공시일	2026-11-17
기준일	2026-11-16

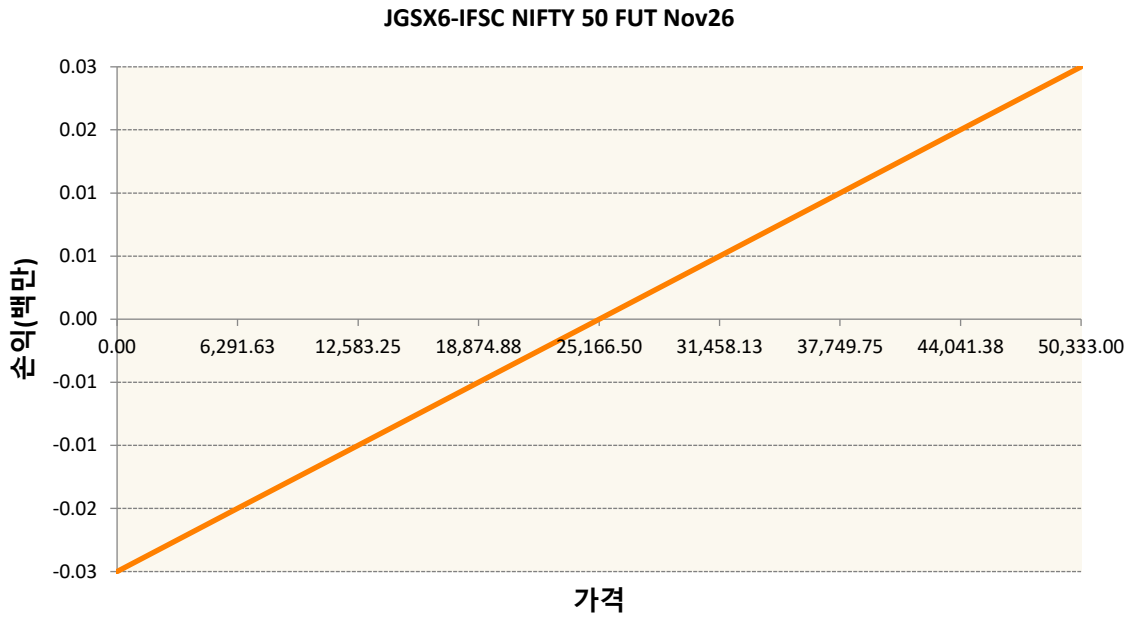
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

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	2026-11-17
기준일	2026-11-16

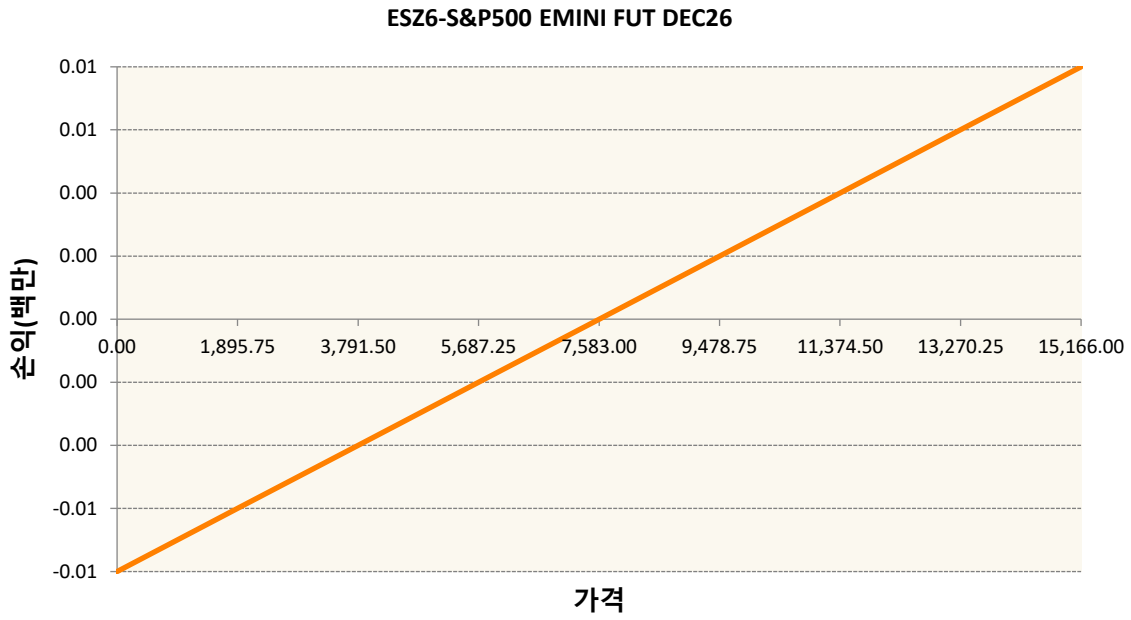
SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

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)

27

공시일	2026-11-17
기준일	2026-11-16

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	2026-11-17
기준일	2026-11-16

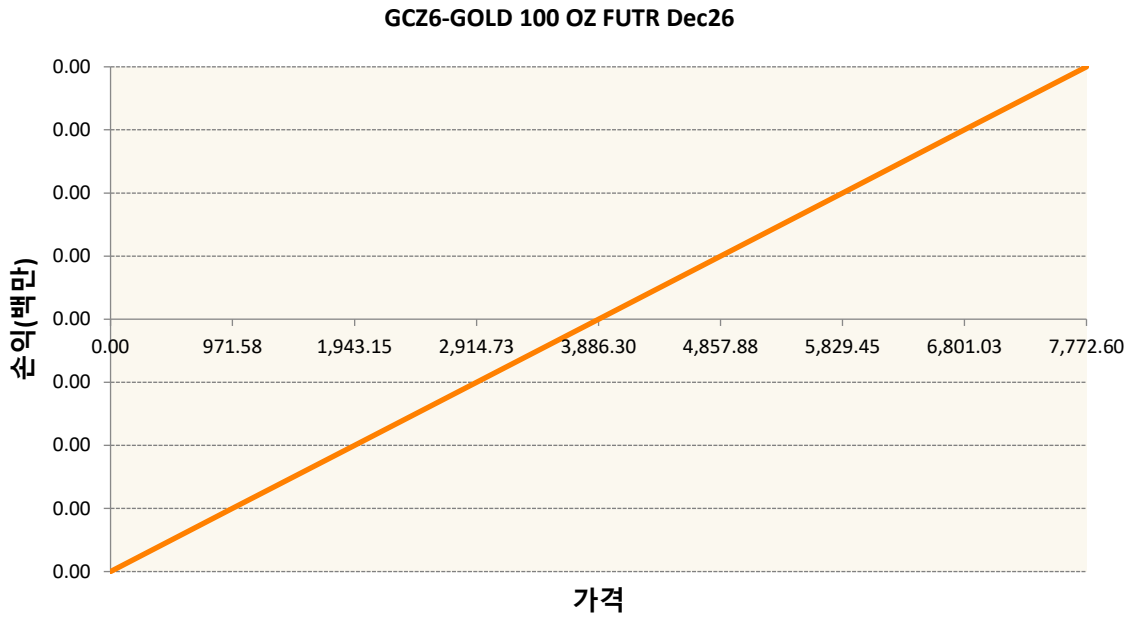
SOL골드커버드콜액티브특별자산상장지수(금

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			5,562	0	5,562	
누계	실물자산	옵션	0	0	0	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

AOGLDUSC3 GLD US 11/20/26 C365 EQUITY	2
GCZ6 GOLD 100 OZ FUTR Dec26	445

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

(단위:백만원)

577

공시일	2026-11-17
기준일	2026-11-16

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)

AOPLTRAC17 PLTR US 11/20/26 C177.5 EQUITY	73
AOPLTRAP17 PLTR US 11/20/26 P177.5 EQUITY	37

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

(단위:백만원)

383

공시일	2026-11-17
기준일	2026-11-16

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)

AOTLTUSC0ᄃTLT US 11/20/26 C80.5 EQUITY	1

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

(단위:백만원)

1

공시일	2026-11-17
기준일	2026-11-16

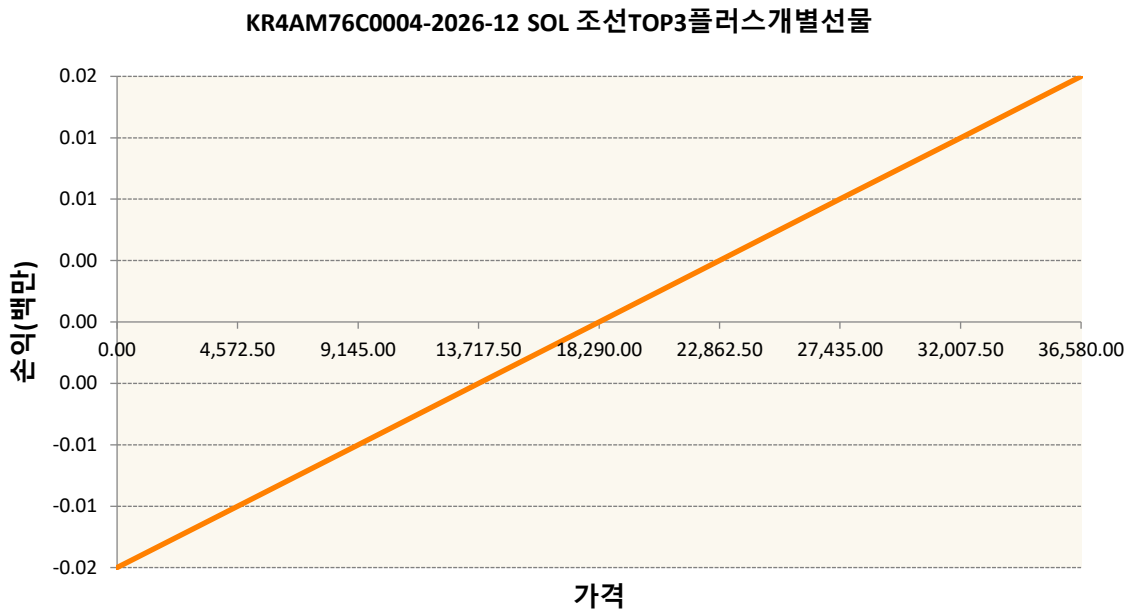
SOL조선TOP3플러스레버리지상장지수(주식)

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	5,047	0	5,047	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4AM76C0004	2026-12 SOL 조선TOP3플러스개별선물						4,037
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-4,037	-4,037	-4,037	-4,037	-4,037	-4,037	-4,037
-5.33%	-2,691	-2,691	-2,691	-2,691	-2,691	-2,691	-2,691
-2.67%	-1,346	-1,346	-1,346	-1,346	-1,346	-1,346	-1,346
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	1,346	1,346	1,346	1,346	1,346	1,346	1,346
5.33%	2,691	2,691	2,691	2,691	2,691	2,691	2,691
8.00%	4,037	4,037	4,037	4,037	4,037	4,037	4,037

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

6,911

공시일	2026-11-17
기준일	2026-11-16

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	2026-11-17
기준일	2026-11-16

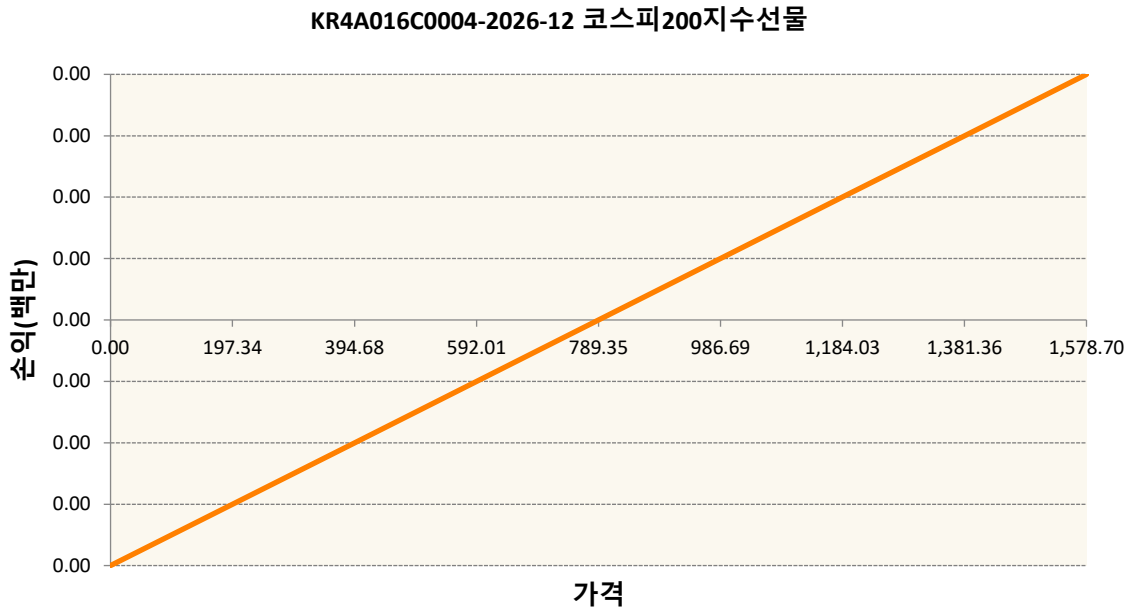
SOL 200타겟위클리커버드콜상장지수(주식)

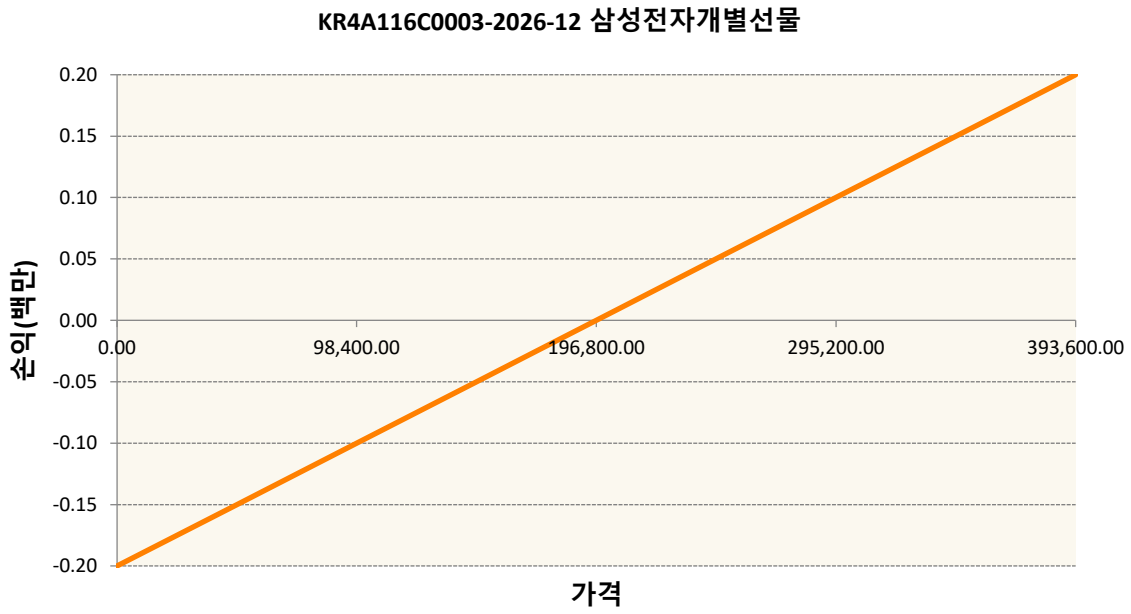
1. 계약금액

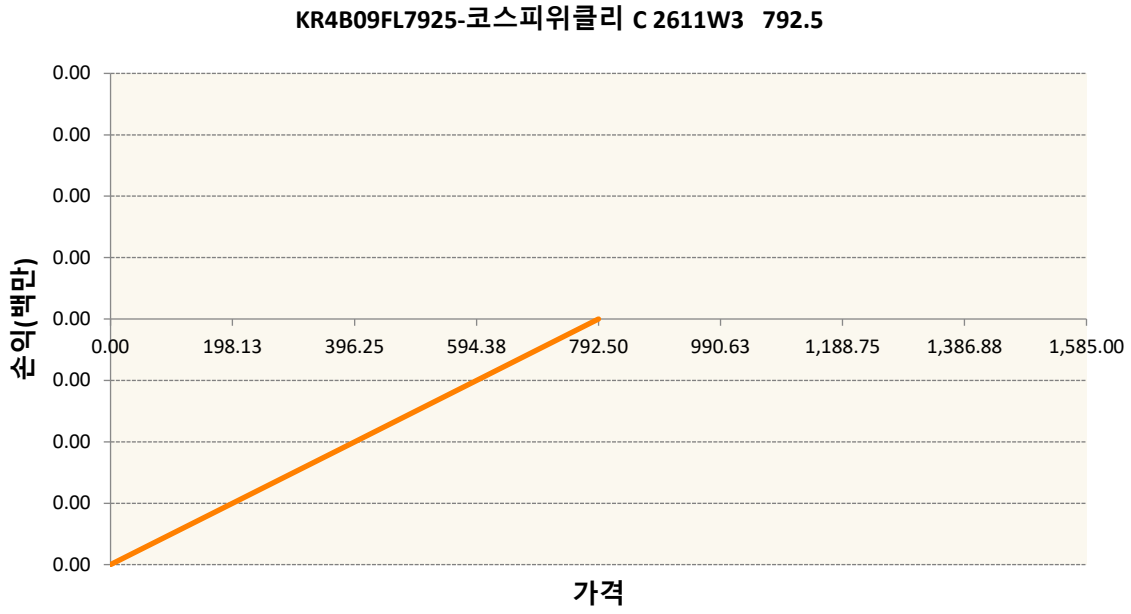
(단위:백만원)

