공시일	2026-11-02
기준일	2026-10-30

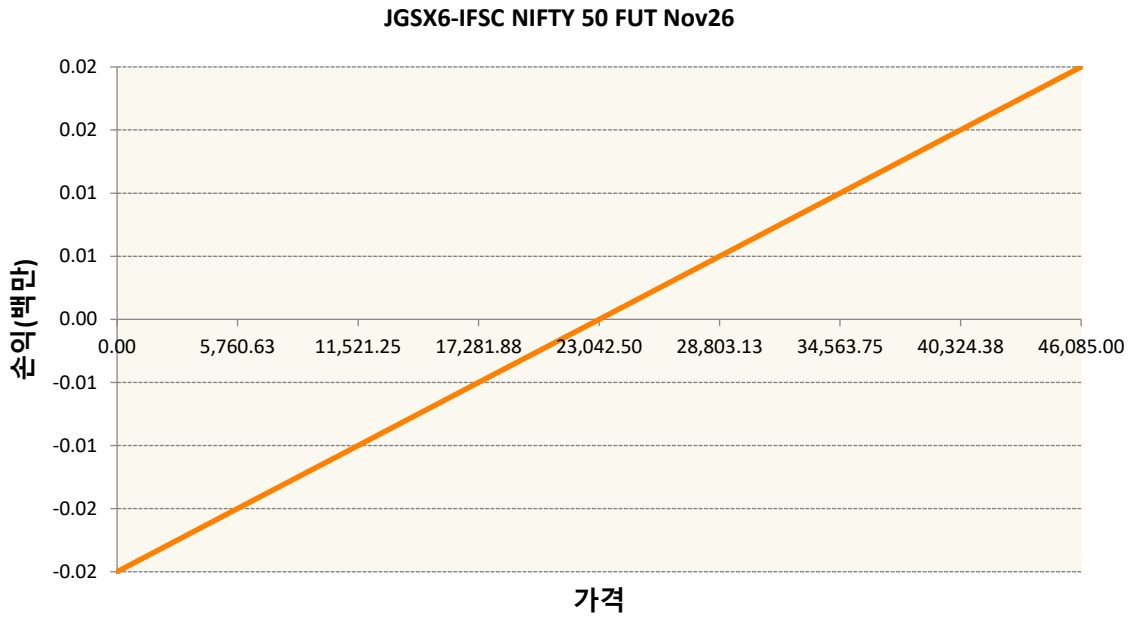
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	305	0	305	

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	2026-11-02
기준일	2026-10-30

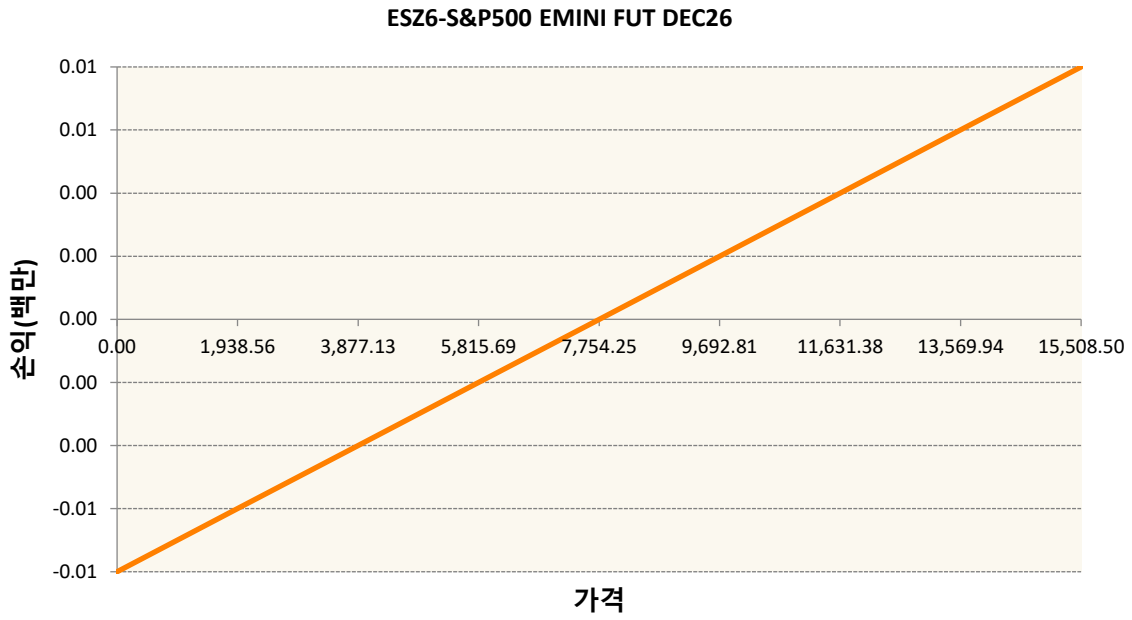
SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	536	0	536	

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)

25

공시일	2026-11-02
기준일	2026-10-30

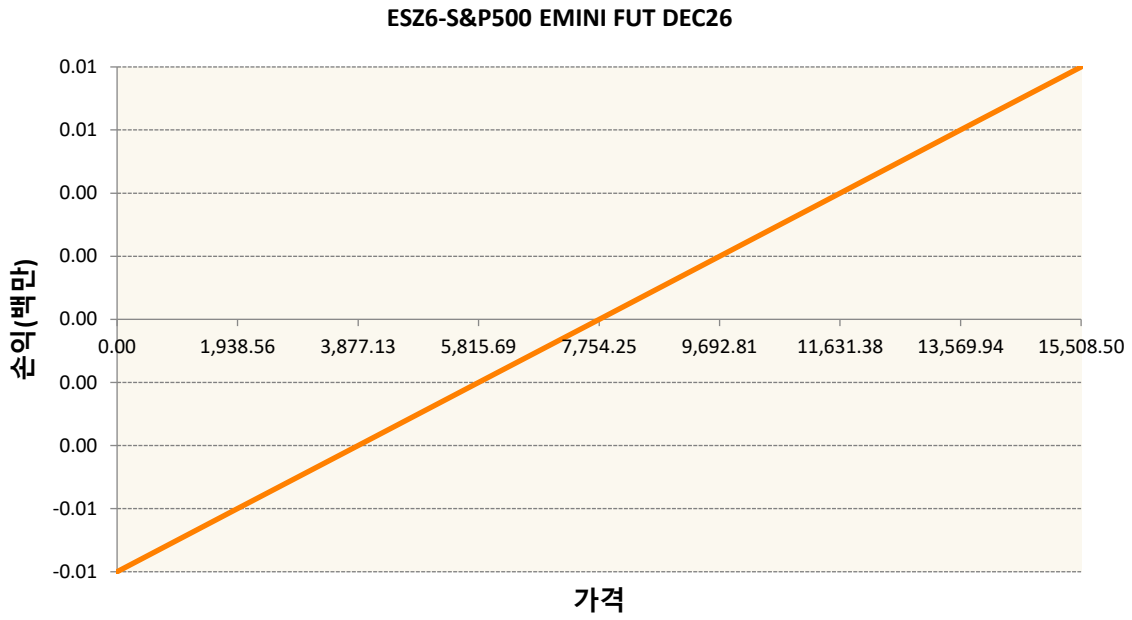
SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	536	0	536	

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)

25

공시일	2026-11-02
기준일	2026-10-30

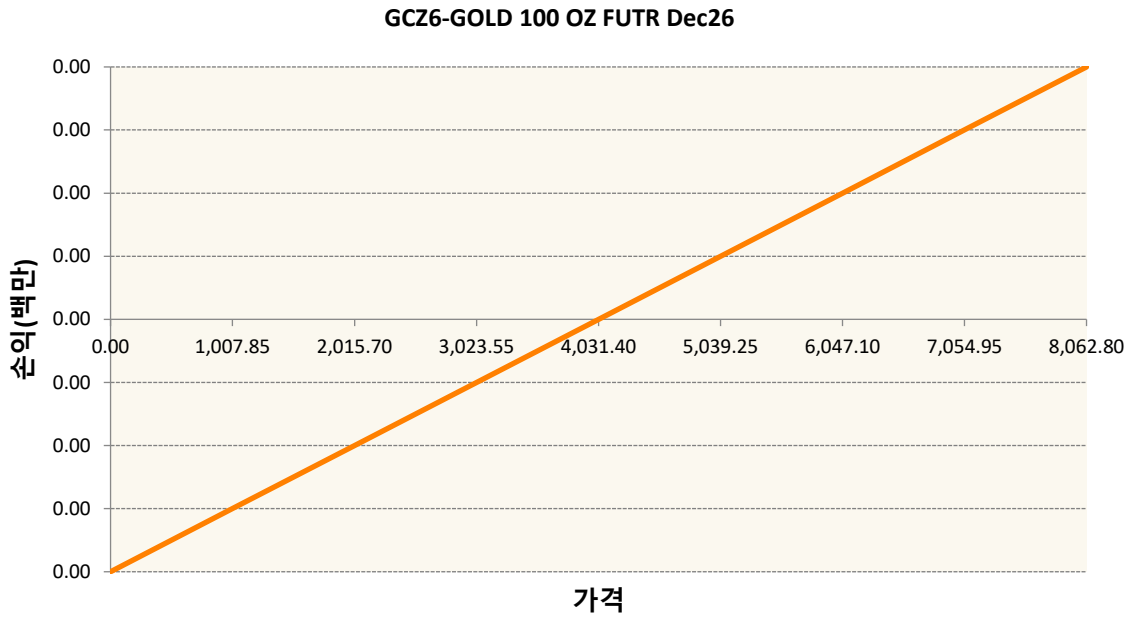
SOL골드커버드콜액티브특별자산상장지수(금

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			5,756	0	5,756	
누계	실물자산	옵션	0	0	0	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

AOGLDUSAC	GLD US 10/30/26 C375 EQUITY	4
GCZ6	GOLD 100 OZ FUTR Dec26	460

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

(단위:백만원)

590

공시일	2026-11-02
기준일	2026-10-30

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	232
AOPLTRAP2(PLTR US 10/30/26 P202.5 EQUITY	20

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

(단위:백만원)

871

공시일	2026-11-02
기준일	2026-10-30

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	6

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

(단위:백만원)

3

공시일	2026-11-02
기준일	2026-10-30

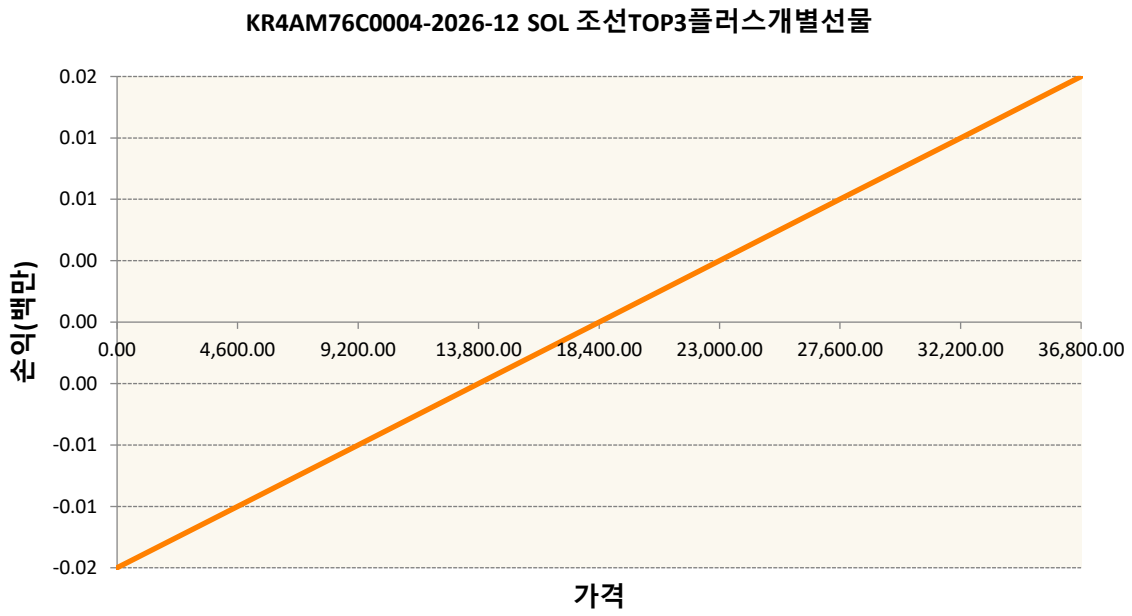
SOL조선TOP3플러스레버리지상장지수(주식)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	1	-1	장내
누계	유가증권	선물	5,174	0	5,174	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4AM76C0004	2026-12 SOL 조선TOP3플러스개별선물						4,123
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-4,123	-4,123	-4,123	-4,123	-4,123	-4,123	-4,123
-5.33%	-2,749	-2,749	-2,749	-2,749	-2,749	-2,749	-2,749
-2.67%	-1,374	-1,374	-1,374	-1,374	-1,374	-1,374	-1,374
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	1,374	1,374	1,374	1,374	1,374	1,374	1,374
5.33%	2,749	2,749	2,749	2,749	2,749	2,749	2,749
8.00%	4,123	4,123	4,123	4,123	4,123	4,123	4,123

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

7,103

공시일	2026-11-02
기준일	2026-10-30

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	2026-11-02
기준일	2026-10-30

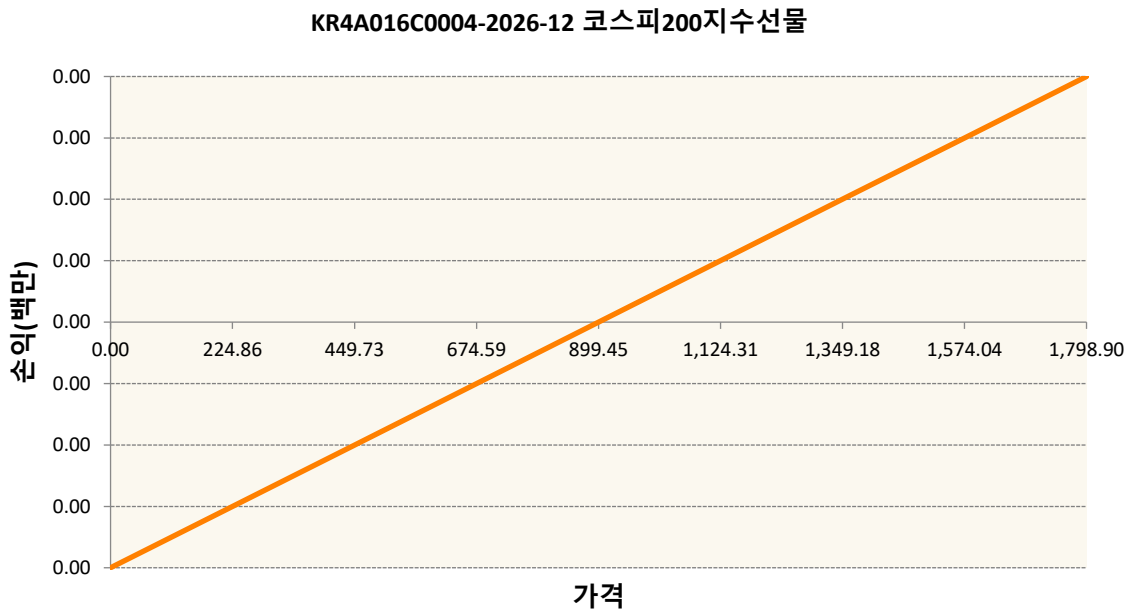
SOL 200타겟위클리커버드콜상장지수(주식)

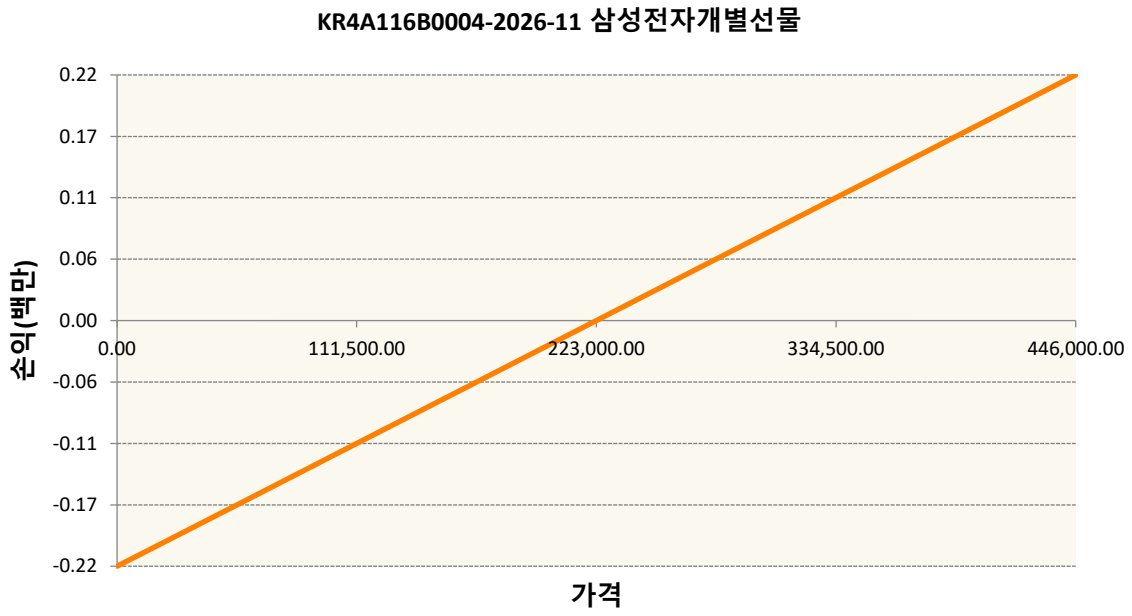
1. 계약금액

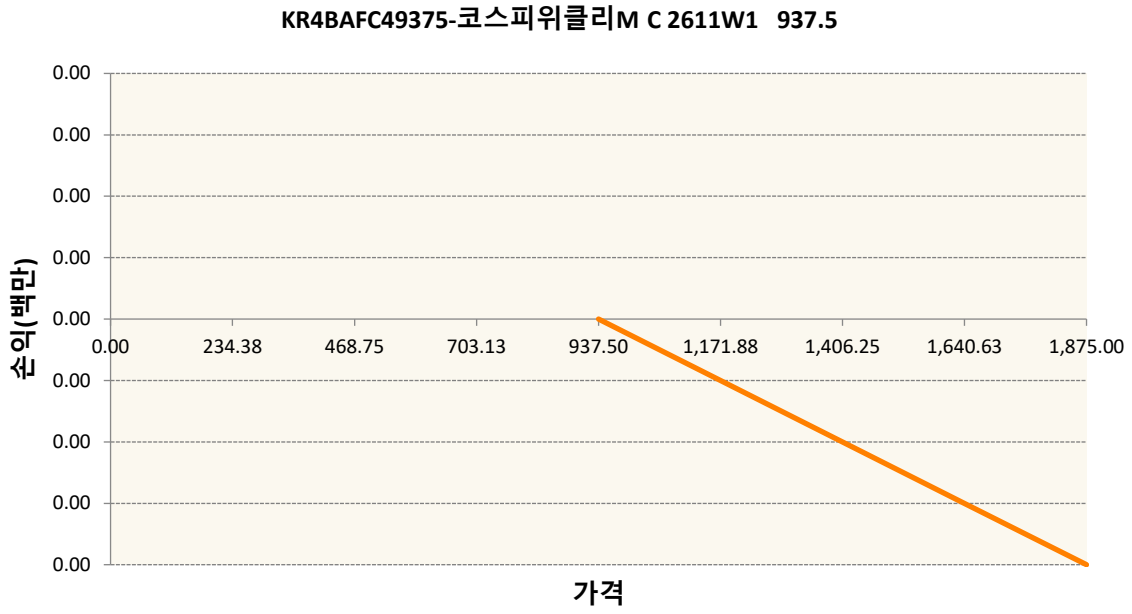
(단위:백만원)

