공시일	2026-11-13
기준일	2026-11-12

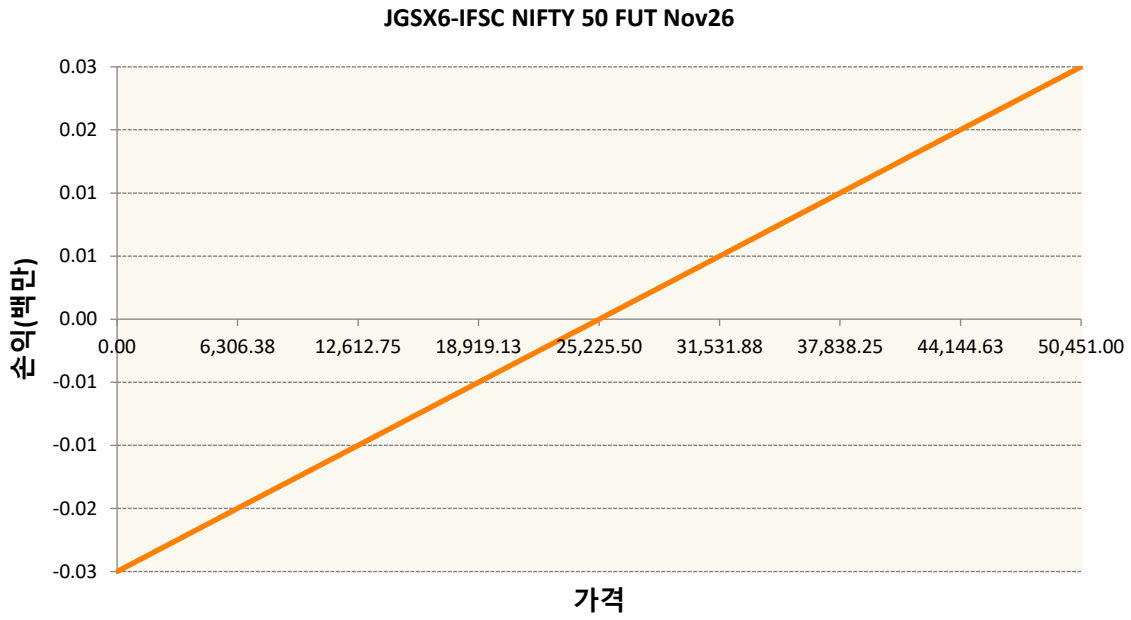
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	334	0	334	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

JGSX6	IFSC NIFTY 50 FUT Nov26	27

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

(단위:백만원)

18

공시일	2026-11-13
기준일	2026-11-12

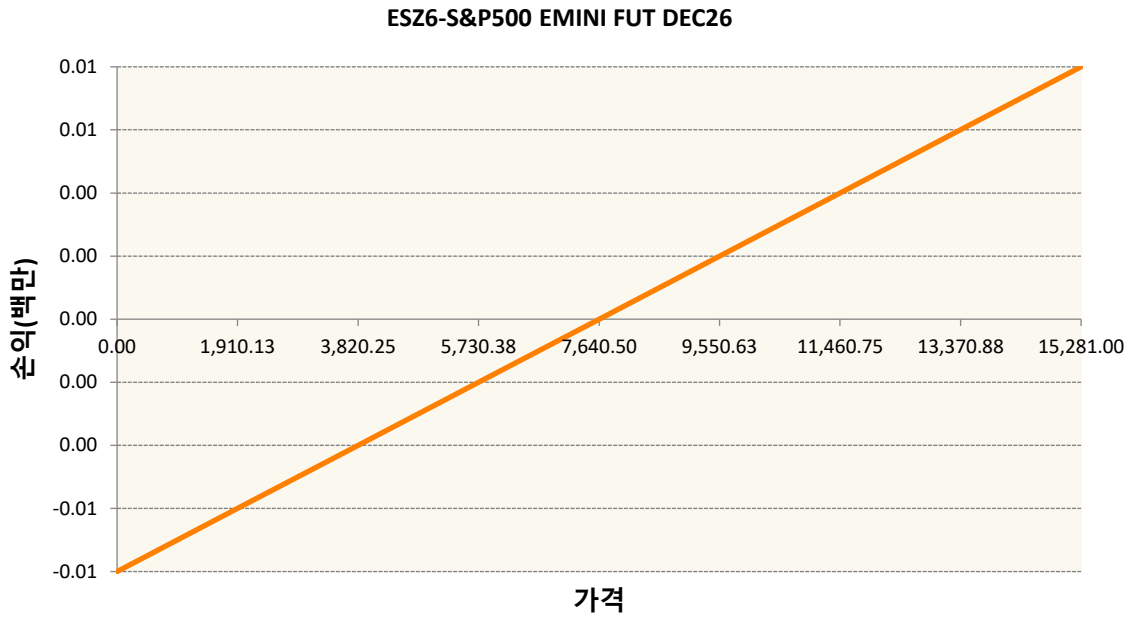
SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	528	0	528	

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)

27

공시일	2026-11-13
기준일	2026-11-12

SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생

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	2026-11-13
기준일	2026-11-12

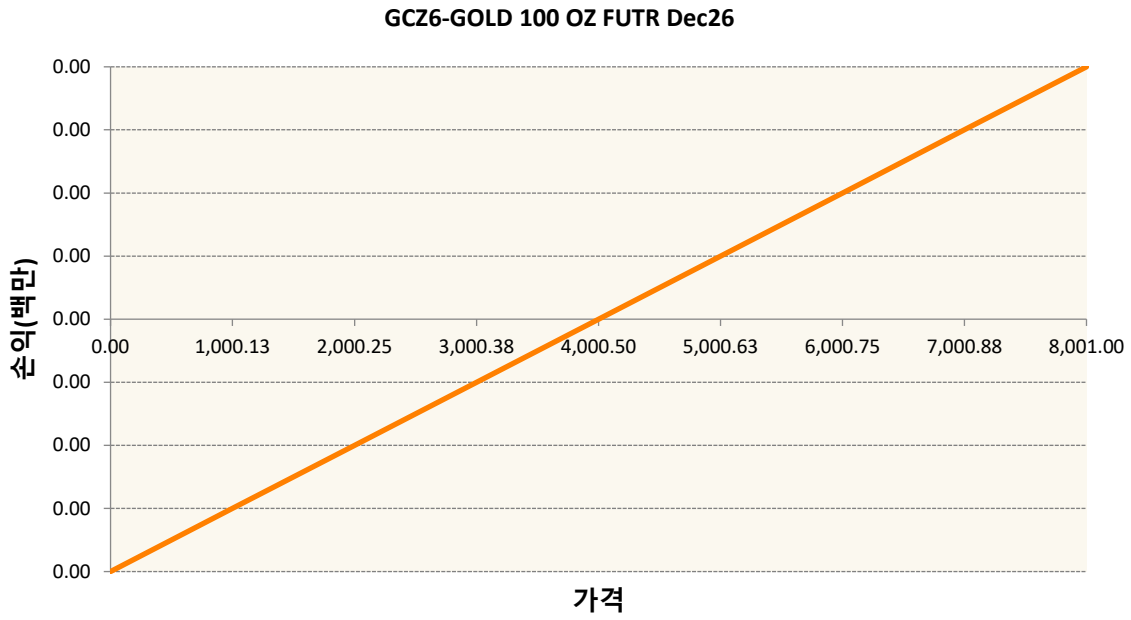
SOL골드커버드콜액티브특별자산상장지수(금

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			5,715	0	5,715	
누계	실물자산	옵션	0	0	0	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

AOGLDUSC3	GLD US 11/13/26 C375 EQUITY	12
GCZ6	GOLD 100 OZ FUTR Dec26	457

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

(단위:백만원)

603

공시일	2026-11-13
기준일	2026-11-12

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)

AOPLTRAC1(PLTR US 11/13/26 C162.5 EQUITY	57
AOPLTRAP1(PLTR US 11/13/26 P162.5 EQUITY	44

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

(단위:백만원)

352

공시일	2026-11-13
기준일	2026-11-12

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)

AOTLTUSBC{TLT US 11/13/26 C82.5 EQUITY	7

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

(단위:백만원)

4

공시일	2026-11-13
기준일	2026-11-12

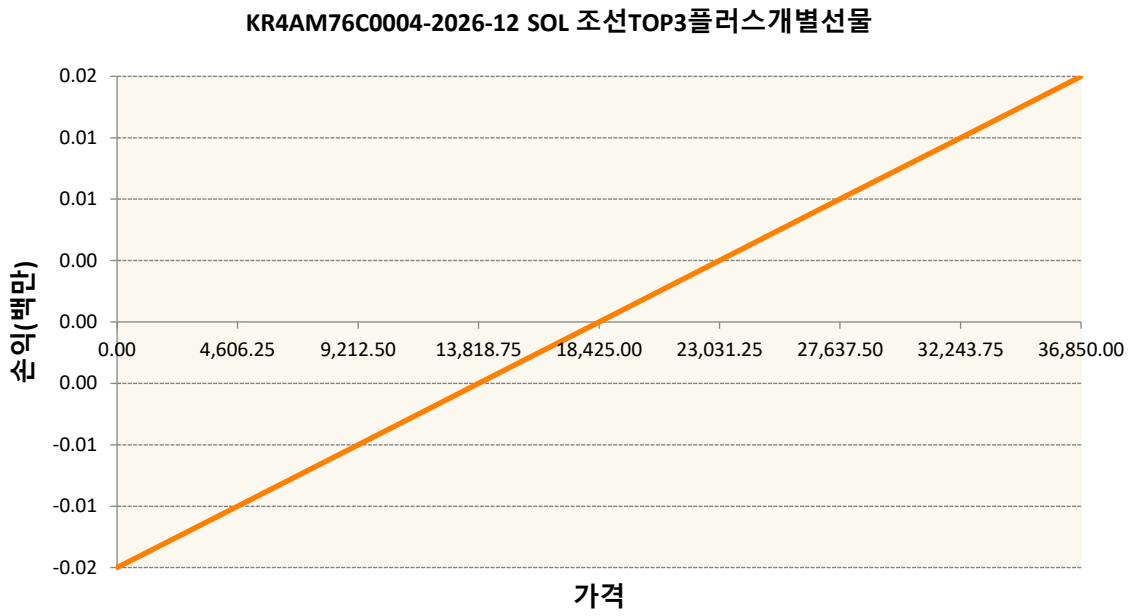
SOL조선TOP3플러스레버리지상장지수(주식)

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	5,085	0	5,085	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4AM76C0004	2026-12 SOL 조선TOP3플러스개별선물						4,052
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-4,052	-4,052	-4,052	-4,052	-4,052	-4,052	-4,052
-5.33%	-2,701	-2,701	-2,701	-2,701	-2,701	-2,701	-2,701
-2.67%	-1,351	-1,351	-1,351	-1,351	-1,351	-1,351	-1,351
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	1,351	1,351	1,351	1,351	1,351	1,351	1,351
5.33%	2,701	2,701	2,701	2,701	2,701	2,701	2,701
8.00%	4,052	4,052	4,052	4,052	4,052	4,052	4,052

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

7,067

공시일	2026-11-13
기준일	2026-11-12

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	2026-11-13
기준일	2026-11-12

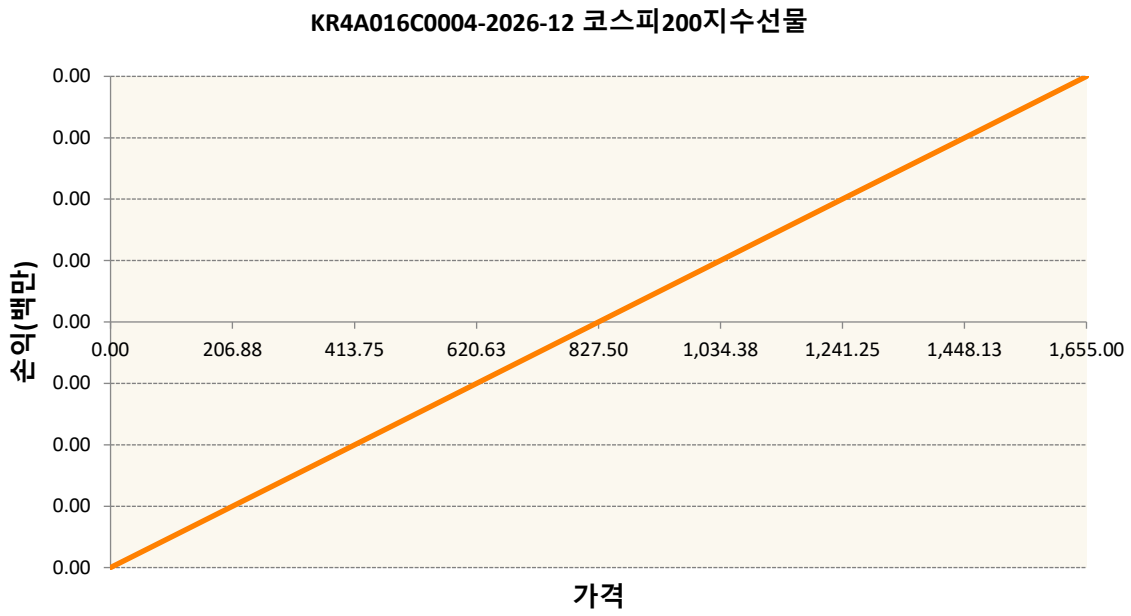
SOL 200타겟위클리커버드콜상장지수(주식)

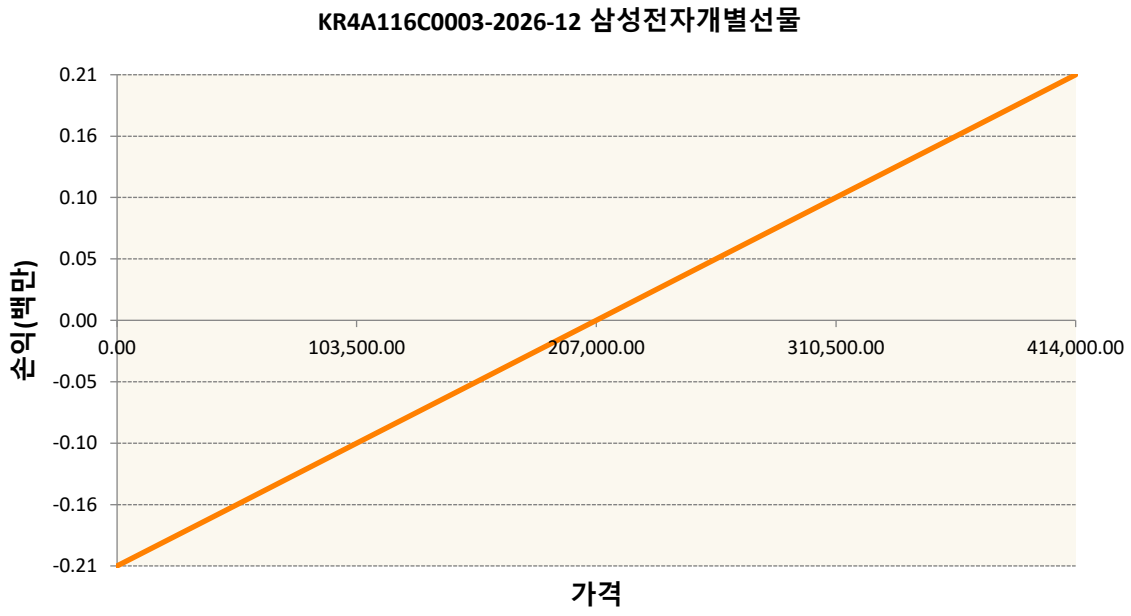
1. 계약금액

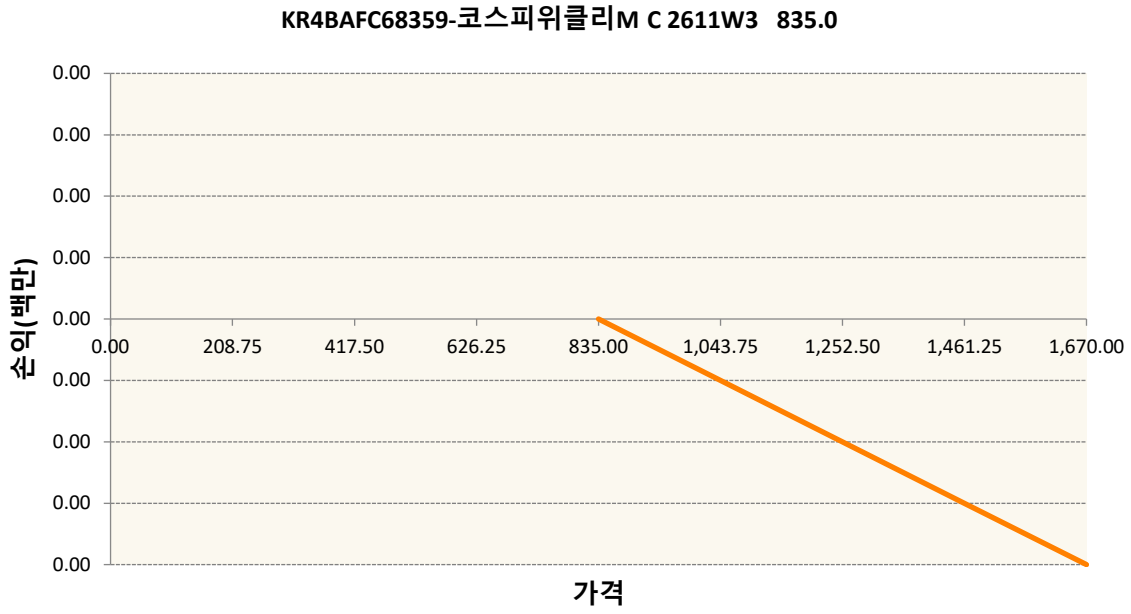
(단위:백만원)

