공시일	2026-11-16
기준일	2026-11-13

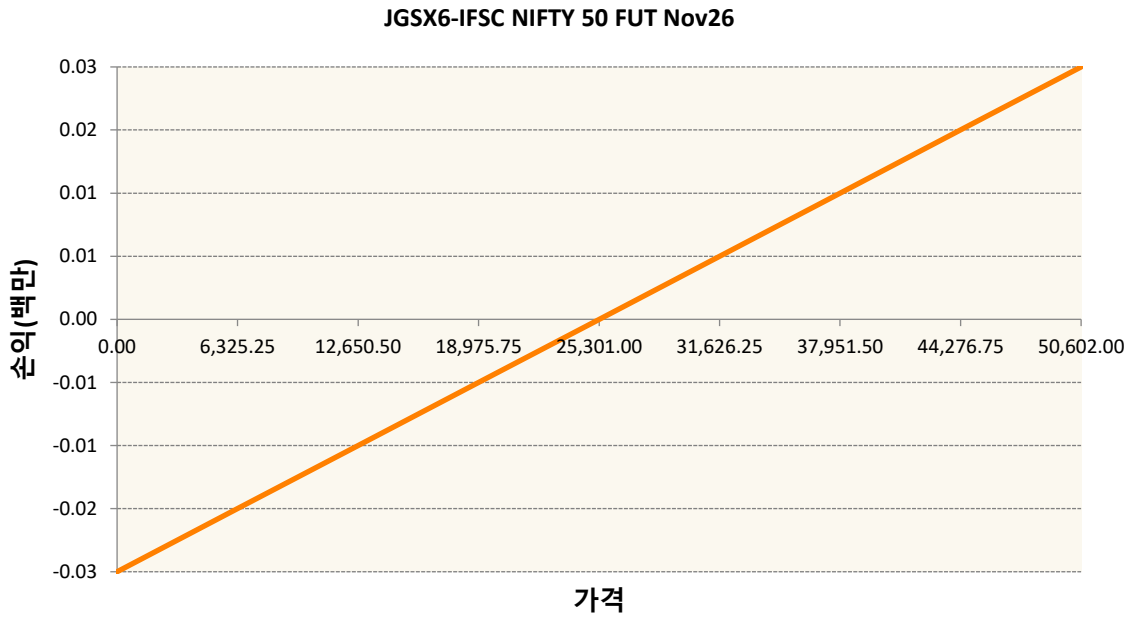
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	335	0	335	

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	2026-11-16
기준일	2026-11-13

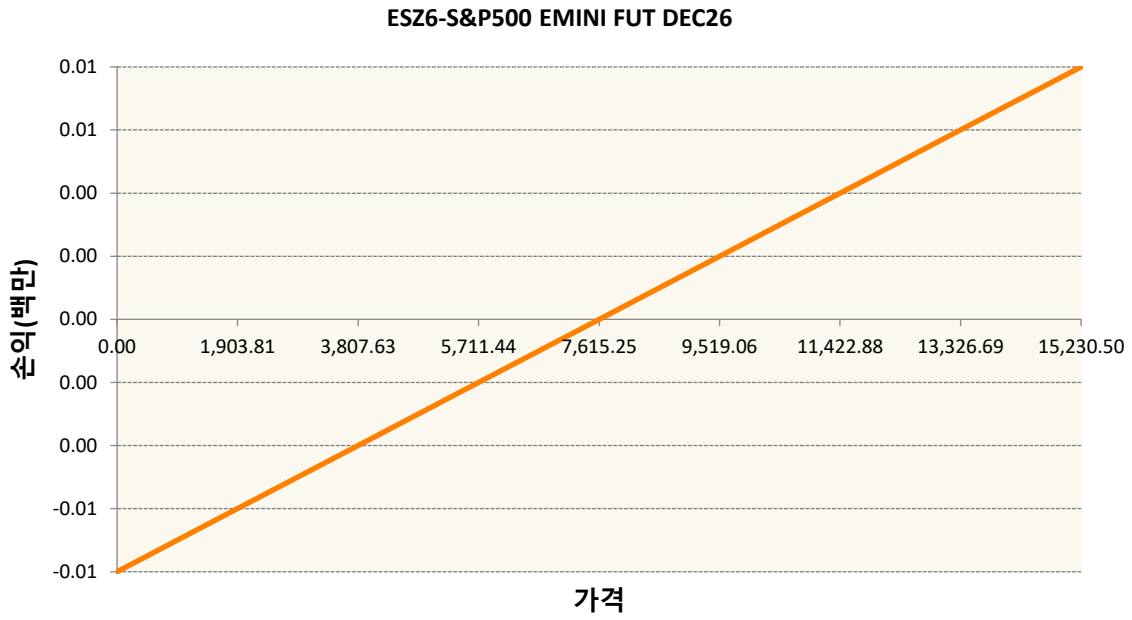
SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	527	0	527	

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	2026-11-16
기준일	2026-11-13

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	2026-11-16
기준일	2026-11-13

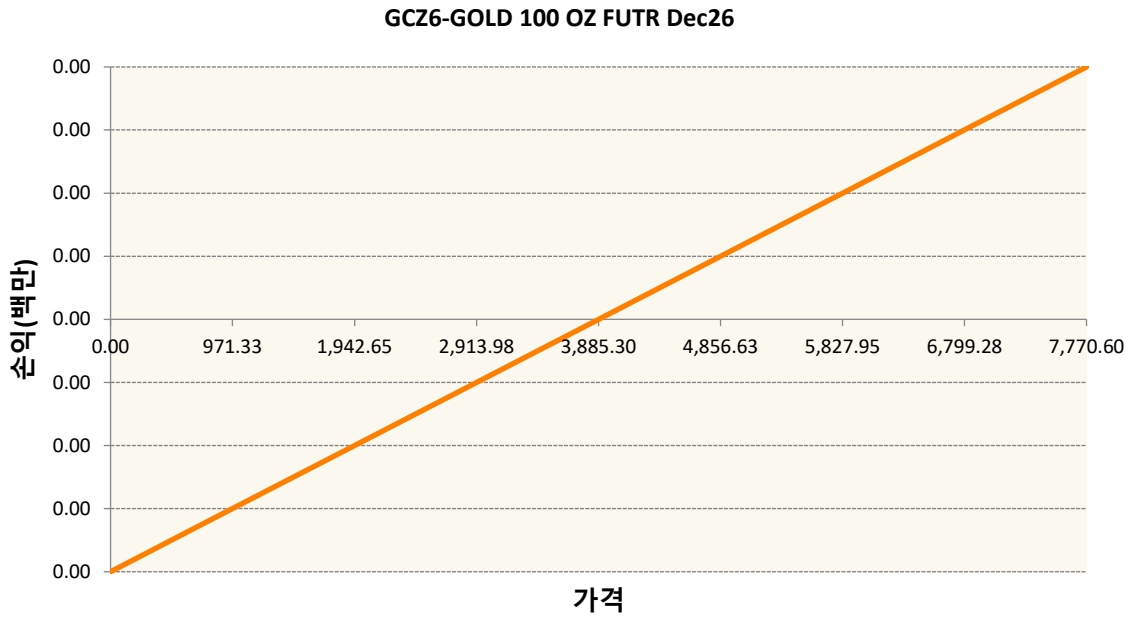
SOL골드커버드콜액티브특별자산상장지수(금

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			5,560	0	5,560	
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	445

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

(단위:백만원)

590

공시일	2026-11-16
기준일	2026-11-13

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	1
AOPLTRAP1(PLTR US 11/13/26 P162.5 EQUITY	45

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

(단위:백만원)

159

공시일	2026-11-16
기준일	2026-11-13

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	2026-11-16
기준일	2026-11-13

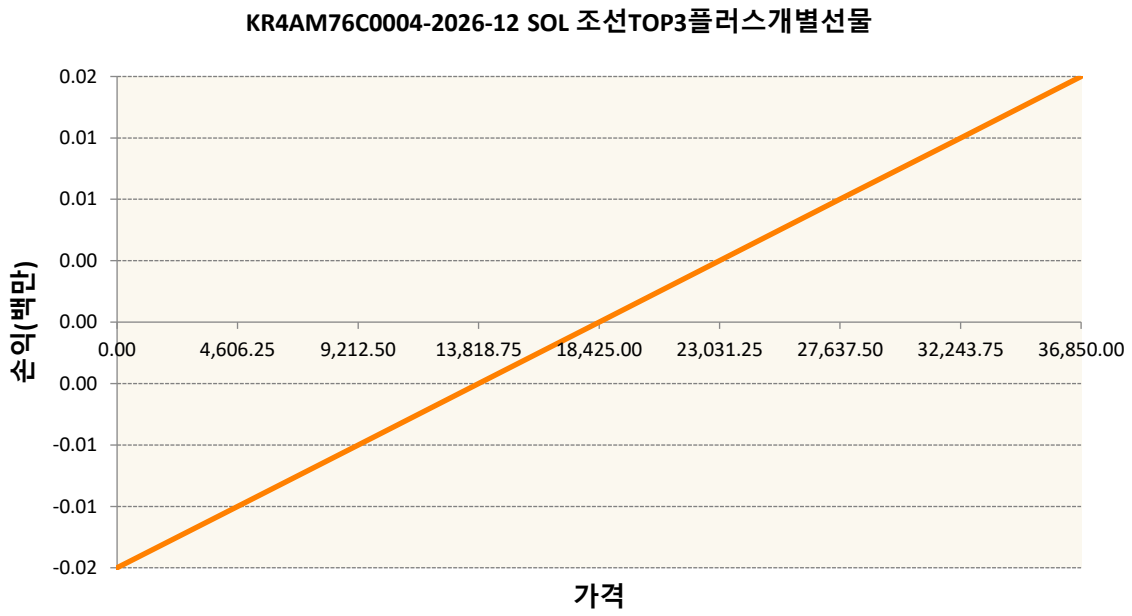
SOL조선TOP3플러스레버리지상장지수(주식)

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						4,060
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-4,060	-4,060	-4,060	-4,060	-4,060	-4,060	-4,060
-5.33%	-2,707	-2,707	-2,707	-2,707	-2,707	-2,707	-2,707
-2.67%	-1,353	-1,353	-1,353	-1,353	-1,353	-1,353	-1,353
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	1,353	1,353	1,353	1,353	1,353	1,353	1,353
5.33%	2,707	2,707	2,707	2,707	2,707	2,707	2,707
8.00%	4,060	4,060	4,060	4,060	4,060	4,060	4,060

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

7,017

공시일	2026-11-16
기준일	2026-11-13

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	2026-11-16
기준일	2026-11-13

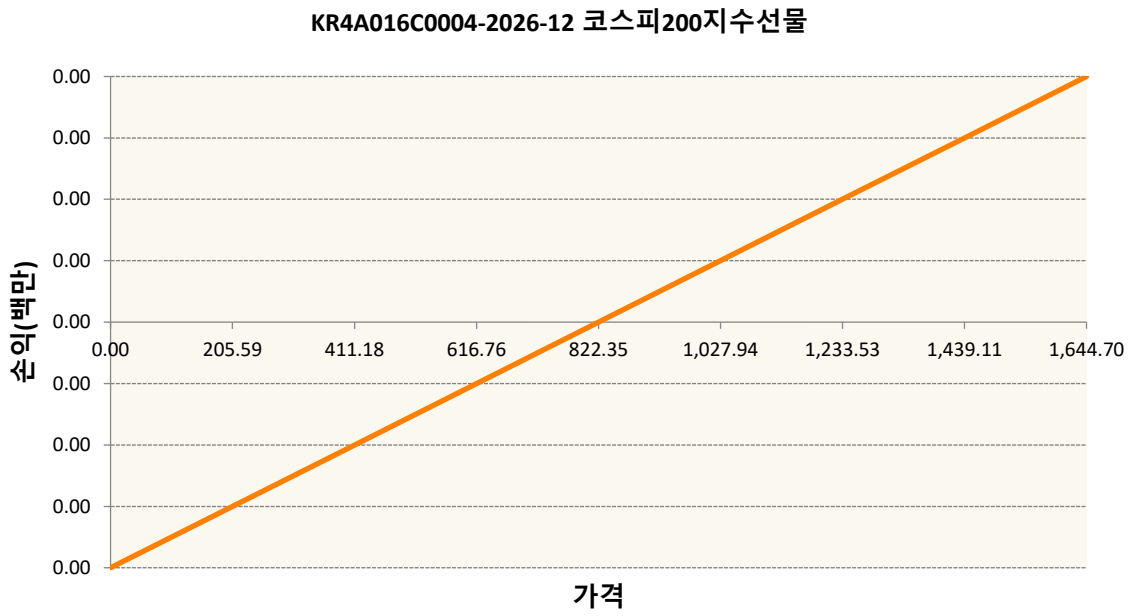
SOL 200타겟위클리커버드콜상장지수(주식)

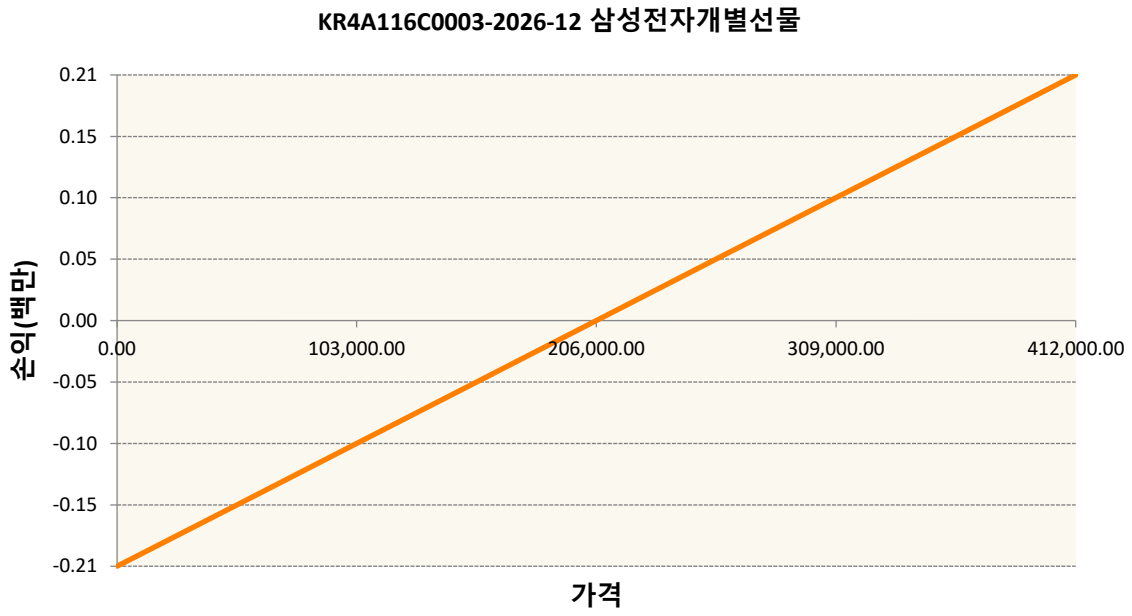
1. 계약금액

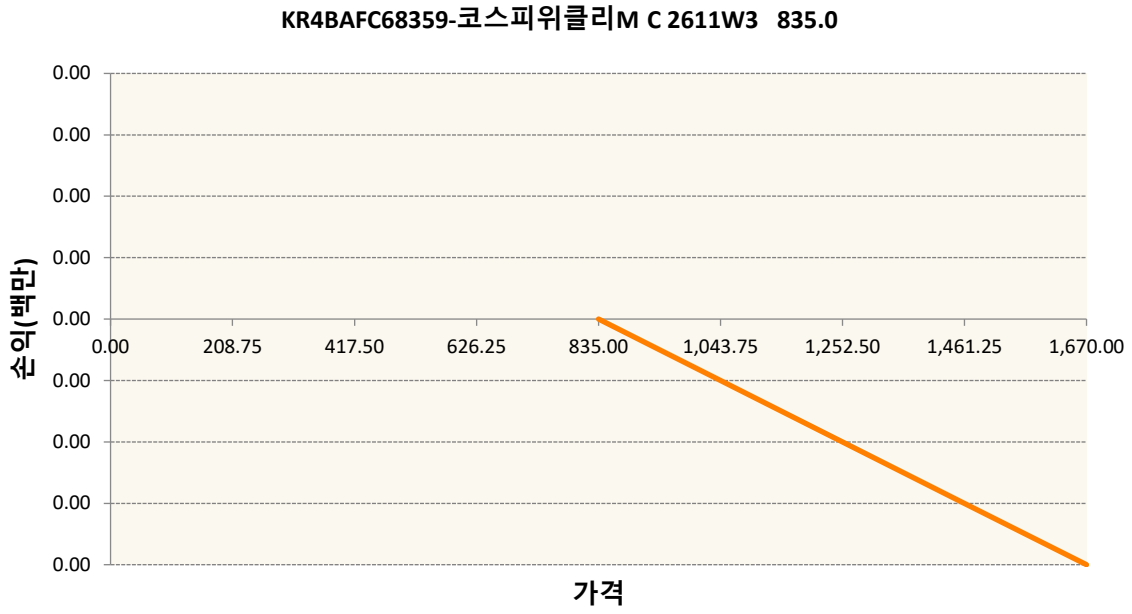
(단위:백만원)

