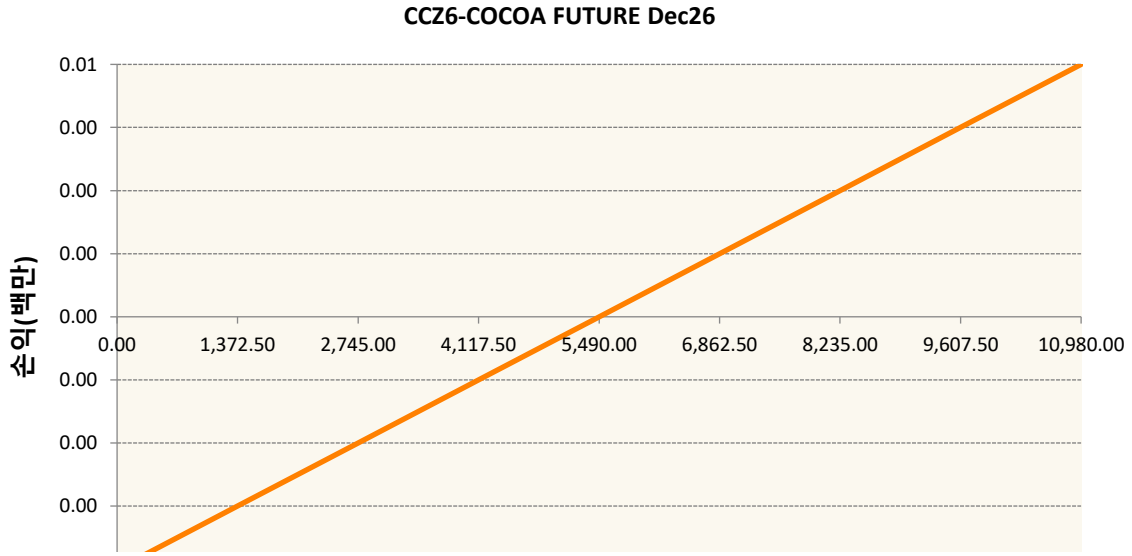
1. 계약금액

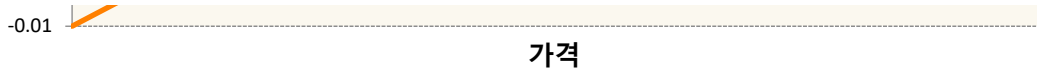
(단위:USD 백만)

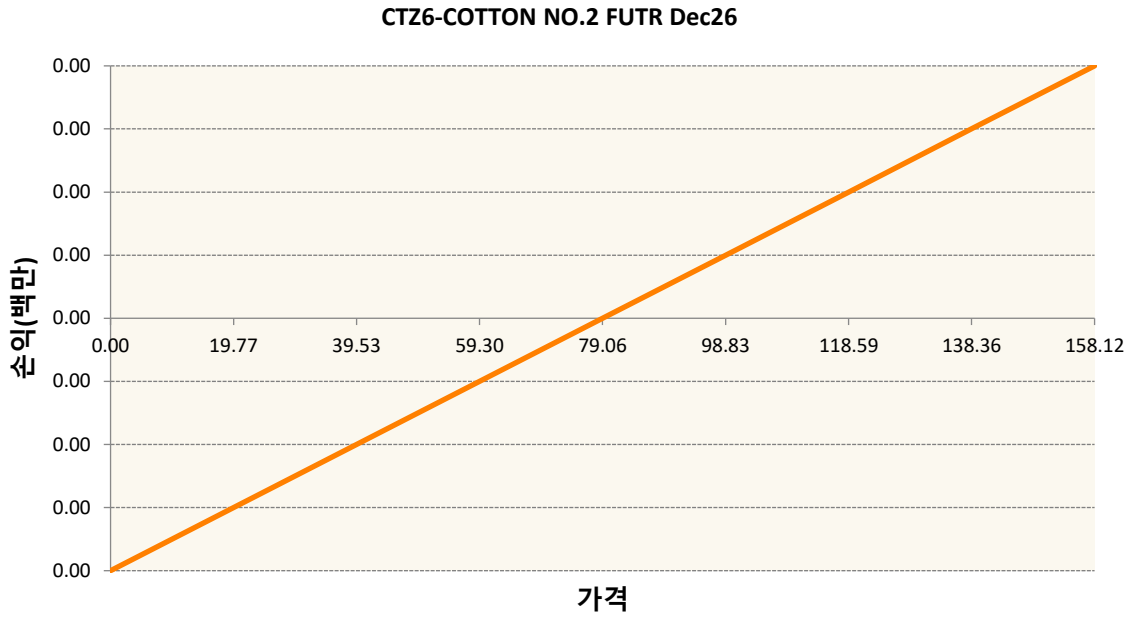
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	실물자산	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	66	0	66	장내
누계	실물자산	선물	349	0	349	
누계	유가증권	선물	2,175	0	2,175	
누계	통화	선물	0	278	-278	장내

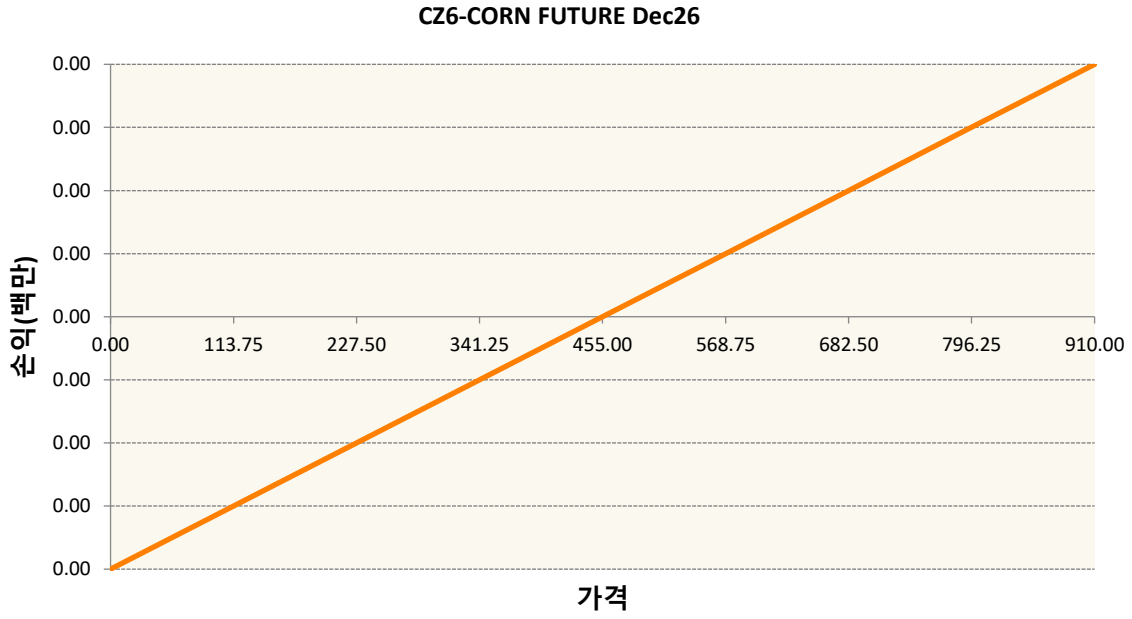
2. 만기시점의 손익구조

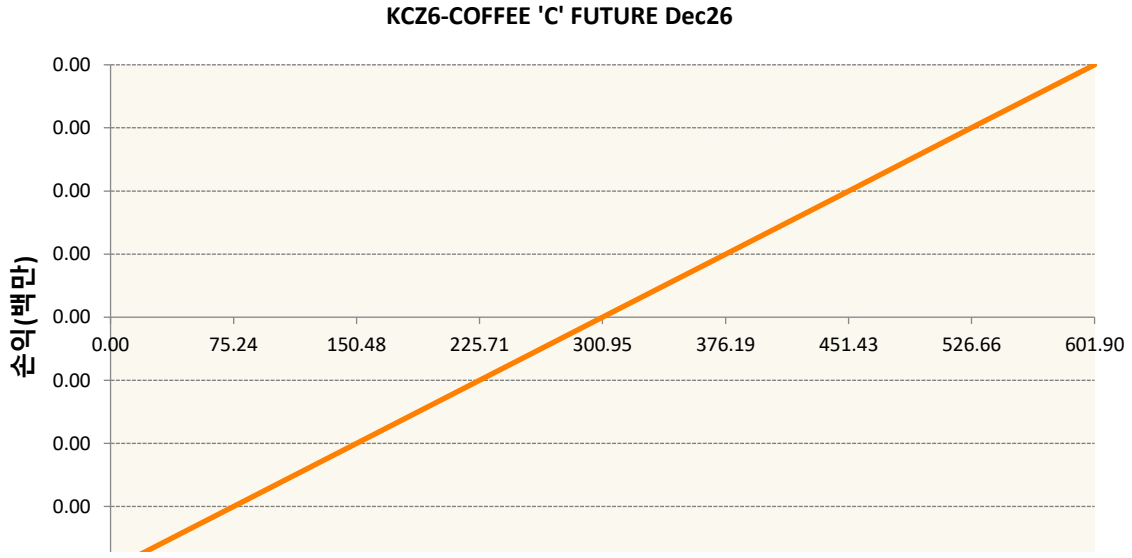


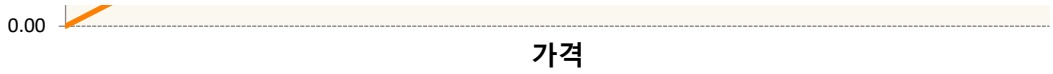


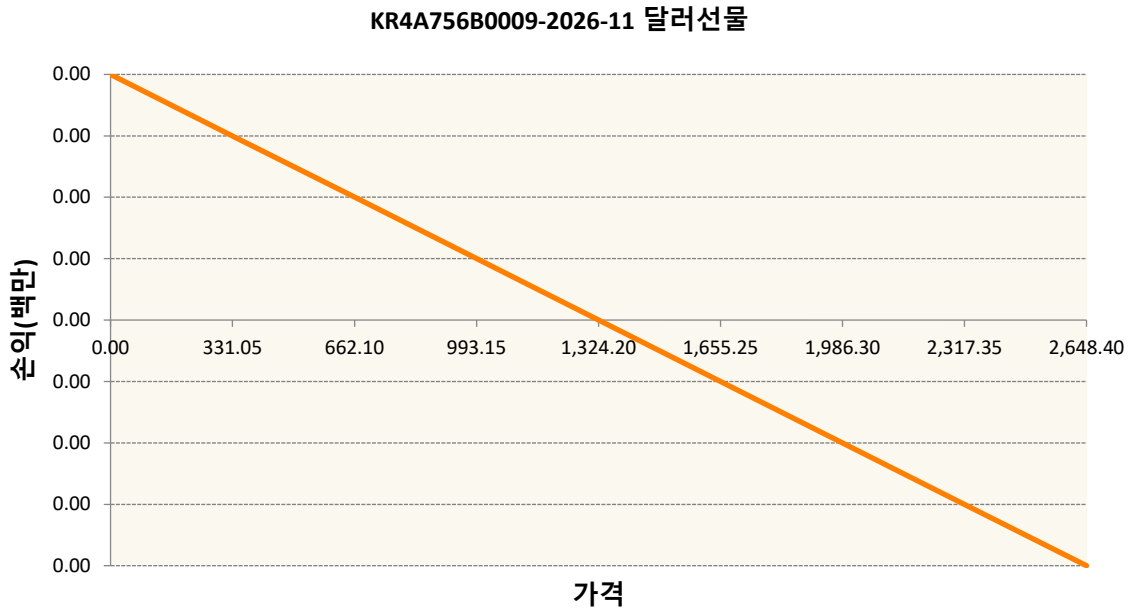

-0.01
가격

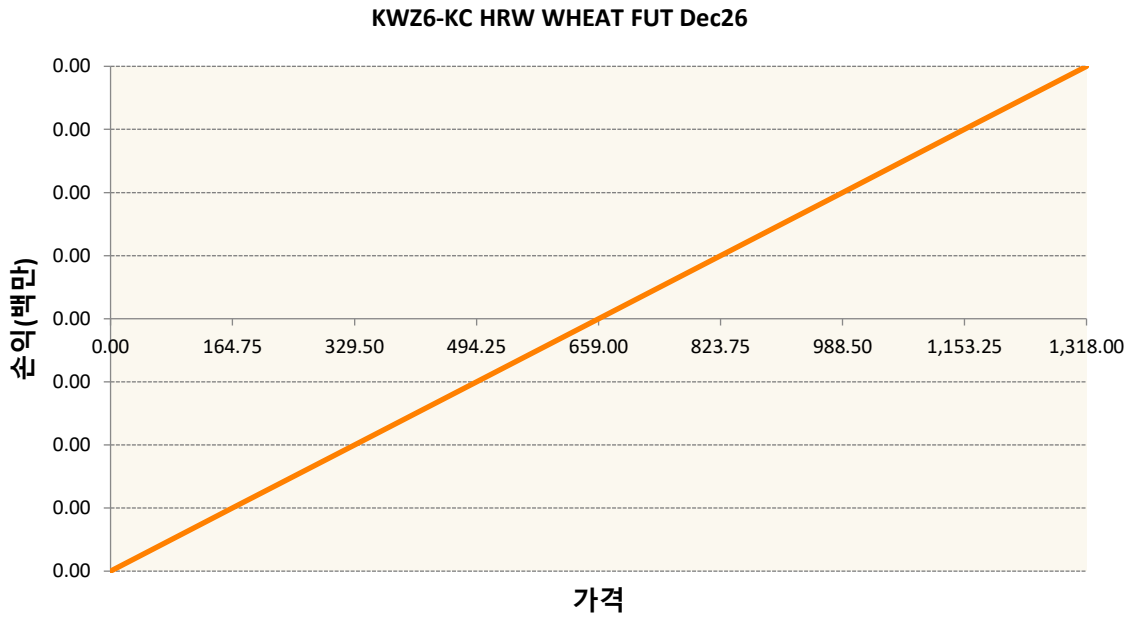

CTZ6-COTTON NO.2 FUTR Dec26
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
19.77
39.53
59.30
79.06
98.83
118.59
138.36
158.12
손익(백만)
가격

