공시일	2026-11-05
기준일	2026-11-04

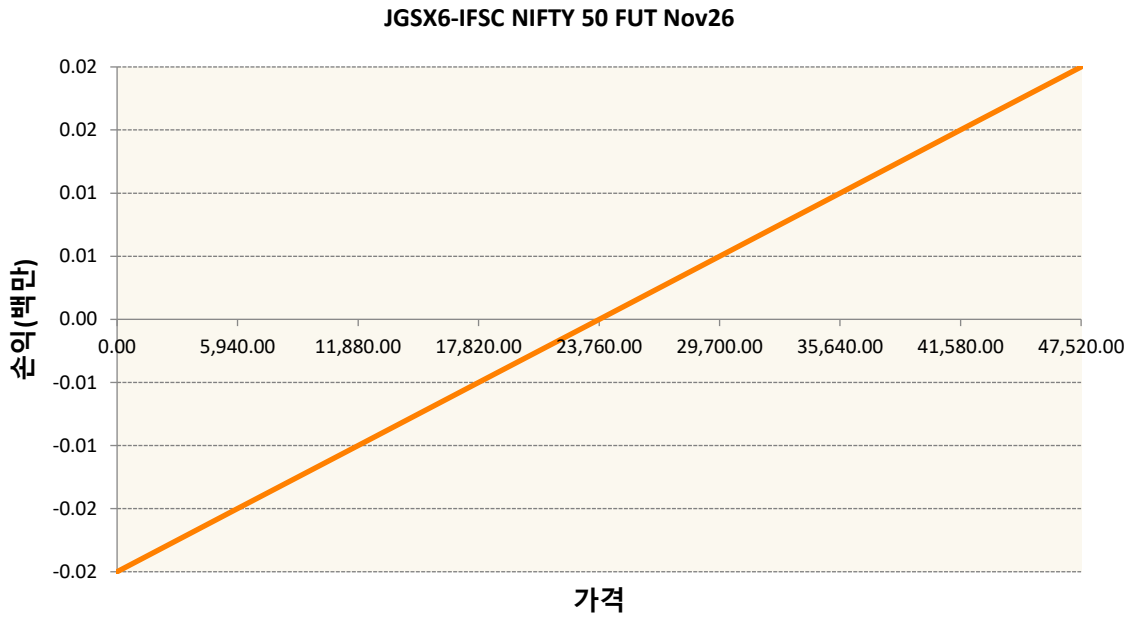
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	315	0	315	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

JGSX6	IFSC NIFTY 50 FUT Nov26	25

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

(단위:백만원)

17

공시일	2026-11-05
기준일	2026-11-04

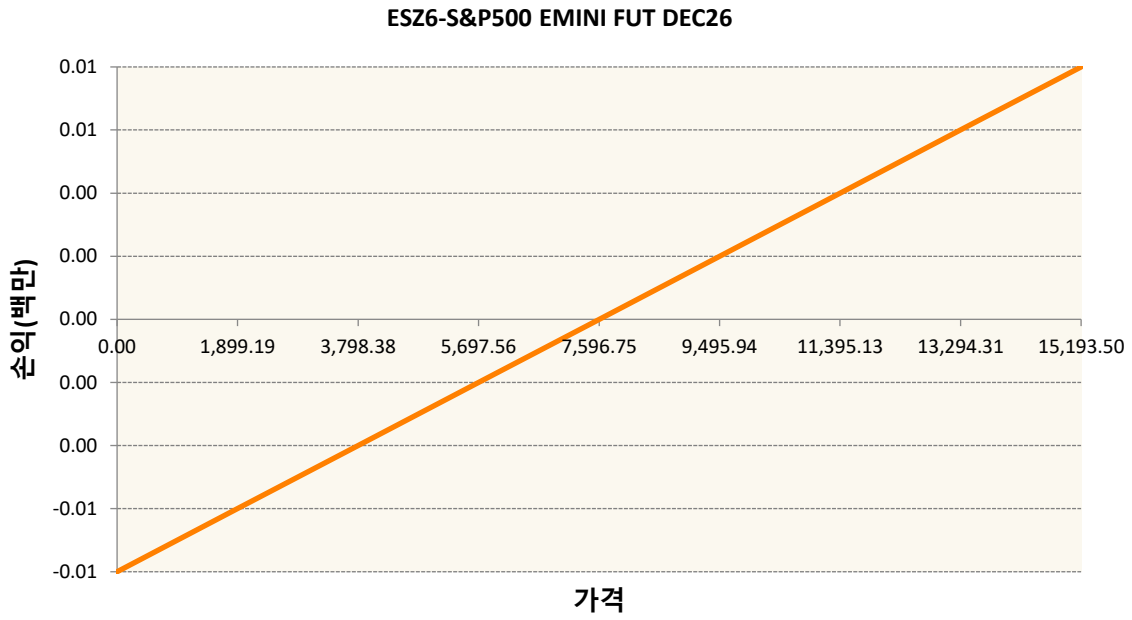
SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	525	0	525	

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	2026-11-05
기준일	2026-11-04

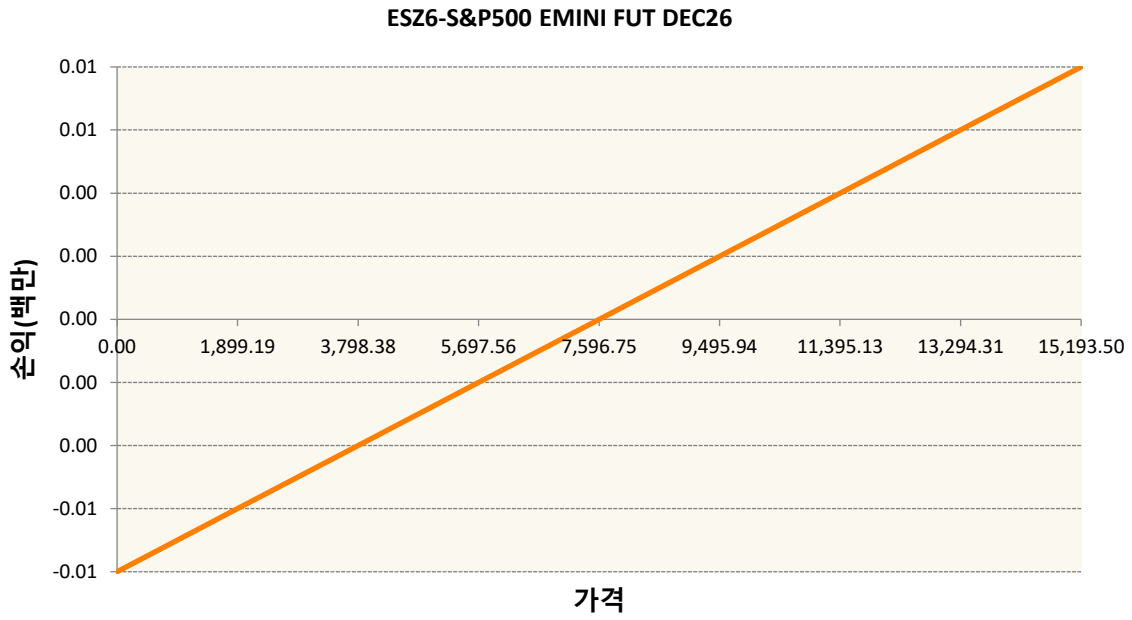
SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	525	0	525	

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	2026-11-05
기준일	2026-11-04

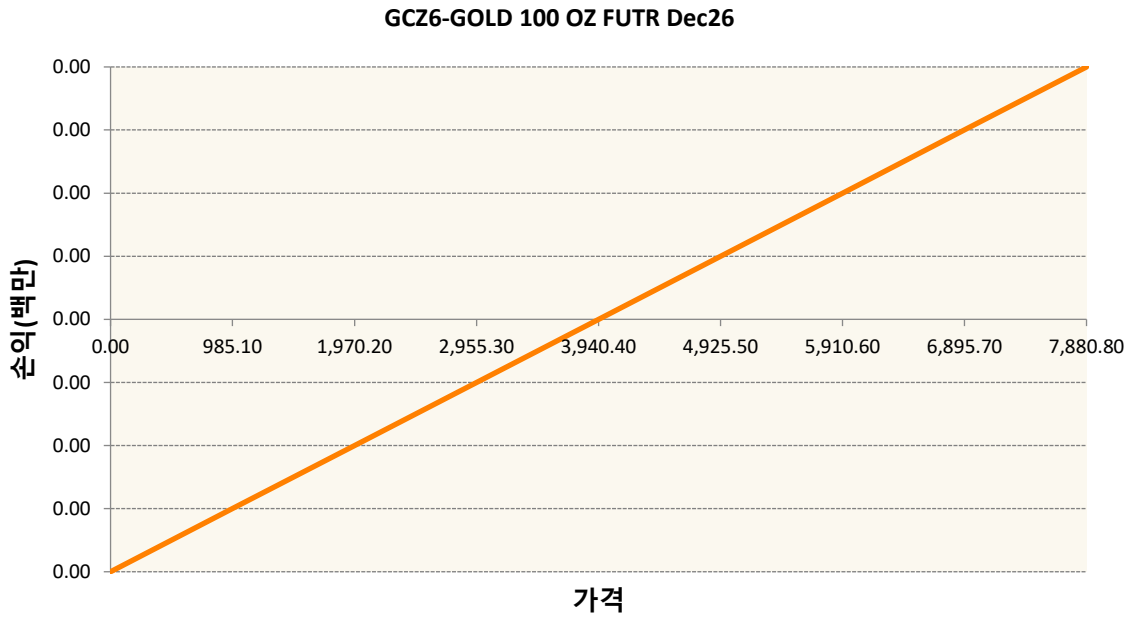
SOL골드커버드콜액티브특별자산상장지수(금

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			5,633	0	5,633	
누계	실물자산	옵션	0	0	0	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

AOGLDUSC3 GLD US 11/06/26 C370 EQUITY	1
GCZ6 GOLD 100 OZ FUTR Dec26	451

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

(단위:백만원)

576

공시일	2026-11-05
기준일	2026-11-04

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)

AOPLTRASC´PLTR US 11/06/26 C190 EQUITY	1
AOPLTRASP1PLTR US 11/06/26 P190 EQUITY	15
AOPLTRBC2(PLTR US 11/06/26 C202.5 EQUITY	455
AOPLTRBP2(PLTR US 11/06/26 P202.5 EQUITY	43

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

(단위:백만원)

1,791

공시일	2026-11-05
기준일	2026-11-04

SOL팔란티어미국채커버드콜혼합상장

1. 계약금액

(단위:백만원)

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

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

AOTLTUSCC(TLT US 11/06/26 C83 EQUITY	3

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

(단위:백만원)

2

공시일	2026-11-05
기준일	2026-11-04

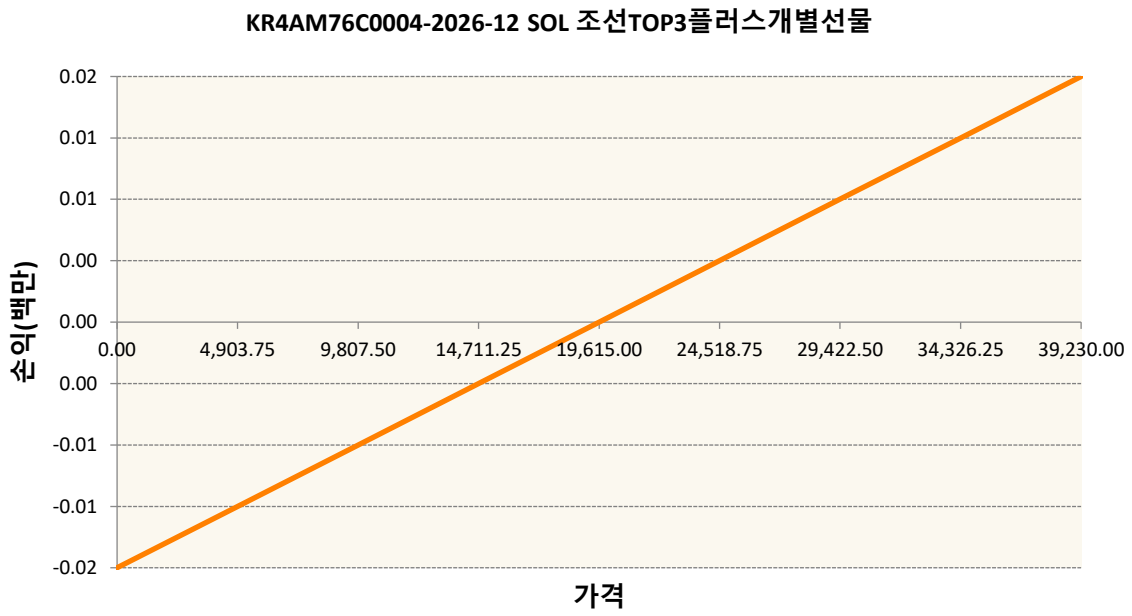
SOL조선TOP3플러스레버리지상장지수(주식)

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	5,810	0	5,810	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4AM76C0004	2026-12 SOL 조선TOP3플러스개별선물						4,626
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-4,626	-4,626	-4,626	-4,626	-4,626	-4,626	-4,626
-5.33%	-3,084	-3,084	-3,084	-3,084	-3,084	-3,084	-3,084
-2.67%	-1,542	-1,542	-1,542	-1,542	-1,542	-1,542	-1,542
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	1,542	1,542	1,542	1,542	1,542	1,542	1,542
5.33%	3,084	3,084	3,084	3,084	3,084	3,084	3,084
8.00%	4,626	4,626	4,626	4,626	4,626	4,626	4,626

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

7,854

공시일	2026-11-05
기준일	2026-11-04

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	2026-11-05
기준일	2026-11-04

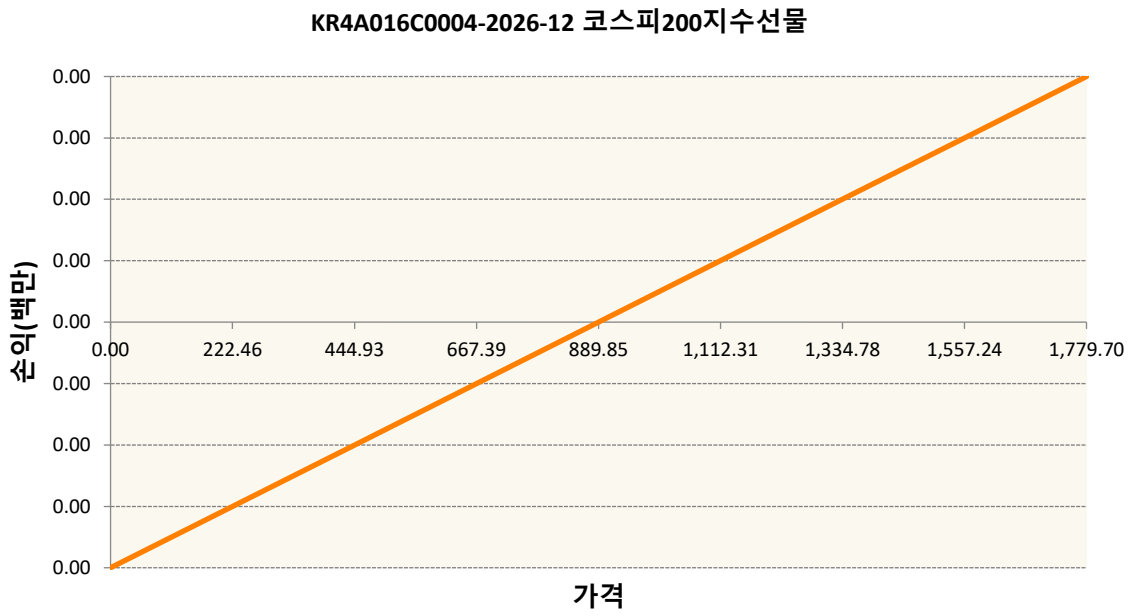
SOL 200타겟위클리커버드콜상장지수(주식)