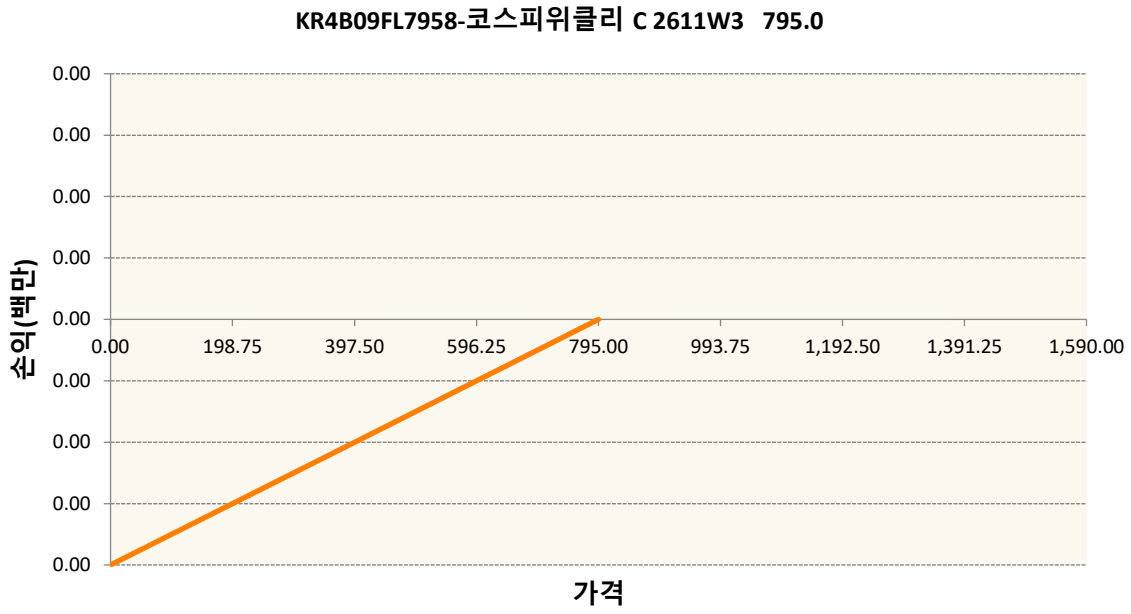
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	31,456	-31,456	장내
누계	유가증권	선물	15,758	0	15,758	장내
누계	유가증권	옵션	0	30,748	-30,748	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A016C0004	2026-12 코스피200지수선물						412
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-412	-412	-412	-412	-412	-412	-412
-5.33%	-274	-274	-274	-274	-274	-274	-274
-2.67%	-137	-137	-137	-137	-137	-137	-137
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	137	137	137	137	137	137	137
5.33%	274	274	274	274	274	274	274
8.00%	412	412	412	412	412	412	412
KR4A116C0003	2026-12 삼성전자개별선물						850
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-850	-850	-850	-850	-850	-850	-850
-5.33%	-567	-567	-567	-567	-567	-567	-567
-2.67%	-283	-283	-283	-283	-283	-283	-283
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	283	283	283	283	283	283	283
5.33%	567	567	567	567	567	567	567
8.00%	850	850	850	850	850	850	850
	KR4B09FL7925		코스피위클리 C 2611W3 792.5				1,153
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,106	-1,109	-1,115	-1,122	-1,131	-1,141	-1,153
-5.33%	-635	-647	-661	-677	-695	-715	-735
-2.67%	-217	-242	-268	-294	-321	-349	-377
0%	95	63	32	0	-32	-63	-95
2.67%	277	251	223	195	167	137	108
5.33%	357	342	325	306	285	263	239
8.00%	382	376	368	358	346	332	316
	KR4B09FL7958		코스피위클리 C 2611W3 795.0				784
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-755	-757	-760	-764	-770	-776	-784
-5.33%	-439	-446	-455	-465	-476	-488	-502
-2.67%	-155	-170	-187	-204	-221	-239	-258
0%	63	42	21	0	-21	-42	-63
2.67%	195	176	157	138	118	98	78
5.33%	254	243	231	217	203	187	171
8.00%	274	270	264	256	247	237	226

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

8,291

공시일	2026-11-17
기준일	2026-11-16

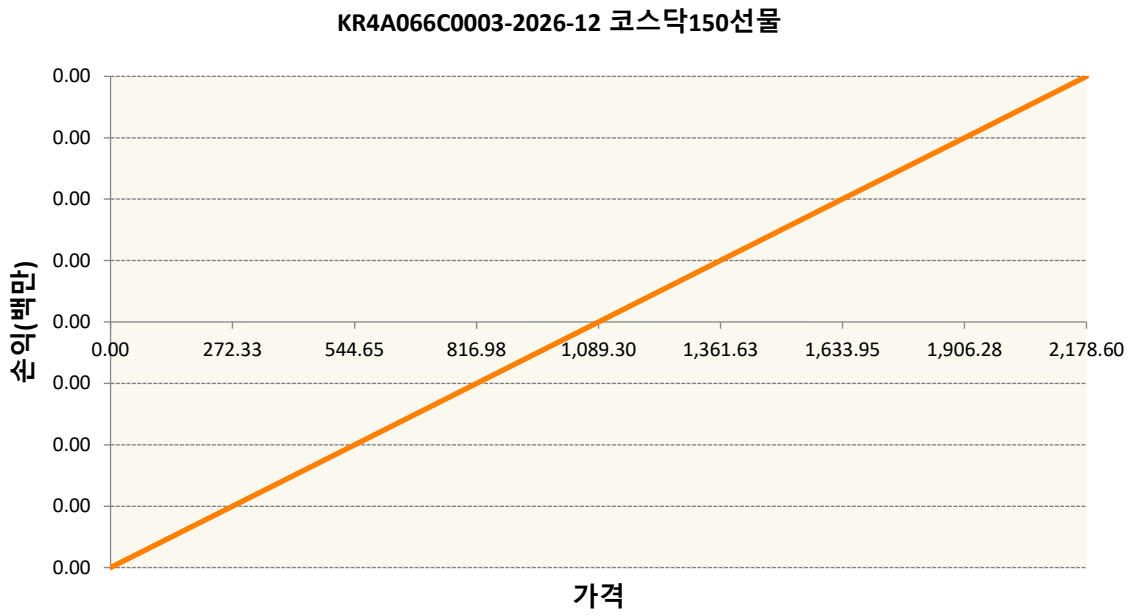
SOL코스닥150인덱스(주식-파생형)

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	436	0	436	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A066C0003 2026-12 코스닥150선물 35

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-35	-35	-35	-35	-35	-35	-35
-5.33%	-23	-23	-23	-23	-23	-23	-23
-2.67%	-12	-12	-12	-12	-12	-12	-12
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	12	12	12	12	12	12	12
5.33%	23	23	23	23	23	23	23
8.00%	35	35	35	35	35	35	35

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

118

공시일	2026-11-17
기준일	2026-11-16

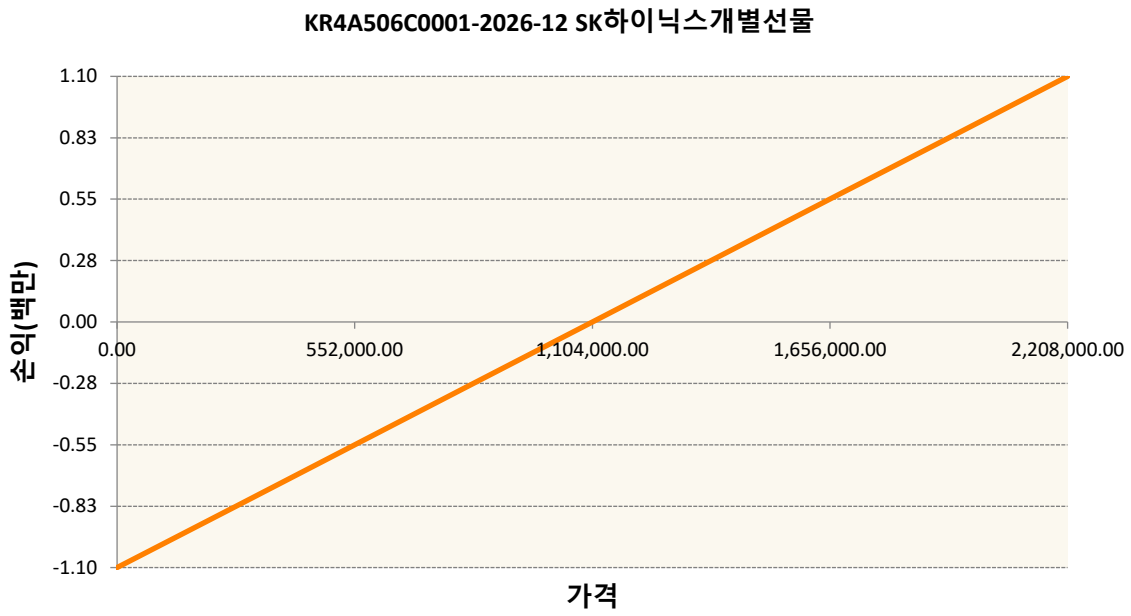
SOLSK하이닉스단일종목레버리지상장지수

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	553	-553	장내
누계	유가증권	선물	17,664	0	17,664	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A506C0001	2026-12 SK하이닉스개별선물	1,434

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,434	-1,434	-1,434	-1,434	-1,434	-1,434	-1,434
-5.33%	-956	-956	-956	-956	-956	-956	-956
-2.67%	-478	-478	-478	-478	-478	-478	-478
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	478	478	478	478	478	478	478
5.33%	956	956	956	956	956	956	956
8.00%	1,434	1,434	1,434	1,434	1,434	1,434	1,434

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

7,202

공시일	2026-11-17
기준일	2026-11-16

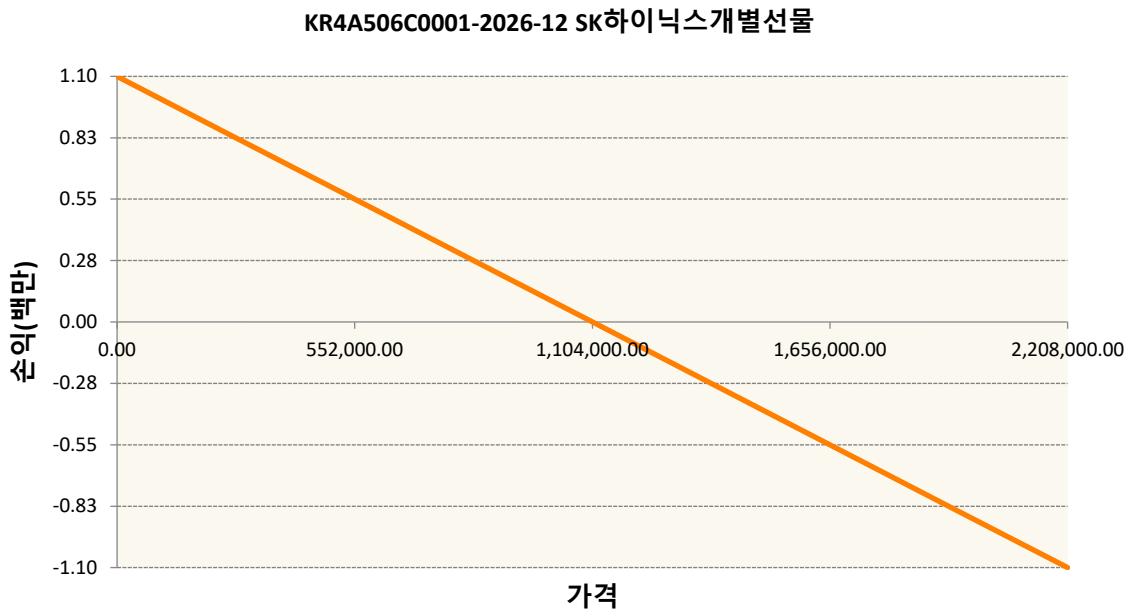
SOLSK하이닉스선물단일종목인버스2X상장지

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	58,270	-58,270	장내
누계	유가증권	선물	0	188,100	-188,100	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A506C0001	2026-12 SK하이닉스개별선물	15,266

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	15,266	15,266	15,266	15,266	15,266	15,266	15,266
-5.33%	10,177	10,177	10,177	10,177	10,177	10,177	10,177
-2.67%	5,089	5,089	5,089	5,089	5,089	5,089	5,089
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-5,089	-5,089	-5,089	-5,089	-5,089	-5,089	-5,089
5.33%	-10,177	-10,177	-10,177	-10,177	-10,177	-10,177	-10,177
8.00%	-15,266	-15,266	-15,266	-15,266	-15,266	-15,266	-15,266

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

76,694

공시일	2026-11-17
기준일	2026-11-16

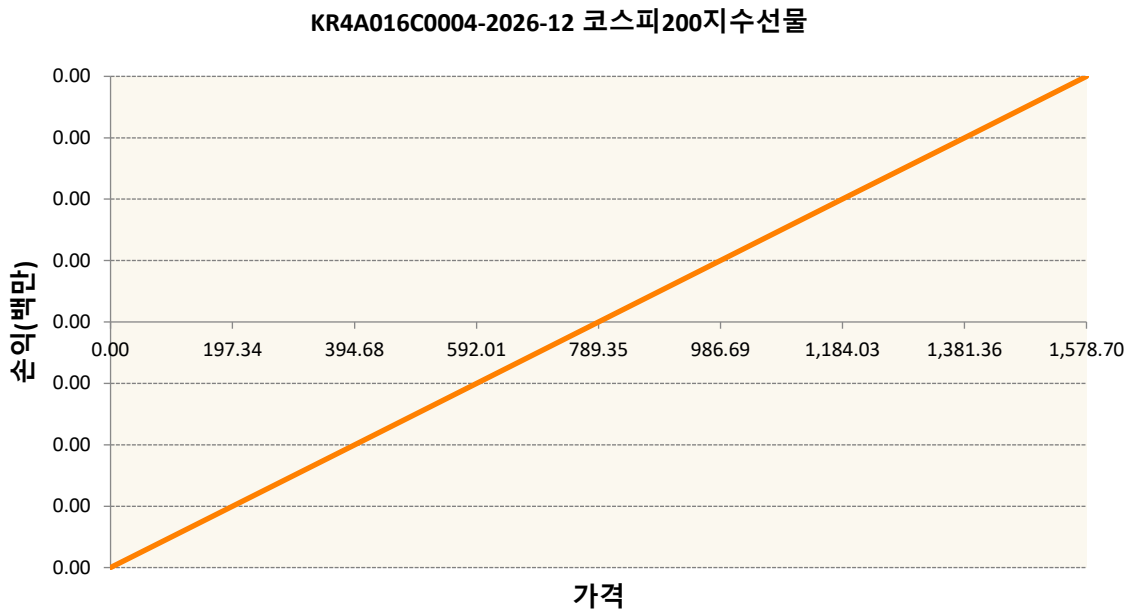
SOL200커버드콜액티브상장지수(주식-파생형

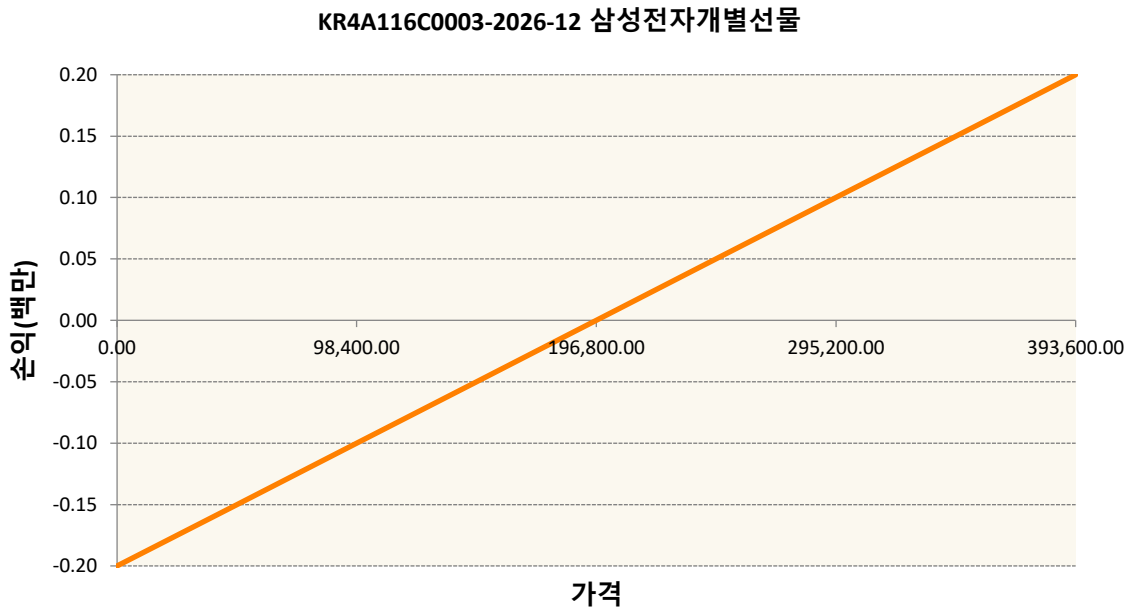
1. 계약금액

(단위:백만원)