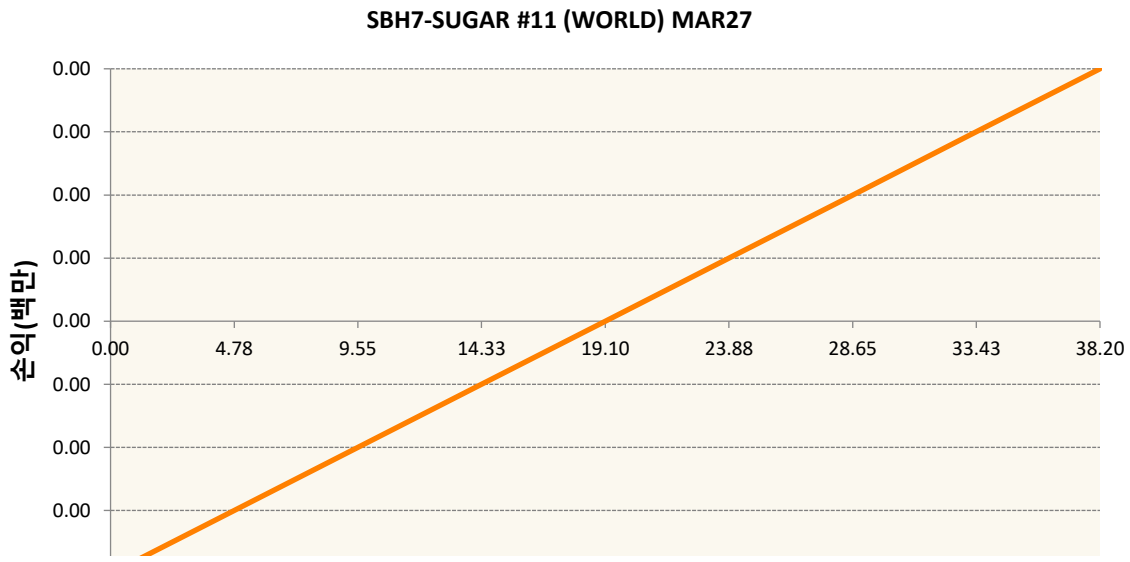

CZ6-CORN FUTURE Dec26
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
113.75
227.50
341.25
455.00
568.75
682.50
796.25
910.00
손익(백만)
가격

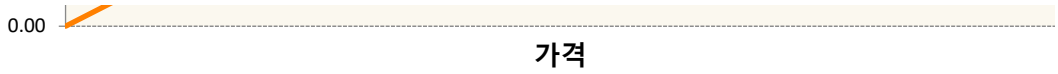

KCZ6-COFFEE 'C' FUTURE Dec26
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
75.24
150.48
225.71
300.95
376.19
451.43
526.66
601.90
손익(백만)

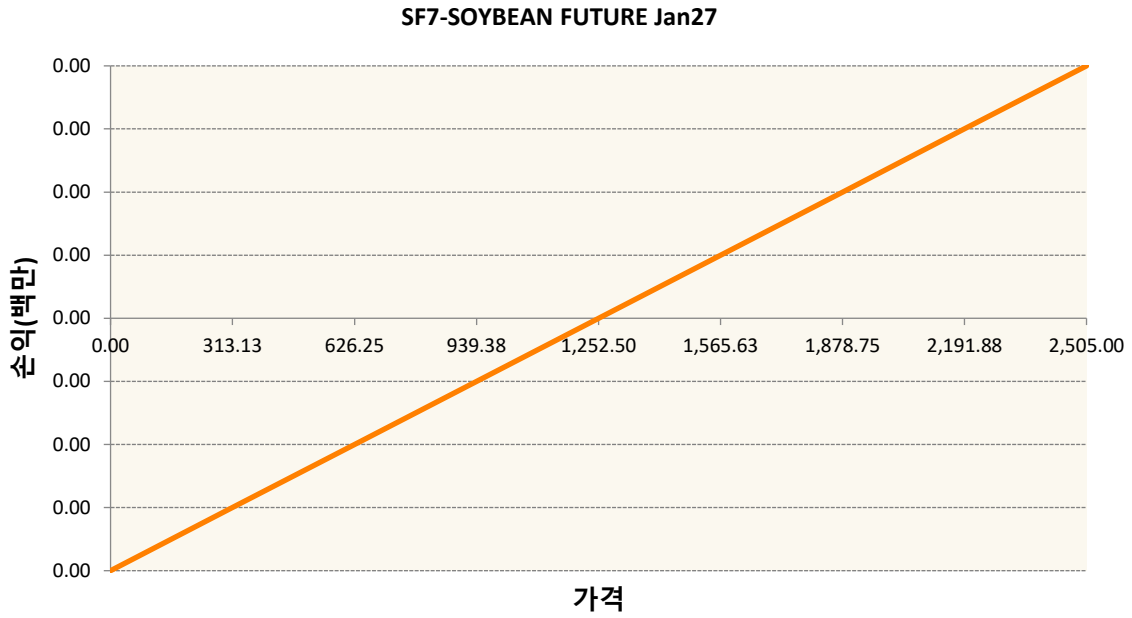

0.00
가격

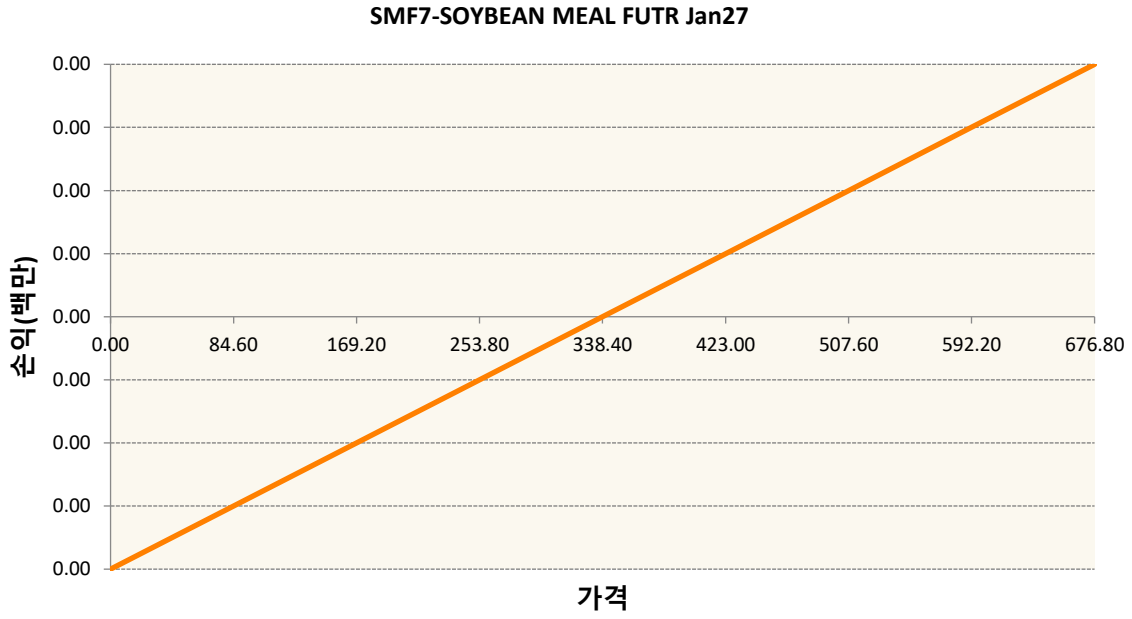

KR4A756B0009-2026-11 달러선물
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
331.05
662.10
993.15
1,324.20
1,655.25
1,986.30
2,317.35
2,648.40
손익(백만)
가격

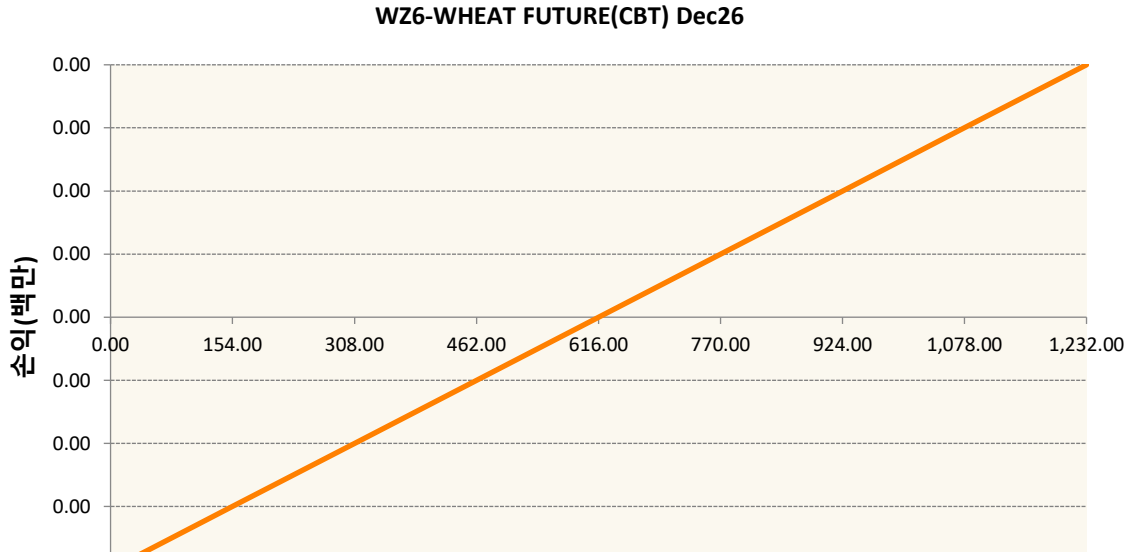

KWZ6-KC HRW WHEAT FUT Dec26
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
164.75
329.50
494.25
659.00
823.75
988.50
1,153.25
1,318.00
손익(백만)
가격


SBH7-SUGAR #11 (WORLD) MAR27
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
4.78
9.55
14.33
19.10
23.88
28.65
33.43
38.20
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
313.13
626.25
939.38
1,252.50
1,565.63
1,878.75
2,191.88
2,505.00
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
84.60
169.20
253.80
338.40
423.00
507.60
592.20
676.80
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
154.00
308.00
462.00
616.00
770.00
924.00
1,078.00
1,232.00
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	2026-10-28
기준일	2026-10-27

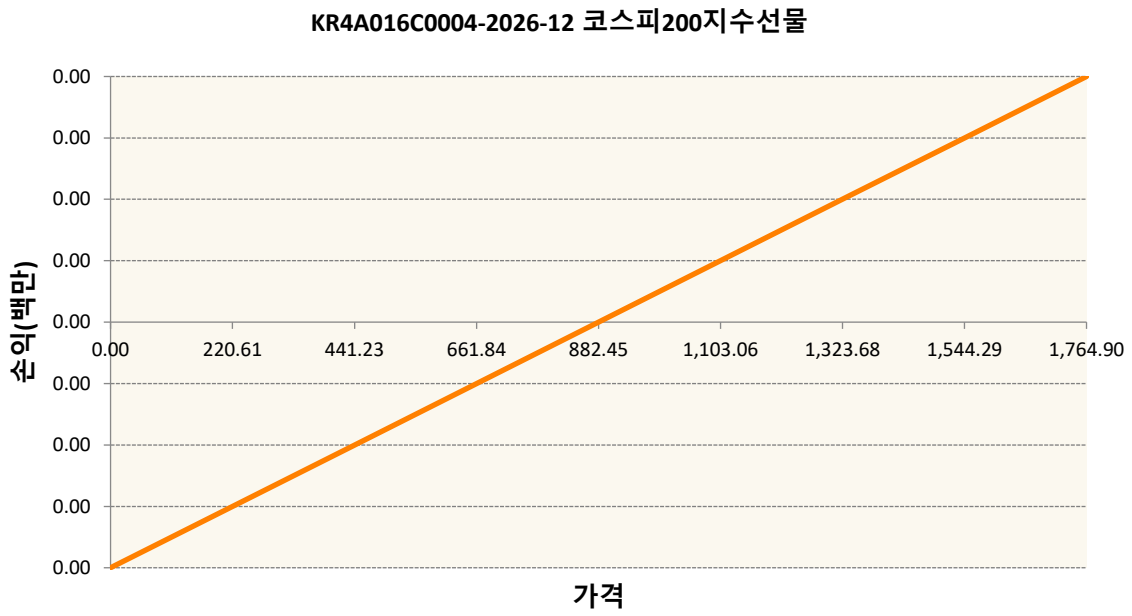
스마트인덱스모

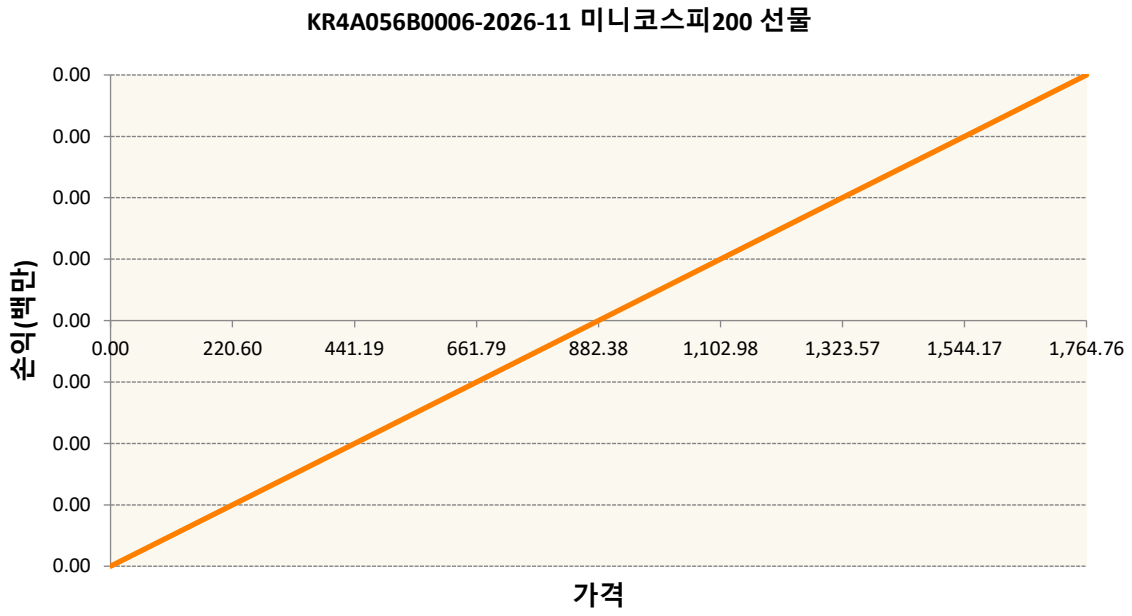
1. 계약금액

(단위:백만원)

