공시일	2026-11-18
기준일	2026-11-17

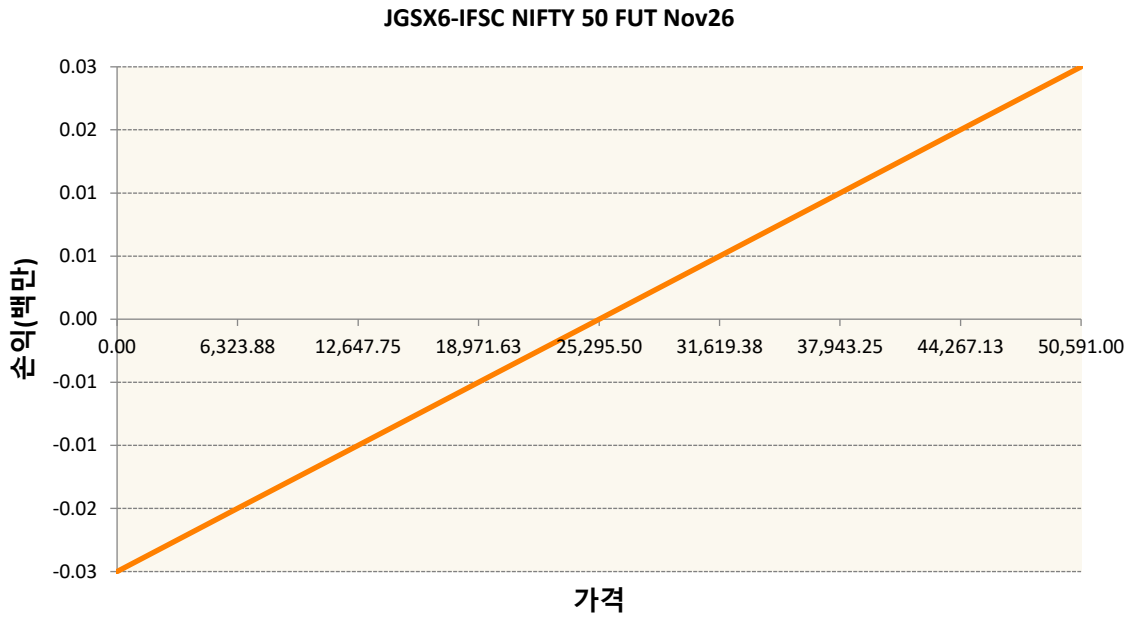
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

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	2026-11-18
기준일	2026-11-17

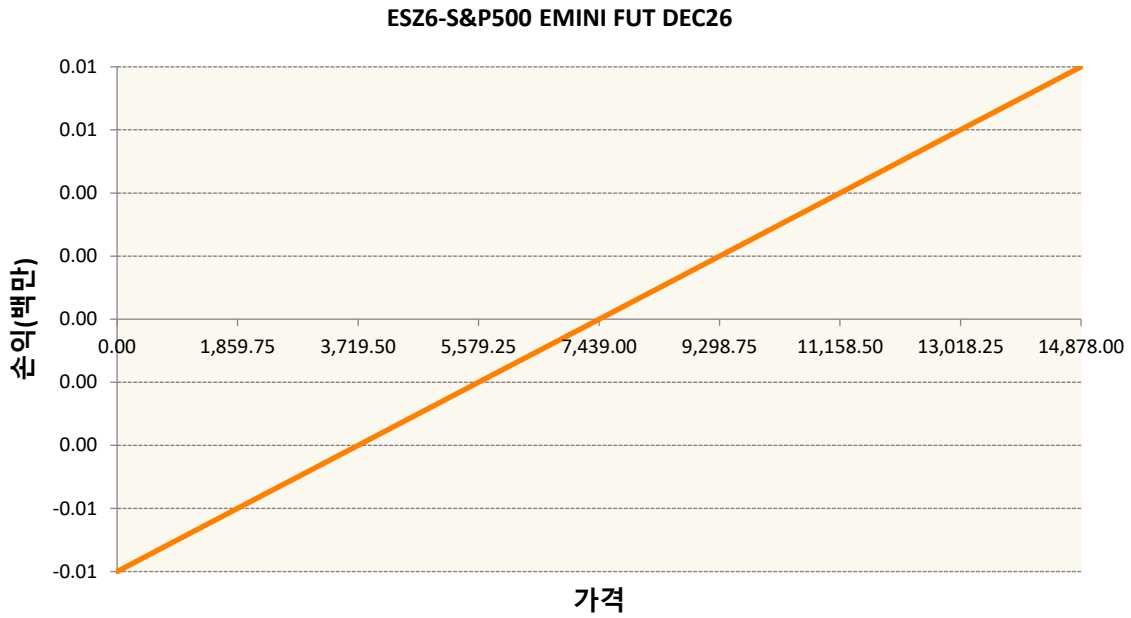
SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	515	0	515	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

ESZ6	S&P500 EMINI FUT DEC26	41

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

(단위:백만원)