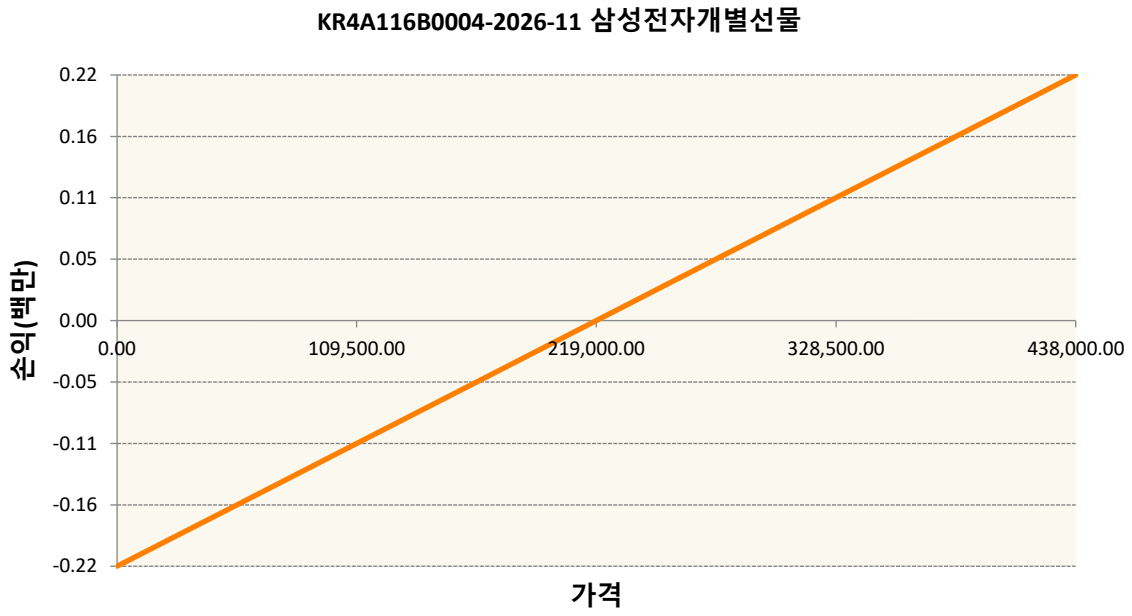
1. 계약금액

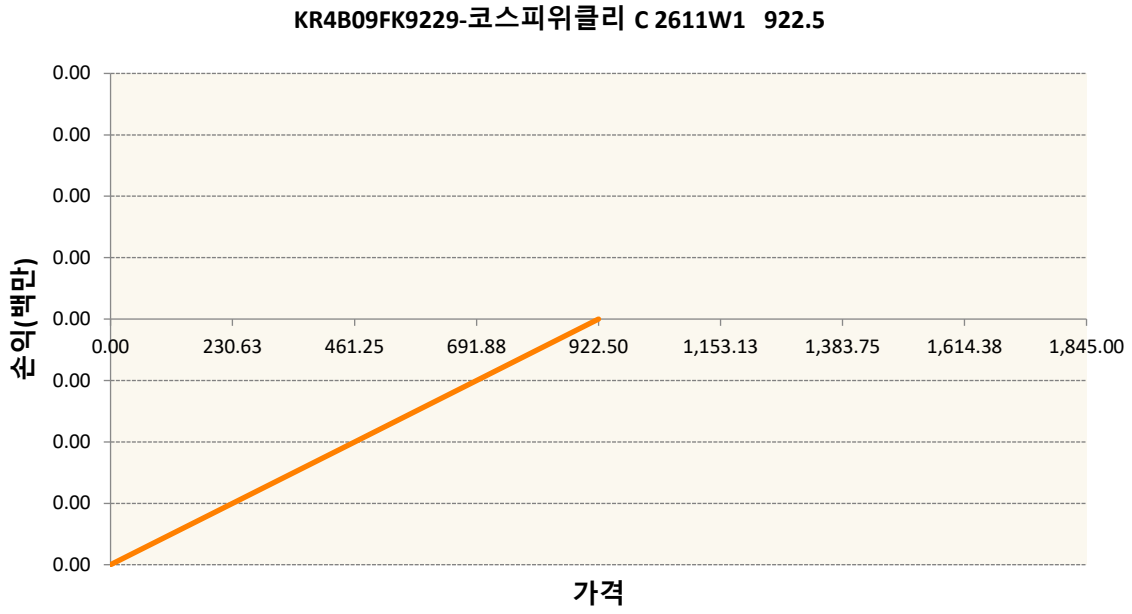
(단위:백만원)

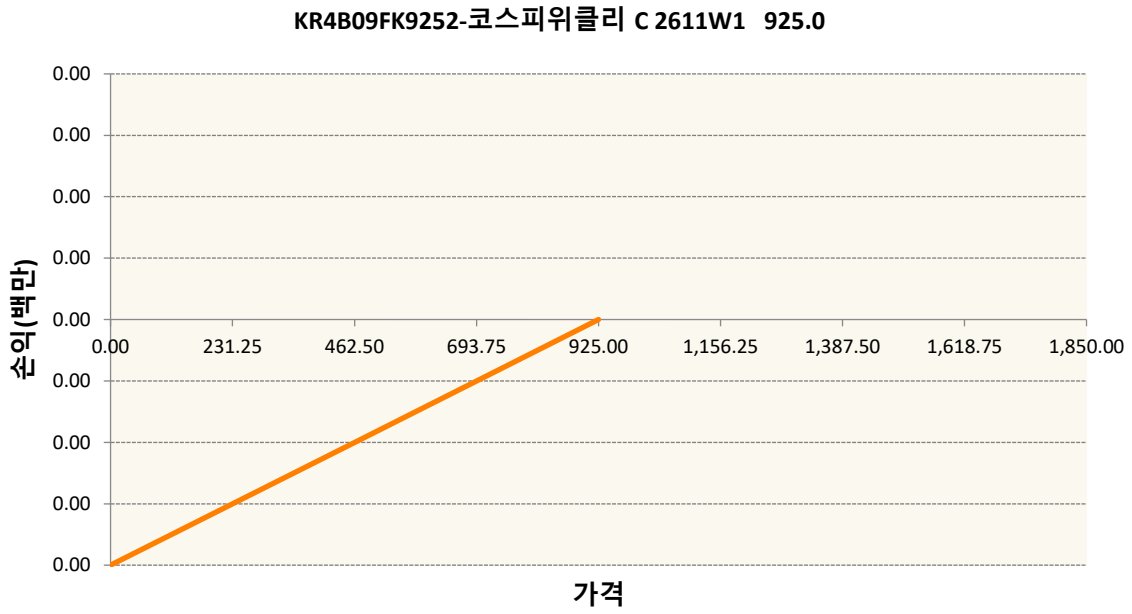
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	17,610	0	17,610	장내
누계	유가증권	옵션	0	39,941	-39,941	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4A016C0004	2026-12 코스피200지수선물						462
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-462	-462	-462	-462	-462	-462	-462
-5.33%	-308	-308	-308	-308	-308	-308	-308
-2.67%	-154	-154	-154	-154	-154	-154	-154
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	154	154	154	154	154	154	154
5.33%	308	308	308	308	308	308	308
8.00%	462	462	462	462	462	462	462
KR4A116B0004	2026-11 삼성전자개별선물						942
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-942	-942	-942	-942	-942	-942	-942
-5.33%	-628	-628	-628	-628	-628	-628	-628
-2.67%	-314	-314	-314	-314	-314	-314	-314
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	314	314	314	314	314	314	314
5.33%	628	628	628	628	628	628	628
8.00%	942	942	942	942	942	942	942
	KR4B09FK9229		코스피위클리 C 2611W1	922.5			1,806
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,806	-1,806	-1,806	-1,806	-1,806	-1,806	-1,806
-5.33%	-1,190	-1,190	-1,190	-1,190	-1,190	-1,191	-1,192
-2.67%	-574	-574	-576	-579	-582	-587	-593
0%	30	21	12	0	-13	-27	-42
2.67%	539	516	493	470	446	423	399
5.33%	819	799	777	755	733	710	687
8.00%	897	890	882	871	860	846	832
	KR4B09FK9252		코스피위클리 C 2611W1	925.0			1,203
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,203	-1,203	-1,203	-1,203	-1,203	-1,203	-1,203
-5.33%	-794	-794	-794	-794	-794	-795	-795
-2.67%	-385	-386	-386	-388	-390	-392	-396
0%	17	13	7	0	-8	-16	-26
2.67%	366	352	337	322	307	292	276
5.33%	570	555	540	525	510	494	478
8.00%	631	626	619	612	603	594	583

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

11,589

공시일	2026-11-05
기준일	2026-11-04

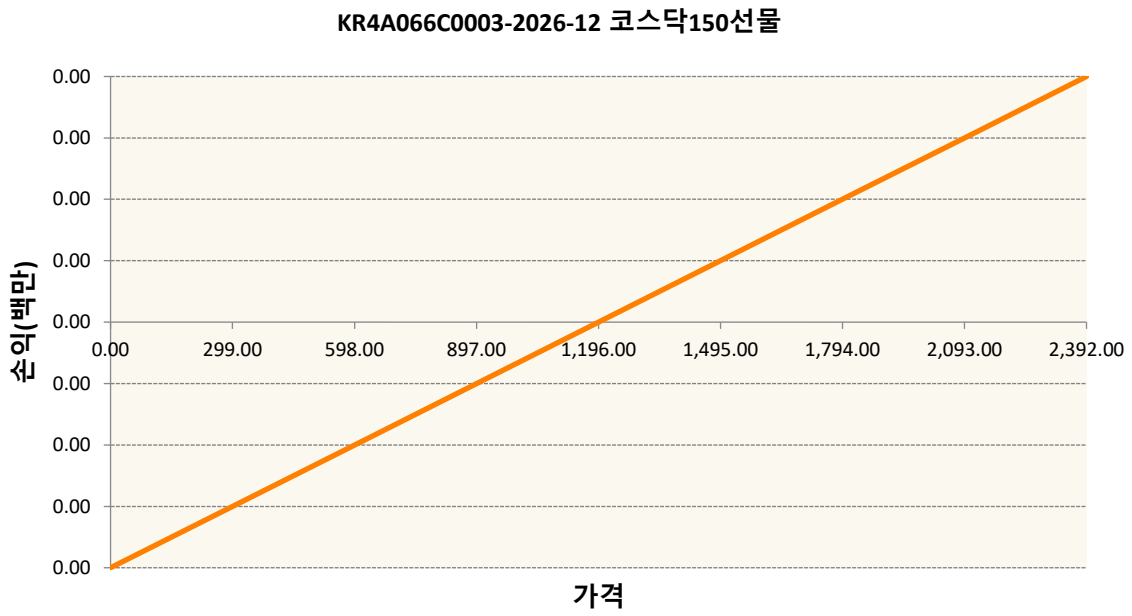
SOL코스닥150인덱스(주식-파생형)

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	478	0	478	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A066C0003 2026-12 코스닥150선물 38

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-38	-38	-38	-38	-38	-38	-38
-5.33%	-25	-25	-25	-25	-25	-25	-25
-2.67%	-13	-13	-13	-13	-13	-13	-13
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	13	13	13	13	13	13	13
5.33%	25	25	25	25	25	25	25
8.00%	38	38	38	38	38	38	38

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

126

공시일	2026-11-05
기준일	2026-11-04

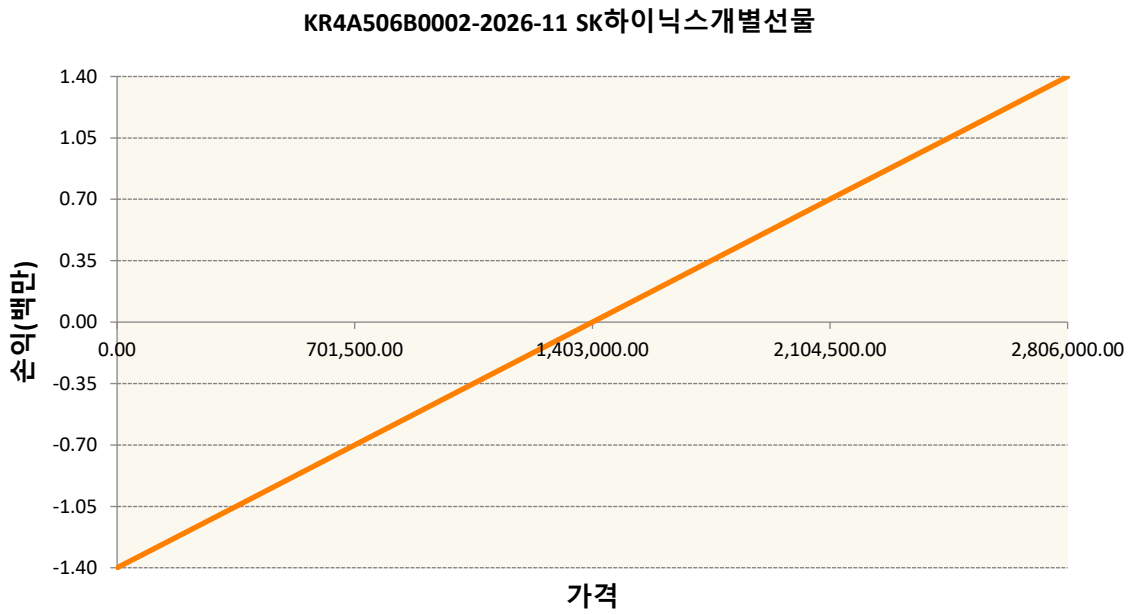
SOLSK하이닉스단일종목레버리지상장지수

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	420	0	420	장내
누계	유가증권	선물	25,100	0	25,100	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A506B0002	2026-11 SK하이닉스개별선물	1,998

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,998	-1,998	-1,998	-1,998	-1,998	-1,998	-1,998
-5.33%	-1,332	-1,332	-1,332	-1,332	-1,332	-1,332	-1,332
-2.67%	-666	-666	-666	-666	-666	-666	-666
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	666	666	666	666	666	666	666
5.33%	1,332	1,332	1,332	1,332	1,332	1,332	1,332
8.00%	1,998	1,998	1,998	1,998	1,998	1,998	1,998

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

9,796

공시일	2026-11-05
기준일	2026-11-04

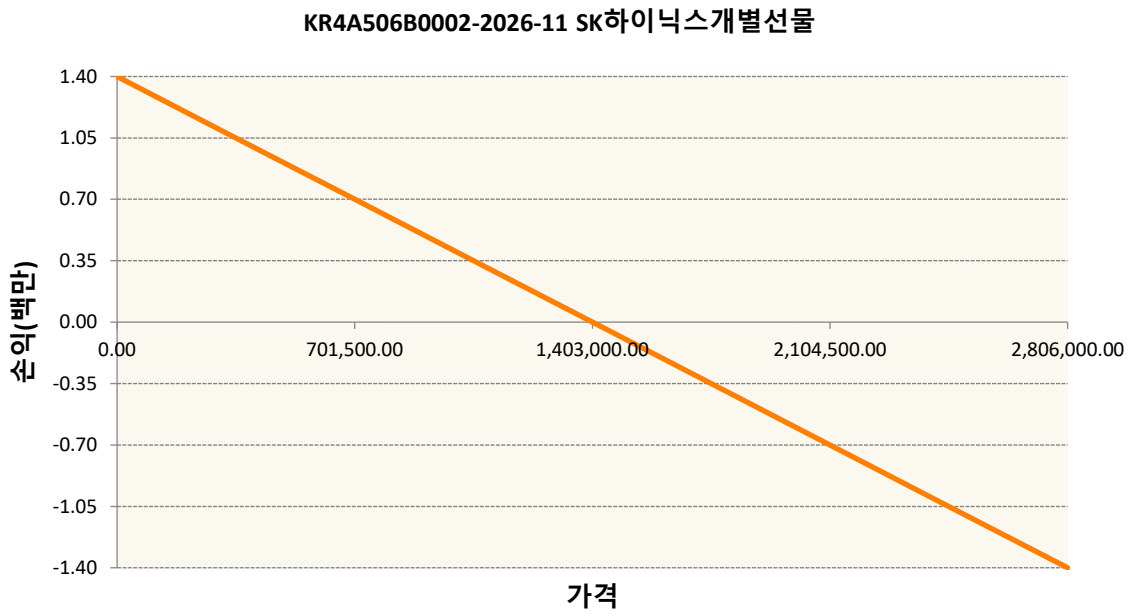
SOLSK하이닉스선물단일종목인버스2X상장지

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	10,990	11,254	-264	장내
누계	유가증권	선물	0	159,858	-159,858	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A506B0002	2026-11 SK하이닉스개별선물						12,725
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	12,725	12,725	12,725	12,725	12,725	12,725	12,725
-5.33%	8,483	8,483	8,483	8,483	8,483	8,483	8,483
-2.67%	4,242	4,242	4,242	4,242	4,242	4,242	4,242
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-4,242	-4,242	-4,242	-4,242	-4,242	-4,242	-4,242
5.33%	-8,483	-8,483	-8,483	-8,483	-8,483	-8,483	-8,483
8.00%	-12,725	-12,725	-12,725	-12,725	-12,725	-12,725	-12,725