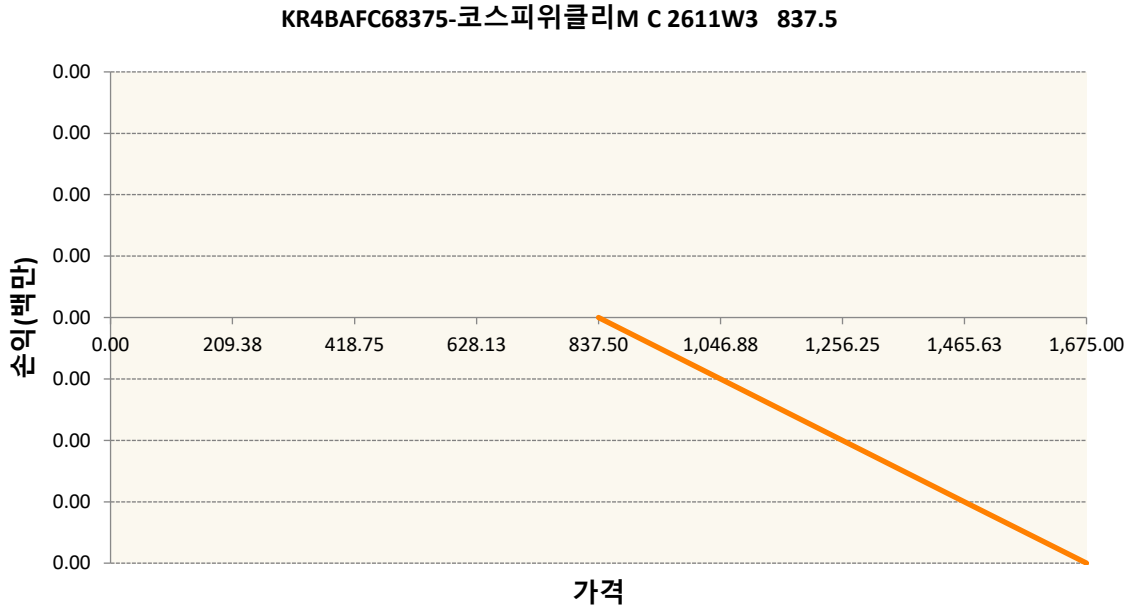
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	16,469	0	16,469	장내
누계	유가증권	옵션	0	41,800	-41,800	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

	KR4A016C0004	2026-12 코스피200지수선물					429
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-429	-429	-429	-429	-429	-429	-429
-5.33%	-286	-286	-286	-286	-286	-286	-286
-2.67%	-143	-143	-143	-143	-143	-143	-143
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	143	143	143	143	143	143	143
5.33%	286	286	286	286	286	286	286
8.00%	429	429	429	429	429	429	429
	KR4A116C0003	2026-12 삼성전자개별선물					890
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-890	-890	-890	-890	-890	-890	-890
-5.33%	-593	-593	-593	-593	-593	-593	-593
-2.67%	-297	-297	-297	-297	-297	-297	-297
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	297	297	297	297	297	297	297
5.33%	593	593	593	593	593	593	593
8.00%	890	890	890	890	890	890	890
	KR4BAFC68359		코스피위클리M C 2611W3	835.0			1,448
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	333	331	329	325	319	311	302
-5.33%	324	316	306	293	278	261	242
-2.67%	274	252	228	201	173	143	113
0%	112	75	38	0	-38	-76	-114
2.67%	-230	-267	-304	-342	-380	-418	-457
5.33%	-742	-765	-790	-818	-847	-877	-909
8.00%	-1,355	-1,364	-1,376	-1,390	-1,408	-1,427	-1,448
	KR4BAFC68375		코스피위클리M C 2611W3	837.5			942
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	203	202	201	199	195	191	185
-5.33%	198	194	188	180	171	160	148
-2.67%	170	157	141	125	107	88	68
0%	73	49	25	0	-25	-50	-75
2.67%	-140	-166	-191	-217	-243	-269	-295
5.33%	-471	-488	-506	-525	-545	-566	-588
8.00%	-874	-881	-890	-901	-913	-927	-942

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

8,977

공시일	2026-11-16
기준일	2026-11-13

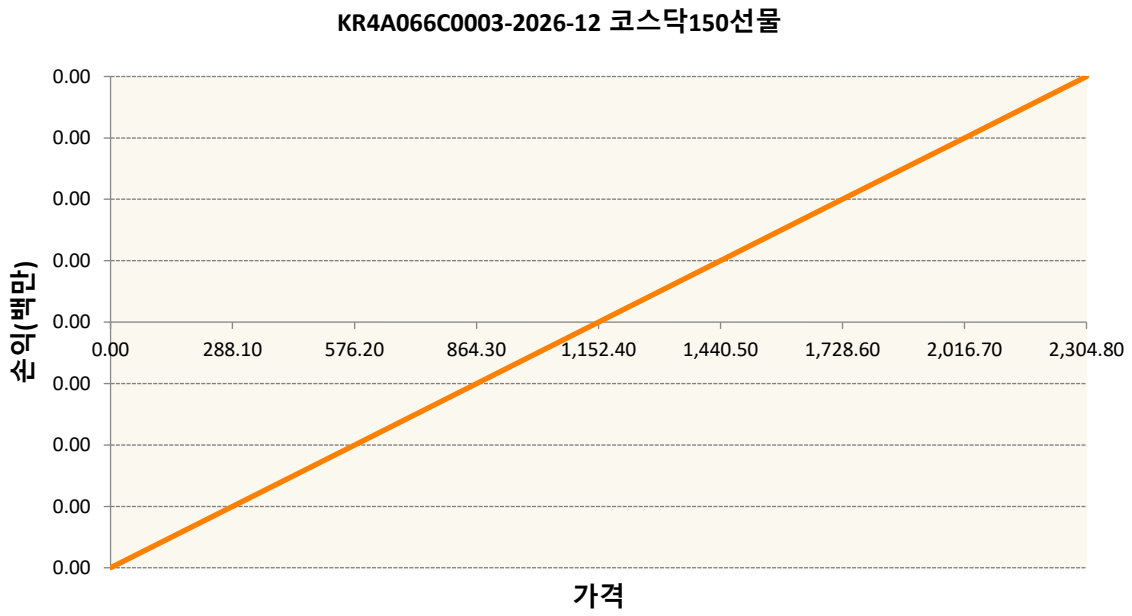
SOL코스닥150인덱스(주식-파생형)

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	461	0	461	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)

125

공시일	2026-11-16
기준일	2026-11-13

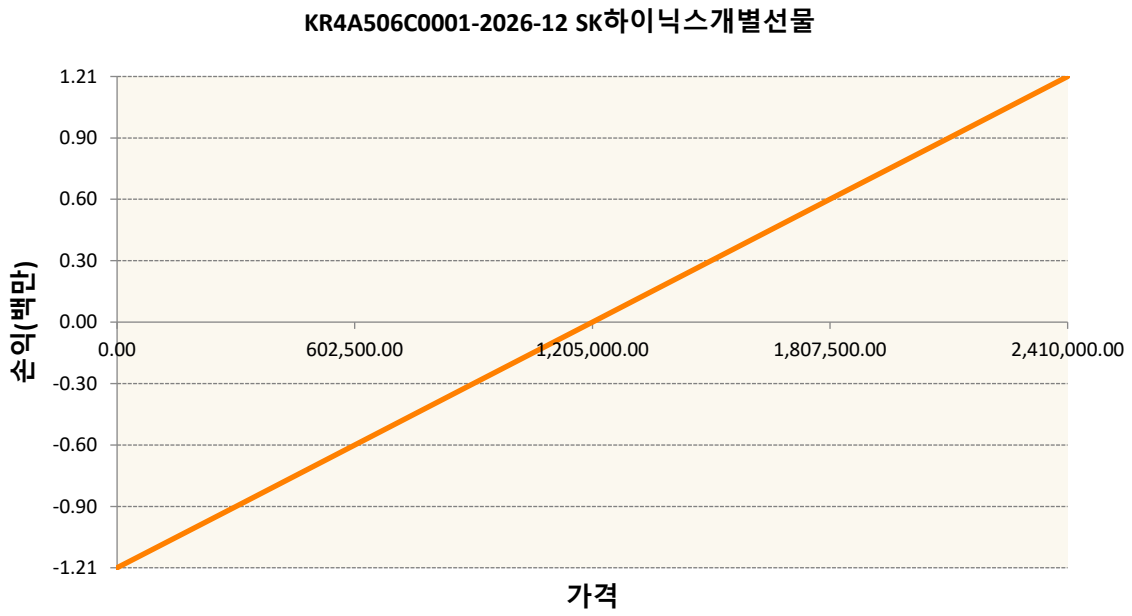
SOLSK하이닉스단일종목레버리지상장지수

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	409	601	-191	장내
누계	유가증권	선물	19,883	0	19,883	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A506C0001 2026-12 SK하이닉스개별선물 1,605

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,605	-1,605	-1,605	-1,605	-1,605	-1,605	-1,605
-5.33%	-1,070	-1,070	-1,070	-1,070	-1,070	-1,070	-1,070
-2.67%	-535	-535	-535	-535	-535	-535	-535
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	535	535	535	535	535	535	535
5.33%	1,070	1,070	1,070	1,070	1,070	1,070	1,070
8.00%	1,605	1,605	1,605	1,605	1,605	1,605	1,605

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

8,041

공시일	2026-11-16
기준일	2026-11-13

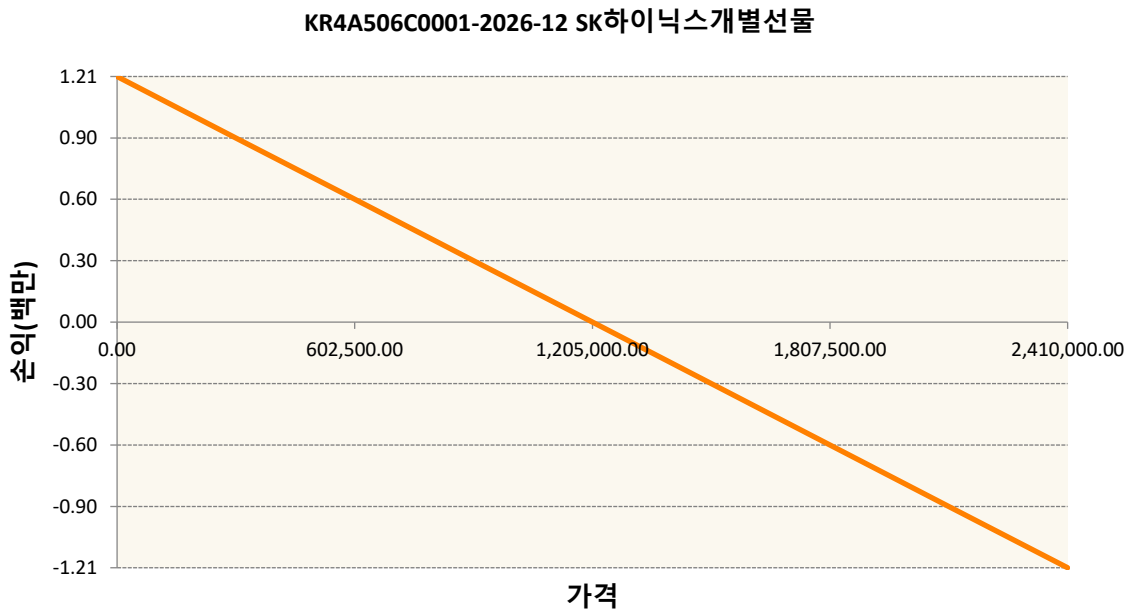
SOLSK하이닉스선물단일종목인버스2X상장지

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	1,674	22,054	-20,380	장내
누계	유가증권	선물	0	144,335	-144,335	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A506C0001	2026-12 SK하이닉스개별선물						11,652
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	11,652	11,652	11,652	11,652	11,652	11,652	11,652
-5.33%	7,768	7,768	7,768	7,768	7,768	7,768	7,768
-2.67%	3,884	3,884	3,884	3,884	3,884	3,884	3,884
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-3,884	-3,884	-3,884	-3,884	-3,884	-3,884	-3,884
5.33%	-7,768	-7,768	-7,768	-7,768	-7,768	-7,768	-7,768
8.00%	-11,652	-11,652	-11,652	-11,652	-11,652	-11,652	-11,652

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

58,371

공시일	2026-11-16
기준일	2026-11-13

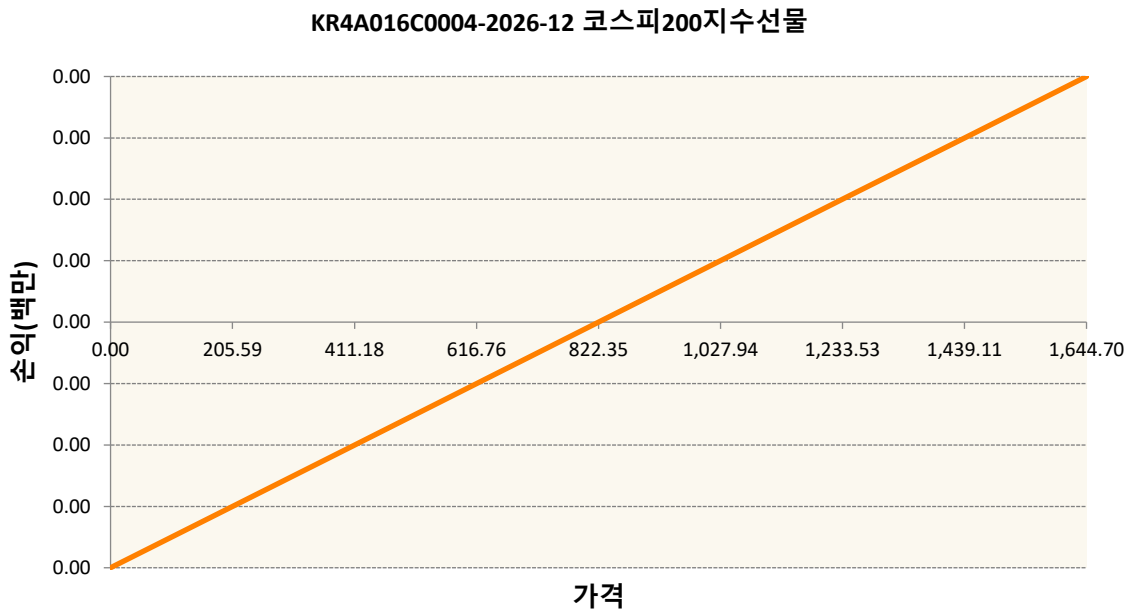
SOL200커버드콜액티브상장지수(주식-파생형

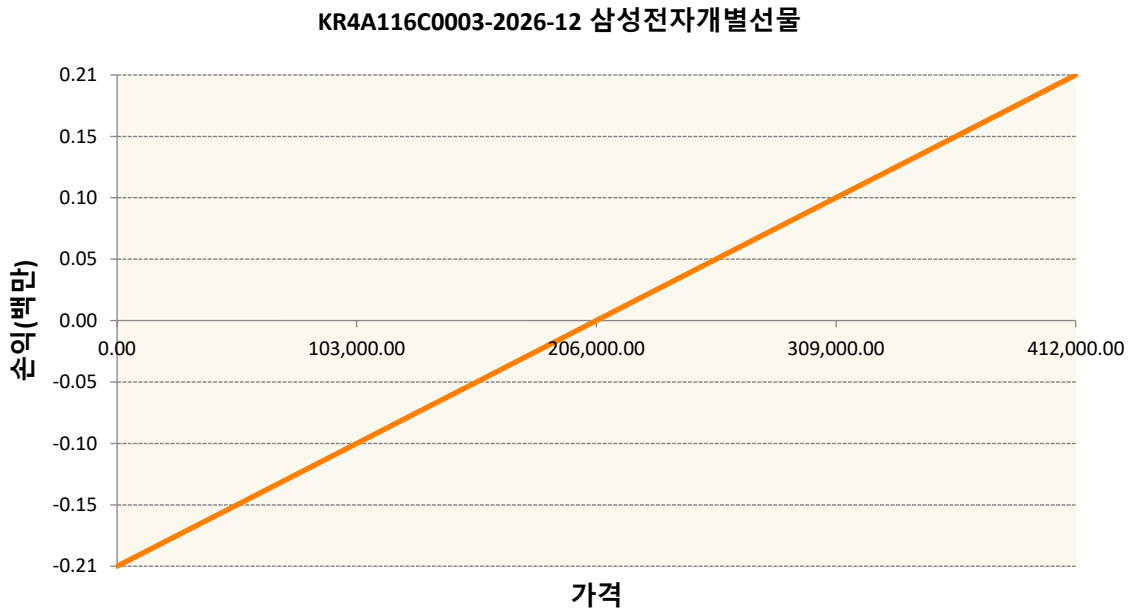
1. 계약금액

(단위:백만원)

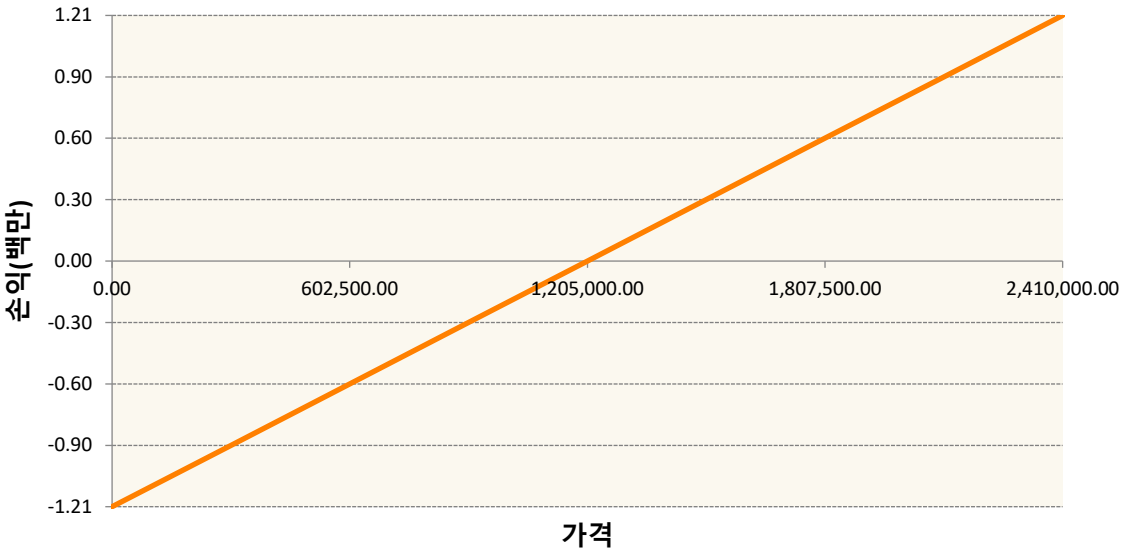
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,257	0	3,257	장내
누계	유가증권	옵션	0	4,180	-4,180	장내