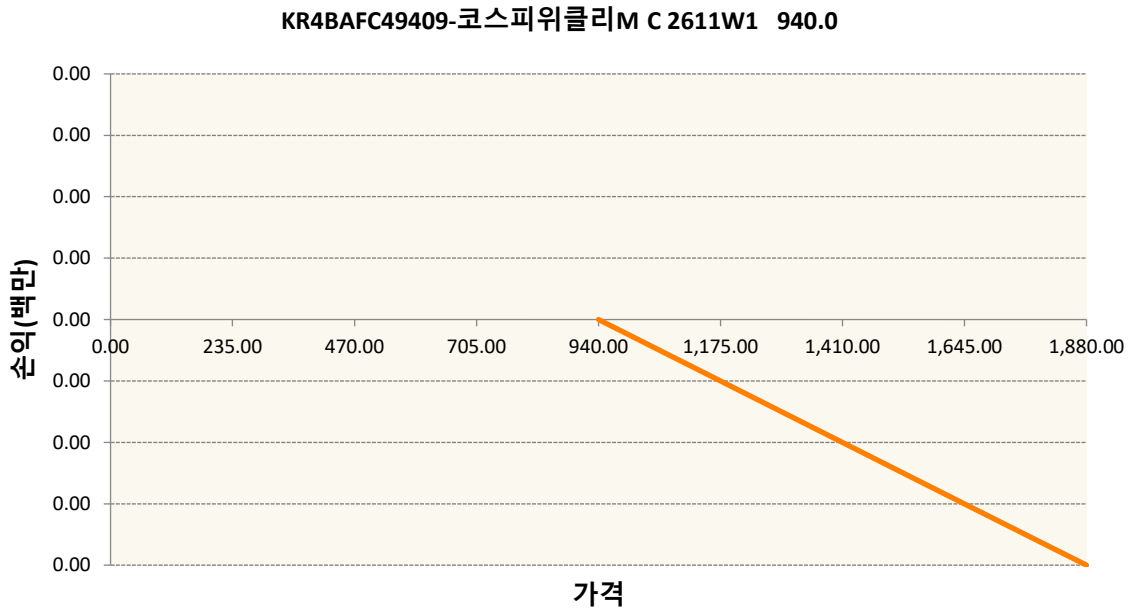
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	17,888	0	17,888	장내
누계	유가증권	옵션	0	46,691	-46,691	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

	KR4A016C0004	2026-12 코스피200지수선물					468
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-468	-468	-468	-468	-468	-468	-468
-5.33%	-312	-312	-312	-312	-312	-312	-312
-2.67%	-156	-156	-156	-156	-156	-156	-156
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	156	156	156	156	156	156	156
5.33%	312	312	312	312	312	312	312
8.00%	468	468	468	468	468	468	468
	KR4A116B0004	2026-11 삼성전자개별선물					972
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-972	-972	-972	-972	-972	-972	-972
-5.33%	-648	-648	-648	-648	-648	-648	-648
-2.67%	-324	-324	-324	-324	-324	-324	-324
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	324	324	324	324	324	324	324
5.33%	648	648	648	648	648	648	648
8.00%	972	972	972	972	972	972	972
	KR4BAFC49375		코스피위클리M C 2611W1	937.5			1,184
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	176	176	174	172	169	164	158
-5.33%	174	171	165	158	148	136	122
-2.67%	159	146	131	112	91	67	41
0%	95	66	34	0	-36	-73	-111
2.67%	-84	-129	-174	-220	-267	-313	-360
5.33%	-434	-481	-528	-575	-623	-671	-719
8.00%	-955	-988	-1,024	-1,062	-1,102	-1,143	-1,184
	KR4BAFC49409		코스피위클리M C 2611W1	940.0			772
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	108	108	107	106	104	101	97
-5.33%	107	105	102	98	92	84	75
-2.67%	98	91	82	70	56	41	24
0%	60	42	22	0	-23	-47	-72
2.67%	-50	-79	-109	-140	-170	-201	-233
5.33%	-272	-304	-336	-369	-401	-433	-466
8.00%	-611	-635	-661	-687	-715	-743	-772

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

8,172

공시일	2026-11-02
기준일	2026-10-30

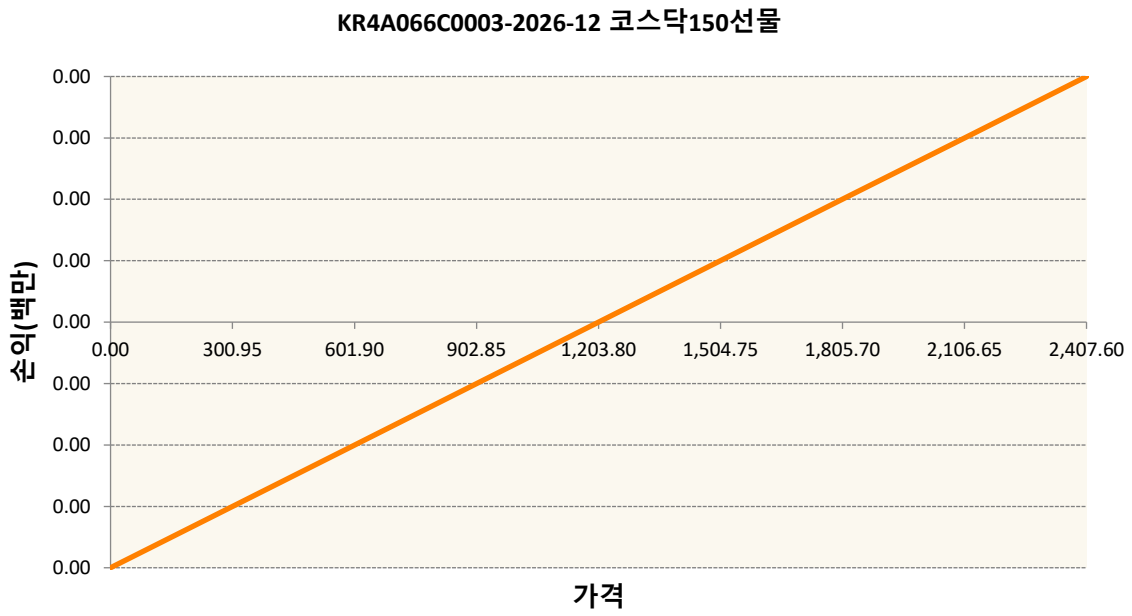
SOL코스닥150인덱스(주식-파생형)

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	482	0	482	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)

128

공시일	2026-11-02
기준일	2026-10-30

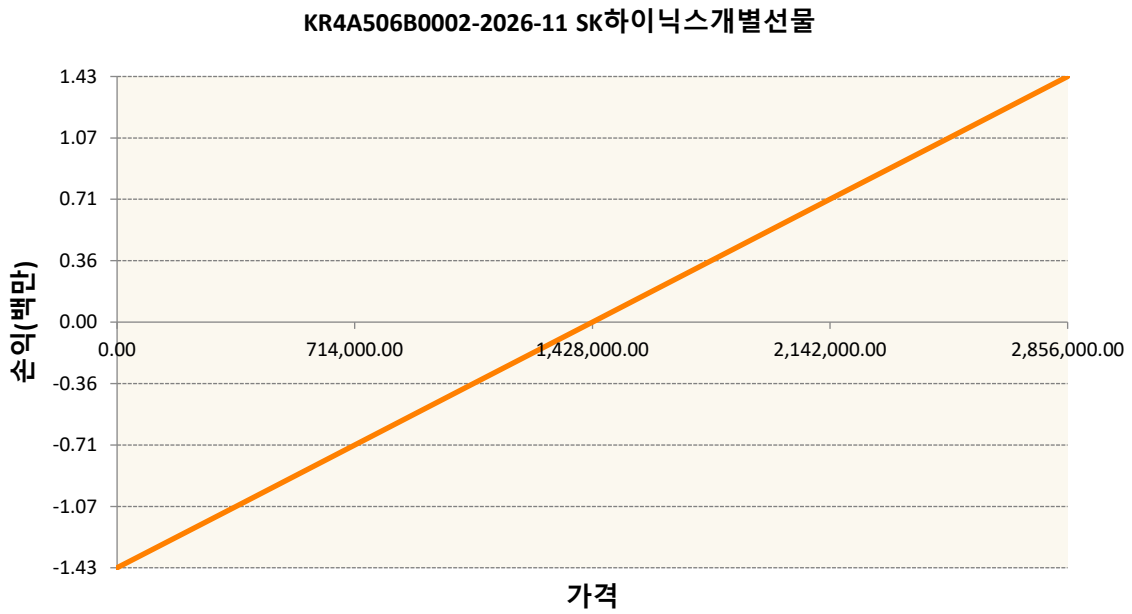
SOLSK하이닉스단일종목레버리지상장지수

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	2,242	-2,242	장내
누계	유가증권	선물	27,632	0	27,632	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A506B0002	2026-11 SK하이닉스개별선물	2,195

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-2,195	-2,195	-2,195	-2,195	-2,195	-2,195	-2,195
-5.33%	-1,463	-1,463	-1,463	-1,463	-1,463	-1,463	-1,463
-2.67%	-732	-732	-732	-732	-732	-732	-732
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	732	732	732	732	732	732	732
5.33%	1,463	1,463	1,463	1,463	1,463	1,463	1,463
8.00%	2,195	2,195	2,195	2,195	2,195	2,195	2,195

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

10,729

공시일	2026-11-02
기준일	2026-10-30

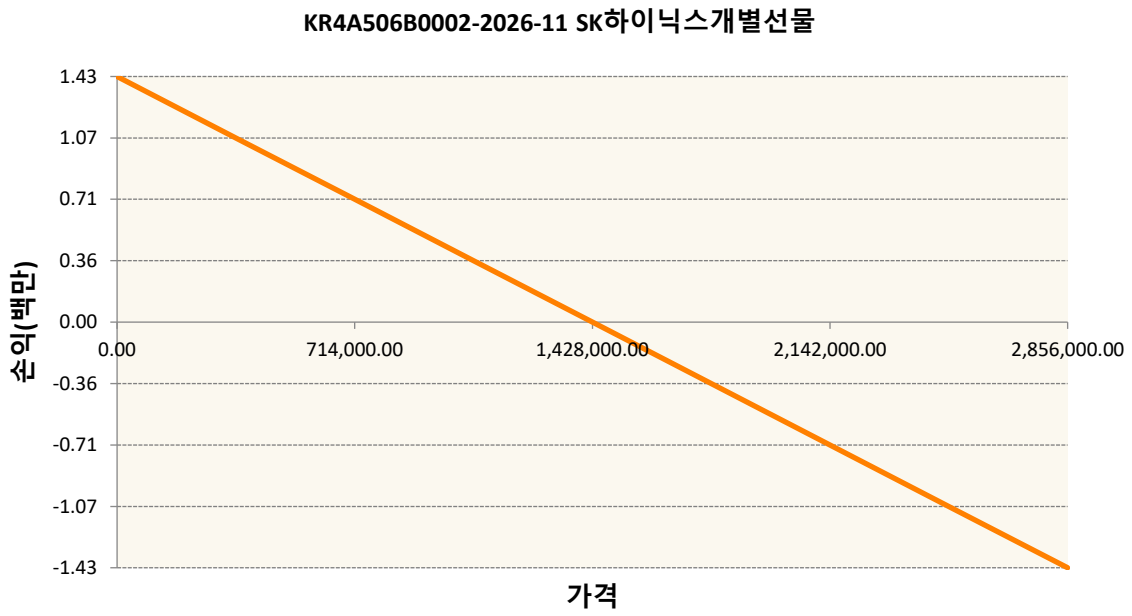
SOLSK하이닉스선물단일종목인버스2X상장지

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	1,326	29,187	-27,861	장내
누계	유가증권	선물	0	185,097	-185,097	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A506B0002	2026-11 SK하이닉스개별선물	14,704

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	14,704	14,704	14,704	14,704	14,704	14,704	14,704
-5.33%	9,803	9,803	9,803	9,803	9,803	9,803	9,803
-2.67%	4,901	4,901	4,901	4,901	4,901	4,901	4,901
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-4,901	-4,901	-4,901	-4,901	-4,901	-4,901	-4,901
5.33%	-9,803	-9,803	-9,803	-9,803	-9,803	-9,803	-9,803
8.00%	-14,704	-14,704	-14,704	-14,704	-14,704	-14,704	-14,704

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

71,873

공시일	2026-11-02
기준일	2026-10-30

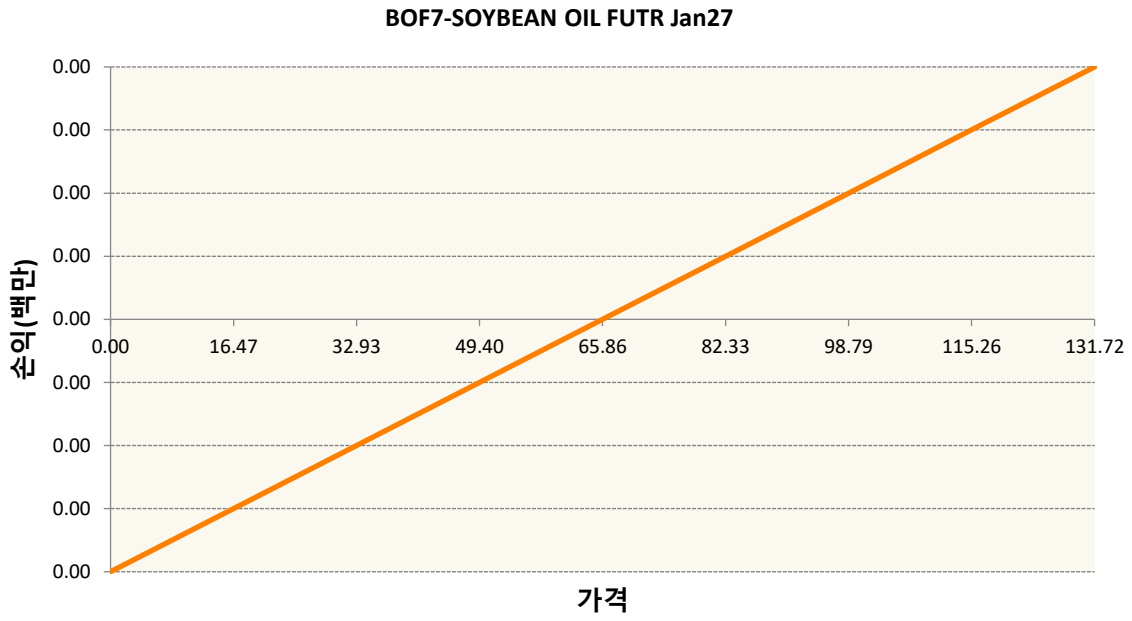
포커스농산물모(채권-파생형)

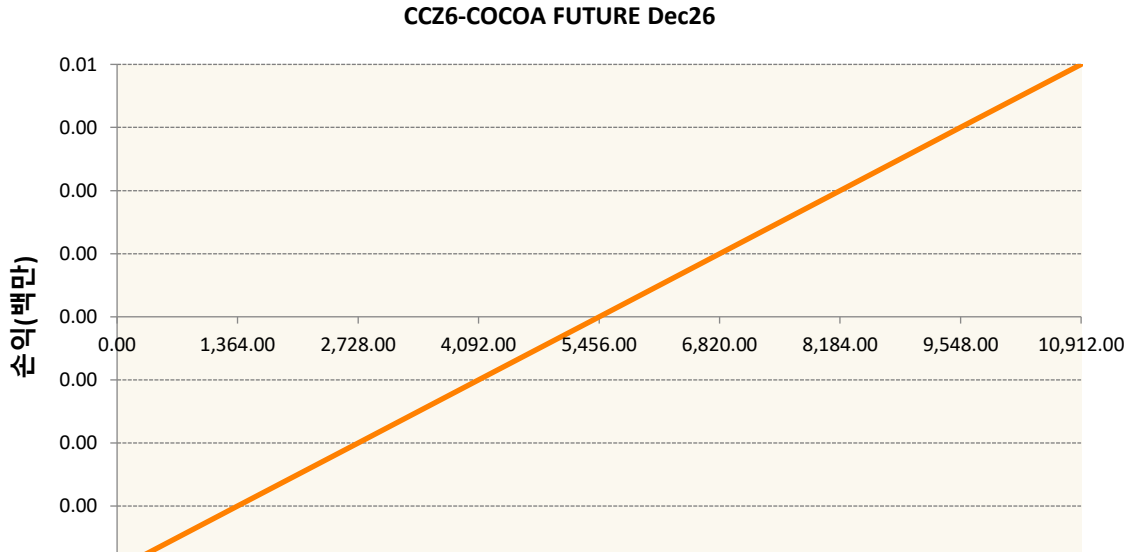
1. 계약금액

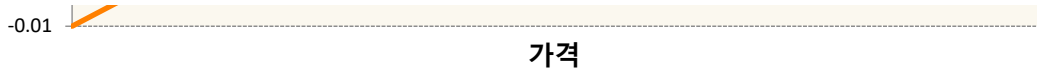
(단위:USD 백만)

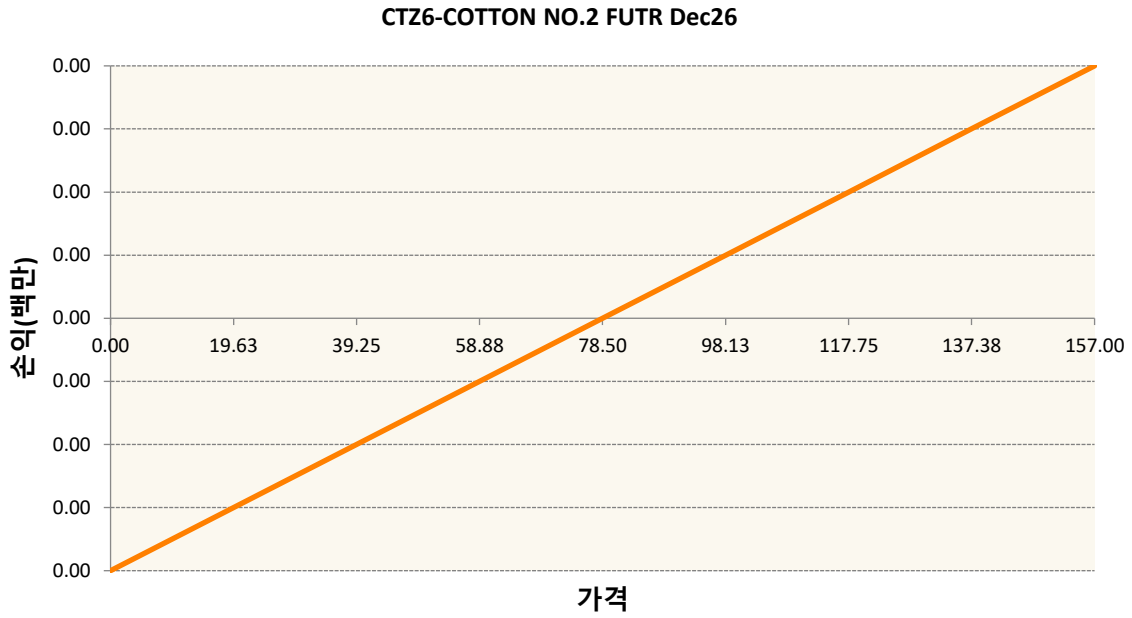
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	실물자산	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	실물자산	선물	343	0	343	
누계	유가증권	선물	2,115	0	2,115	
누계	통화	선물	0	280	-280	장내