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

62,389

공시일	2026-11-05
기준일	2026-11-04

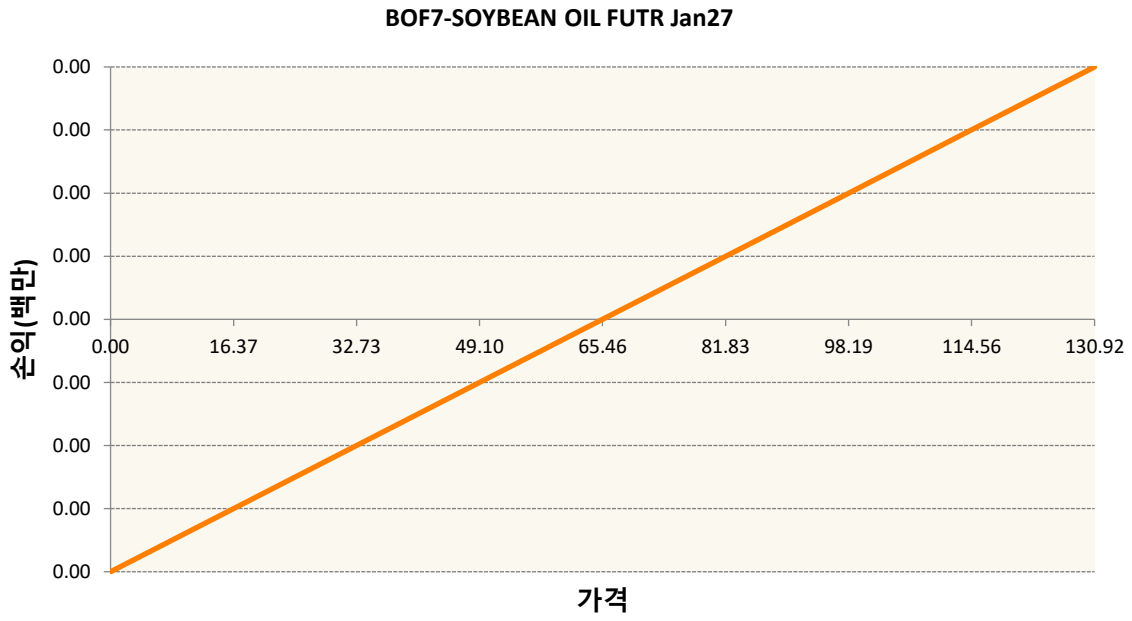
포커스농산물모(채권-파생형)

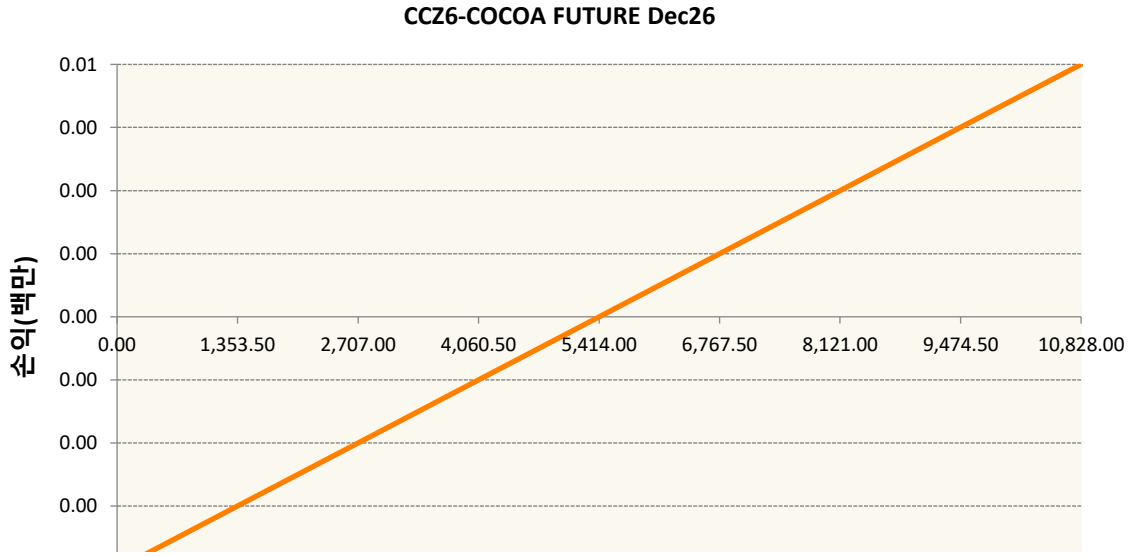
1. 계약금액

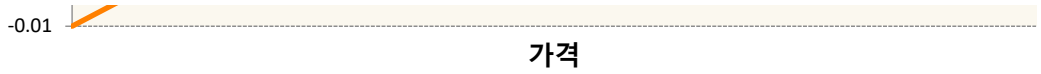
(단위:USD 백만)

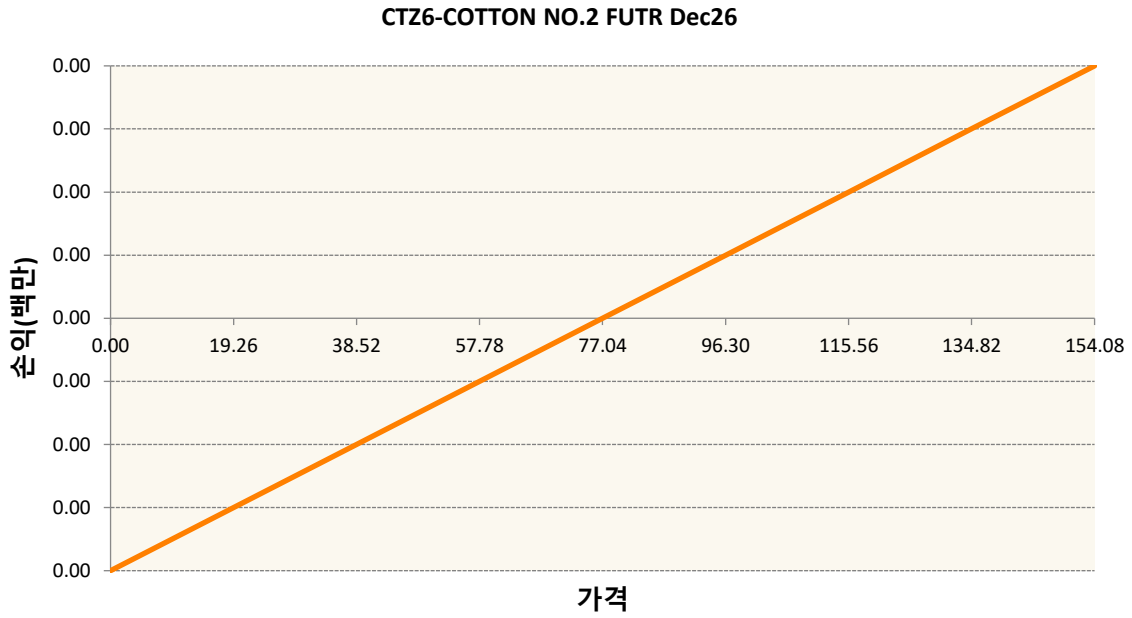
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	실물자산	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	실물자산	선물	341	0	341	
누계	유가증권	선물	2,067	0	2,067	
누계	통화	선물	0	282	-282	장내

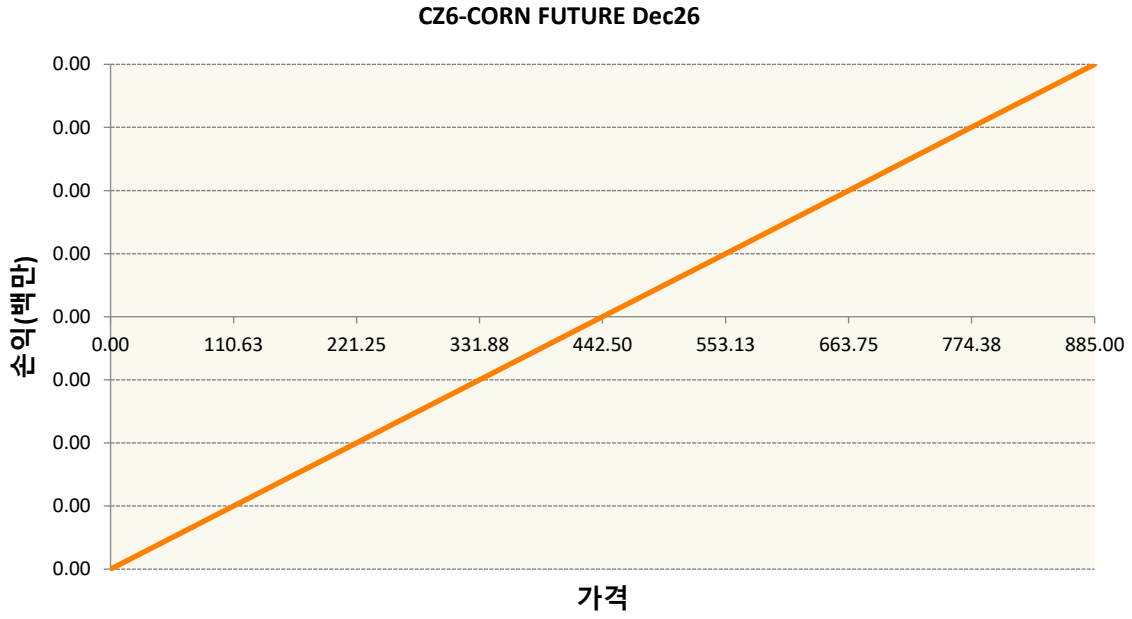
2. 만기시점의 손익구조

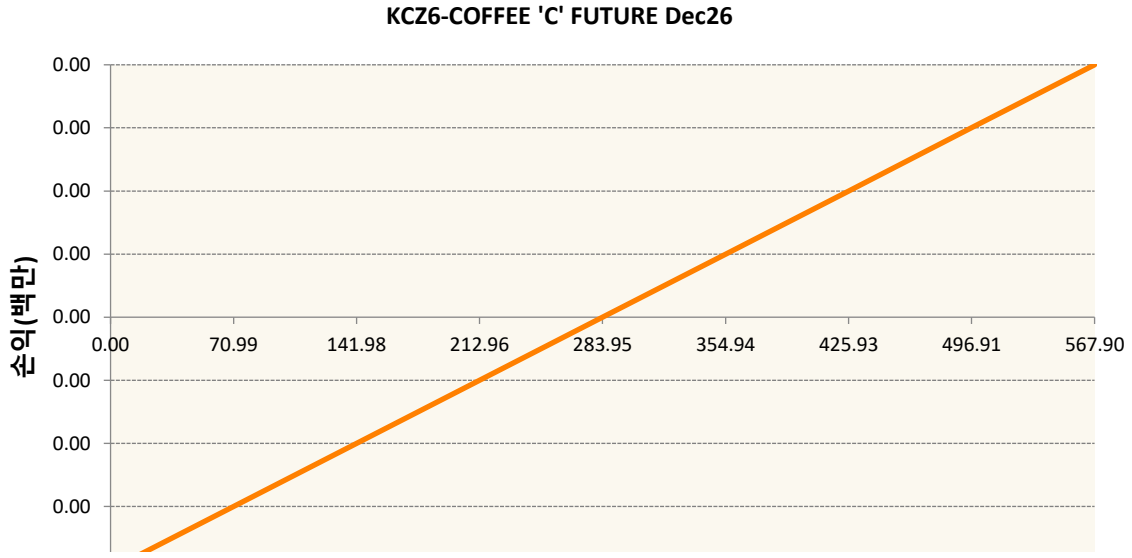


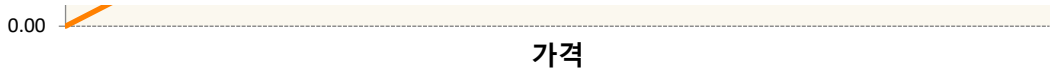



-0.01
가격

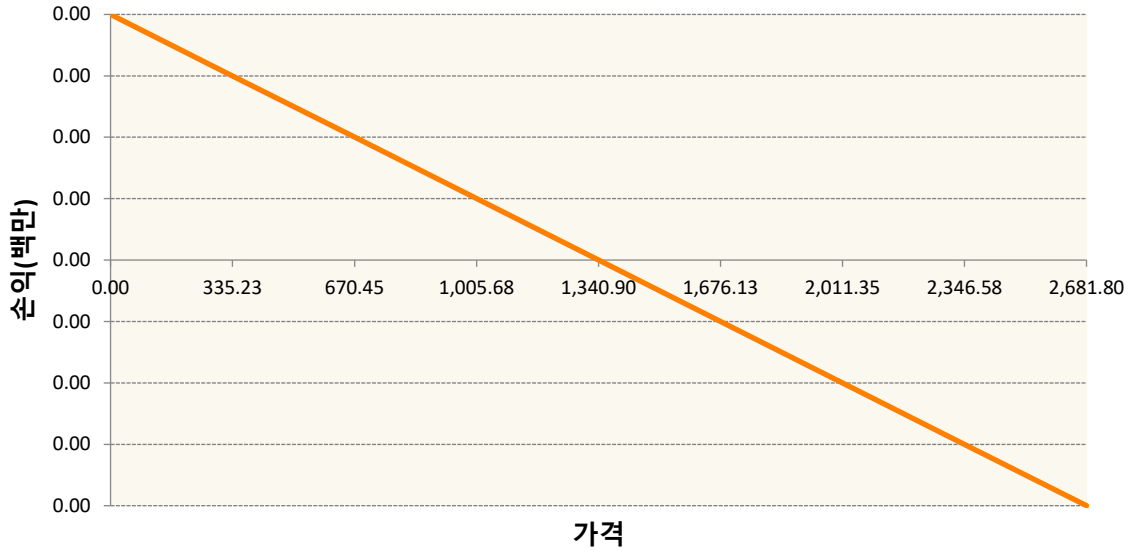

CTZ6-COTTON NO.2 FUTR Dec26
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
19.26
38.52
57.78
77.04
96.30
115.56
134.82
154.08
손익(백만)
가격


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
110.63
221.25
331.88
442.50
553.13
663.75
774.38
885.00
손익(백만)
가격

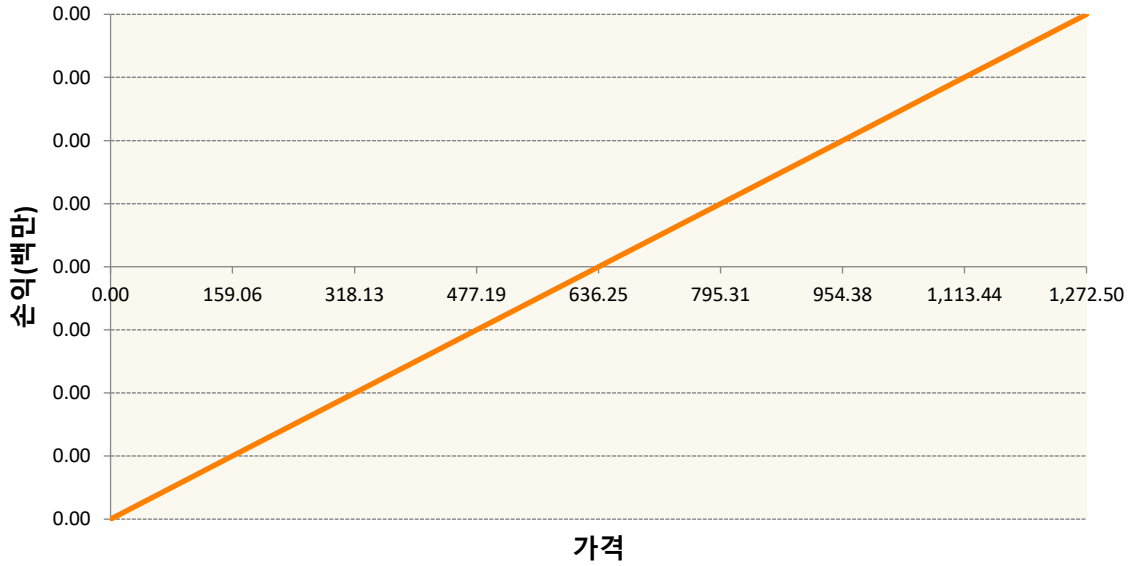

KCZ6-COFFEE 'C' FUTURE Dec26
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
70.99
141.98
212.96
283.95
354.94
425.93
496.91
567.90
손익(백만)