2. 만기시점의 손익구조

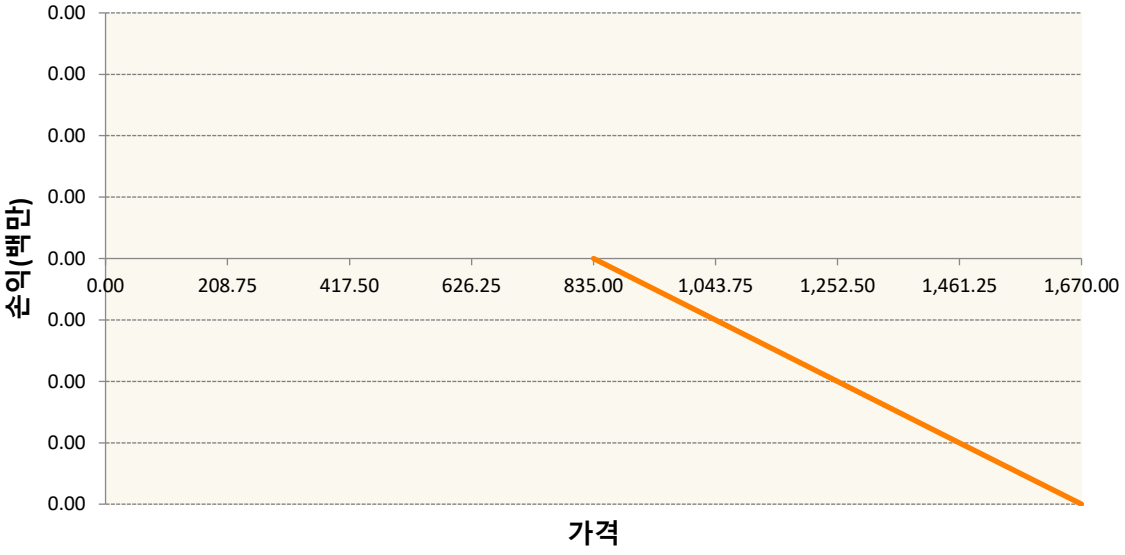




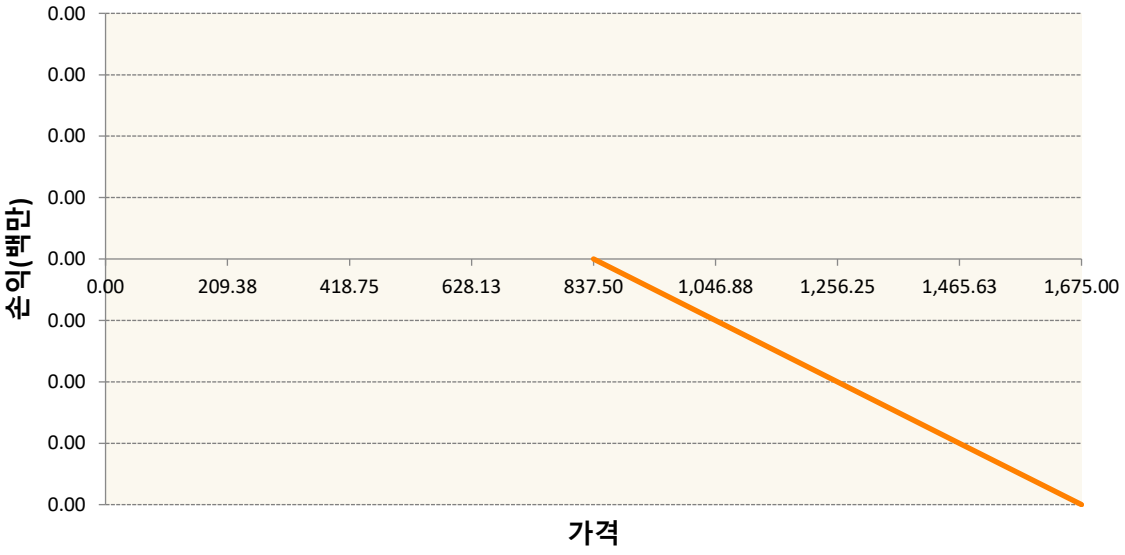
KR4A506C0001-2026-12 SK하이닉스개별선물



KR4BAFC68359-코스피위클리M C 2611W3 835.0



KR4BAFC68375-코스피위클리M C 2611W3 837.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4A016C0004	2026-12 코스피200지수선물						132
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-132	-132	-132	-132	-132	-132	-132
-5.33%	-88	-88	-88	-88	-88	-88	-88
-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%	88	88	88	88	88	88	88
8.00%	132	132	132	132	132	132	132

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						104
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-104	-104	-104	-104	-104	-104	-104
-5.33%	-69	-69	-69	-69	-69	-69	-69
-2.67%	-35	-35	-35	-35	-35	-35	-35
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	35	35	35	35	35	35	35
5.33%	69	69	69	69	69	69	69
8.00%	104	104	104	104	104	104	104

KR4BAFC68359	코스피위클리M C 2611W3 835.0						145
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	33	33	33	32	32	31	30
-5.33%	32	32	31	29	28	26	24
-2.67%	27	25	23	20	17	14	11
0%	11	8	4	0	-4	-8	-11
2.67%	-23	-27	-30	-34	-38	-42	-46
5.33%	-74	-77	-79	-82	-85	-88	-91
8.00%	-135	-136	-138	-139	-141	-143	-145

KR4BAFC68375	코스피위클리M C 2611W3 837.5						94
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	20	20	20	20	20	19	18
-5.33%	20	19	19	18	17	16	15
-2.67%	17	16	14	12	11	9	7
0%	7	5	2	0	-2	-5	-8
2.67%	-14	-17	-19	-22	-24	-27	-29
5.33%	-47	-49	-51	-52	-55	-57	-59
8.00%	-87	-88	-89	-90	-91	-93	-94

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

1,469

공시일	2026-11-16
기준일	2026-11-13

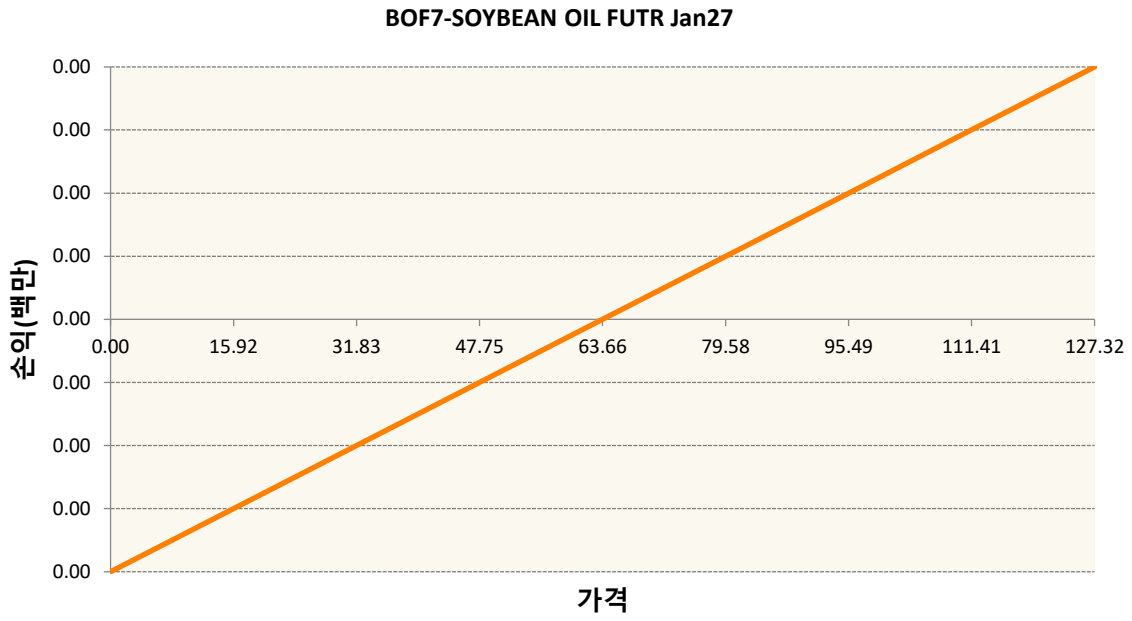
포커스농산물모(채권-파생형)

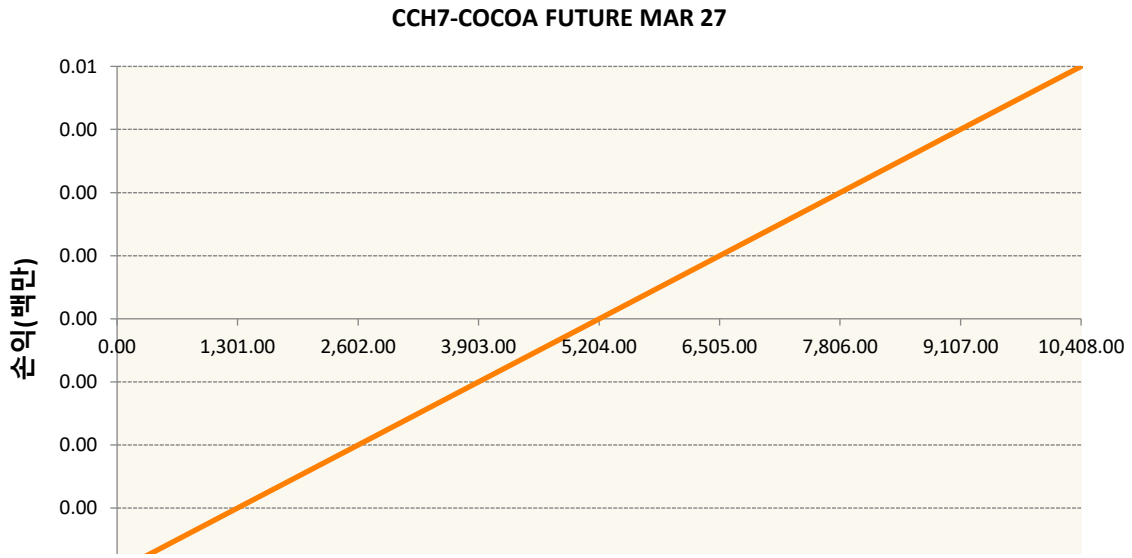
1. 계약금액

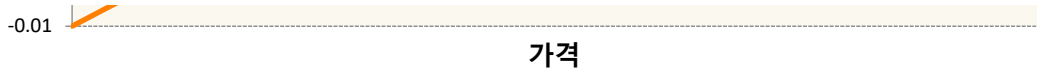
(단위:USD 백만)

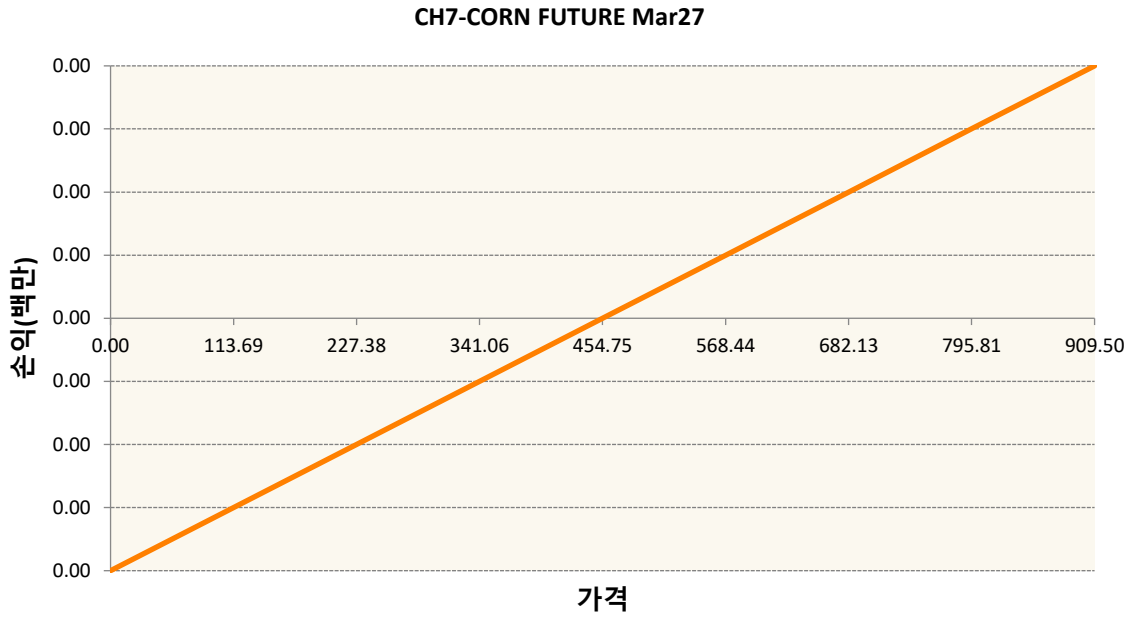
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	실물자산	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	실물자산	선물	326	0	326	
누계	유가증권	선물	1,978	0	1,978	
누계	통화	선물	0	53	-53	장내