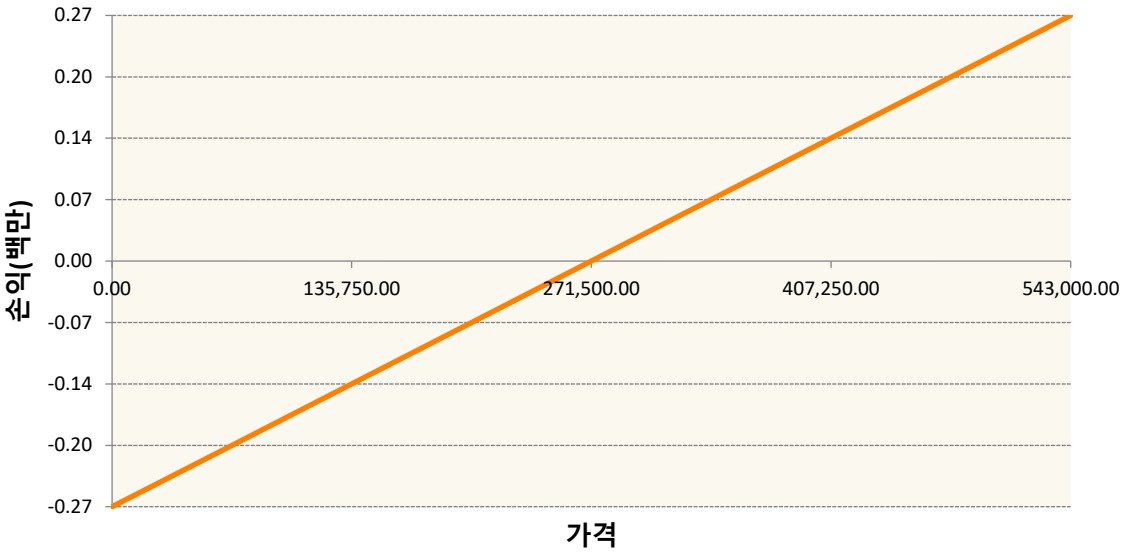
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	893	892	1	장내
누계	유가증권	선물	7,636	71	7,565	장내

2. 만기시점의 손익구조

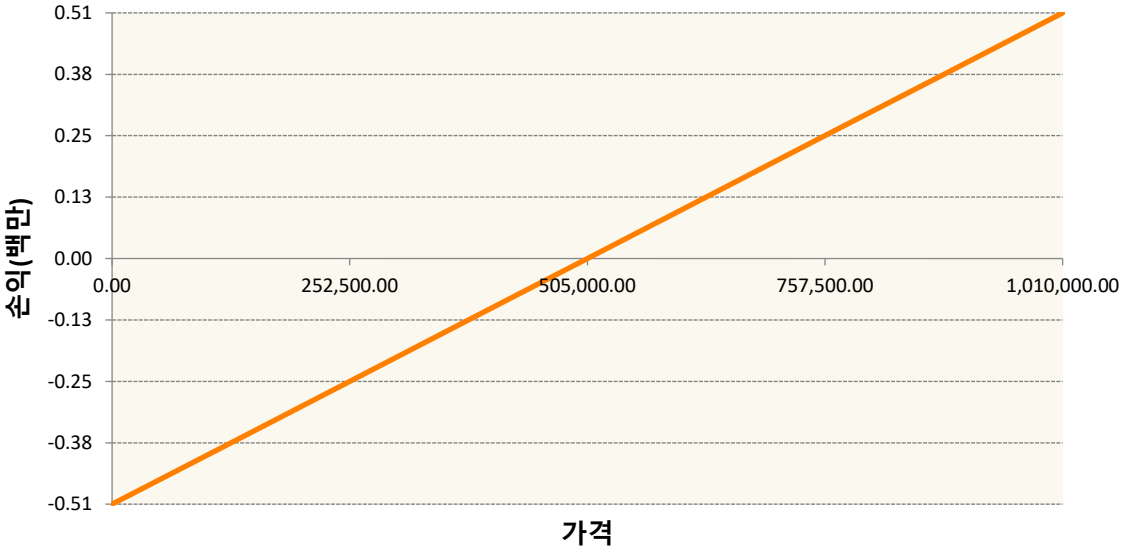




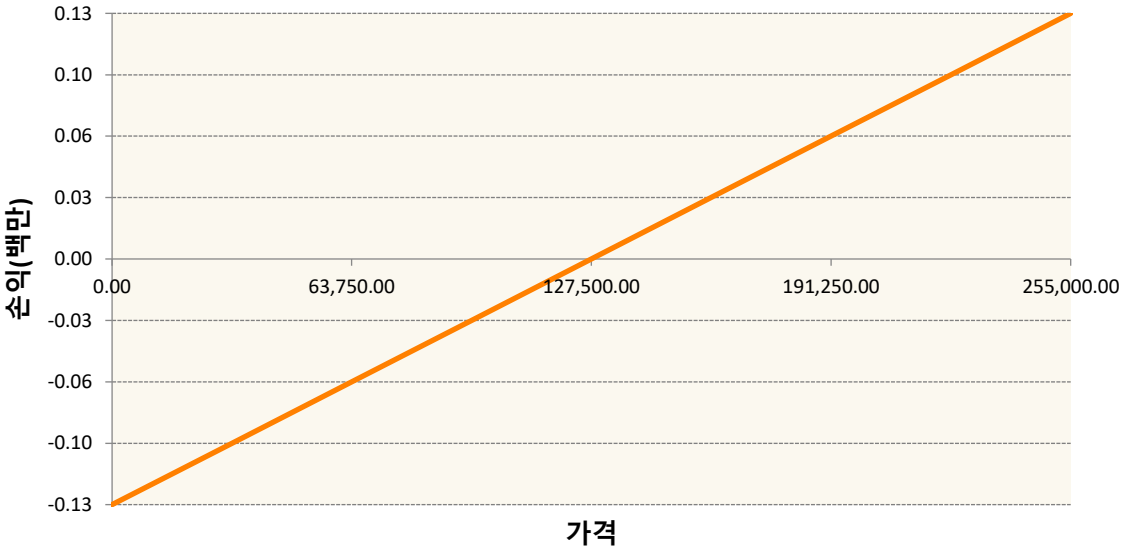
KR4A1Q6B0009-2026-11 에이피알개별선물

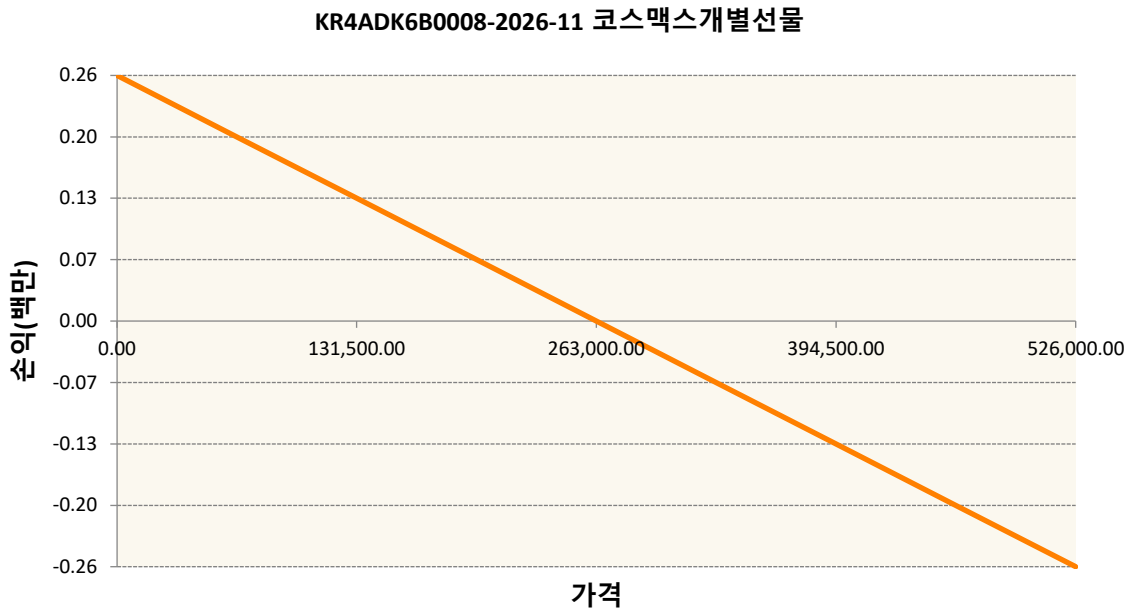


KR4A226B0001-2026-11 삼성SDI개별선물



KR4AB26B0009-2026-11 S-Oil개별선물





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

	KR4A016C0004	2026-12 코스피200지수선물					476
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-476	-476	-476	-476	-476	-476	-476
-5.33%	-317	-317	-317	-317	-317	-317	-317
-2.67%	-159	-159	-159	-159	-159	-159	-159
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	159	159	159	159	159	159	159
5.33%	317	317	317	317	317	317	317
8.00%	476	476	476	476	476	476	476

	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				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
	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)

1,768

공시일	2026-10-28
기준일	2026-10-27

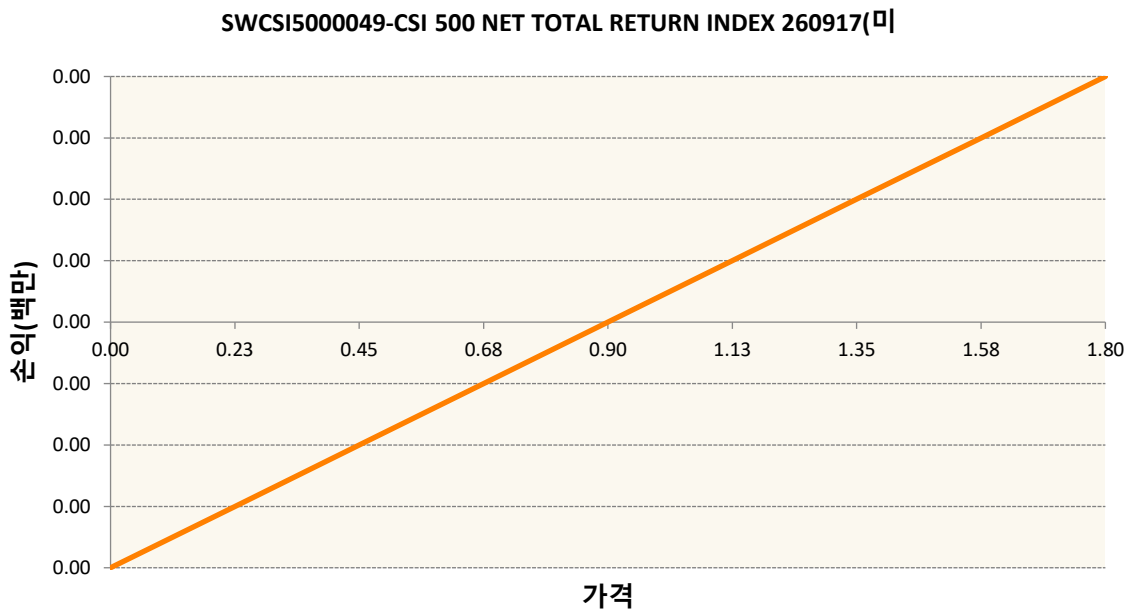
SOL차이나강소기업CSI500상장

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	4,789	0	4,789	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 CSI 500 NET TOTAL RETURN INDEX 260917(미	383

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

613

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2026-10-28
기준일	2026-10-27

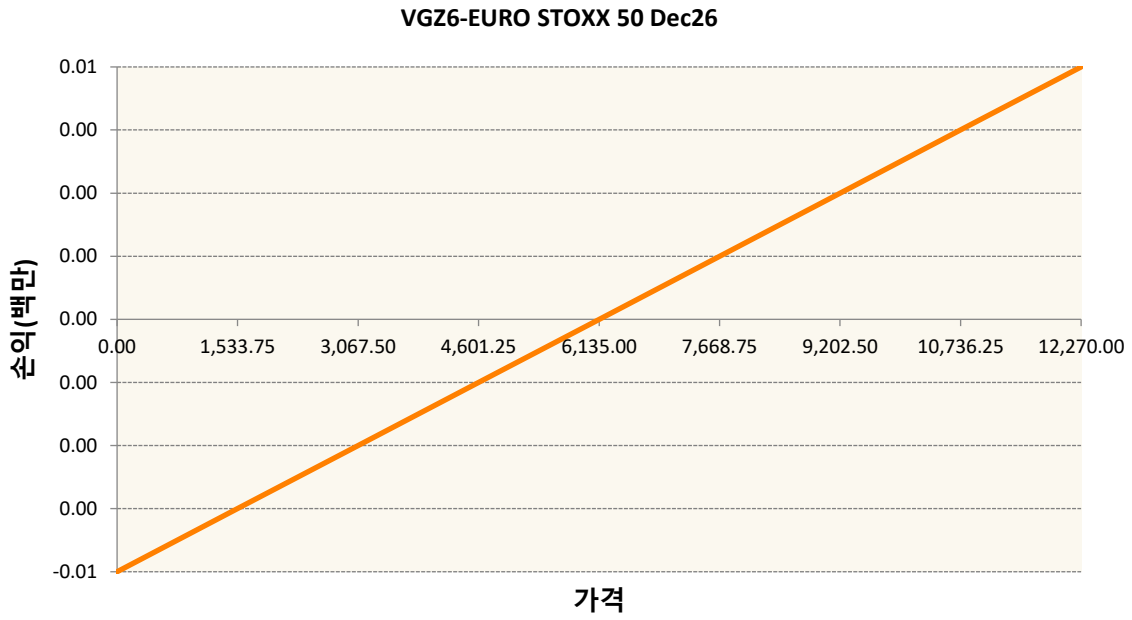
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,165	0	1,165	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGZ6	EURO STOXX 50 Dec26	93