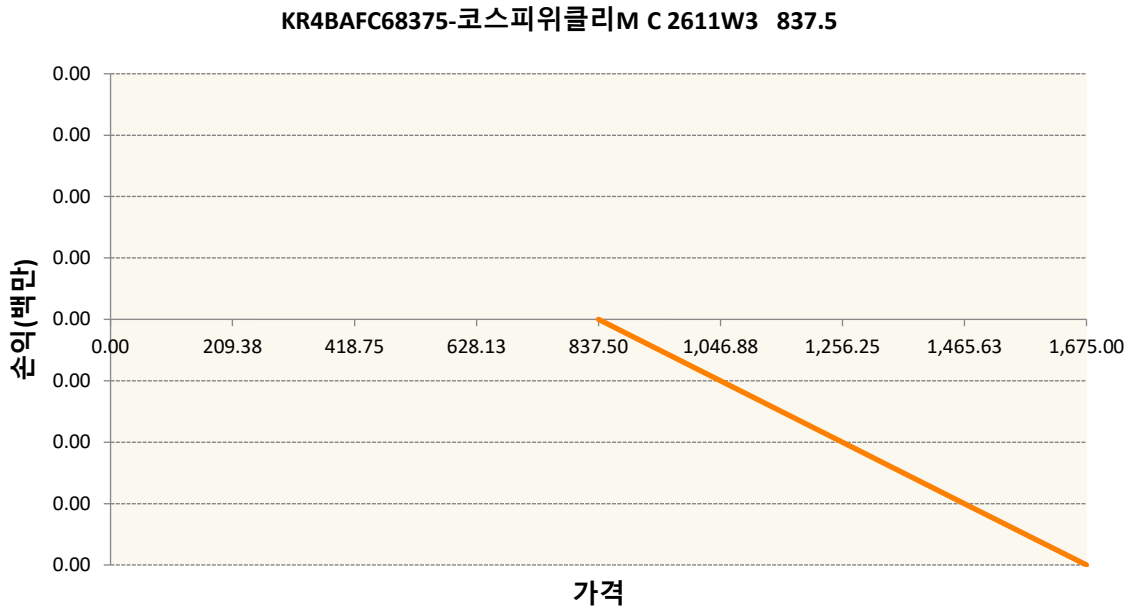
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	42,508	-42,508	장내
누계	유가증권	선물	16,557	0	16,557	장내
누계	유가증권	옵션	0	41,800	-41,800	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A016C0004	2026-12 코스피200지수선물						433
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-433	-433	-433	-433	-433	-433	-433
-5.33%	-289	-289	-289	-289	-289	-289	-289
-2.67%	-144	-144	-144	-144	-144	-144	-144
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	144	144	144	144	144	144	144
5.33%	289	289	289	289	289	289	289
8.00%	433	433	433	433	433	433	433
KR4A116C0003	2026-12 삼성전자개별선물						899
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-899	-899	-899	-899	-899	-899	-899
-5.33%	-599	-599	-599	-599	-599	-599	-599
-2.67%	-300	-300	-300	-300	-300	-300	-300
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	300	300	300	300	300	300	300
5.33%	599	599	599	599	599	599	599
8.00%	899	899	899	899	899	899	899
	KR4BAFC68359		코스피위클리M C 2611W3 835.0				1,553
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	530	523	513	501	485	468	448
-5.33%	496	476	453	427	399	369	337
-2.67%	386	349	310	271	230	189	147
0%	139	93	46	0	-46	-93	-139
2.67%	-272	-312	-353	-395	-438	-482	-526
5.33%	-817	-842	-870	-900	-933	-967	-1,003
8.00%	-1,439	-1,451	-1,465	-1,483	-1,504	-1,527	-1,553
	KR4BAFC68375		코스피위클리M C 2611W3 837.5				1,016
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	331	327	321	313	304	293	280
-5.33%	311	299	285	268	251	231	211
-2.67%	245	222	197	171	145	118	91
0%	93	62	31	0	-31	-62	-93
2.67%	-169	-197	-225	-254	-284	-313	-343
5.33%	-524	-542	-562	-583	-606	-630	-655
8.00%	-935	-943	-954	-967	-982	-998	-1,016

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

9,535

공시일	2026-11-13
기준일	2026-11-12

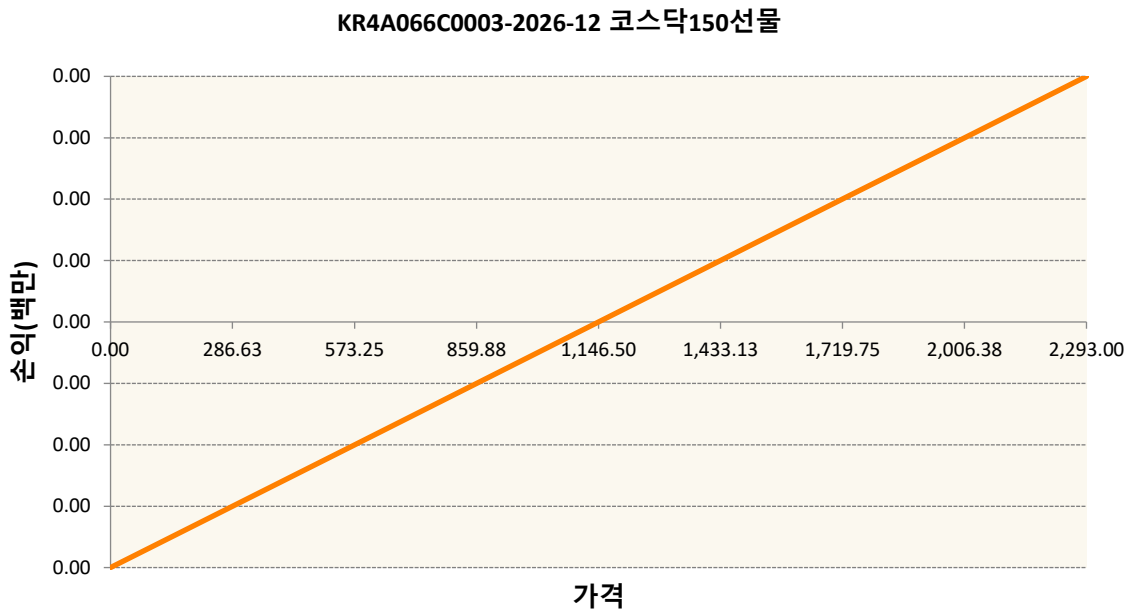
SOL코스닥150인덱스(주식-파생형)

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	459	0	459	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A066C0003 2026-12 코스닥150선물 37

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-37	-37	-37	-37	-37	-37	-37
-5.33%	-25	-25	-25	-25	-25	-25	-25
-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%	25	25	25	25	25	25	25
8.00%	37	37	37	37	37	37	37

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

124

공시일	2026-11-13
기준일	2026-11-12

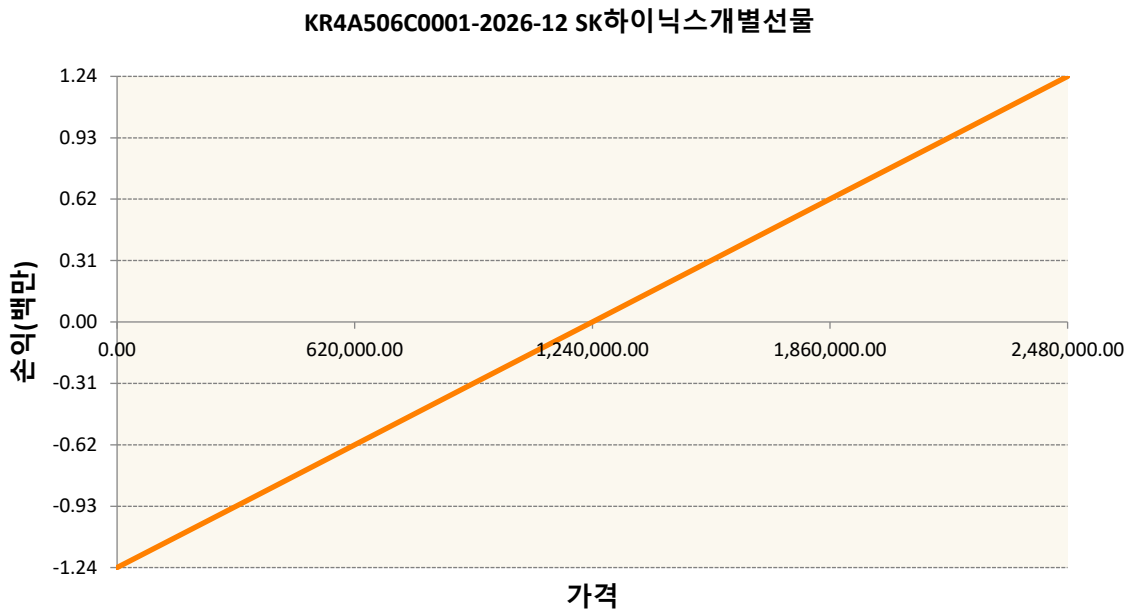
SOLSK하이닉스단일종목레버리지상장지수

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	5,688	50	5,638	장내
누계	유가증권	선물	20,671	0	20,671	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A506C0001	2026-12 SK하이닉스개별선물	1,672

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,672	-1,672	-1,672	-1,672	-1,672	-1,672	-1,672
-5.33%	-1,115	-1,115	-1,115	-1,115	-1,115	-1,115	-1,115
-2.67%	-557	-557	-557	-557	-557	-557	-557
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	557	557	557	557	557	557	557
5.33%	1,115	1,115	1,115	1,115	1,115	1,115	1,115
8.00%	1,672	1,672	1,672	1,672	1,672	1,672	1,672

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

8,357

공시일	2026-11-13
기준일	2026-11-12

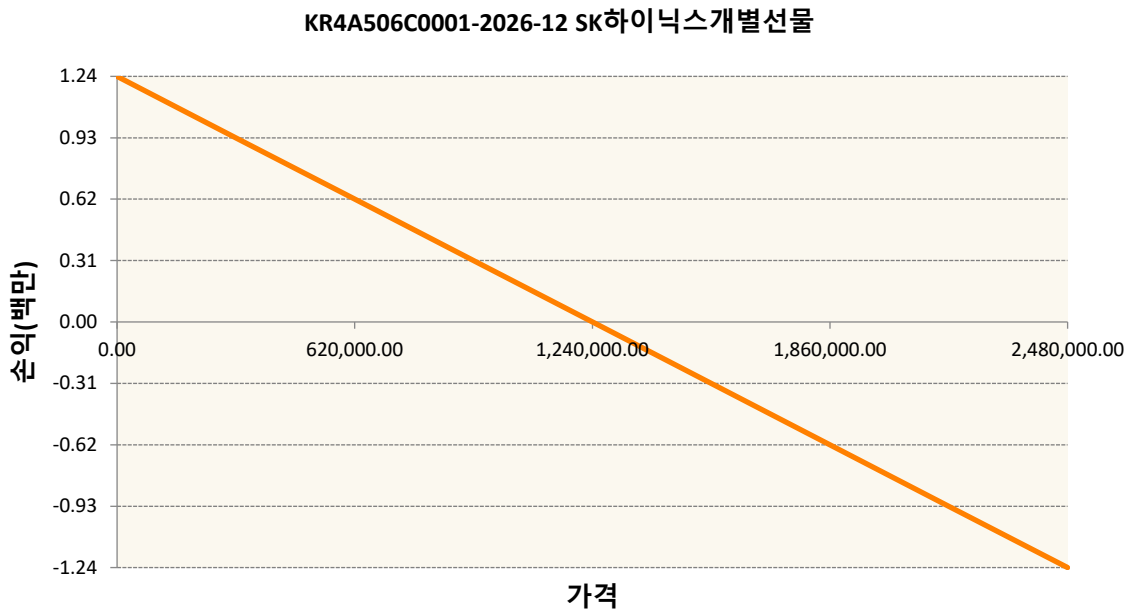
SOLSK하이닉스선물단일종목인버스2X상장지

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	1,768	38,048	-36,280	장내
누계	유가증권	선물	0	127,844	-127,844	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A506C0001	2026-12 SK하이닉스개별선물	10,343

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	10,343	10,343	10,343	10,343	10,343	10,343	10,343
-5.33%	6,895	6,895	6,895	6,895	6,895	6,895	6,895
-2.67%	3,448	3,448	3,448	3,448	3,448	3,448	3,448
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-3,448	-3,448	-3,448	-3,448	-3,448	-3,448	-3,448
5.33%	-6,895	-6,895	-6,895	-6,895	-6,895	-6,895	-6,895
8.00%	-10,343	-10,343	-10,343	-10,343	-10,343	-10,343	-10,343

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

51,683

공시일	2026-11-13
기준일	2026-11-12

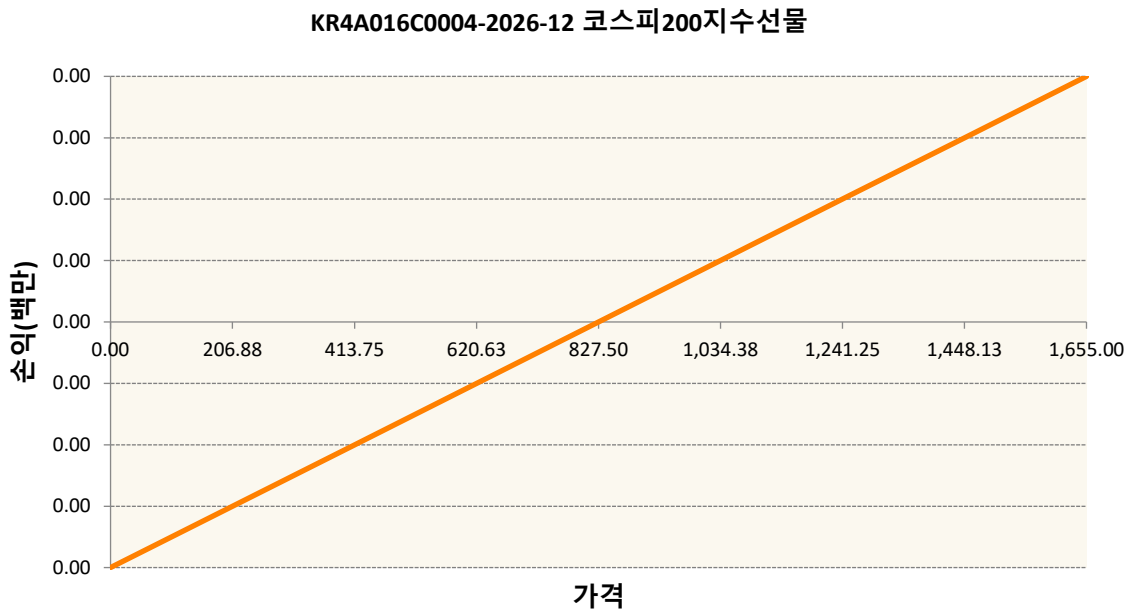
SOL200커버드콜액티브상장지수(주식-파생형

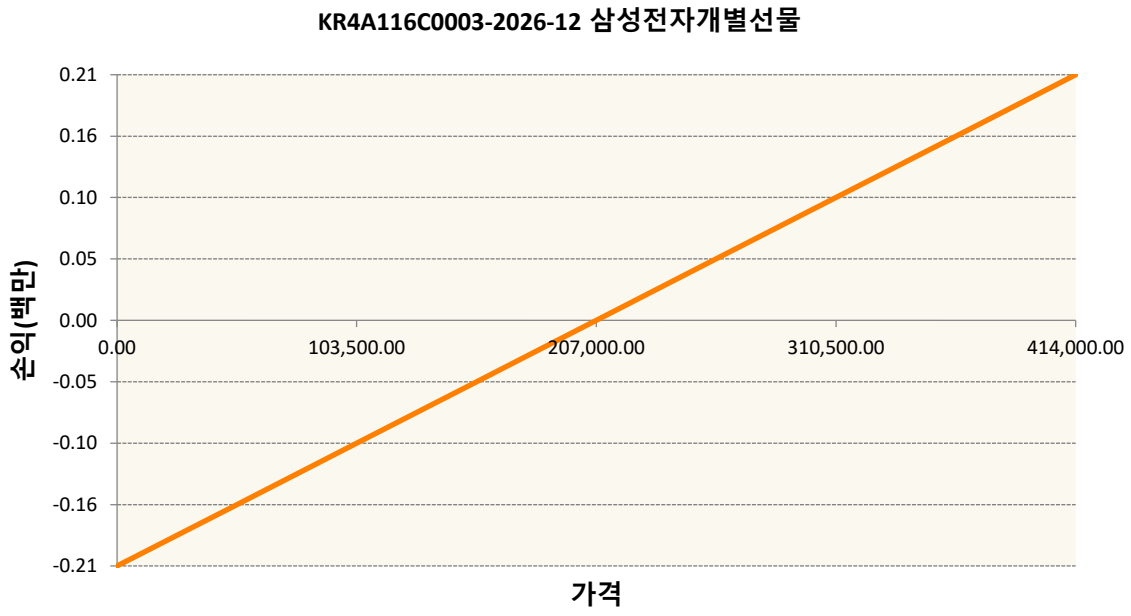
1. 계약금액

(단위:백만원)

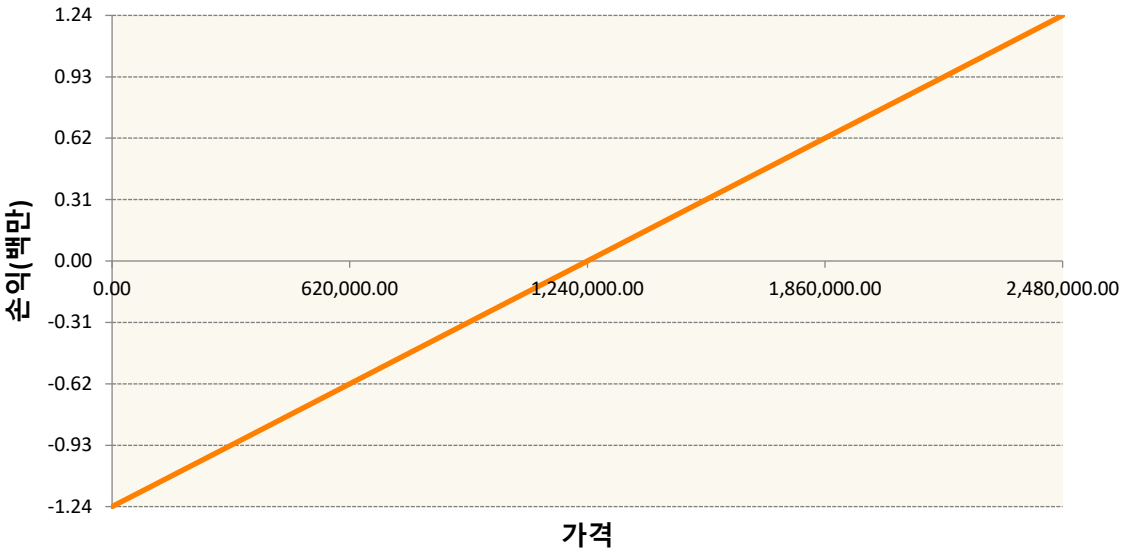
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	2,507	-2,507	장내
신규	유가증권	옵션	0	4,250	-4,250	장내
누계	유가증권	선물	3,307	0	3,307	장내
누계	유가증권	옵션	0	4,180	-4,180	장내