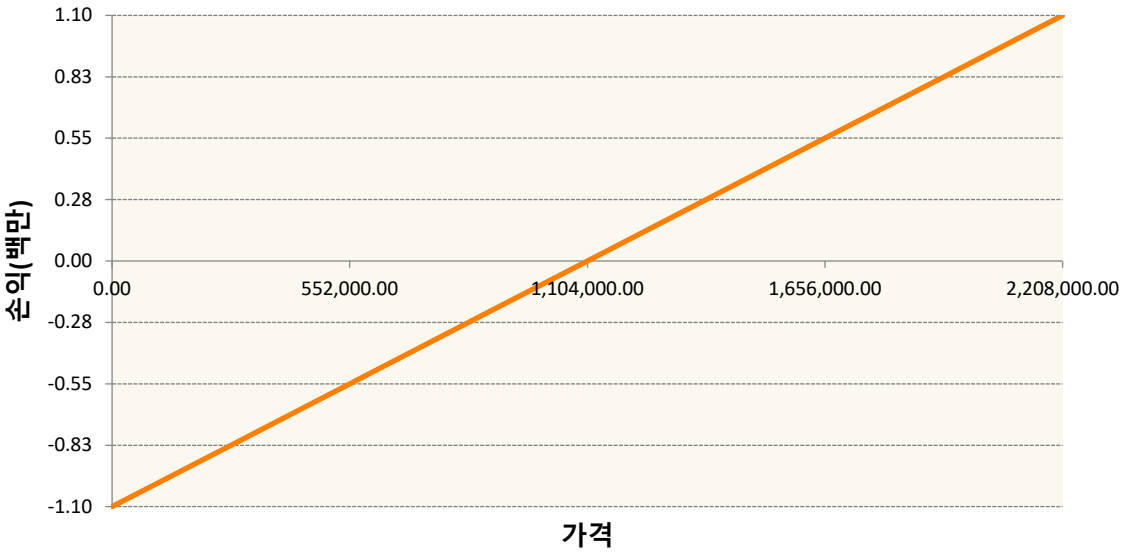
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	307	232	75	장내
신규	유가증권	옵션	0	2,837	-2,837	장내
누계	유가증권	선물	3,145	0	3,145	장내
누계	유가증권	옵션	0	2,769	-2,769	장내

2. 만기시점의 손익구조

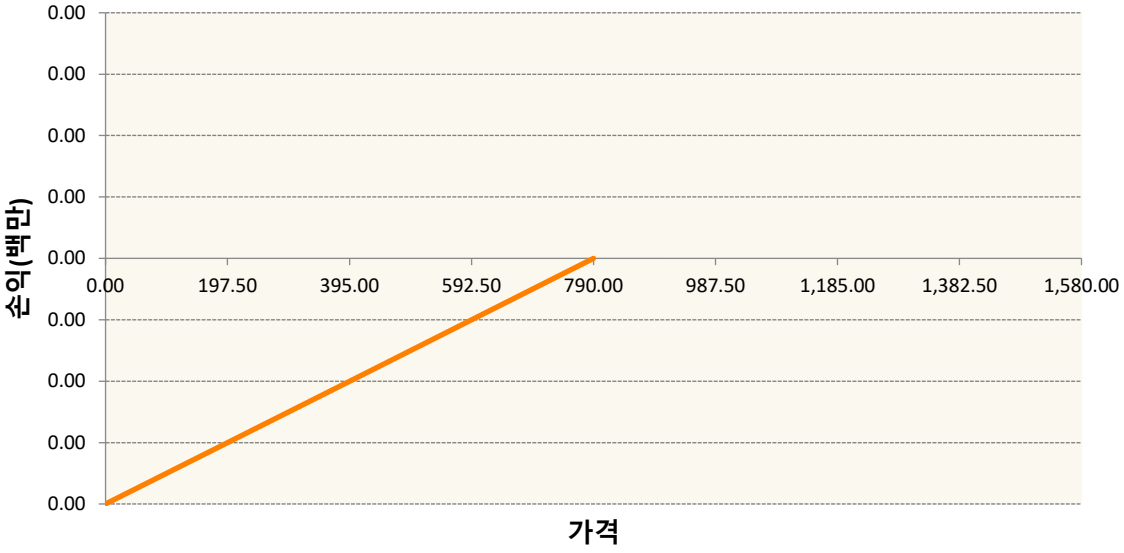




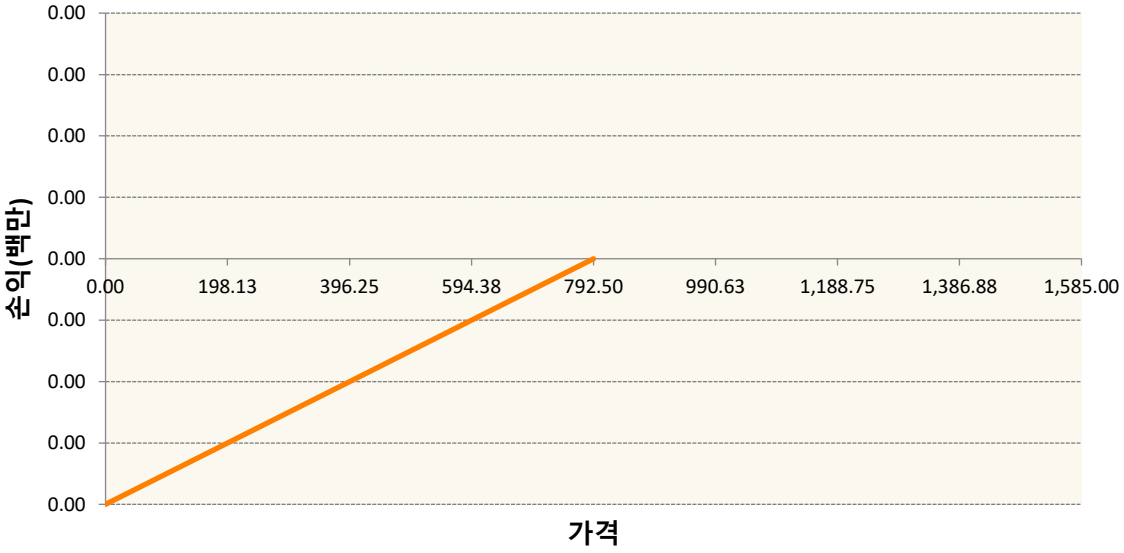
KR4A506C0001-2026-12 SK하이닉스개별선물



KR4B09FL7909-코스피위클리 C 2611W3 790.0



KR4B09FL7925-코스피위클리 C 2611W3 792.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

	KR4A016C0004		2026-12 코스피200지수선물				142
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-142	-142	-142	-142	-142	-142	-142
-5.33%	-95	-95	-95	-95	-95	-95	-95
-2.67%	-47	-47	-47	-47	-47	-47	-47
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	47	47	47	47	47	47	47
5.33%	95	95	95	95	95	95	95
8.00%	142	142	142	142	142	142	142
	KR4A116C0003		2026-12 삼성전자개별선물				34
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-34	-34	-34	-34	-34	-34	-34
-5.33%	-22	-22	-22	-22	-22	-22	-22
-2.67%	-11	-11	-11	-11	-11	-11	-11
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	11	11	11	11	11	11	11
5.33%	22	22	22	22	22	22	22
8.00%	34	34	34	34	34	34	34
	KR4A506C0001		2026-12 SK하이닉스개별선물				77
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-77	-77	-77	-77	-77	-77	-77
-5.33%	-51	-51	-51	-51	-51	-51	-51
-2.67%	-26	-26	-26	-26	-26	-26	-26
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	26	26	26	26	26	26	26
5.33%	51	51	51	51	51	51	51
8.00%	77	77	77	77	77	77	77
	KR4B09FL7909		코스피위클리 C 2611W3 790.0				97
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-93	-93	-94	-94	-95	-96	-97
-5.33%	-53	-54	-55	-57	-58	-60	-62
-2.67%	-17	-20	-22	-24	-27	-29	-32
0%	8	5	3	0	-3	-5	-8
2.67%	23	20	18	16	13	11	9
5.33%	29	27	26	25	23	21	19
8.00%	30	30	29	29	28	27	25
	KR4B09FL7925		코스피위클리 C 2611W3 792.5				74
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-71	-72	-72	-72	-73	-74	-74
-5.33%	-41	-42	-43	-44	-45	-46	-47
-2.67%	-14	-16	-17	-19	-21	-23	-24
0%	6	4	2	0	-2	-4	-6
2.67%	18	16	14	13	11	9	7
5.33%	23	22	21	20	18	17	15
8.00%	25	24	24	23	22	21	20

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

1,317

공시일	2026-11-17
기준일	2026-11-16

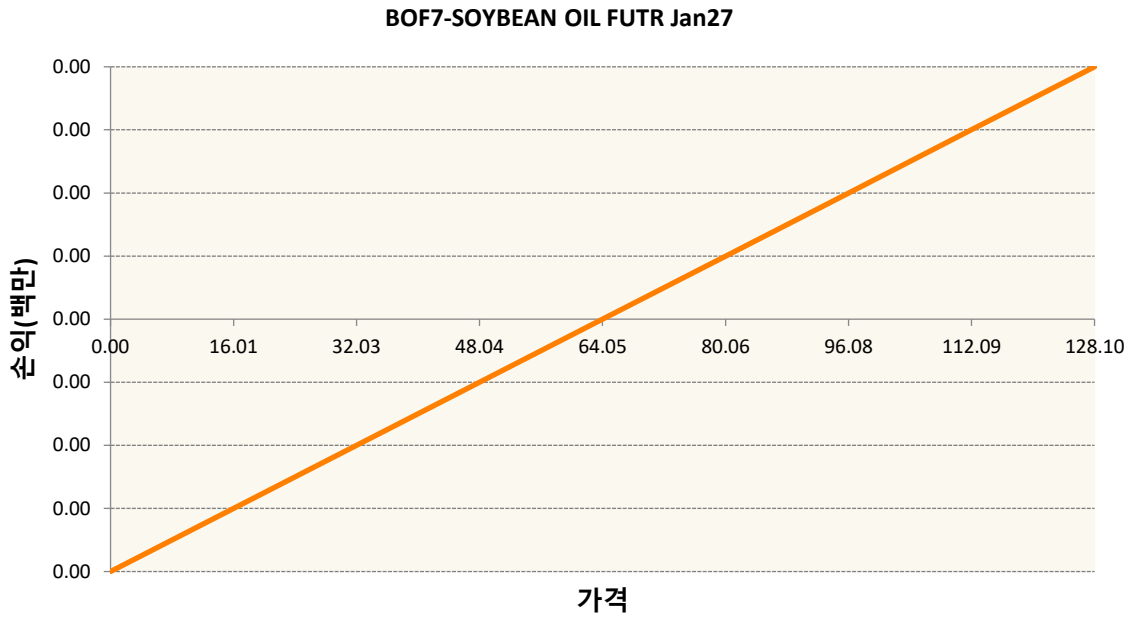
포커스농산물모(채권-파생형)

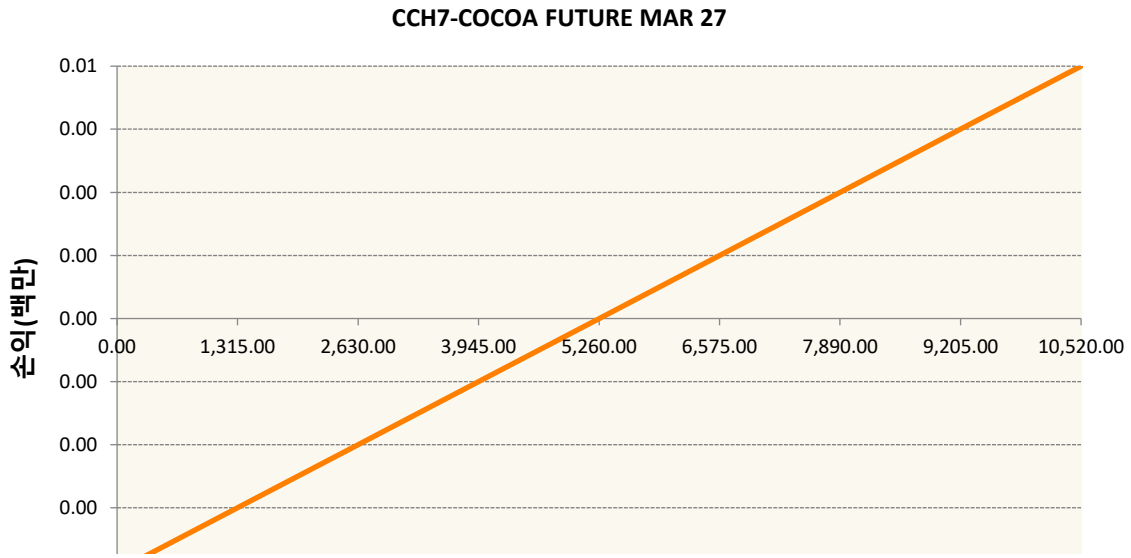
1. 계약금액

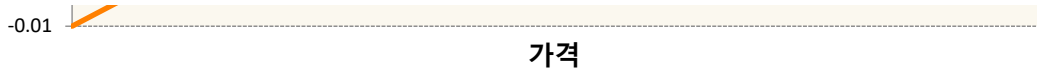
(단위:USD 백만)

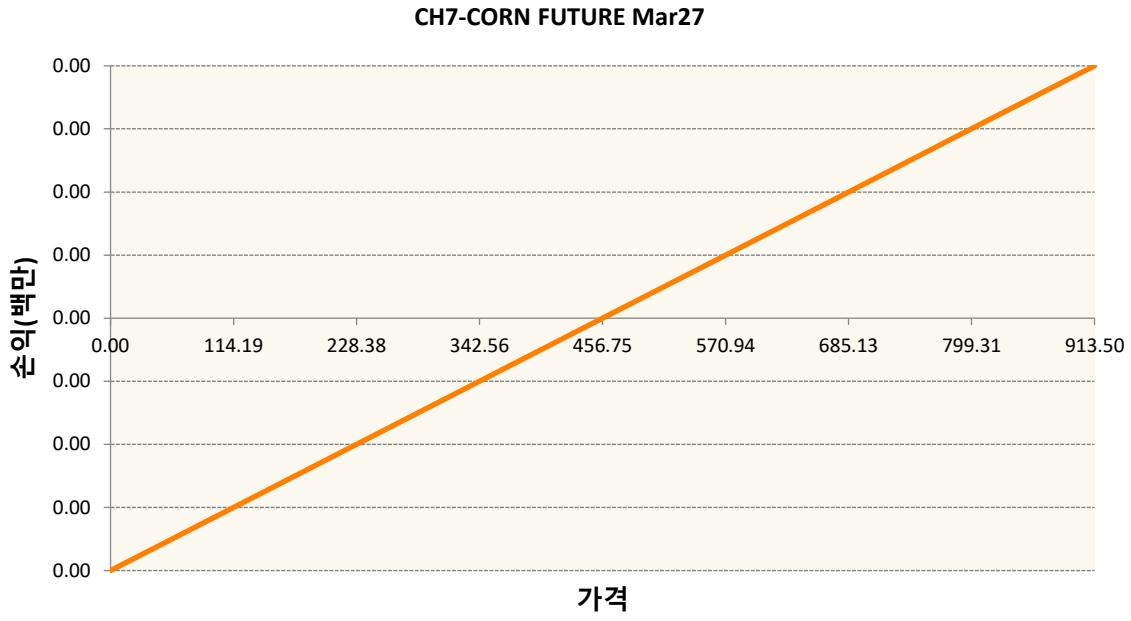
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	실물자산	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	실물자산	선물	329	0	329	
누계	유가증권	선물	1,993	0	1,993	
누계	통화	선물	0	53	-53	장내