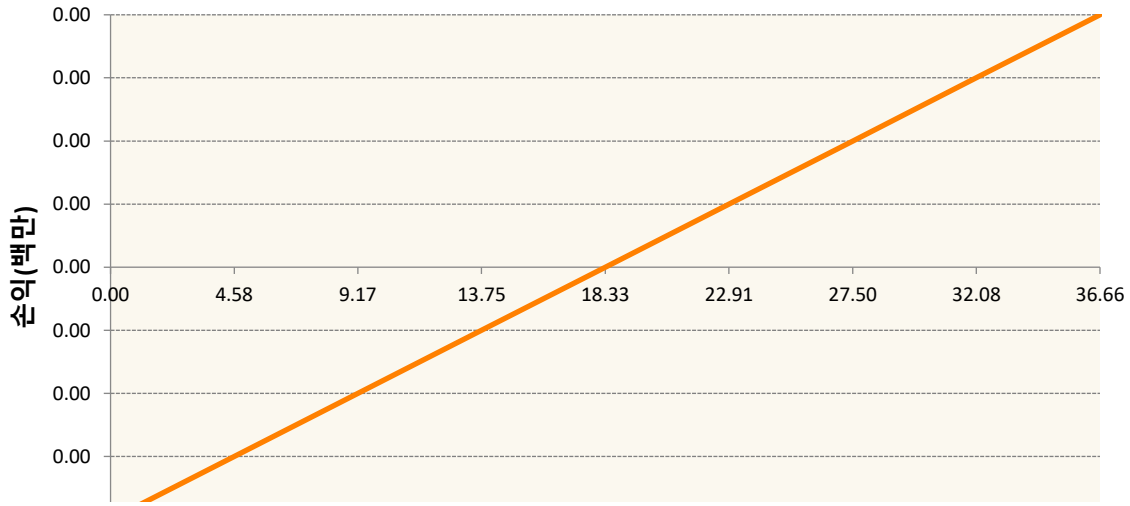
KR4A756B0009-2026-11 달러선물

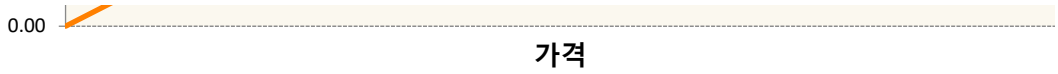


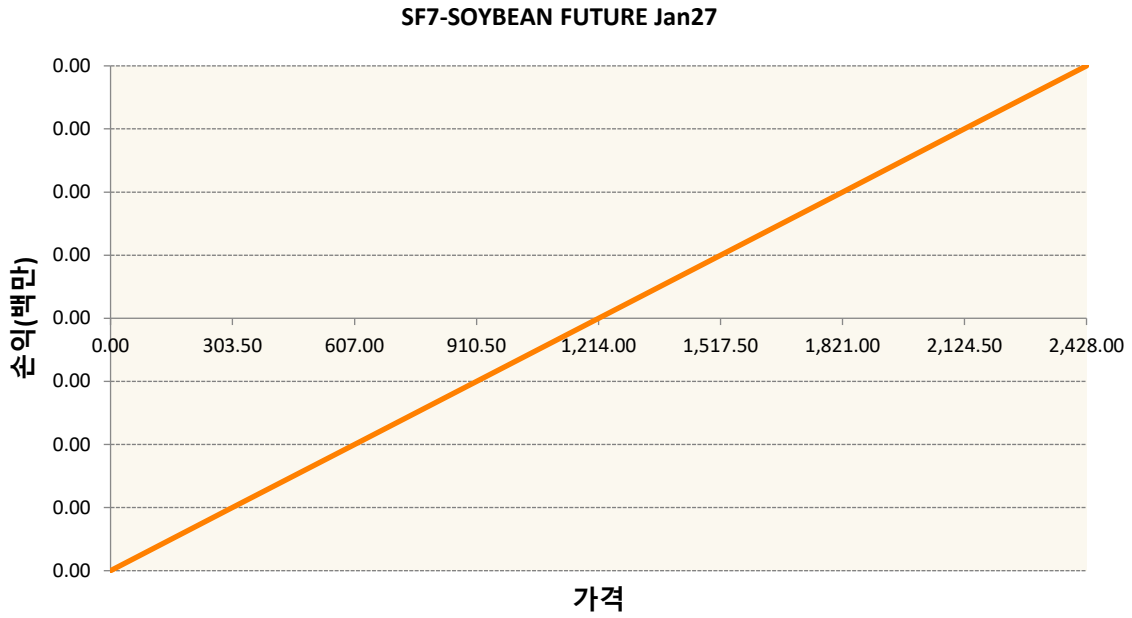
KWZ6-KC HRW WHEAT FUT Dec26

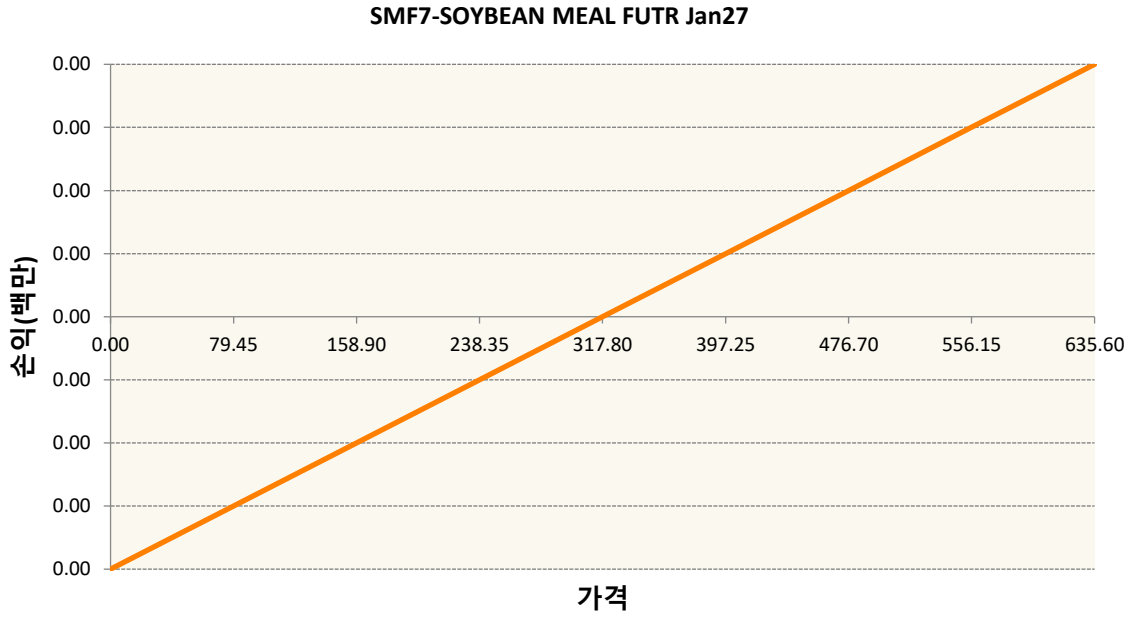


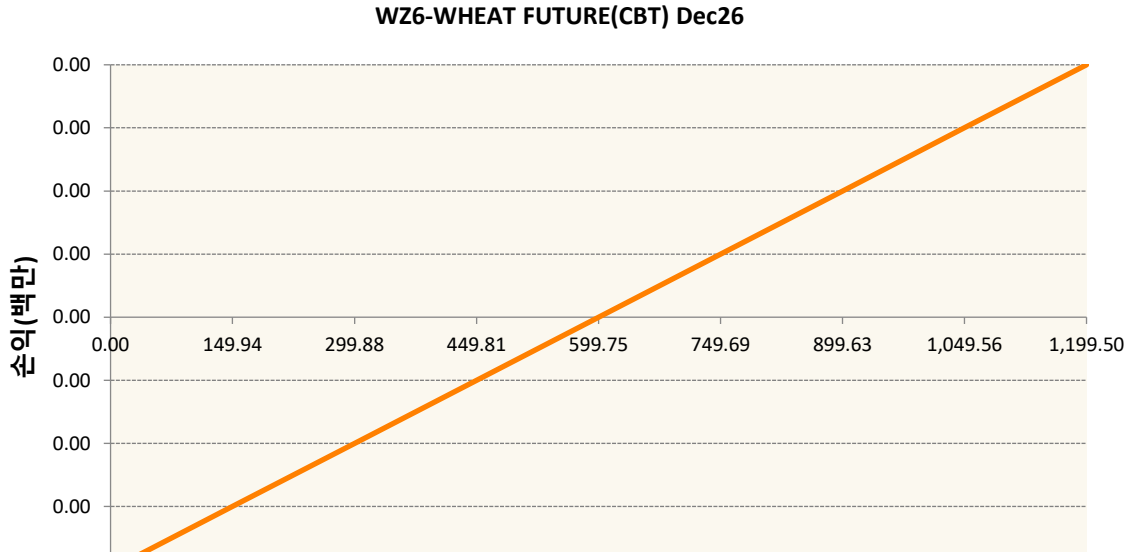
SBH7-SUGAR #11 (WORLD) MAR27




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
손익(백만)
0.00
303.50
607.00
910.50
1,214.00
1,517.50
1,821.00
2,124.50
2,428.00
가격


SMF7-SOYBEAN MEAL FUTR Jan27
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
손익(백만)
0.00
79.45
158.90
238.35
317.80
397.25
476.70
556.15
635.60
가격


WZ6-WHEAT FUTURE(CBT) Dec26
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
손익(백만)
0.00
149.94
299.88
449.81
599.75
749.69
899.63
1,049.56
1,199.50



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	2026-11-05
기준일	2026-11-04

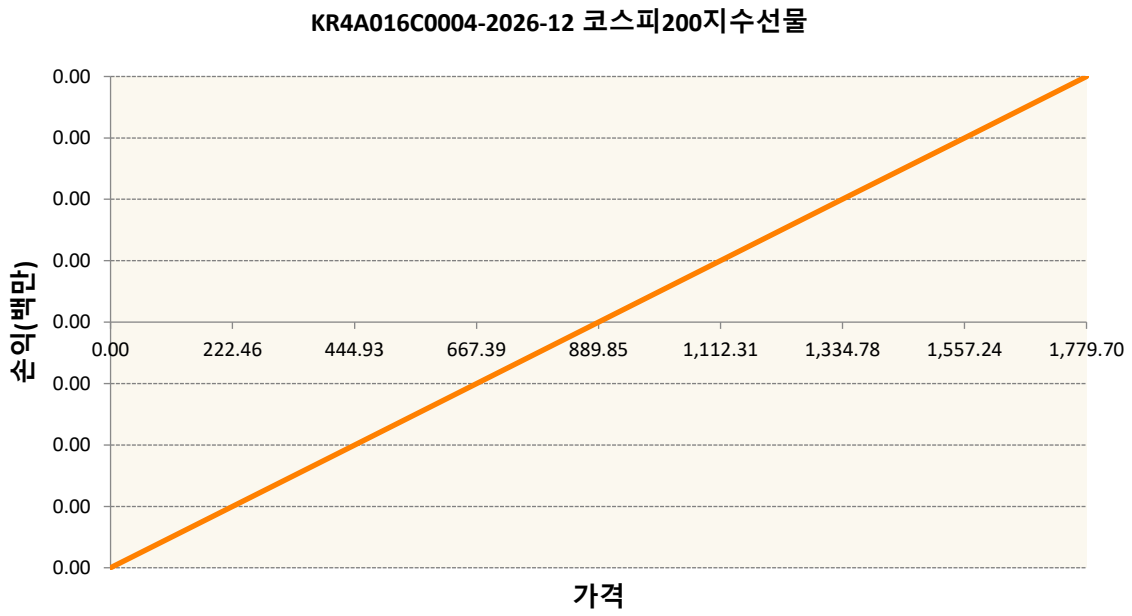
스마트인덱스모

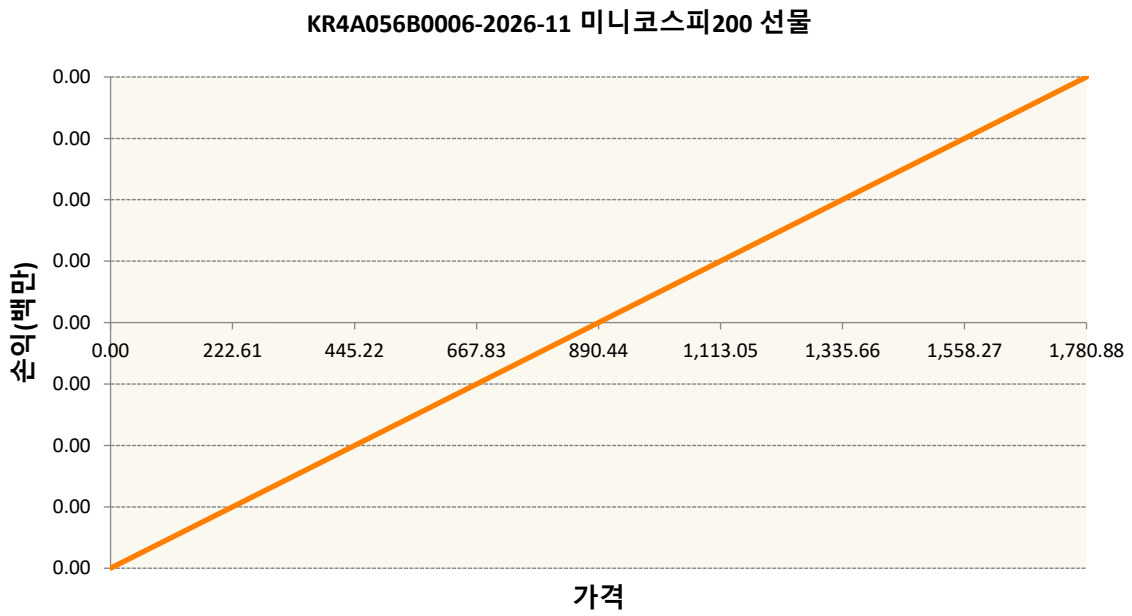
1. 계약금액

(단위:백만원)

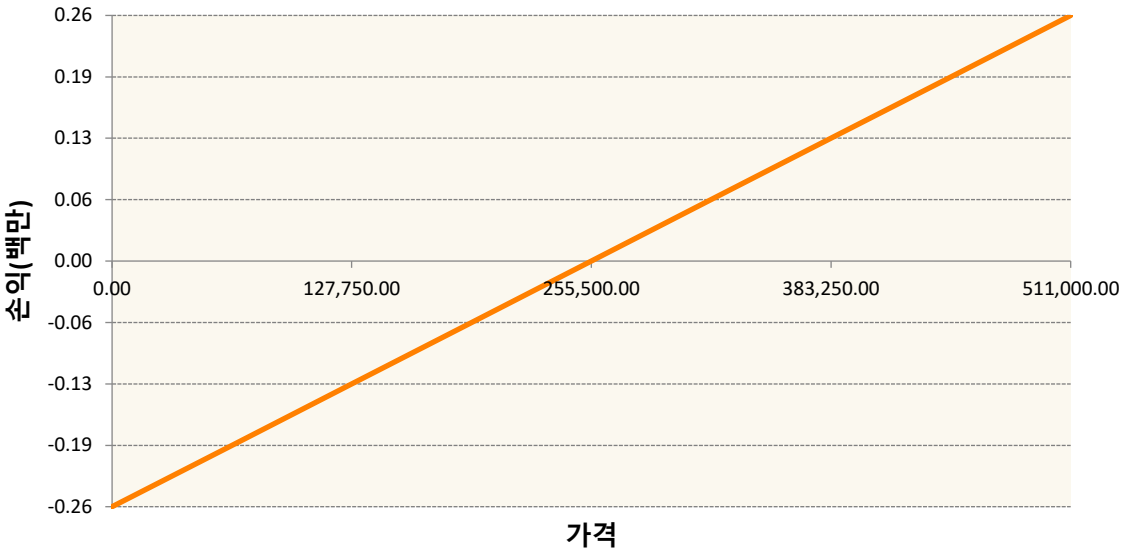
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	681	0	681	장내
누계	유가증권	선물	10,816	0	10,816	장내