2. 만기시점의 손익구조

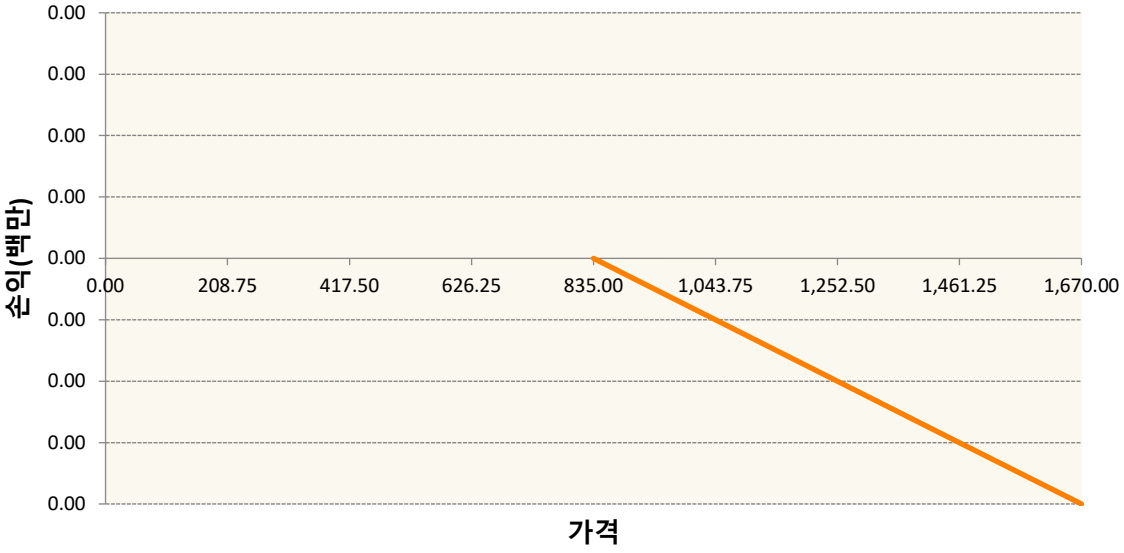




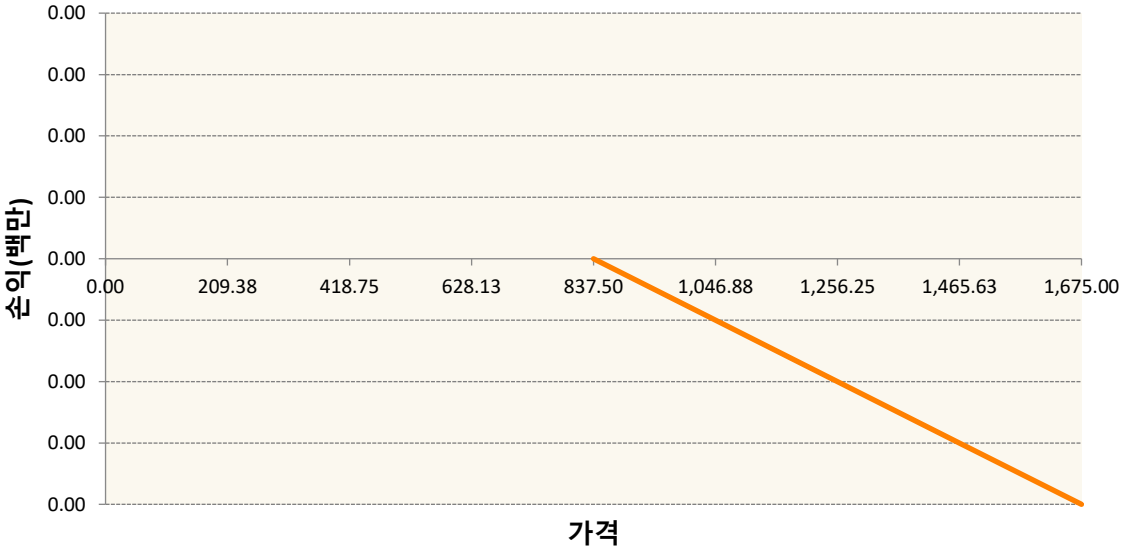
KR4A506C0001-2026-12 SK하이닉스개별선물



KR4BAFC68359-코스피위클리M C 2611W3 835.0



KR4BAFC68375-코스피위클리M C 2611W3 837.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

	KR4A016C0004	2026-12 코스피200지수선물					133
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-133	-133	-133	-133	-133	-133	-133
-5.33%	-89	-89	-89	-89	-89	-89	-89
-2.67%	-44	-44	-44	-44	-44	-44	-44
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	44	44	44	44	44	44	44
5.33%	89	89	89	89	89	89	89
8.00%	133	133	133	133	133	133	133

	KR4A116C0003	2026-12 삼성전자개별선물					26
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-26	-26	-26	-26	-26	-26	-26
-5.33%	-17	-17	-17	-17	-17	-17	-17
-2.67%	-9	-9	-9	-9	-9	-9	-9
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	9	9	9	9	9	9	9
5.33%	17	17	17	17	17	17	17
8.00%	26	26	26	26	26	26	26

	KR4A506C0001	2026-12 SK하이닉스개별선물					107
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-107	-107	-107	-107	-107	-107	-107
-5.33%	-72	-72	-72	-72	-72	-72	-72
-2.67%	-36	-36	-36	-36	-36	-36	-36
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	36	36	36	36	36	36	36
5.33%	72	72	72	72	72	72	72
8.00%	107	107	107	107	107	107	107

	KR4BAFC68359	코스피위클리M C 2611W3 835.0					155
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	53	52	51	50	49	47	45
-5.33%	50	48	45	43	40	37	34
-2.67%	39	35	31	27	23	19	15
0%	14	9	5	0	-5	-9	-14
2.67%	-27	-31	-35	-40	-44	-48	-53
5.33%	-82	-84	-87	-90	-93	-97	-100
8.00%	-144	-145	-147	-148	-150	-153	-155

	KR4BAFC68375	코스피위클리M C 2611W3 837.5					102
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	33	33	32	31	30	29	28
-5.33%	31	30	28	27	25	23	21
-2.67%	25	22	20	17	14	12	9
0%	9	6	3	0	-3	-6	-9
2.67%	-17	-20	-23	-25	-28	-31	-34
5.33%	-52	-54	-56	-58	-61	-63	-65
8.00%	-93	-94	-95	-97	-98	-100	-102

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

1,540

공시일	2026-11-13
기준일	2026-11-12

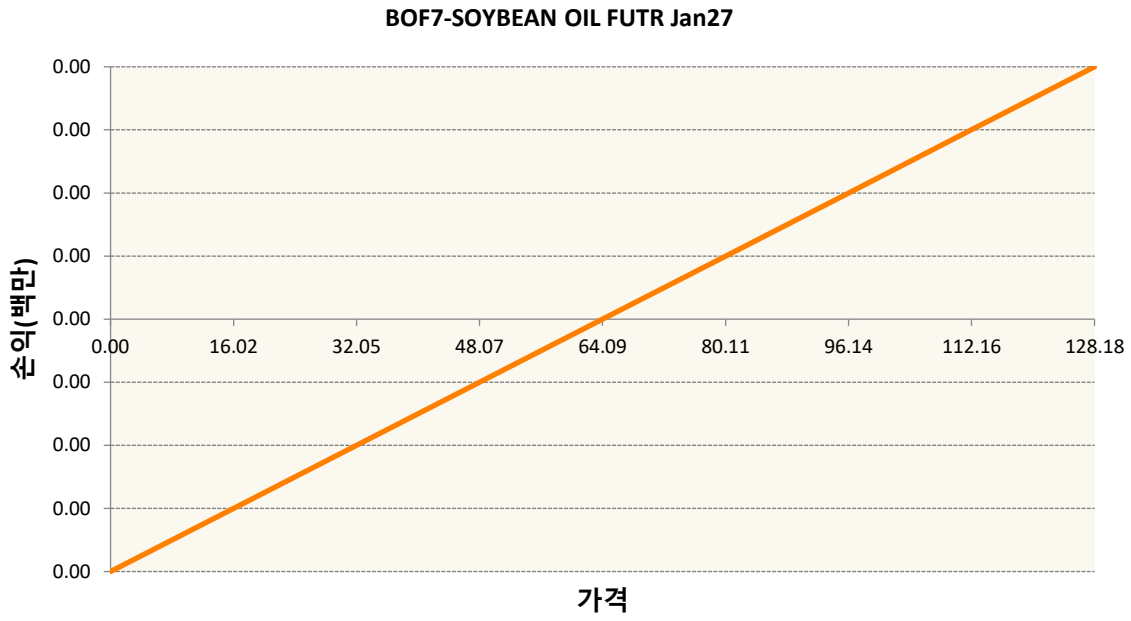
포커스농산물모(채권-파생형)

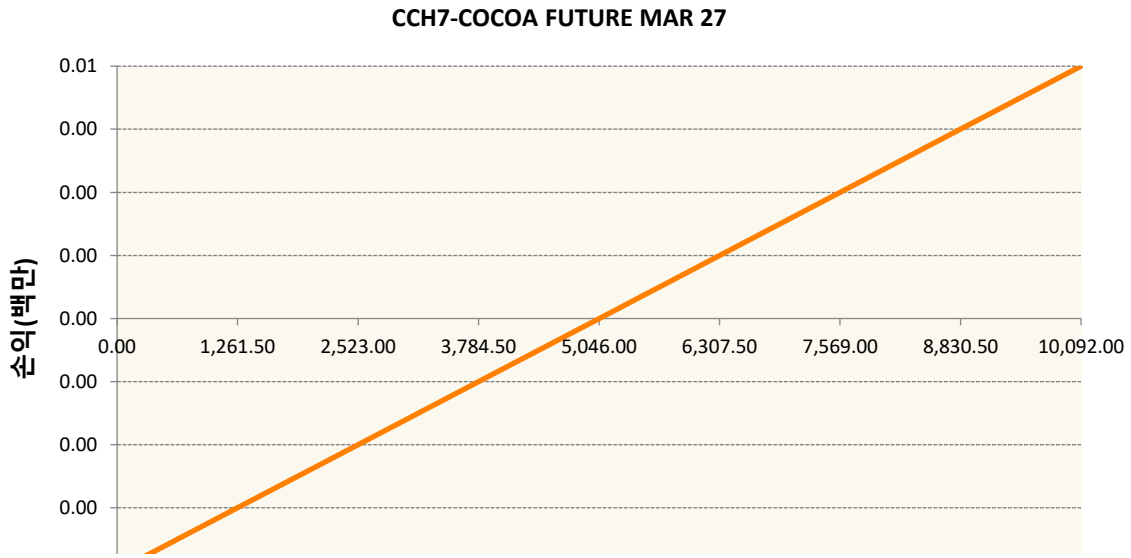
1. 계약금액

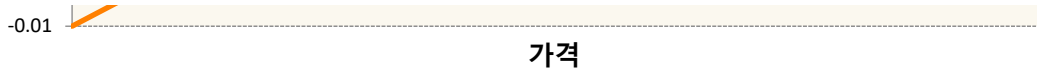
(단위:USD 백만)

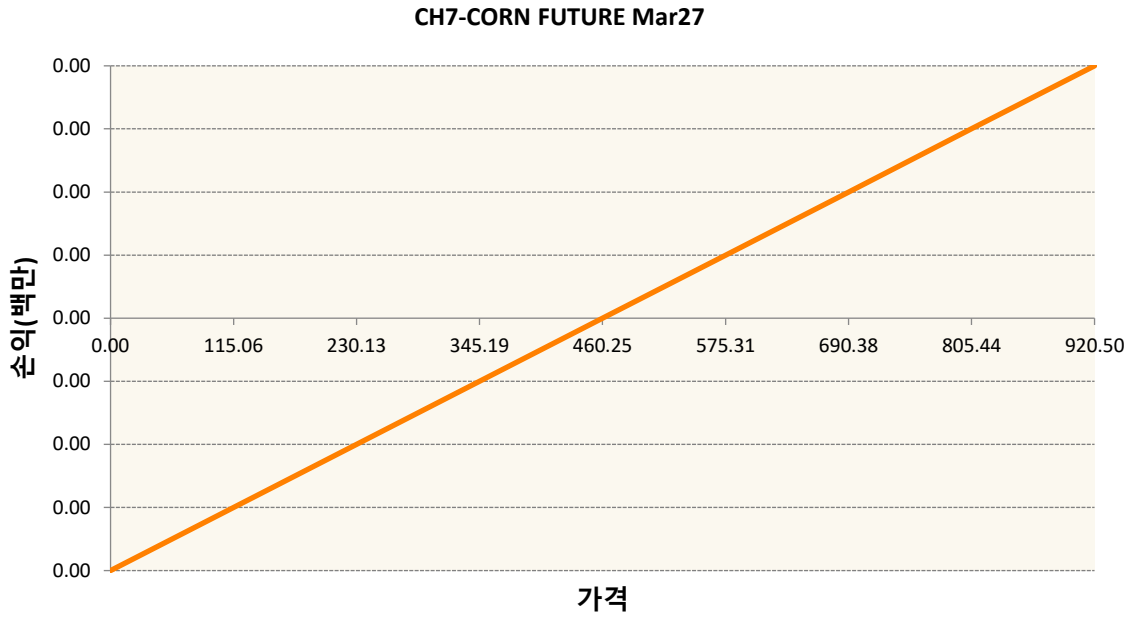
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	실물자산	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	53	-53	장내
누계	실물자산	선물	326	0	326	
누계	유가증권	선물	1,998	0	1,998	
누계	통화	선물	0	53	-53	장내

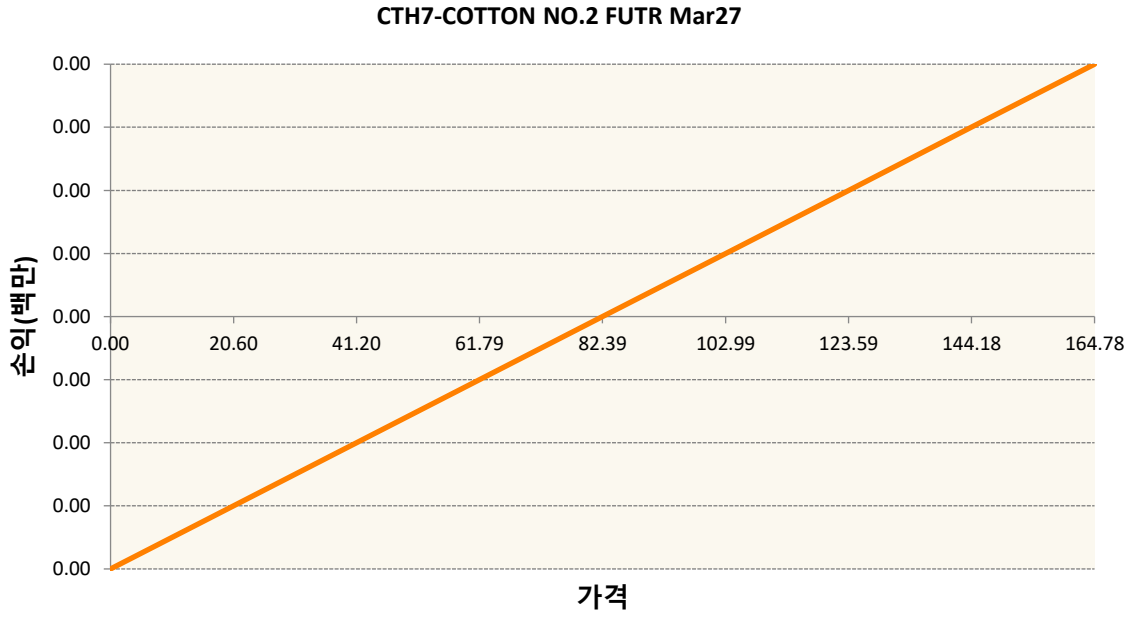
2. 만기시점의 손익구조

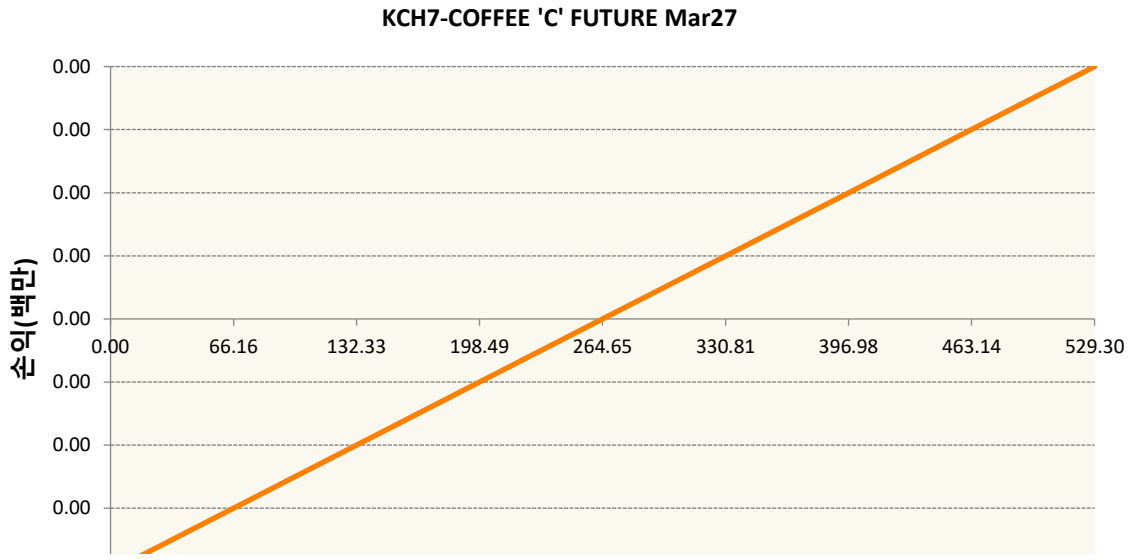


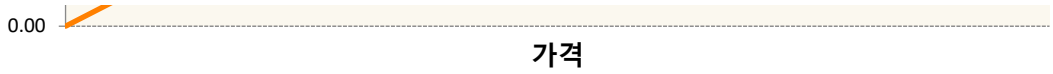



-0.01
가격

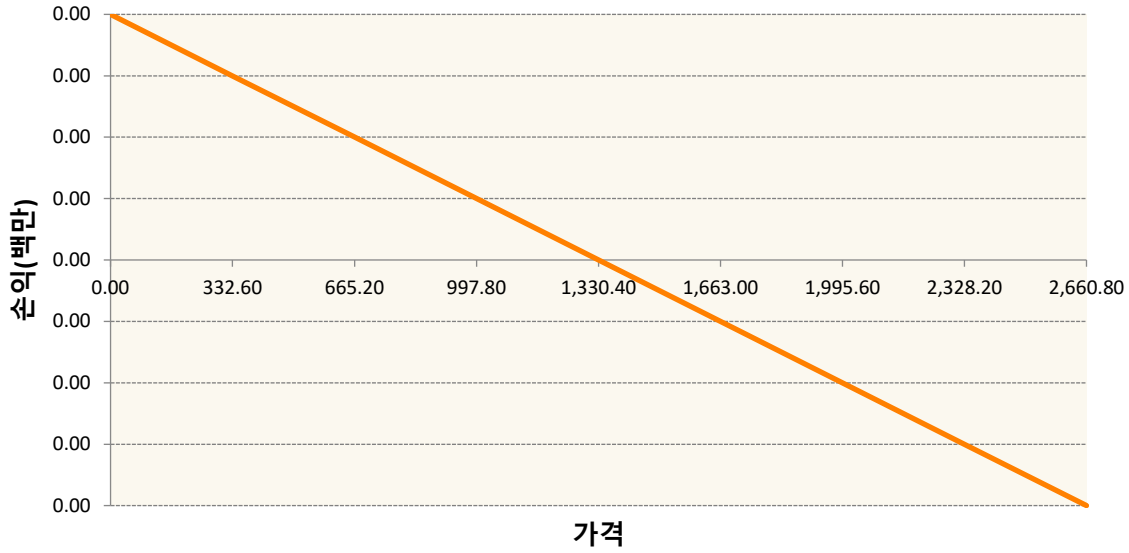

CH7-CORN FUTURE Mar27
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
115.06
230.13
345.19
460.25
575.31
690.38
805.44
920.50
손익(백만)
가격