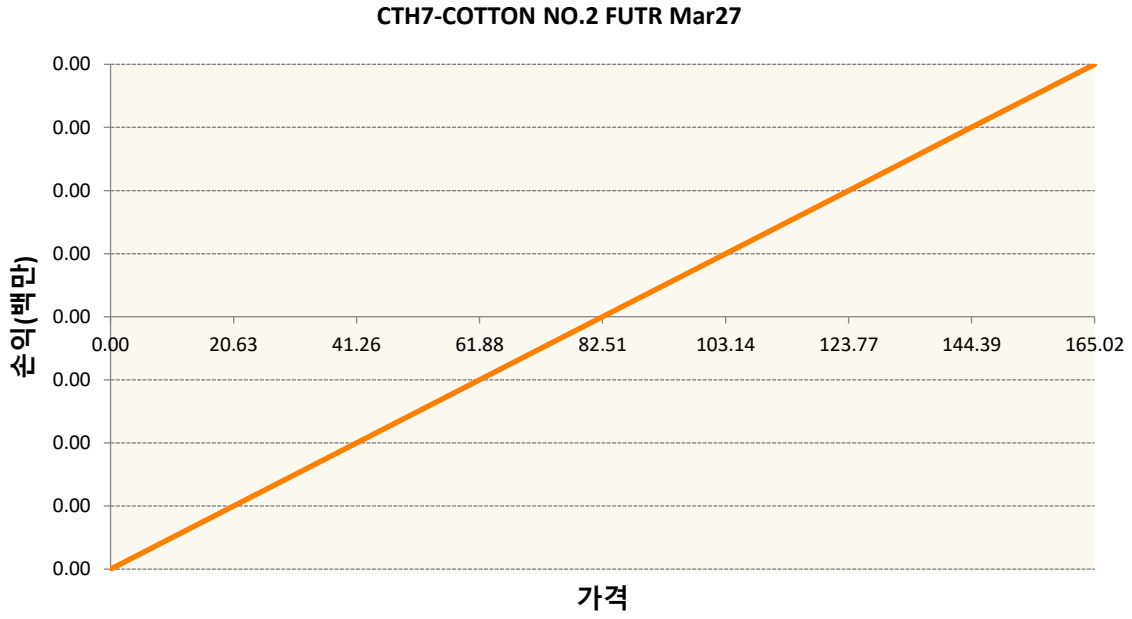
2. 만기시점의 손익구조

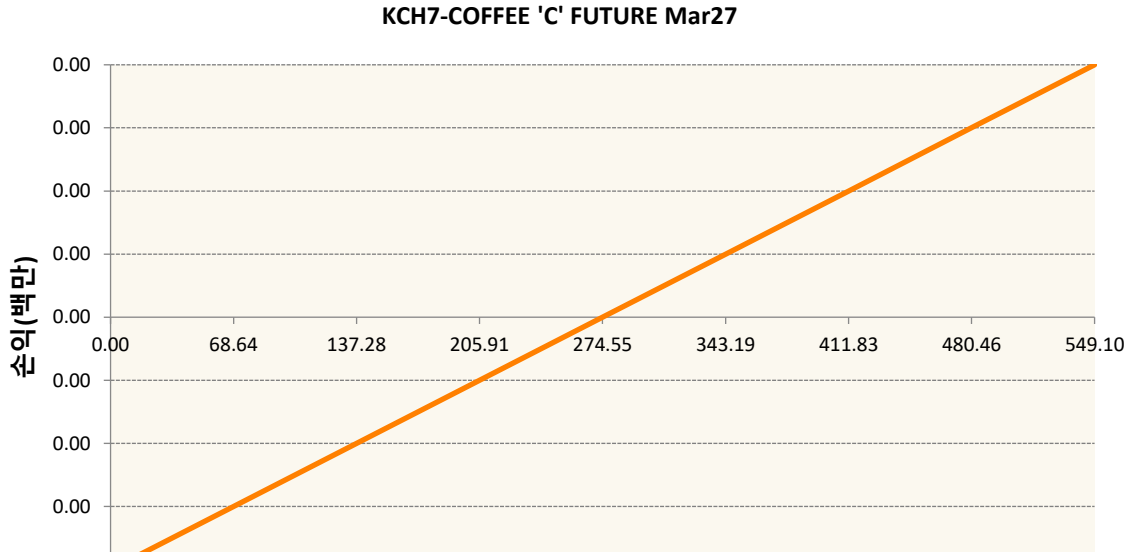


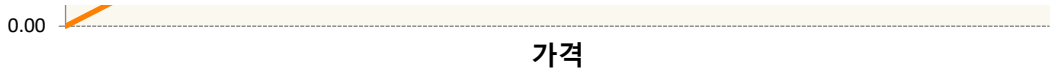


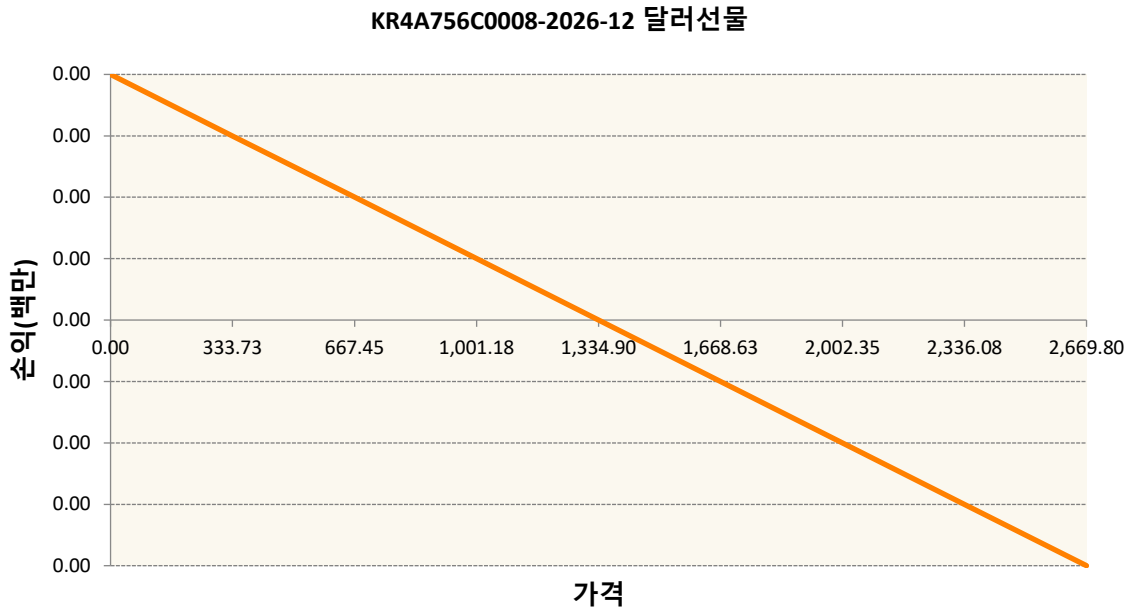

-0.01
가격

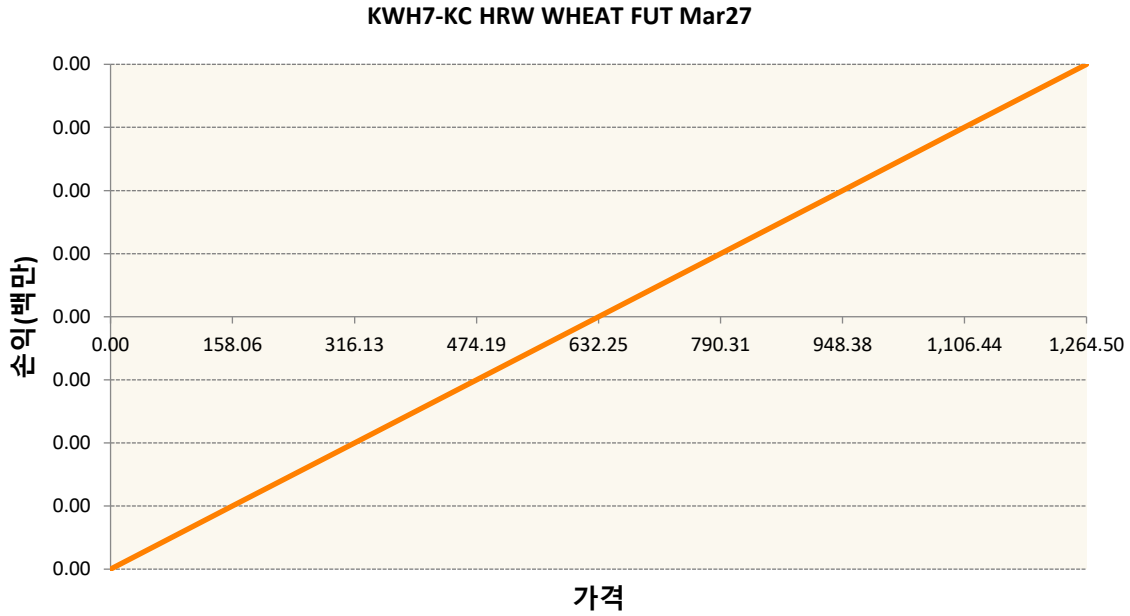

CH7-CORN FUTURE Mar27
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
113.69
227.38
341.06
454.75
568.44
682.13
795.81
909.50
손익(백만)
가격

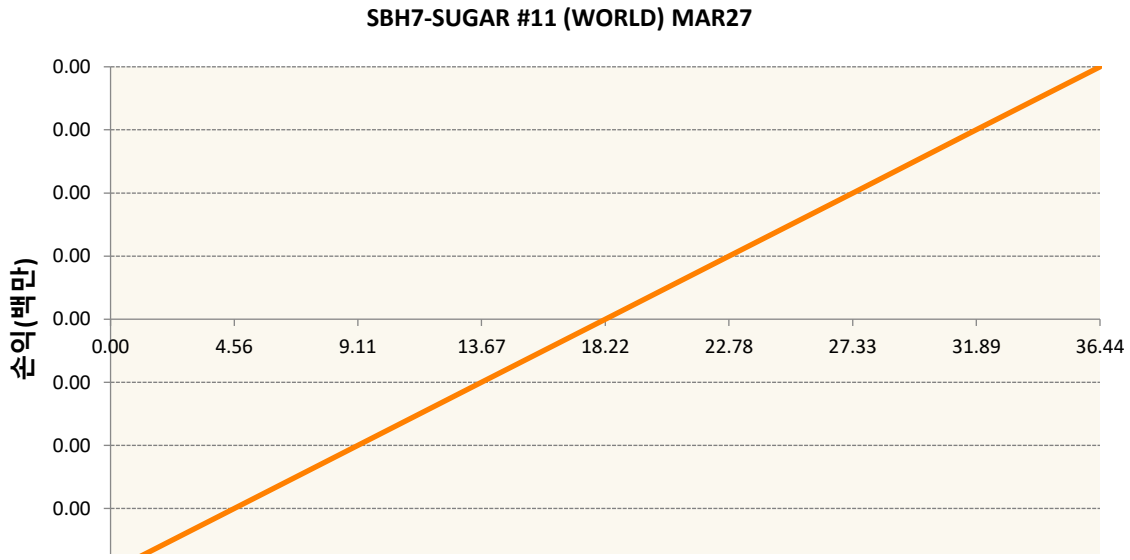

CTH7-COTTON NO.2 FUTR Mar27
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
20.63
41.26
61.88
82.51
103.14
123.77
144.39
165.02
손익(백만)
가격

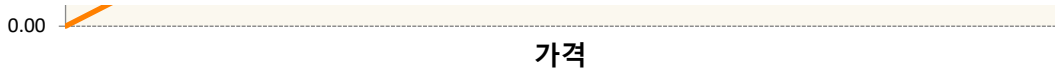

KCH7-COFFEE 'C' FUTURE Mar27
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
68.64
137.28
205.91
274.55
343.19
411.83
480.46
549.10
손익(백만)

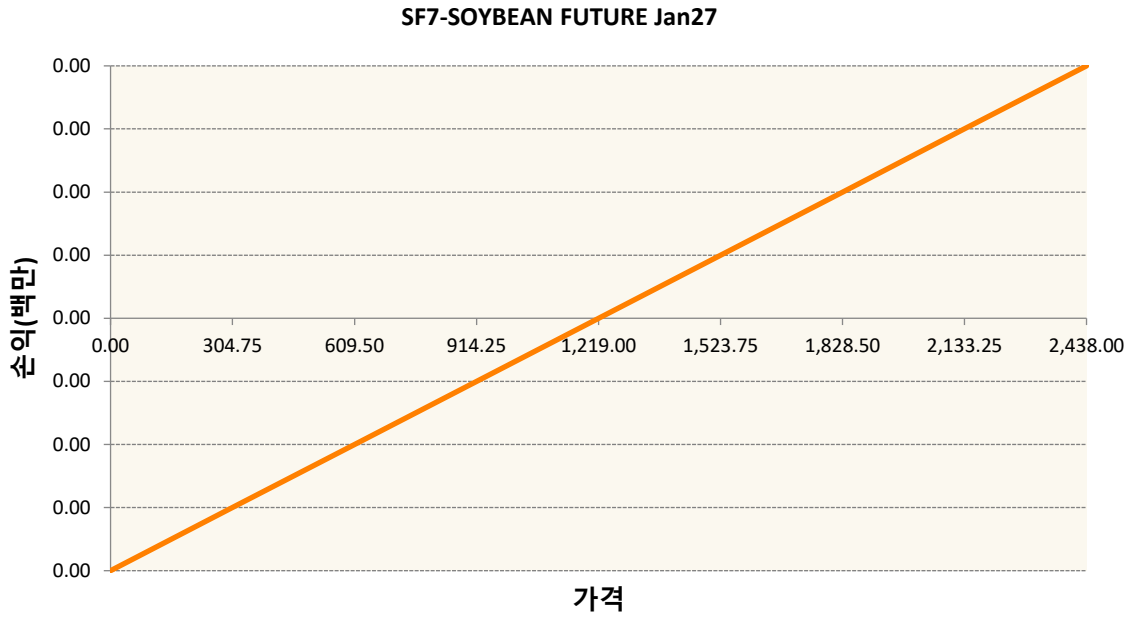

0.00
가격

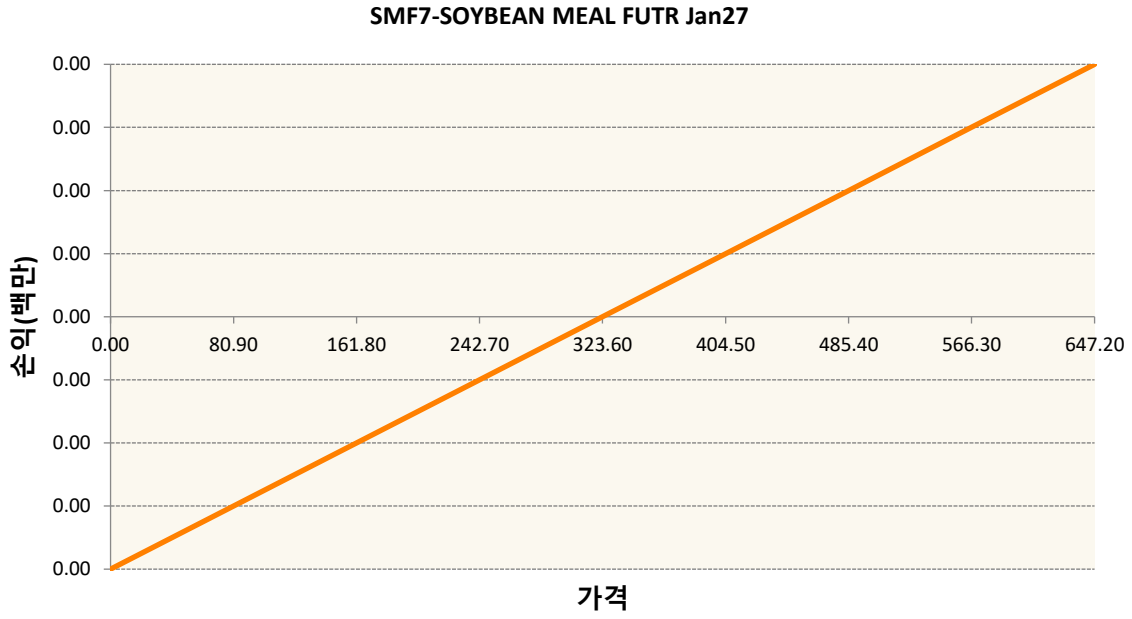

KR4A756C0008-2026-12 달러선물
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
333.73
667.45
1,001.18
1,334.90
1,668.63
2,002.35
2,336.08
2,669.80
손익(백만)
가격

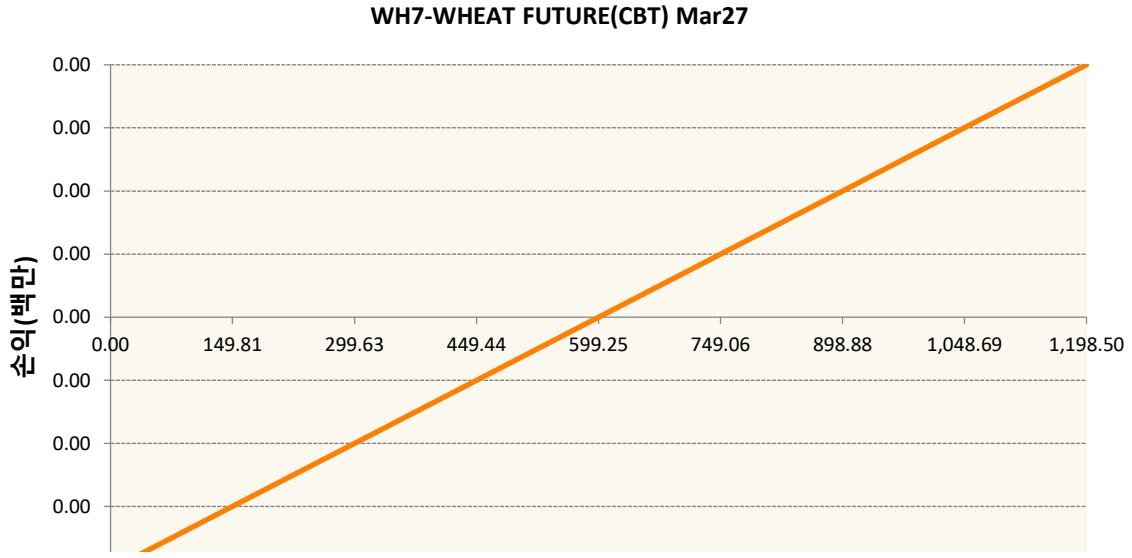

KWH7-KC HRW WHEAT FUT Mar27
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
158.06
316.13
474.19
632.25
790.31
948.38
1,106.44
1,264.50
손익(백만)
가격


SBH7-SUGAR #11 (WORLD) MAR27
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
4.56
9.11
13.67
18.22
22.78
27.33
31.89
36.44
손익(백만)


0.00
가격


SF7-SOYBEAN FUTURE Jan27
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
304.75
609.50
914.25
1,219.00
1,523.75
1,828.50
2,133.25
2,438.00
손익(백만)
가격


SMF7-SOYBEAN MEAL FUTR Jan27
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
80.90
161.80
242.70
323.60
404.50
485.40
566.30
647.20
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
149.81
299.63
449.44
599.25
749.06
898.88
1,048.69
1,198.50
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	2026-11-16
기준일	2026-11-13

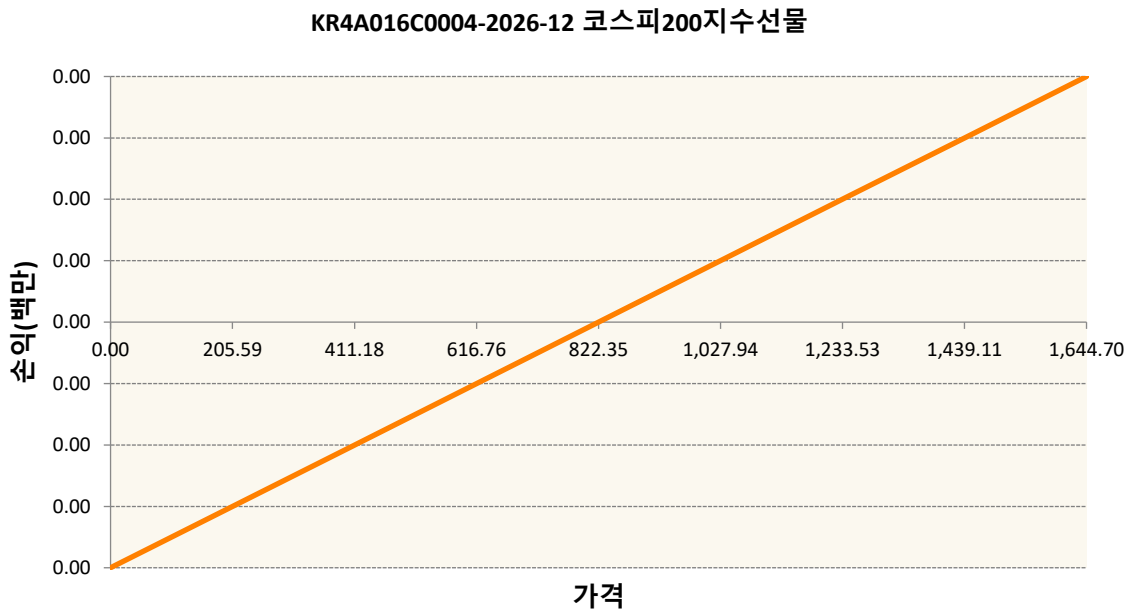
스마트인덱스모

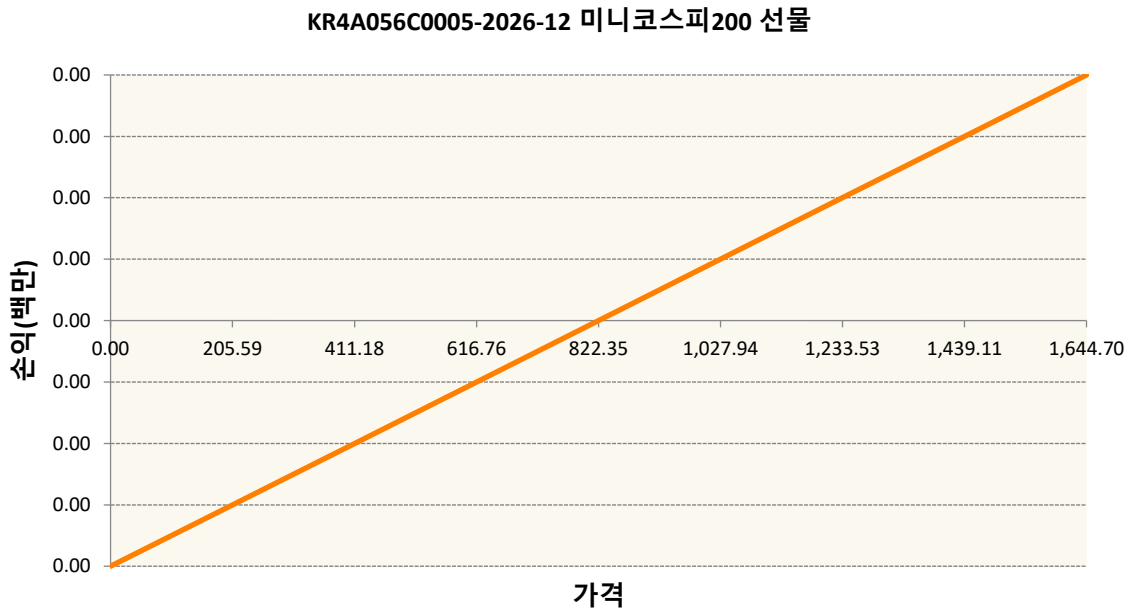
1. 계약금액

(단위:백만원)