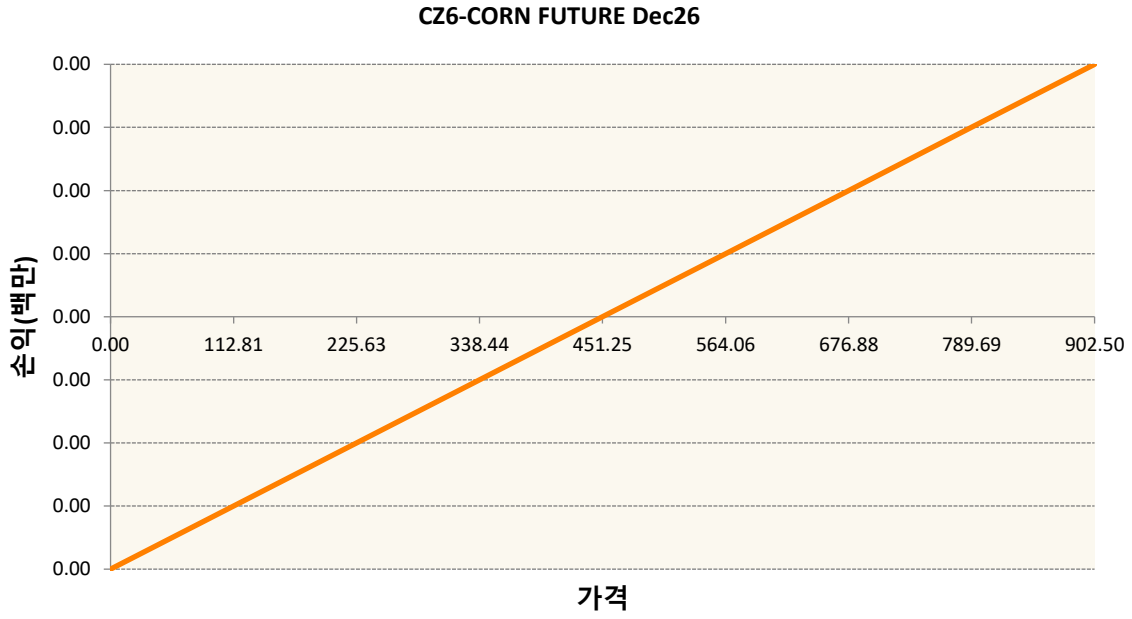
2. 만기시점의 손익구조

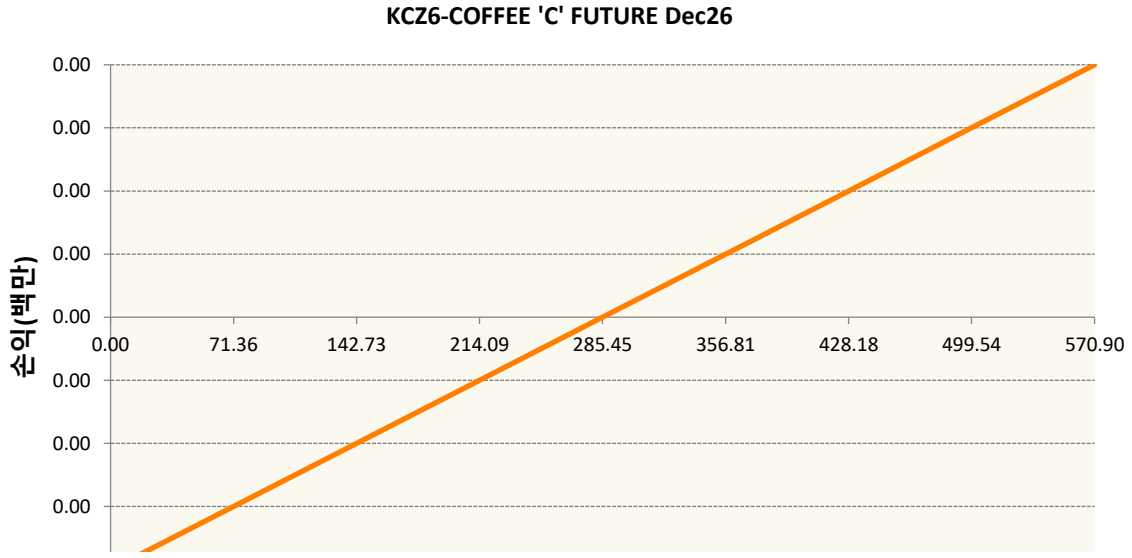


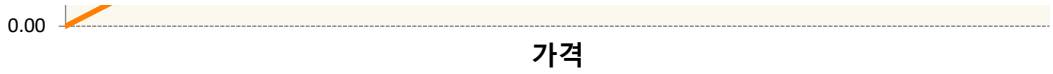



-0.01
가격

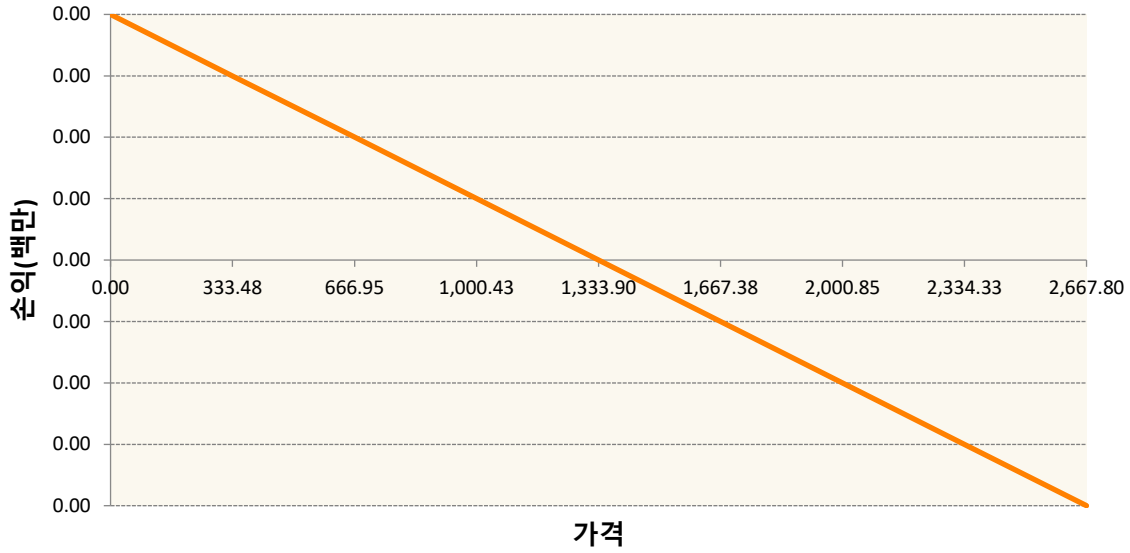

CTZ6-COTTON NO.2 FUTR Dec26
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
19.63
39.25
58.88
78.50
98.13
117.75
137.38
157.00
손익(백만)
가격


CZ6-CORN FUTURE Dec26
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
112.81
225.63
338.44
451.25
564.06
676.88
789.69
902.50
손익(백만)
가격

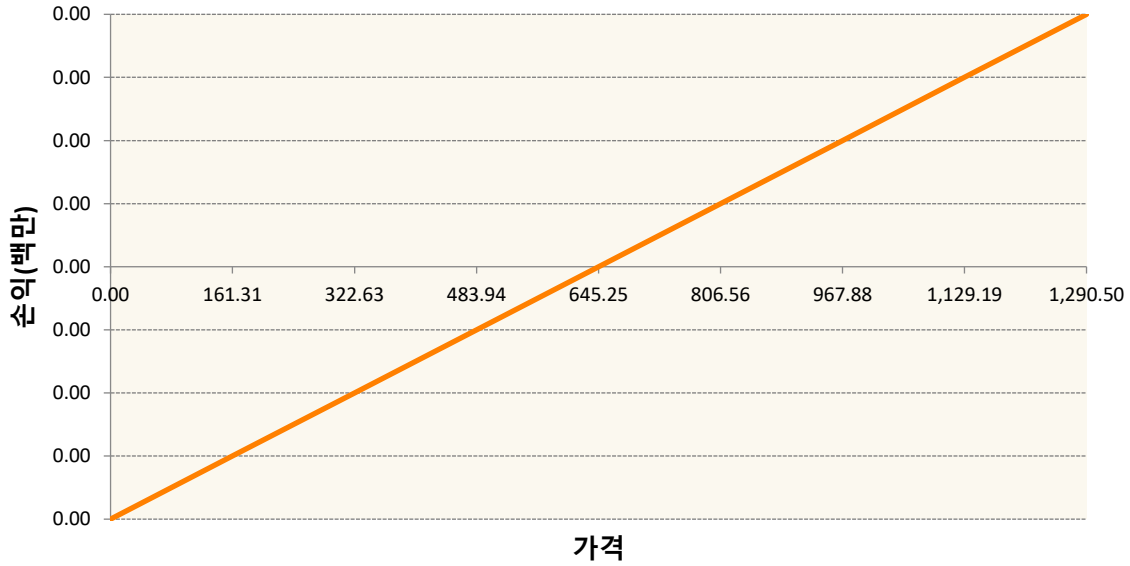

KCZ6-COFFEE 'C' FUTURE Dec26
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
71.36
142.73
214.09
285.45
356.81
428.18
499.54
570.90
손익(백만)



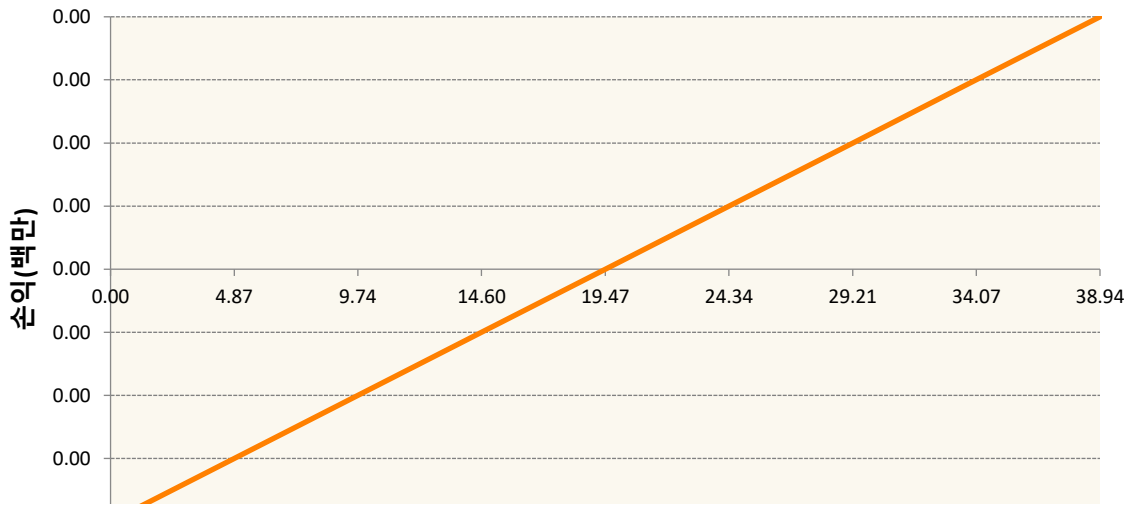
KR4A756B0009-2026-11 달러선물

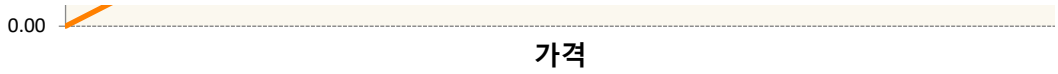


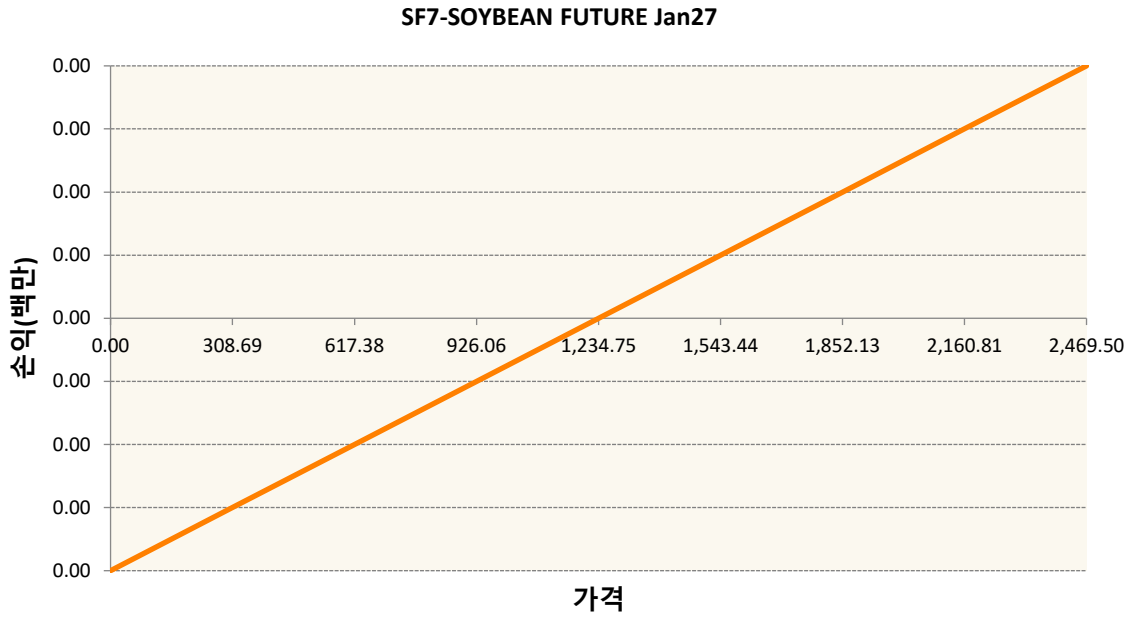
KWZ6-KC HRW WHEAT FUT Dec26



SBH7-SUGAR #11 (WORLD) MAR27






SF7-SOYBEAN FUTURE Jan27
0.00
0.00
0.00



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	2026-11-02
기준일	2026-10-30

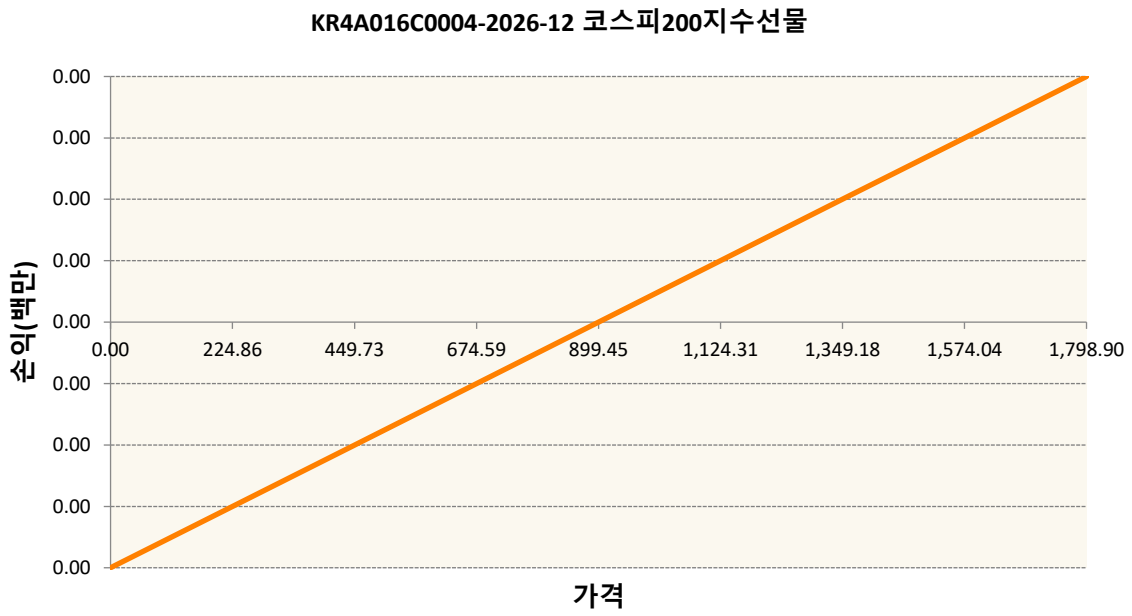
스마트인덱스모

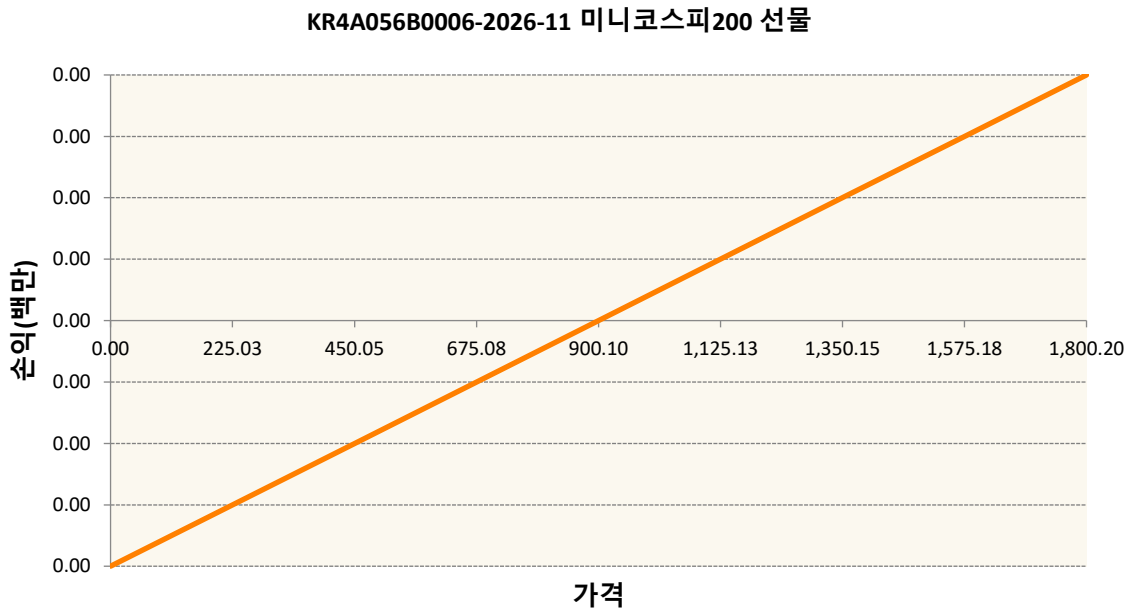
1. 계약금액

(단위:백만원)

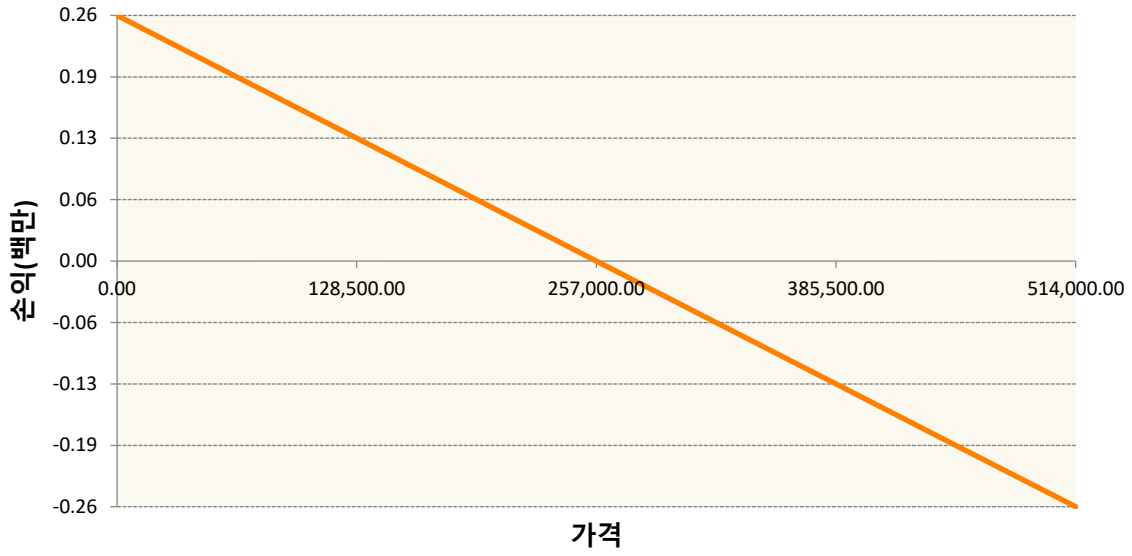
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	2,685	1,350	1,334	장내
누계	유가증권	선물	10,025	520	9,505	장내