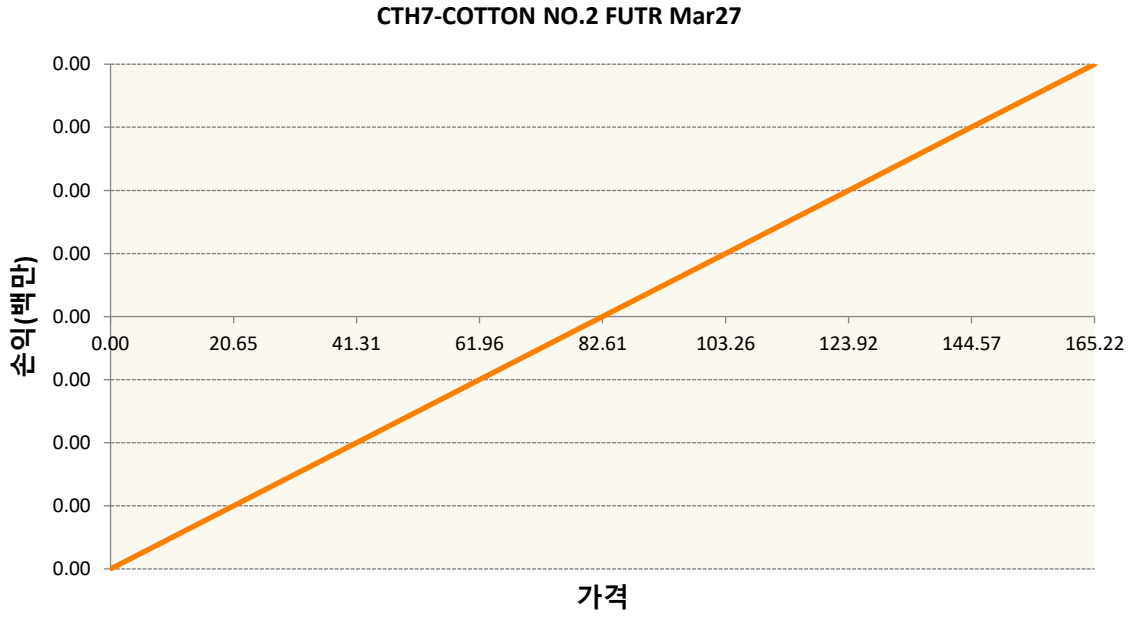
2. 만기시점의 손익구조

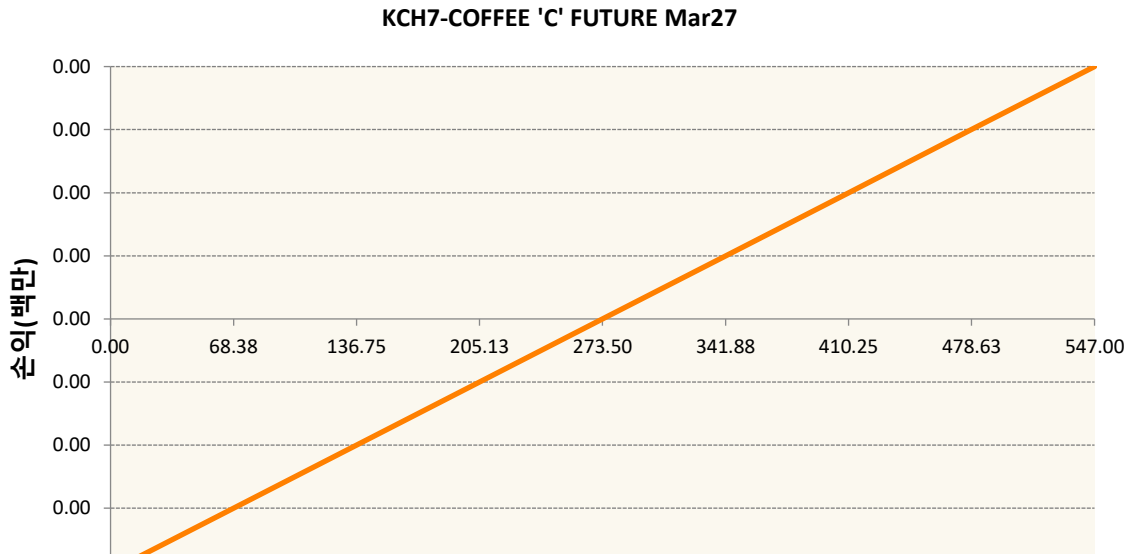


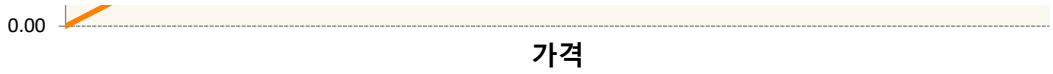



-0.01
가격

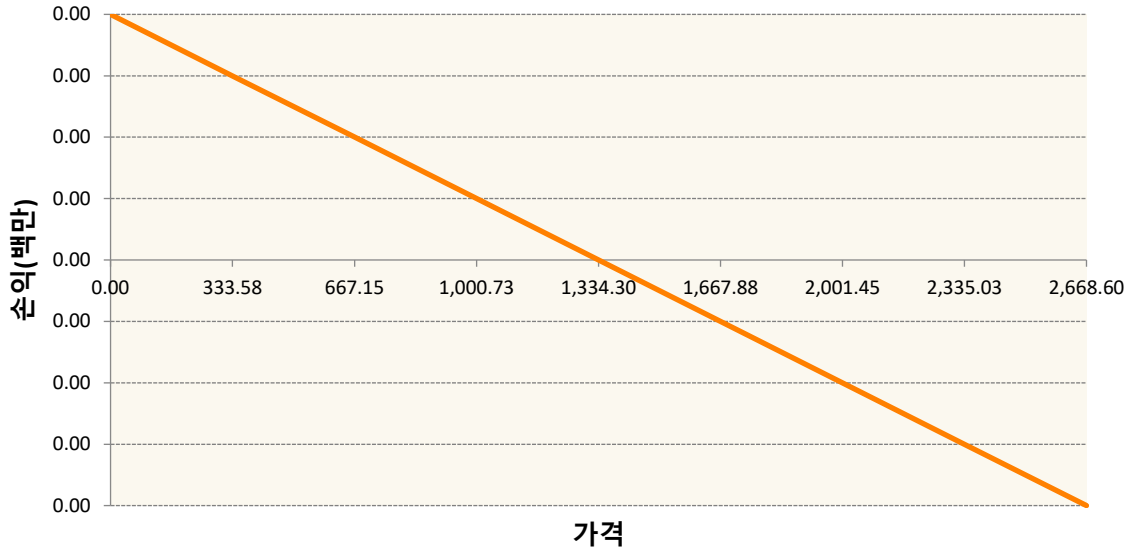

CH7-CORN FUTURE Mar27
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
114.19
228.38
342.56
456.75
570.94
685.13
799.31
913.50
손익(백만)
가격


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
20.65
41.31
61.96
82.61
103.26
123.92
144.57
165.22
손익(백만)
가격

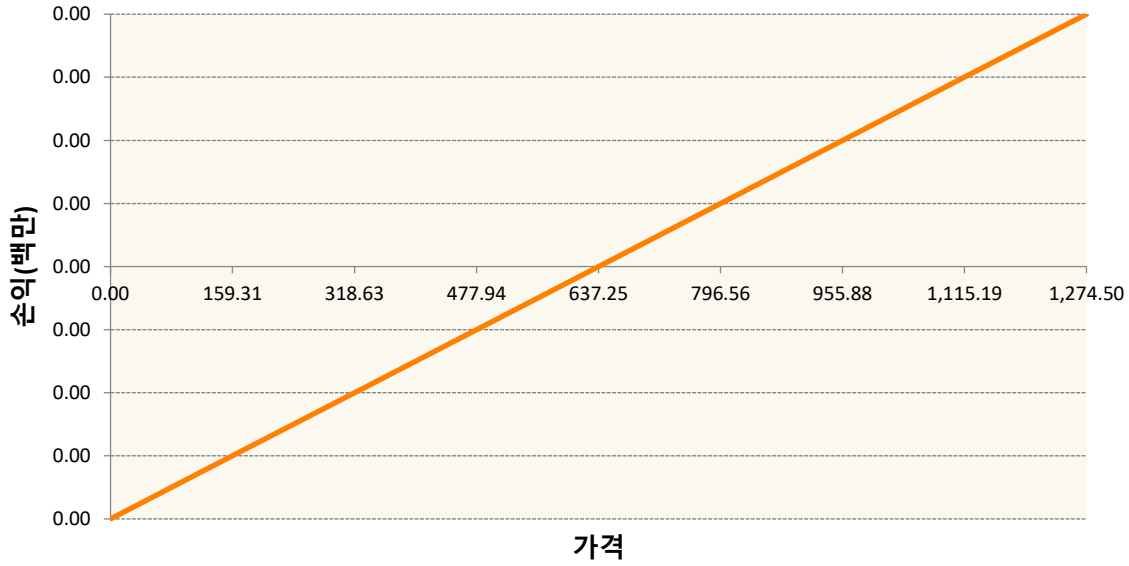

KCH7-COFFEE 'C' FUTURE Mar27
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
68.38
136.75
205.13
273.50
341.88
410.25
478.63
547.00
손익(백만)



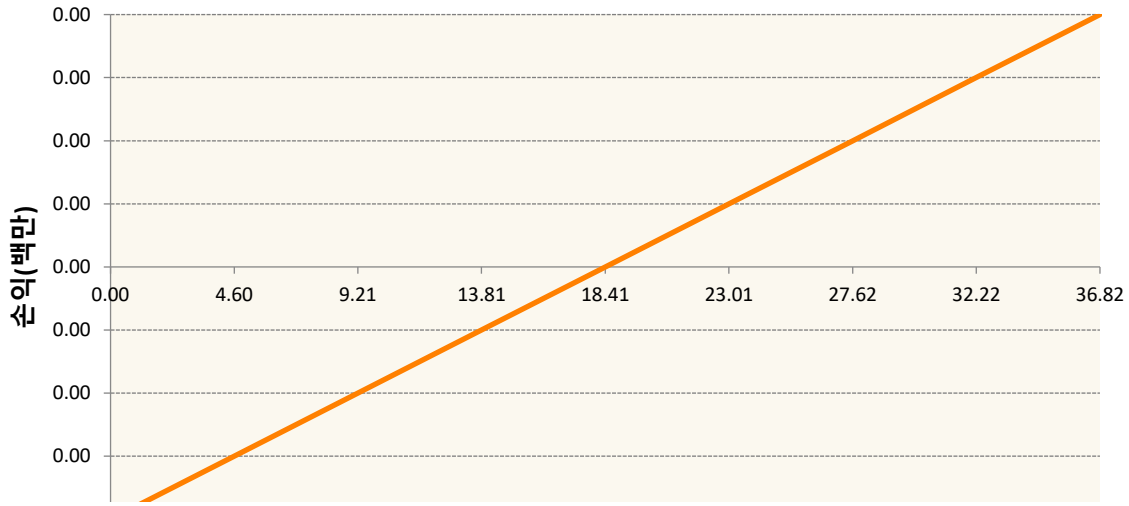
KR4A756C0008-2026-12 달러선물

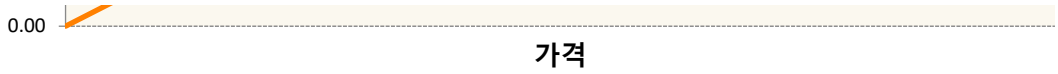


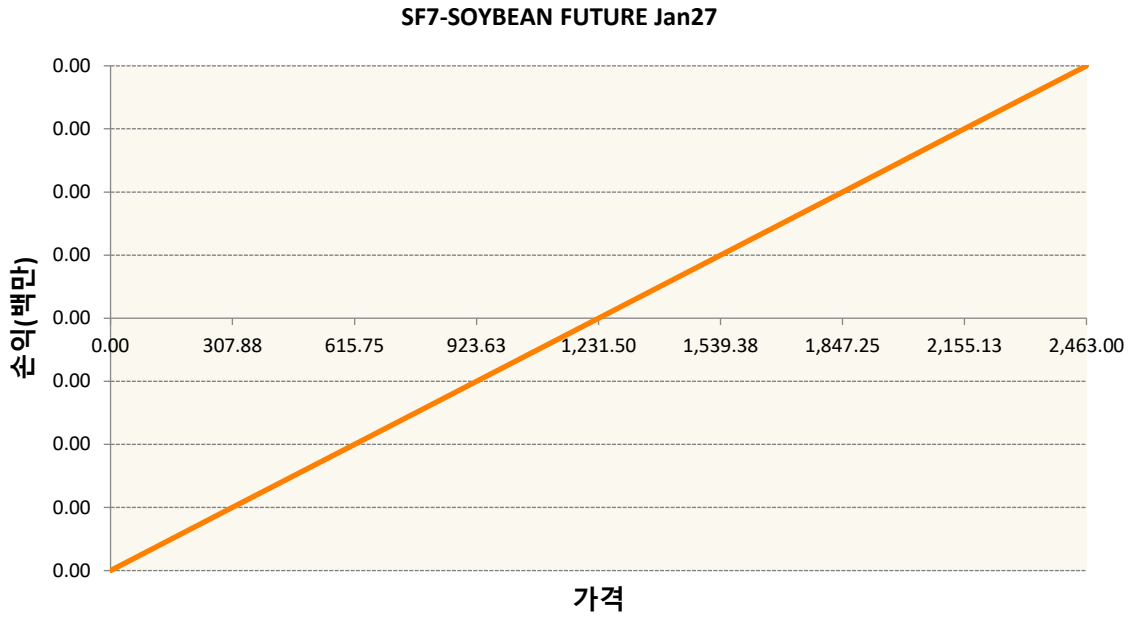
KWH7-KC HRW WHEAT FUT Mar27

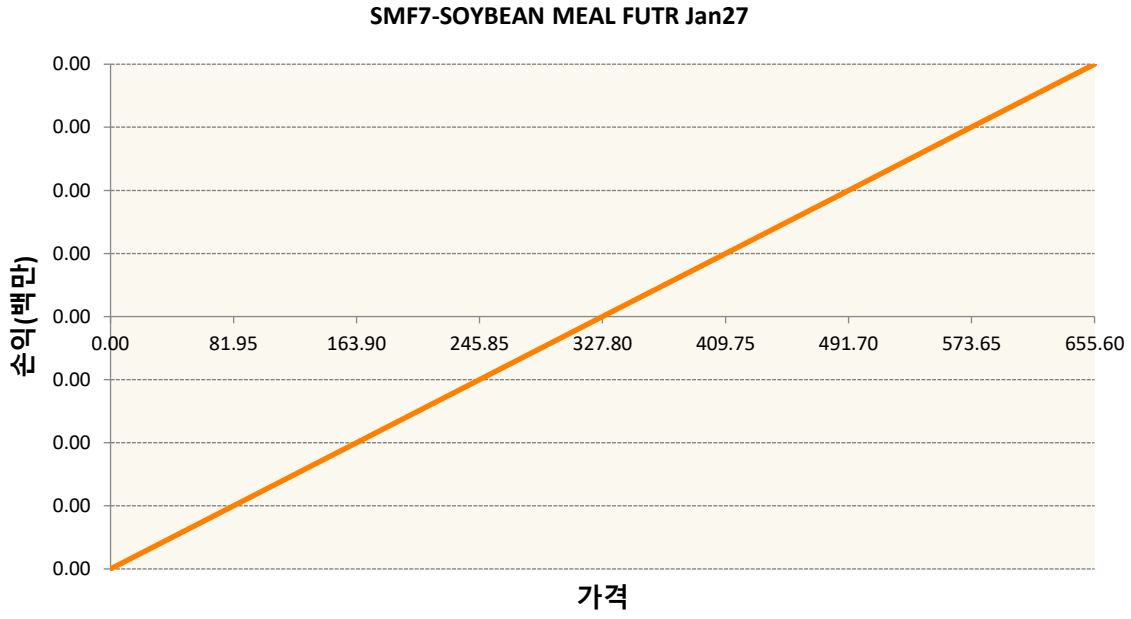


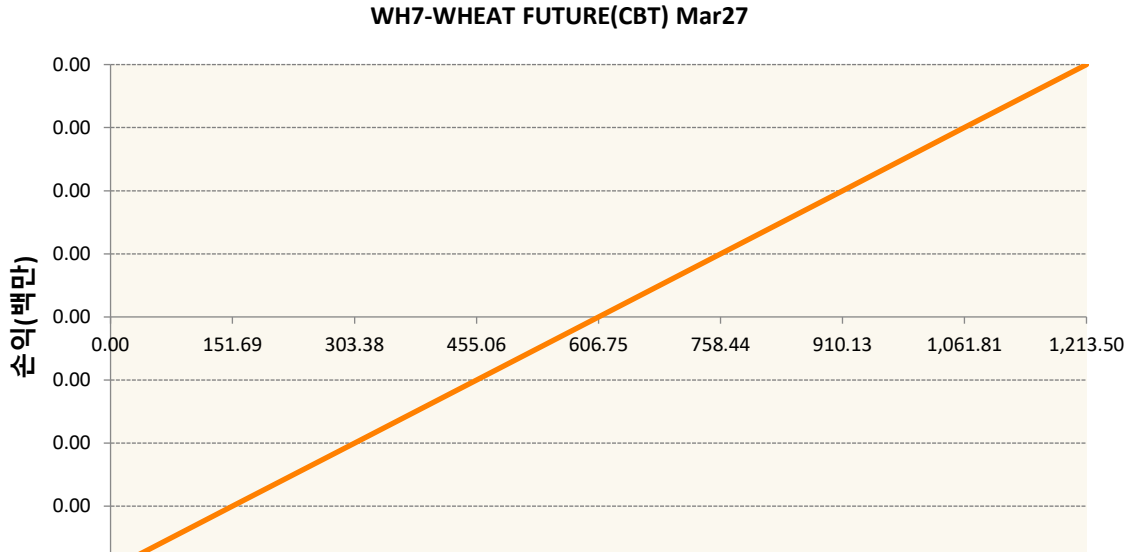
SBH7-SUGAR #11 (WORLD) MAR27




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
307.88
615.75
923.63
1,231.50
1,539.38
1,847.25
2,155.13
2,463.00
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
81.95
163.90
245.85
327.80
409.75
491.70
573.65
655.60
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
151.69
303.38
455.06
606.75
758.44
910.13
1,061.81
1,213.50
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	2026-11-17
기준일	2026-11-16