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

(단위:백만원)

69

공시일	2026-10-28
기준일	2026-10-27

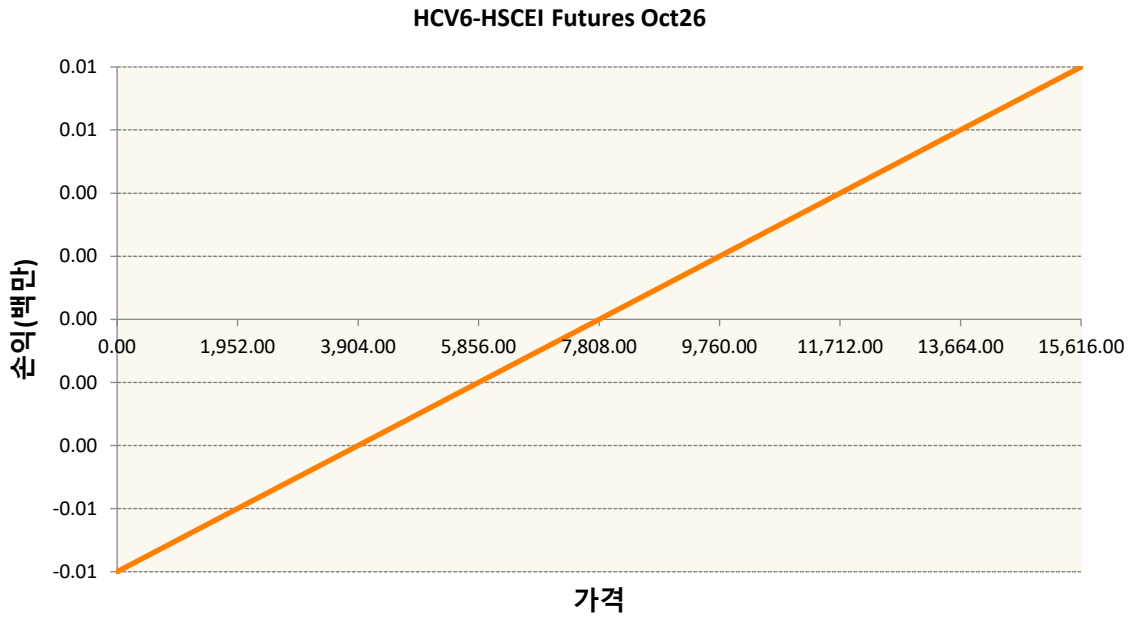
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,361	0	1,361	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCV6	HSCEI Futures Oct26	109

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

(단위:백만원)

103

공시일	2026-10-28
기준일	2026-10-27

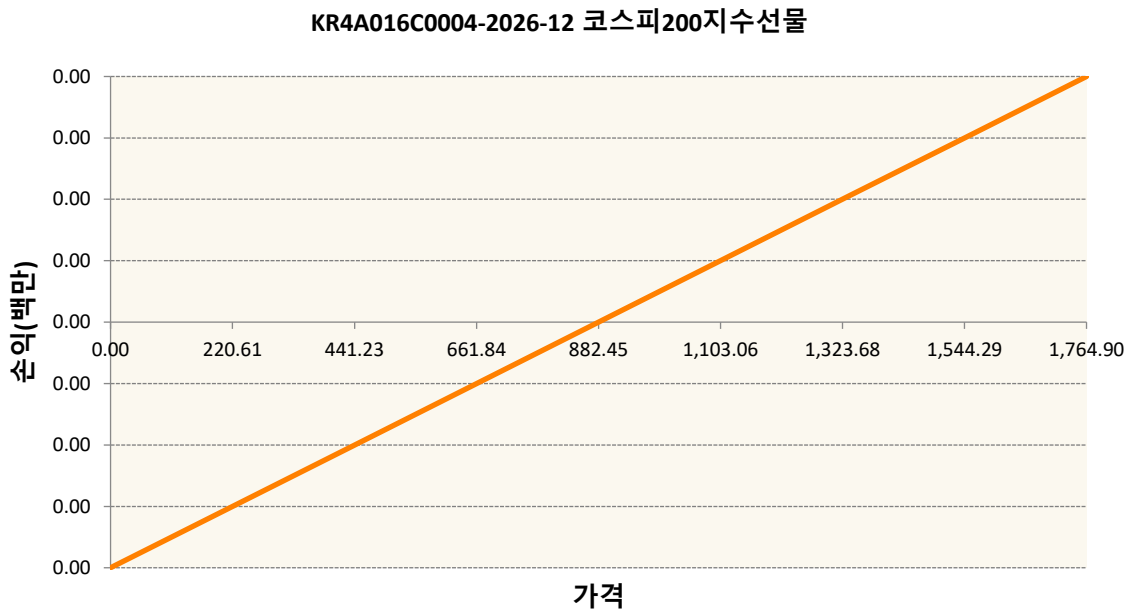
커버드콜모(주식혼합-파생형)

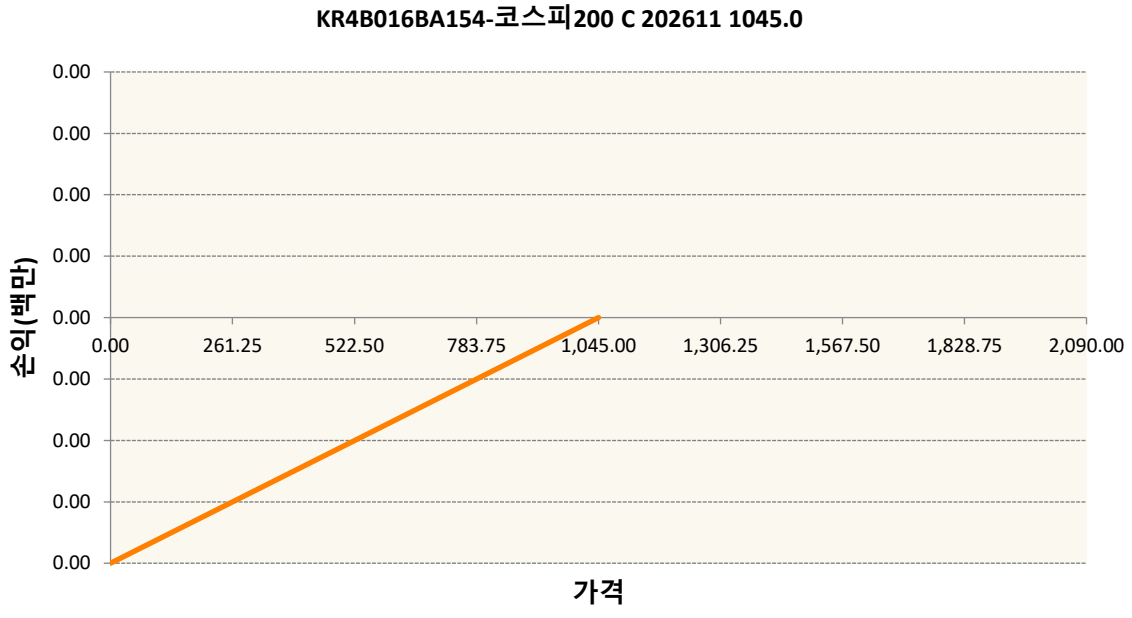
1. 계약금액

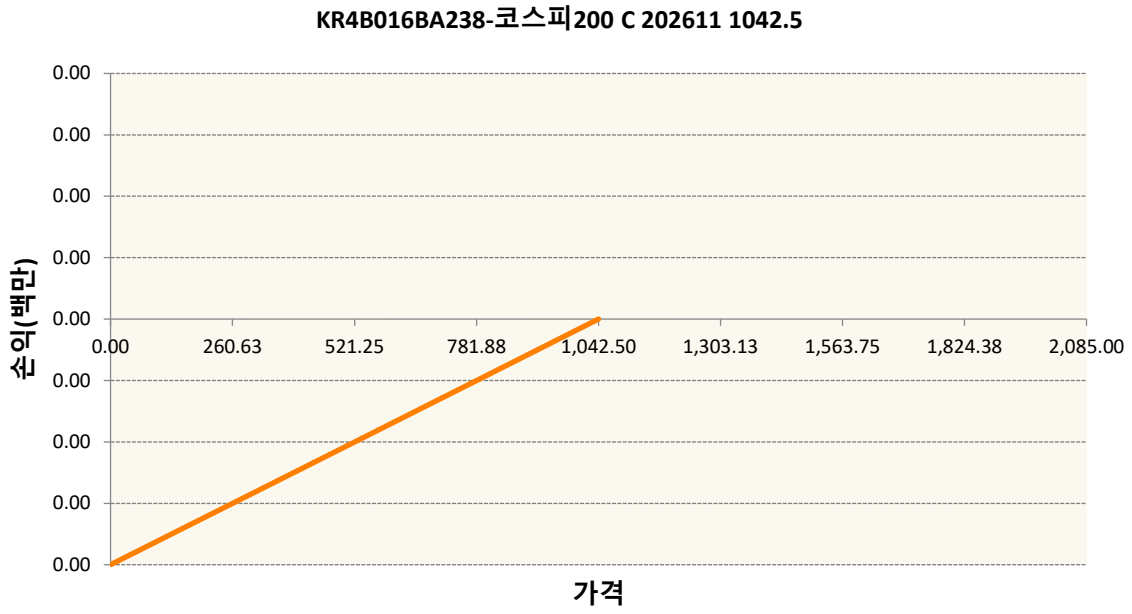
(단위:백만원)

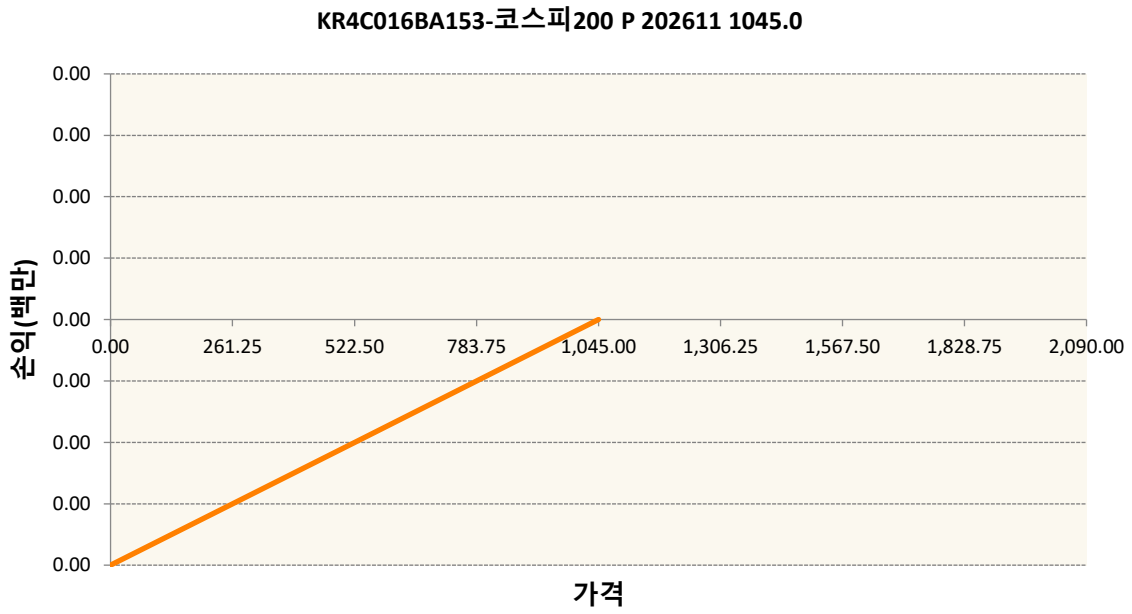
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	441	0	441	장내
누계	유가증권	옵션	0	49,876	-49,876	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A016C0004	2026-12 코스피200지수선물						35
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-35	-35	-35	-35	-35	-35	-35
-5.33%	-23	-23	-23	-23	-23	-23	-23
-2.67%	-12	-12	-12	-12	-12	-12	-12
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	12	12	12	12	12	12	12
5.33%	23	23	23	23	23	23	23
8.00%	35	35	35	35	35	35	35
KR4B016BA154	코스피200 C 202611 1045.0						2,007
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,957	-1,959	-1,962	-1,968	-1,978	-1,990	-2,007
-5.33%	-1,278	-1,282	-1,289	-1,300	-1,316	-1,336	-1,361
-2.67%	-601	-610	-623	-642	-667	-696	-731
0%	68	52	29	0	-36	-77	-124
2.67%	726	698	662	620	571	517	457
5.33%	1,362	1,319	1,268	1,210	1,147	1,079	1,006
8.00%	1,966	1,904	1,836	1,763	1,685	1,603	1,519
	KR4B016BA238		코스피200 C 202611 1042.5				640
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-623	-623	-625	-627	-630	-634	-640
-5.33%	-406	-408	-410	-414	-419	-426	-434
-2.67%	-191	-194	-198	-204	-212	-222	-234
0%	23	17	10	0	-12	-25	-40
2.67%	232	223	211	197	181	163	144
5.33%	434	420	403	384	364	341	318
8.00%	626	605	583	559	534	508	480
	KR4C016BA153		코스피200 P 202611 1045.0				658
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-641	-642	-643	-645	-648	-652	-658
-5.33%	-419	-420	-422	-426	-431	-438	-446
-2.67%	-197	-200	-204	-210	-218	-228	-240
0%	22	17	10	0	-12	-25	-40
2.67%	238	229	217	203	187	169	150
5.33%	446	432	415	396	376	353	330
8.00%	644	624	602	577	552	525	498