2. 만기시점의 손익구조

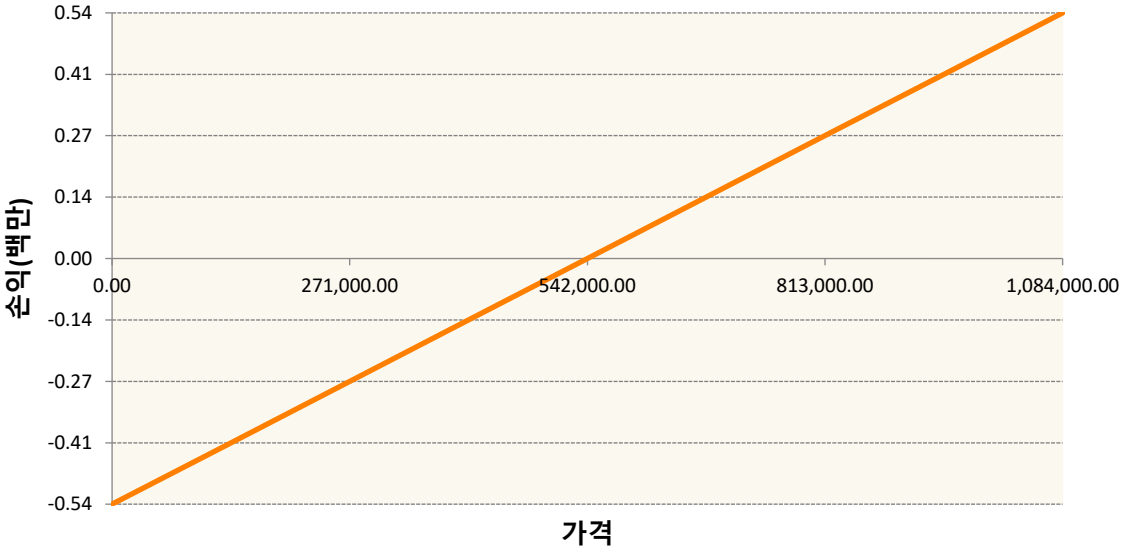




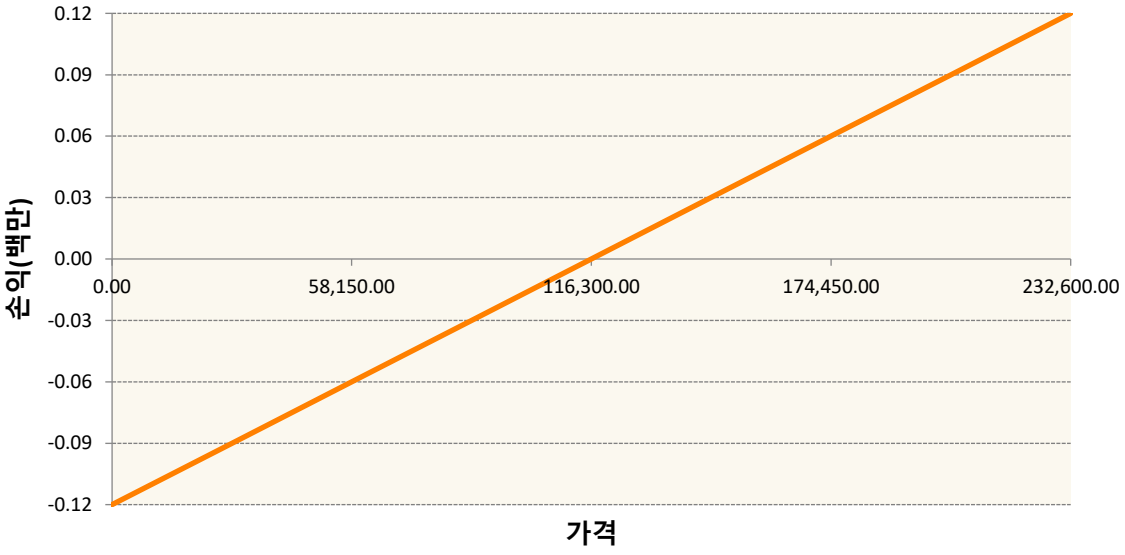
KR4A1Q6B0009-2026-11 에이피알개별선물



KR4A226B0001-2026-11 삼성SDI개별선물



KR4AB26B0009-2026-11 S-Oil개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

	KR4A016C0004		2026-12 코스피200지수선물				640
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-640	-640	-640	-640	-640	-640	-640
-5.33%	-427	-427	-427	-427	-427	-427	-427
-2.67%	-213	-213	-213	-213	-213	-213	-213
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	213	213	213	213	213	213	213
5.33%	427	427	427	427	427	427	427
8.00%	640	640	640	640	640	640	640
	KR4A056B0006		2026-11 미니코스피200 선물				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
	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				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
	KR4AB26B0009		2026-11 S-Oil개별선물				9
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-9	-9	-9	-9	-9	-9	-9
-5.33%	-6	-6	-6	-6	-6	-6	-6
-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%	6	6	6	6	6	6	6
8.00%	9	9	9	9	9	9	9

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

2,428

공시일	2026-11-05
기준일	2026-11-04

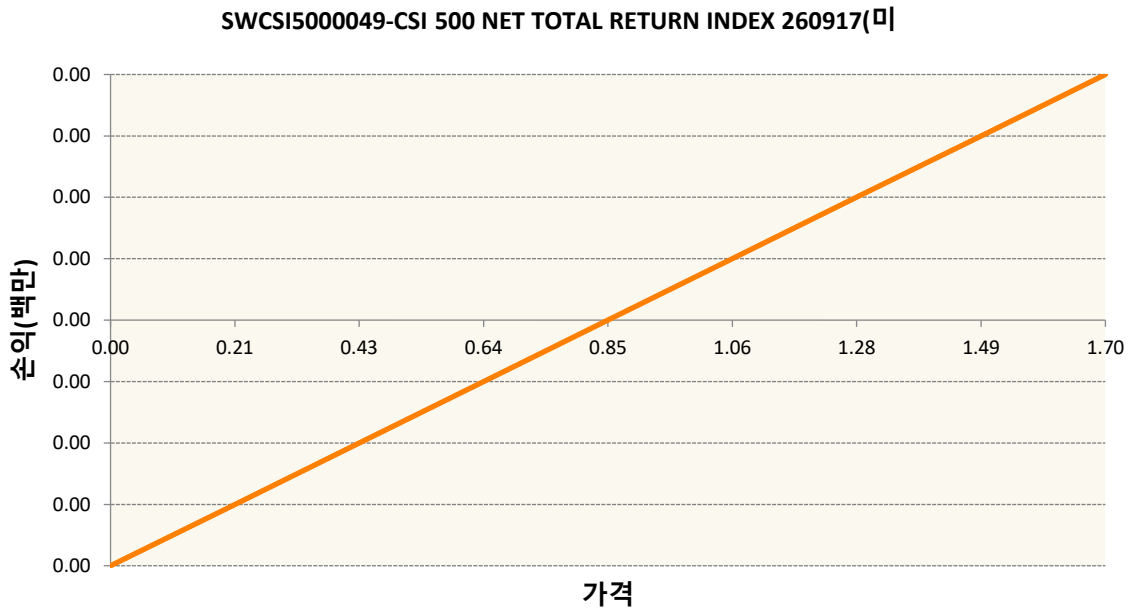
SOL차이나강소기업CSI500상장

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	4,523	0	4,523	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 CSI 500 NET TOTAL RETURN INDEX 260917(미	360

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

589

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2026-11-05
기준일	2026-11-04

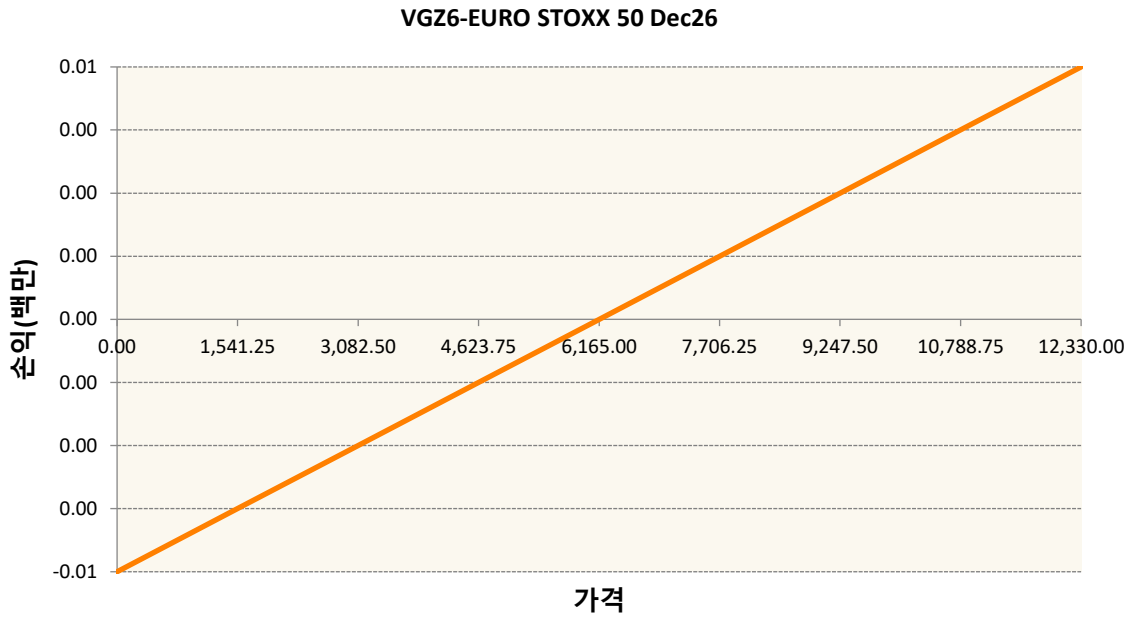
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,072	0	1,072	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGZ6	EURO STOXX 50 Dec26	86

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

(단위:백만원)

63

공시일	2026-11-05
기준일	2026-11-04

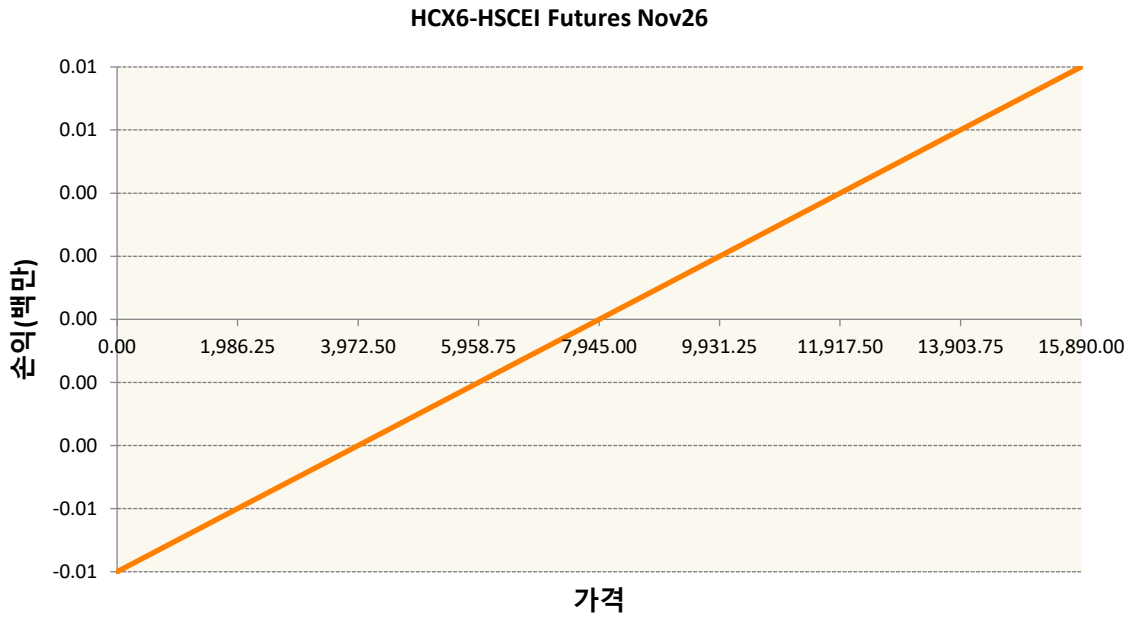
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,355	0	1,355	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCX6	HSCEI Futures Nov26	108

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

(단위:백만원)

102

공시일	2026-11-05
기준일	2026-11-04

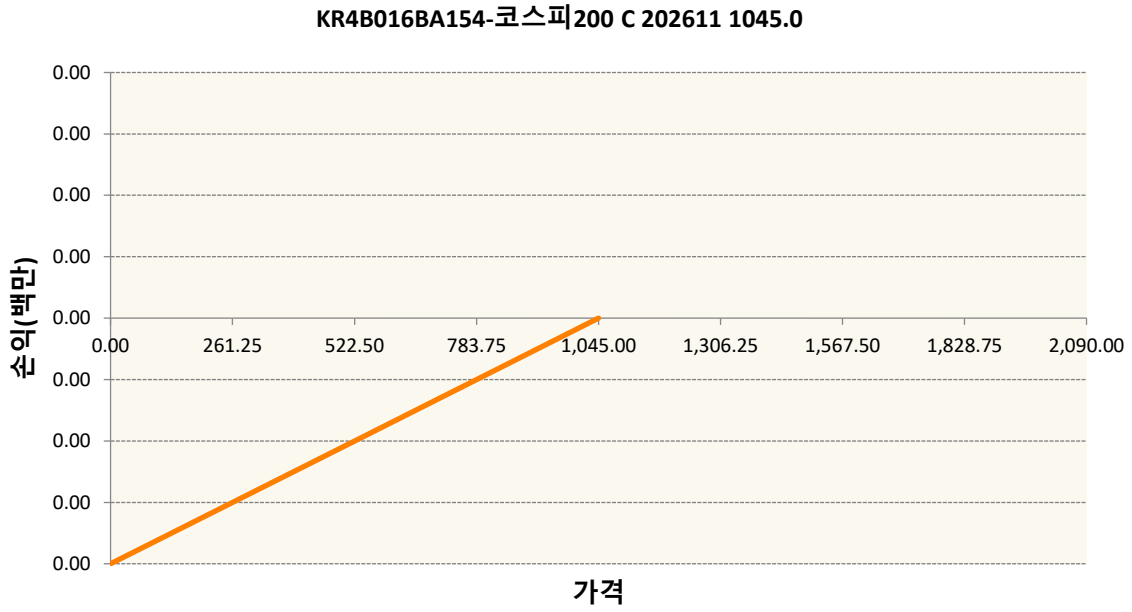
커버드콜모(주식혼합-파생형)

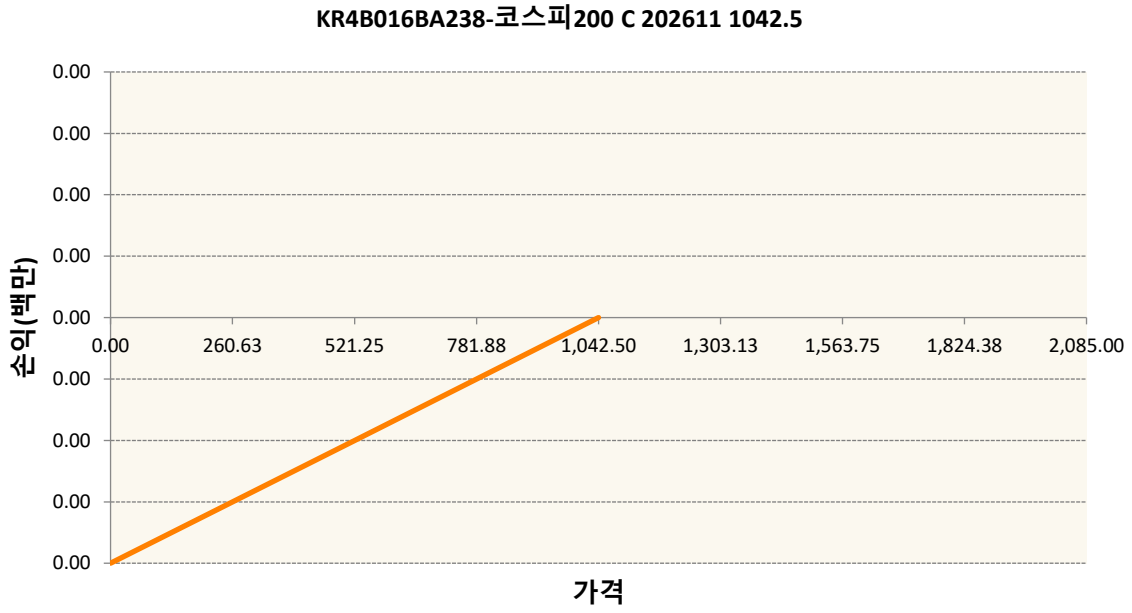
1. 계약금액

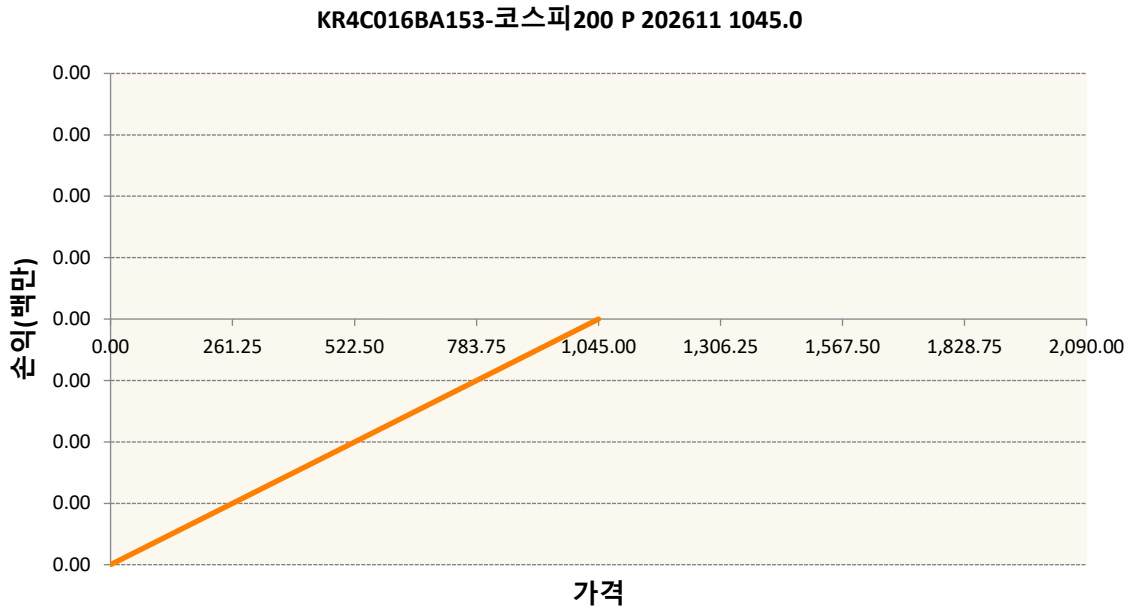
(단위:백만원)