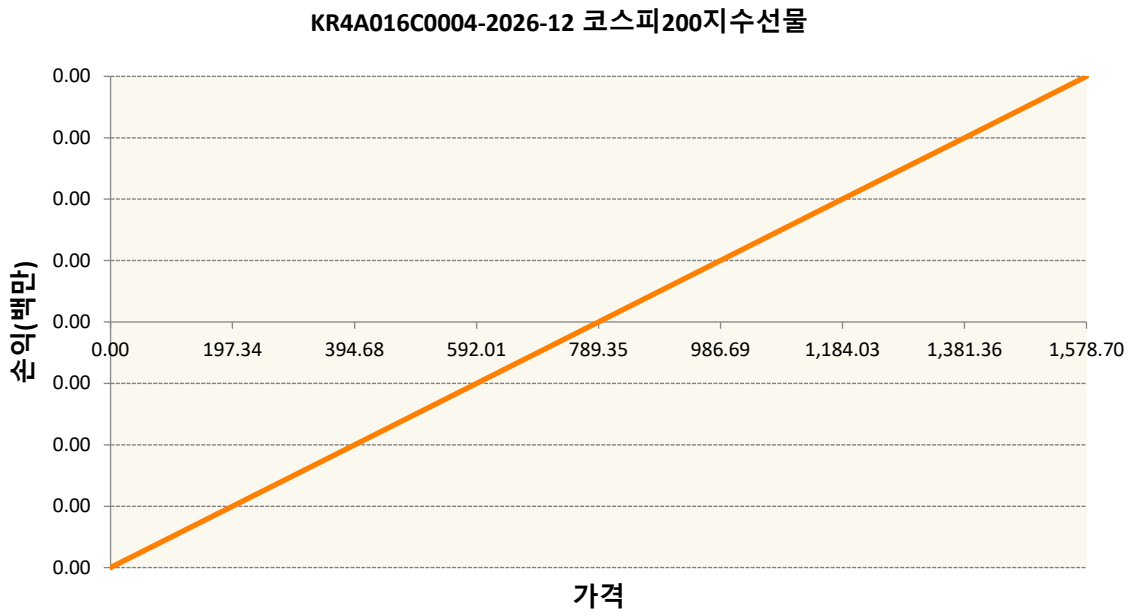
스마트인덱스모

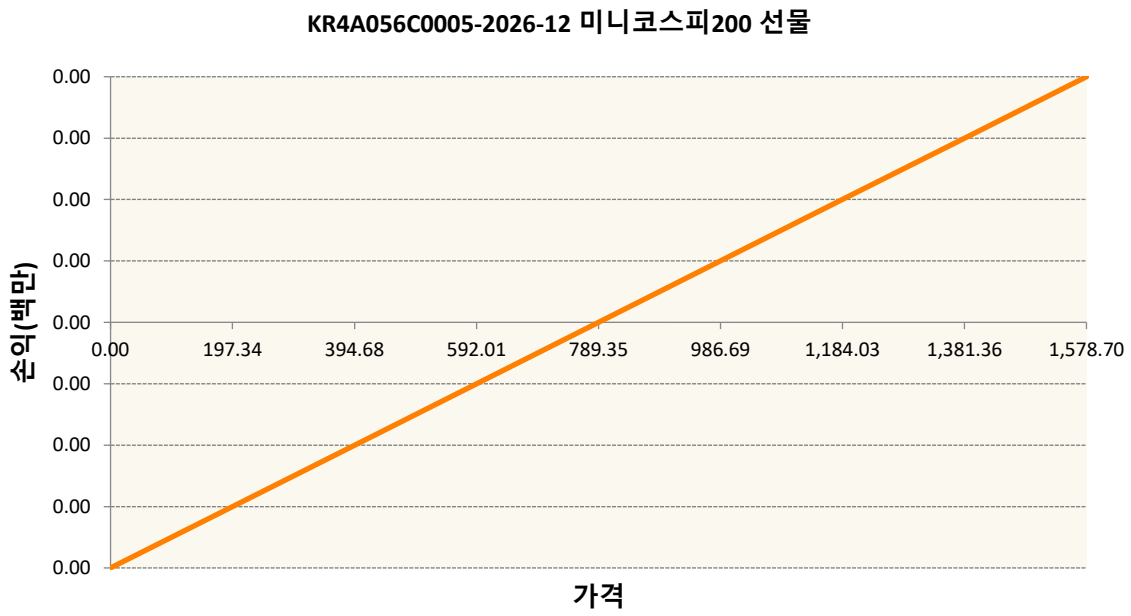
1. 계약금액

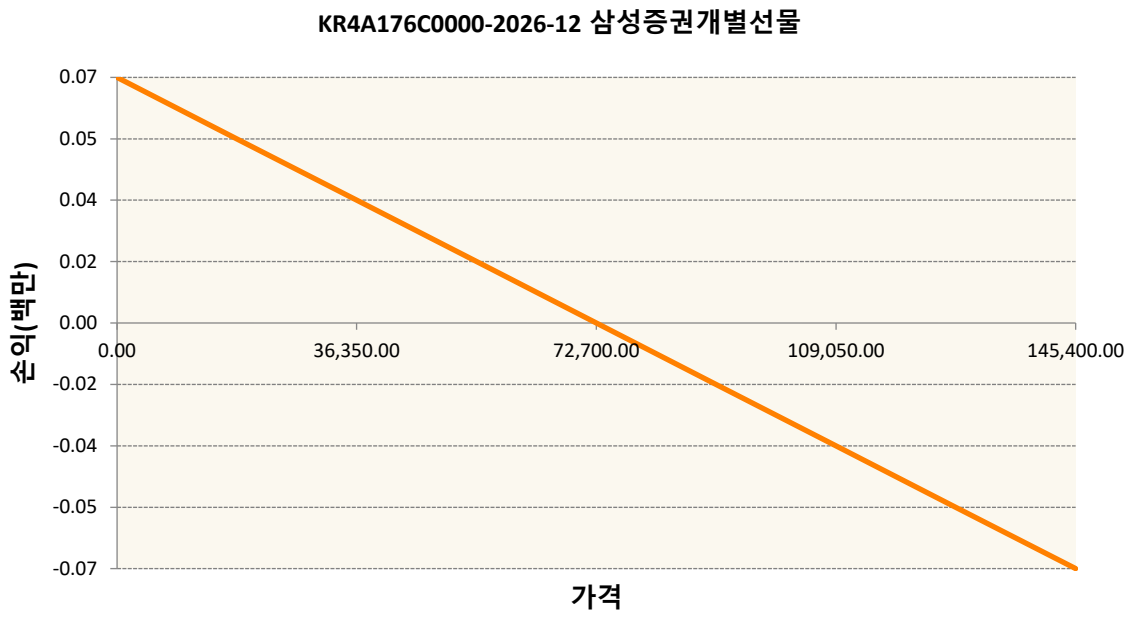
(단위:백만원)

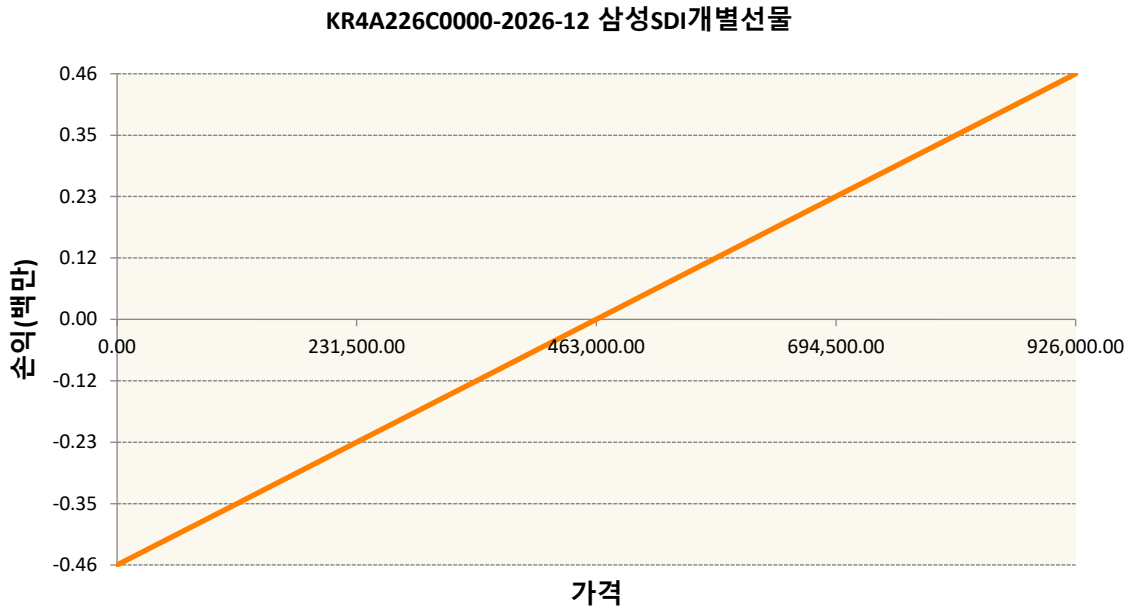
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	8,877	113	8,764	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

	KR4A016C0004	2026-12 코스피200지수선물					443
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-443	-443	-443	-443	-443	-443	-443
-5.33%	-296	-296	-296	-296	-296	-296	-296
-2.67%	-148	-148	-148	-148	-148	-148	-148
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	148	148	148	148	148	148	148
5.33%	296	296	296	296	296	296	296
8.00%	443	443	443	443	443	443	443
	KR4A056C0005	2026-12 미니코스피200 선물					51
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-51	-51	-51	-51	-51	-51	-51
-5.33%	-34	-34	-34	-34	-34	-34	-34
-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%	34	34	34	34	34	34	34
8.00%	51	51	51	51	51	51	51
	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%	-10	-10	-10	-10	-10	-10	-10
-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%	10	10	10	10	10	10	10
8.00%	16	16	16	16	16	16	16

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

1,794

공시일	2026-11-17
기준일	2026-11-16

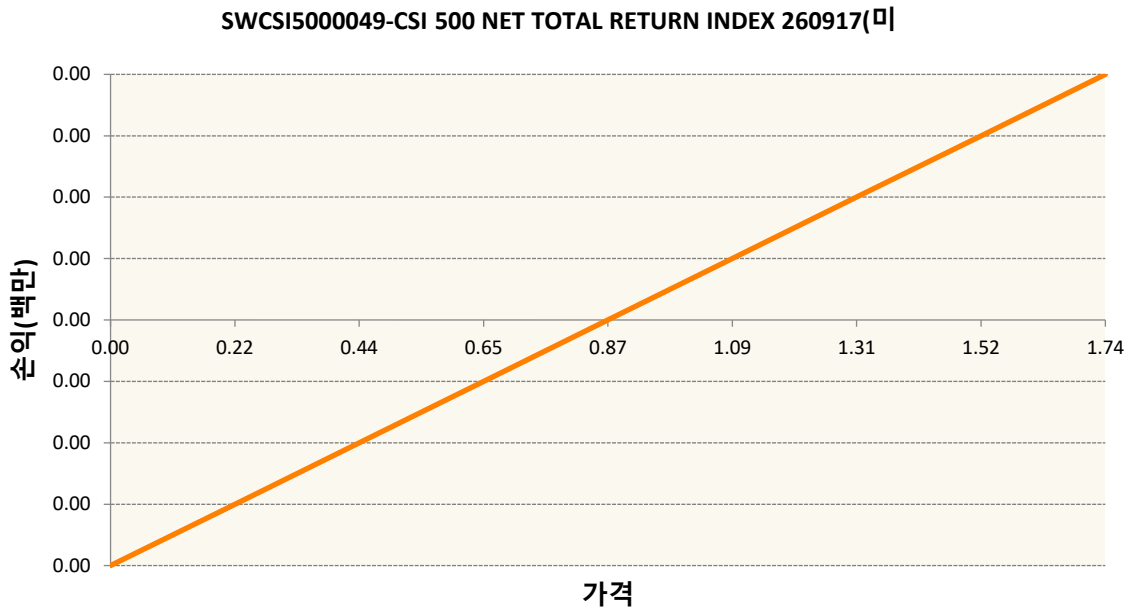
SOL차이나강소기업CSI500상장

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	4,629	0	4,629	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 CSI 500 NET TOTAL RETURN INDEX 260917(미	369

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

612

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2026-11-17
기준일	2026-11-16

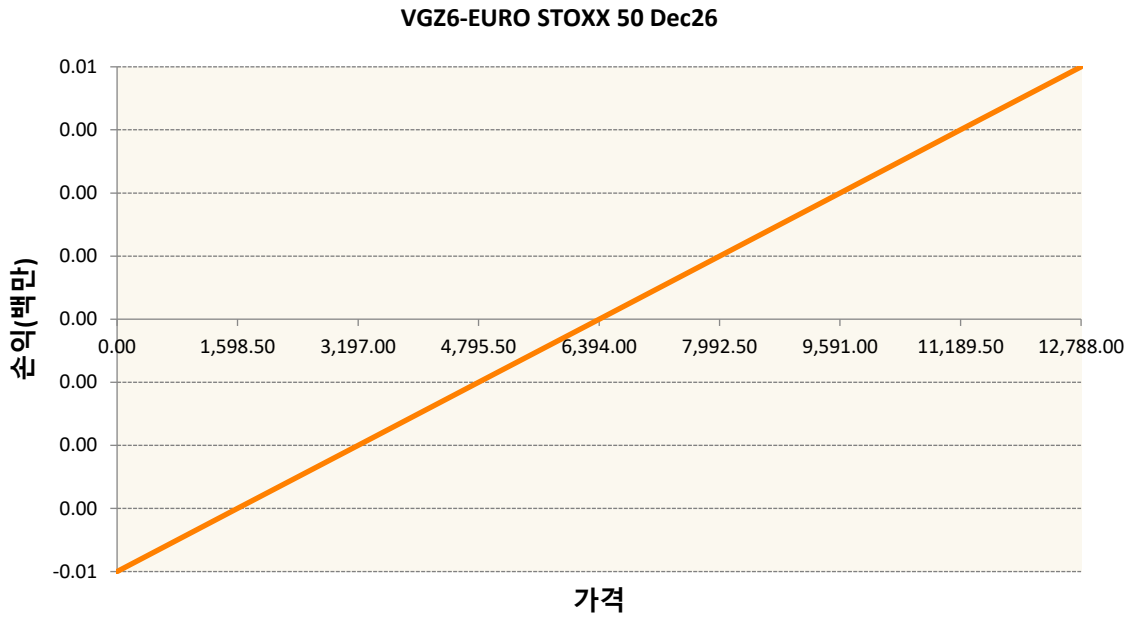
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,110	0	1,110	

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	2026-11-17
기준일	2026-11-16

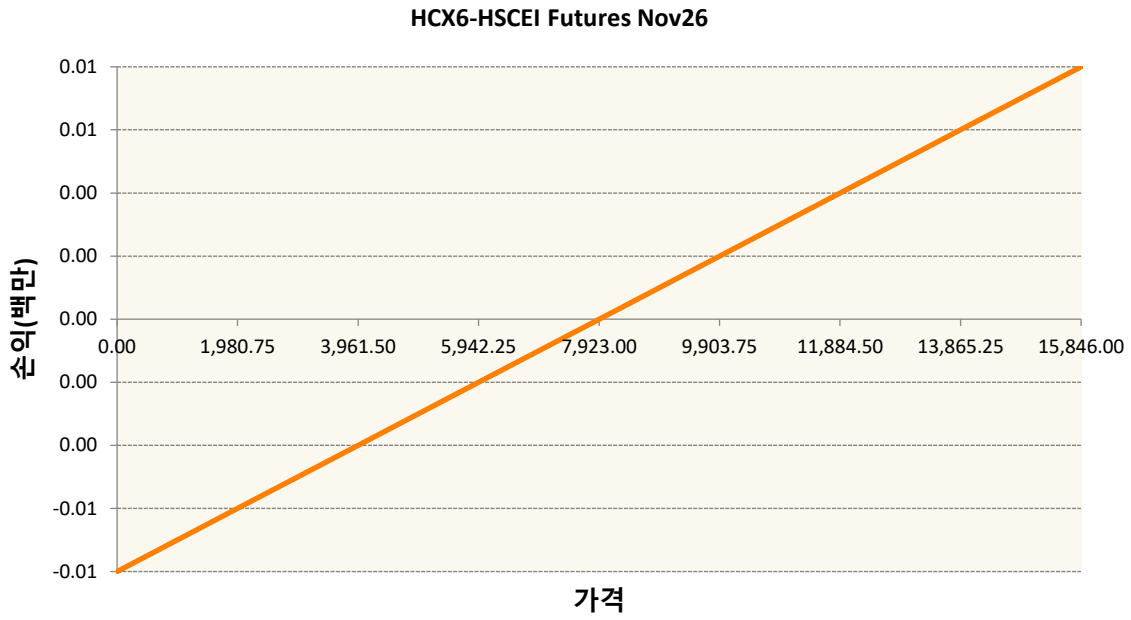
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,148	0	1,148	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCX6	HSCEI Futures Nov26	92

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

(단위:백만원)

87

공시일	2026-11-17
기준일	2026-11-16

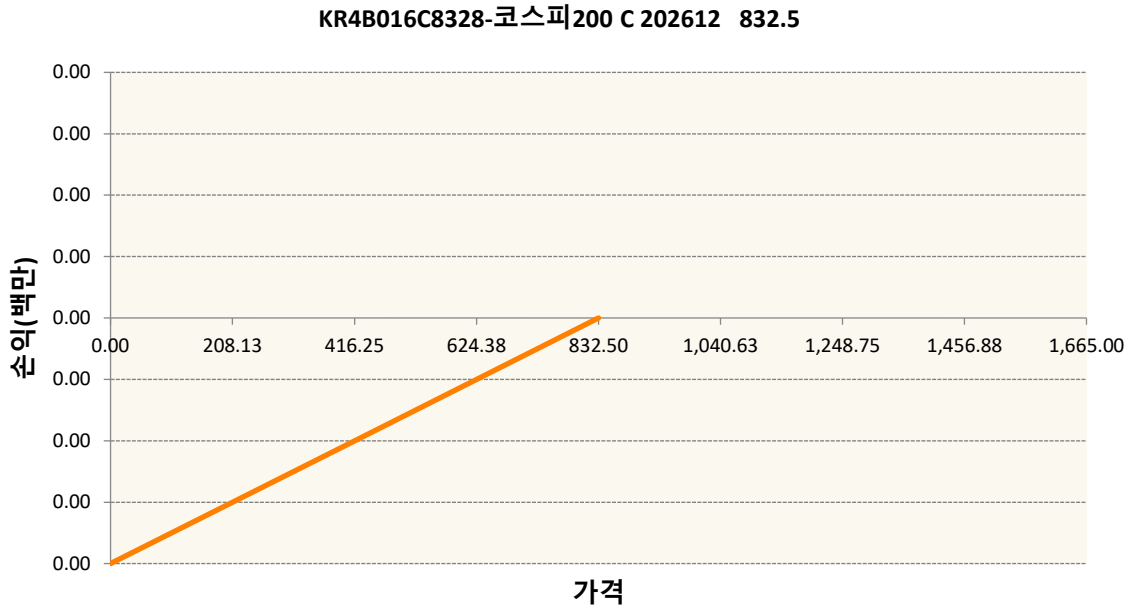
커버드콜모(주식혼합-파생형)