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

6,518

공시일	2026-10-28
기준일	2026-10-27

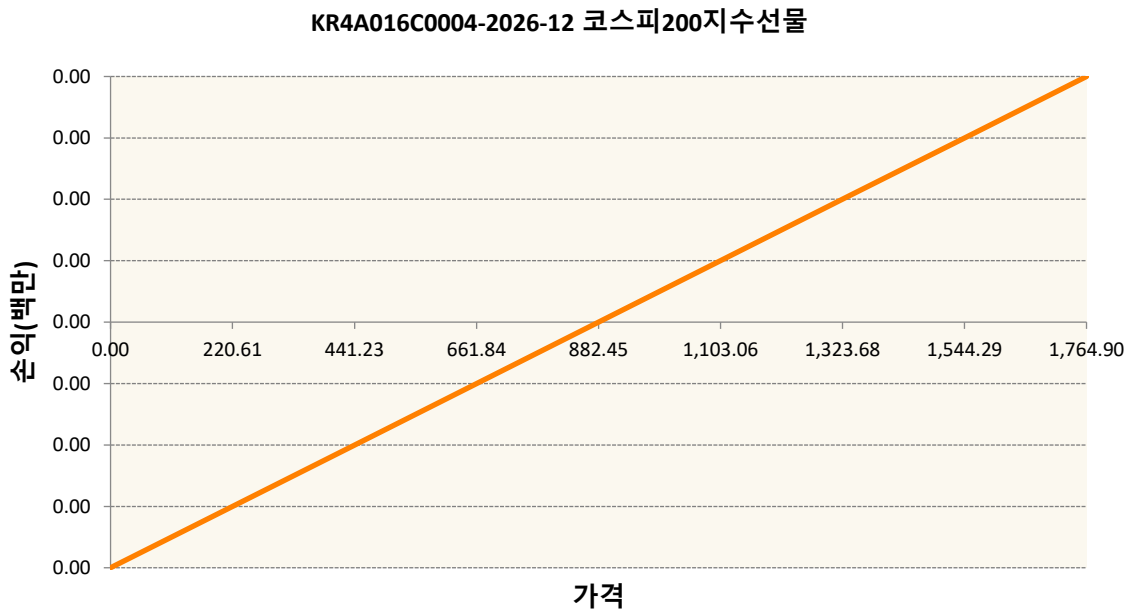
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

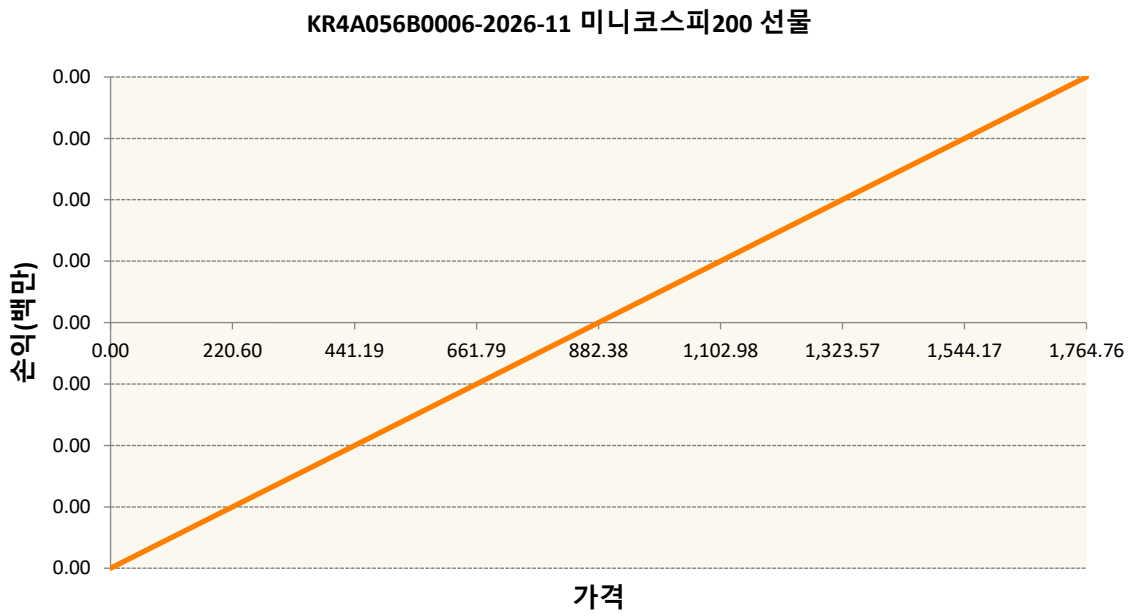
1. 계약금액

(단위:백만원)

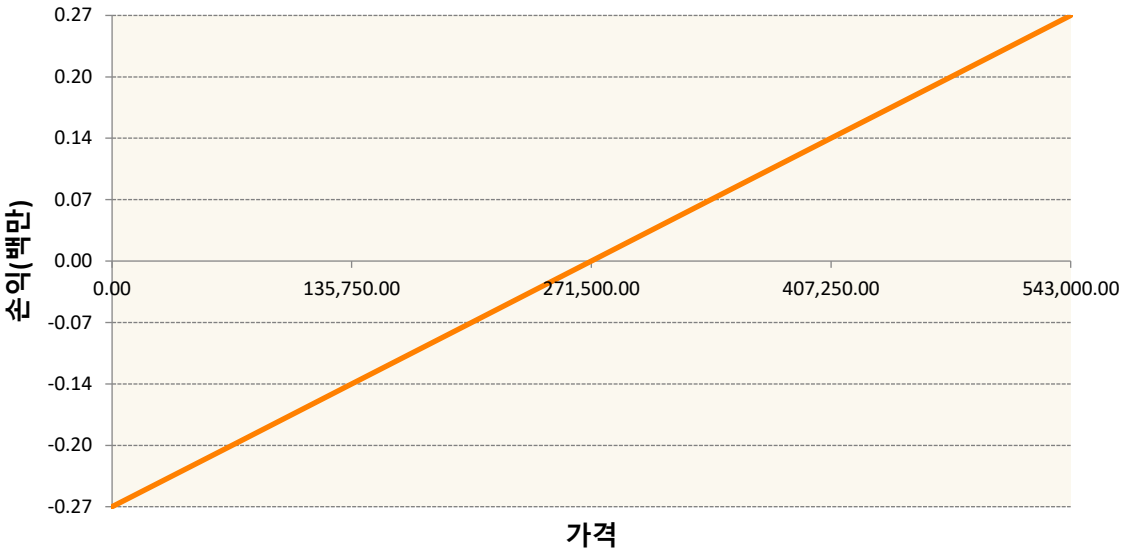
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	223	223	0	장내
누계	유가증권	선물	1,856	16	1,840	장내

2. 만기시점의 손익구조

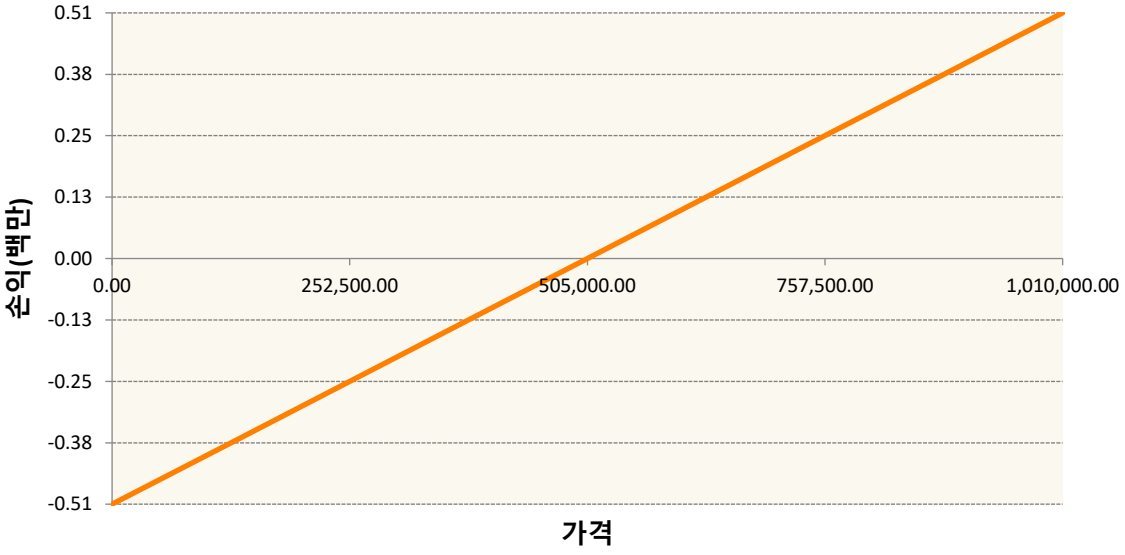




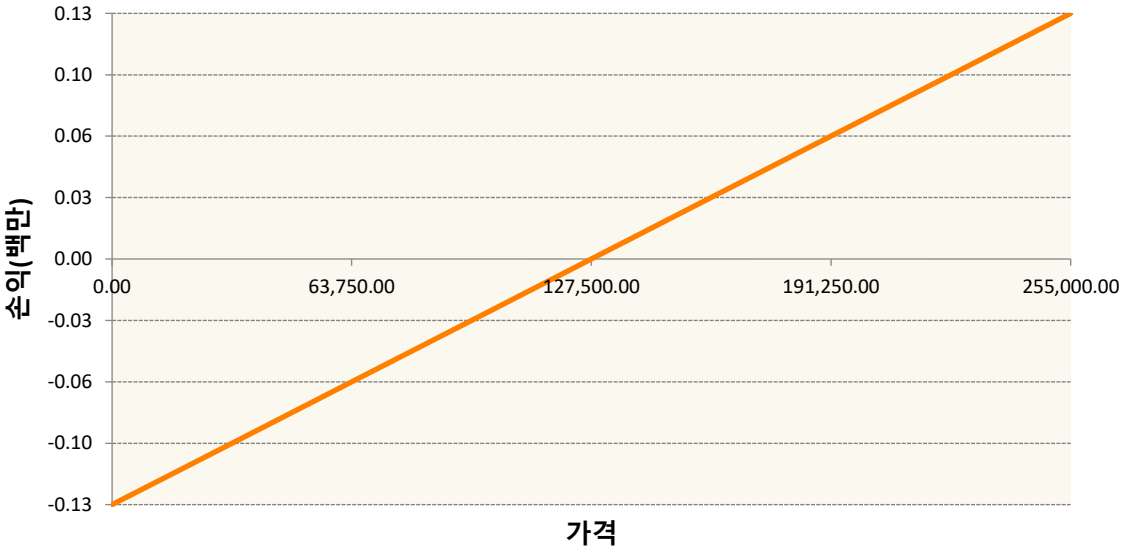
KR4A1Q6B0009-2026-11 에이피알개별선물

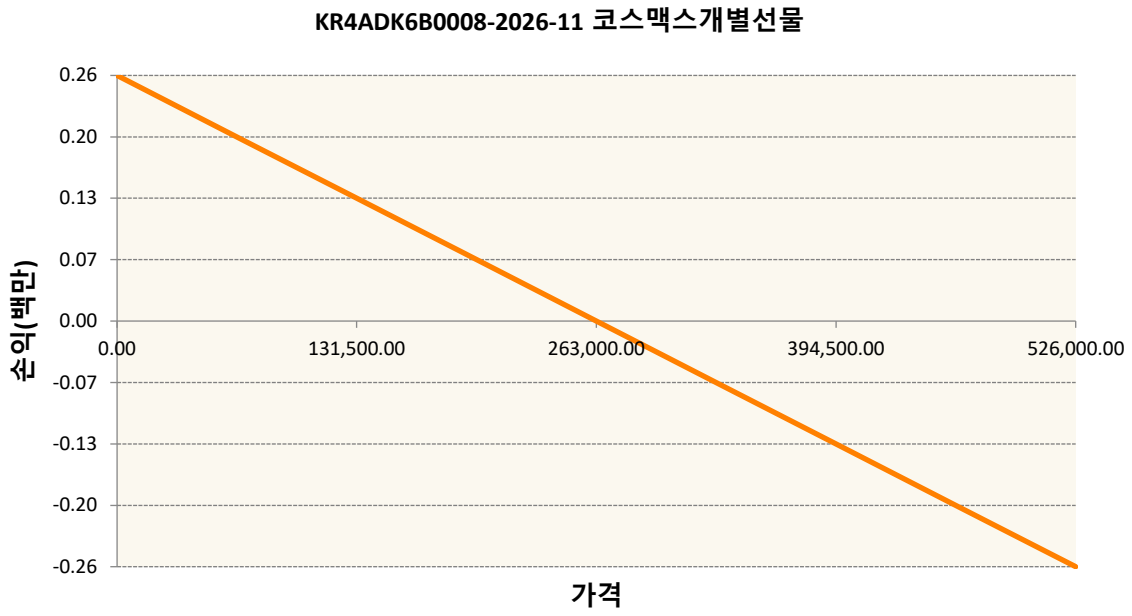


KR4A226B0001-2026-11 삼성SDI개별선물



KR4AB26B0009-2026-11 S-Oil개별선물





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

KR4A056B0006	2026-11 미니코스피200 선물						18
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-18	-18	-18	-18	-18	-18	-18
-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%	18	18	18	18	18	18	18

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)