26

공시일	2026-11-18
기준일	2026-11-17

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	2026-11-18
기준일	2026-11-17

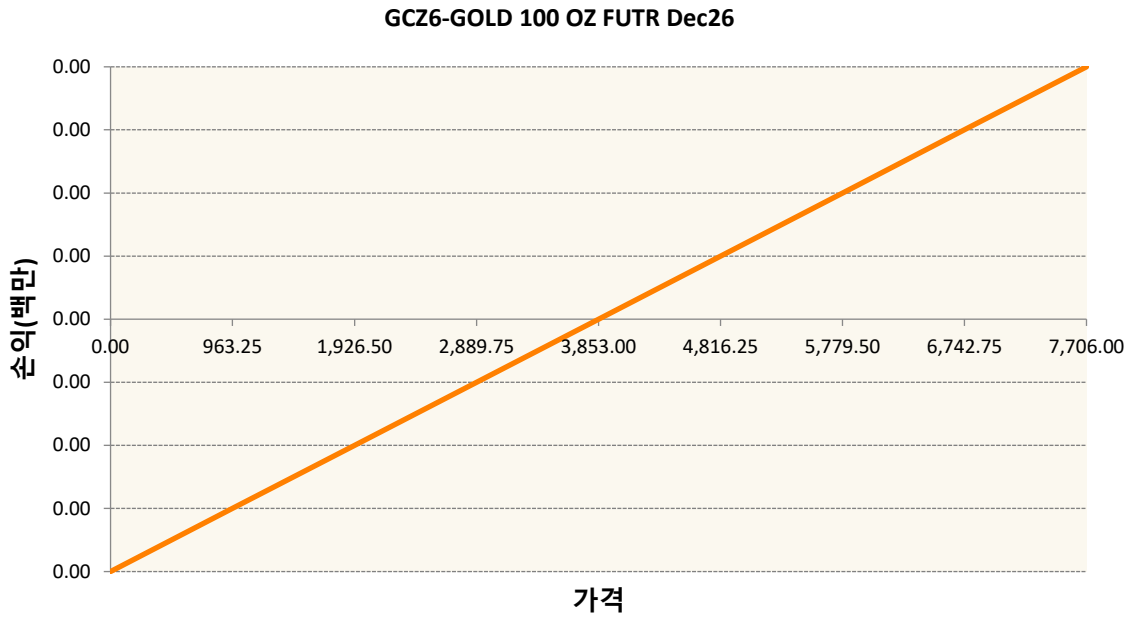
SOL골드커버드콜액티브특별자산상장지수(금

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			5,516	0	5,516	
누계	실물자산	옵션	0	0	0	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

AOGLDUSC3 GLD US 11/20/26 C365 EQUITY	3
GCZ6 GOLD 100 OZ FUTR Dec26	441

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

(단위:백만원)

573

공시일	2026-11-18
기준일	2026-11-17

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	126
AOPLTRAP17 PLTR US 11/20/26 P177.5 EQUITY	17

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

(단위:백만원)

493

공시일	2026-11-18
기준일	2026-11-17

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	2026-11-18
기준일	2026-11-17

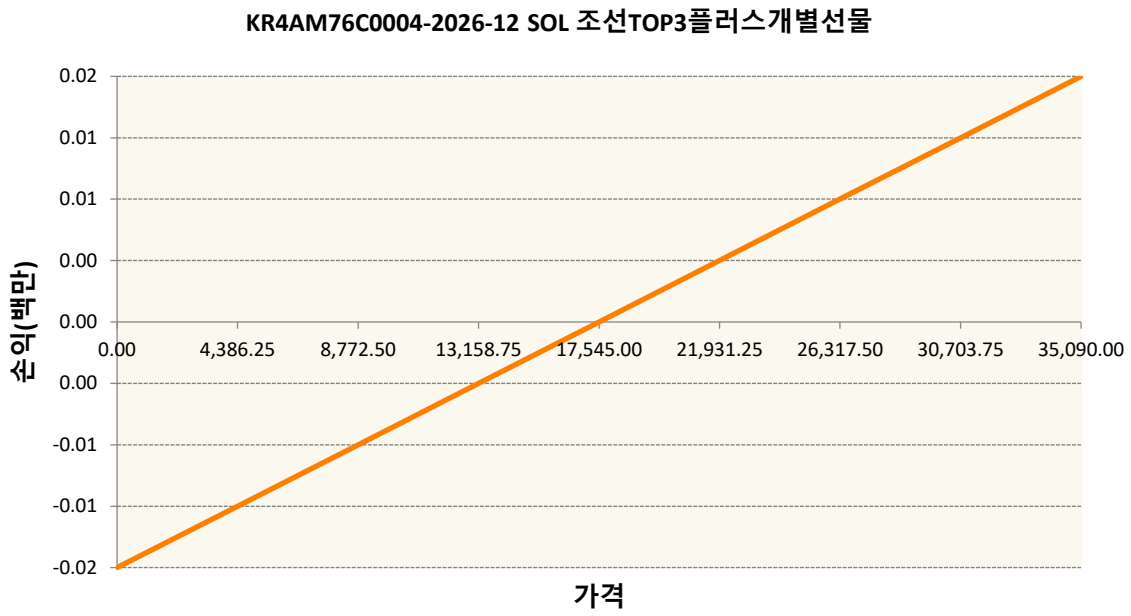
SOL조선TOP3플러스레버리지상장지수(주식)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	88	-88	장내
누계	유가증권	선물	4,754	0	4,754	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4AM76C0004	2026-12 SOL 조선TOP3플러스개별선물						3,792
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-3,792	-3,792	-3,792	-3,792	-3,792	-3,792	-3,792
-5.33%	-2,528	-2,528	-2,528	-2,528	-2,528	-2,528	-2,528
-2.67%	-1,264	-1,264	-1,264	-1,264	-1,264	-1,264	-1,264
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	1,264	1,264	1,264	1,264	1,264	1,264	1,264
5.33%	2,528	2,528	2,528	2,528	2,528	2,528	2,528
8.00%	3,792	3,792	3,792	3,792	3,792	3,792	3,792

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

6,482

공시일	2026-11-18
기준일	2026-11-17

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	2026-11-18
기준일	2026-11-17

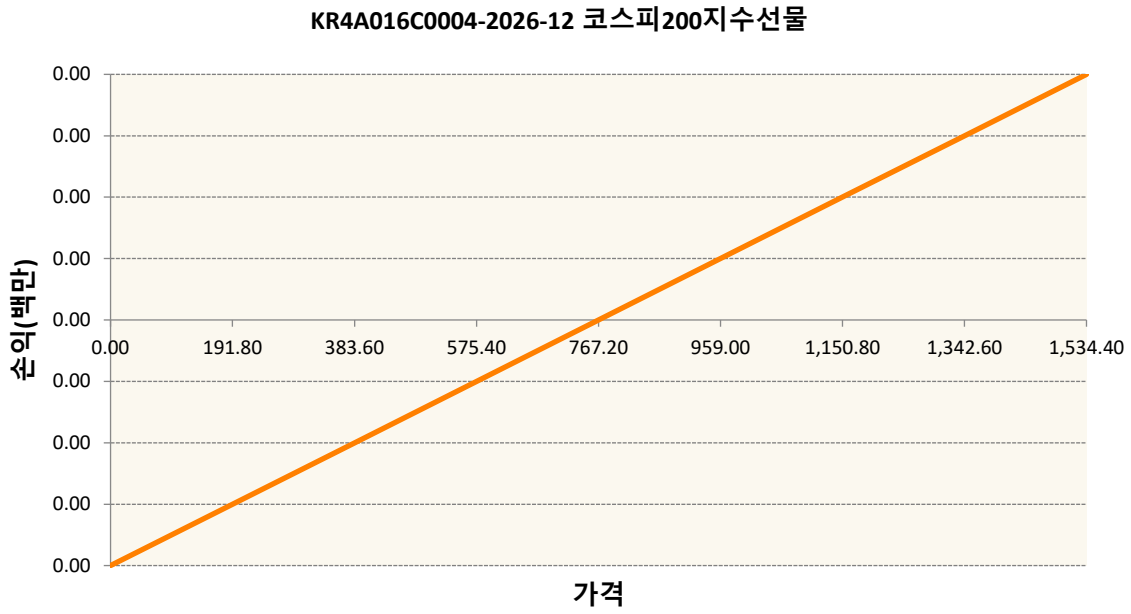
SOL 200타겟위클리커버드콜상장지수(주식)