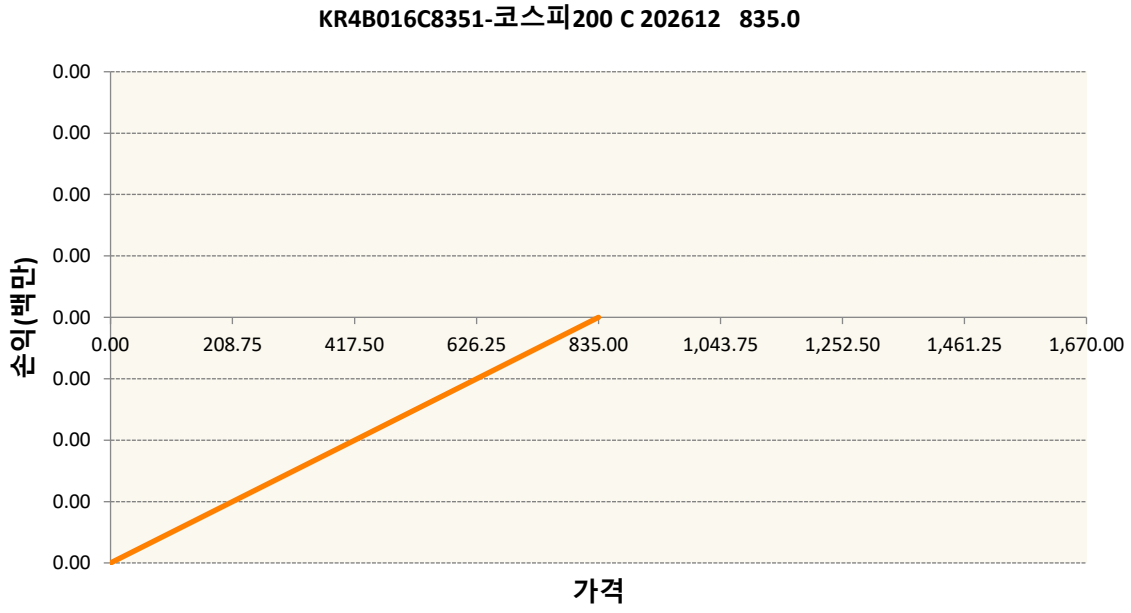
1. 계약금액

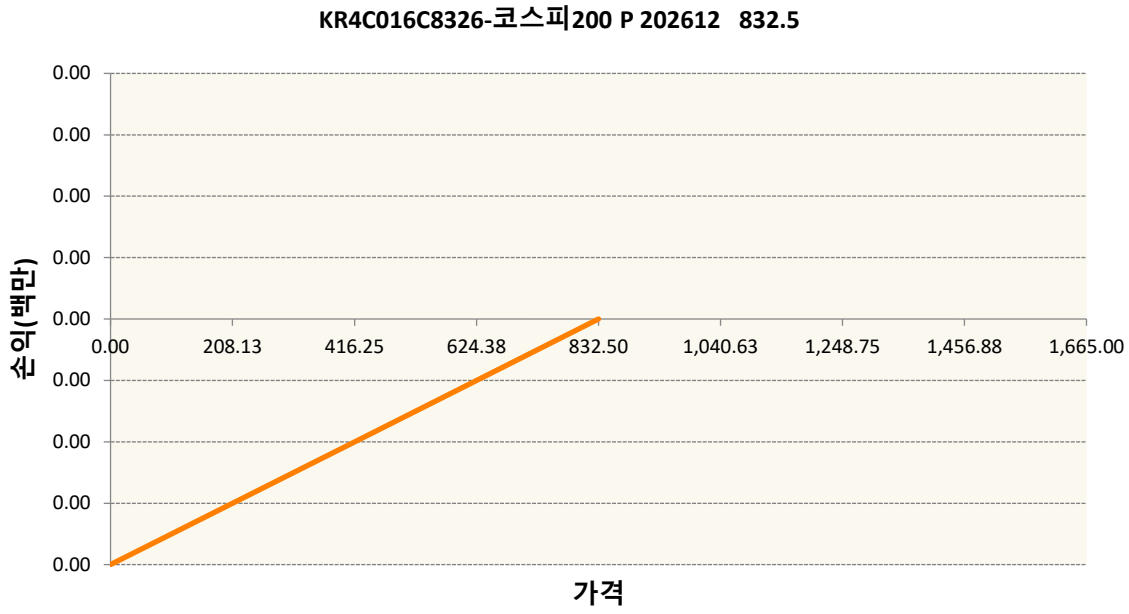
(단위:백만원)

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

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

	KR4B016C8328	코스피200 C 202612 832.5					1,028
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-742	-780	-822	-869	-919	-972	-1,028
-5.33%	-394	-443	-497	-553	-612	-673	-735
-2.67%	-74	-134	-198	-263	-329	-397	-466
0%	213	143	72	0	-73	-146	-219
2.67%	463	387	310	234	157	80	4
5.33%	675	596	517	439	360	282	203
8.00%	849	771	694	616	537	459	380
	KR4B016C8351	코스피200 C 202612 835.0					1,140
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-830	-871	-917	-968	-1,022	-1,080	-1,140
-5.33%	-444	-497	-555	-617	-681	-747	-815
-2.67%	-87	-153	-222	-293	-366	-440	-515
0%	233	157	79	0	-80	-160	-241
2.67%	513	430	346	262	177	93	8
5.33%	752	665	578	491	404	318	231
8.00%	948	862	776	690	603	516	429
	KR4C016C8326	코스피200 P 202612 832.5					474
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-342	-360	-380	-401	-424	-449	-474
-5.33%	-182	-205	-229	-255	-282	-311	-339
-2.67%	-34	-62	-91	-121	-152	-183	-215
0%	98	66	33	0	-34	-67	-101

2.67%	214	179	143	108	73	37	2
5.33%	311	275	239	203	166	130	94
8.00%	392	356	320	284	248	212	176

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

4,178

공시일	2026-11-17
기준일	2026-11-16

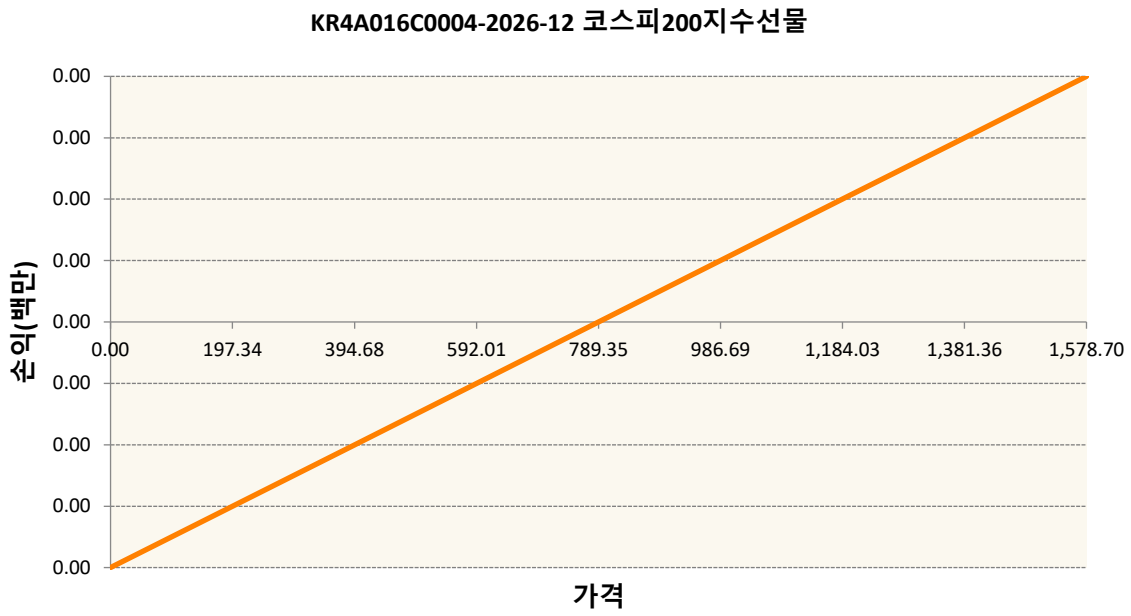
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

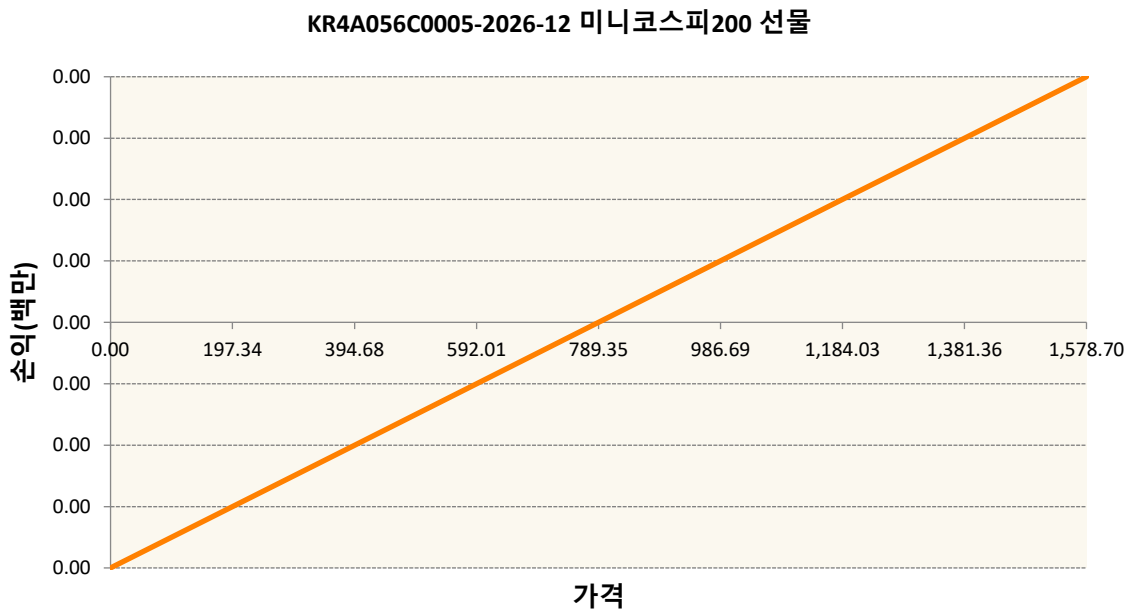
1. 계약금액

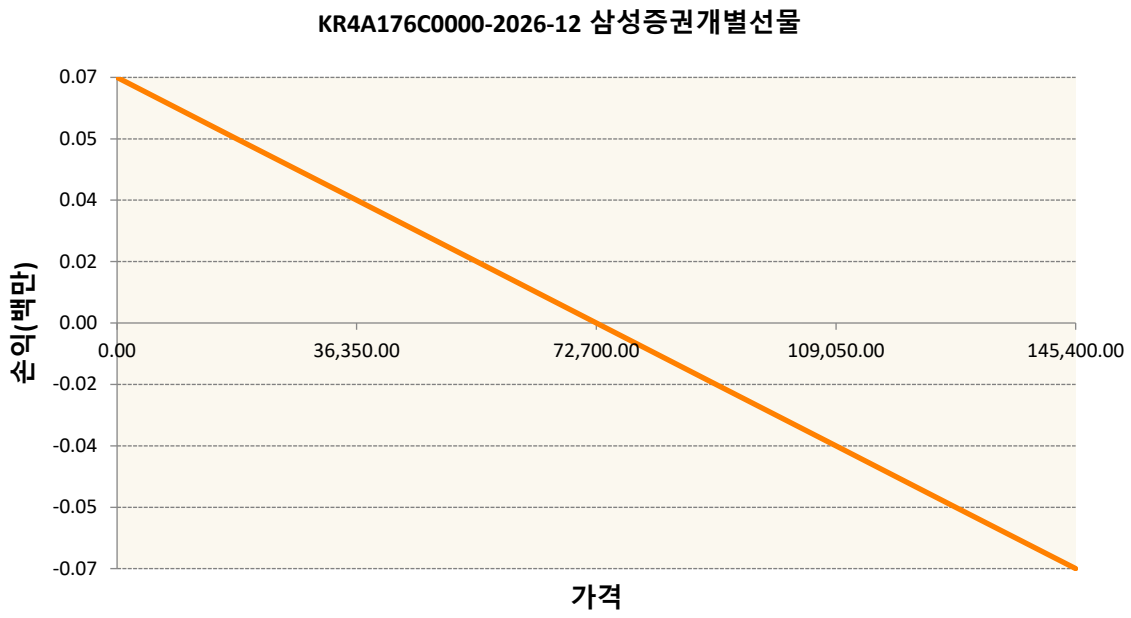
(단위:백만원)

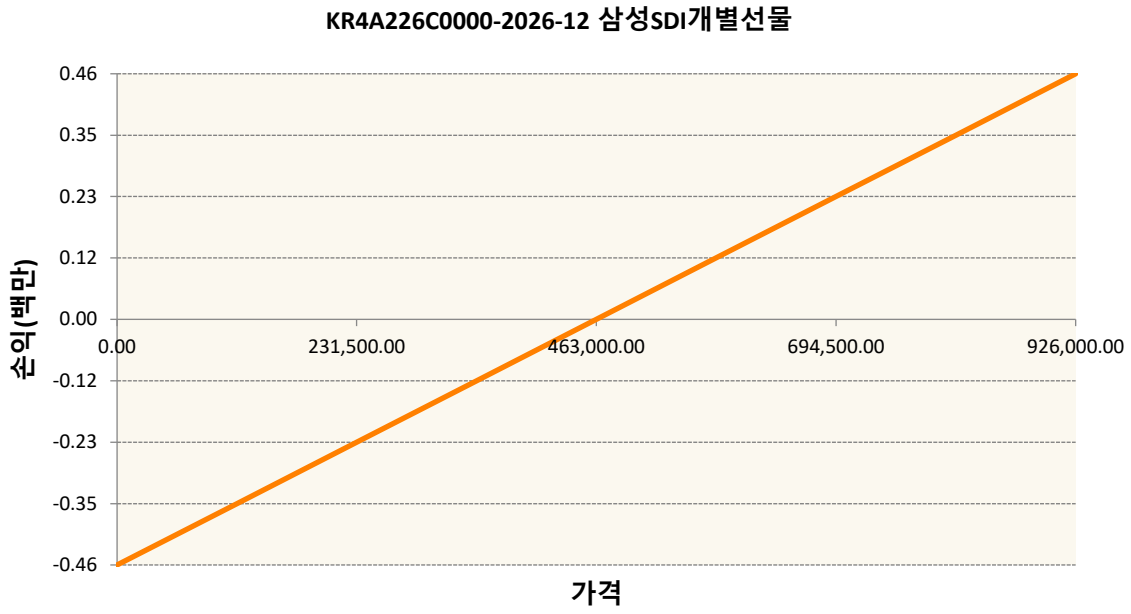
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	199	-199	장내
누계	유가증권	선물	1,813	22	1,791	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4A016C0004	2026-12 코스피200지수선물						47
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-47	-47	-47	-47	-47	-47	-47
-5.33%	-32	-32	-32	-32	-32	-32	-32
-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%	32	32	32	32	32	32	32
8.00%	47	47	47	47	47	47	47
KR4A056C0005	2026-12 미니코스피200 선물						19
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-19	-19	-19	-19	-19	-19	-19
-5.33%	-13	-13	-13	-13	-13	-13	-13
-2.67%	-6	-6	-6	-6	-6	-6	-6
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	6	6	6	6	6	6	6
5.33%	13	13	13	13	13	13	13
8.00%	19	19	19	19	19	19	19
	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

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

244

공시일	2026-11-17
기준일	2026-11-16

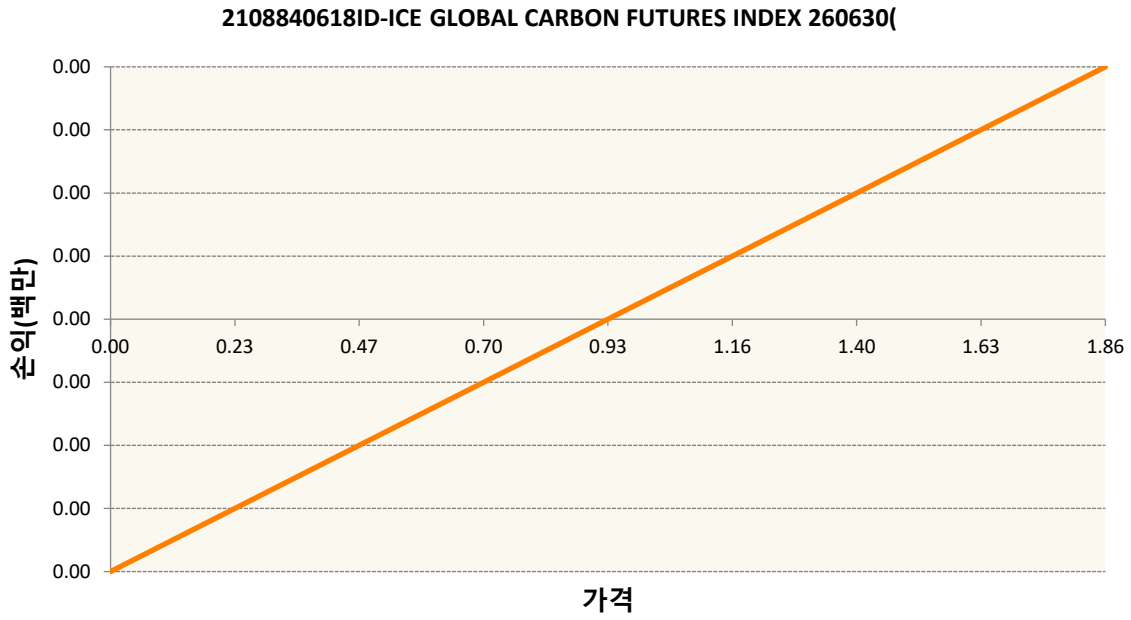
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