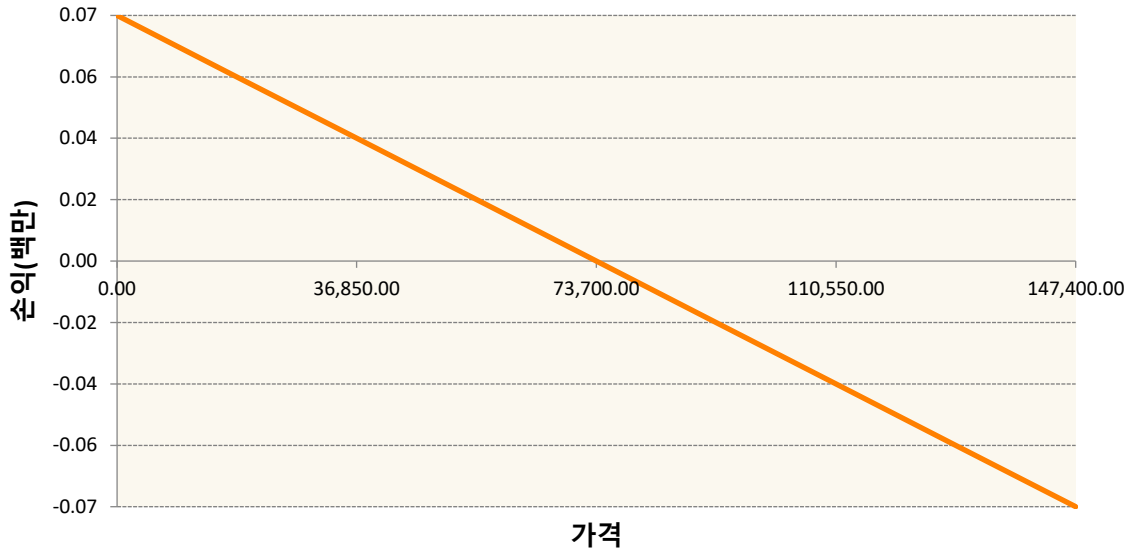
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	626	970	-344	장내
누계	유가증권	선물	9,247	343	8,905	장내

2. 만기시점의 손익구조

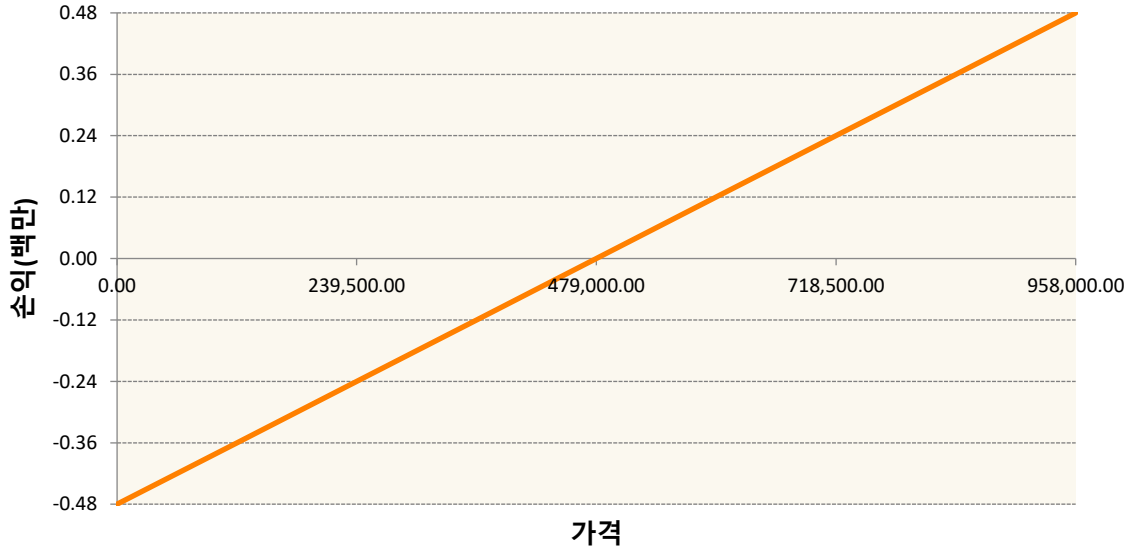




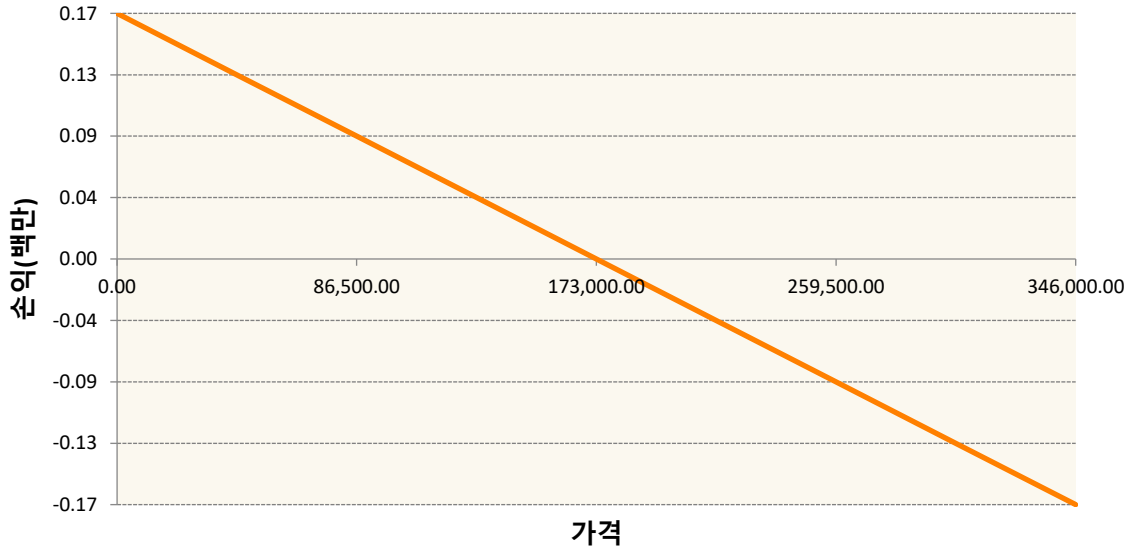
KR4A176C0000-2026-12 삼성증권개별선물

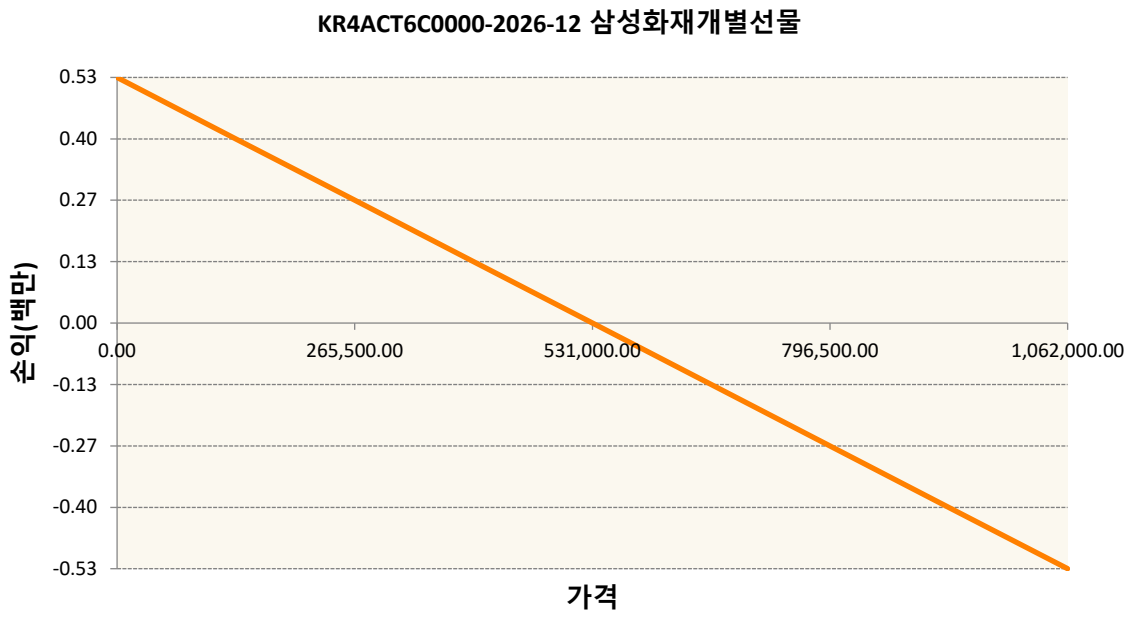


KR4A226C0000-2026-12 삼성SDI개별선물



KR4A566C0008-2026-12 NAVER개별선물





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

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%	-35	-35	-35	-35	-35	-35	-35
-2.67%	-18	-18	-18	-18	-18	-18	-18
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	18	18	18	18	18	18	18
5.33%	35	35	35	35	35	35	35
8.00%	53	53	53	53	53	53	53

KR4A176C0000	2026-12 삼성증권개별선물						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
	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

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

1,889

공시일	2026-11-16
기준일	2026-11-13

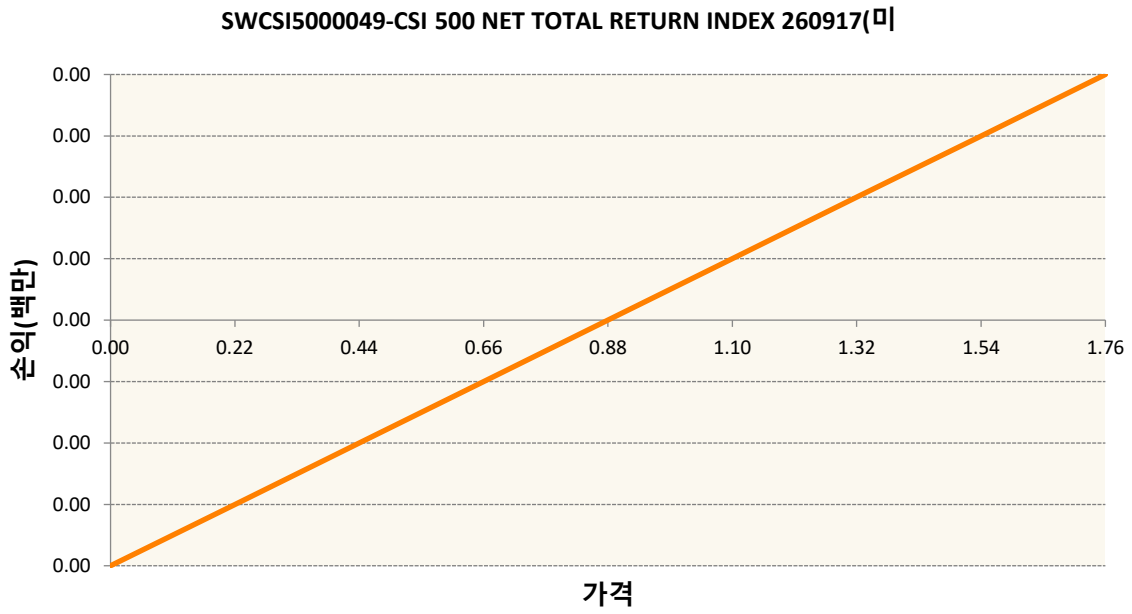
SOL차이나강소기업CSI500상장

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	4,682	0	4,682	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 CSI 500 NET TOTAL RETURN INDEX 260917(미	377

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

623

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2026-11-16
기준일	2026-11-13

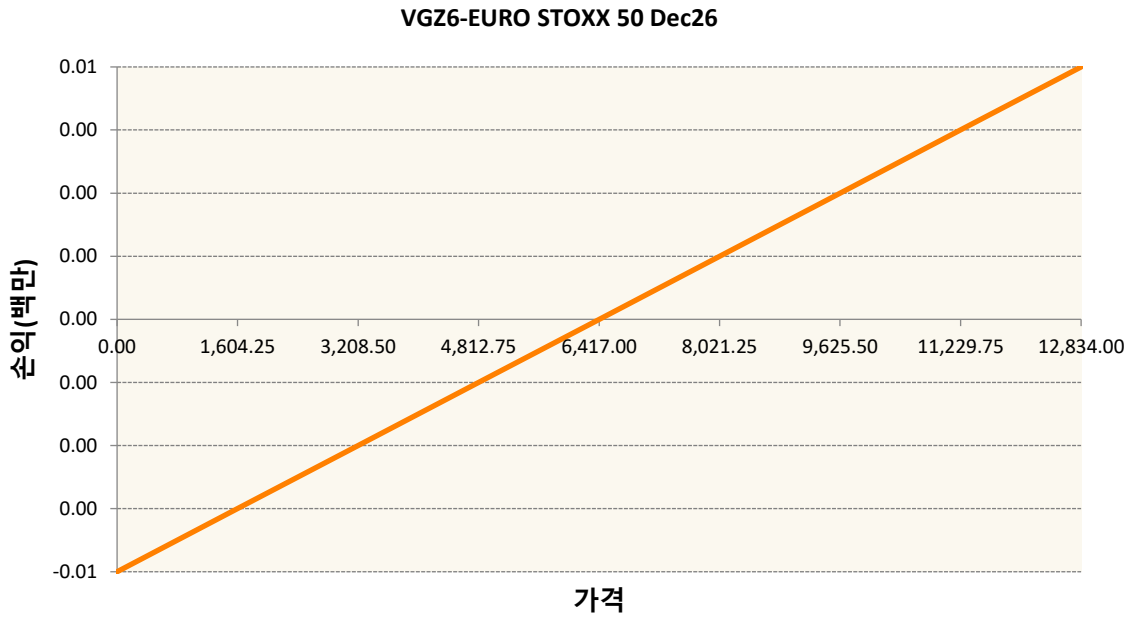
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,114	0	1,114	

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	2026-11-16
기준일	2026-11-13

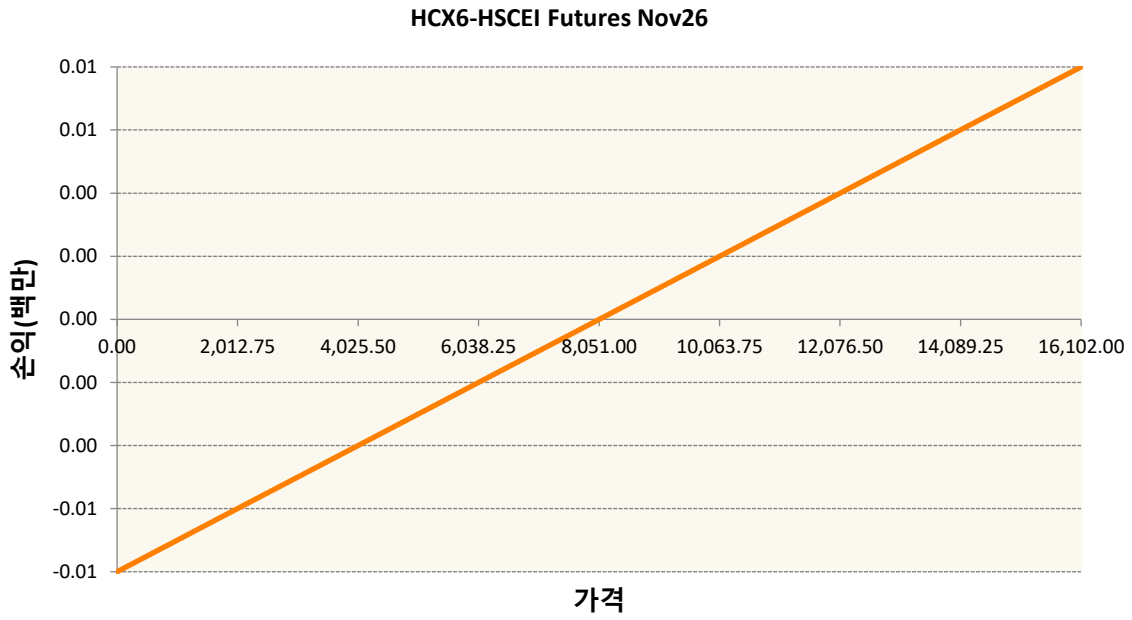
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,167	0	1,167	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCX6	HSCEI Futures Nov26	93

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

(단위:백만원)

89

공시일	2026-11-16
기준일	2026-11-13

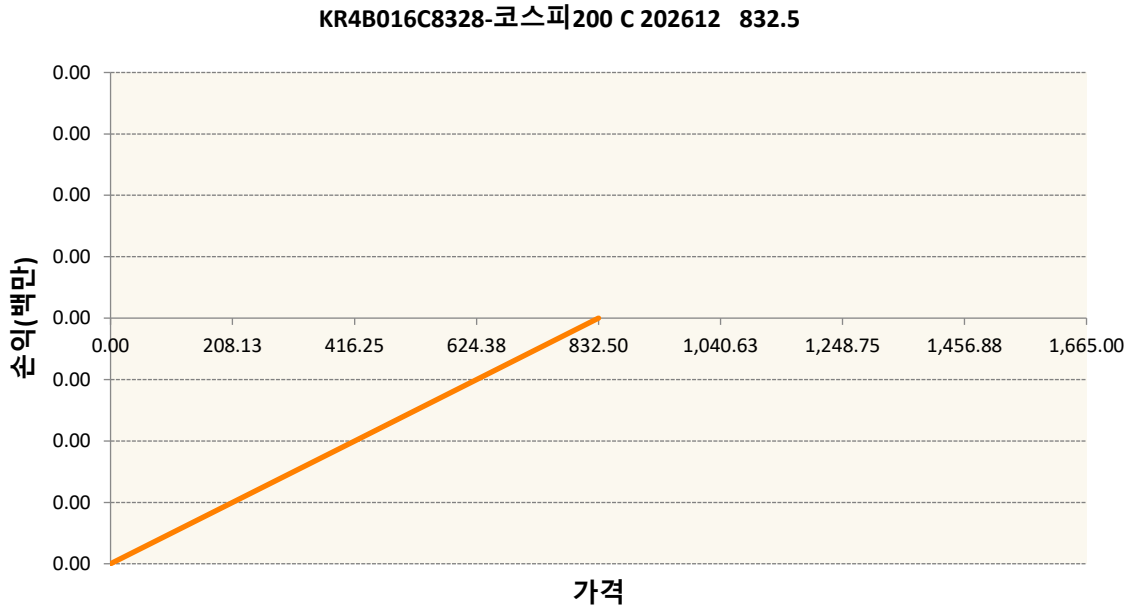
커버드콜모(주식혼합-파생형)