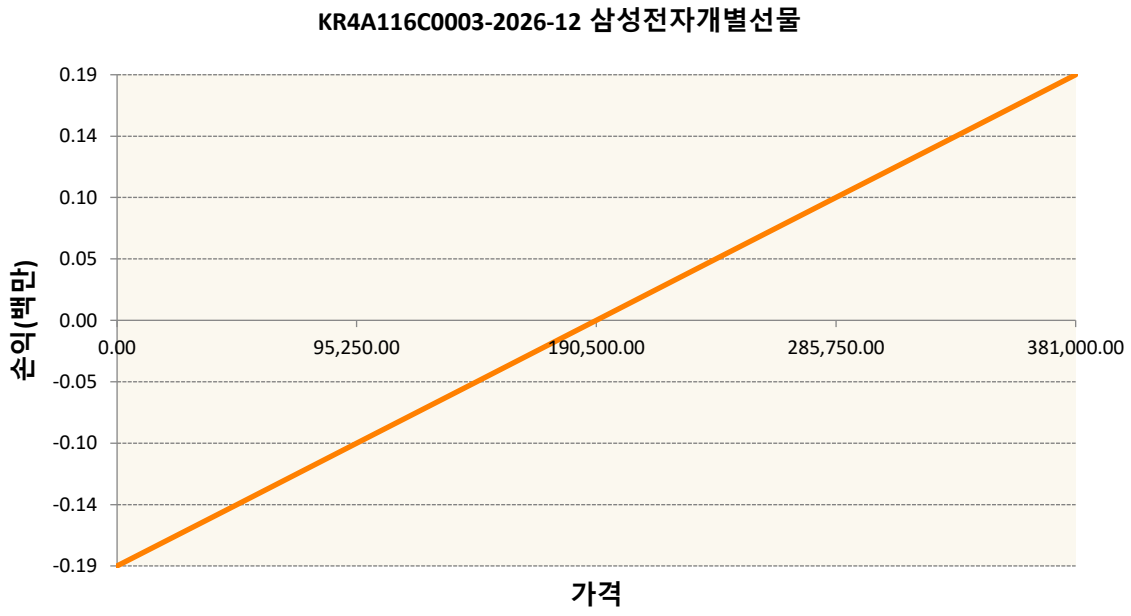
1. 계약금액

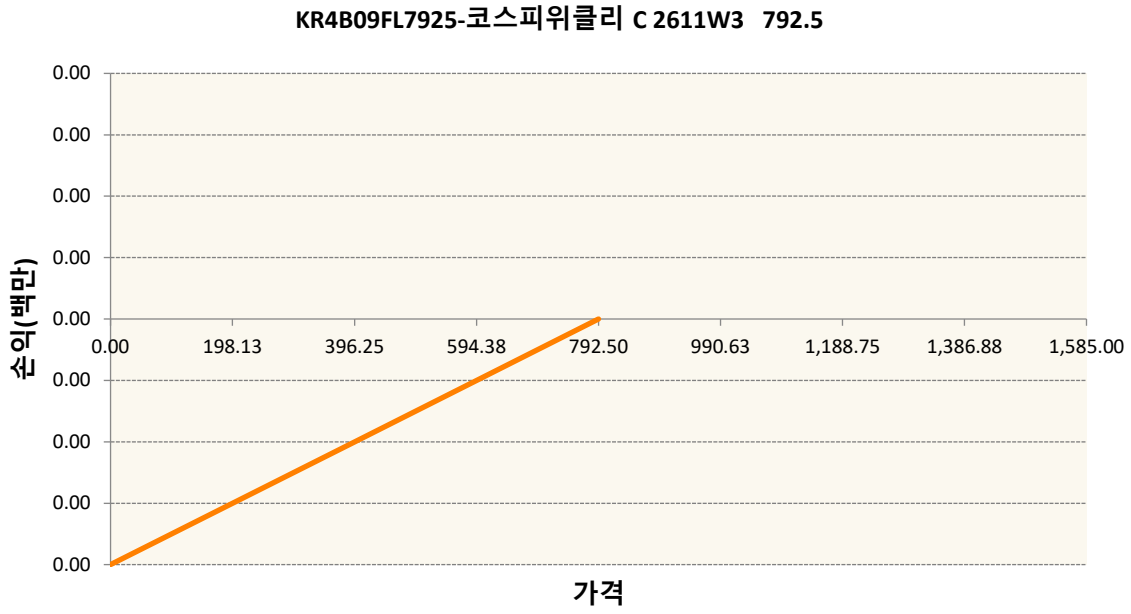
(단위:백만원)