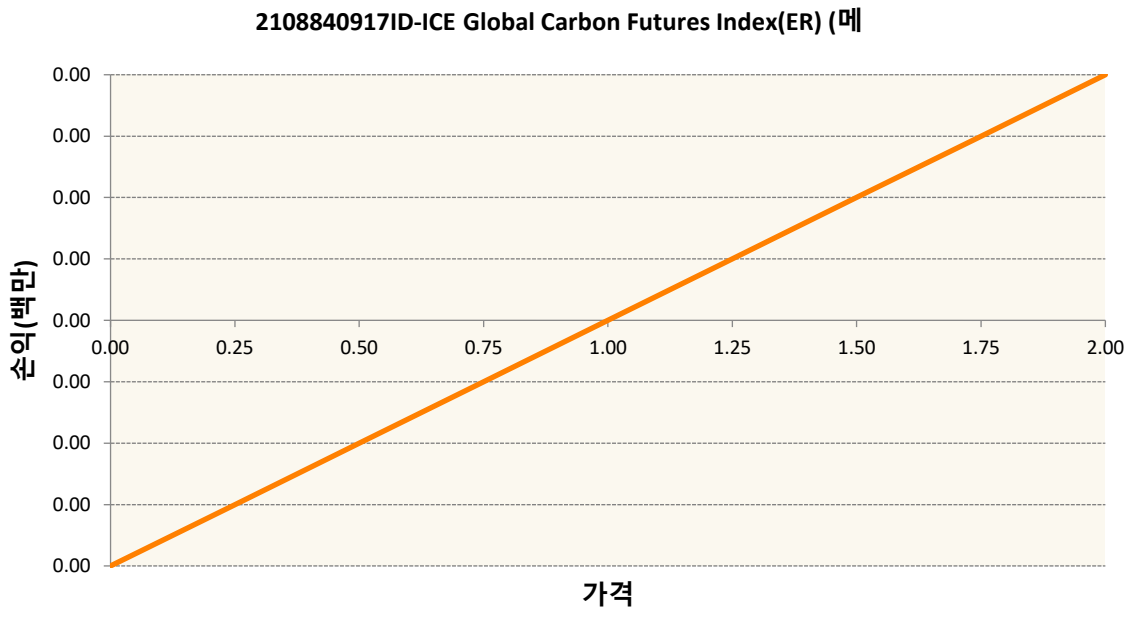
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	7,075	0	7,075	장외

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2108840618ICE GLOBAL CARBON FUTURES INDEX 260630(	451
2108840917ICE Global Carbon Futures Index(ER) (메	114

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

582

공시일	2026-11-17
기준일	2026-11-16

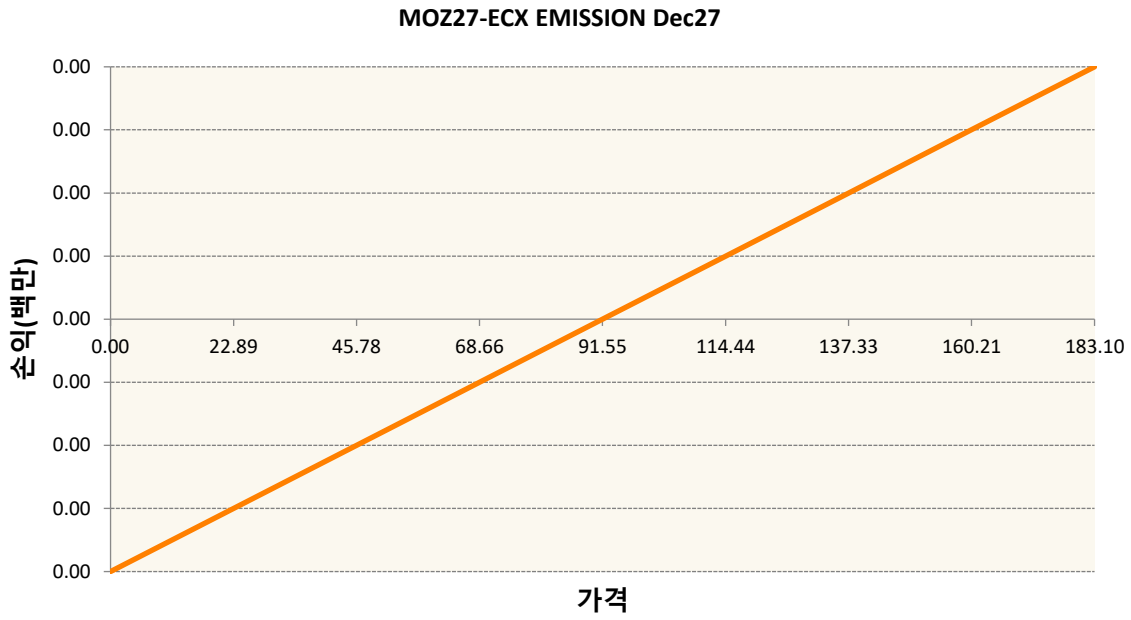
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	5,860	0	5,860	
누계	통화	선도	0	2,758	-2,758	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213GAV KRW/EUR 30-11-26E	221
MOZ27 ECX EMISSION Dec27	469

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

(단위:백만원)

715

공시일	2026-11-17
기준일	2026-11-16

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(	17
SWSOL0000(CSI PHOTOVOLTAIC INDUSTRY INDEX 260923(	29

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

(단위:백만원)

108

공시일	2026-11-17
기준일	2026-11-16

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	-6,249	0	-6,249	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 251218(NH)	52
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 260714(미래)	335
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 260917(메리츠)	110

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

(단위:백만원)

988

공시일	2026-11-17
기준일	2026-11-16

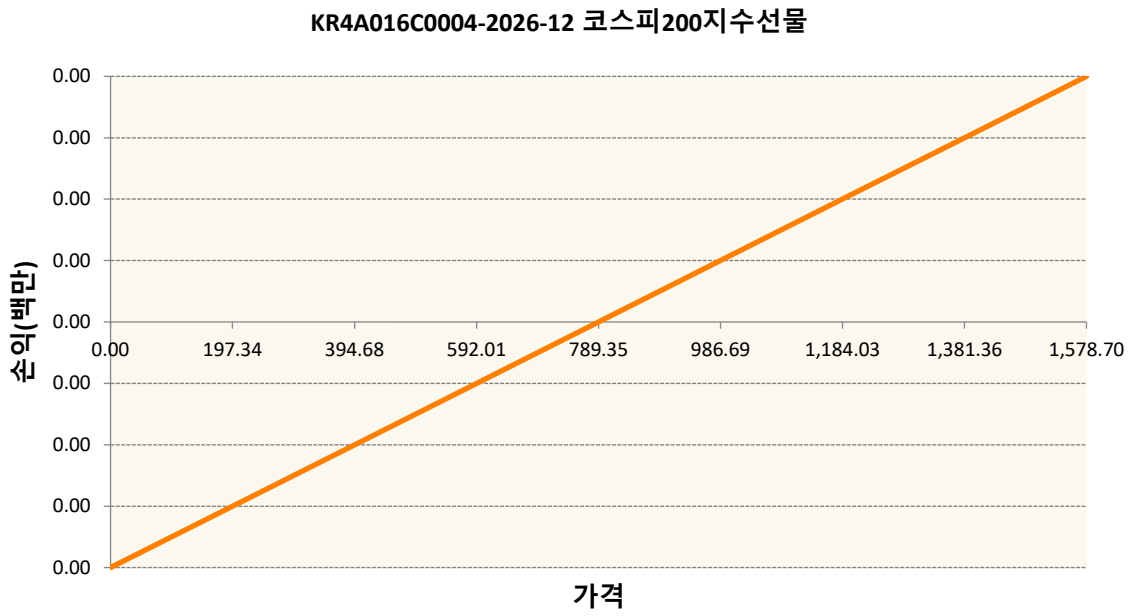
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

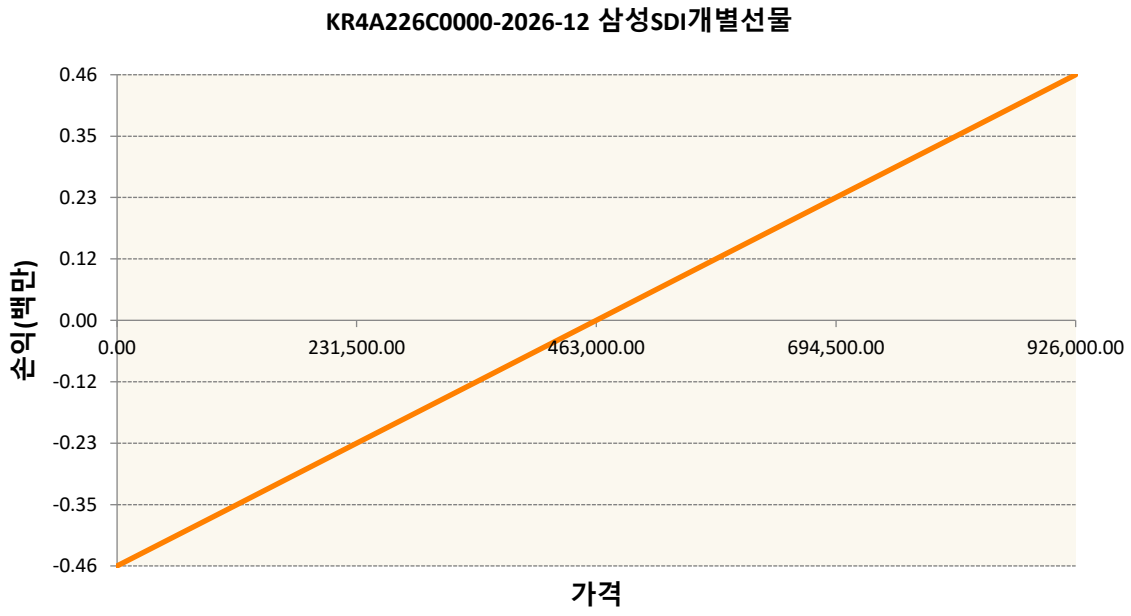
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	1,574	399	1,175	장내
누계	유가증권	선물	11,707	0	11,707	장내

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4A016C0004	2026-12 코스피200지수선물						902
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-902	-902	-902	-902	-902	-902	-902
-5.33%	-602	-602	-602	-602	-602	-602	-602
-2.67%	-301	-301	-301	-301	-301	-301	-301
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	301	301	301	301	301	301	301
5.33%	602	602	602	602	602	602	602
8.00%	902	902	902	902	902	902	902

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%	-24	-24	-24	-24	-24	-24	-24
-2.67%	-12	-12	-12	-12	-12	-12	-12
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	12	12	12	12	12	12	12
5.33%	24	24	24	24	24	24	24
8.00%	37	37	37	37	37	37	37

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

3,298

공시일	2026-11-17
기준일	2026-11-16

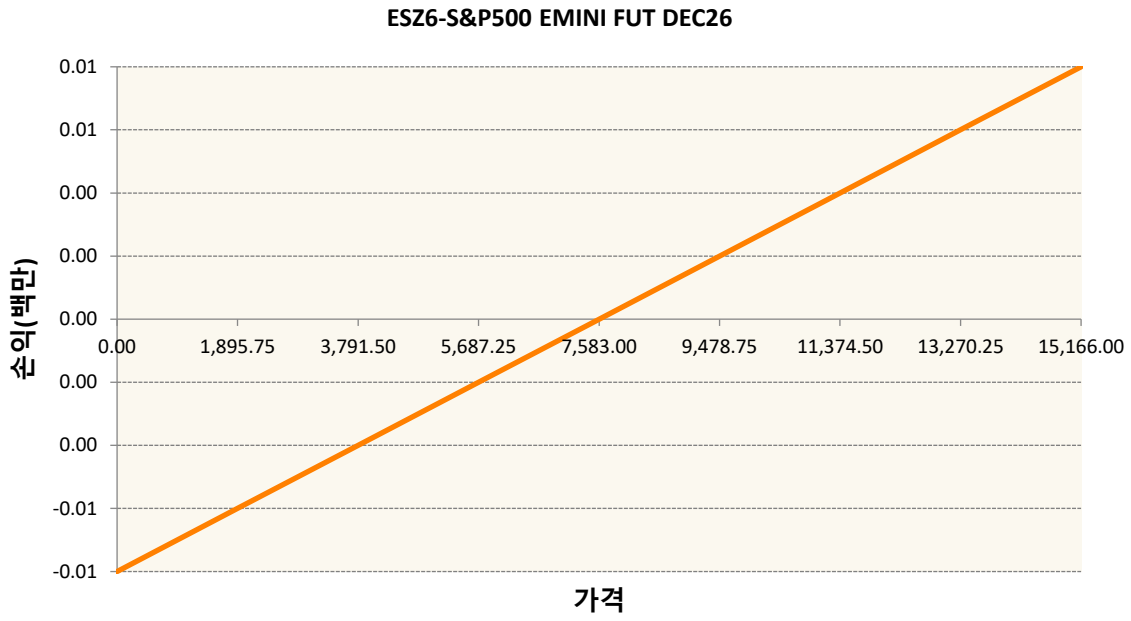
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

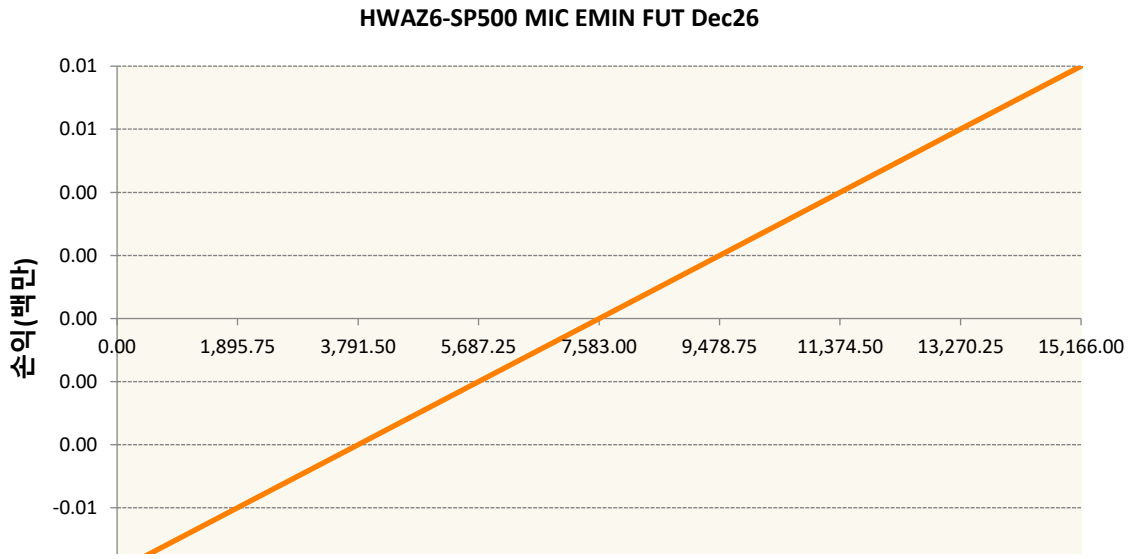
1. 계약금액

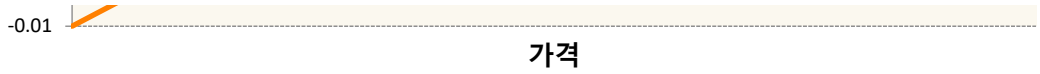
(단위:백만원)

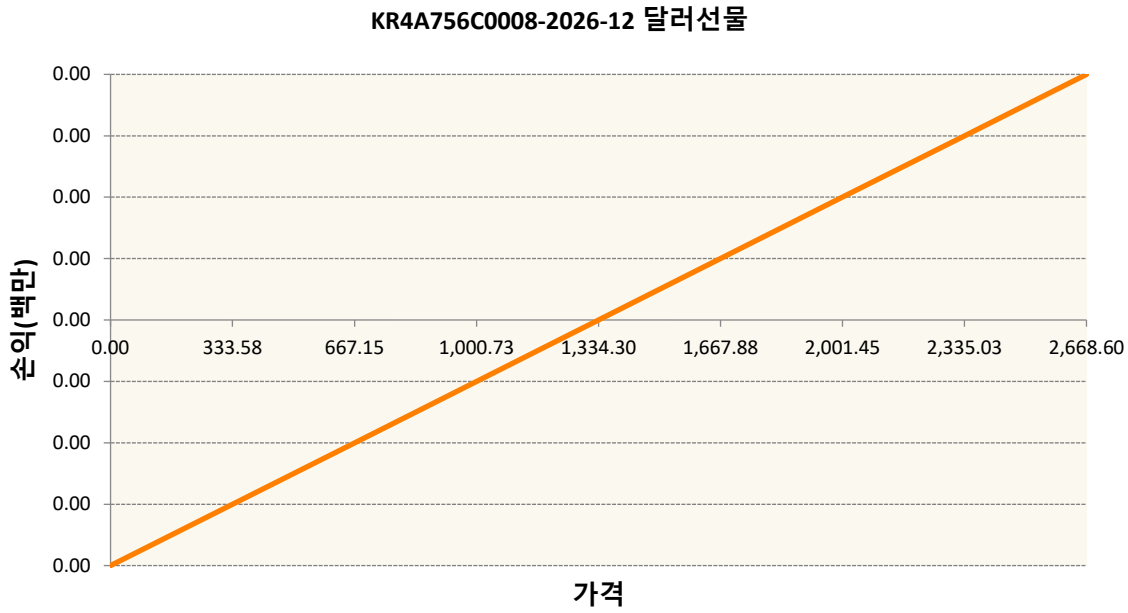
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
신규	지수	선물	0	0	0	장내
신규	통화	선물	1,201	0	1,201	장내
누계	지수	선물	75,315	0	75,315	
누계	지수	선물	367	0	367	장내
누계	통화	선물	22,550	0	22,550	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