2. 만기시점의 손익구조

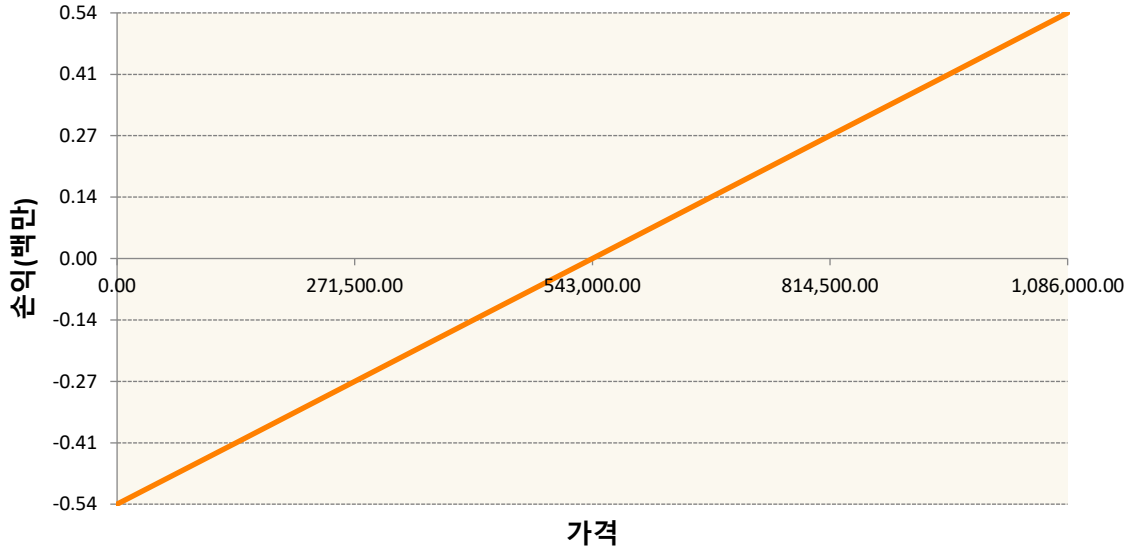




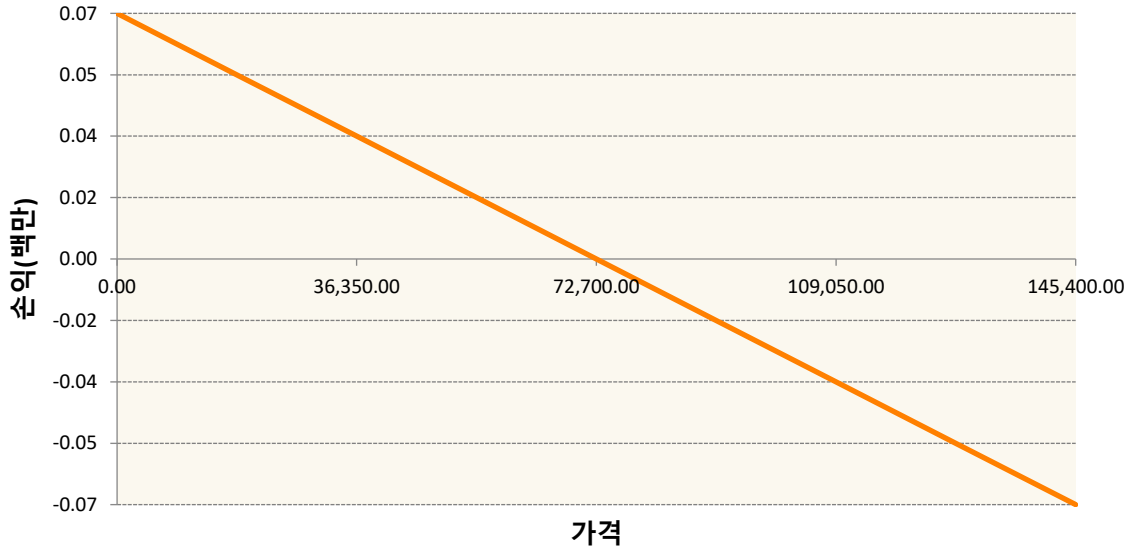
KR4A1Q6B0009-2026-11 에이피알개별선물



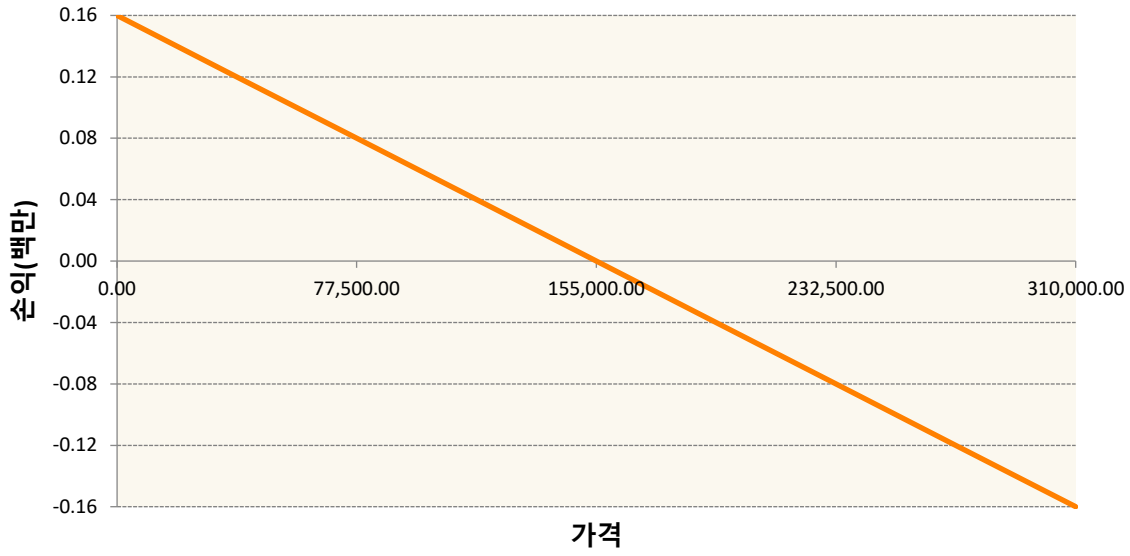
KR4A226B0001-2026-11 삼성SDI개별선물



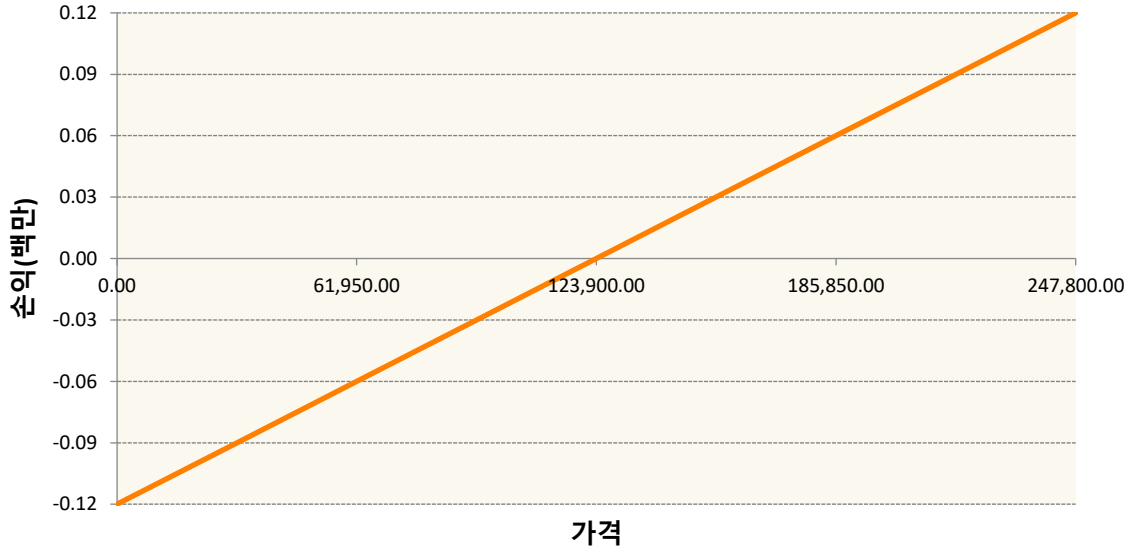
KR4A2K6B0000-2026-11 LG씨엔에스개별선물



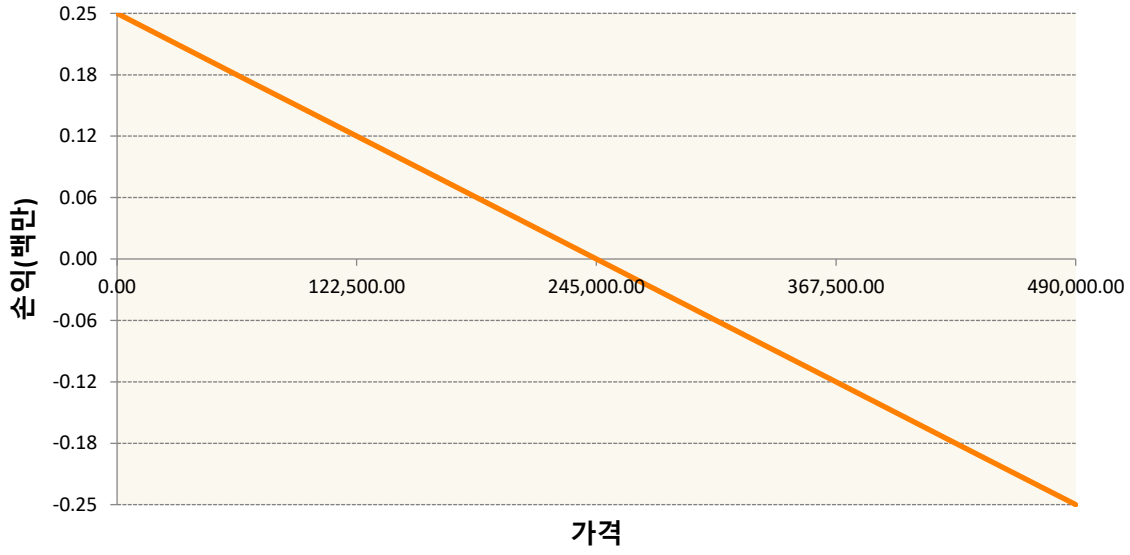
KR4A466B0000-2026-11 KB금융개별선물

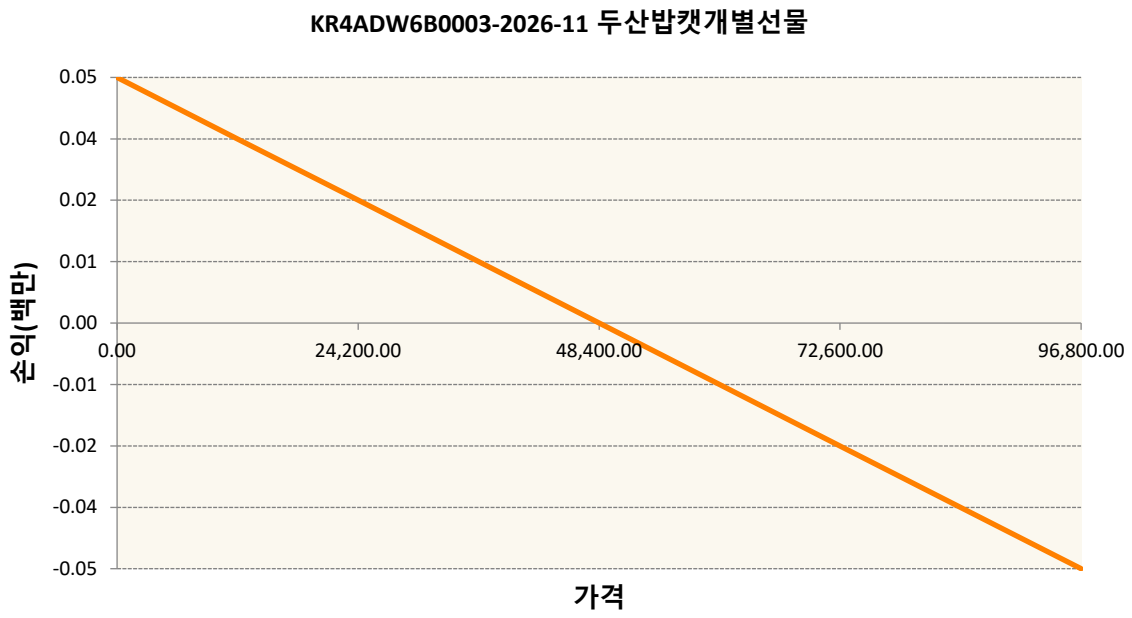


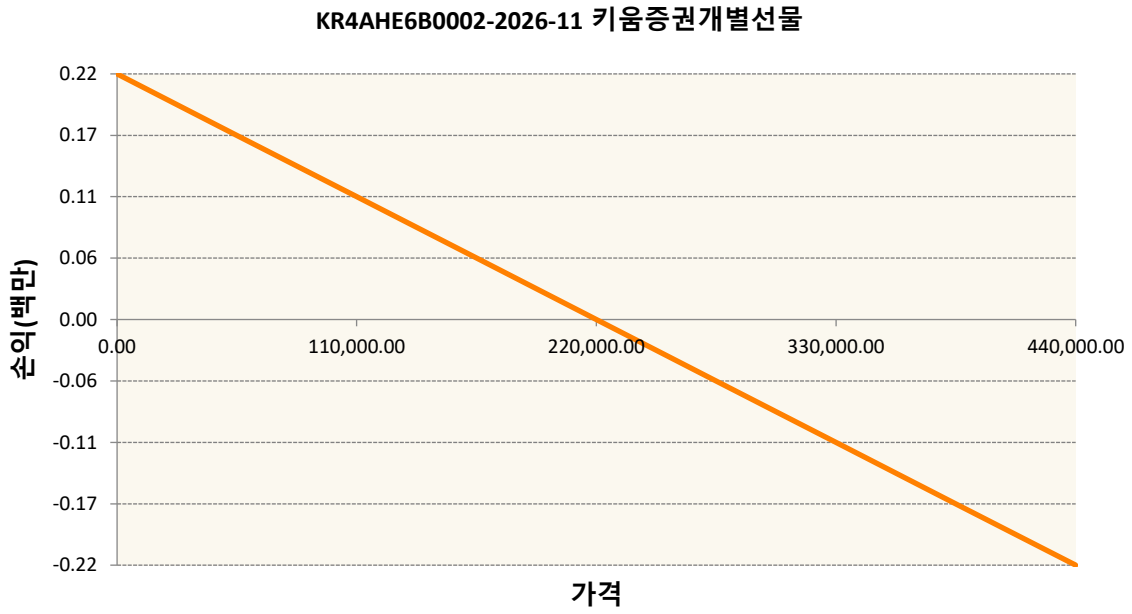
KR4AB26B0009-2026-11 S-Oil개별선물



KR4ADK6B0008-2026-11 코스맥스개별선물







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A016C0004	2026-12 코스피200지수선물						594
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-594	-594	-594	-594	-594	-594	-594
-5.33%	-396	-396	-396	-396	-396	-396	-396
-2.67%	-198	-198	-198	-198	-198	-198	-198
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	198	198	198	198	198	198	198
5.33%	396	396	396	396	396	396	396
8.00%	594	594	594	594	594	594	594
KR4A056B0006	2026-11 미니코스피200 선물						36
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-36	-36	-36	-36	-36	-36	-36
-5.33%	-24	-24	-24	-24	-24	-24	-24
-2.67%	-12	-12	-12	-12	-12	-12	-12
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	12	12	12	12	12	12	12
5.33%	24	24	24	24	24	24	24
8.00%	36	36	36	36	36	36	36
	KR4A1Q6B0009		2026-11 에이피알개별선물				5
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	5	5	5	5	5	5	5
-5.33%	3	3	3	3	3	3	3
-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%	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-3
8.00%	-5	-5	-5	-5	-5	-5	-5
	KR4A226B0001		2026-11 삼성SDI개별선물				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
	KR4A2K6B0000		2026-11 LG씨엔에스개별선물				7
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	7	7	7	7	7	7	7
-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%	-7	-7	-7	-7	-7	-7	-7
	KR4A466B0000		2026-11 KB금융개별선물				13
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	13	13	13	13	13	13	13
-5.33%	9	9	9	9	9	9	9
-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%	-9	-9	-9	-9	-9	-9	-9
8.00%	-13	-13	-13	-13	-13	-13	-13
	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				5
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	5	5	5	5	5	5	5
-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%	-5	-5	-5	-5	-5	-5	-5
	KR4ADW6B0003		2026-11 두산밥캣개별선물				5
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	5	5	5	5	5	5	5
-5.33%	3	3	3	3	3	3	3
-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%	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-3
8.00%	-5	-5	-5	-5	-5	-5	-5
	KR4AHE6B0002		2026-11 키움증권개별선물				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)

2,264

공시일	2026-11-02
기준일	2026-10-30

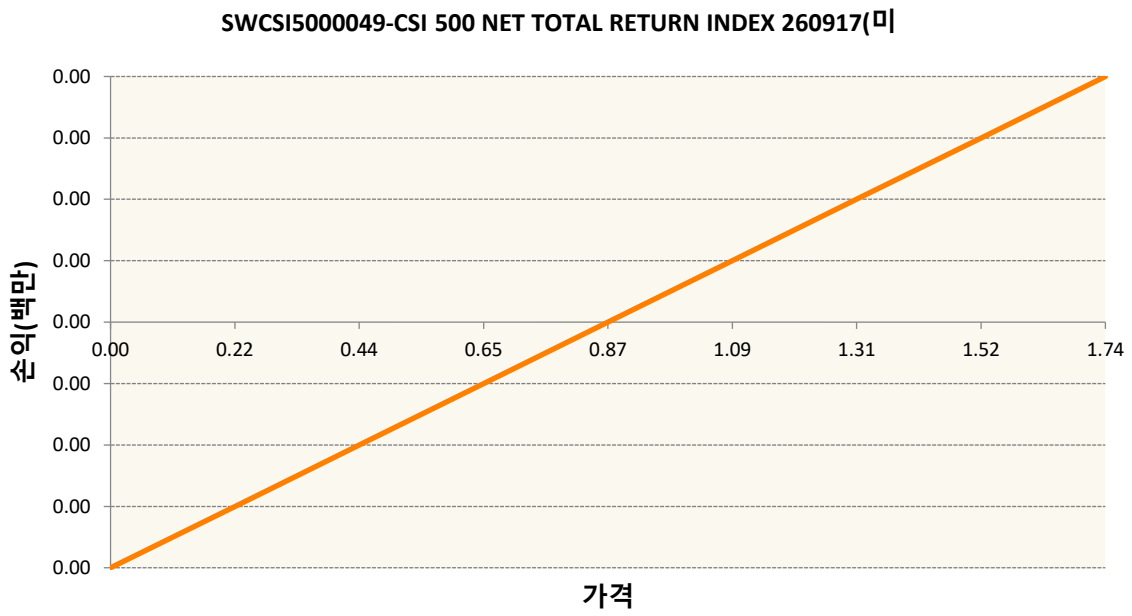
SOL차이나강소기업CSI500상장

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	4,629	0	4,629	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 CSI 500 NET TOTAL RETURN INDEX 260917(미	369