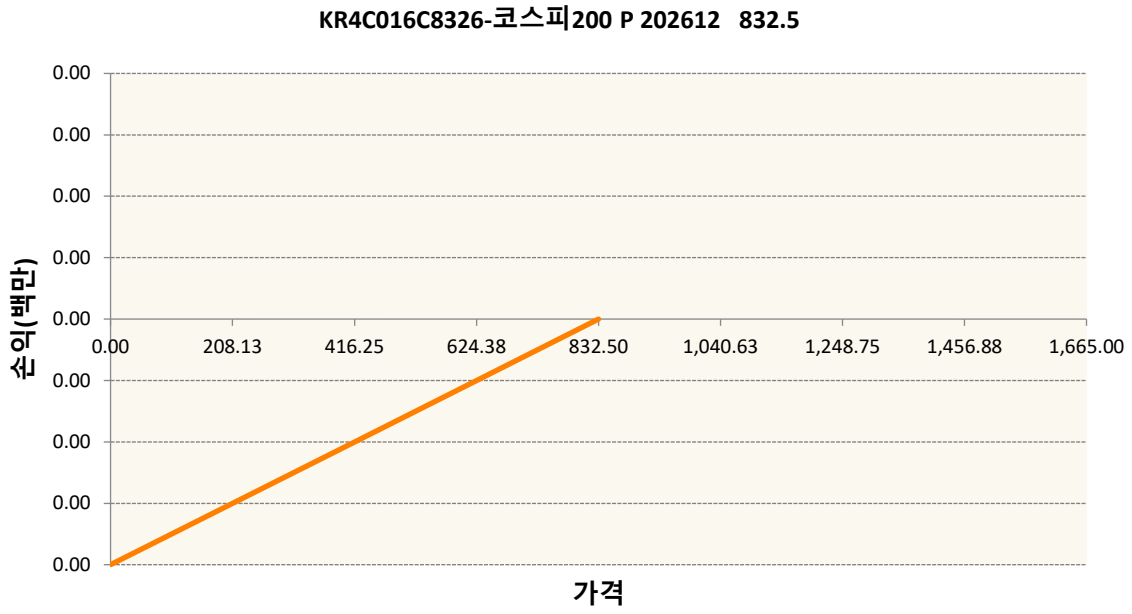
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	43,816	-43,816	장내
누계	유가증권	옵션	0	41,679	-41,679	장내

2. 만기시점의 손익구조


KR4B016C8328-코스피200 C 202612 832.5
0.00
0.00
0.00



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4B016C8328	코스피200 C 202612 832.5						965
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-614	-666	-722	-780	-840	-902	-965
-5.33%	-294	-357	-422	-488	-556	-624	-693
-2.67%	-12	-83	-155	-228	-301	-374	-447
0%	227	152	76	0	-76	-152	-227
2.67%	424	348	272	196	120	43	-33
5.33%	580	508	435	361	287	212	136
8.00%	700	635	567	498	427	356	283
KR4B016C8351	코스피200 C 202612 835.0						1,073
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-691	-748	-808	-871	-937	-1,004	-1,073
-5.33%	-334	-403	-473	-546	-620	-695	-770
-2.67%	-19	-97	-176	-255	-335	-415	-496
0%	251	167	84	0	-84	-167	-251
2.67%	473	389	304	220	135	51	-34
5.33%	650	570	488	406	323	240	156
8.00%	787	714	638	561	482	402	321
KR4C016C8326	코스피200 P 202612 832.5						445
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-283	-308	-333	-360	-388	-416	-445
-5.33%	-135	-165	-195	-225	-256	-288	-320
-2.67%	-6	-39	-72	-105	-139	-172	-206
0%	105	70	35	0	-35	-70	-105

2.67%	196	161	126	90	55	20	-15
5.33%	268	235	201	167	132	98	63
8.00%	323	293	262	230	197	164	131

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

3,658

공시일	2026-11-16
기준일	2026-11-13

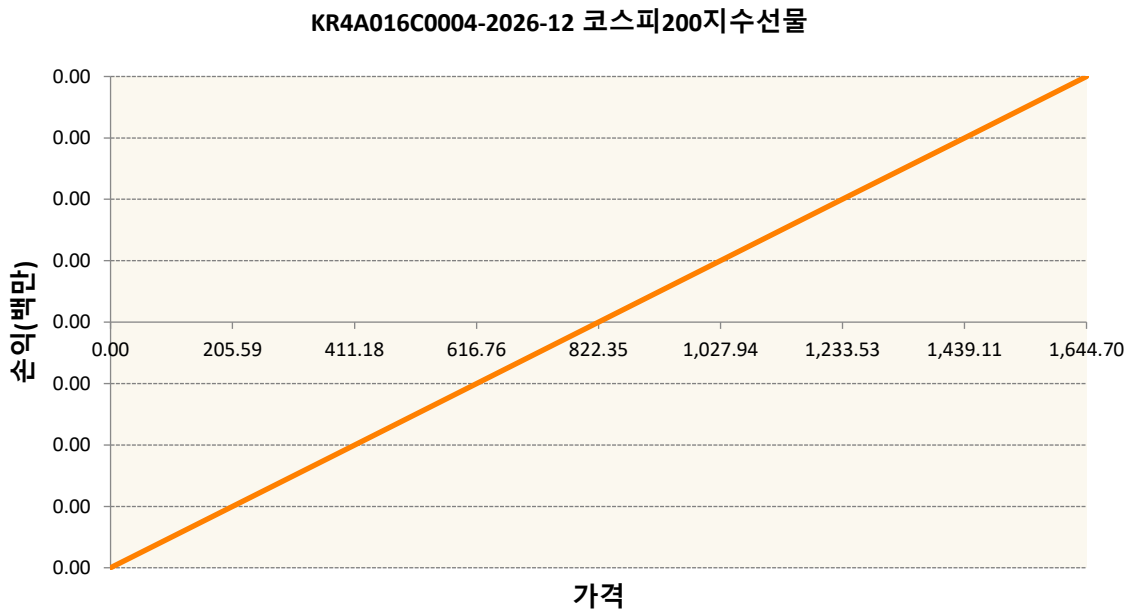
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

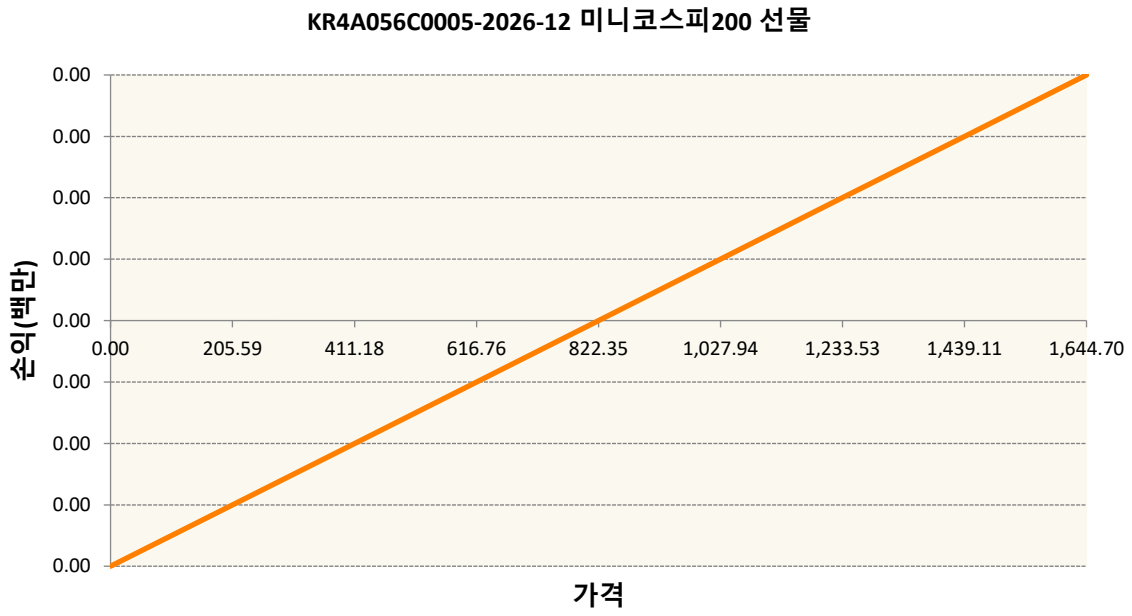
1. 계약금액

(단위:백만원)

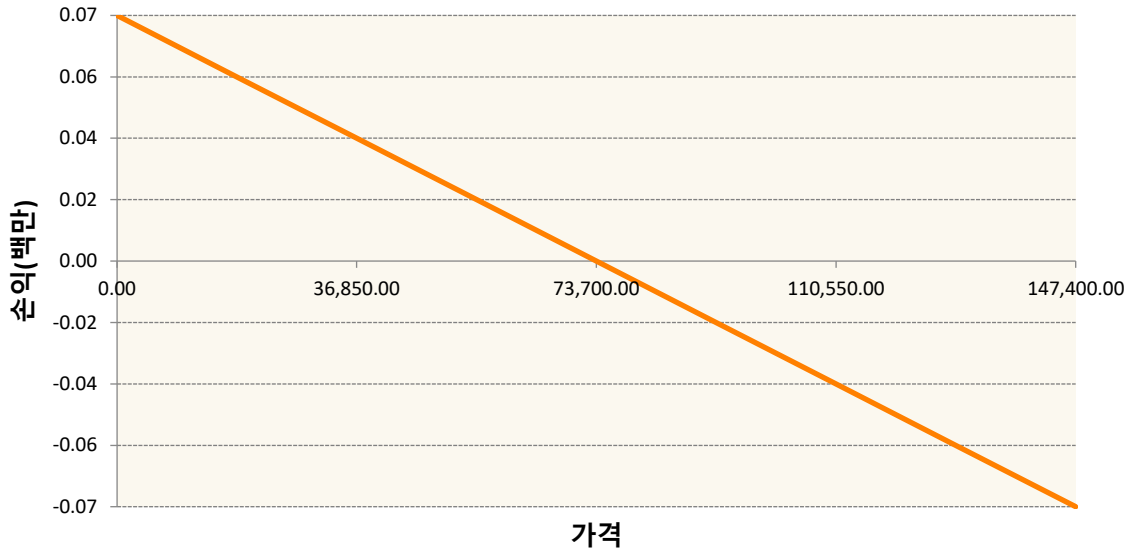
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	236	-236	장내
누계	유가증권	선물	2,094	66	2,028	장내

2. 만기시점의 손익구조

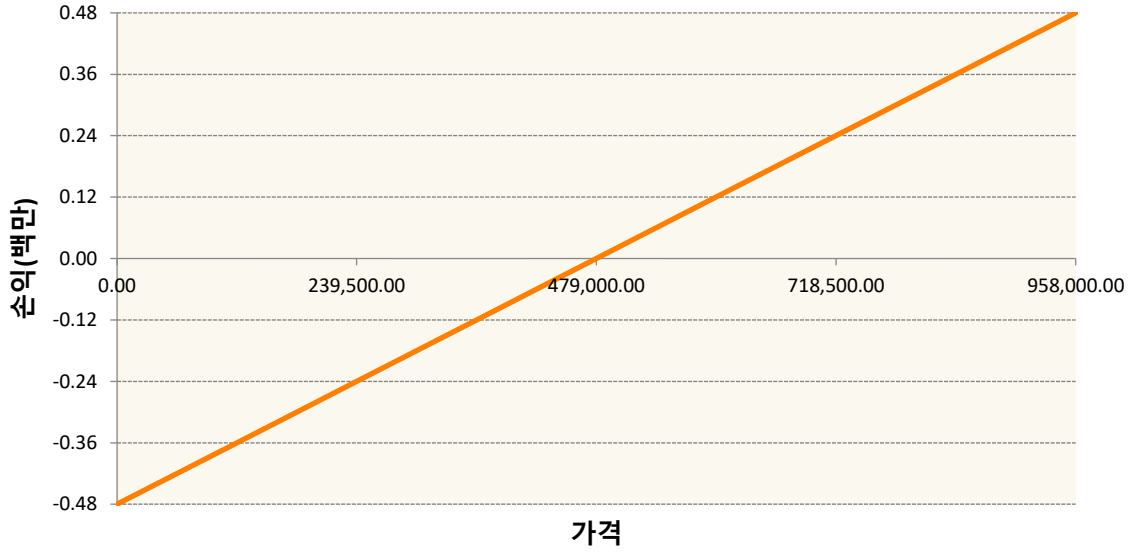




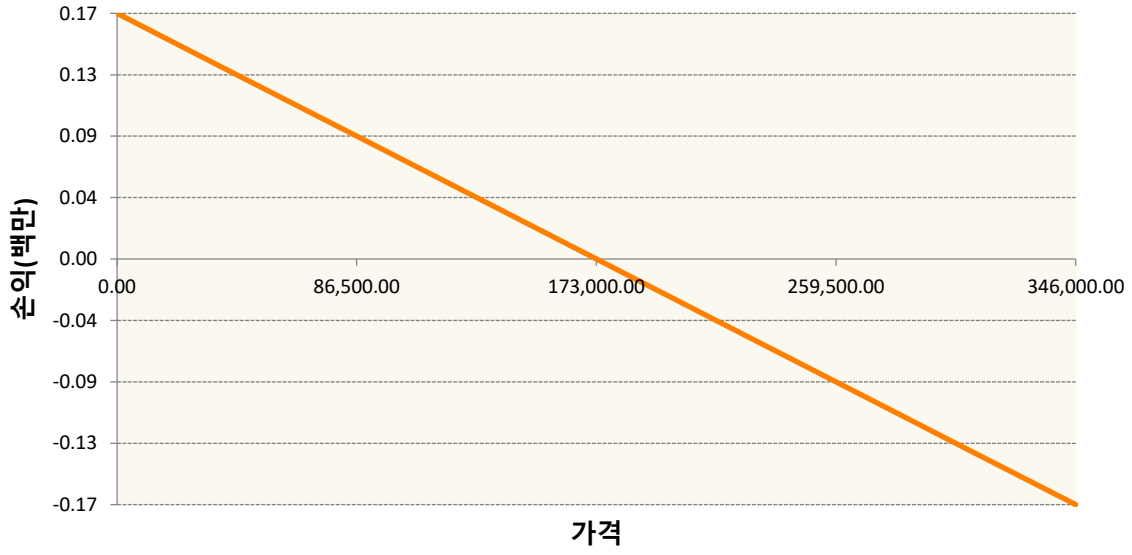
KR4A176C0000-2026-12 삼성증권개별선물

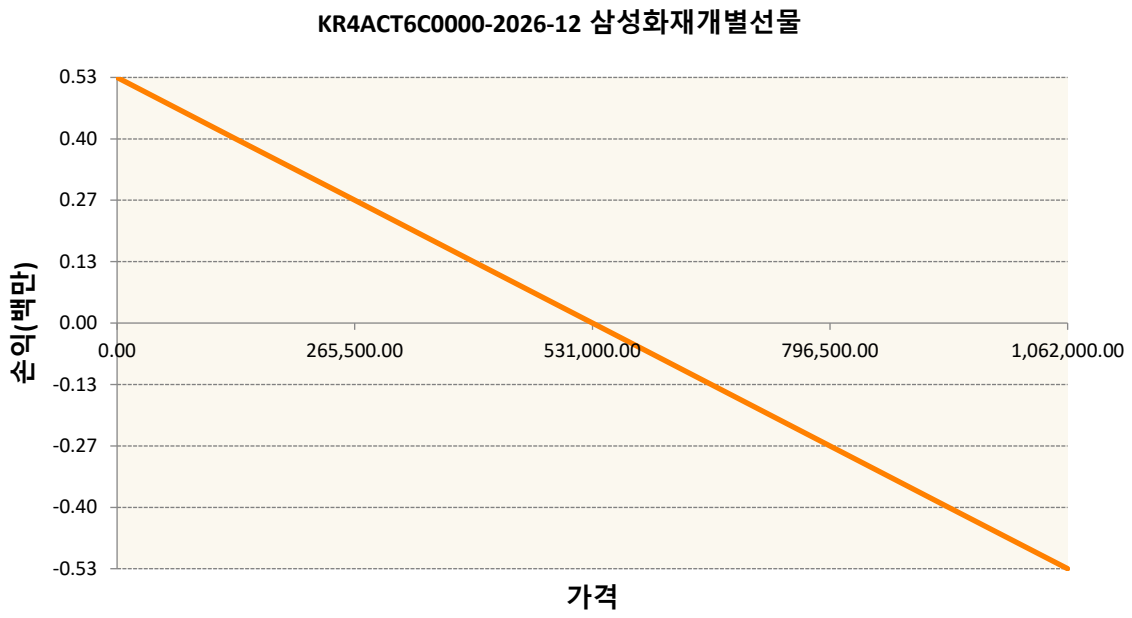


KR4A226C0000-2026-12 삼성SDI개별선물



KR4A566C0008-2026-12 NAVER개별선물





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A016C0004	2026-12 코스피200지수선물						49
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-49	-49	-49	-49	-49	-49	-49
-5.33%	-33	-33	-33	-33	-33	-33	-33
-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%	33	33	33	33	33	33	33
8.00%	49	49	49	49	49	49	49

KR4A056C0005	2026-12 미니코스피200 선물						23
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-23	-23	-23	-23	-23	-23	-23
-5.33%	-15	-15	-15	-15	-15	-15	-15
-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%	15	15	15	15	15	15	15
8.00%	23	23	23	23	23	23	23

KR4A176C0000	2026-12 삼성증권개별선물						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
	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