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

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4B016BA154	코스피200 C 202611 1045.0						2,096
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-2,082	-2,082	-2,082	-2,084	-2,086	-2,090	-2,096
-5.33%	-1,377	-1,377	-1,379	-1,382	-1,387	-1,395	-1,406
-2.67%	-672	-675	-679	-686	-696	-710	-728
0%	29	23	14	0	-18	-41	-68
2.67%	724	711	692	668	639	605	567
5.33%	1,404	1,378	1,346	1,309	1,266	1,219	1,168
8.00%	2,054	2,011	1,963	1,910	1,852	1,791	1,727
KR4B016BA238	코스피200 C 202611 1042.5						651
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-646	-647	-647	-647	-648	-649	-651
-5.33%	-427	-428	-428	-429	-431	-433	-437
-2.67%	-208	-209	-211	-213	-216	-221	-226
0%	10	8	5	0	-6	-13	-22
2.67%	225	221	215	207	198	187	175
5.33%	436	428	417	405	392	377	360
8.00%	637	623	608	591	572	553	533
KR4C016BA153	코스피200 P 202611 1045.0						669
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-665	-665	-665	-665	-666	-667	-669
-5.33%	-440	-440	-440	-441	-443	-446	-449
-2.67%	-215	-215	-217	-219	-222	-227	-232
0%	9	7	4	0	-6	-13	-22

2.67%	231	227	221	213	204	193	181
5.33%	448	440	430	418	404	389	373
8.00%	656	642	627	610	591	572	551

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

6,749

공시일	2026-11-05
기준일	2026-11-04

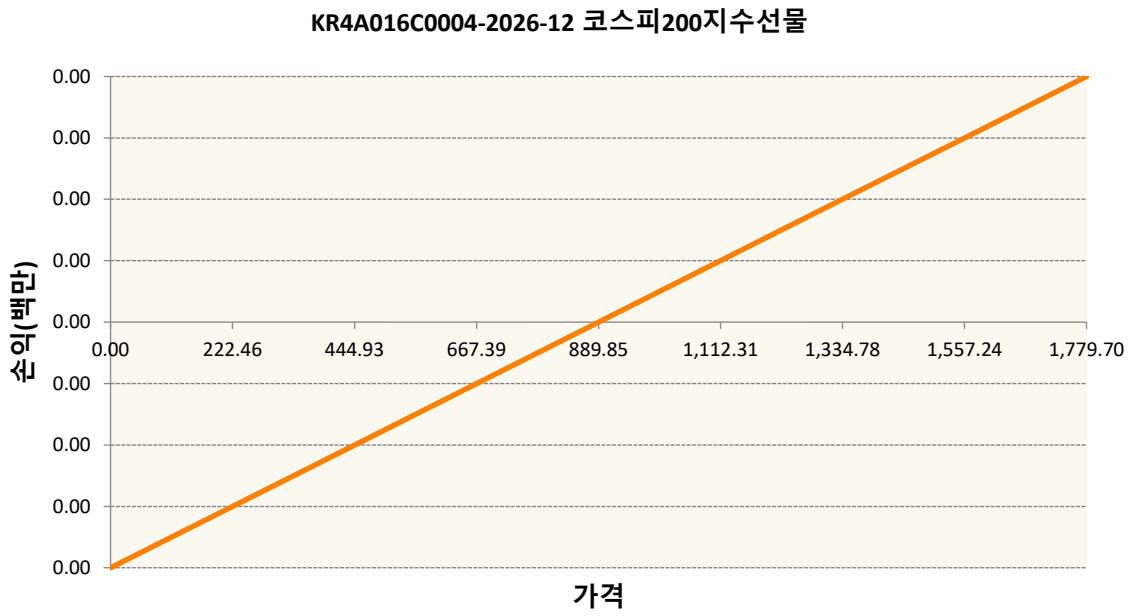
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

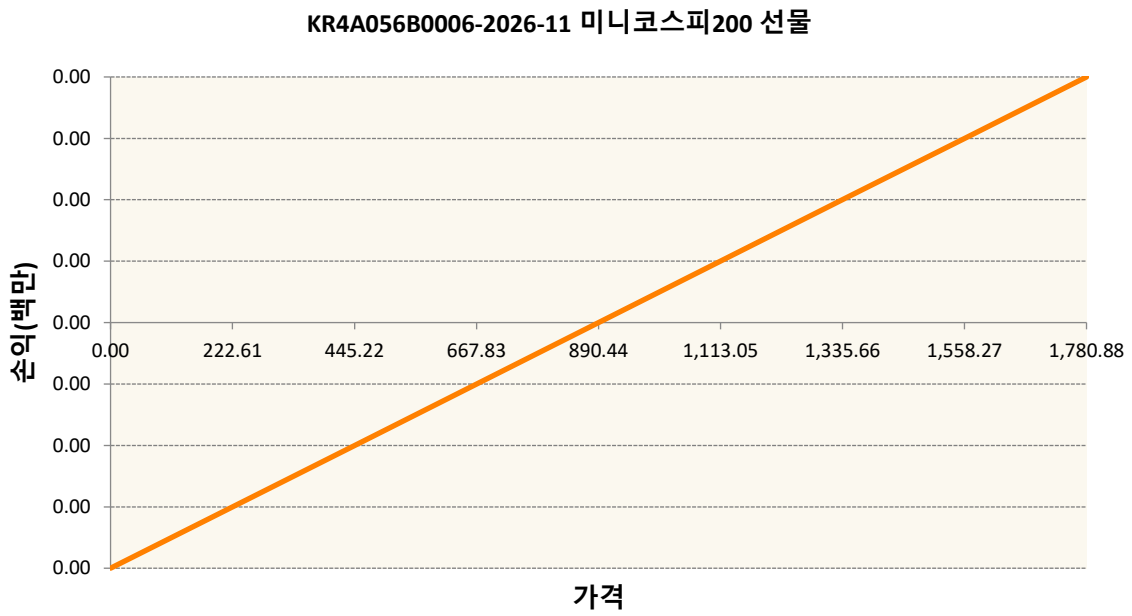
1. 계약금액

(단위:백만원)

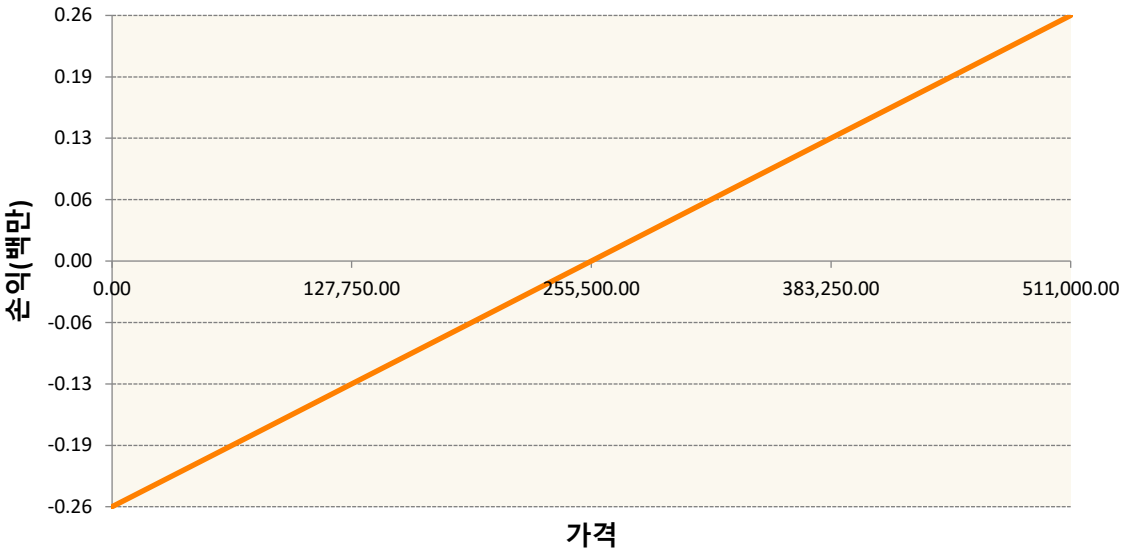
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	224	-224	장내
누계	유가증권	선물	1,870	0	1,870	장내

2. 만기시점의 손익구조

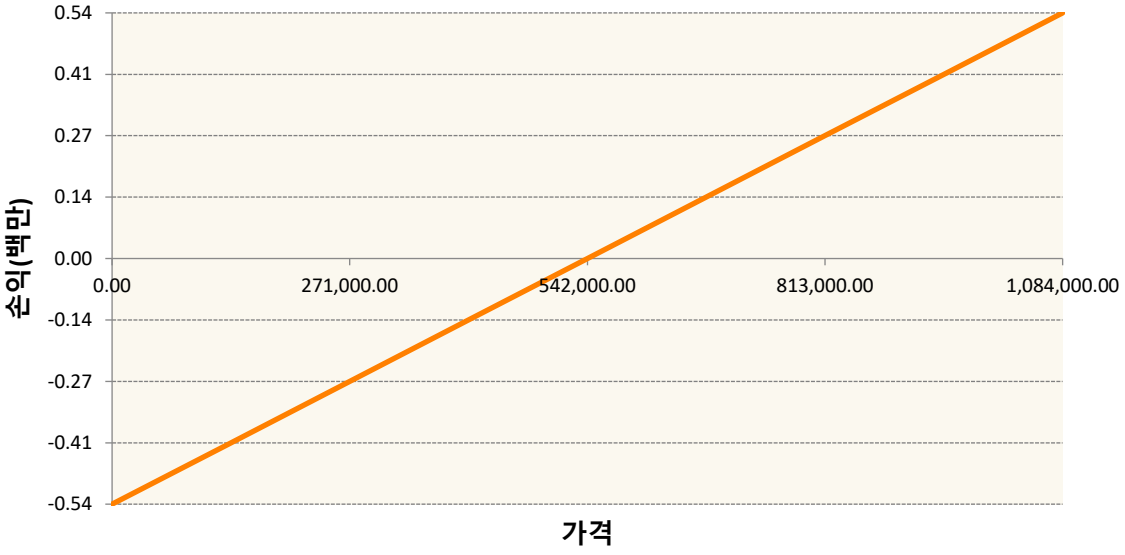




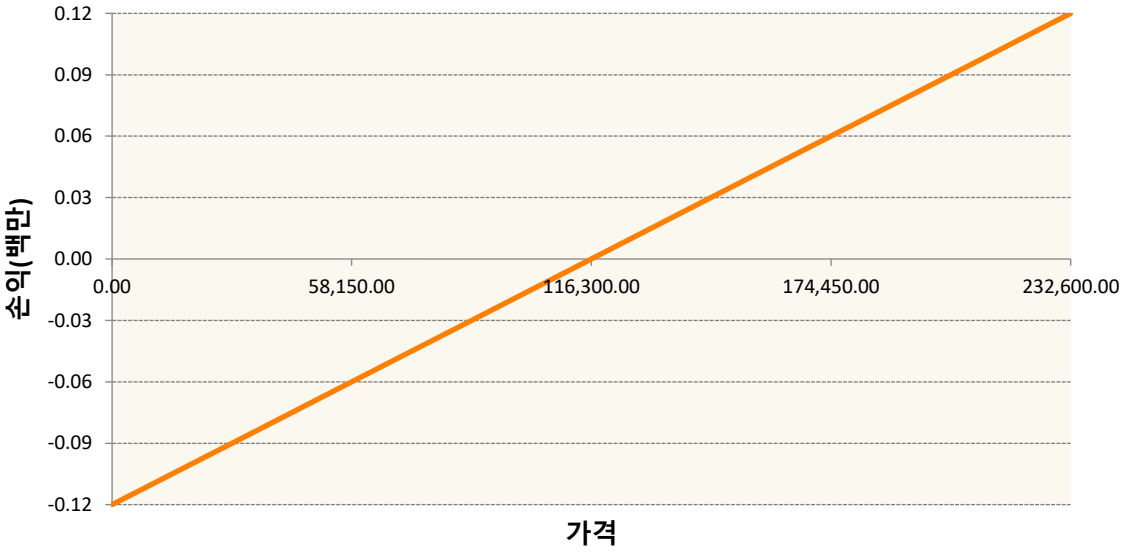
KR4A1Q6B0009-2026-11 에이피알개별선물



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%	-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%	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

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

258

공시일	2026-11-05
기준일	2026-11-04

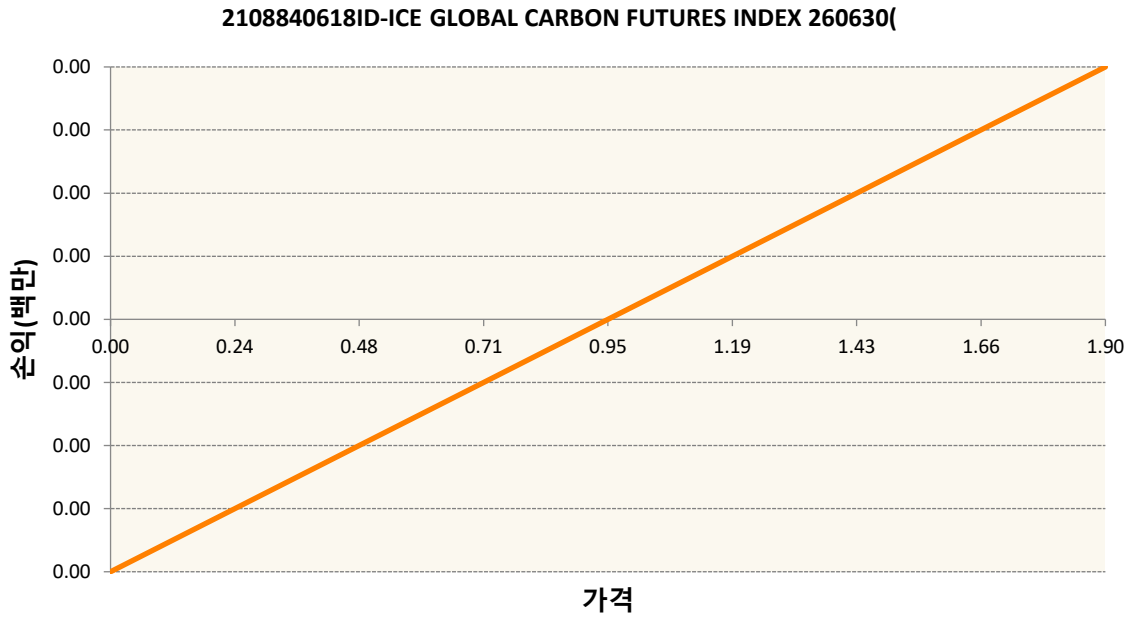
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