ESZ6	S&P500 EMINI FUT DEC26	6,025
HWAZ6	SP500 MIC EMIN FUT Dec26	29
KR4A756C00	2026-12 달러선물	1,804

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

3,856

공시일	2026-11-17
기준일	2026-11-16

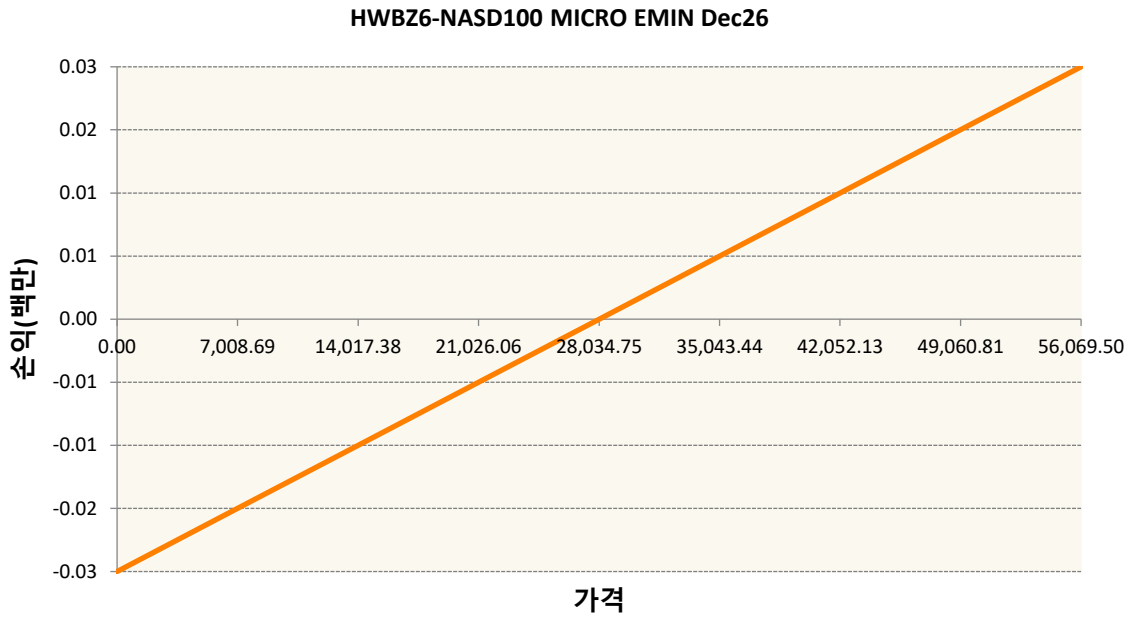
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

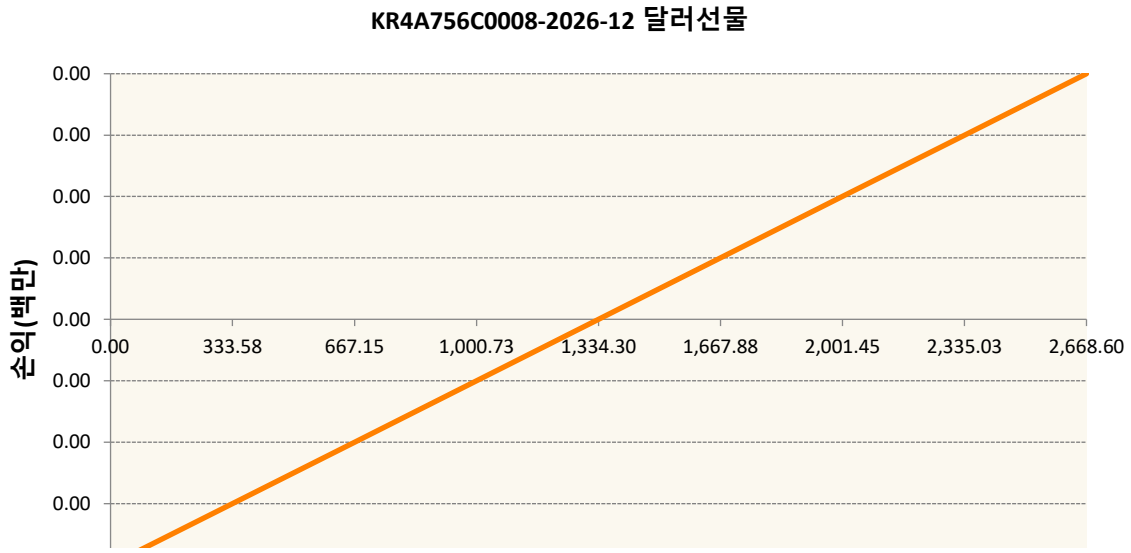
1. 계약금액

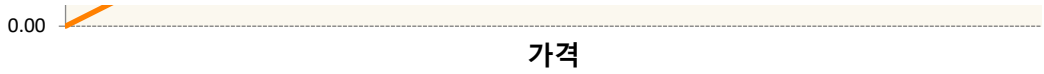
(단위:백만원)

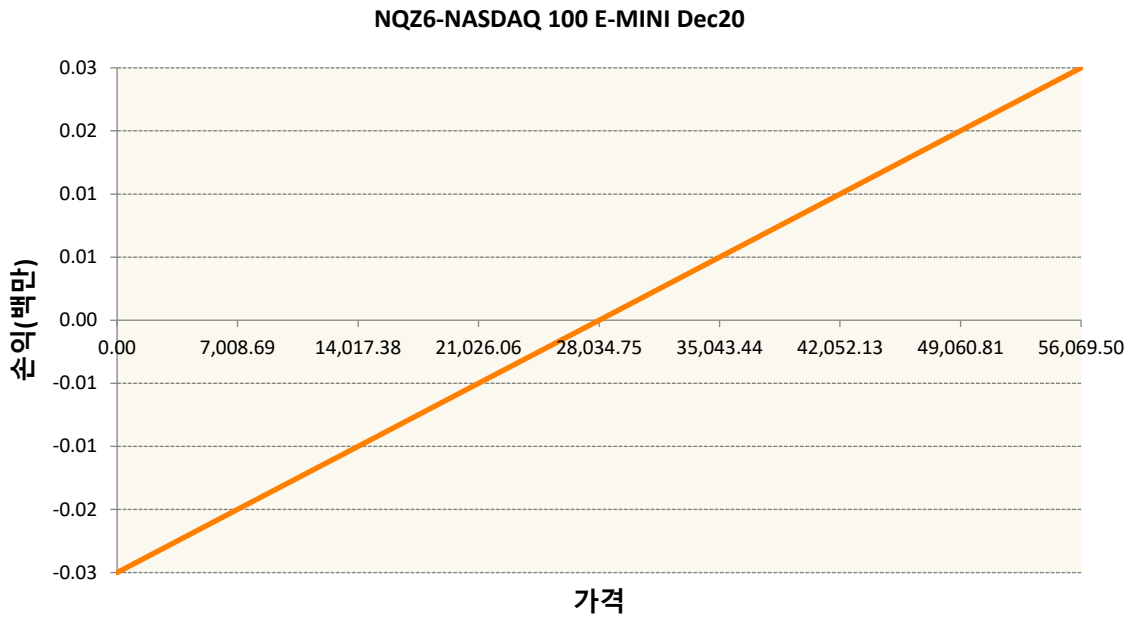
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
신규	지수	선물	0	0	0	장내
신규	통화	선물	400	0	400	장내
누계	지수	선물	31,014	0	31,014	
누계	지수	선물	388	0	388	장내
누계	통화	선물	10,221	0	10,221	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HWBZ6	NASD100 MICRO EMIN Dec26	31
KR4A756C00	2026-12 달러선물	818
NQZ6	NASDAQ 100 E-MINI Dec20	2,481

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	2,419

공시일	2026-11-17
기준일	2026-11-16

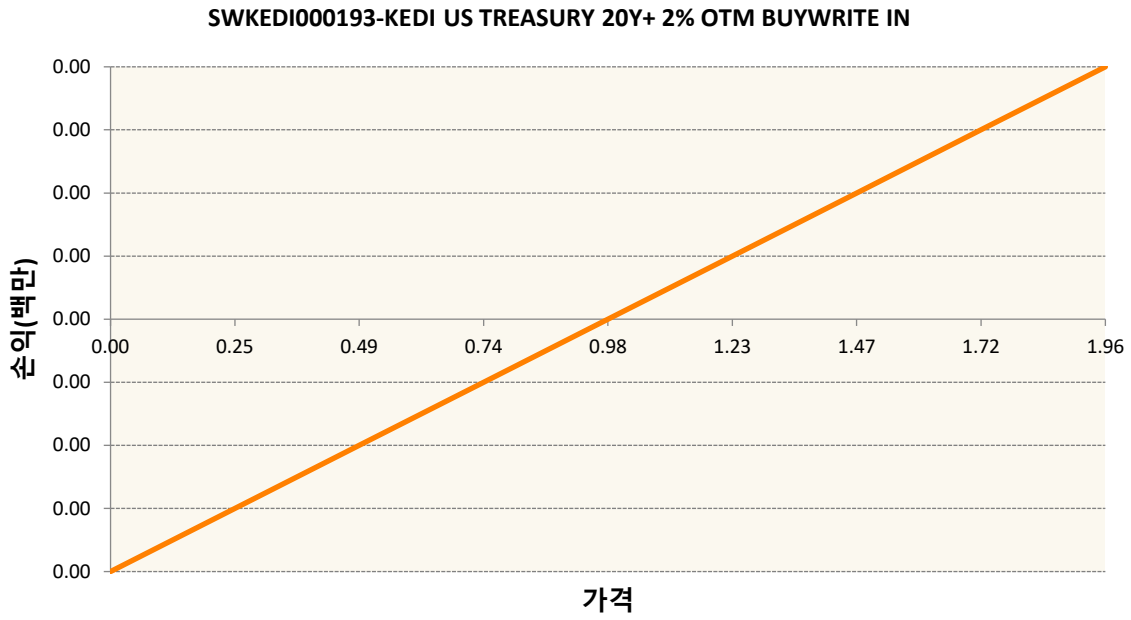
SOL미국30년국채커버드콜(합성)

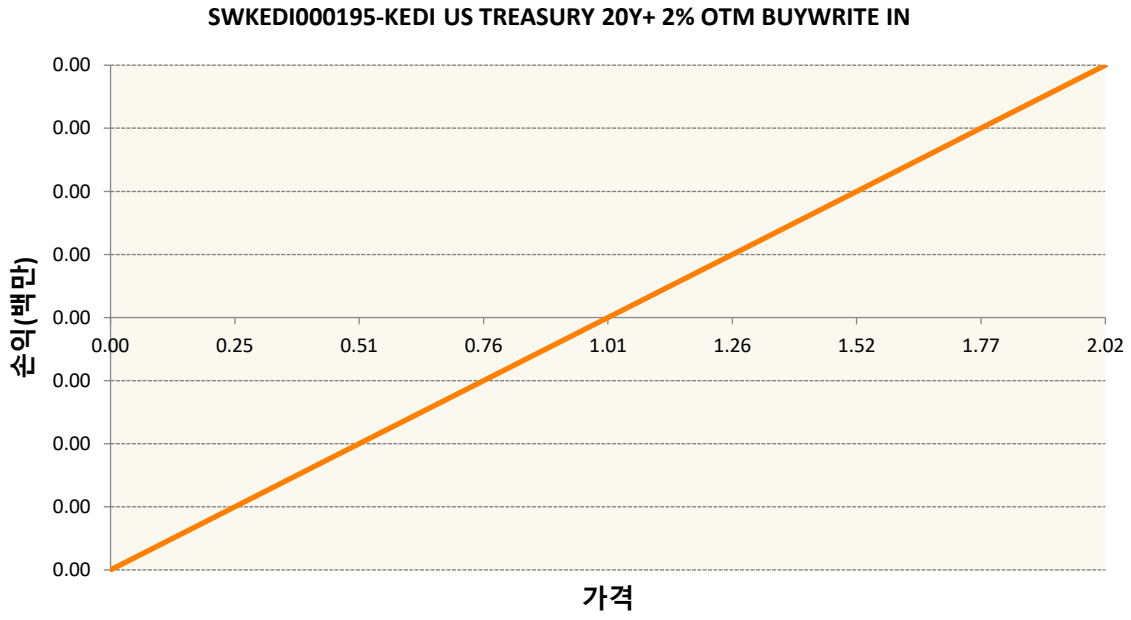
1. 계약금액

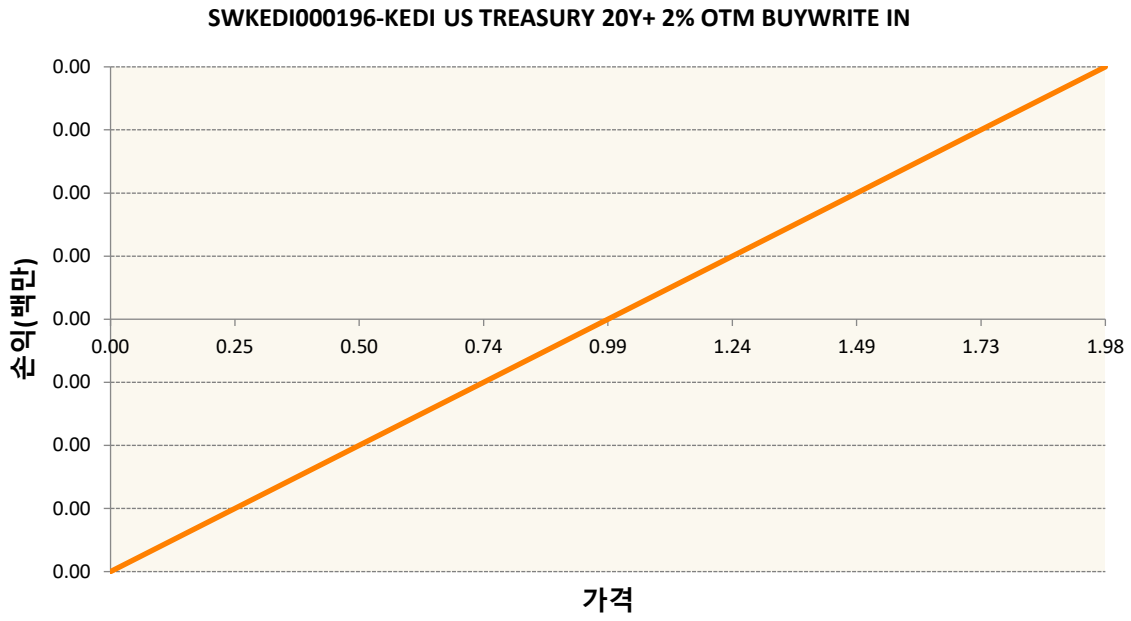
(단위:백만원)

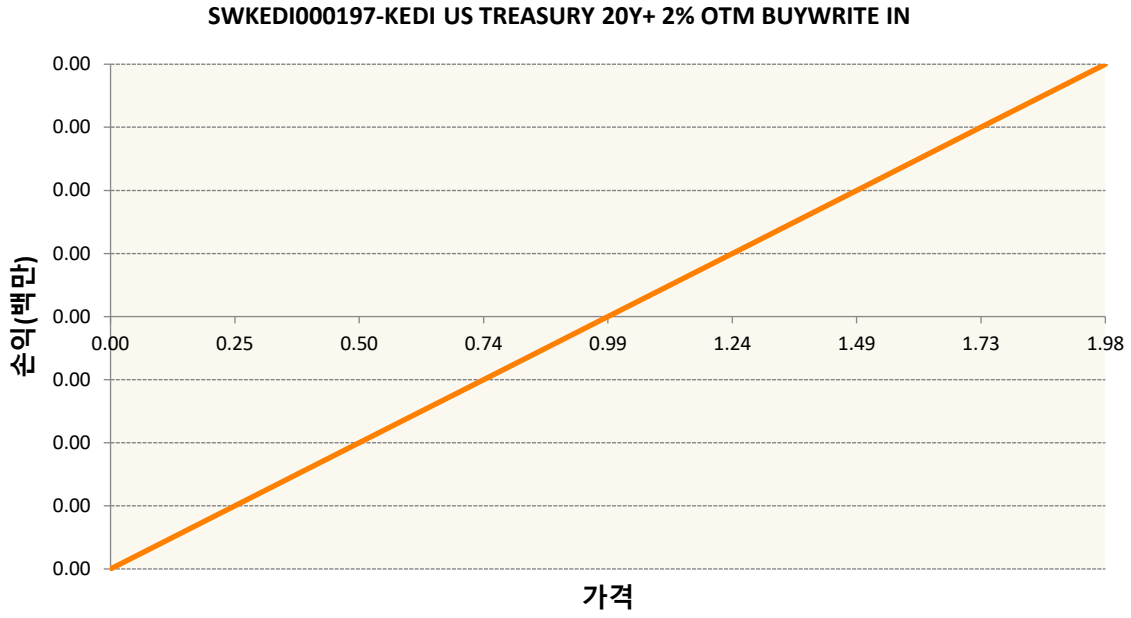
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	274,397	0	274,397	장외

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	6,925
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	7,803
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	2,567
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	4,660

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

8,536