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

270

공시일	2026-11-16
기준일	2026-11-13

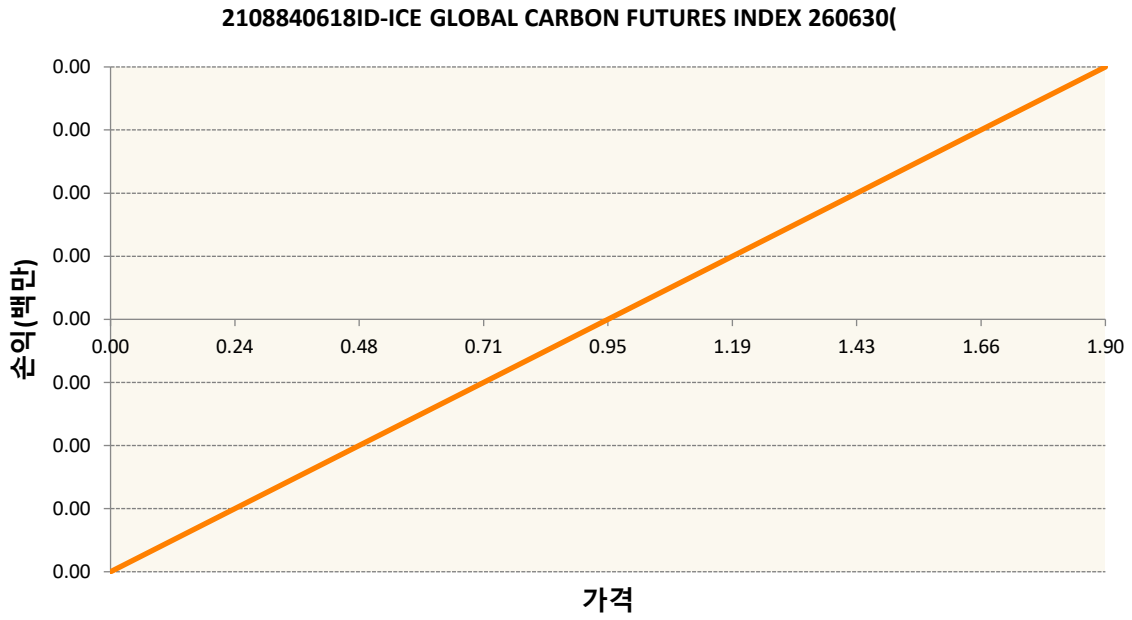
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

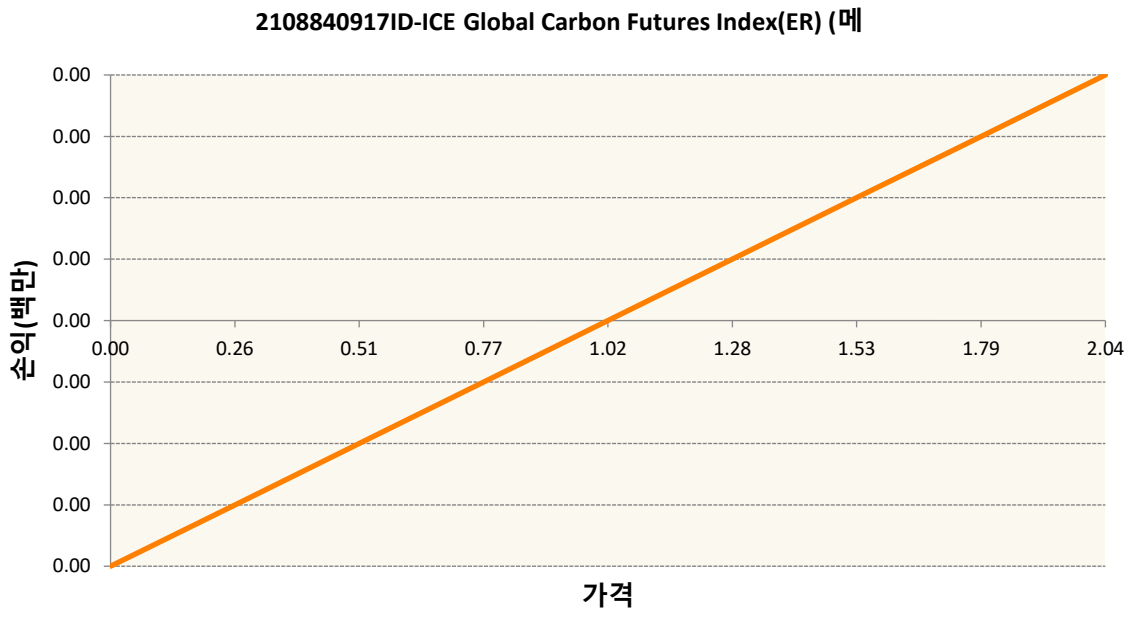
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	7,225	0	7,225	장외

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2108840618ㅣICE GLOBAL CARBON FUTURES INDEX 260630(	461
2108840917ㅣICE Global Carbon Futures Index(ER) (메	117

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

593

공시일	2026-11-16
기준일	2026-11-13

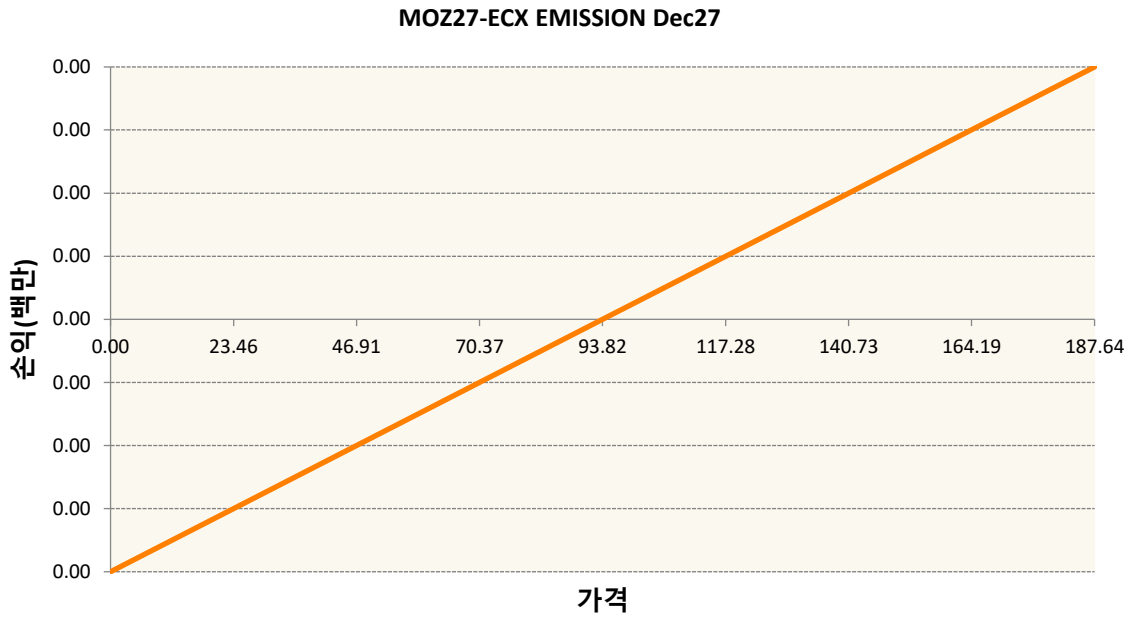
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	6,004	0	6,004	
누계	통화	선도	0	2,771	-2,771	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213GAV KRW/EUR 30-11-26E	222
MOZ27 ECX EMISSION Dec27	480

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

(단위:백만원)

732

공시일	2026-11-16
기준일	2026-11-13

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	-732	0	-732	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWSOL0000(CSI PHOTOVOLTAIC INDUSTRY INDEX 260325(	10
SWSOL0000(CSI PHOTOVOLTAIC INDUSTRY INDEX 260630(N	10
SWSOL0000(CSI PHOTOVOLTAIC INDUSTRY INDEX 260630(	15
SWSOL0000(CSI PHOTOVOLTAIC INDUSTRY INDEX 260923(	25

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

(단위:백만원)

93

공시일	2026-11-16
기준일	2026-11-13

SOL차이나육성산업액티브상장지

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	-5,949	0	-5,949	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 251218(NH)	47
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 260714(미래)	325
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 260917(메리츠)	99

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

(단위:백만원)

935

공시일	2026-11-16
기준일	2026-11-13

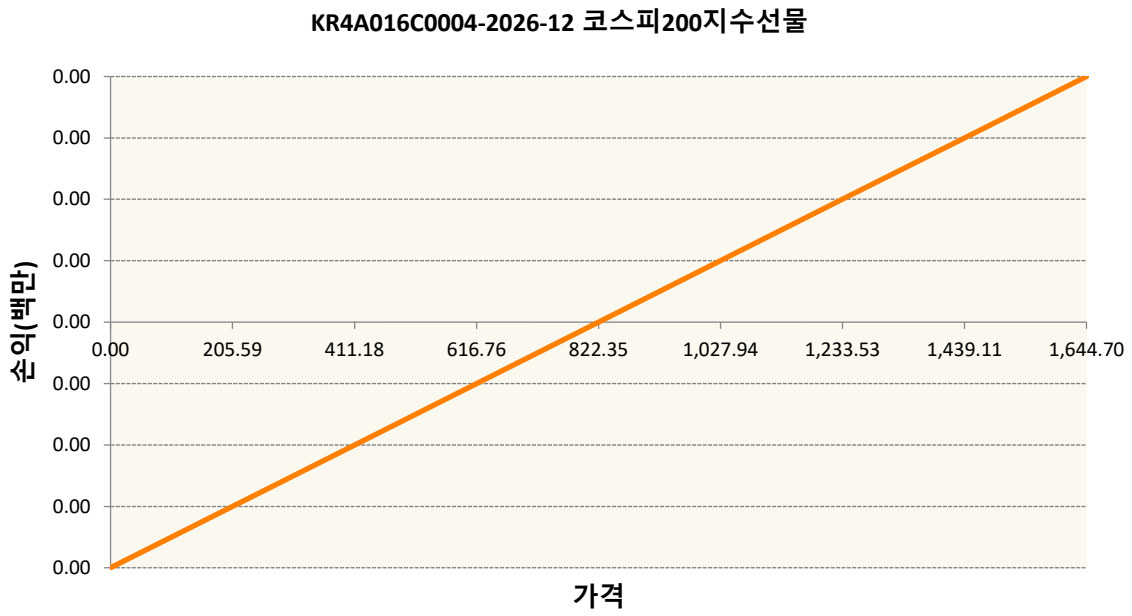
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

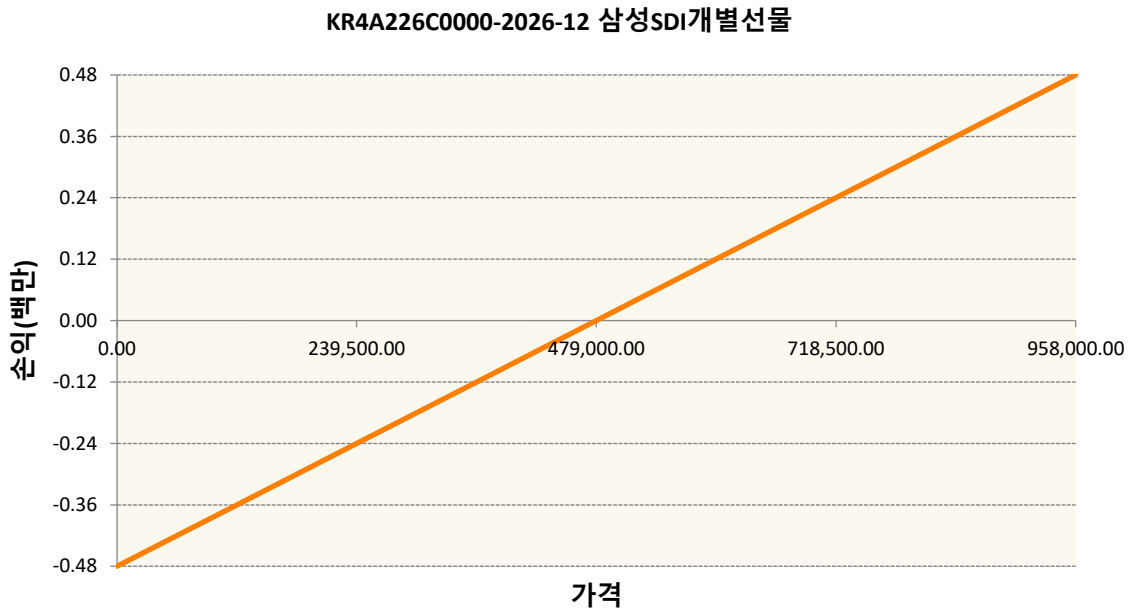
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	206	830	-624	장내
누계	유가증권	선물	10,959	0	10,959	장내

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4A016C0004	2026-12 코스피200지수선물						841
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-841	-841	-841	-841	-841	-841	-841
-5.33%	-561	-561	-561	-561	-561	-561	-561
-2.67%	-280	-280	-280	-280	-280	-280	-280
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	280	280	280	280	280	280	280
5.33%	561	561	561	561	561	561	561
8.00%	841	841	841	841	841	841	841

KR4A226C0000	2026-12 삼성SDI개별선물						38
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-38	-38	-38	-38	-38	-38	-38
-5.33%	-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)

3,077

공시일	2026-11-16
기준일	2026-11-13

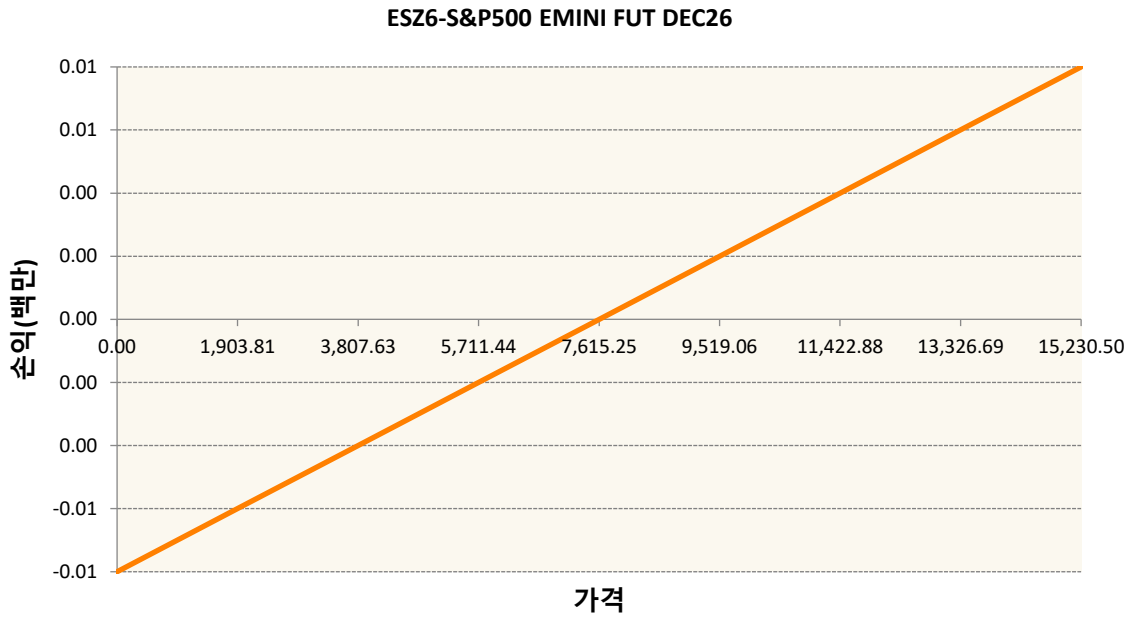
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

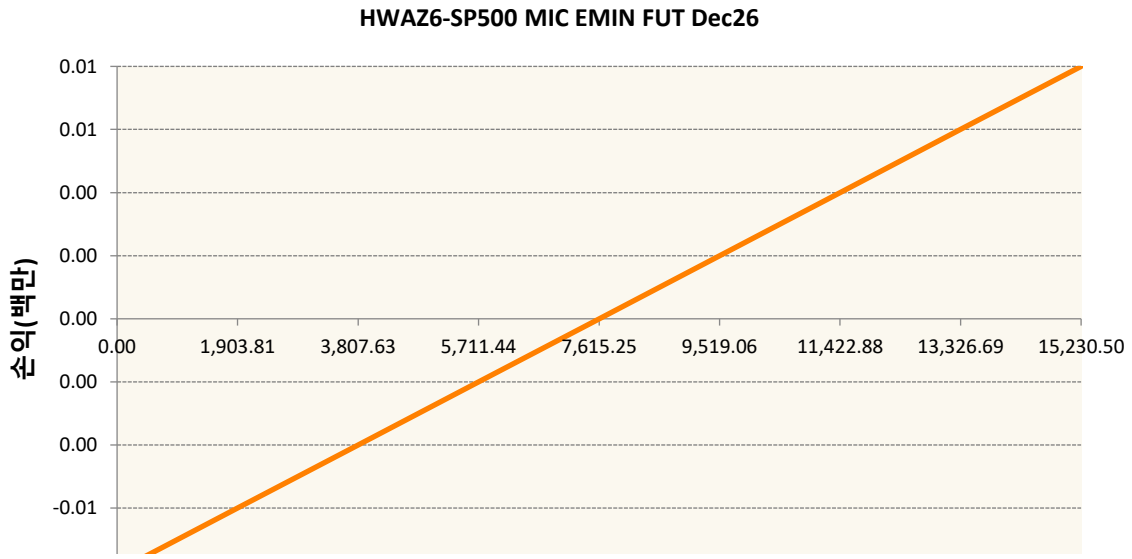
1. 계약금액

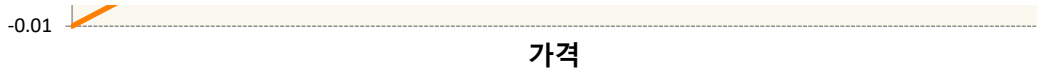
(단위:백만원)

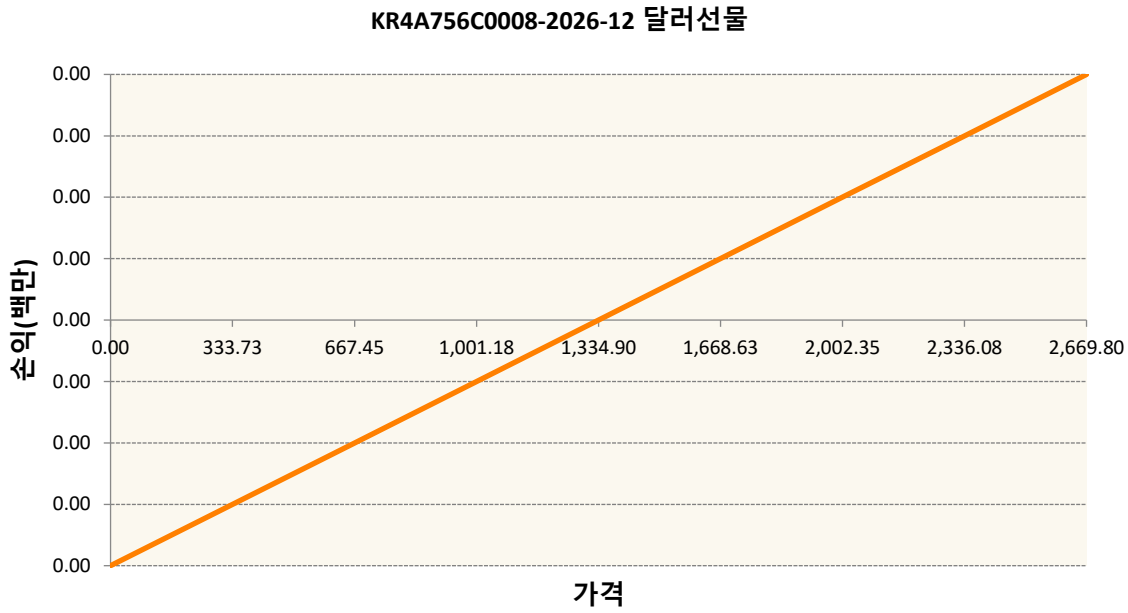
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
신규	지수	선물	0	0	0	장내
신규	통화	선물	934	0	934	장내
누계	지수	선물	75,626	0	75,626	
누계	지수	선물	369	0	369	장내
누계	통화	선물	21,358	0	21,358	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