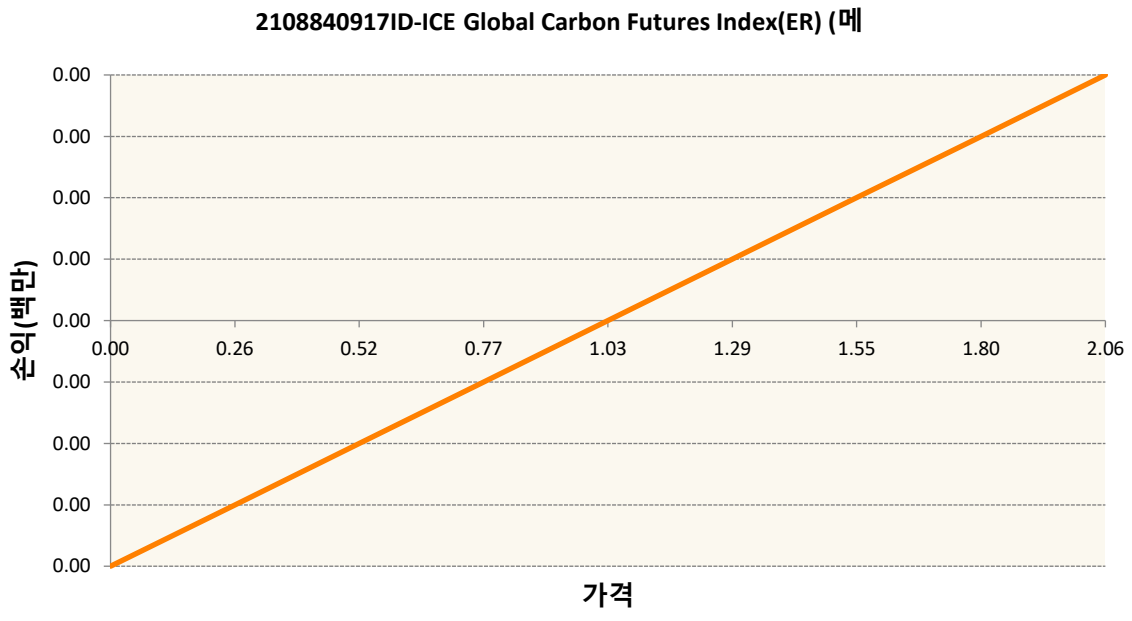
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	7,240	0	7,240	장외

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2108840618ICE GLOBAL CARBON FUTURES INDEX 260630(	462
2108840917ICE Global Carbon Futures Index(ER) (메	117

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

594

공시일	2026-11-05
기준일	2026-11-04

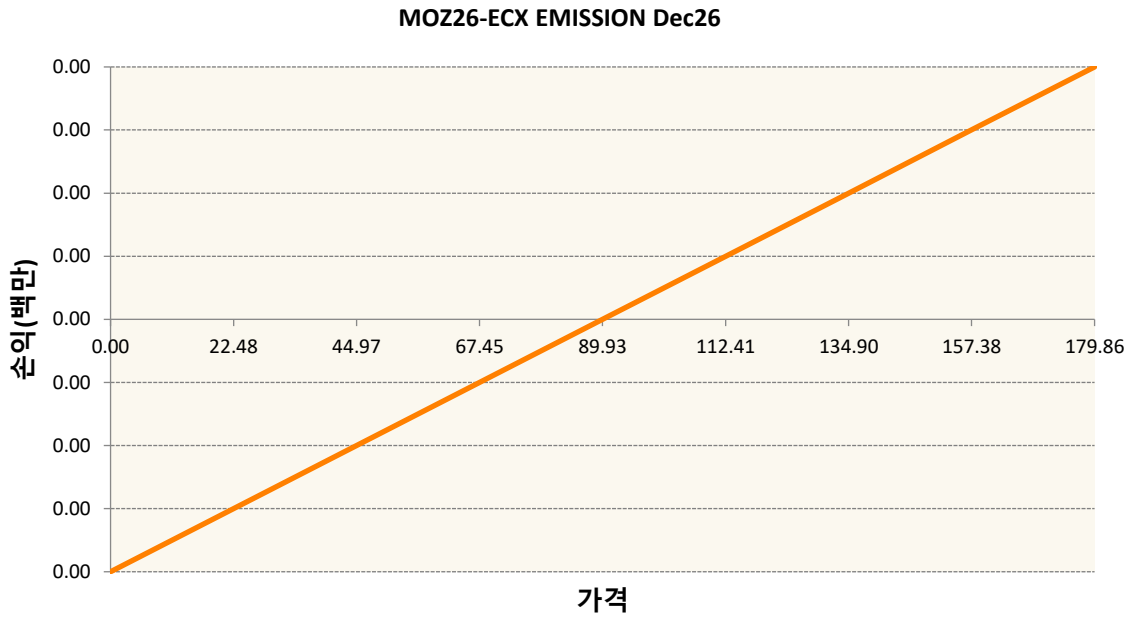
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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			6,324	0	6,324	
누계	통화	선도	0	2,825	-2,825	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213GAV KRW/EUR 30-11-26E	226
MOZ26 ECX EMISSION Dec26	506

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

(단위:백만원)

756

공시일	2026-11-05
기준일	2026-11-04

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(	29

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

(단위:백만원)

108

공시일	2026-11-05
기준일	2026-11-04

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	-7,437	0	-7,437	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 251218(NH)	73
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 260714(미래)	375
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 260917(메리츠)	154

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

(단위:백만원)

1,167

공시일	2026-11-05
기준일	2026-11-04

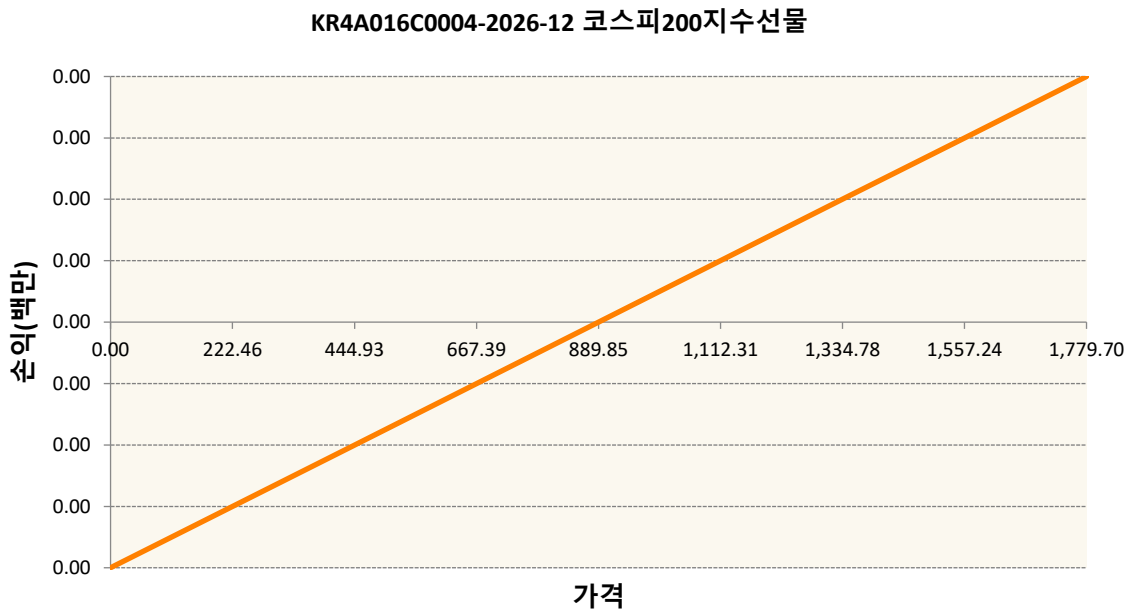
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

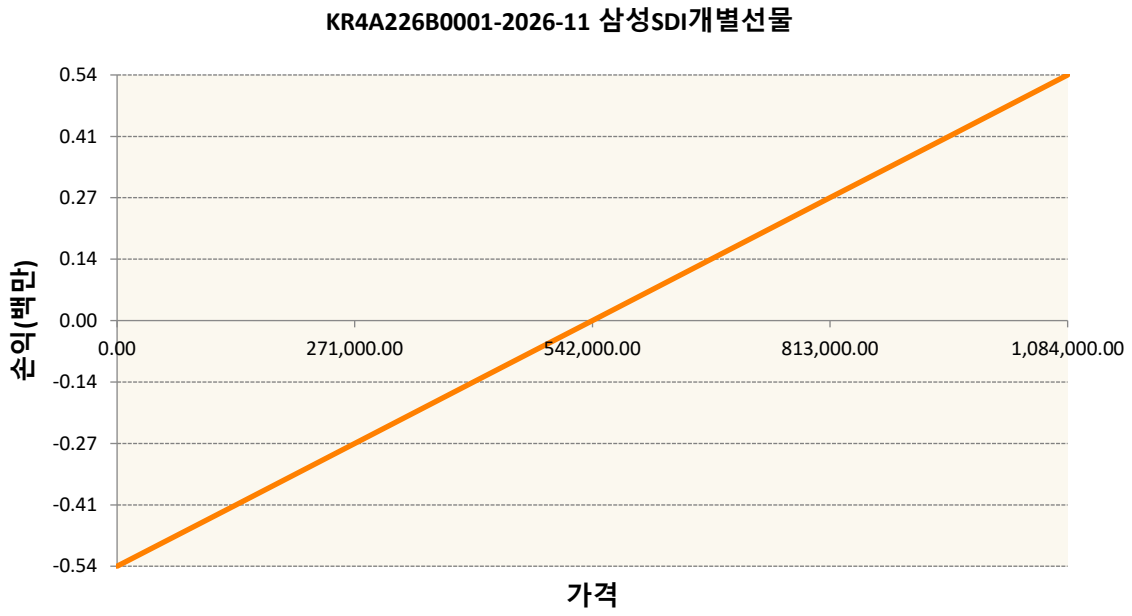
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	1,771	225	1,546	장내
누계	유가증권	선물	10,547	0	10,547	장내

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4A016C0004	2026-12 코스피200지수선물						800
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-800	-800	-800	-800	-800	-800	-800
-5.33%	-534	-534	-534	-534	-534	-534	-534
-2.67%	-267	-267	-267	-267	-267	-267	-267
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	267	267	267	267	267	267	267
5.33%	534	534	534	534	534	534	534
8.00%	800	800	800	800	800	800	800

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

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

2,910

공시일	2026-11-05
기준일	2026-11-04

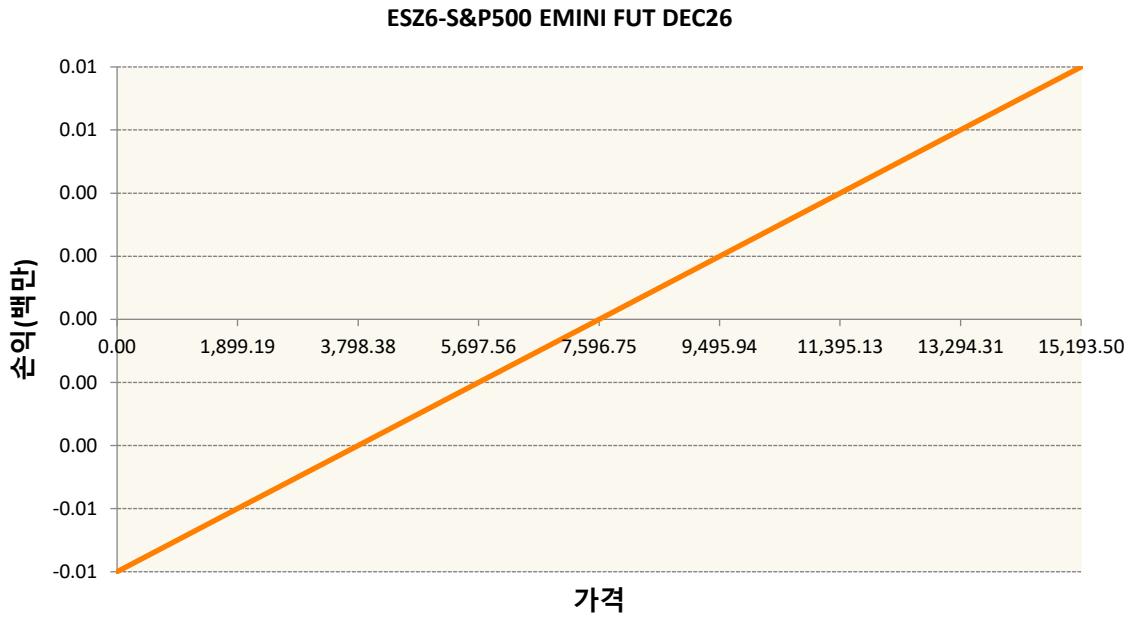
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

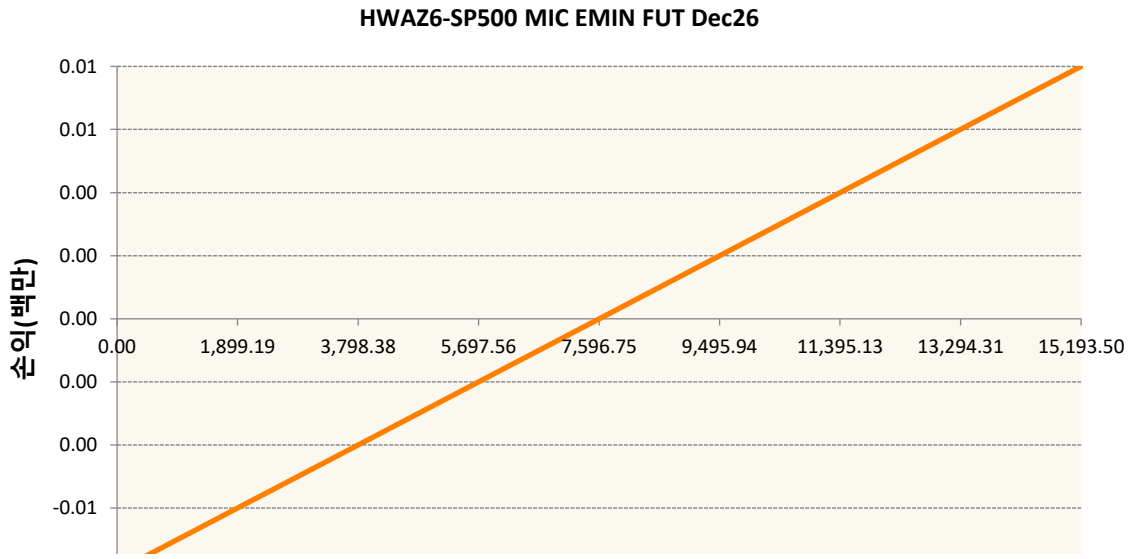
1. 계약금액

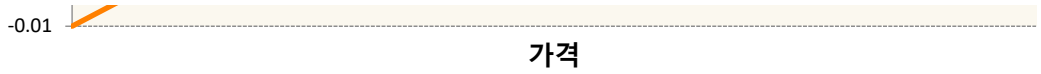
(단위:백만원)

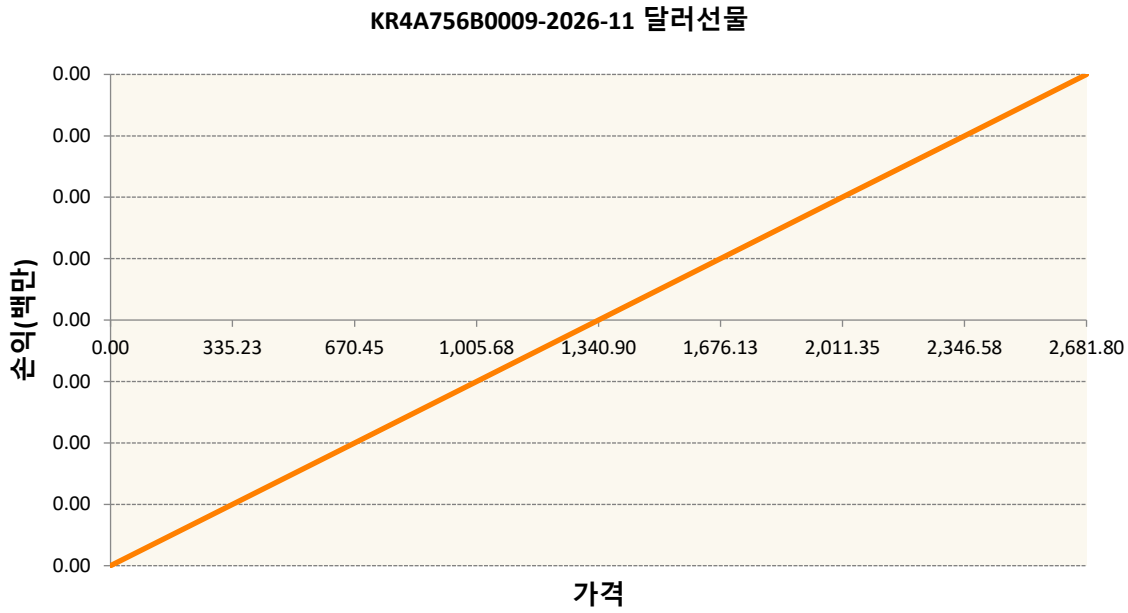
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
신규	지수	선물	0	0	0	장내
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	지수	선물	75,444	0	75,444	
누계	지수	선물	368	0	368	장내
누계	통화	선물	18,639	0	18,639	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESZ6	S&P500 EMINI FUT DEC26	6,036
HWAZ6	SP500 MIC EMIN FUT Dec26	29
KR4A756B00	2026-11 달러선물	1,491