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

597

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2026-11-02
기준일	2026-10-30

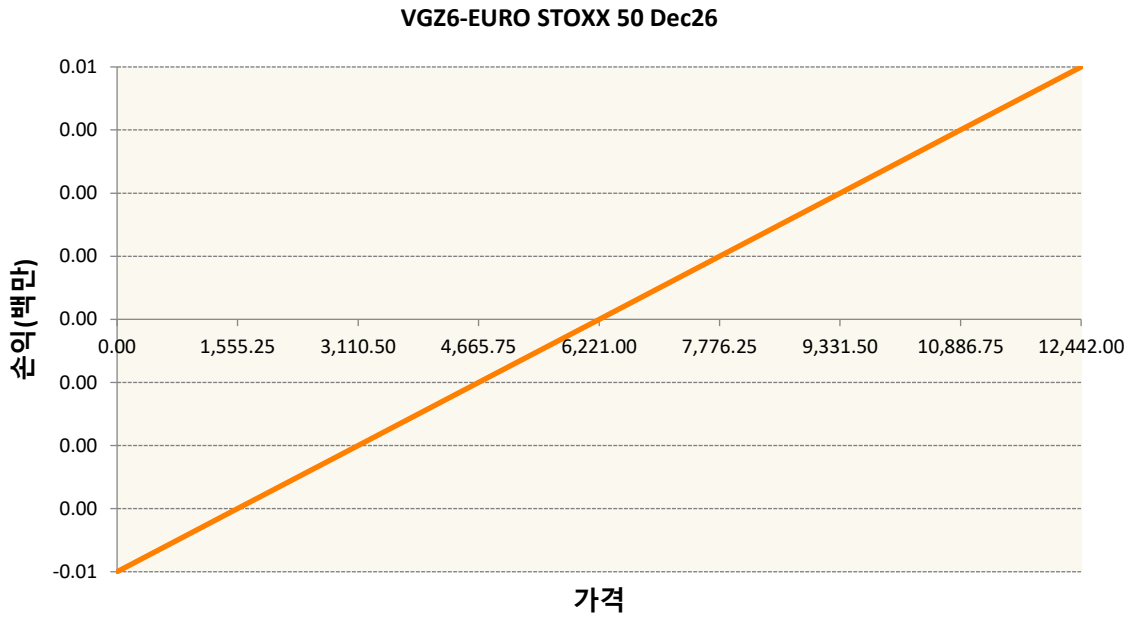
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

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

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGZ6	EURO STOXX 50 Dec26	94

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

(단위:백만원)

70

공시일	2026-11-02
기준일	2026-10-30

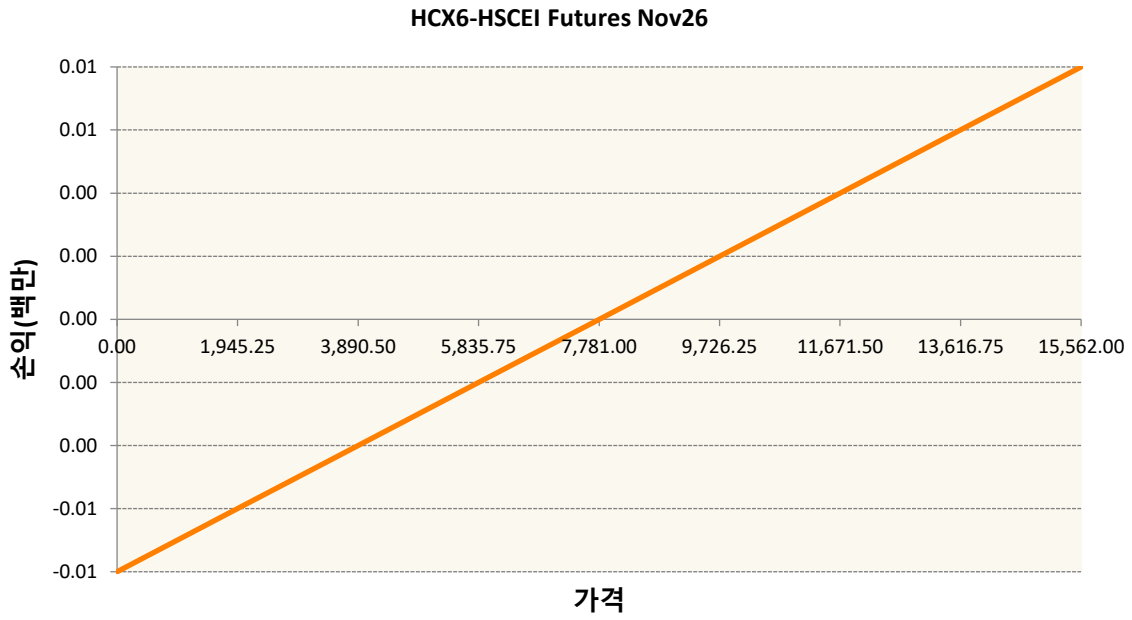
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,327	0	1,327	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCX6	HSCEI Futures Nov26	106

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

(단위:백만원)

100

공시일	2026-11-02
기준일	2026-10-30

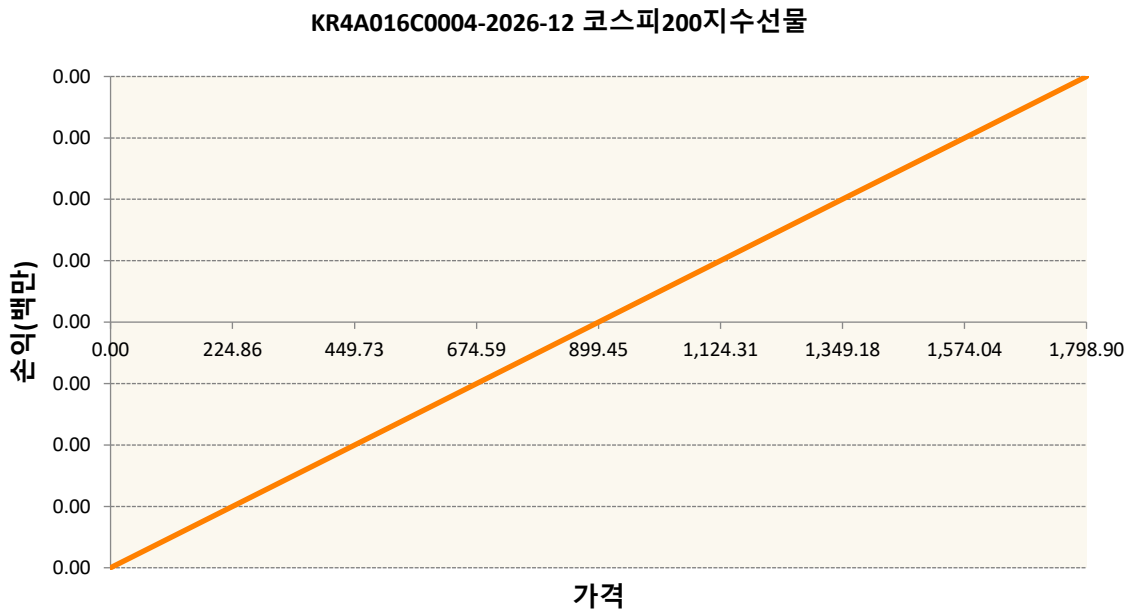
커버드콜모(주식혼합-파생형)

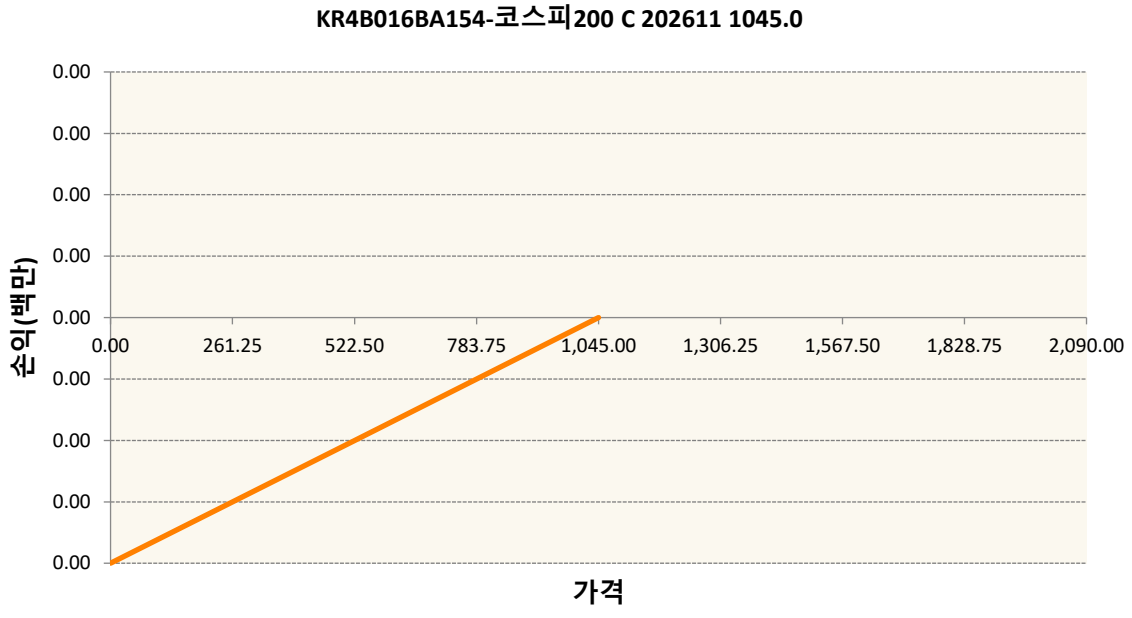
1. 계약금액

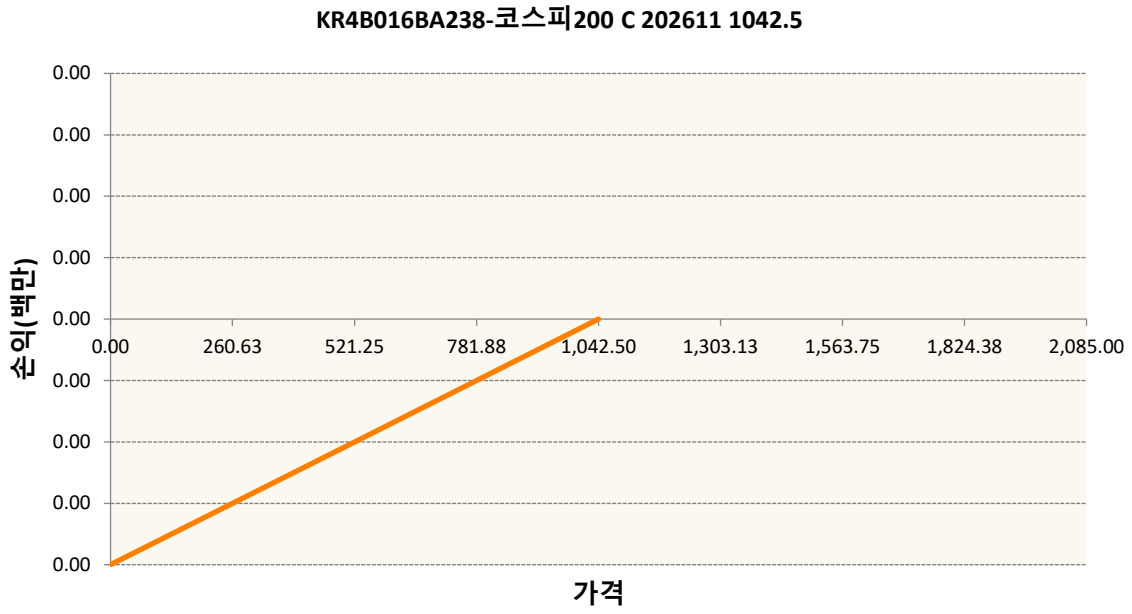
(단위:백만원)

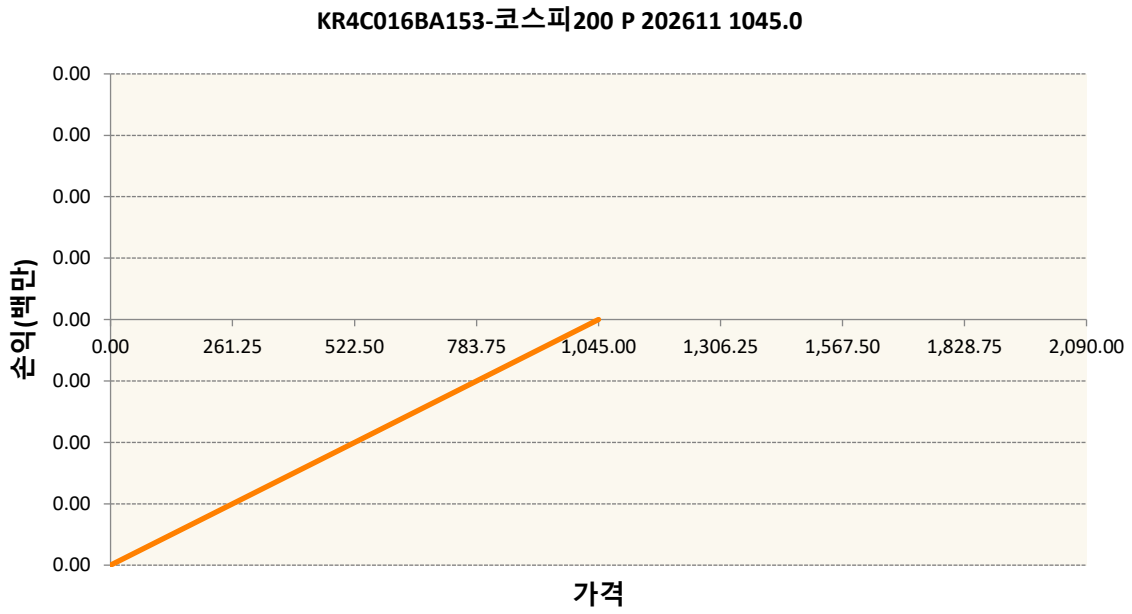
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	450	0	450	장내
누계	유가증권	옵션	0	50,659	-50,659	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A016C0004	2026-12 코스피200지수선물						36
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-36	-36	-36	-36	-36	-36	-36
-5.33%	-24	-24	-24	-24	-24	-24	-24
-2.67%	-12	-12	-12	-12	-12	-12	-12
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	12	12	12	12	12	12	12
5.33%	24	24	24	24	24	24	24
8.00%	36	36	36	36	36	36	36
KR4B016BA154	코스피200 C 202611 1045.0						2,085
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-2,019	-2,022	-2,027	-2,035	-2,048	-2,064	-2,085
-5.33%	-1,309	-1,315	-1,326	-1,340	-1,360	-1,386	-1,416
-2.67%	-604	-617	-635	-660	-690	-727	-768
0%	91	68	37	0	-44	-93	-148
2.67%	767	729	683	630	572	508	440
5.33%	1,411	1,355	1,291	1,222	1,148	1,071	990
8.00%	2,010	1,934	1,853	1,768	1,680	1,589	1,496
	KR4B016BA238		코스피200 C 202611 1042.5				647
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-626	-627	-629	-631	-635	-641	-647
-5.33%	-405	-407	-411	-416	-422	-430	-440
-2.67%	-186	-190	-196	-204	-214	-226	-239
0%	29	22	12	0	-14	-30	-47
2.67%	239	226	212	195	176	156	135
5.33%	438	420	400	378	354	330	304
8.00%	623	598	573	546	518	490	461
	KR4C016BA153		코스피200 P 202611 1045.0				666
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-645	-646	-647	-650	-654	-659	-666
-5.33%	-418	-420	-423	-428	-434	-442	-452
-2.67%	-193	-197	-203	-211	-220	-232	-245
0%	29	22	12	0	-14	-30	-47
2.67%	245	233	218	201	183	162	141
5.33%	451	433	412	390	367	342	316
8.00%	642	618	592	565	536	507	478

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

6,645

공시일	2026-11-02
기준일	2026-10-30

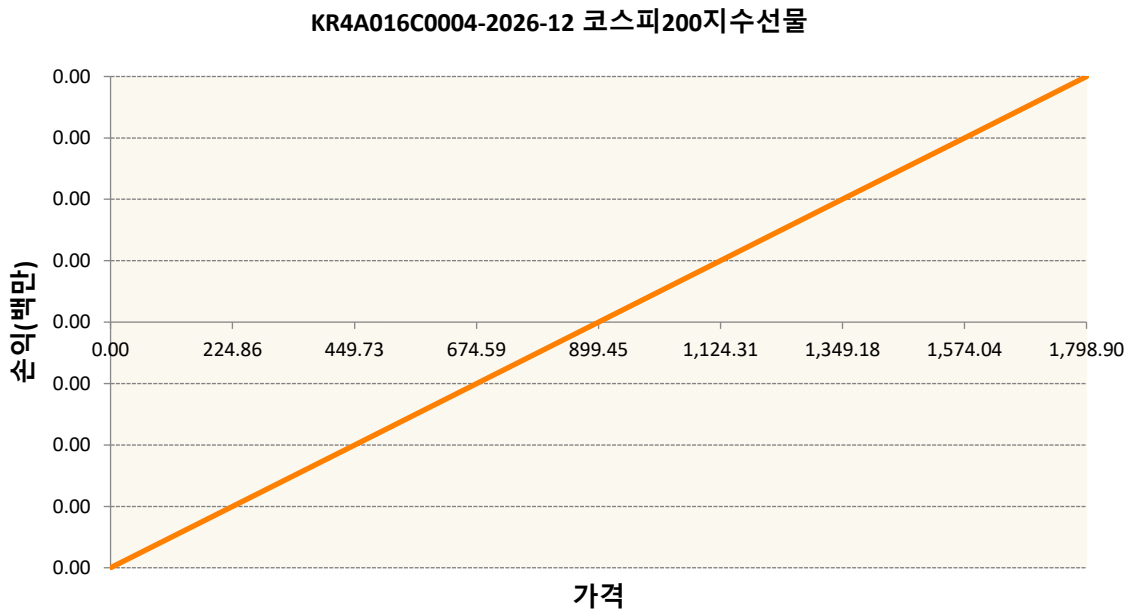
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

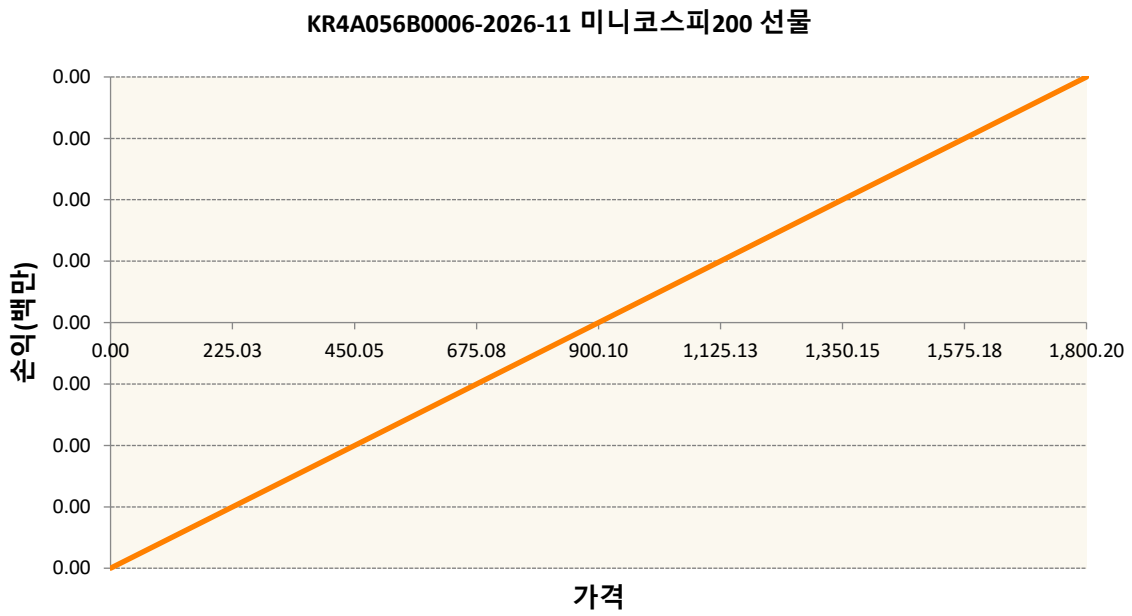
1. 계약금액

(단위:백만원)