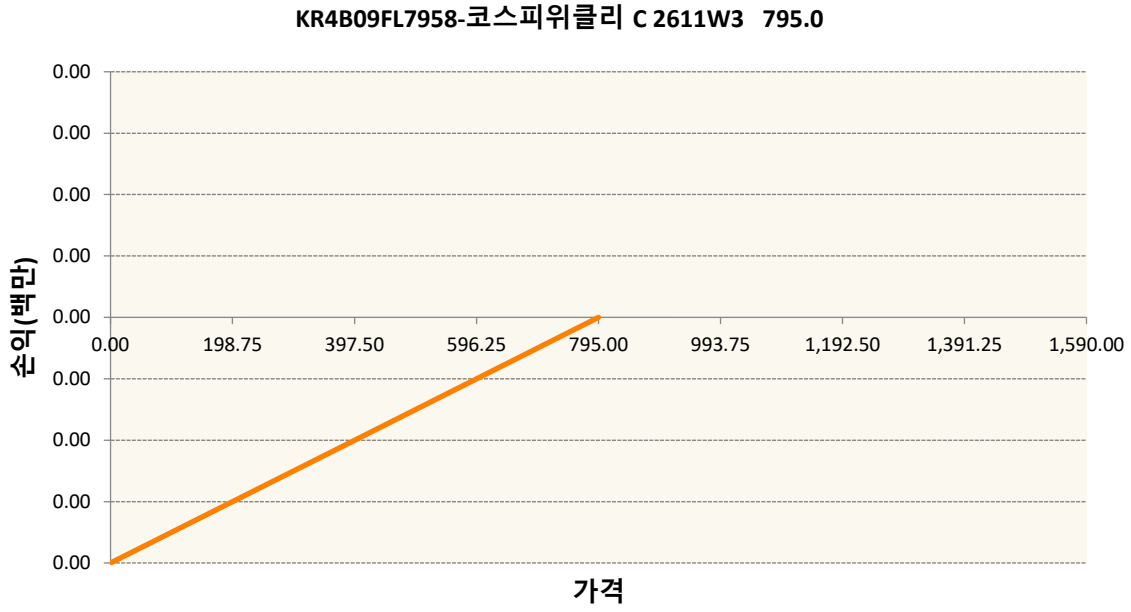
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	15,274	0	15,274	장내
누계	유가증권	옵션	0	30,748	-30,748	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4A016C0004	2026-12 코스피200지수선물						401
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-401	-401	-401	-401	-401	-401	-401
-5.33%	-267	-267	-267	-267	-267	-267	-267
-2.67%	-134	-134	-134	-134	-134	-134	-134
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	134	134	134	134	134	134	134
5.33%	267	267	267	267	267	267	267
8.00%	401	401	401	401	401	401	401
KR4A116C0003	2026-12 삼성전자개별선물						822
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-822	-822	-822	-822	-822	-822	-822
-5.33%	-548	-548	-548	-548	-548	-548	-548
-2.67%	-274	-274	-274	-274	-274	-274	-274
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	274	274	274	274	274	274	274
5.33%	548	548	548	548	548	548	548
8.00%	822	822	822	822	822	822	822
	KR4B09FL7925		코스피위클리 C 2611W3 792.5				1,314
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,307	-1,307	-1,308	-1,308	-1,310	-1,312	-1,314
-5.33%	-830	-832	-834	-838	-843	-849	-857
-2.67%	-363	-370	-380	-391	-403	-417	-432
0%	61	41	21	0	-22	-44	-67
2.67%	377	350	323	296	270	243	216
5.33%	549	528	506	483	459	435	411
8.00%	613	603	591	577	562	545	527
	KR4B09FL7958		코스피위클리 C 2611W3 795.0				885
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-881	-881	-881	-882	-882	-883	-885
-5.33%	-563	-564	-565	-567	-570	-574	-578
-2.67%	-250	-254	-260	-266	-274	-283	-292
0%	38	26	13	0	-14	-28	-43
2.67%	259	242	224	206	188	171	153
5.33%	386	370	355	339	323	306	290
8.00%	435	427	418	408	397	386	373

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

9,059

공시일	2026-11-18
기준일	2026-11-17

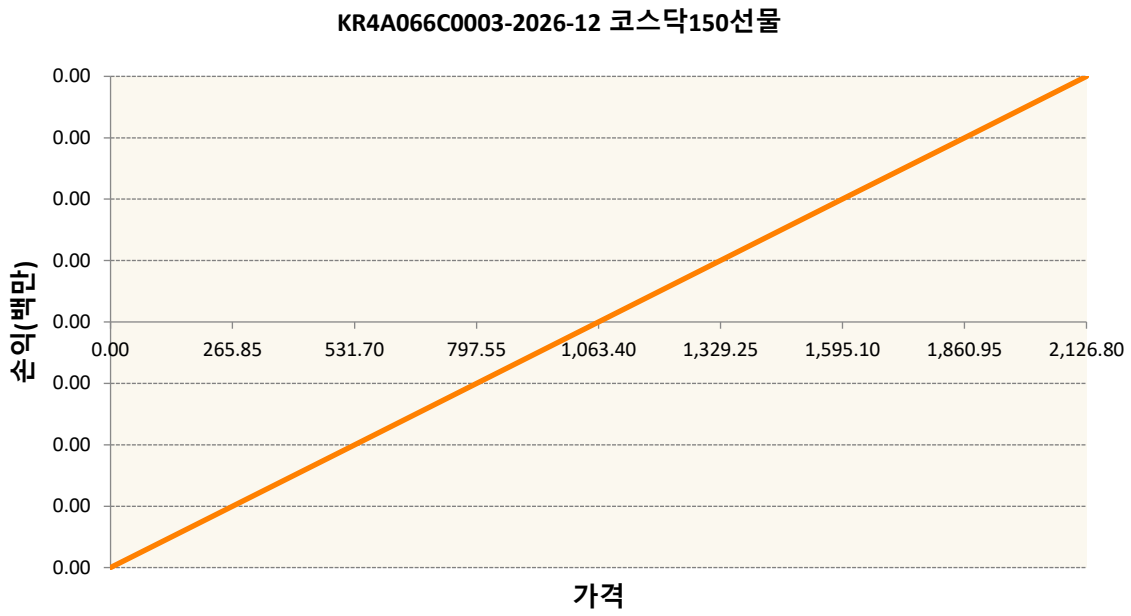
SOL코스닥150인덱스(주식-파생형)

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	425	0	425	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A066C0003	2026-12 코스닥150선물	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%	-23	-23	-23	-23	-23	-23	-23
-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%	23	23	23	23	23	23	23
8.00%	34	34	34	34	34	34	34