ESZ6	S&P500 EMINI FUT DEC26	6,050
HWAZ6	SP500 MIC EMIN FUT Dec26	29
KR4A756C00	2026-12 달러선물	1,709

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

3,869

공시일	2026-11-16
기준일	2026-11-13

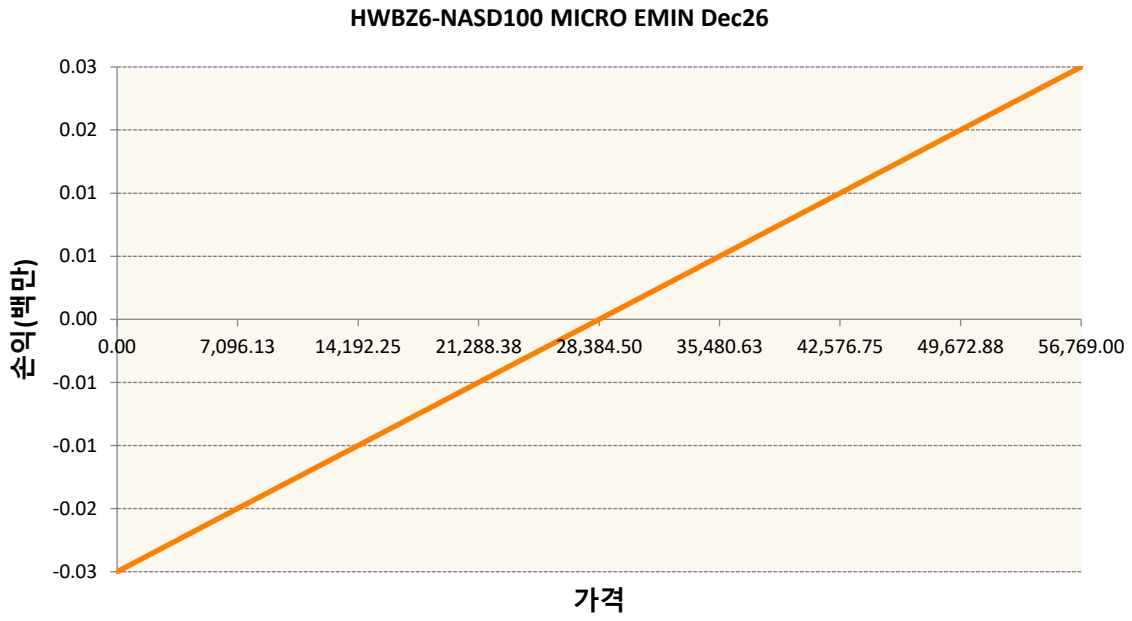
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

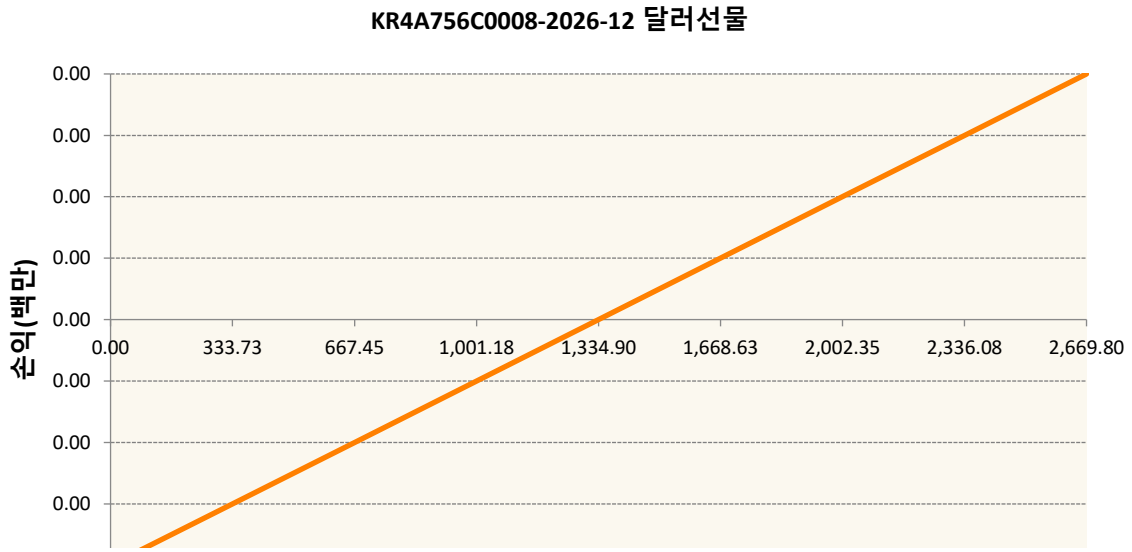
1. 계약금액

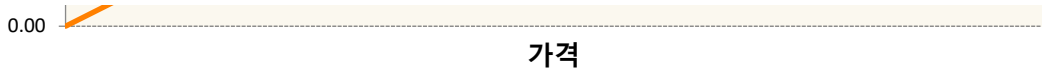
(단위:백만원)

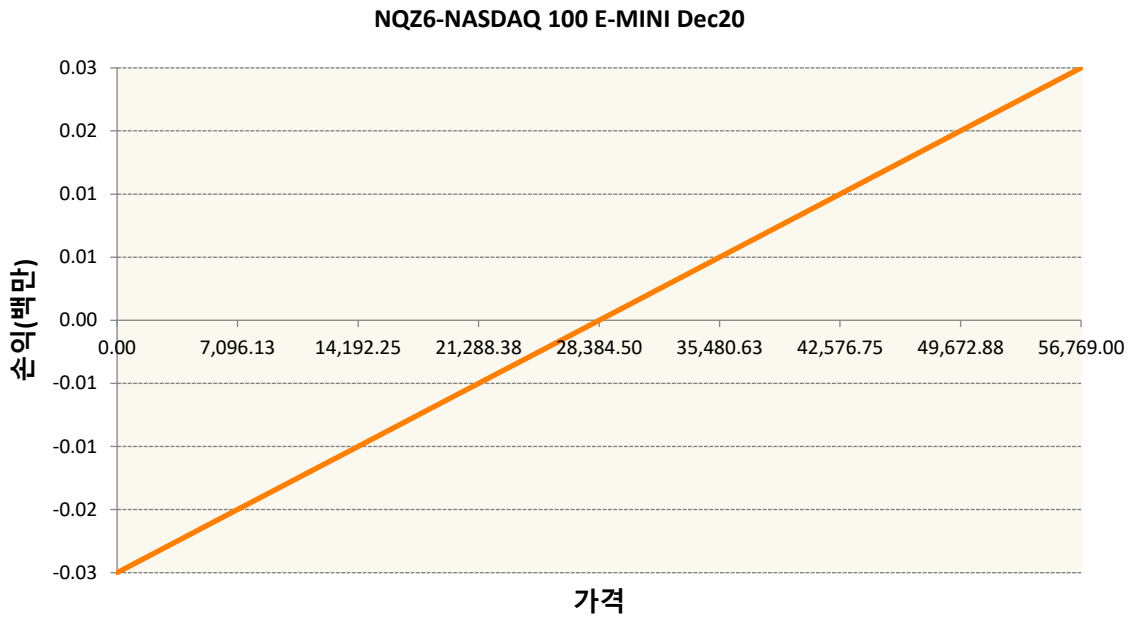
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
신규	지수	선물	0	0	0	장내
신규	통화	선물	400	0	400	장내
누계	지수	선물	31,388	0	31,388	
누계	지수	선물	393	0	393	장내
누계	통화	선물	9,825	0	9,825	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HWBZ6	NASD100 MICRO EMIN Dec26	31
KR4A756C00	2026-12 달러선물	786
NQZ6	NASDAQ 100 E-MINI Dec20	2,511

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

(단위:백만원)

2,444

공시일	2026-11-16
기준일	2026-11-13

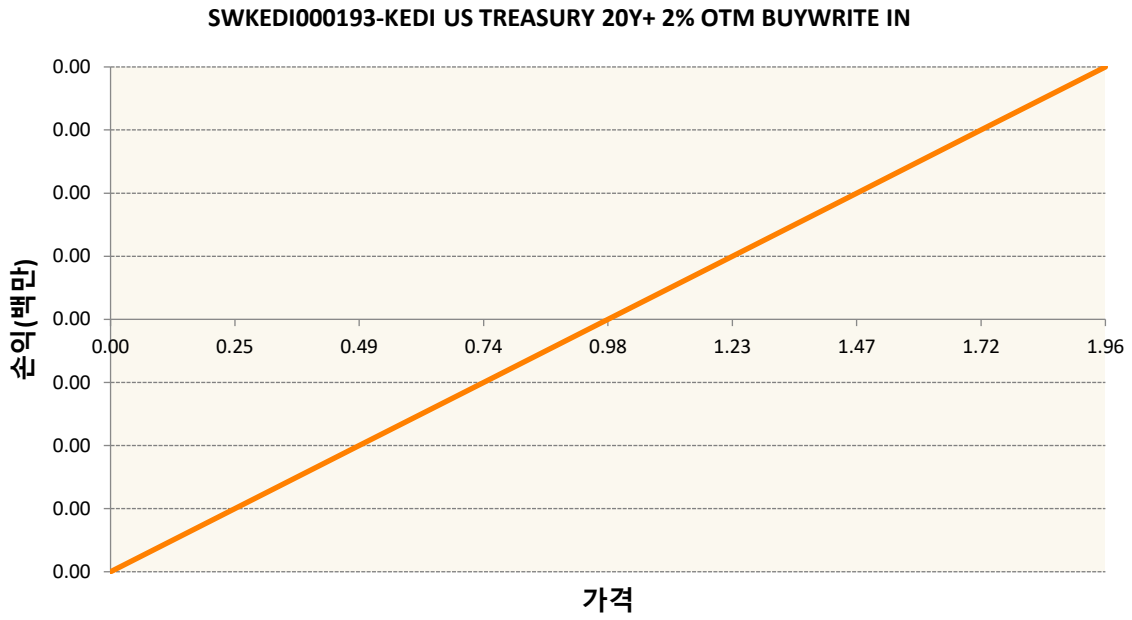
SOL미국30년국채커버드콜(합성)

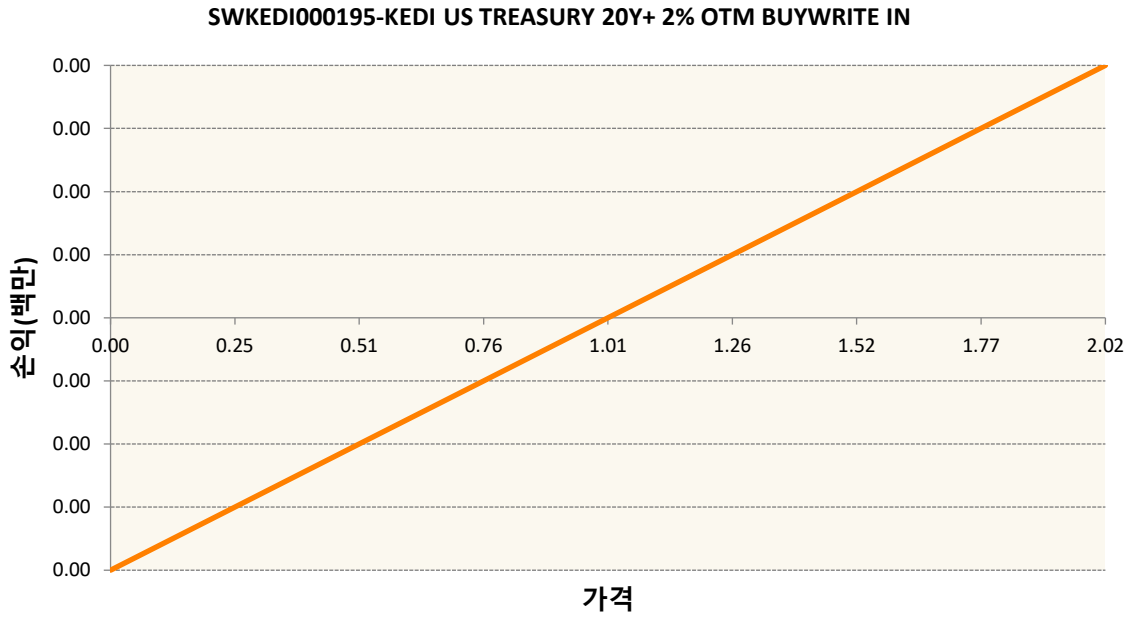
1. 계약금액

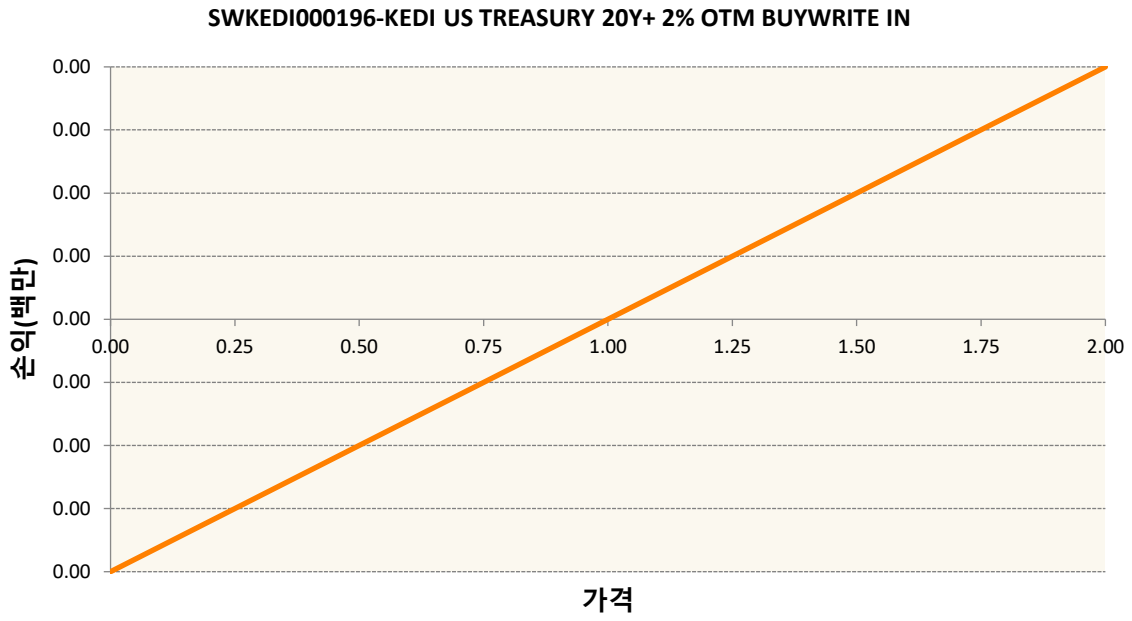
(단위:백만원)

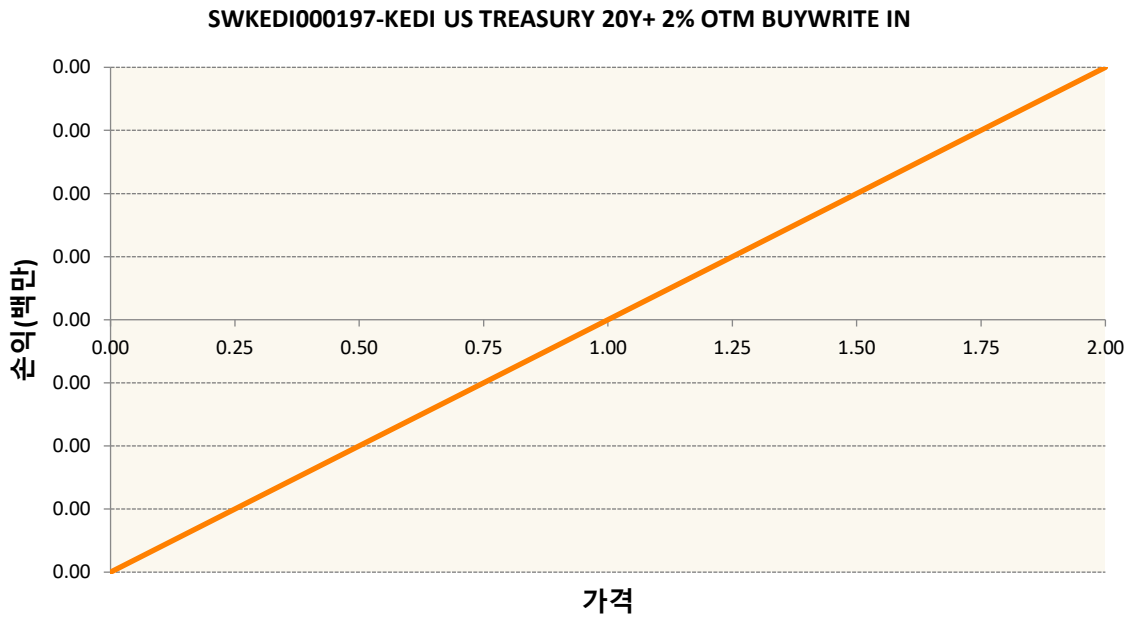
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	275,306	0	275,306	장외

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	6,943
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	7,823
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	2,574
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	4,672

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

8,580