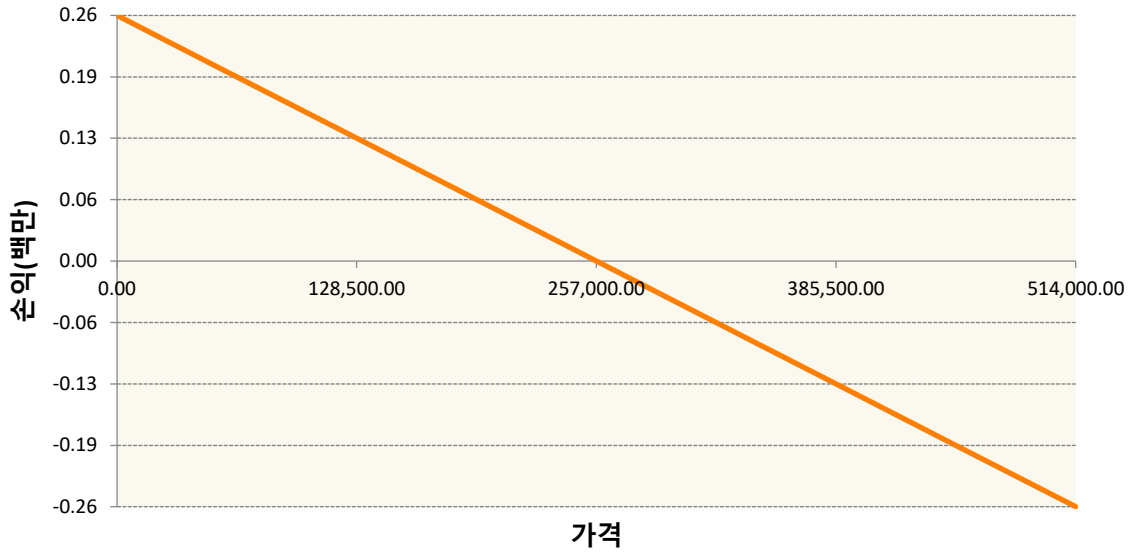
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	673	316	358	장내
누계	유가증권	선물	2,329	97	2,232	장내

2. 만기시점의 손익구조

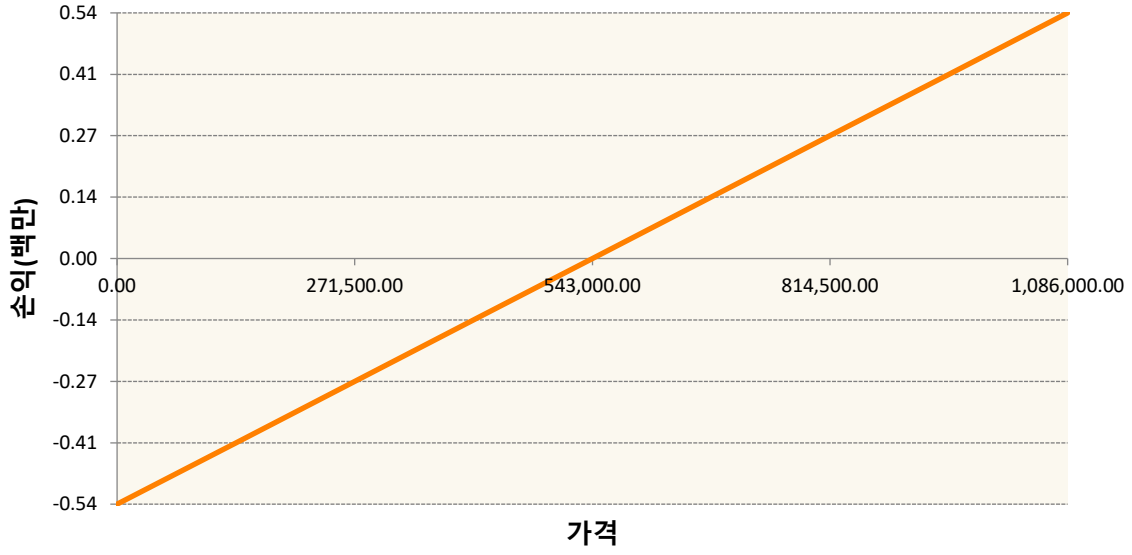




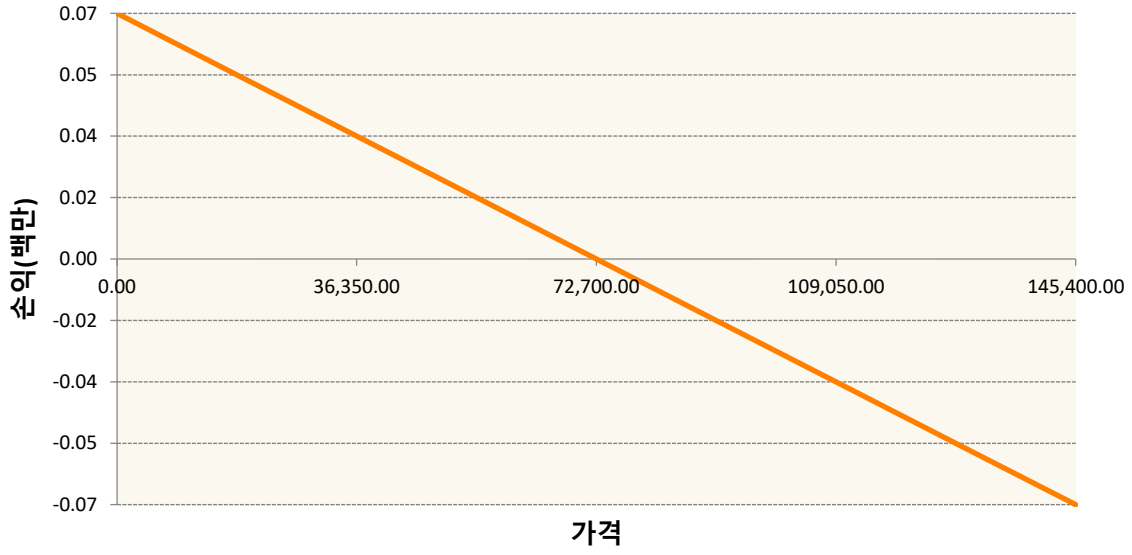
KR4A1Q6B0009-2026-11 에이피알개별선물



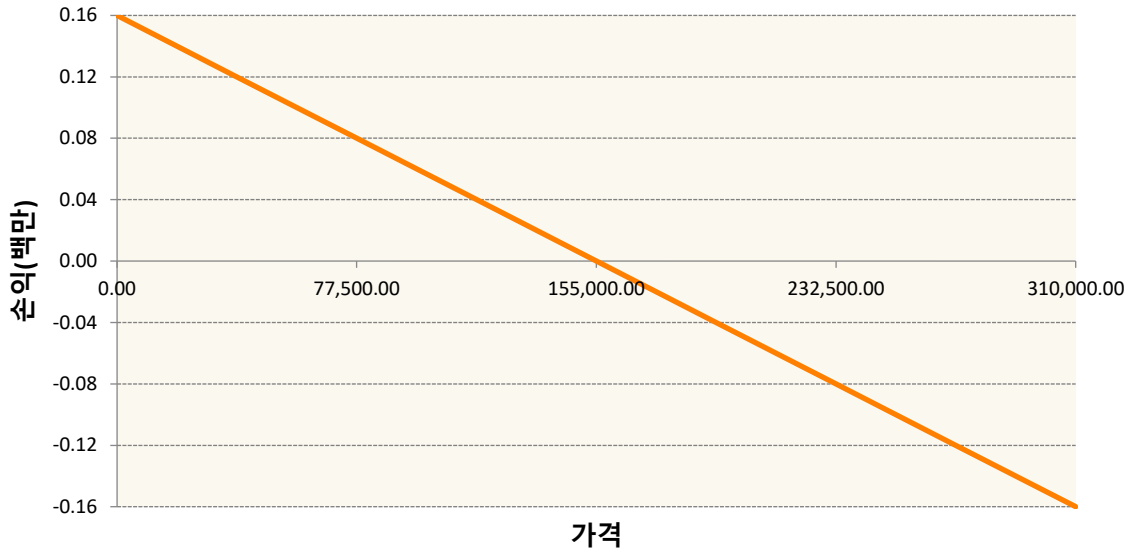
KR4A226B0001-2026-11 삼성SDI개별선물



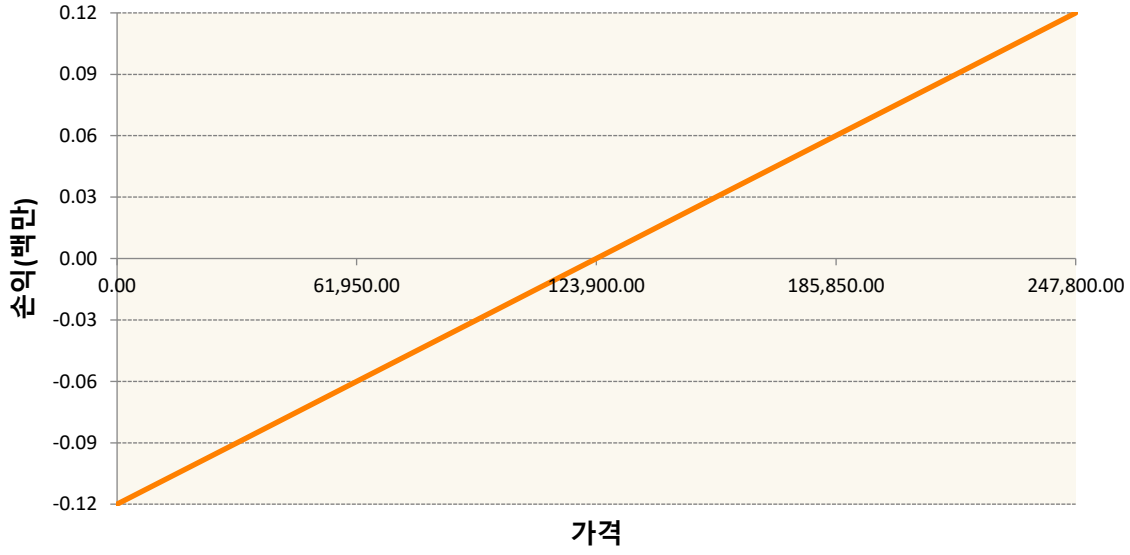
KR4A2K6B0000-2026-11 LG씨엔에스개별선물



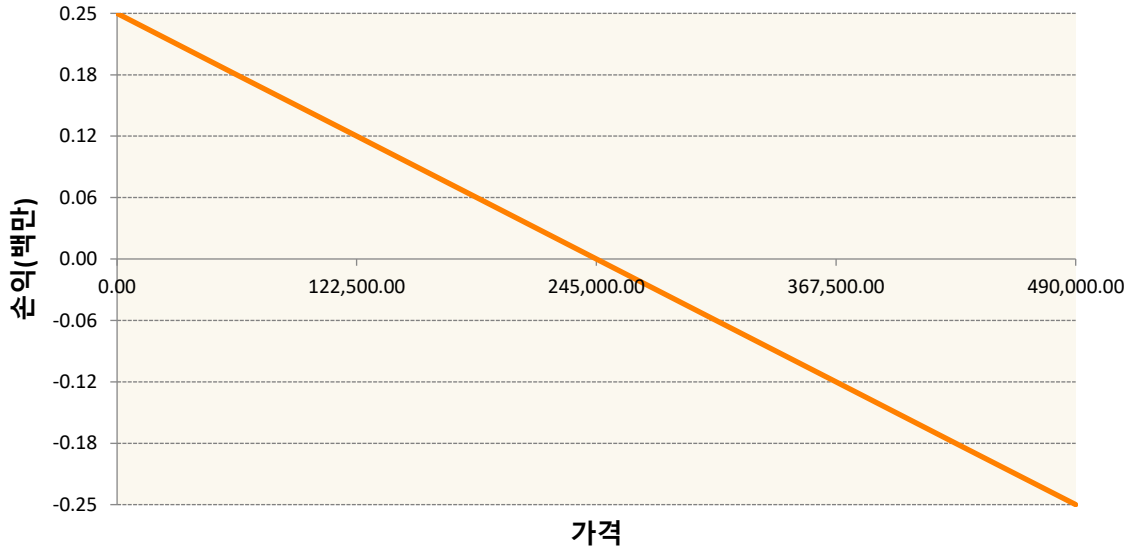
KR4A466B0000-2026-11 KB금융개별선물

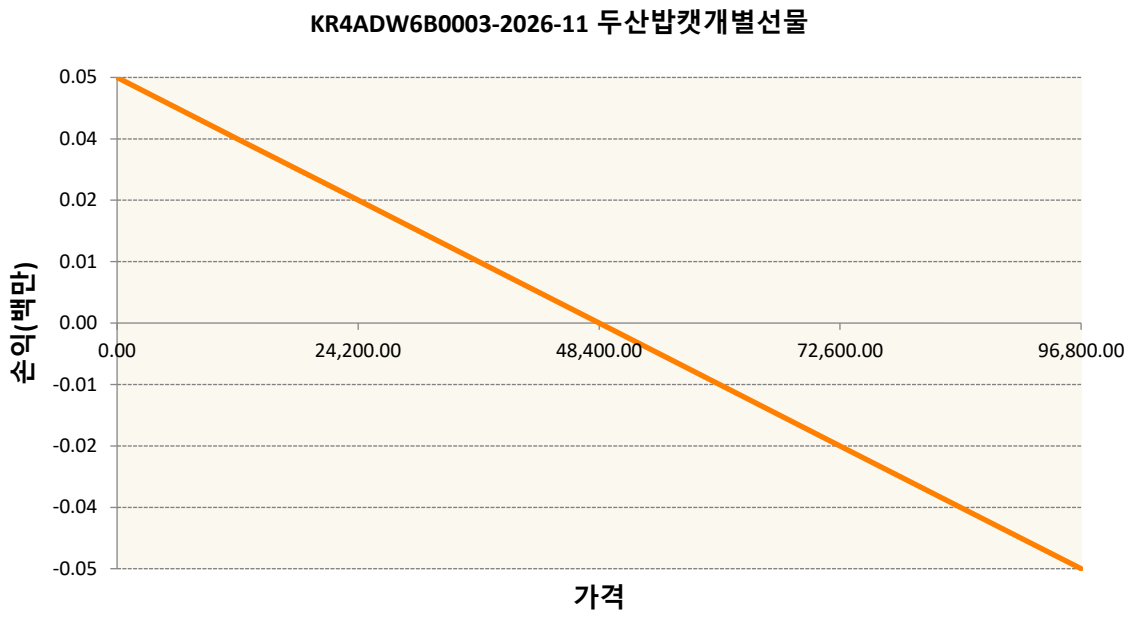


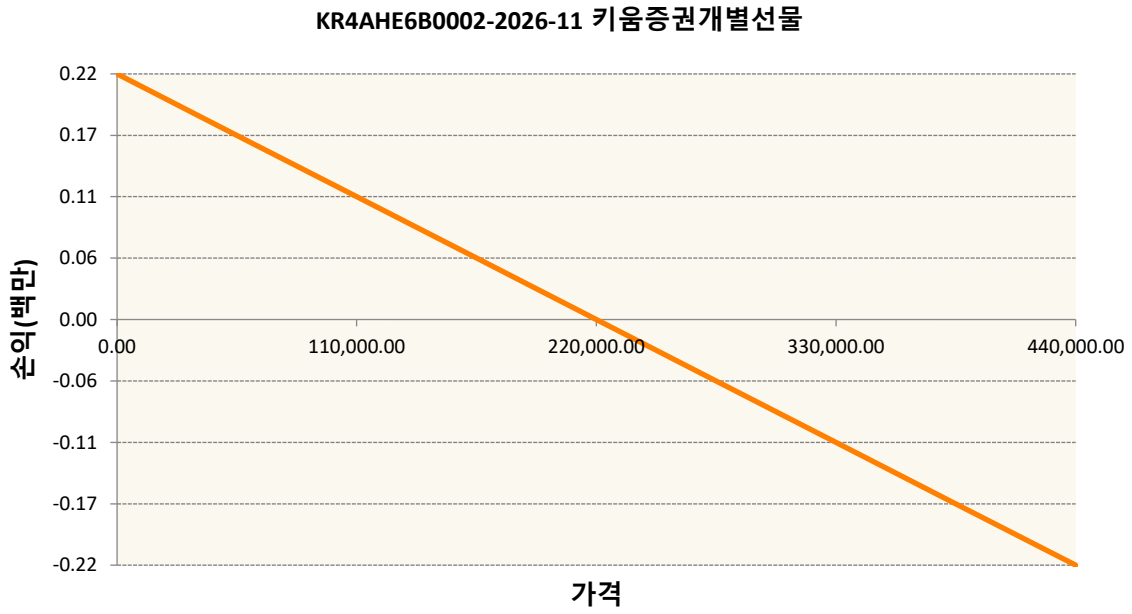
KR4AB26B0009-2026-11 S-Oil개별선물



KR4ADK6B0008-2026-11 코스맥스개별선물







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4A016C0004	2026-12 코스피200지수선물						54
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-54	-54	-54	-54	-54	-54	-54
-5.33%	-36	-36	-36	-36	-36	-36	-36
-2.67%	-18	-18	-18	-18	-18	-18	-18
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	18	18	18	18	18	18	18
5.33%	36	36	36	36	36	36	36
8.00%	54	54	54	54	54	54	54
KR4A056B0006	2026-11 미니코스피200 선물						25
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-25	-25	-25	-25	-25	-25	-25
-5.33%	-17	-17	-17	-17	-17	-17	-17
-2.67%	-8	-8	-8	-8	-8	-8	-8
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	8	8	8	8	8	8	8
5.33%	17	17	17	17	17	17	17
8.00%	25	25	25	25	25	25	25
	KR4A1Q6B0009		2026-11 에이피알개별선물				0
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	0	0	0	0	0	0	0
-5.33%	0	0	0	0	0	0	0
-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%	0	0	0	0	0	0	0
8.00%	0	0	0	0	0	0	0
	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
	KR4A2K6B0000		2026-11 LG씨엔에스개별선물				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
	KR4A466B0000		2026-11 KB금융개별선물				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
	KR4ADW6B0003		2026-11 두산밥캣개별선물				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
	KR4AHE6B0002		2026-11 키움증권개별선물				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)

289

공시일	2026-11-02
기준일	2026-10-30

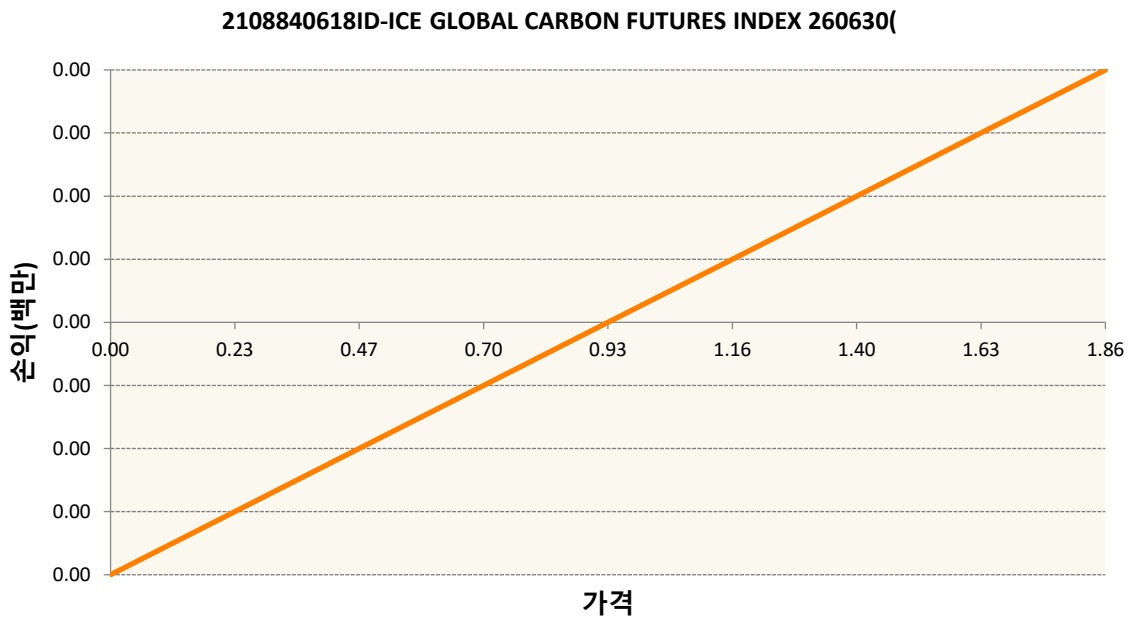
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