CTH7-COTTON NO.2 FUTR Mar27
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
20.60
41.20
61.79
82.39
102.99
123.59
144.18
164.78
손익(백만)
가격

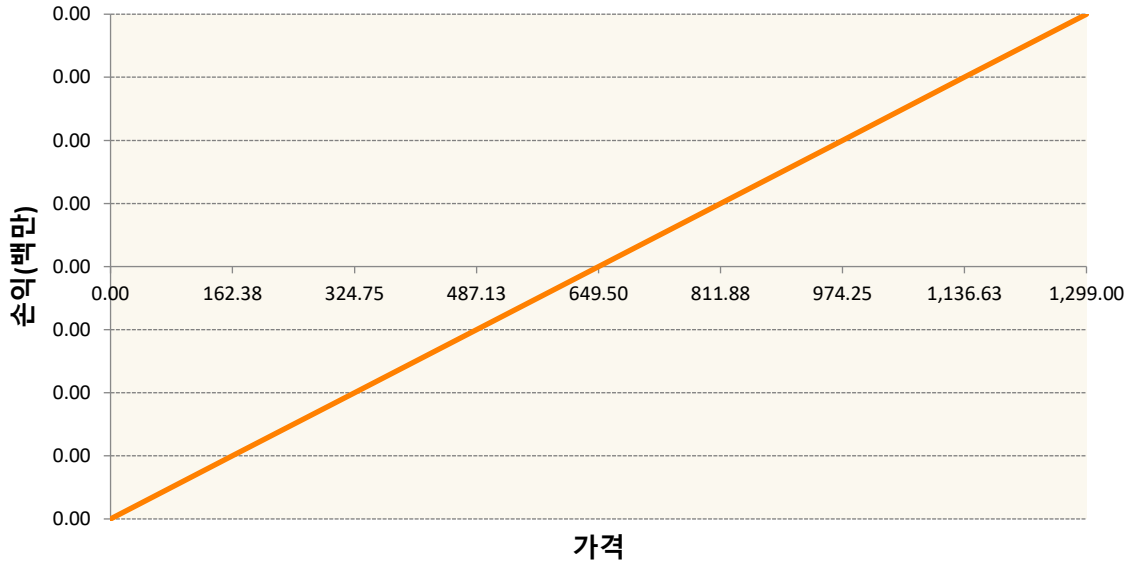

KCH7-COFFEE 'C' FUTURE Mar27
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
66.16
132.33
198.49
264.65
330.81
396.98
463.14
529.30
손익(백만)



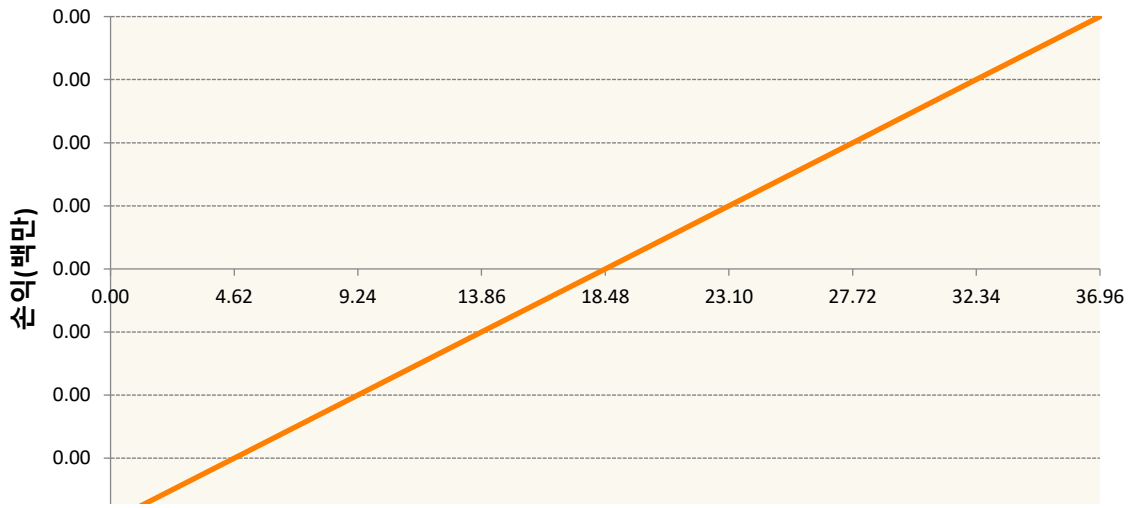
KR4A756C0008-2026-12 달러선물

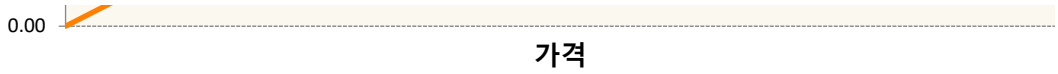


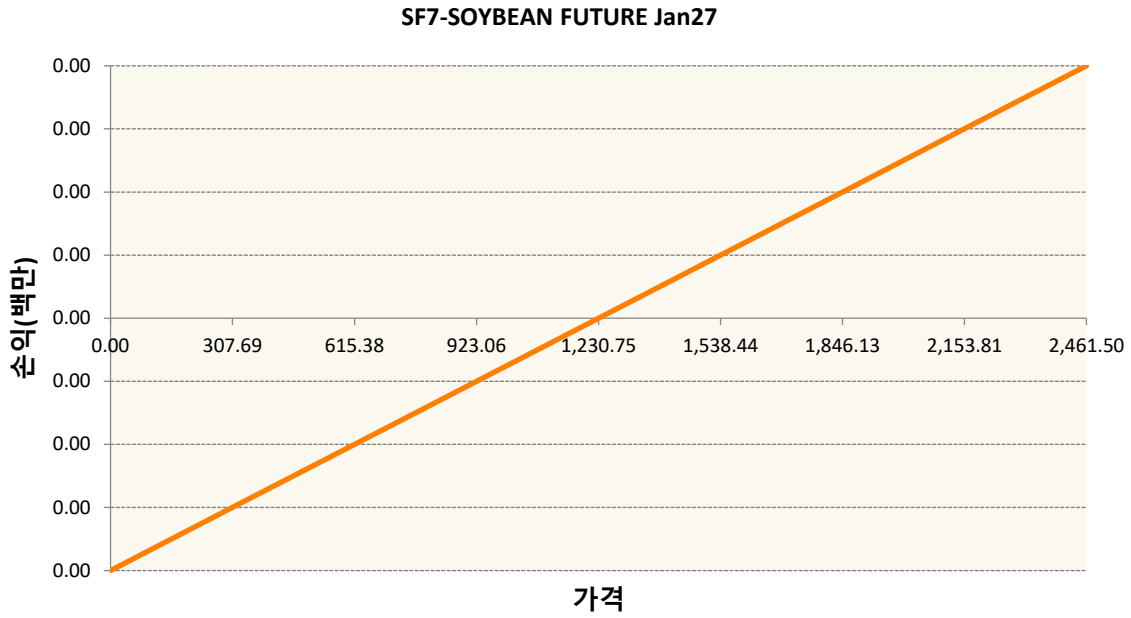
KWH7-KC HRW WHEAT FUT Mar27

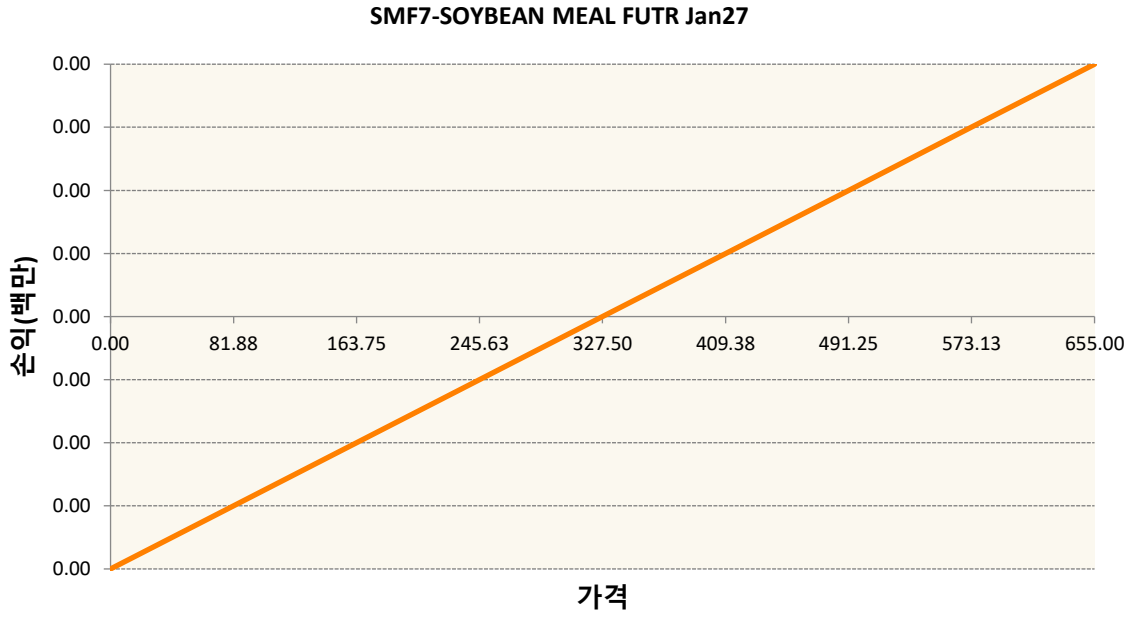


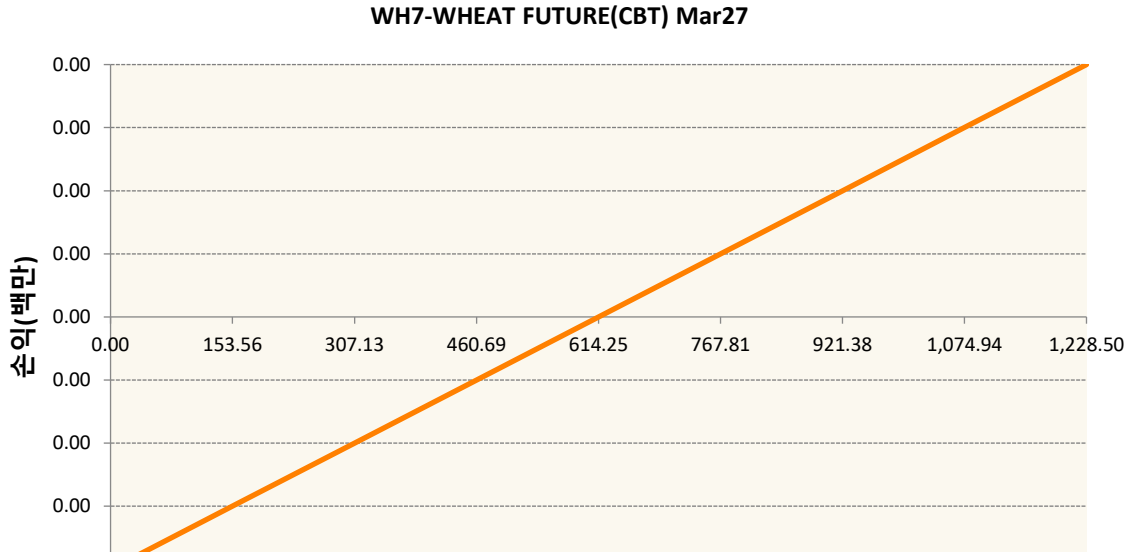
SBH7-SUGAR #11 (WORLD) MAR27




0.00
가격


SF7-SOYBEAN FUTURE Jan27
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
307.69
615.38
923.06
1,230.75
1,538.44
1,846.13
2,153.81
2,461.50
손익(백만)
가격


SMF7-SOYBEAN MEAL FUTR Jan27
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
81.88
163.75
245.63
327.50
409.38
491.25
573.13
655.00
손익(백만)
가격


WH7-WHEAT FUTURE(CBT) Mar27
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
153.56
307.13
460.69
614.25
767.81
921.38
1,074.94
1,228.50
손익(백만)



가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

공시일	2026-11-13
기준일	2026-11-12

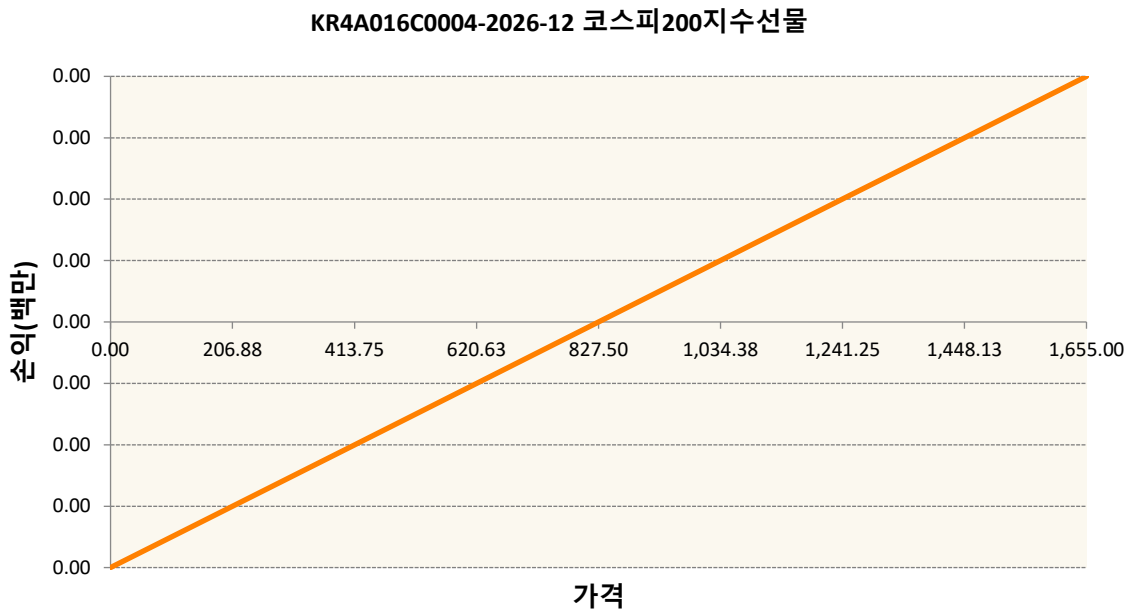
스마트인덱스모

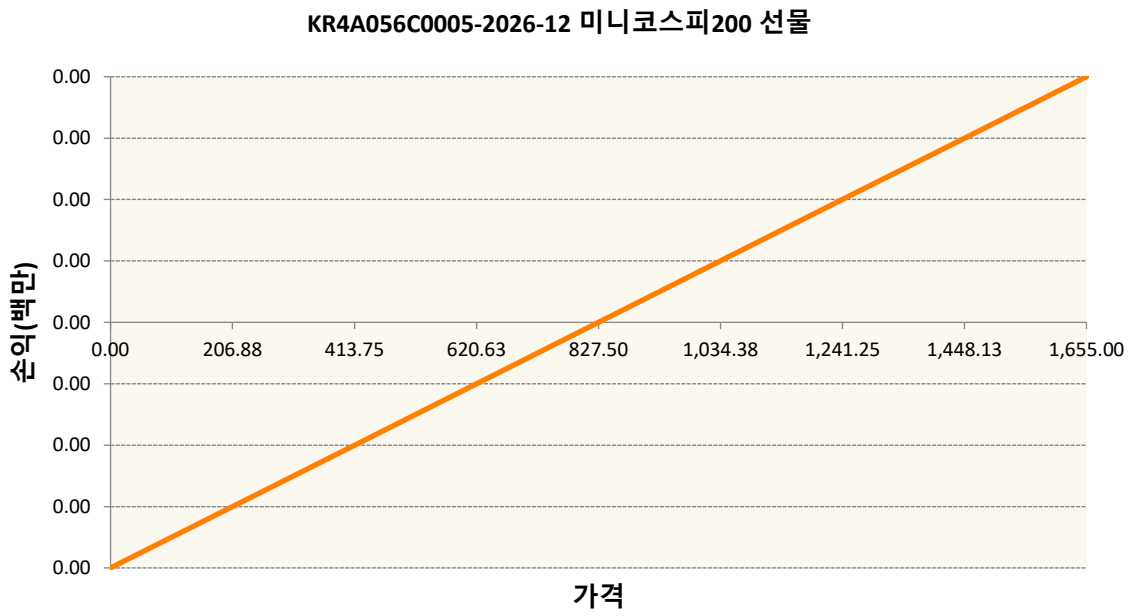
1. 계약금액

(단위:백만원)

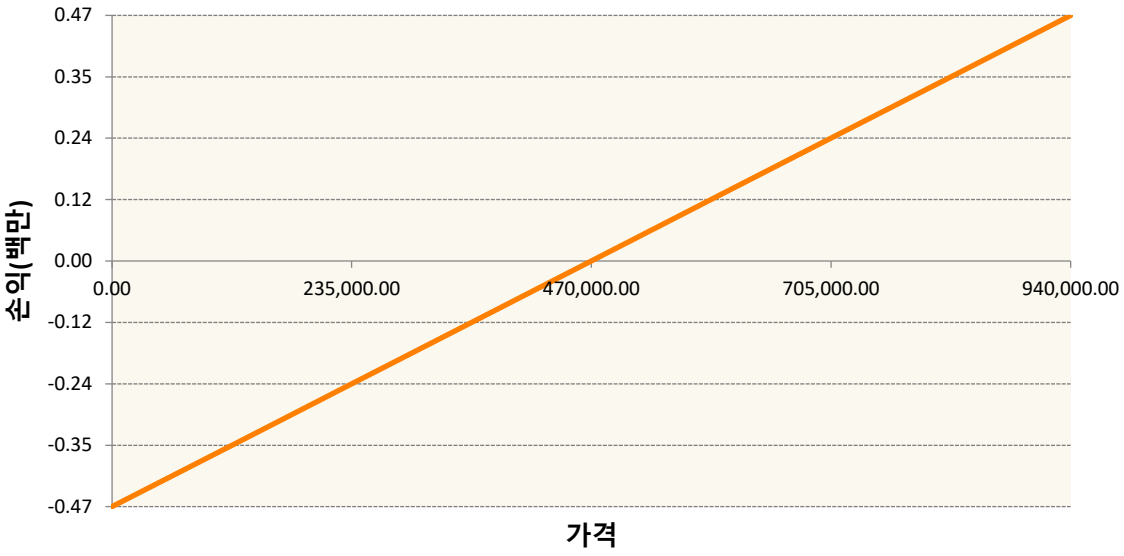
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	831	653	179	장내
누계	유가증권	선물	9,507	593	8,914	장내