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

116

공시일	2026-11-18
기준일	2026-11-17

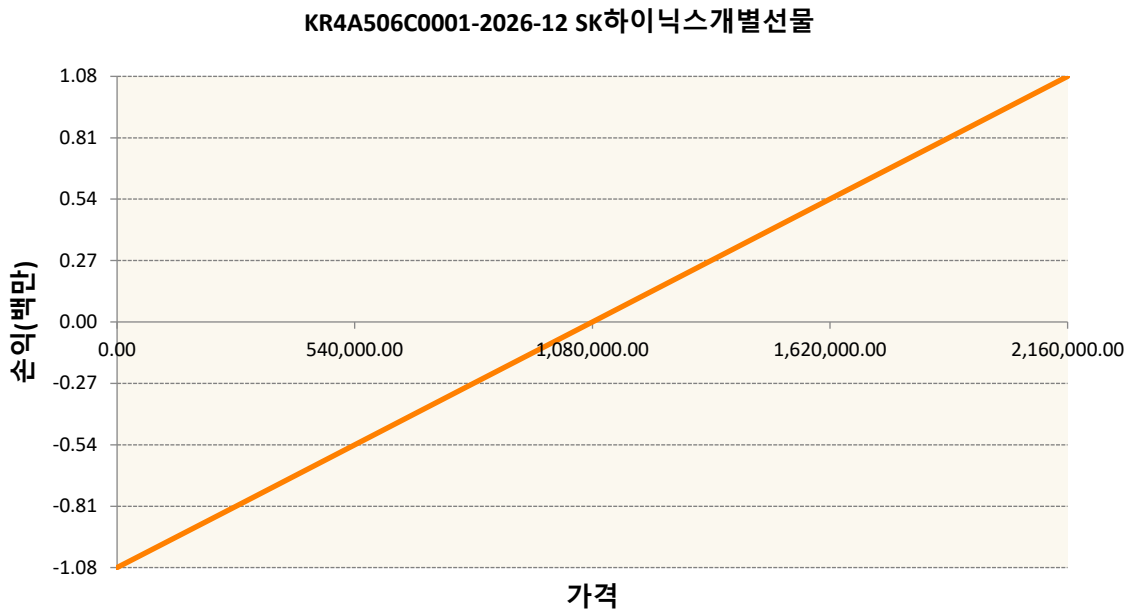
SOLSK하이닉스단일종목레버리지상장지수

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	1,946	-1,946	장내
누계	유가증권	선물	15,368	0	15,368	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A506C0001	2026-12 SK하이닉스개별선물	1,250

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,250	-1,250	-1,250	-1,250	-1,250	-1,250	-1,250
-5.33%	-833	-833	-833	-833	-833	-833	-833
-2.67%	-417	-417	-417	-417	-417	-417	-417
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	417	417	417	417	417	417	417
5.33%	833	833	833	833	833	833	833
8.00%	1,250	1,250	1,250	1,250	1,250	1,250	1,250

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

6,274

공시일	2026-11-18
기준일	2026-11-17

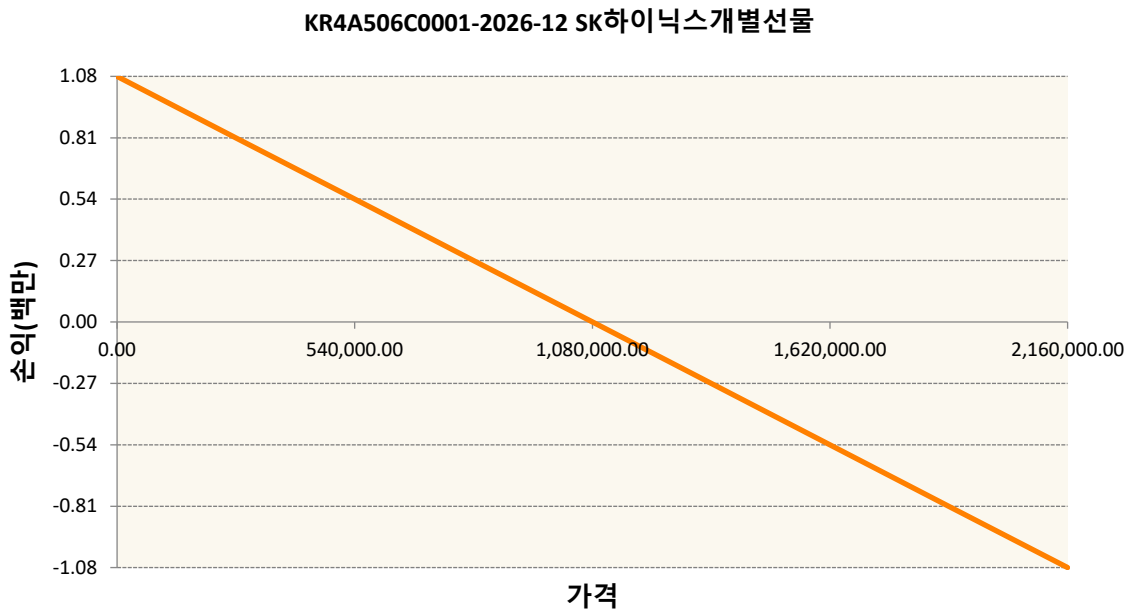
SOLSK하이닉스선물단일종목인버스2X상장지

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	20,855	24,612	-3,757	장내
누계	유가증권	선물	0	187,898	-187,898	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A506C0001	2026-12 SK하이닉스개별선물	15,282

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	15,282	15,282	15,282	15,282	15,282	15,282	15,282
-5.33%	10,188	10,188	10,188	10,188	10,188	10,188	10,188
-2.67%	5,094	5,094	5,094	5,094	5,094	5,094	5,094
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-5,094	-5,094	-5,094	-5,094	-5,094	-5,094	-5,094
5.33%	-10,188	-10,188	-10,188	-10,188	-10,188	-10,188	-10,188
8.00%	-15,282	-15,282	-15,282	-15,282	-15,282	-15,282	-15,282