253

공시일	2026-10-28
기준일	2026-10-27

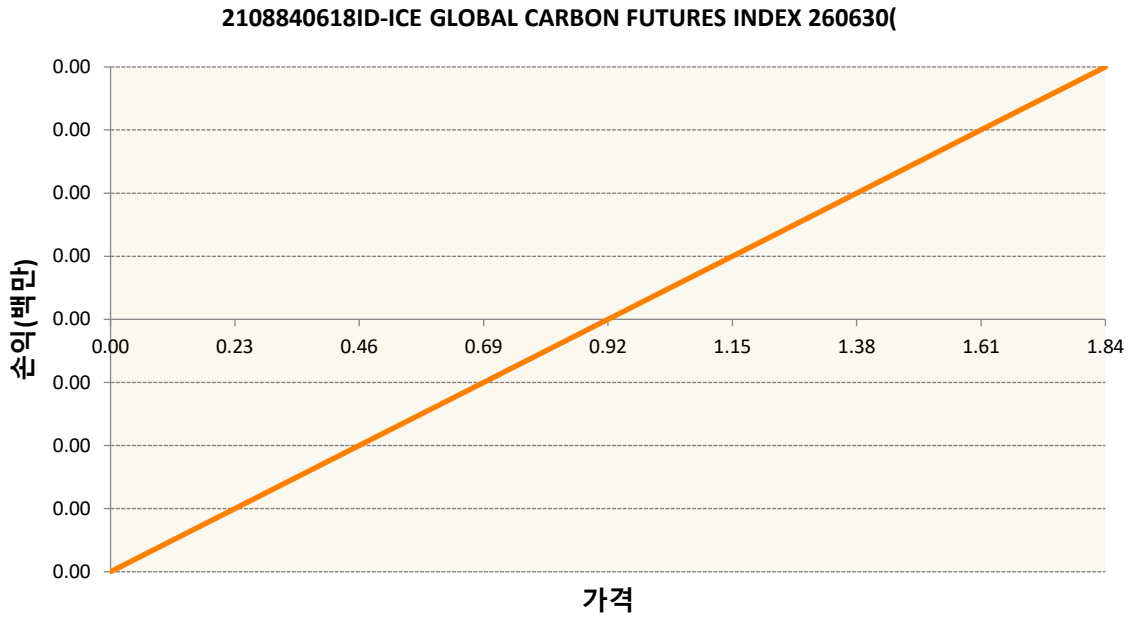
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

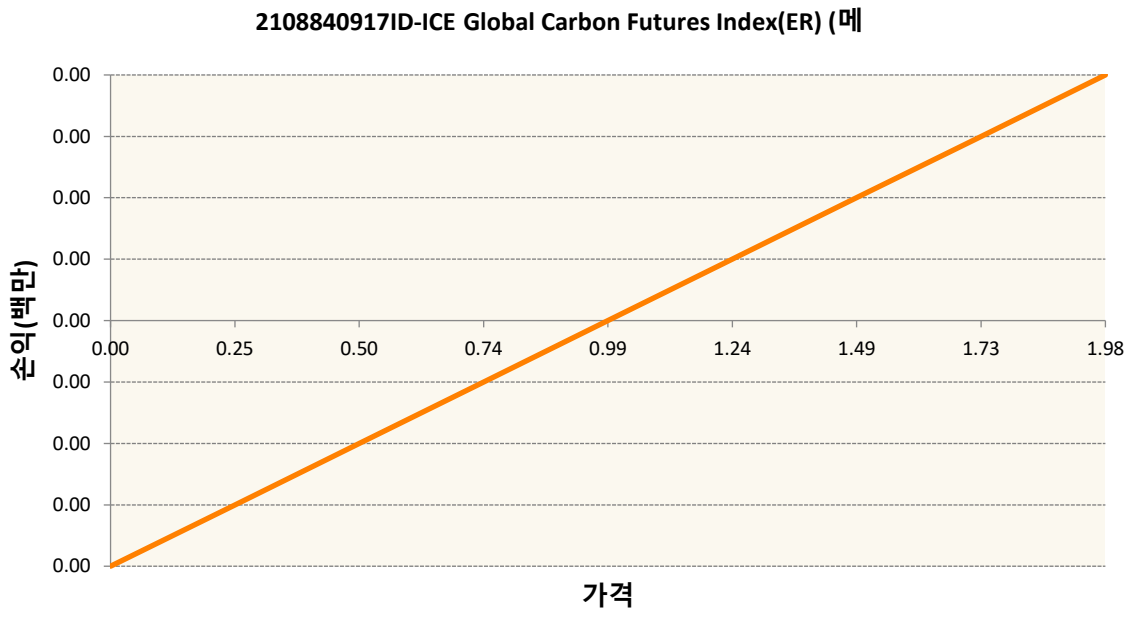
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	7,000	0	7,000	장외

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2108840618ICE GLOBAL CARBON FUTURES INDEX 260630(	447
2108840917ICE Global Carbon Futures Index(ER) (메	113

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

577

공시일	2026-10-28
기준일	2026-10-27

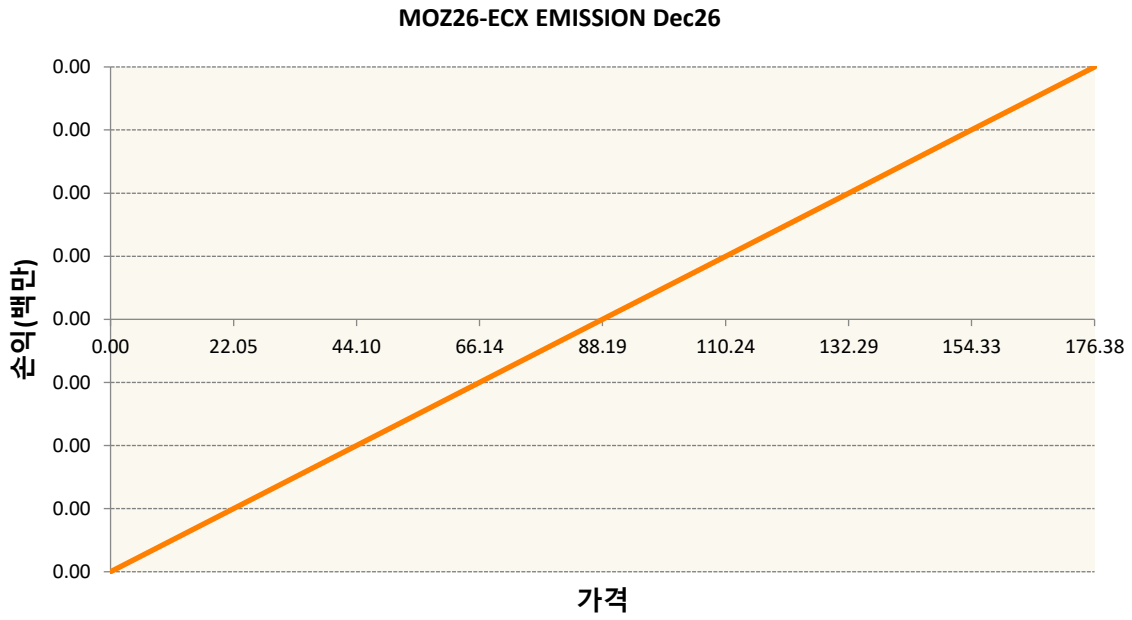
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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			6,209	0	6,209	
누계	통화	선도	0	2,453	-2,453	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213G9V	KRW/EUR 30-10-26E	196
MOZ26	ECX EMISSION Dec26	497

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

(단위:백만원)

730

공시일	2026-10-28
기준일	2026-10-27

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(	11
SWSOL0000(CSI PHOTOVOLTAIC INDUSTRY INDEX 260630(N	11
SWSOL0000(CSI PHOTOVOLTAIC INDUSTRY INDEX 260630(	16
SWSOL0000(CSI PHOTOVOLTAIC INDUSTRY INDEX 260923(	27

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

(단위:백만원)

99

공시일	2026-10-28
기준일	2026-10-27

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)	48
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 260714(미래)	326
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 260917(메리츠)	101

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

(단위:백만원)

898

공시일	2026-10-28
기준일	2026-10-27

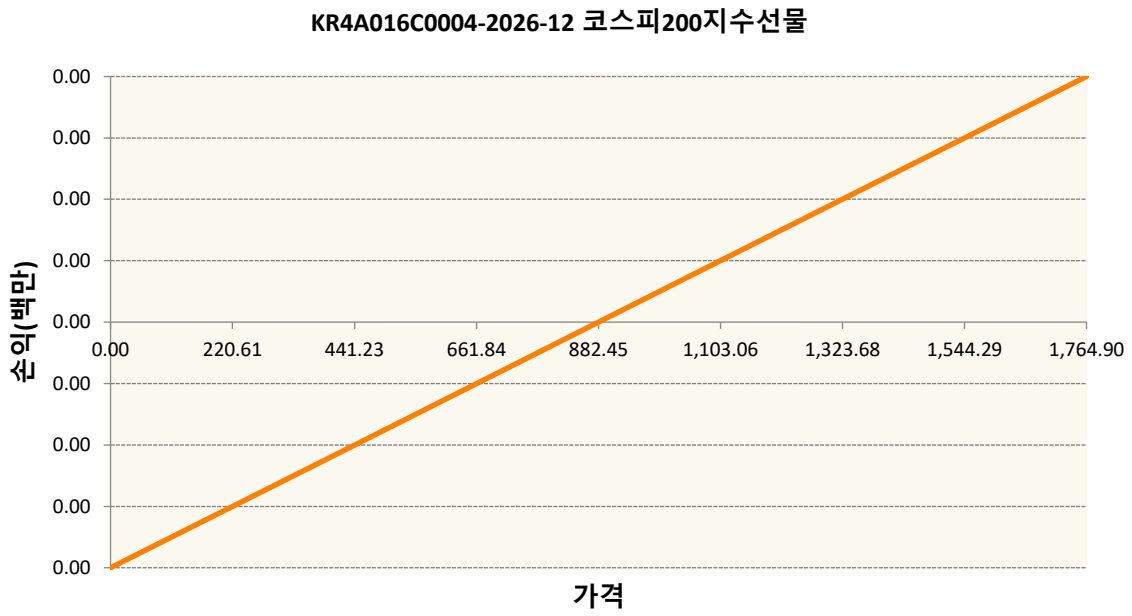
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

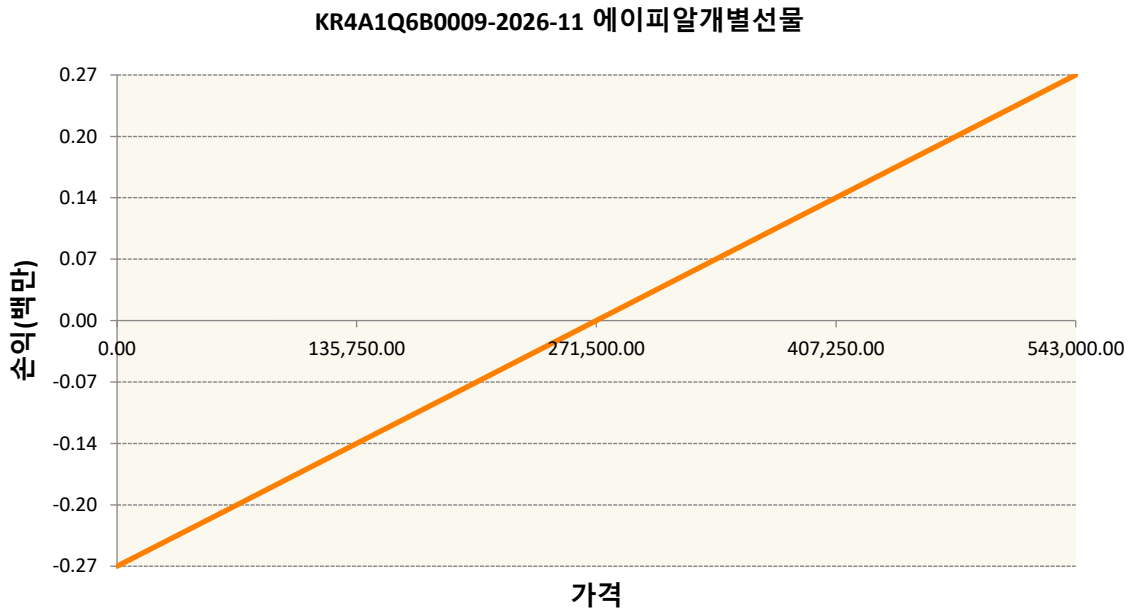
1. 계약금액

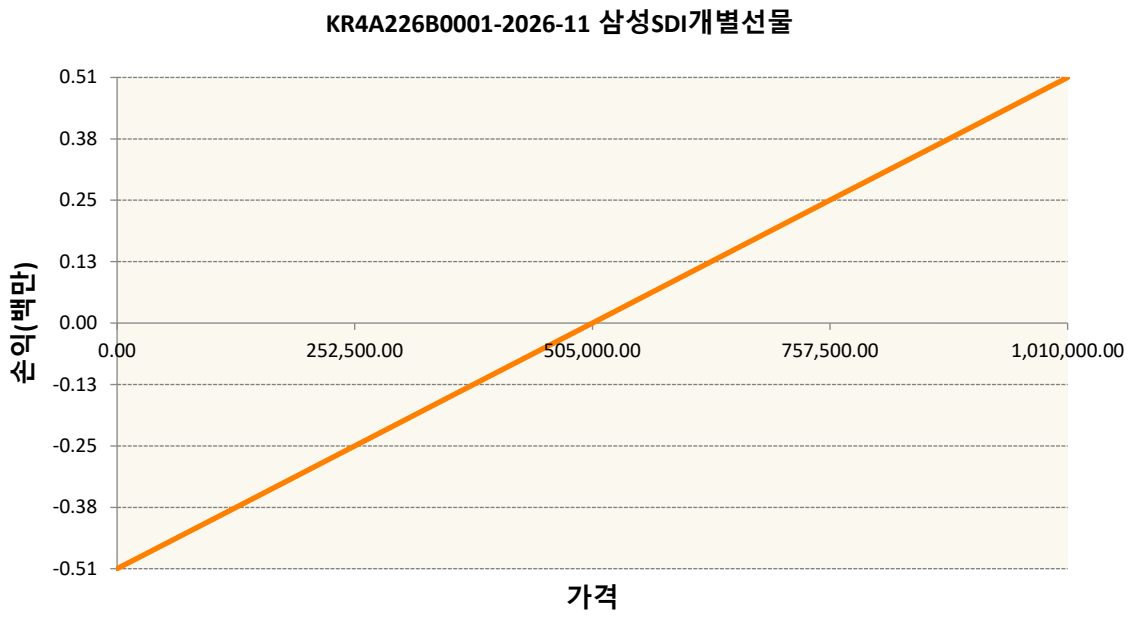
(단위:백만원)