2. 만기시점의 손익구조

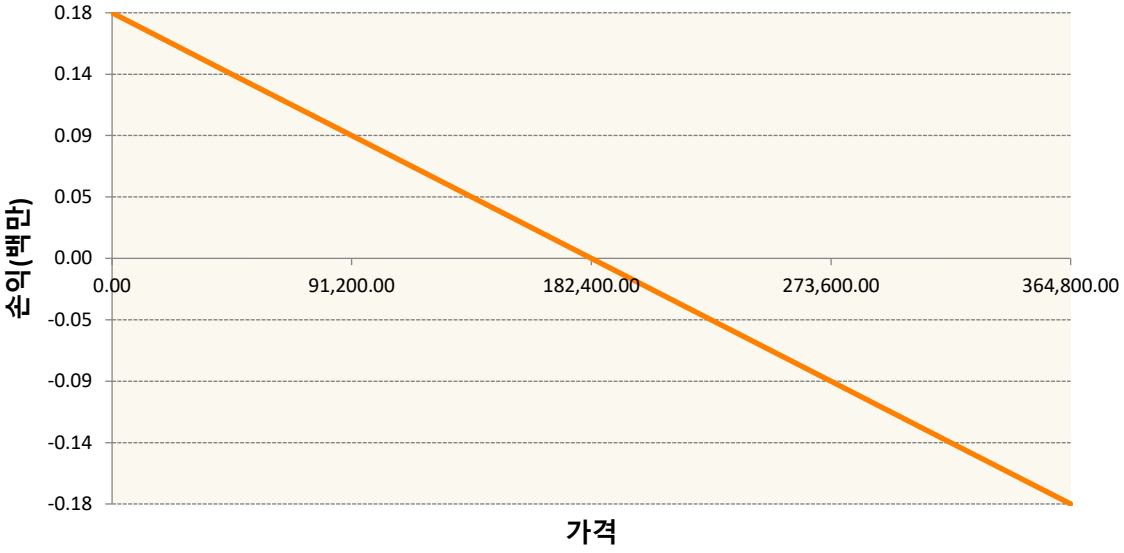




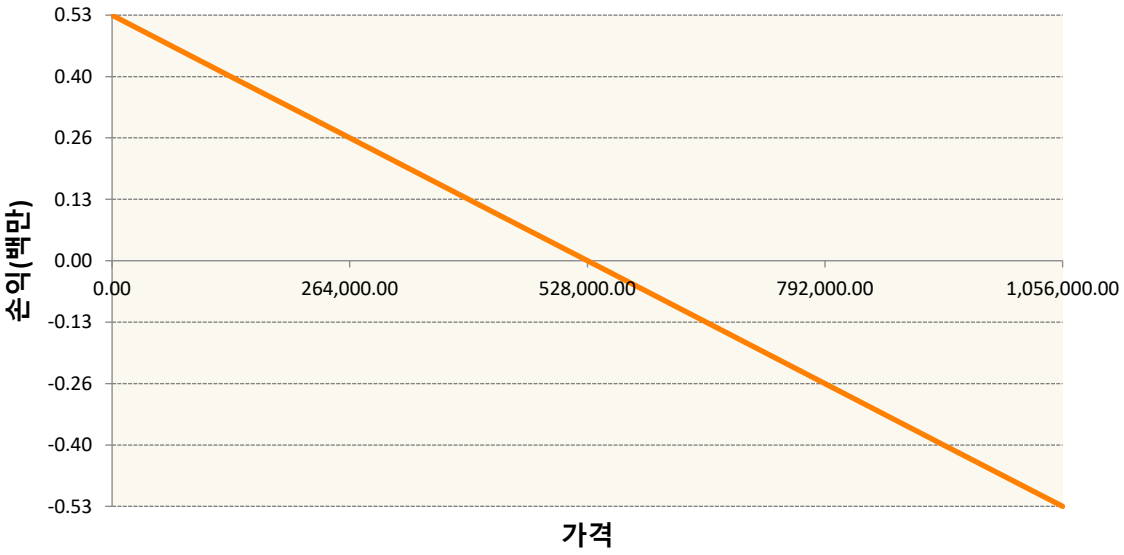
KR4A226C0000-2026-12 삼성SDI개별선물

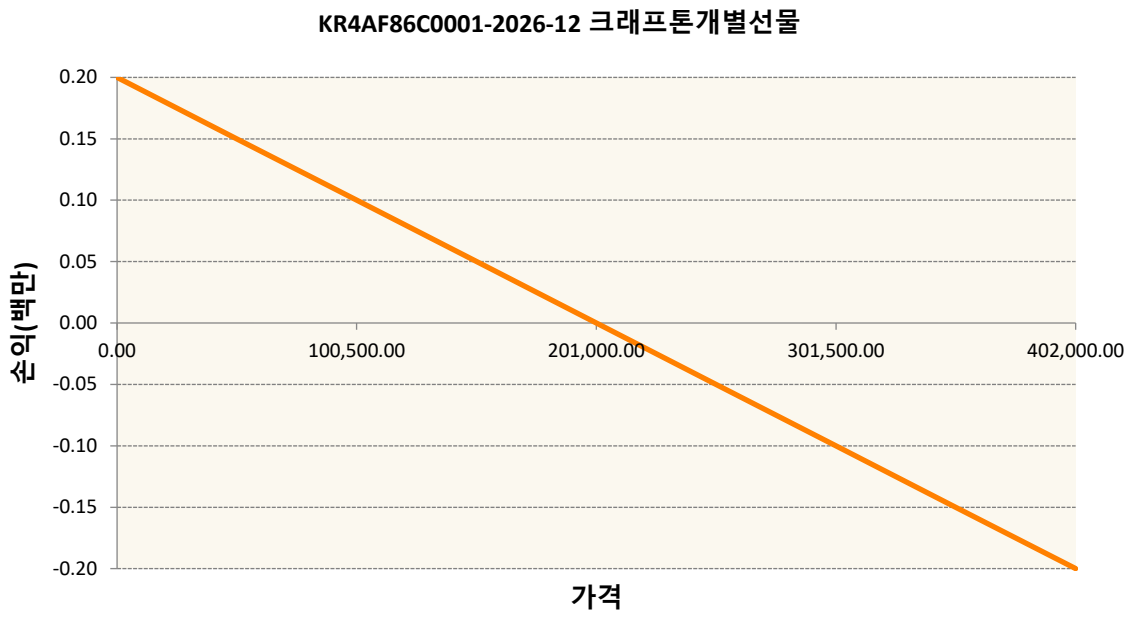


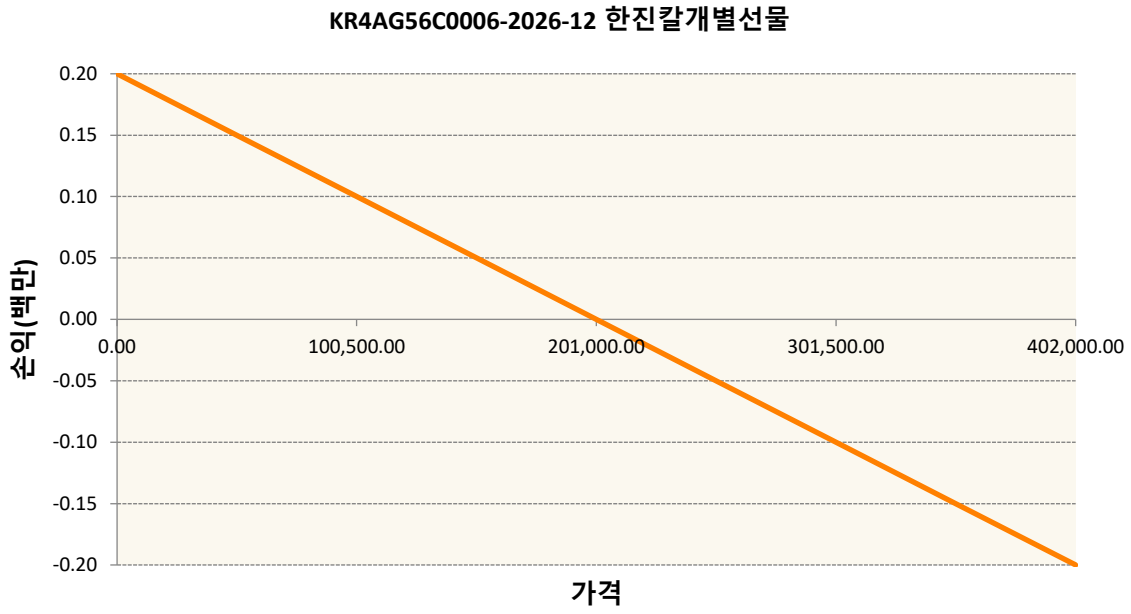
KR4A566C0008-2026-12 NAVER개별선물



KR4ACT6C0000-2026-12 삼성화재개별선물







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A016C0004	2026-12 코스피200지수선물						483
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-483	-483	-483	-483	-483	-483	-483
-5.33%	-322	-322	-322	-322	-322	-322	-322
-2.67%	-161	-161	-161	-161	-161	-161	-161
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	161	161	161	161	161	161	161
5.33%	322	322	322	322	322	322	322
8.00%	483	483	483	483	483	483	483
KR4A056C0005	2026-12 미니코스피200 선물						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
	KR4A226C0000		2026-12 삼성SDI개별선물				16
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-16	-16	-16	-16	-16	-16	-16
-5.33%	-11	-11	-11	-11	-11	-11	-11
-2.67%	-5	-5	-5	-5	-5	-5	-5
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	5	5	5	5	5	5	5
5.33%	11	11	11	11	11	11	11
8.00%	16	16	16	16	16	16	16
	KR4A566C0008		2026-12 NAVER개별선물				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
	KR4ACT6C0000		2026-12 삼성화재개별선물				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
	KR4AF86C0001		2026-12 크래프톤개별선물				12
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	12	12	12	12	12	12	12
-5.33%	8	8	8	8	8	8	8
-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%	-8	-8	-8	-8	-8	-8	-8
8.00%	-12	-12	-12	-12	-12	-12	-12
	KR4AG56C0006		2026-12 한진칼개별선물				17
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	17	17	17	17	17	17	17
-5.33%	12	12	12	12	12	12	12
-2.67%	6	6	6	6	6	6	6
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-6	-6	-6	-6	-6	-6	-6
5.33%	-12	-12	-12	-12	-12	-12	-12
8.00%	-17	-17	-17	-17	-17	-17	-17

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

1,972

공시일	2026-11-13
기준일	2026-11-12

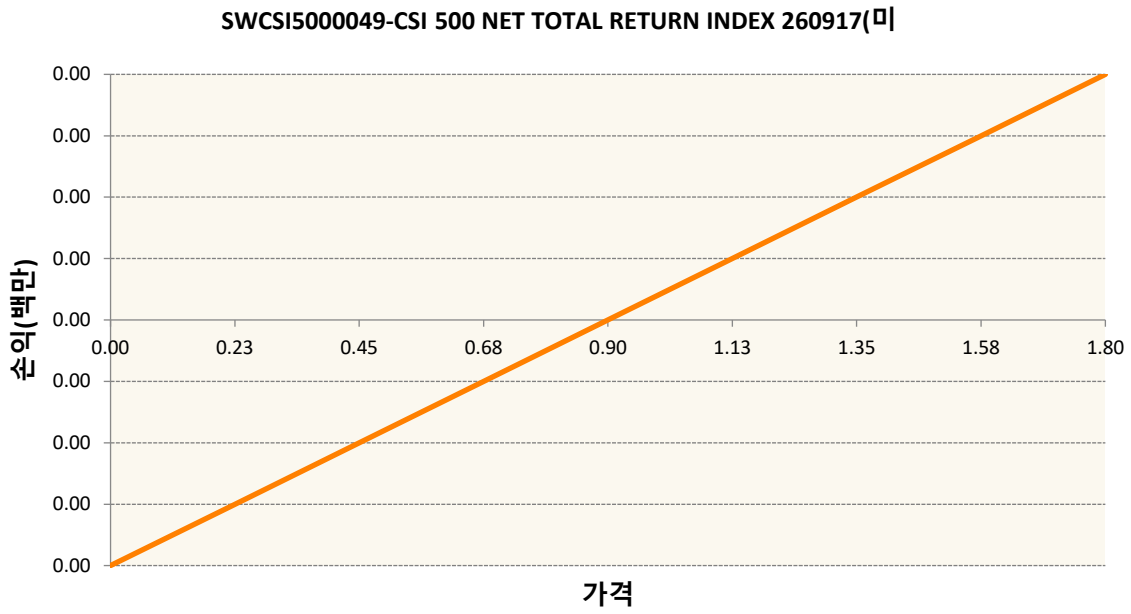
SOL차이나강소기업CSI500상장

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	382

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

633

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2026-11-13
기준일	2026-11-12

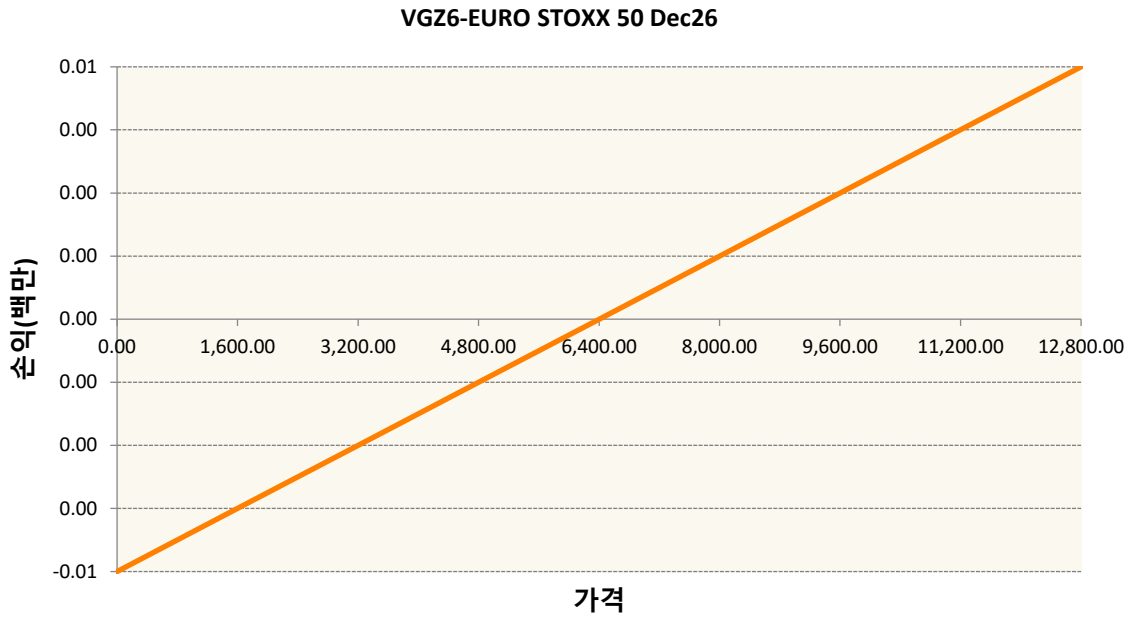
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,111	0	1,111	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGZ6	EURO STOXX 50 Dec26	89

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

(단위:백만원)

66

공시일	2026-11-13
기준일	2026-11-12

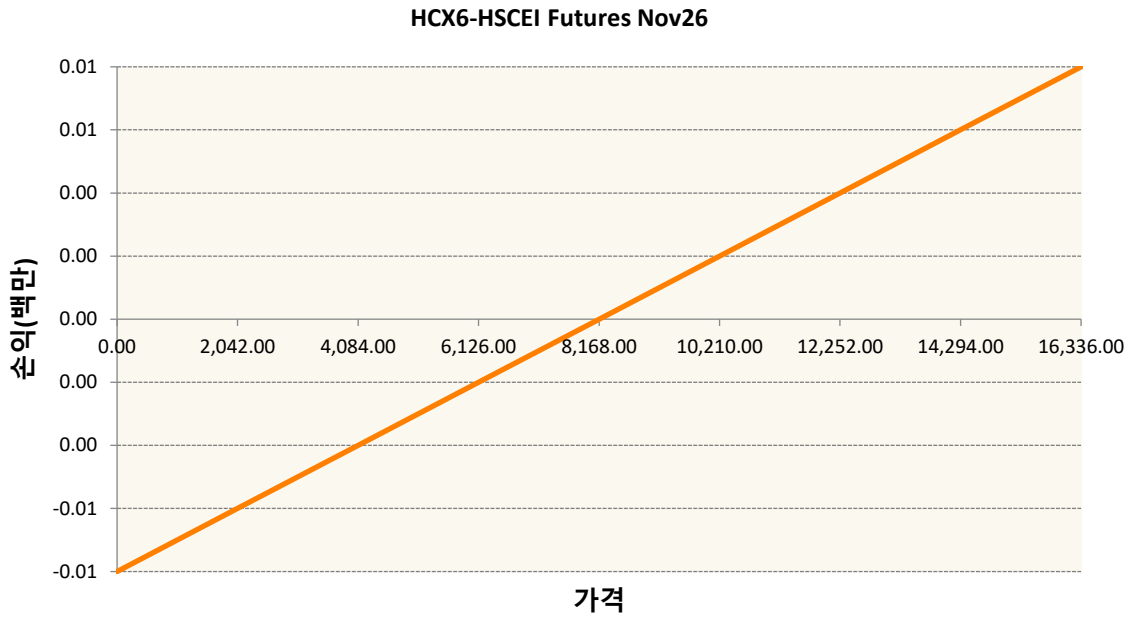
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,184	0	1,184	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCX6	HSCEI Futures Nov26	95

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

(단위:백만원)

90

공시일	2026-11-13
기준일	2026-11-12

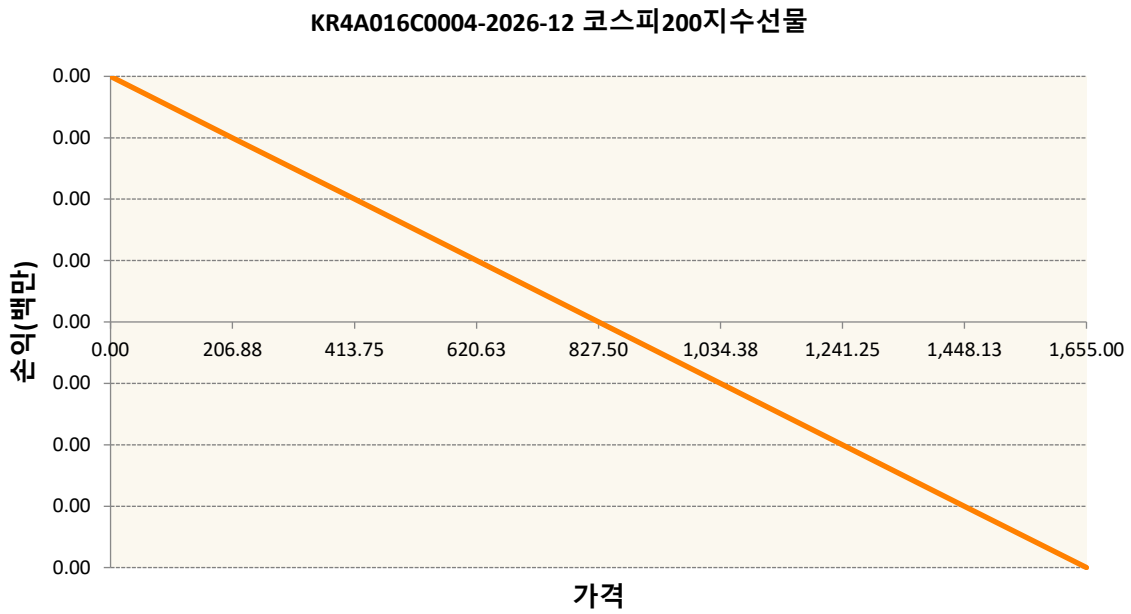
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	11,647	-11,647	장내
누계	유가증권	선물	0	11,585	-11,585	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A016C0004 2026-12 코스피200지수선물 934