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

76,711

공시일	2026-11-18
기준일	2026-11-17

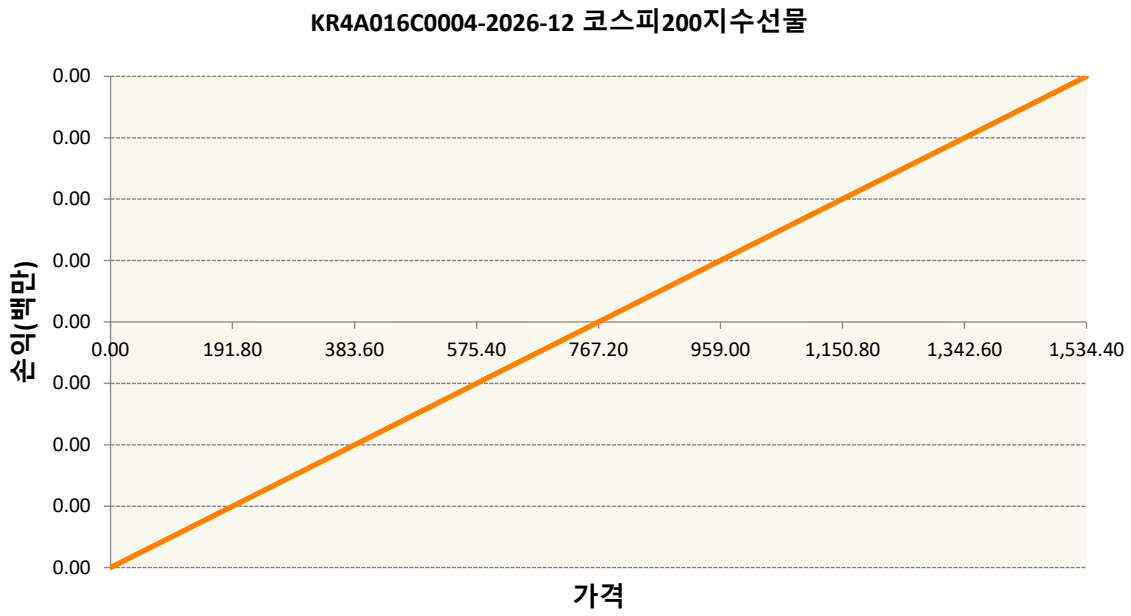
SOL200커버드콜액티브상장지수(주식-파생형

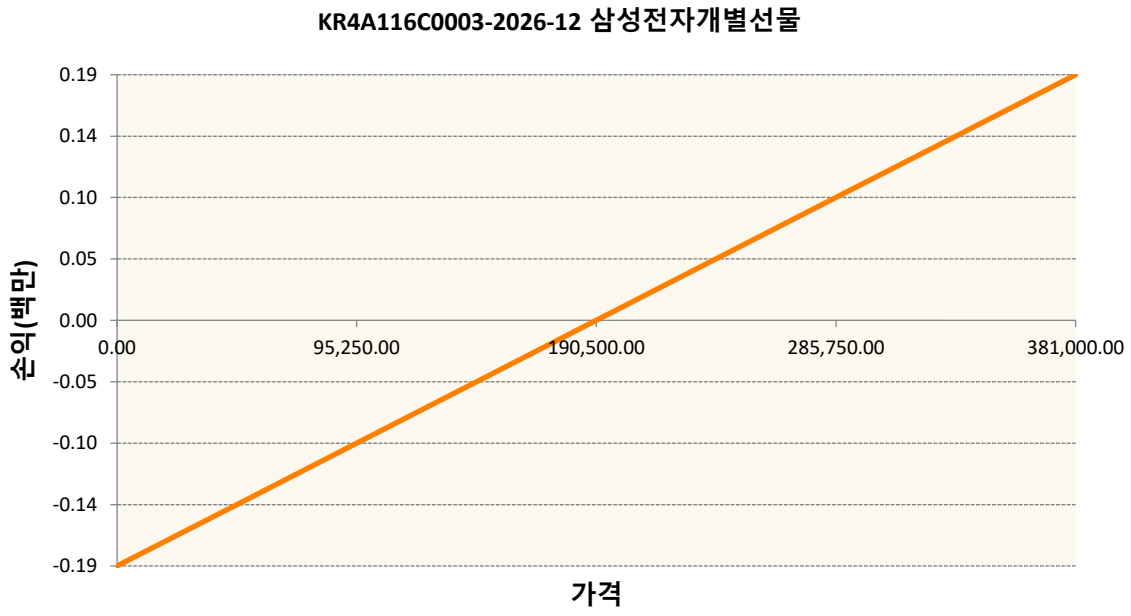
1. 계약금액

(단위:백만원)

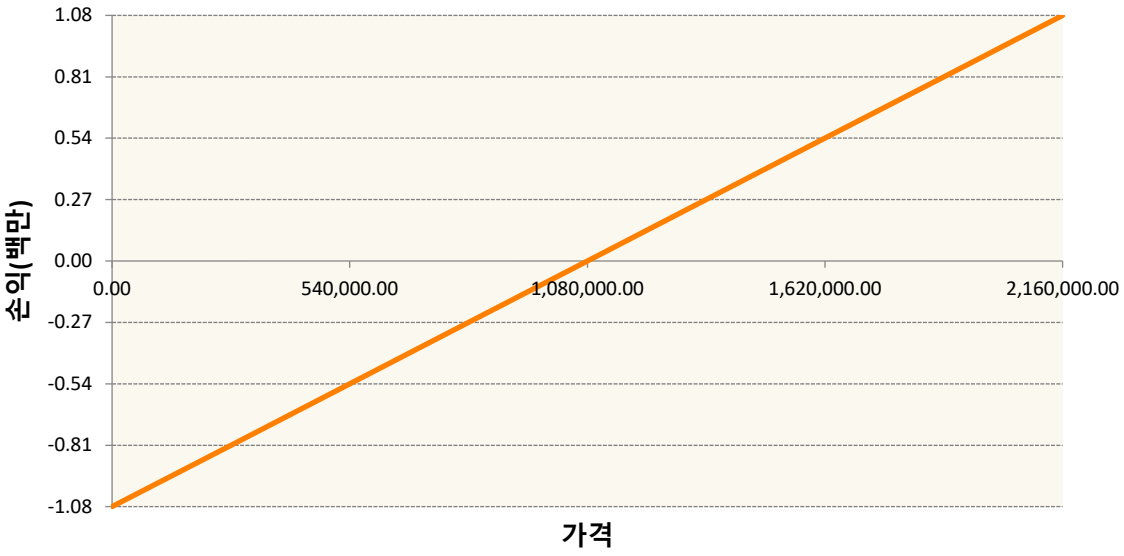
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,061	0	3,061	장내
누계	유가증권	옵션	0	2,769	-2,769	장내