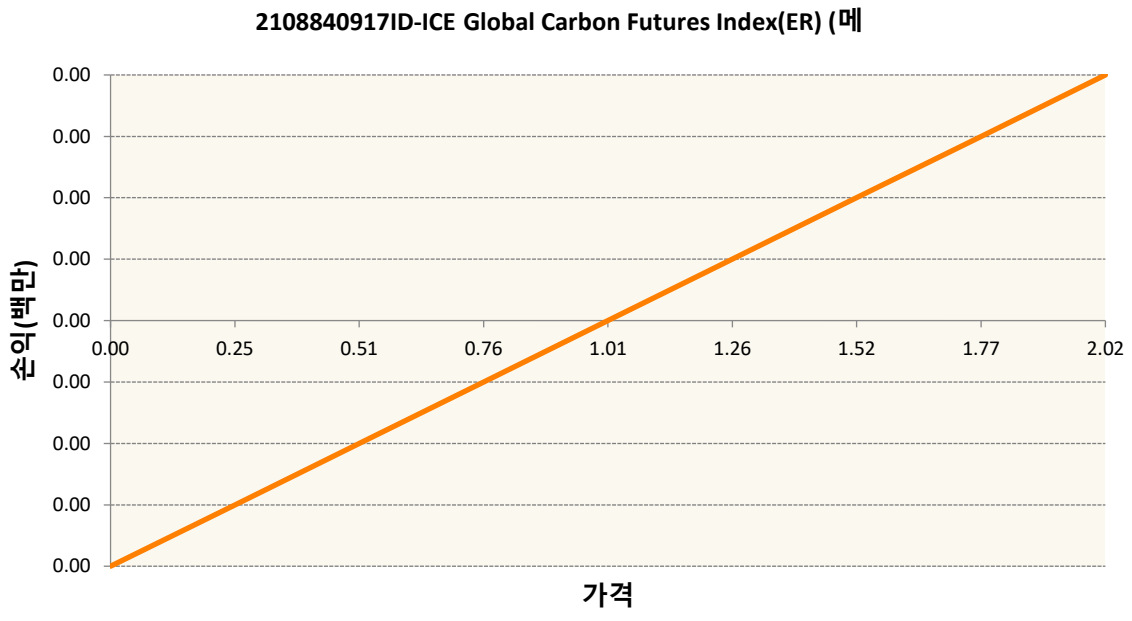
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	7,090	0	7,090	장외

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2108840618ㅣICE GLOBAL CARBON FUTURES INDEX 260630(	453
2108840917ㅣICE Global Carbon Futures Index(ER) (메	115

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

585

공시일	2026-11-02
기준일	2026-10-30

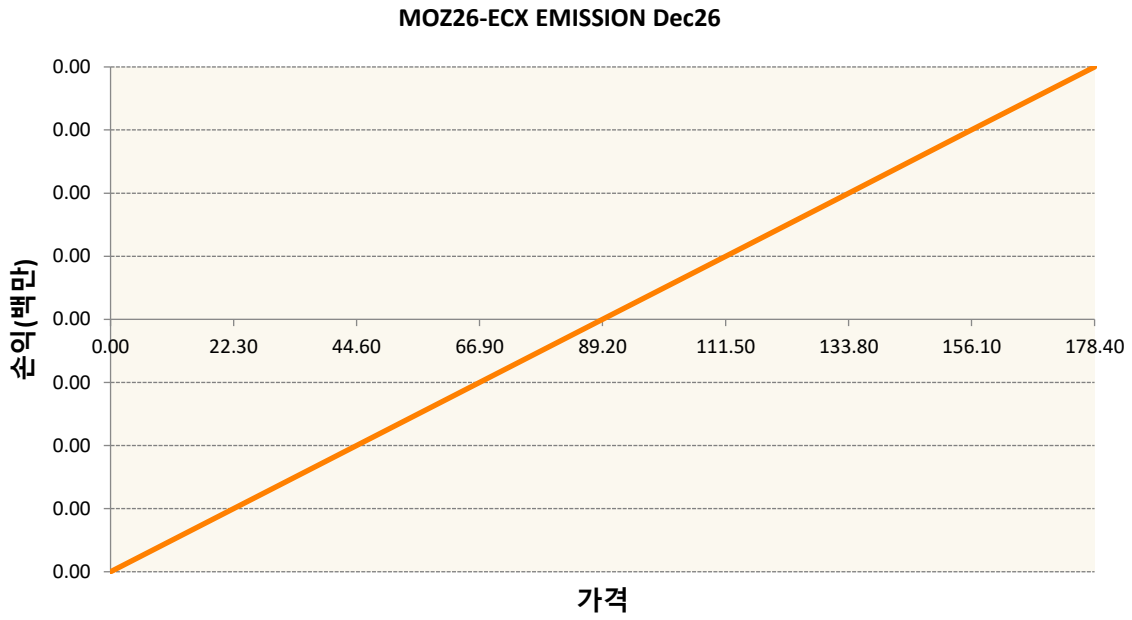
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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			6,275	0	6,275	
누계	통화	선도	0	2,798	-2,798	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213GAV KRW/EUR 30-11-26E	224
MOZ26 ECX EMISSION Dec26	502

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

(단위:백만원)

752

공시일	2026-11-02
기준일	2026-10-30

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	-889	0	-889	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWSOL0000(CSI PHOTOVOLTAIC INDUSTRY INDEX 260325(	12
SWSOL0000(CSI PHOTOVOLTAIC INDUSTRY INDEX 260630(N	12
SWSOL0000(CSI PHOTOVOLTAIC INDUSTRY INDEX 260630(	18
SWSOL0000(CSI PHOTOVOLTAIC INDUSTRY INDEX 260923(	30

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

(단위:백만원)

111

공시일	2026-11-02
기준일	2026-10-30

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	-6,745	0	-6,745	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 251218(NH)	60
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 260714(미래)	351
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 260917(메리츠)	127

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

(단위:백만원)

1,031

공시일	2026-11-02
기준일	2026-10-30

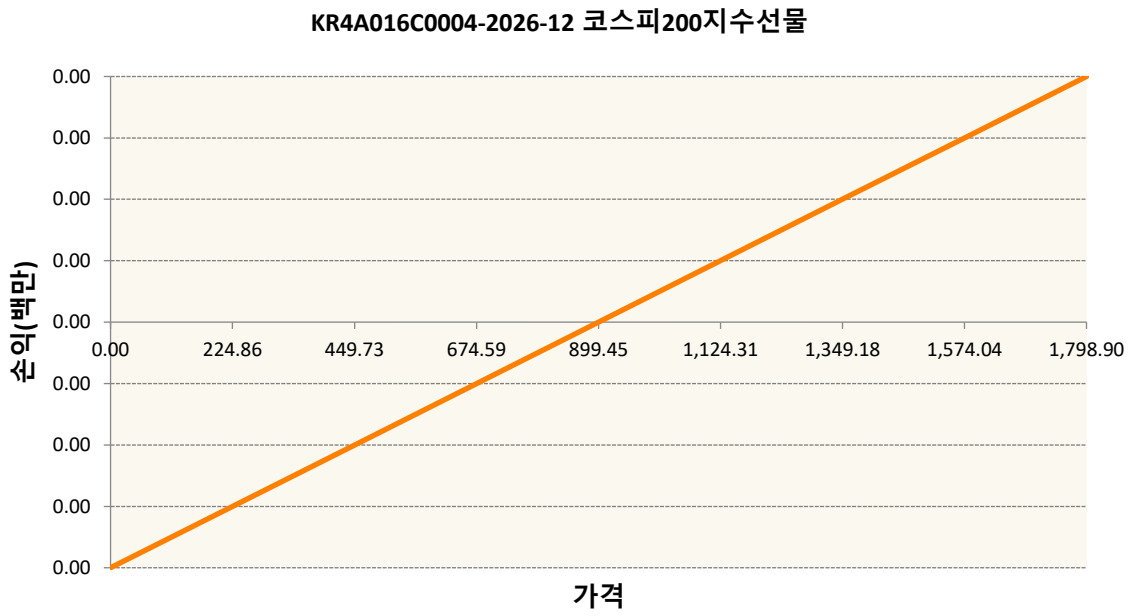
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

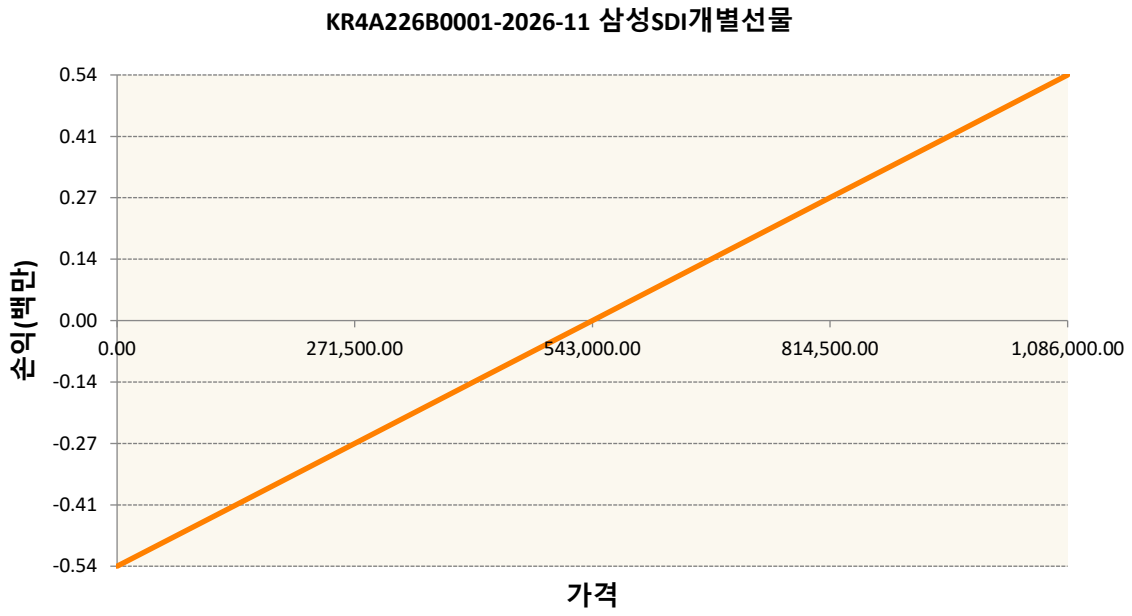
1. 계약금액

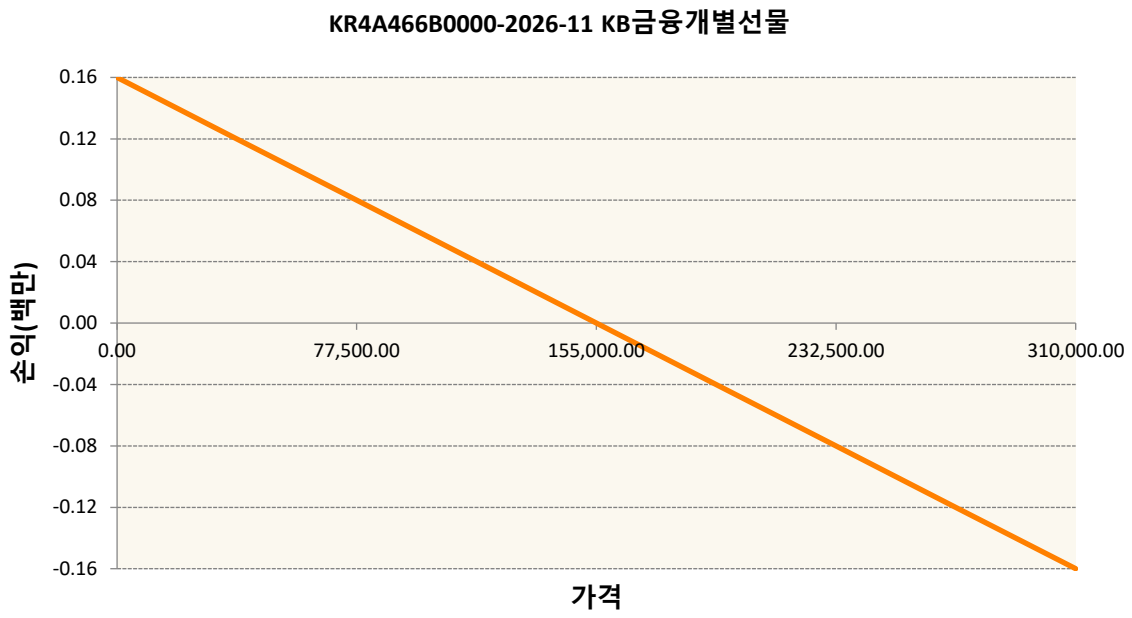
(단위:백만원)

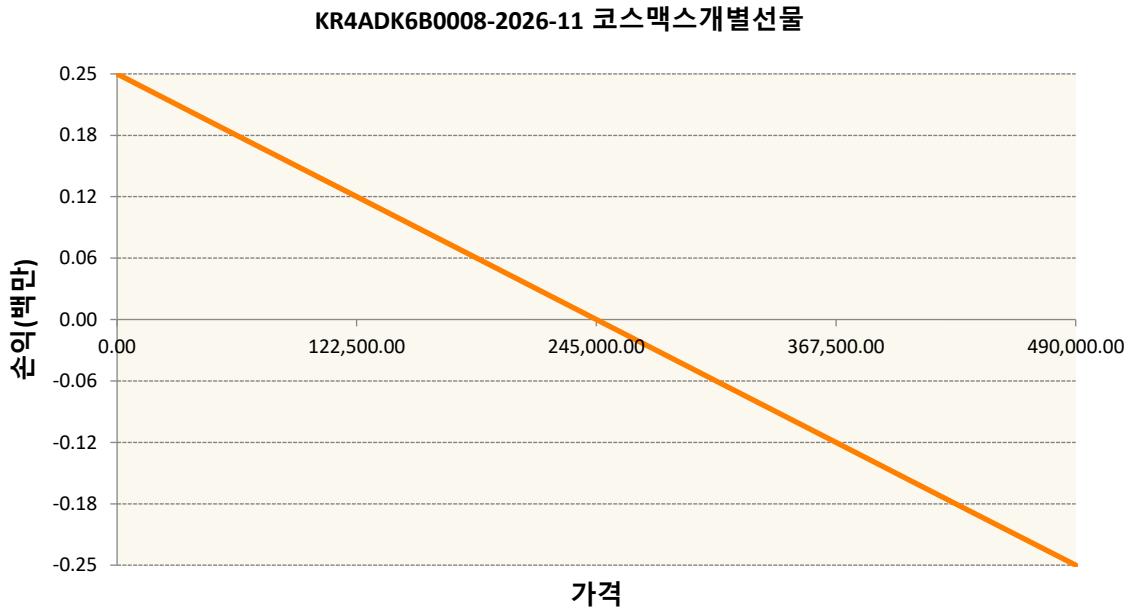
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	6,468	4,121	2,347	장내
누계	유가증권	선물	9,082	826	8,256	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4A016C0004	2026-12 코스피200지수선물						684
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-684	-684	-684	-684	-684	-684	-684
-5.33%	-456	-456	-456	-456	-456	-456	-456
-2.67%	-228	-228	-228	-228	-228	-228	-228
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	228	228	228	228	228	228	228
5.33%	456	456	456	456	456	456	456
8.00%	684	684	684	684	684	684	684
KR4A226B0001	2026-11 삼성SDI개별선물						43
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-43	-43	-43	-43	-43	-43	-43
-5.33%	-29	-29	-29	-29	-29	-29	-29
-2.67%	-14	-14	-14	-14	-14	-14	-14
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	14	14	14	14	14	14	14
5.33%	29	29	29	29	29	29	29
8.00%	43	43	43	43	43	43	43
	KR4A466B0000		2026-11 KB금융개별선물				47
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	47	47	47	47	47	47	47
-5.33%	31	31	31	31	31	31	31
-2.67%	16	16	16	16	16	16	16
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-16	-16	-16	-16	-16	-16	-16
5.33%	-31	-31	-31	-31	-31	-31	-31
8.00%	-47	-47	-47	-47	-47	-47	-47
	KR4ADK6B0008		2026-11 코스맥스개별선물				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

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

2,541

공시일	2026-11-02
기준일	2026-10-30

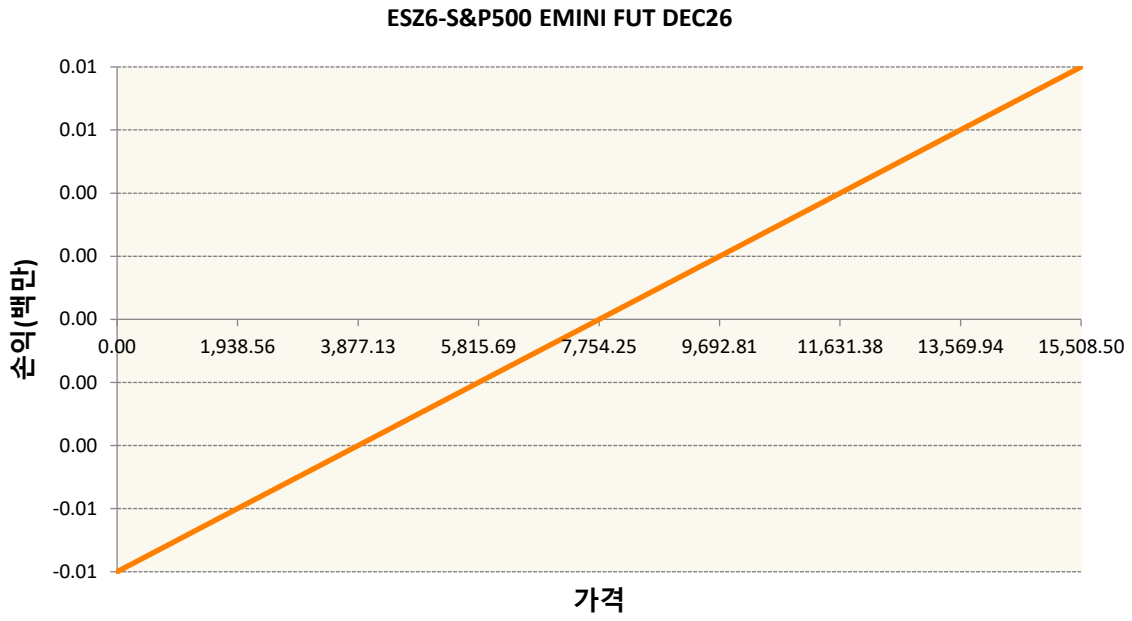
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