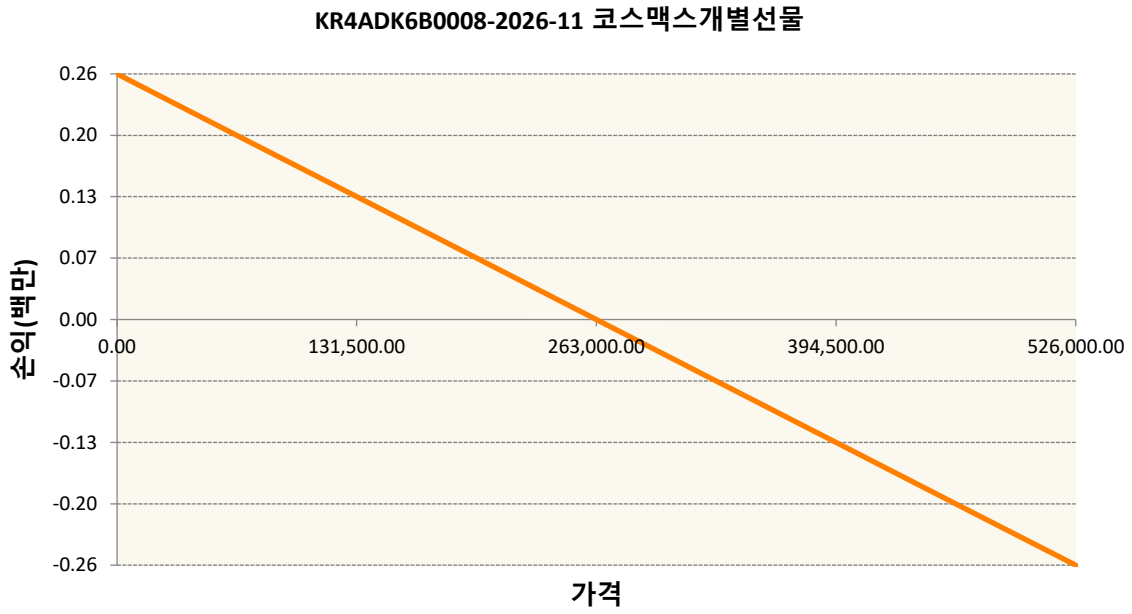
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	2,904	3,780	-876	장내
누계	유가증권	선물	8,455	263	8,192	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A016C0004	2026-12 코스피200지수선물						617
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-617	-617	-617	-617	-617	-617	-617
-5.33%	-411	-411	-411	-411	-411	-411	-411
-2.67%	-206	-206	-206	-206	-206	-206	-206
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	206	206	206	206	206	206	206
5.33%	411	411	411	411	411	411	411
8.00%	617	617	617	617	617	617	617
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				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
	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)

2,237

공시일	2026-10-28
기준일	2026-10-27

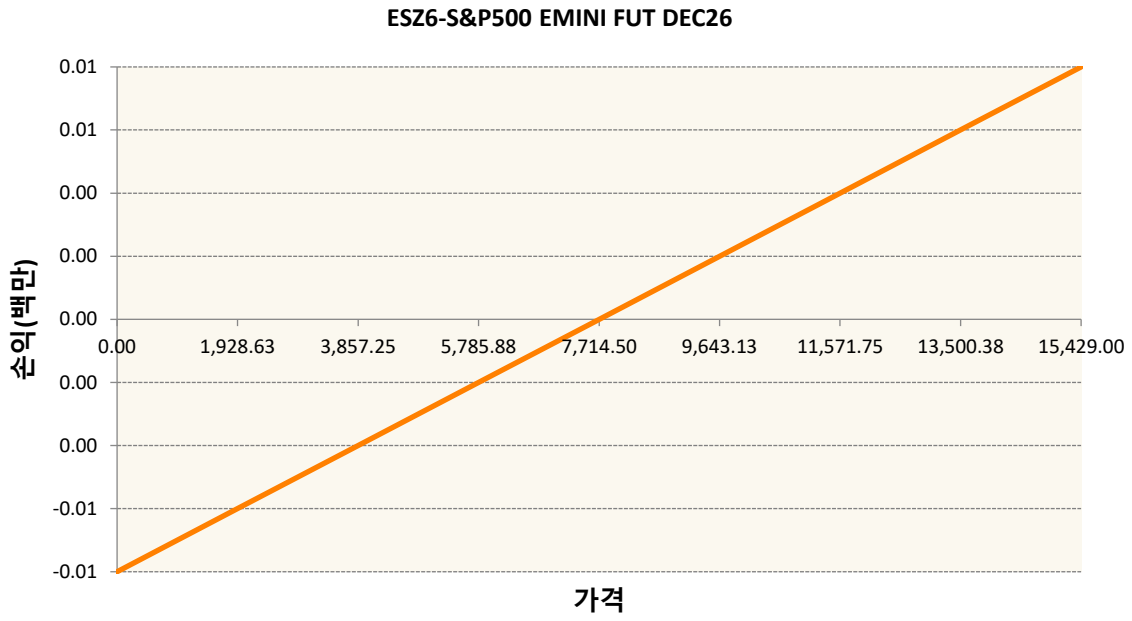
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

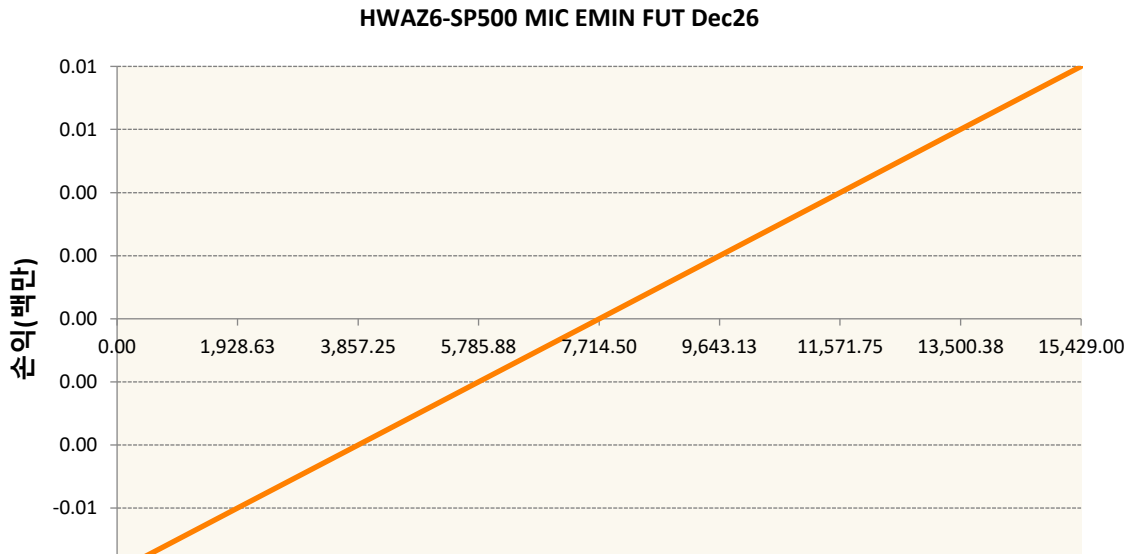
1. 계약금액

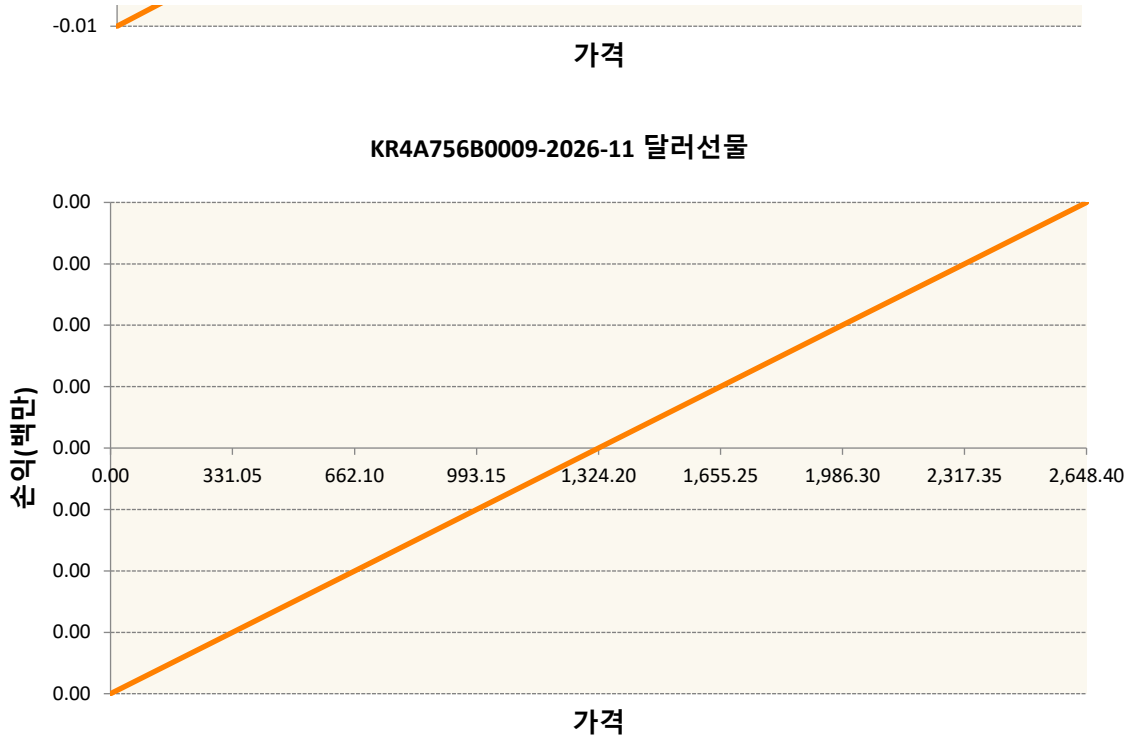
(단위:백만원)

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	78,709	0	78,709	
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	6,297
HWAZ6	SP500 MIC EMIN FUT Dec26	30
KR4A756B00	2026-11 달러선물	1,473

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

3,787

공시일	2026-10-28
기준일	2026-10-27

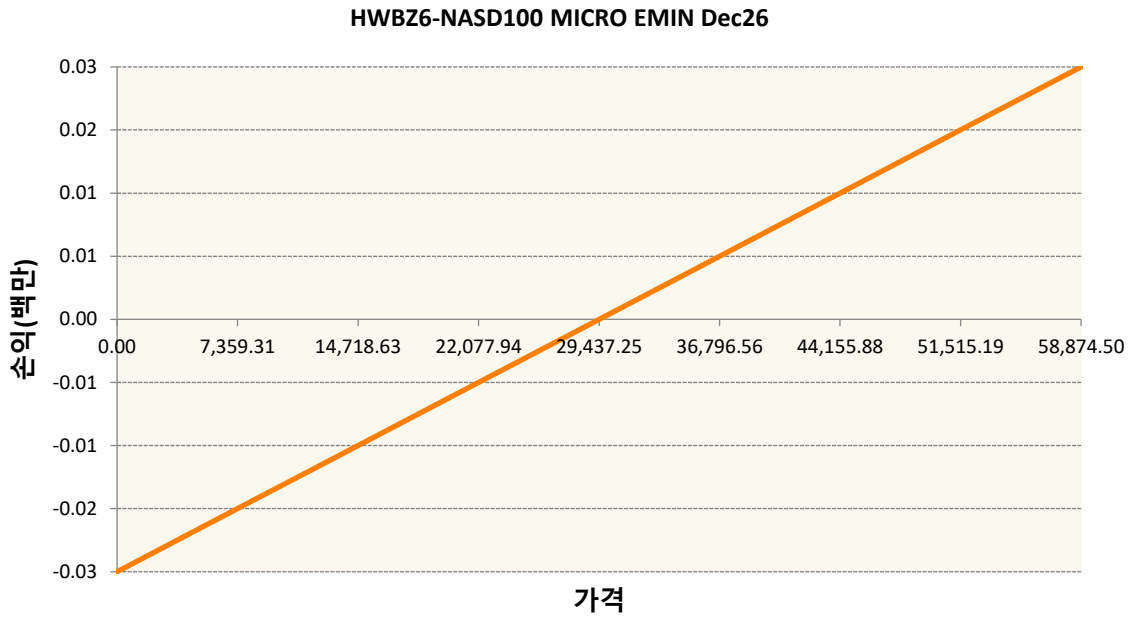
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