2. 만기시점의 손익구조

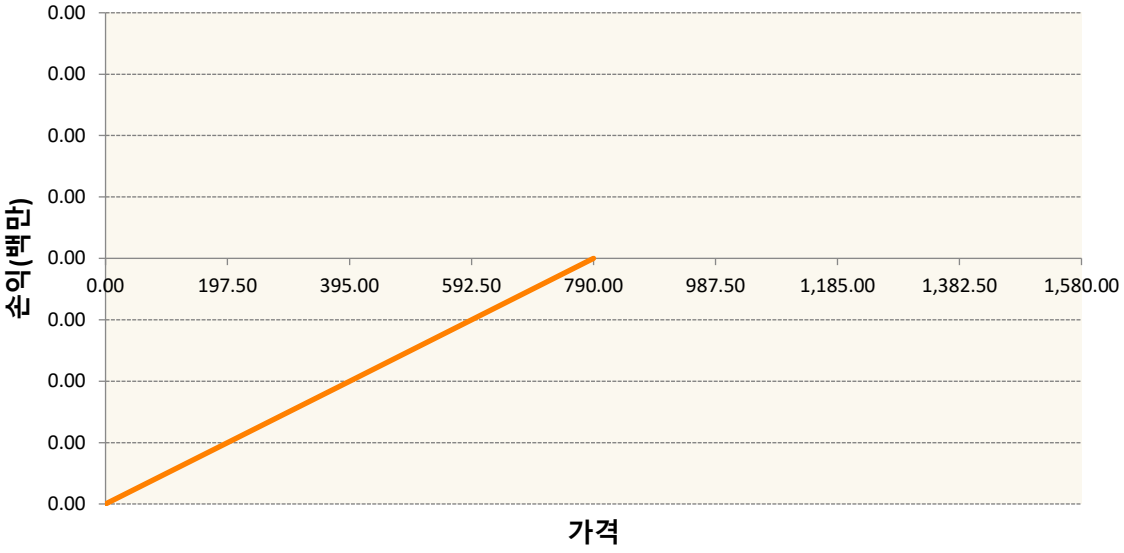




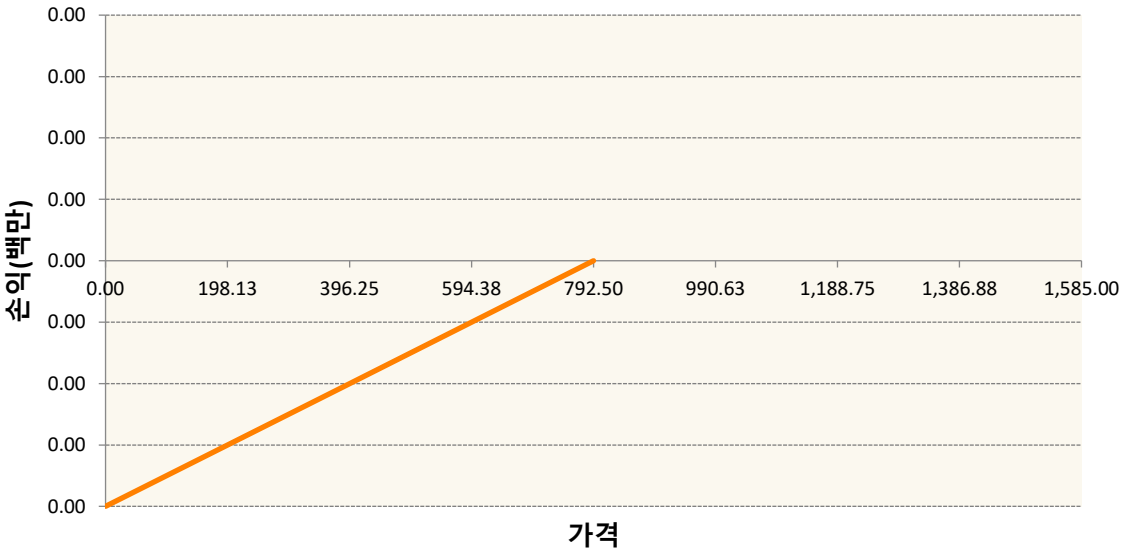
KR4A506C0001-2026-12 SK하이닉스개별선물



KR4B09FL7909-코스피위클리 C 2611W3 790.0



KR4B09FL7925-코스피위클리 C 2611W3 792.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4A016C0004	2026-12 코스피200지수선물						139
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-139	-139	-139	-139	-139	-139	-139
-5.33%	-92	-92	-92	-92	-92	-92	-92
-2.67%	-46	-46	-46	-46	-46	-46	-46
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	46	46	46	46	46	46	46
5.33%	92	92	92	92	92	92	92
8.00%	139	139	139	139	139	139	139

KR4A116C0003	2026-12 삼성전자개별선물						32
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-32	-32	-32	-32	-32	-32	-32
-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%	32	32	32	32	32	32	32

KR4A506C0001	2026-12 SK하이닉스개별선물						76
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-76	-76	-76	-76	-76	-76	-76
-5.33%	-50	-50	-50	-50	-50	-50	-50
-2.67%	-25	-25	-25	-25	-25	-25	-25
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	25	25	25	25	25	25	25
5.33%	50	50	50	50	50	50	50
8.00%	76	76	76	76	76	76	76

KR4B09FL7909	코스피위클리 C 2611W3 790.0						112
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-111	-111	-111	-111	-111	-112	-112
-5.33%	-70	-70	-71	-71	-71	-72	-73
-2.67%	-30	-31	-32	-33	-34	-35	-37
0%	6	4	2	0	-2	-4	-6
2.67%	31	29	27	24	22	20	17
5.33%	45	43	41	39	37	35	33
8.00%	49	49	48	47	45	44	43

KR4B09FL7925	코스피위클리 C 2611W3 792.5						85
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-84	-84	-84	-84	-84	-85	-85
-5.33%	-54	-54	-54	-54	-54	-55	-55
-2.67%	-23	-24	-24	-25	-26	-27	-28
0%	4	3	1	0	-1	-3	-4
2.67%	24	23	21	19	17	16	14
5.33%	35	34	33	31	30	28	27
8.00%	40	39	38	37	36	35	34