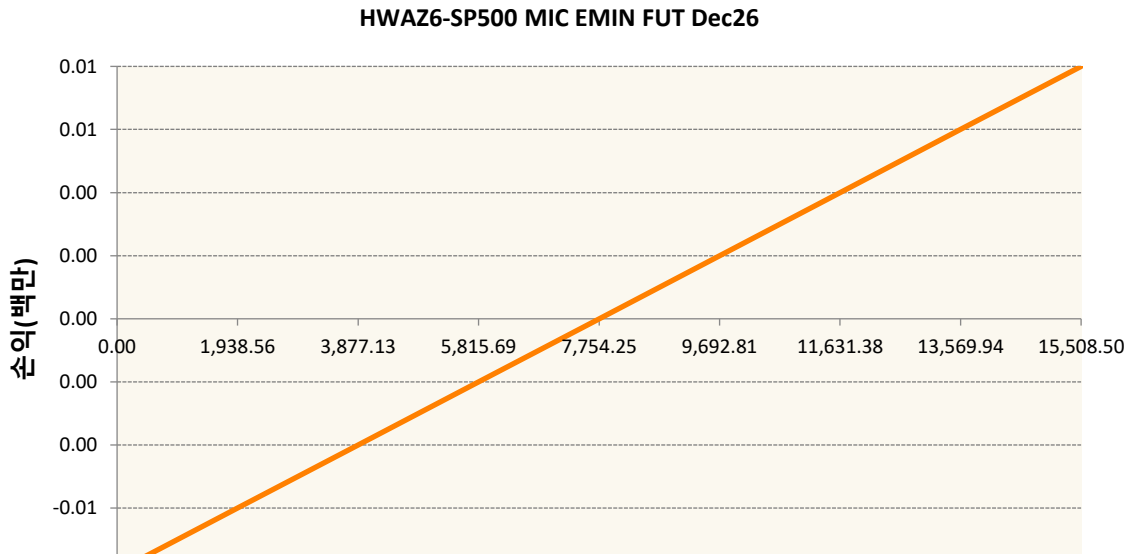
1. 계약금액

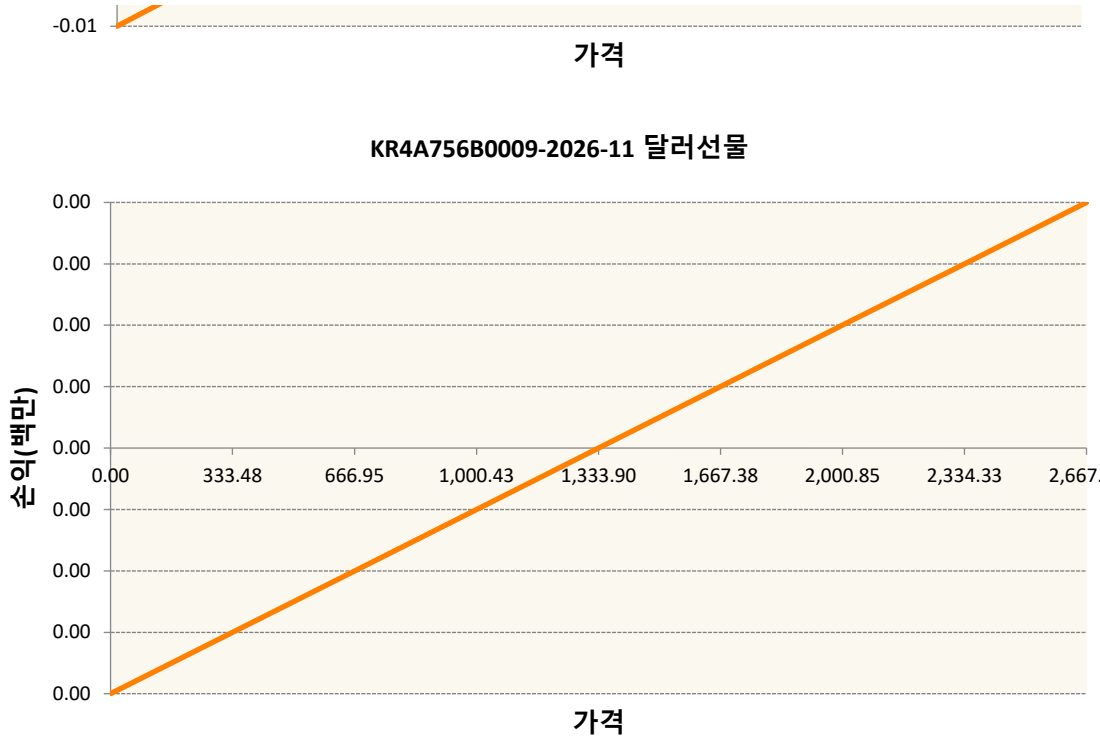
(단위:백만원)

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	79,105	0	79,105	
누계	지수	선물	375	0	375	장내
누계	통화	선물	18,541	0	18,541	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

ESZ6	S&P500 EMINI FUT DEC26	6,328
HWAZ6	SP500 MIC EMIN FUT Dec26	30
KR4A756B00	2026-11 달러선물	1,483

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

3,769

공시일	2026-11-02
기준일	2026-10-30

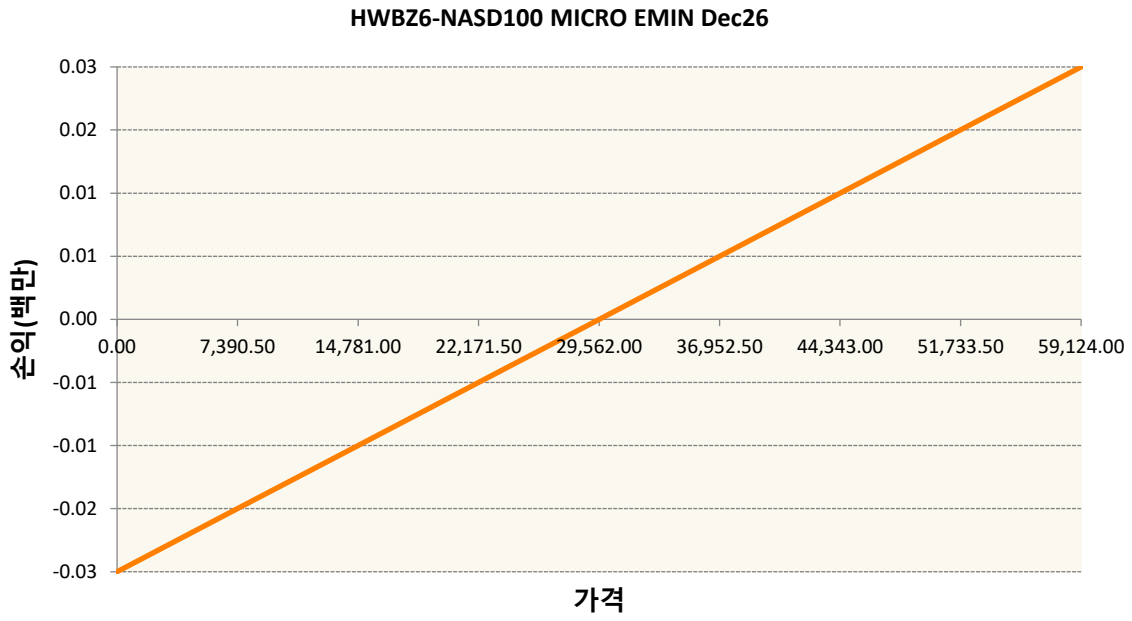
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

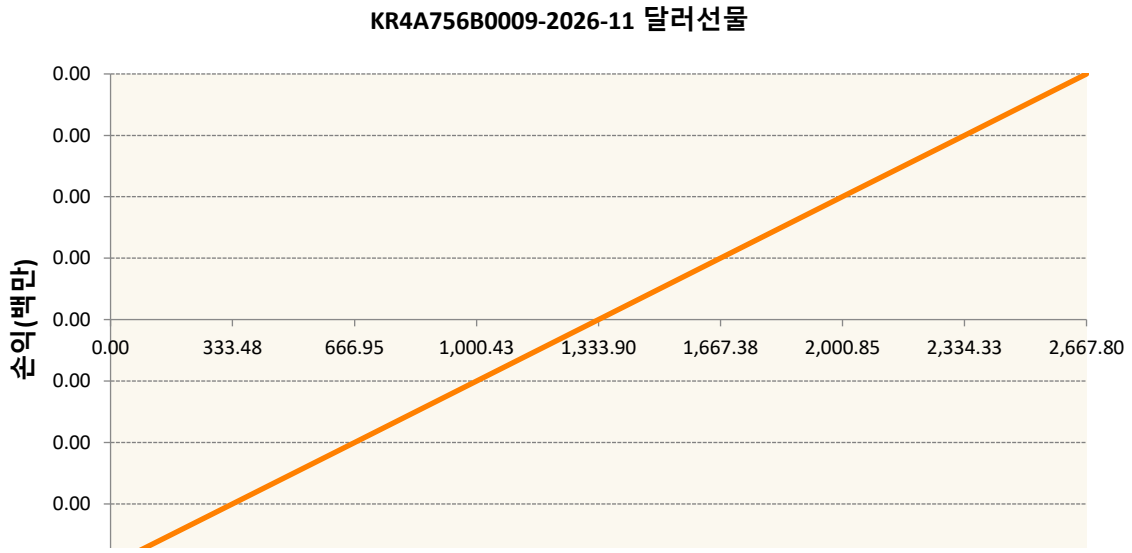
1. 계약금액

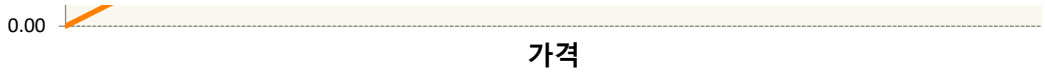
(단위:백만원)

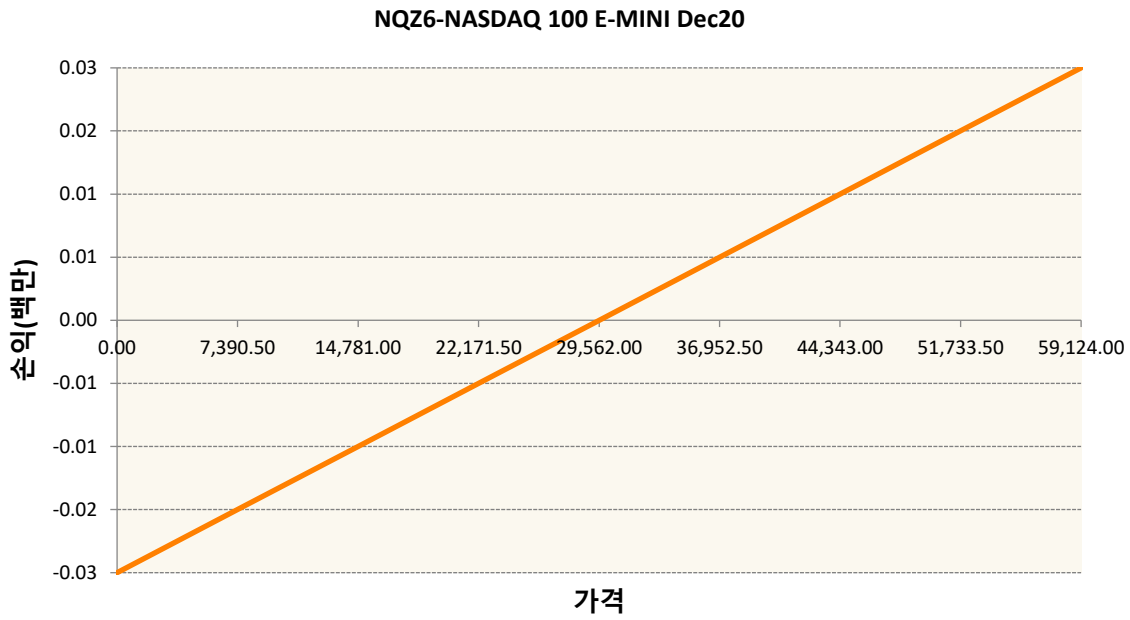
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
신규	지수	선물	0	0	0	장내
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	지수	선물	35,098	0	35,098	
누계	지수	선물	409	0	409	장내
누계	통화	선물	8,617	0	8,617	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HWBZ6	NASD100 MICRO EMIN Dec26	33
KR4A756B00	2026-11 달러선물	689
NQZ6	NASDAQ 100 E-MINI Dec20	2,808

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	2,537

공시일	2026-11-02
기준일	2026-10-30

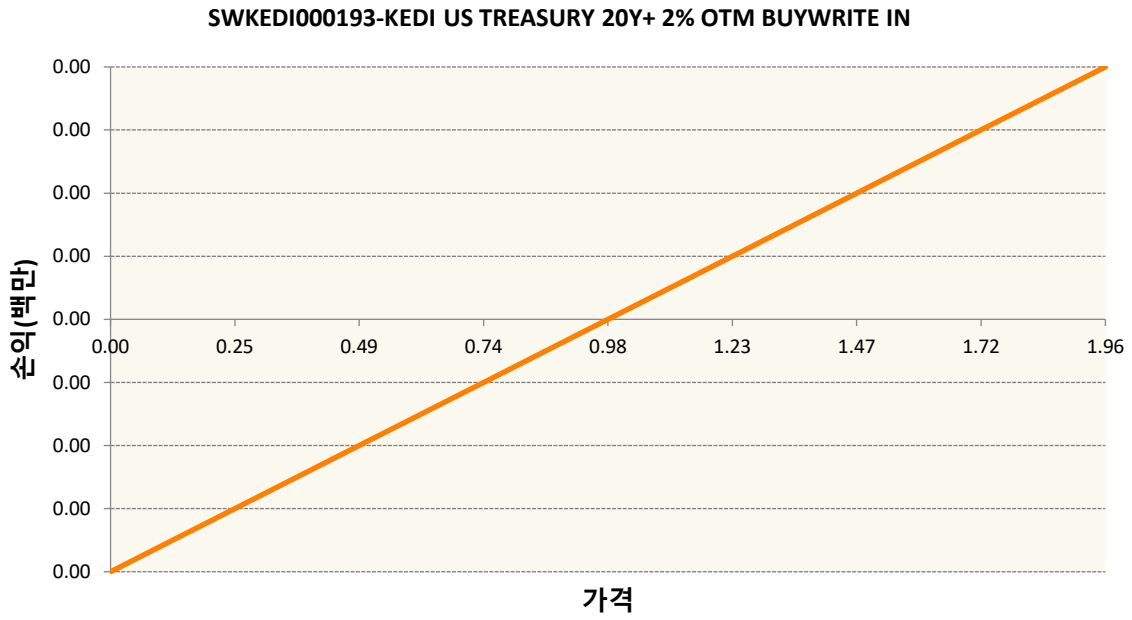
SOL미국30년국채커버드콜(합성)

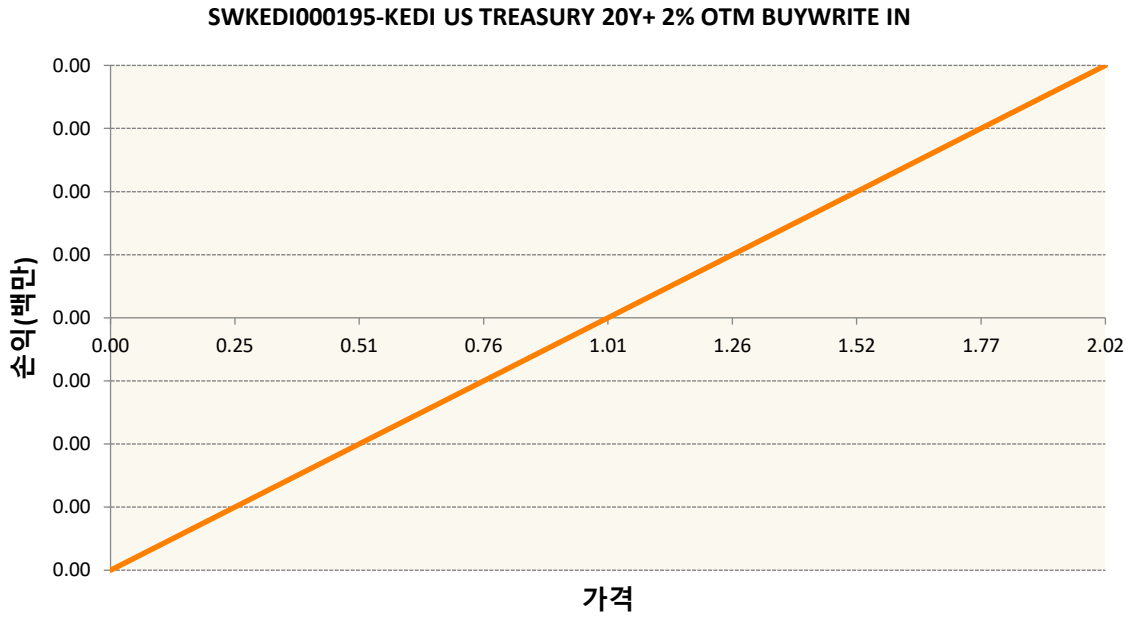
1. 계약금액

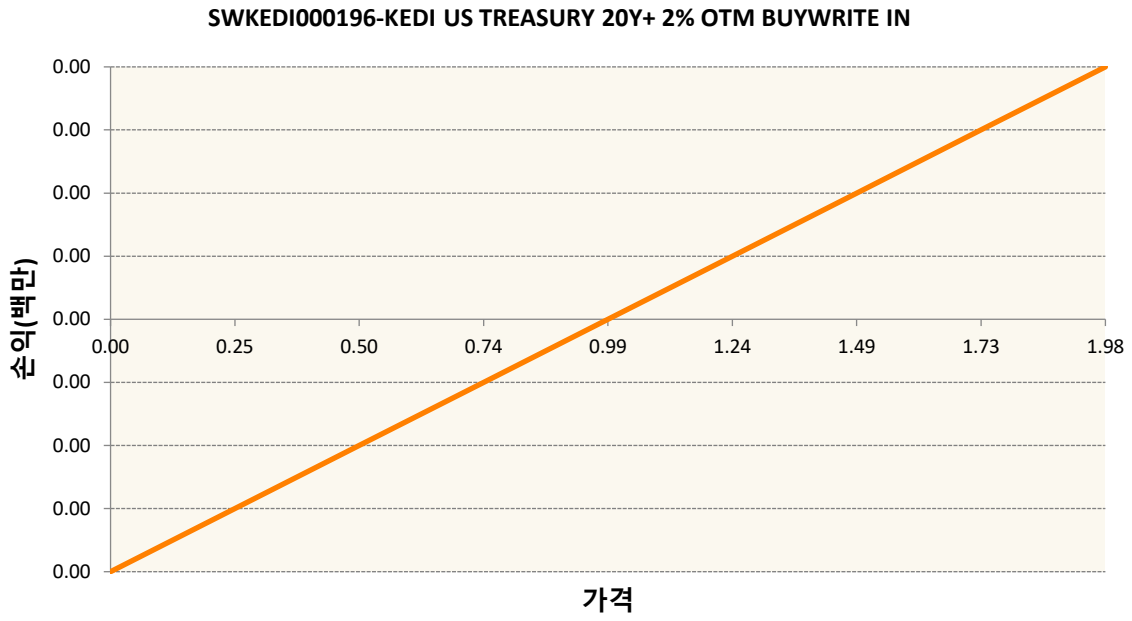
(단위:백만원)

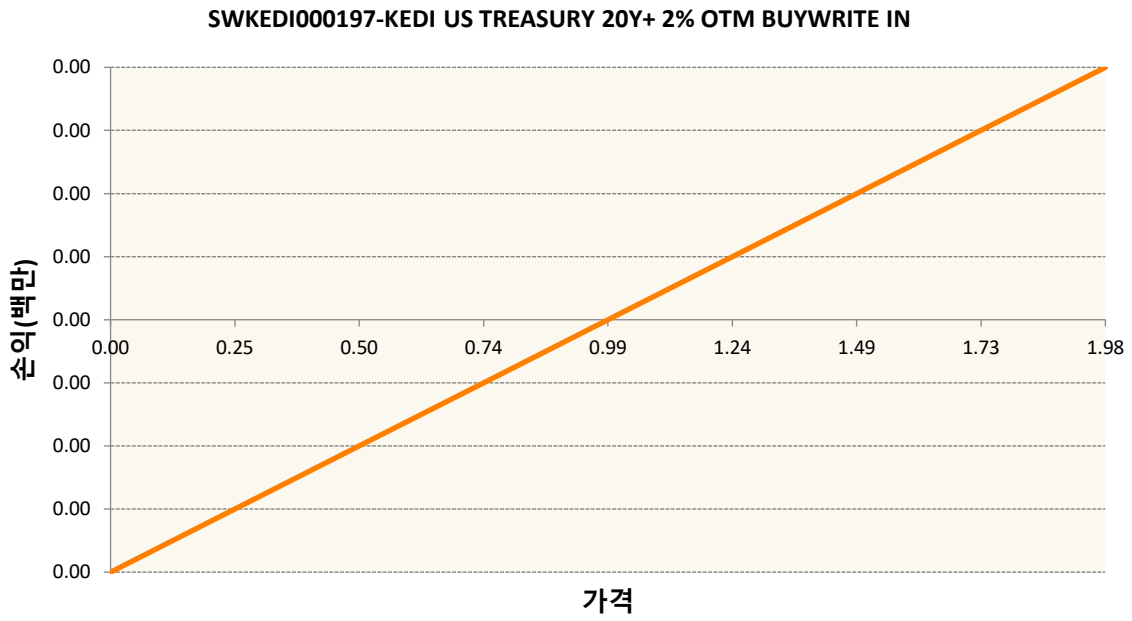
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	274,397	0	274,397	장외

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	6,930
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	7,809
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	2,569
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	4,664

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

8,618