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	3,627

공시일	2026-11-05
기준일	2026-11-04

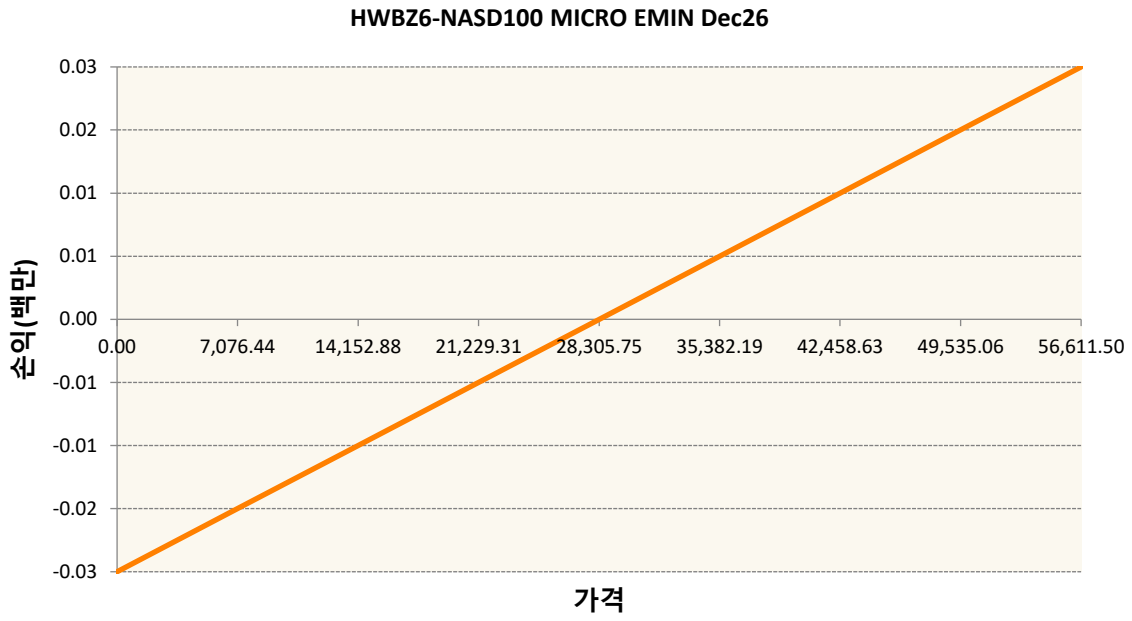
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

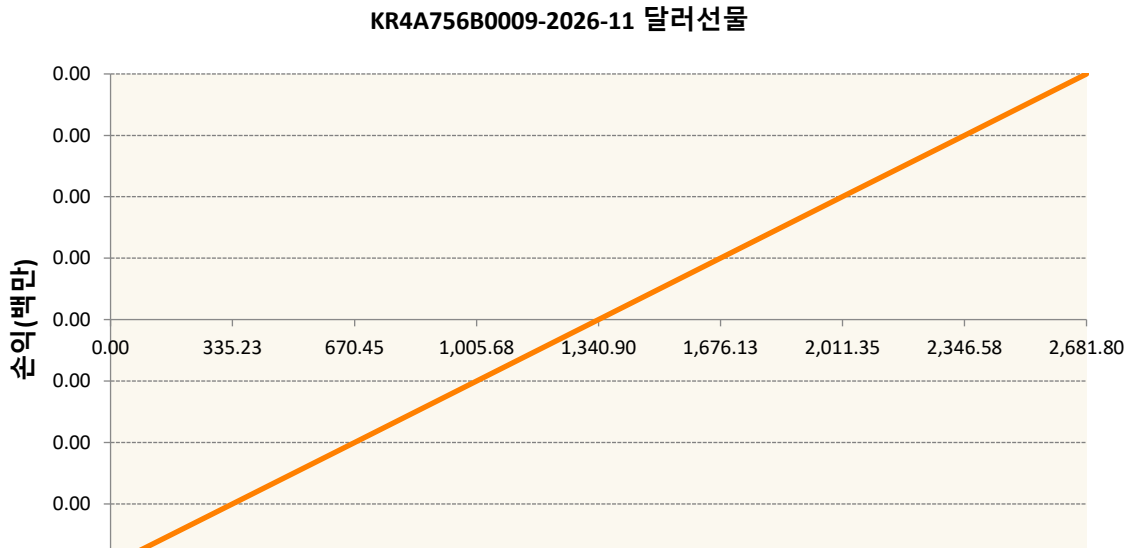
1. 계약금액

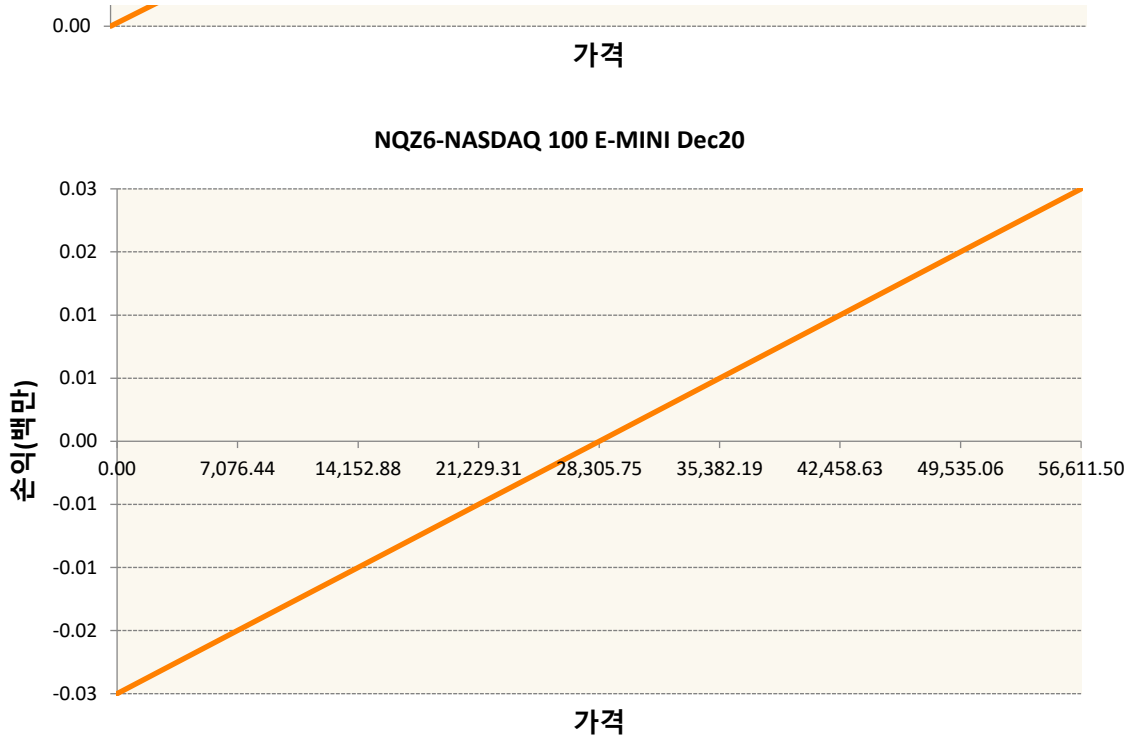
(단위:백만원)

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	31,299	0	31,299	
누계	지수	선물	392	0	392	장내
누계	통화	선물	8,662	0	8,662	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HWBZ6	NASD100 MICRO EMIN Dec26	31
KR4A756B00	2026-11 달러선물	693
NQZ6	NASDAQ 100 E-MINI Dec20	2,504

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

(단위:백만원)

2,300

공시일	2026-11-05
기준일	2026-11-04

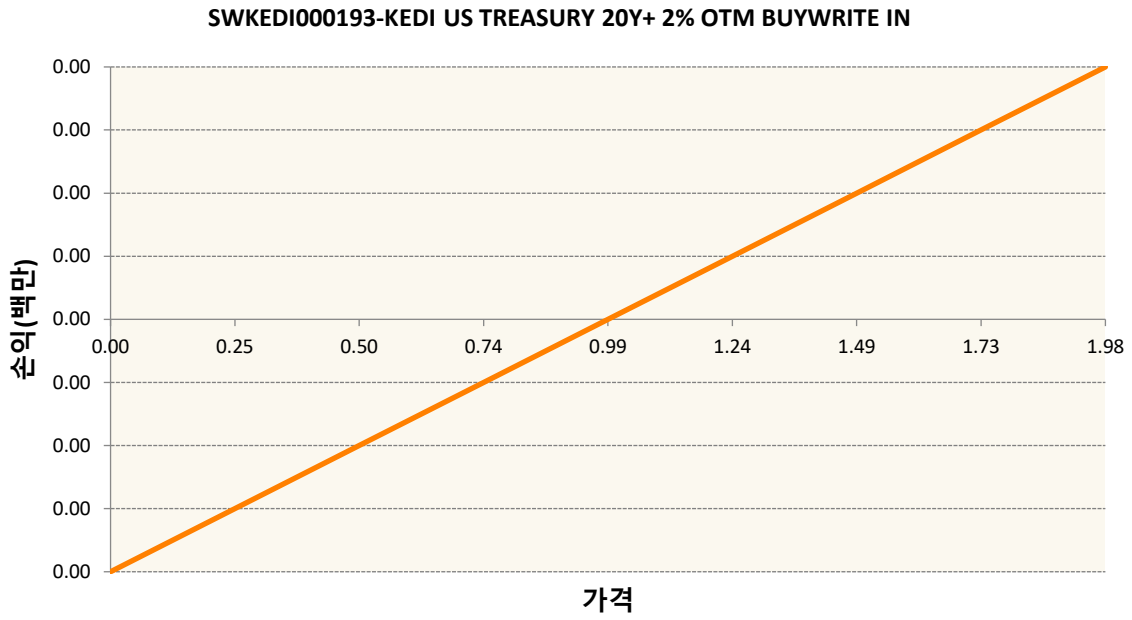
SOL미국30년국채커버드콜(합성)

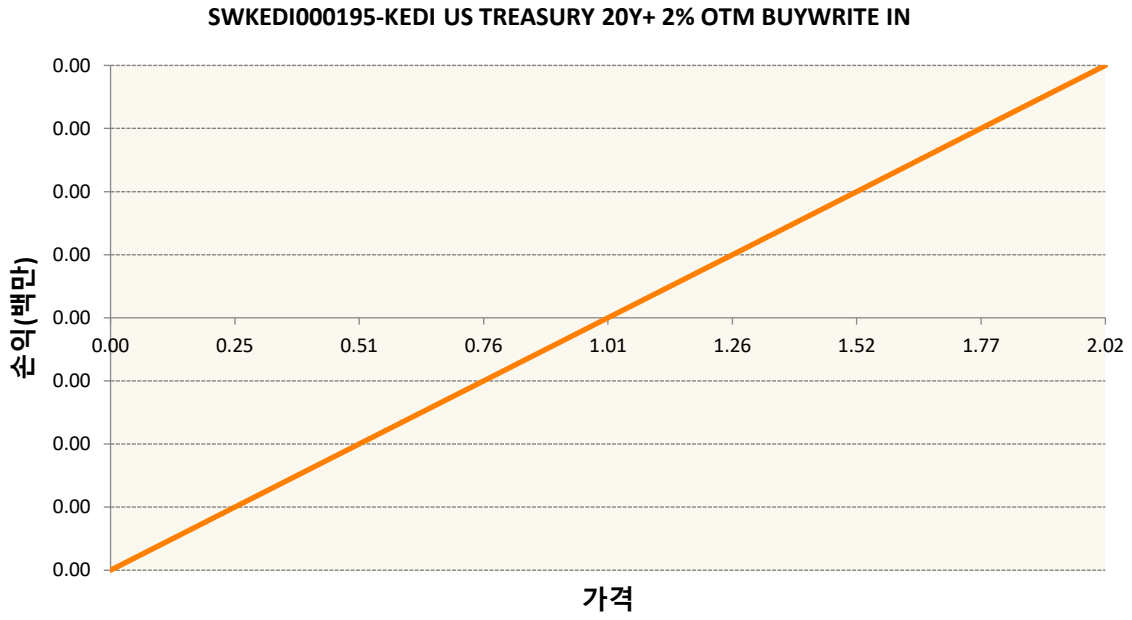
1. 계약금액

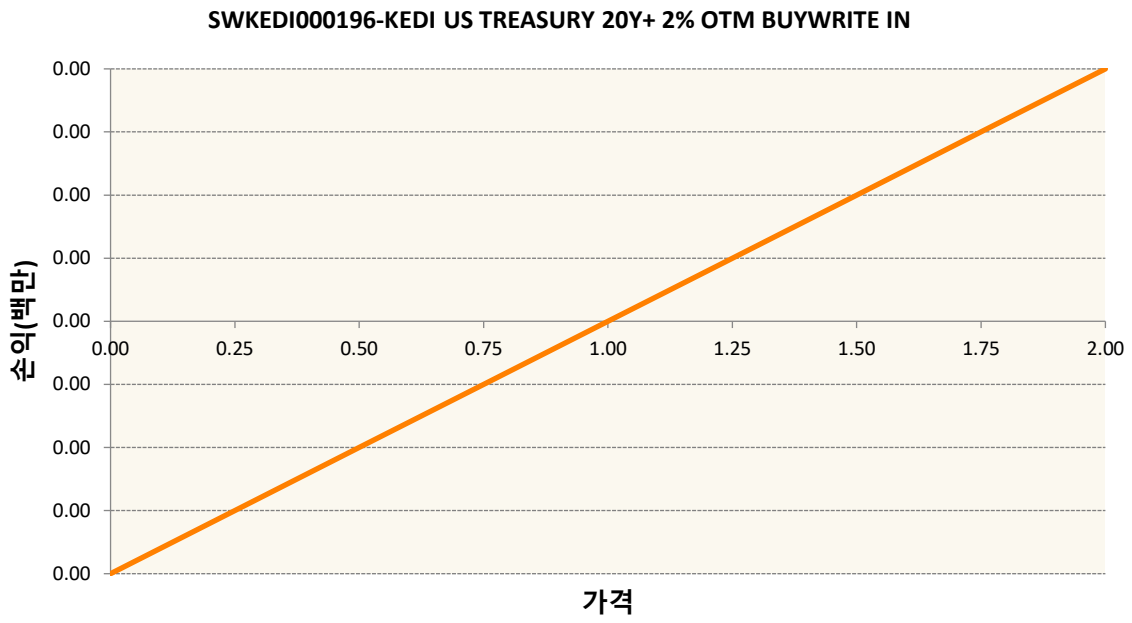
(단위:백만원)

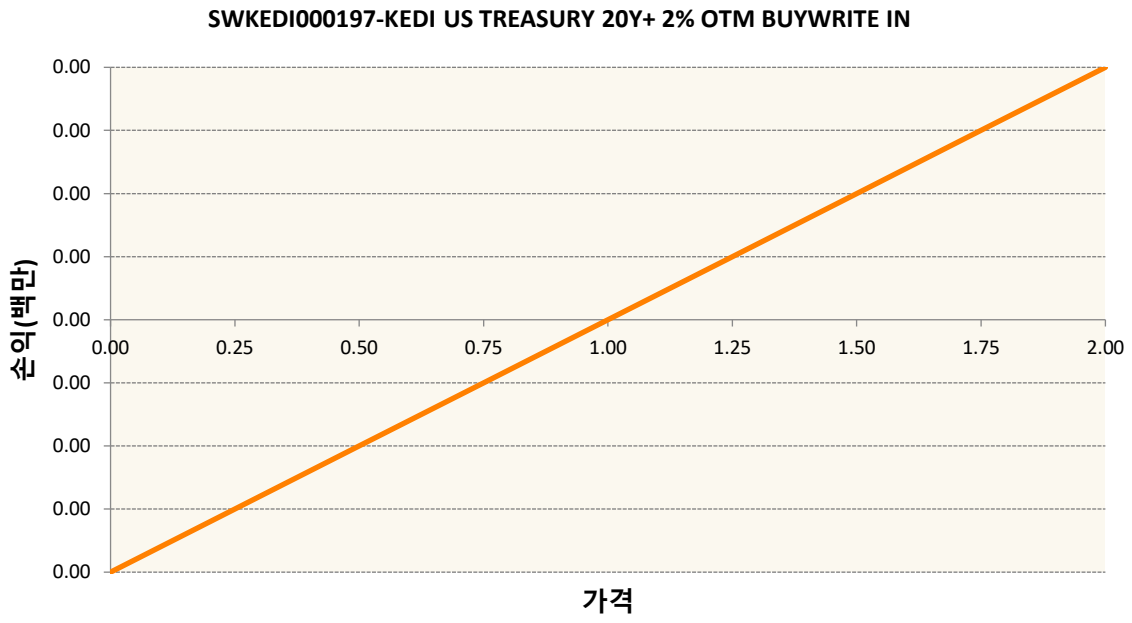
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	276,188	0	276,188	장외

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	6,989
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	7,875
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	2,591
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	4,704

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

8,648