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	934	934	934	934	934	934	934
-5.33%	622	622	622	622	622	622	622
-2.67%	311	311	311	311	311	311	311
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-311	-311	-311	-311	-311	-311	-311
5.33%	-622	-622	-622	-622	-622	-622	-622
8.00%	-934	-934	-934	-934	-934	-934	-934

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

3,311

공시일	2026-11-13
기준일	2026-11-12

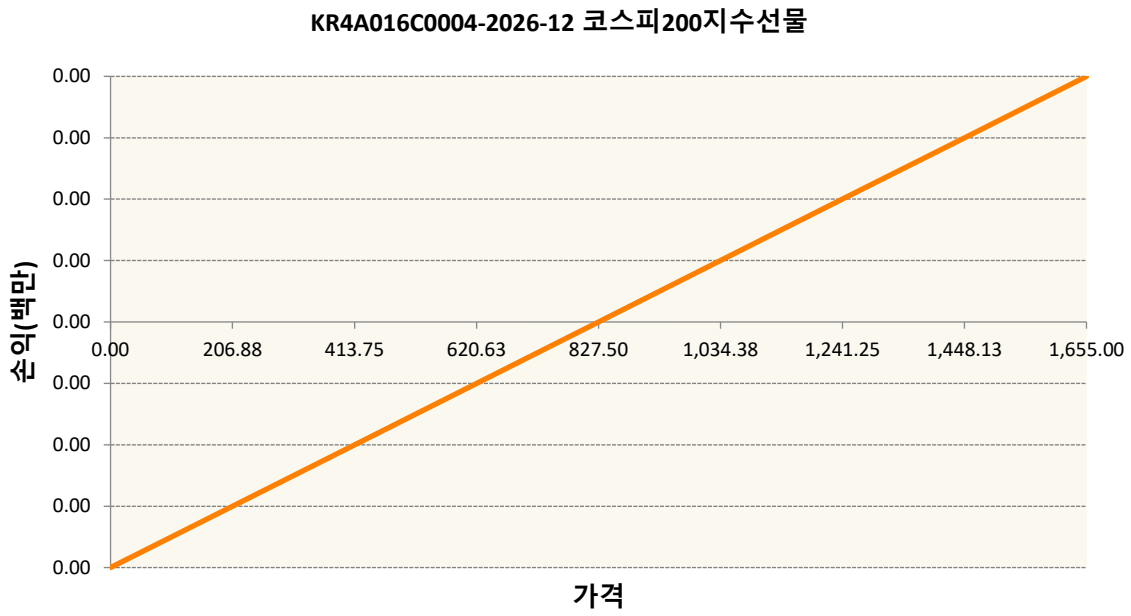
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

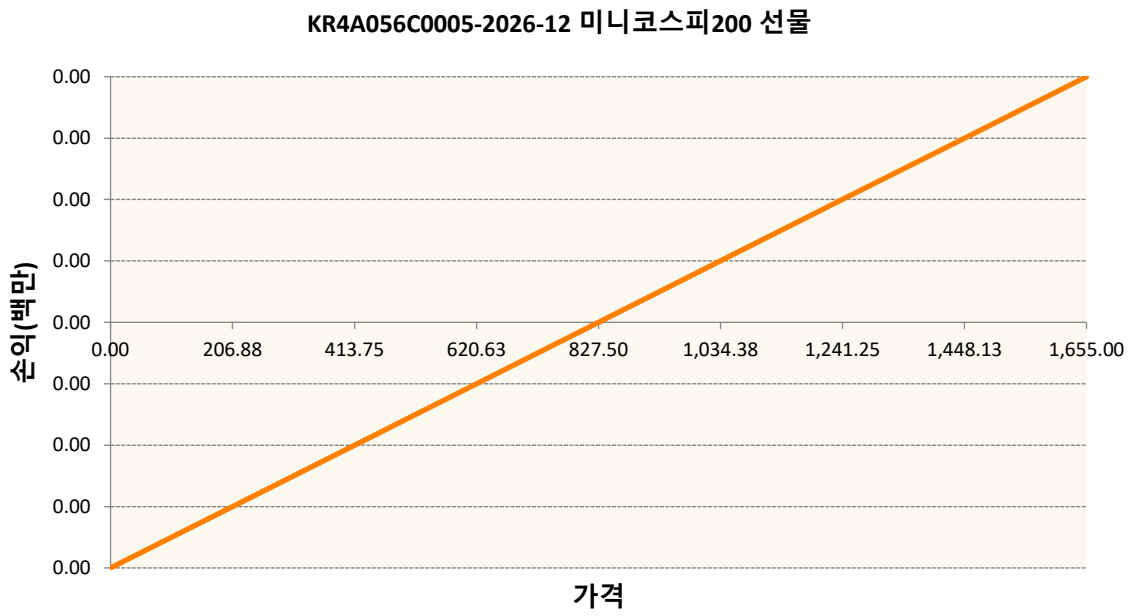
1. 계약금액

(단위:백만원)

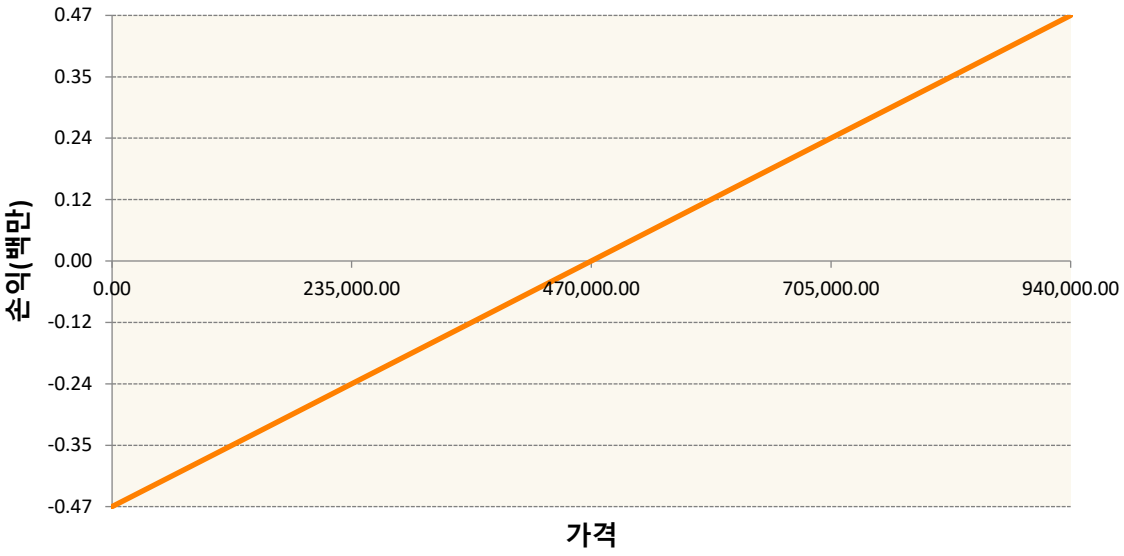
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	38	45	-7	장내
누계	유가증권	선물	2,313	115	2,198	장내

2. 만기시점의 손익구조

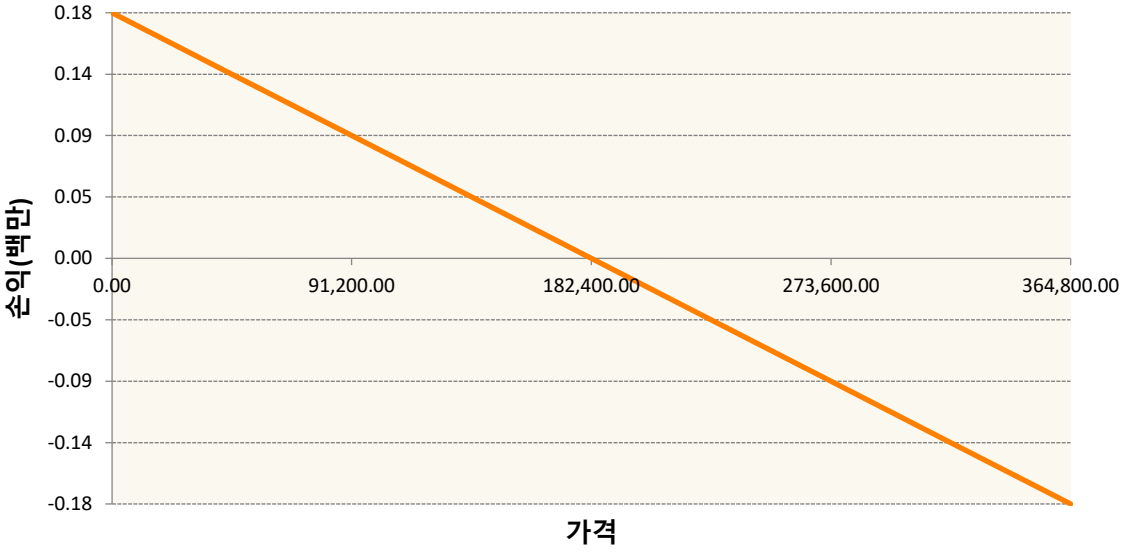




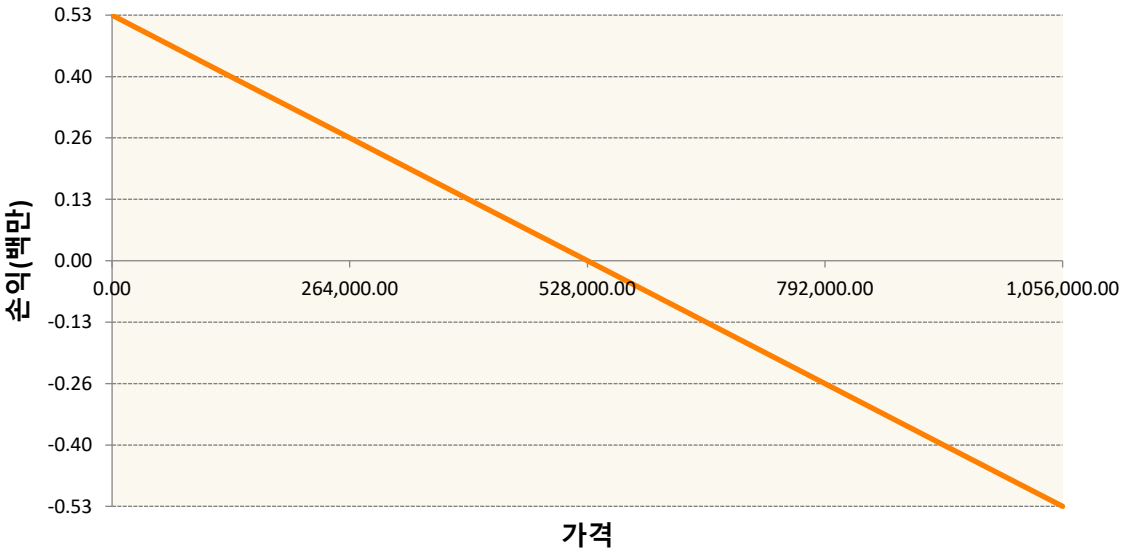
KR4A226C0000-2026-12 삼성SDI개별선물

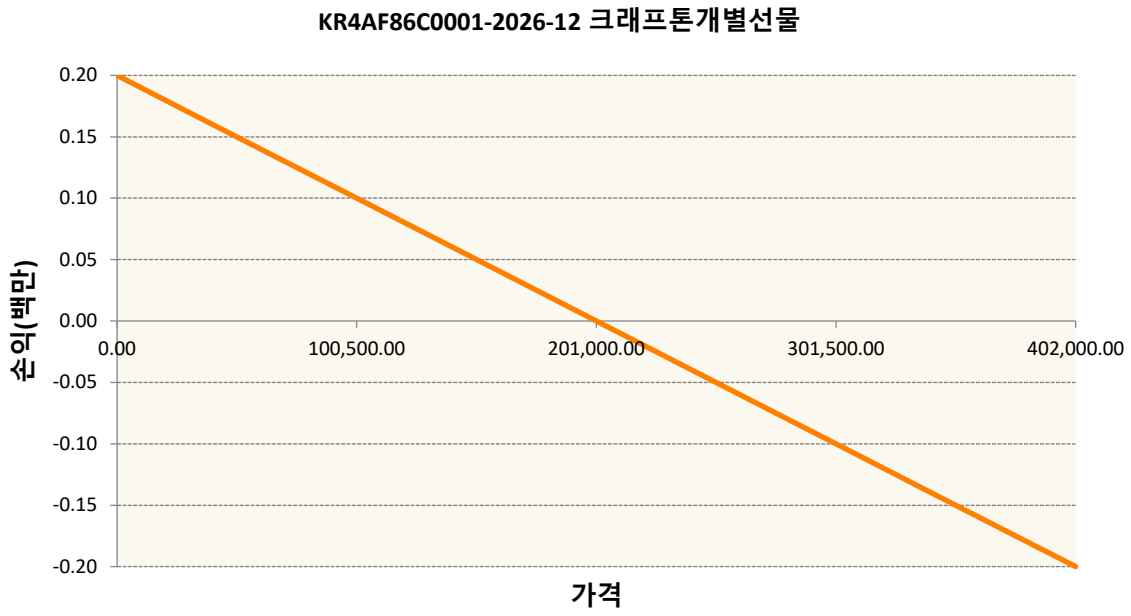


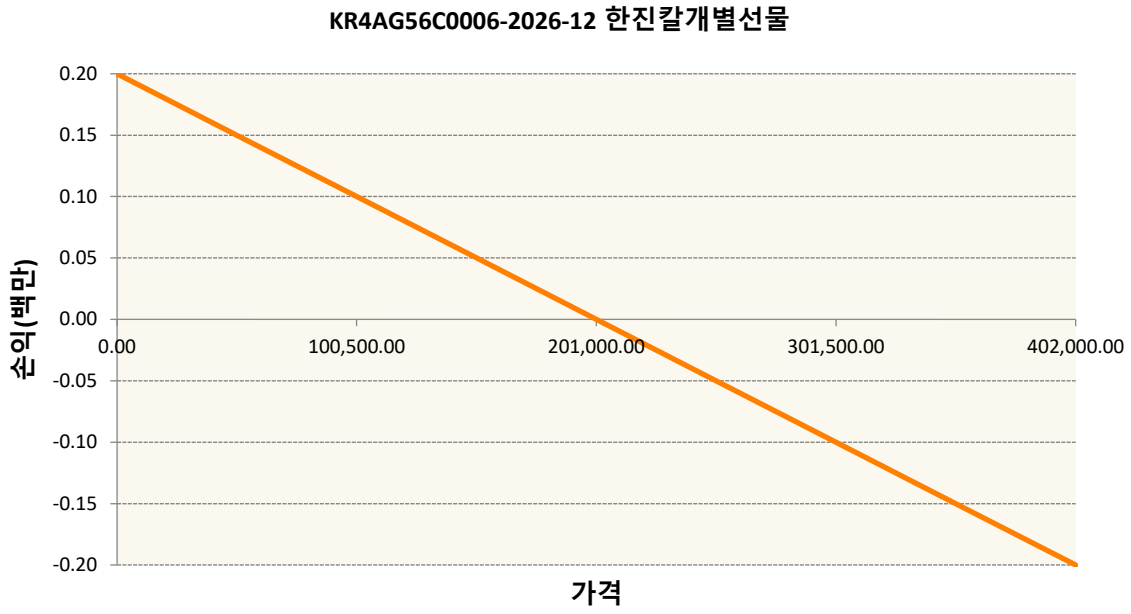
KR4A566C0008-2026-12 NAVER개별선물



KR4ACT6C0000-2026-12 삼성화재개별선물







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

	KR4A016C0004	2026-12 코스피200지수선물					50
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-50	-50	-50	-50	-50	-50	-50
-5.33%	-33	-33	-33	-33	-33	-33	-33
-2.67%	-17	-17	-17	-17	-17	-17	-17
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	17	17	17	17	17	17	17
5.33%	33	33	33	33	33	33	33
8.00%	50	50	50	50	50	50	50
	KR4A056C0005	2026-12 미니코스피200 선물					27
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-27	-27	-27	-27	-27	-27	-27
-5.33%	-18	-18	-18	-18	-18	-18	-18
-2.67%	-9	-9	-9	-9	-9	-9	-9
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	9	9	9	9	9	9	9
5.33%	18	18	18	18	18	18	18
8.00%	27	27	27	27	27	27	27
	KR4A226C0000		2026-12 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
	KR4A566C0008		2026-12 NAVER개별선물				2
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	2	2	2	2	2	2	2
-5.33%	1	1	1	1	1	1	1
-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%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1
8.00%	-2	-2	-2	-2	-2	-2	-2
	KR4ACT6C0000		2026-12 삼성화재개별선물				2
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	2	2	2	2	2	2	2
-5.33%	1	1	1	1	1	1	1
-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%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1
8.00%	-2	-2	-2	-2	-2	-2	-2
	KR4AF86C0001		2026-12 크래프톤개별선물				2
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	2	2	2	2	2	2	2
-5.33%	1	1	1	1	1	1	1
-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%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1
8.00%	-2	-2	-2	-2	-2	-2	-2
	KR4AG56C0006		2026-12 한진칼개별선물				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)

285

공시일	2026-11-13
기준일	2026-11-12

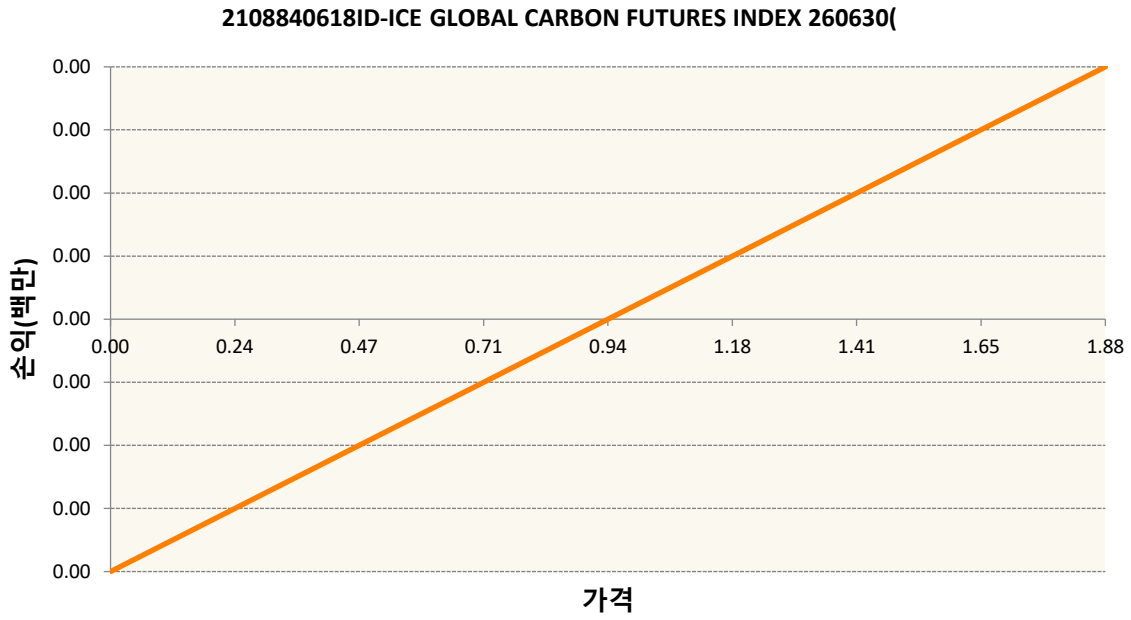
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