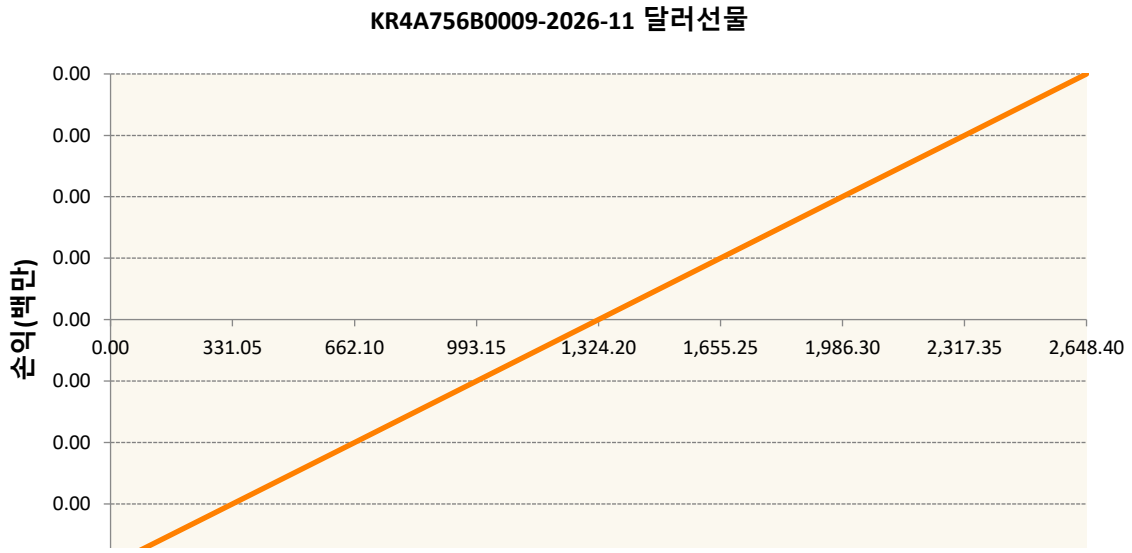
1. 계약금액

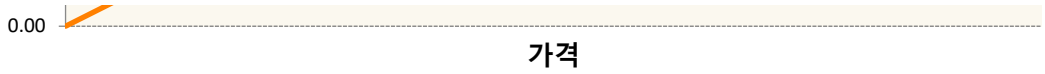
(단위:백만원)

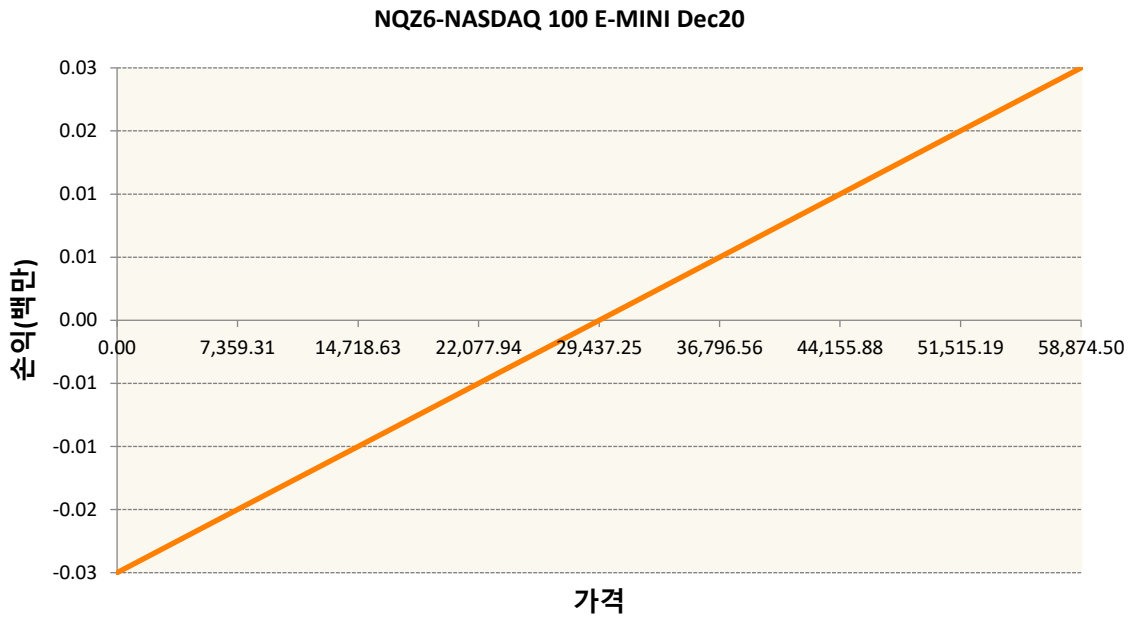
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
신규	지수	선물	0	0	0	장내
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	지수	선물	34,954	0	34,954	
누계	지수	선물	407	0	407	장내
누계	통화	선물	8,554	0	8,554	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HWBZ6	NASD100 MICRO EMIN Dec26	33
KR4A756B00	2026-11 달러선물	684
NQZ6	NASDAQ 100 E-MINI Dec20	2,796

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

2,533

공시일	2026-10-28
기준일	2026-10-27

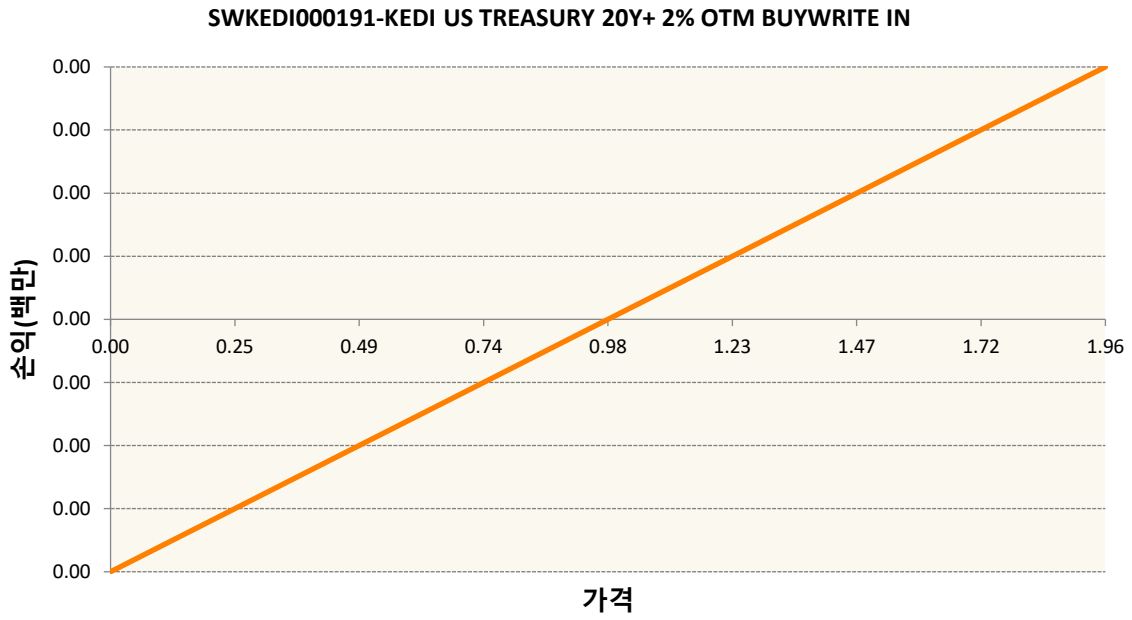
SOL미국30년국채커버드콜(합성)

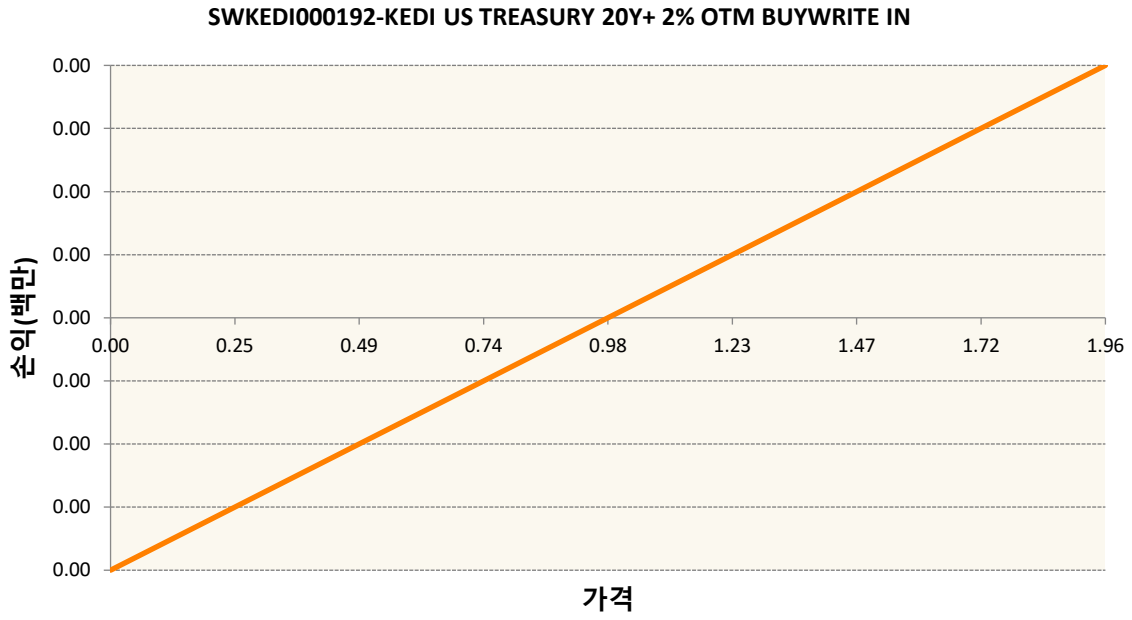
1. 계약금액

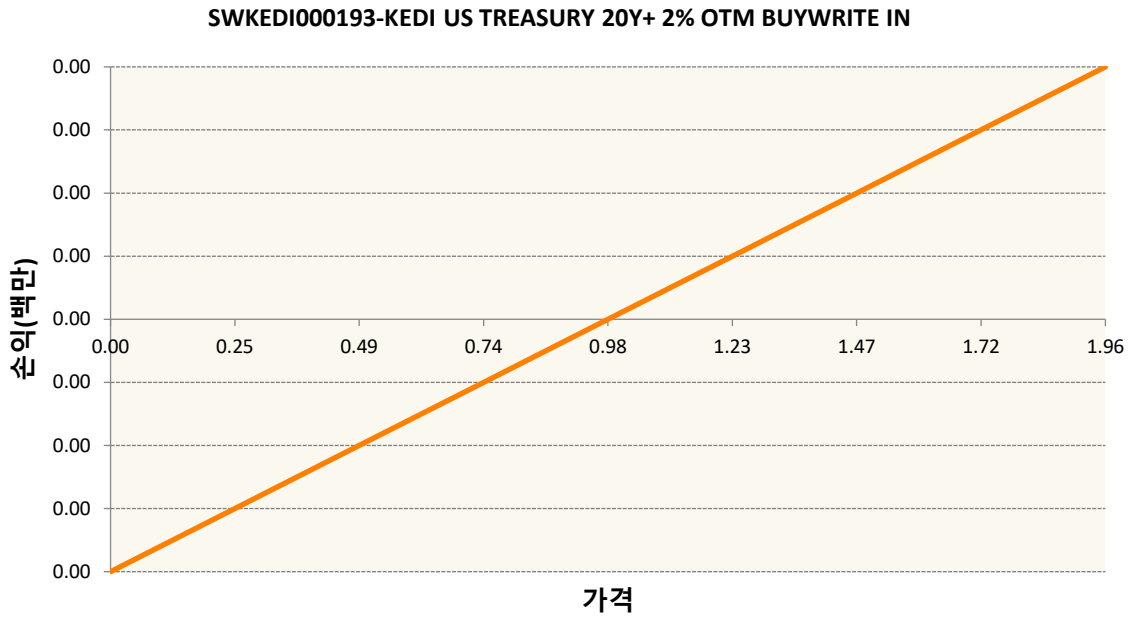
(단위:백만원)

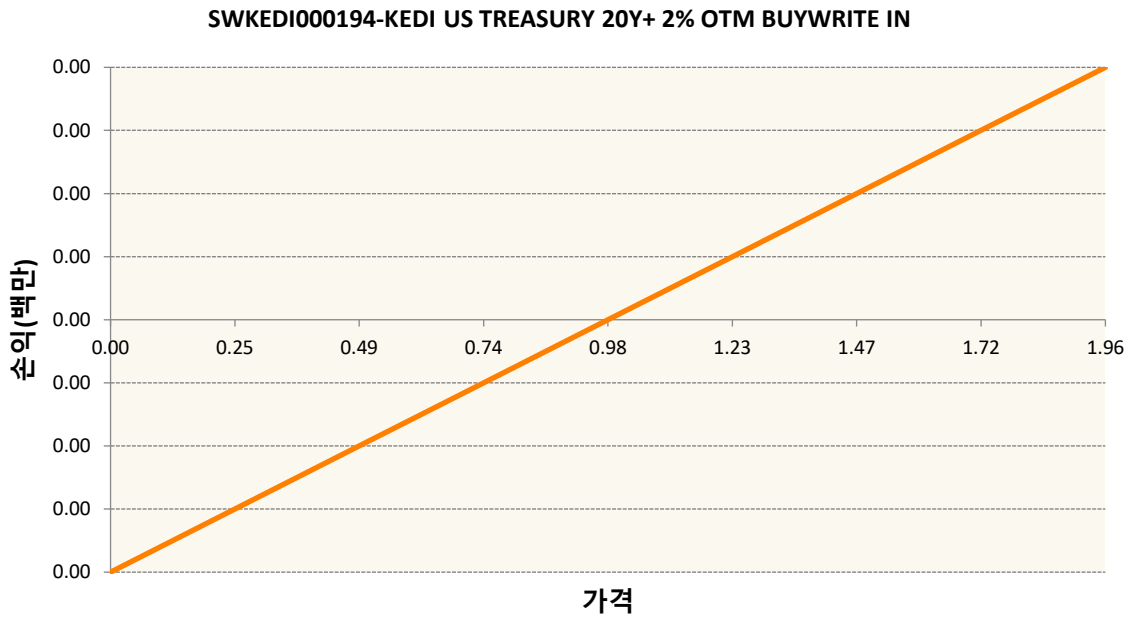
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	273,840	0	273,840	장외

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	2,664
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	4,739
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	6,889
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	7,536

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

8,593