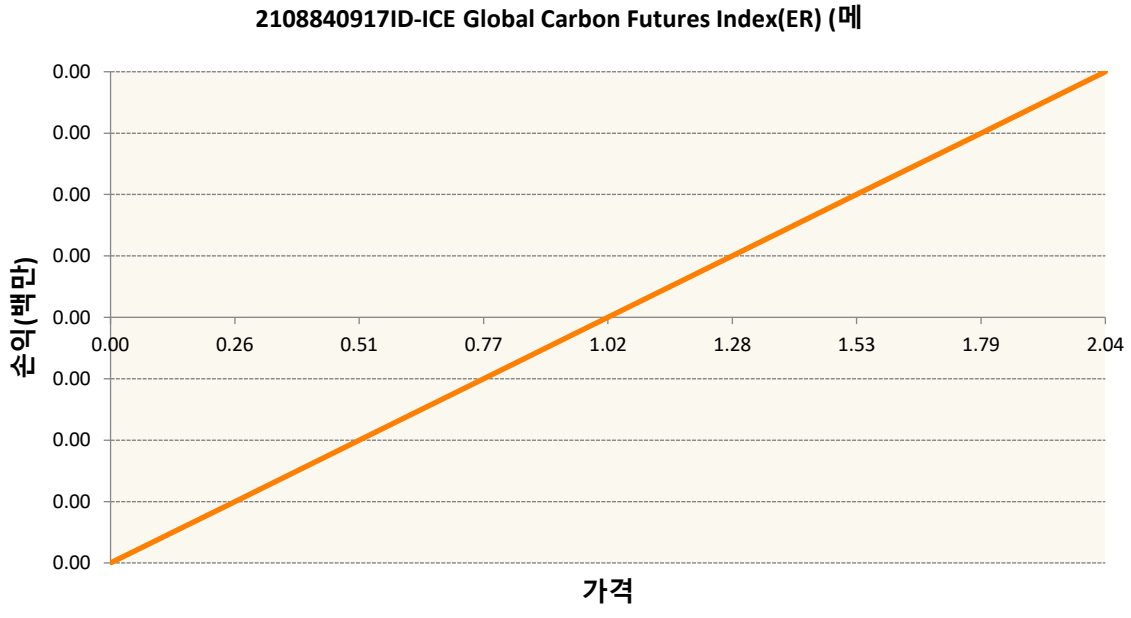
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	7,165	0	7,165	장외

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2108840618ICE GLOBAL CARBON FUTURES INDEX 260630(	458
2108840917ICE Global Carbon Futures Index(ER) (메	116

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

589

공시일	2026-11-13
기준일	2026-11-12

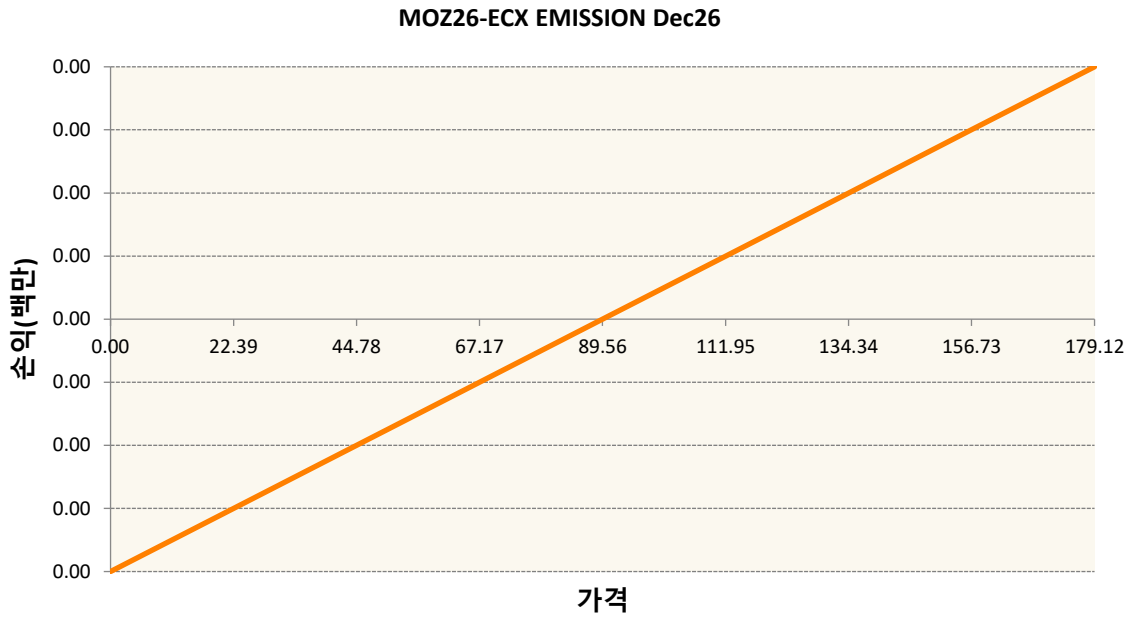
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

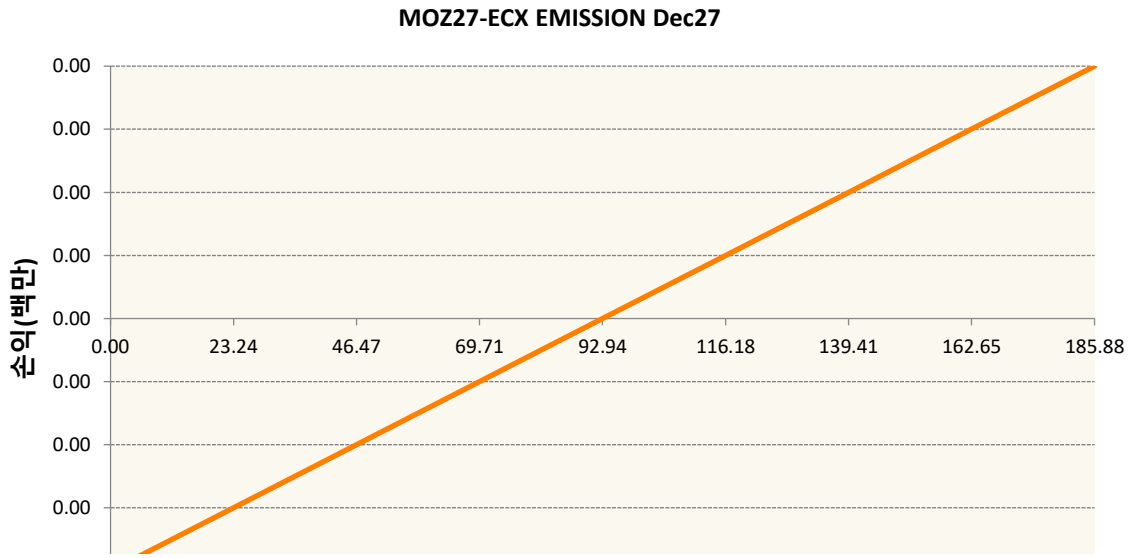
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규			0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계			1,319	0	1,319	
누계	유가증권	선물	4,711	0	4,711	
누계	통화	선도	0	2,763	-2,763	장외

2. 만기시점의 손익구조







가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

FXW213GAV	KRW/EUR 30-11-26E	221
MOZ26	ECX EMISSION Dec26	106
MOZ27	ECX EMISSION Dec27	377

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

733

공시일	2026-11-13
기준일	2026-11-12

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	-680	0	-680	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWSOL0000(CSI PHOTOVOLTAIC INDUSTRY INDEX 260325(	9
SWSOL0000(CSI PHOTOVOLTAIC INDUSTRY INDEX 260630(N	9
SWSOL0000(CSI PHOTOVOLTAIC INDUSTRY INDEX 260630(	14
SWSOL0000(CSI PHOTOVOLTAIC INDUSTRY INDEX 260923(	23

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

(단위:백만원)

86

공시일	2026-11-13
기준일	2026-11-12

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	-6,052	0	-6,052	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 251218(NH)	49
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 260714(미래)	330
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 260917(메리츠)	104

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

(단위:백만원)

959

공시일	2026-11-13
기준일	2026-11-12

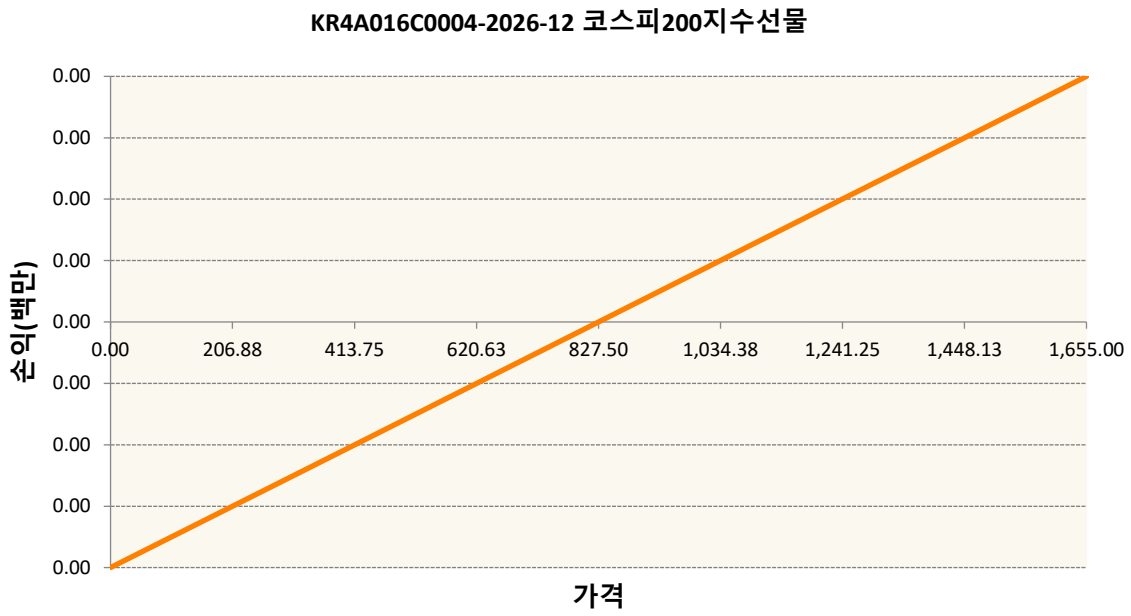
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

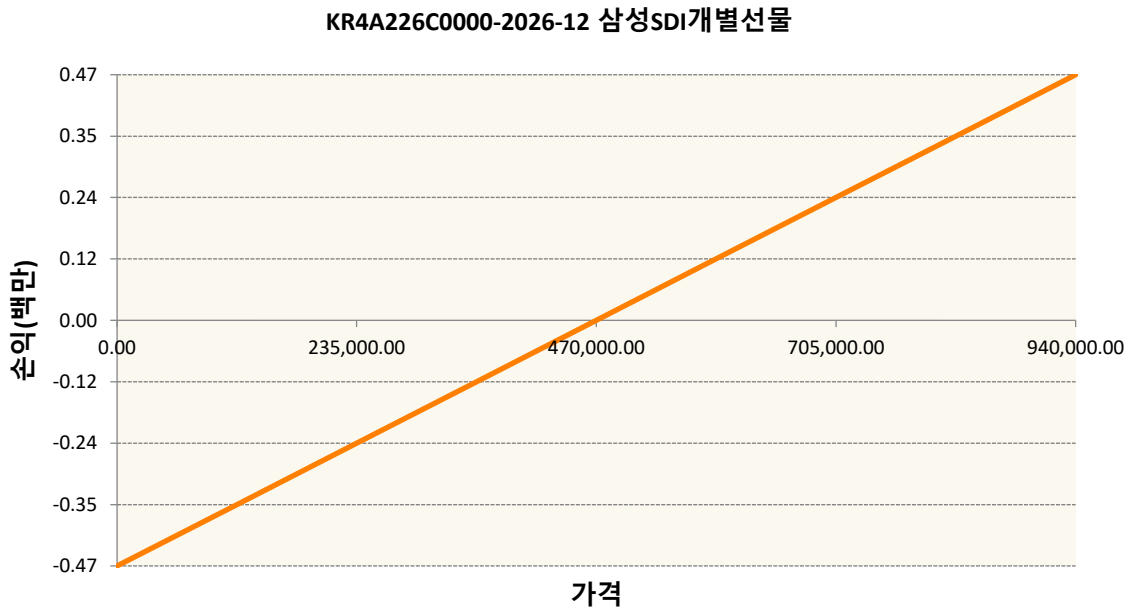
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	682	833	-151	장내
누계	유가증권	선물	11,637	0	11,637	장내

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4A016C0004	2026-12 코스피200지수선물						900
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-900	-900	-900	-900	-900	-900	-900
-5.33%	-600	-600	-600	-600	-600	-600	-600
-2.67%	-300	-300	-300	-300	-300	-300	-300
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	300	300	300	300	300	300	300
5.33%	600	600	600	600	600	600	600
8.00%	900	900	900	900	900	900	900

KR4A226C0000	2026-12 삼성SDI개별선물						37
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-37	-37	-37	-37	-37	-37	-37
-5.33%	-25	-25	-25	-25	-25	-25	-25
-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%	25	25	25	25	25	25	25
8.00%	37	37	37	37	37	37	37

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

3,286

공시일	2026-11-13
기준일	2026-11-12

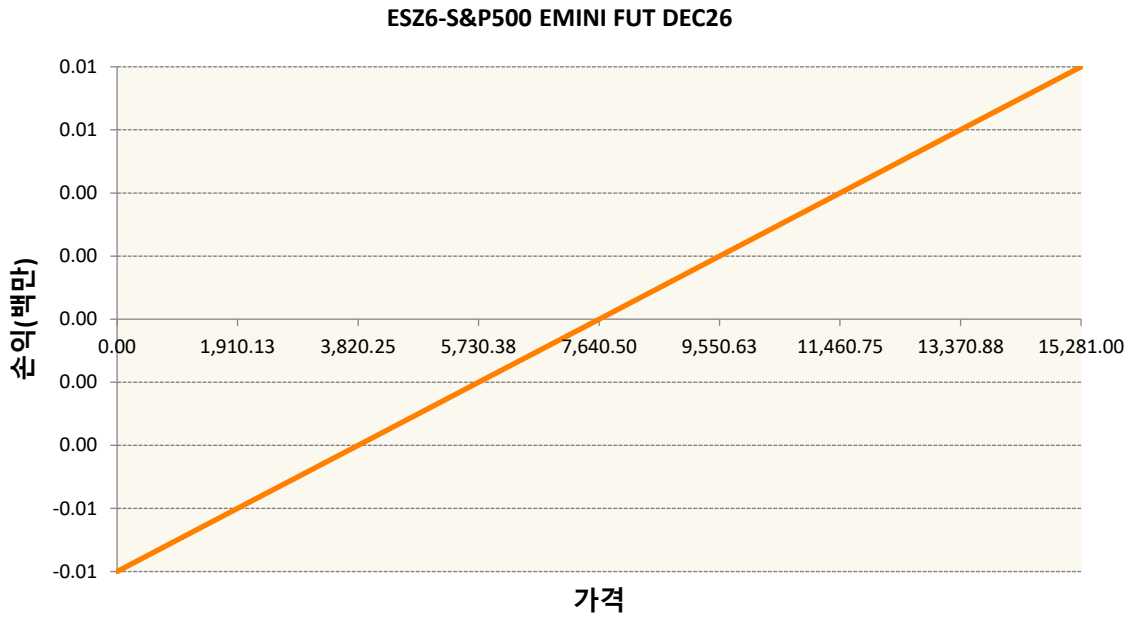
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

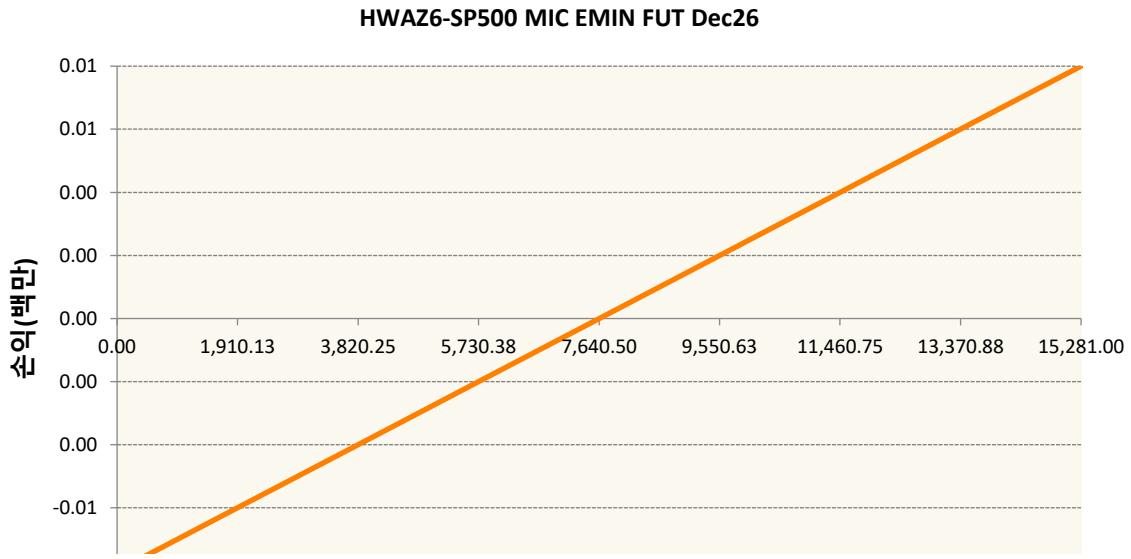
1. 계약금액

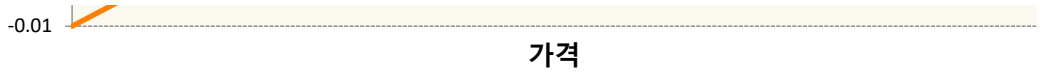
(단위:백만원)

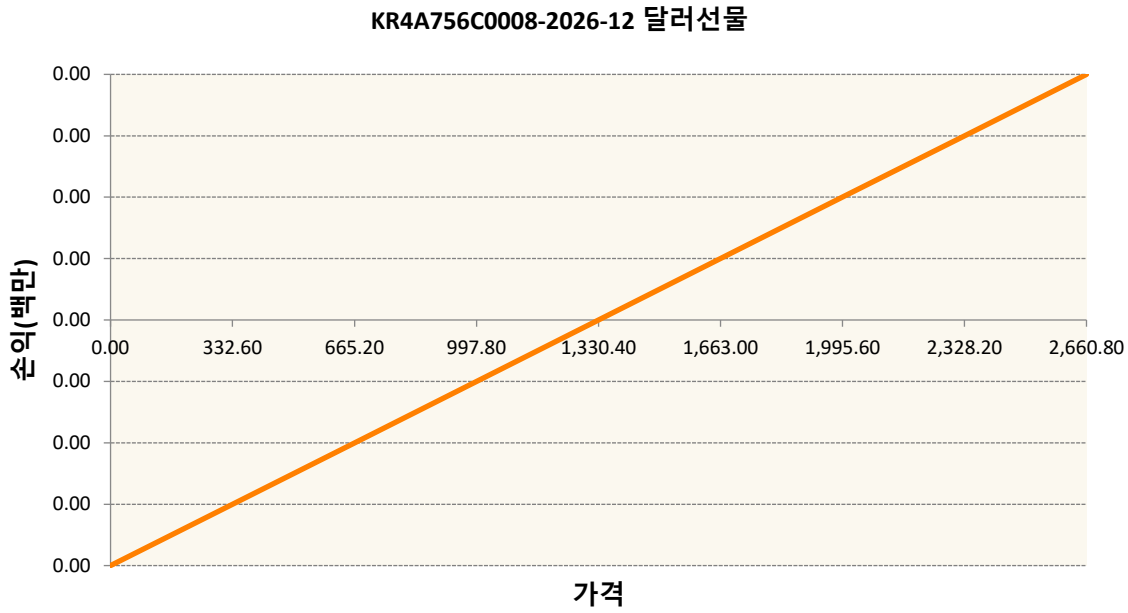
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
신규	지수	선물	0	0	0	장내
신규	통화	선물	930	0	930	장내
누계	지수	선물	75,870	0	75,870	
누계	지수	선물	370	0	370	장내
누계	통화	선물	20,355	0	20,355	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

ESZ6	S&P500 EMINI FUT DEC26	6,070
HWAZ6	SP500 MIC EMIN FUT Dec26	30
KR4A756C00	2026-12 달러선물	1,628

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

3,881

공시일	2026-11-13
기준일	2026-11-12

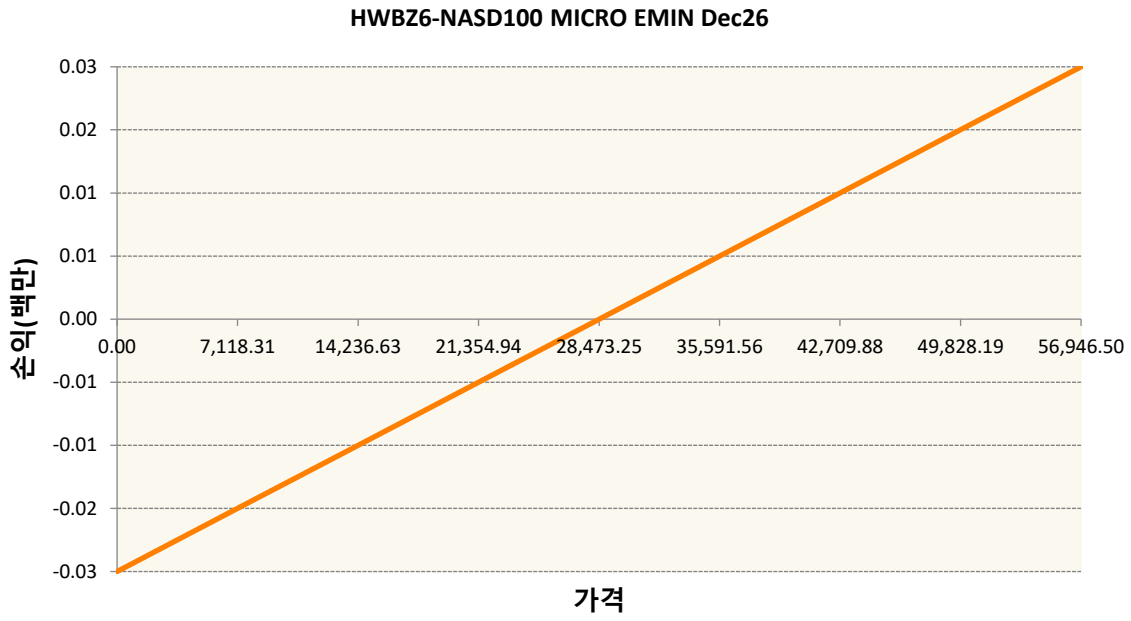
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

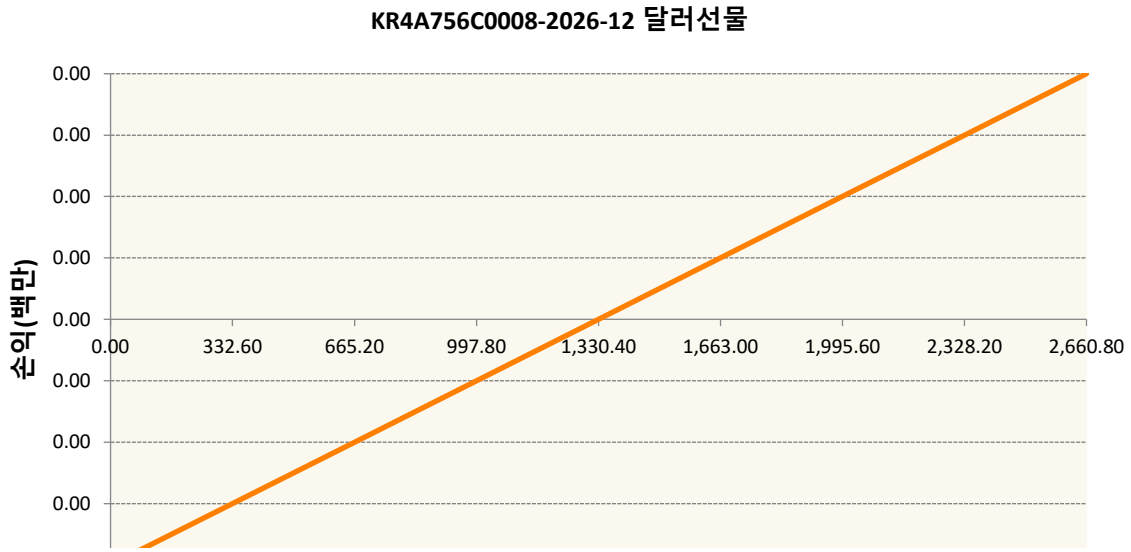
1. 계약금액

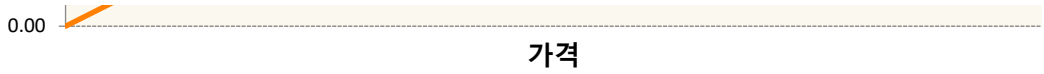
(단위:백만원)

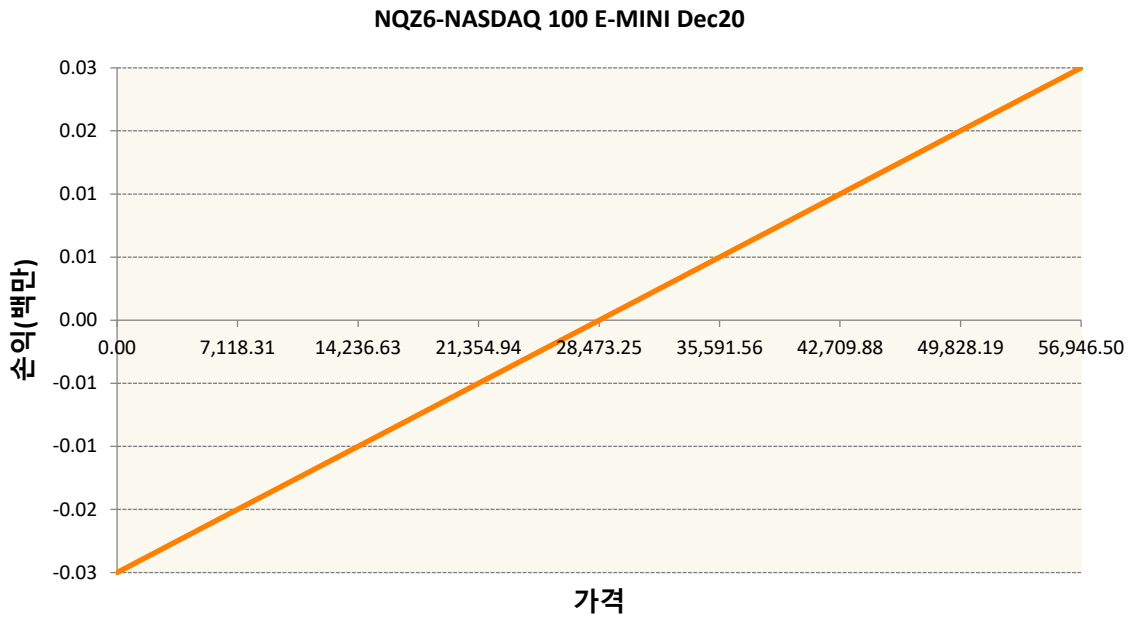
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
신규	지수	선물	0	0	0	장내
신규	통화	선물	398	0	398	장내
누계	지수	선물	31,487	0	31,487	
누계	지수	선물	394	0	394	장내
누계	통화	선물	9,393	0	9,393	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HWBZ6	NASD100 MICRO EMIN Dec26	32
KR4A756C00	2026-12 달러선물	751
NQZ6	NASDAQ 100 E-MINI Dec20	2,519

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	2,452

공시일	2026-11-13
기준일	2026-11-12

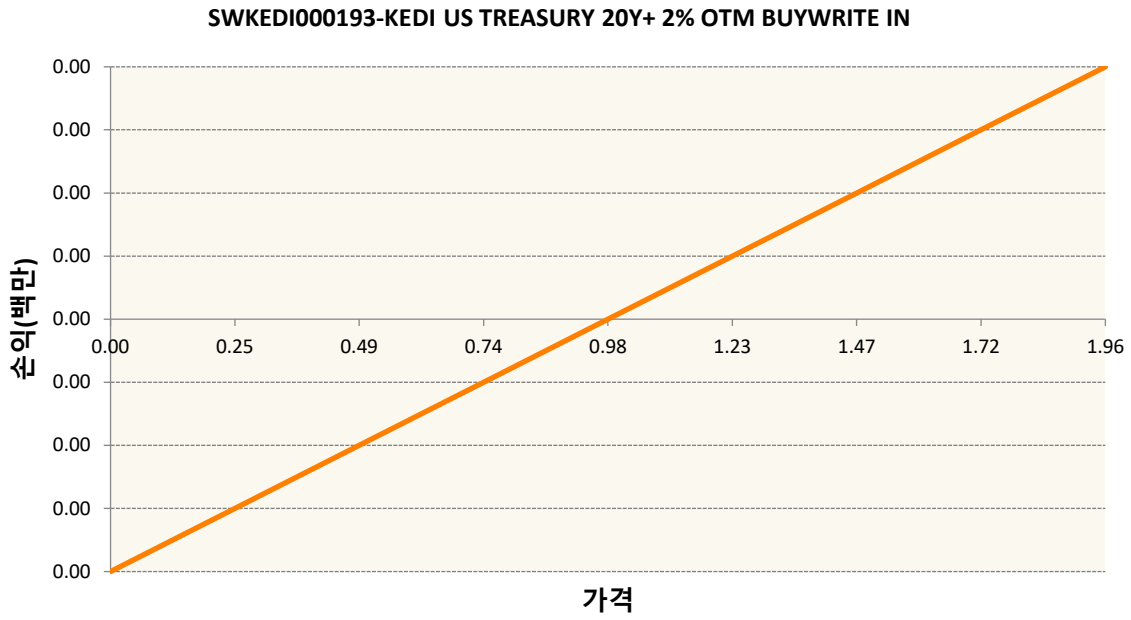
SOL미국30년국채커버드콜(합성)

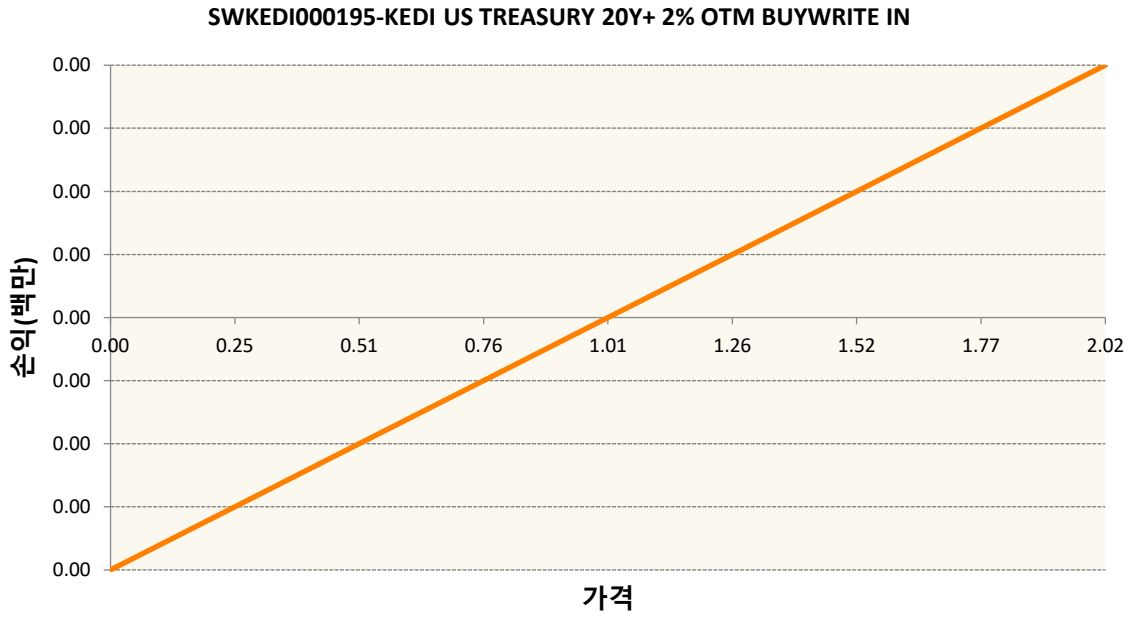
1. 계약금액

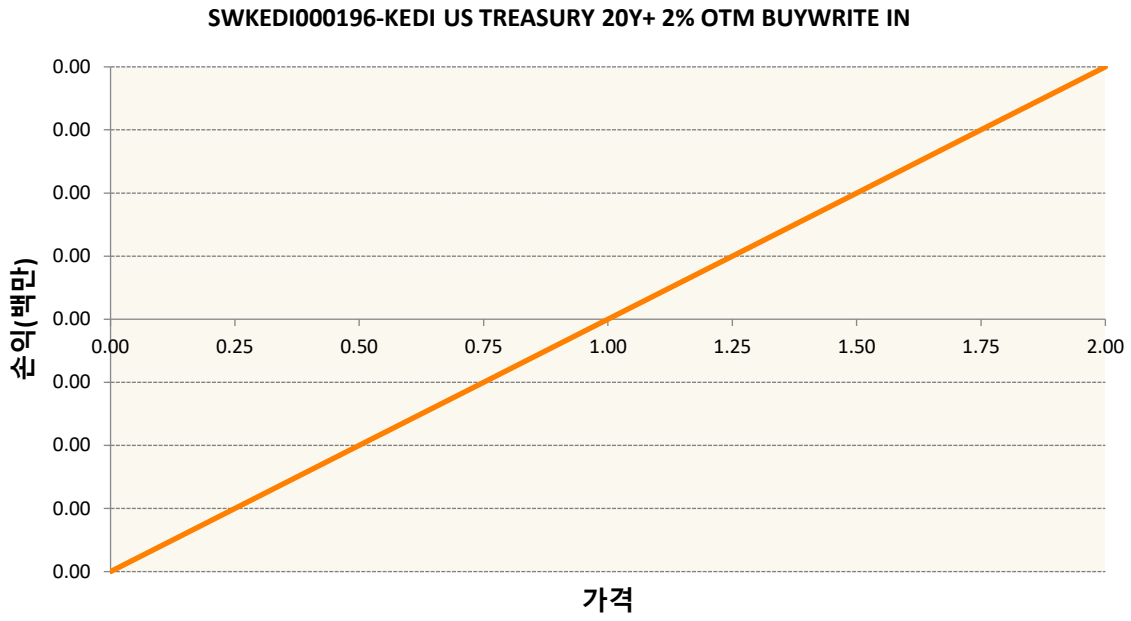
(단위:백만원)

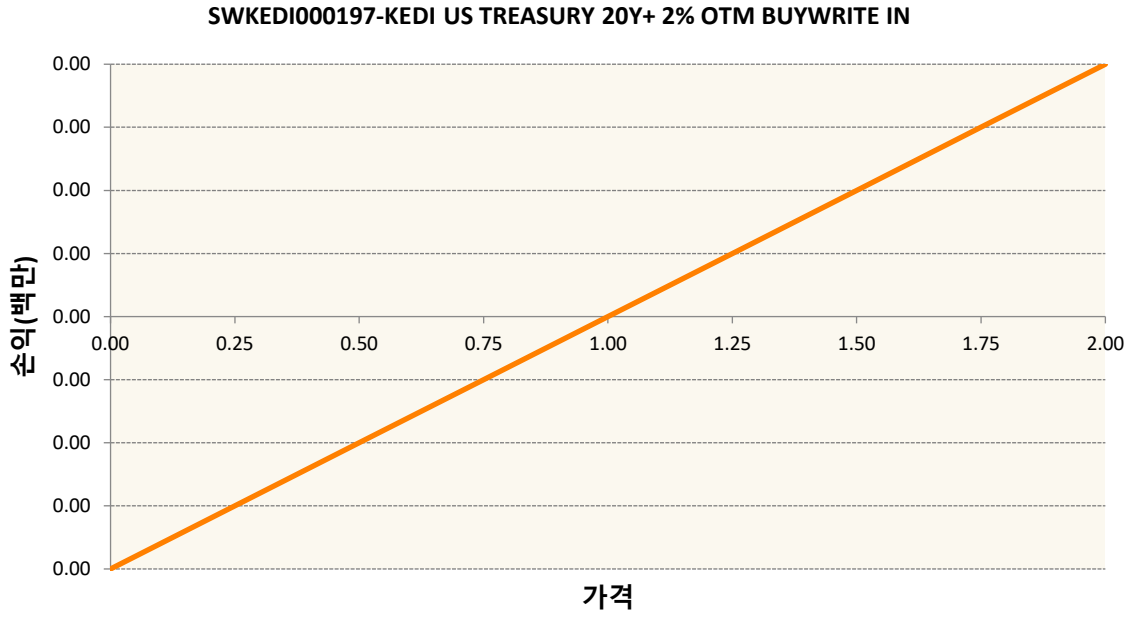
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	275,306	0	275,306	장외

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	6,948
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	7,829
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	2,576
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	4,676

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

8,576