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

1,378

공시일	2026-11-18
기준일	2026-11-17

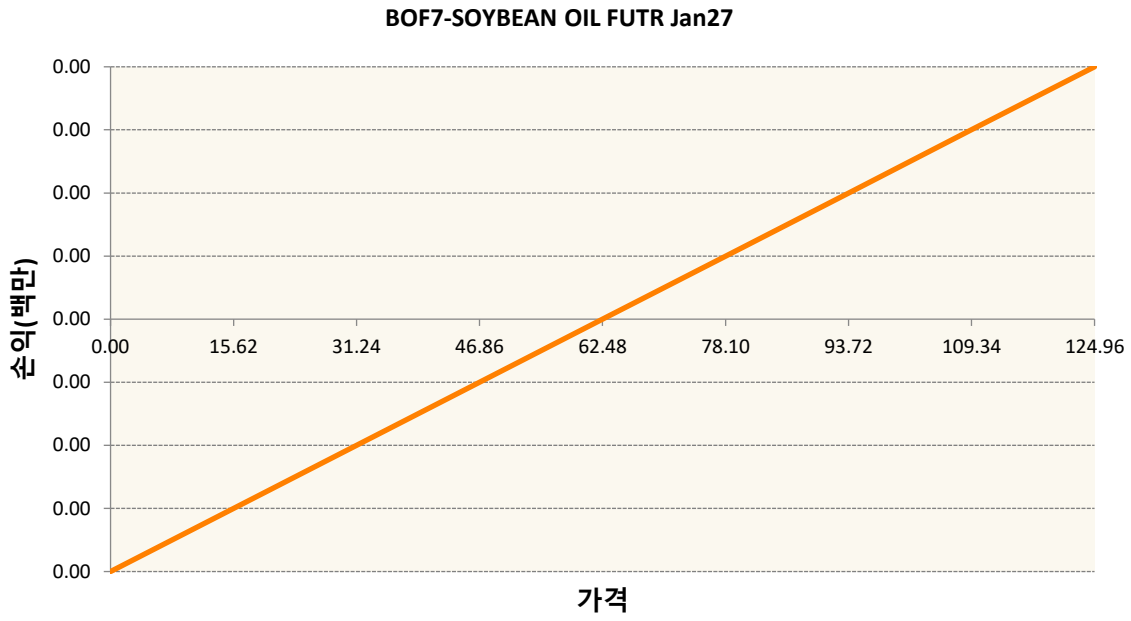
포커스농산물모(채권-파생형)

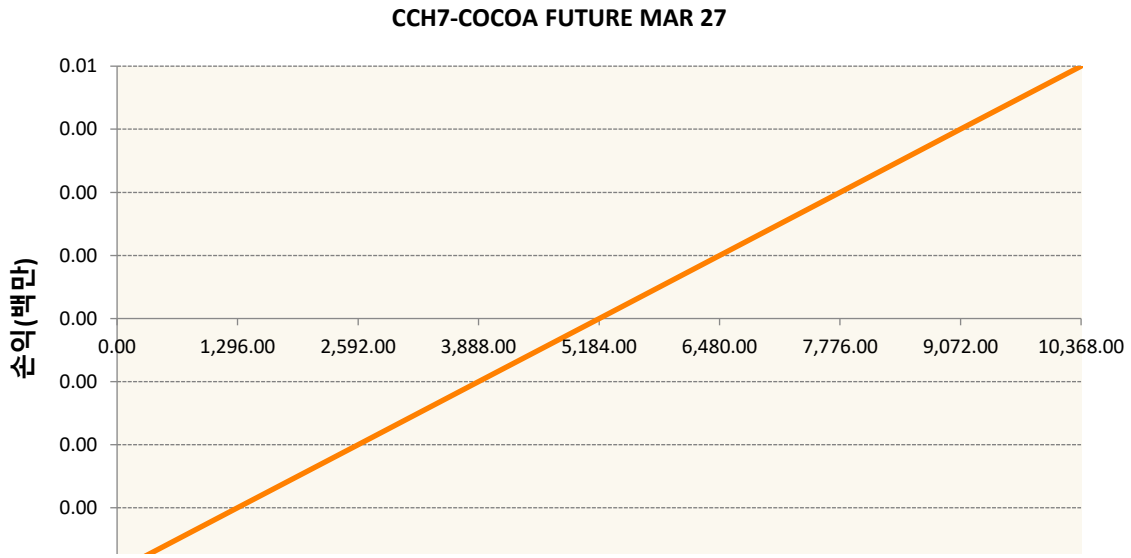
1. 계약금액

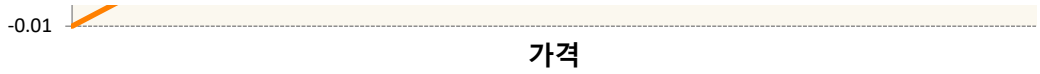
(단위:USD 백만)

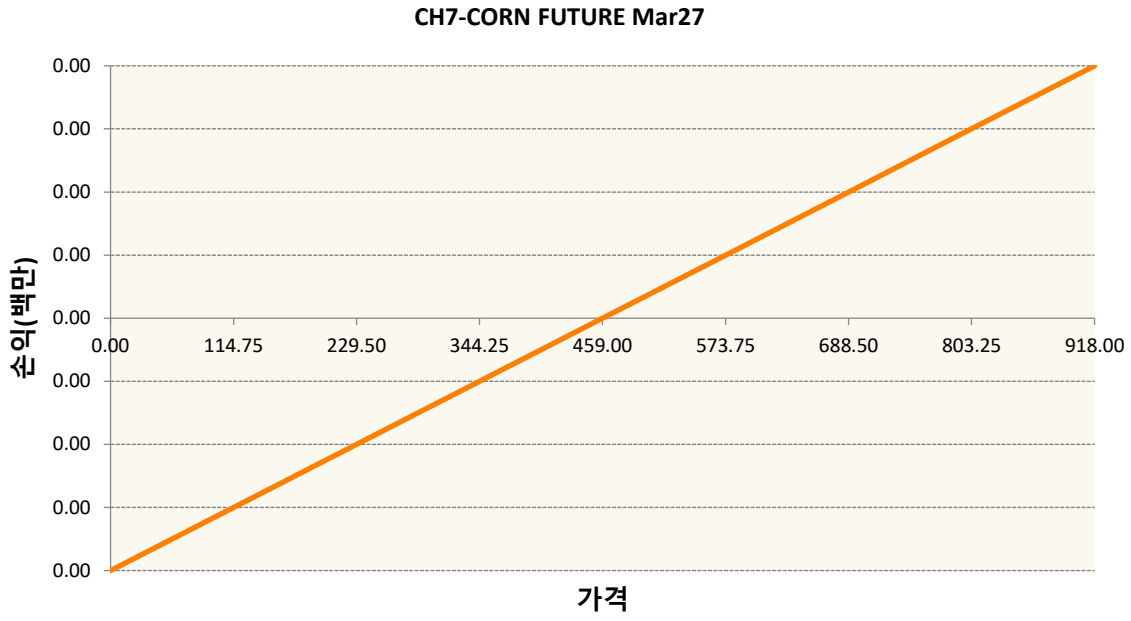
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	실물자산	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	실물자산	선물	321	0	321	
누계	유가증권	선물	1,986	0	1,986	
누계	통화	선물	0	53	-53	장내

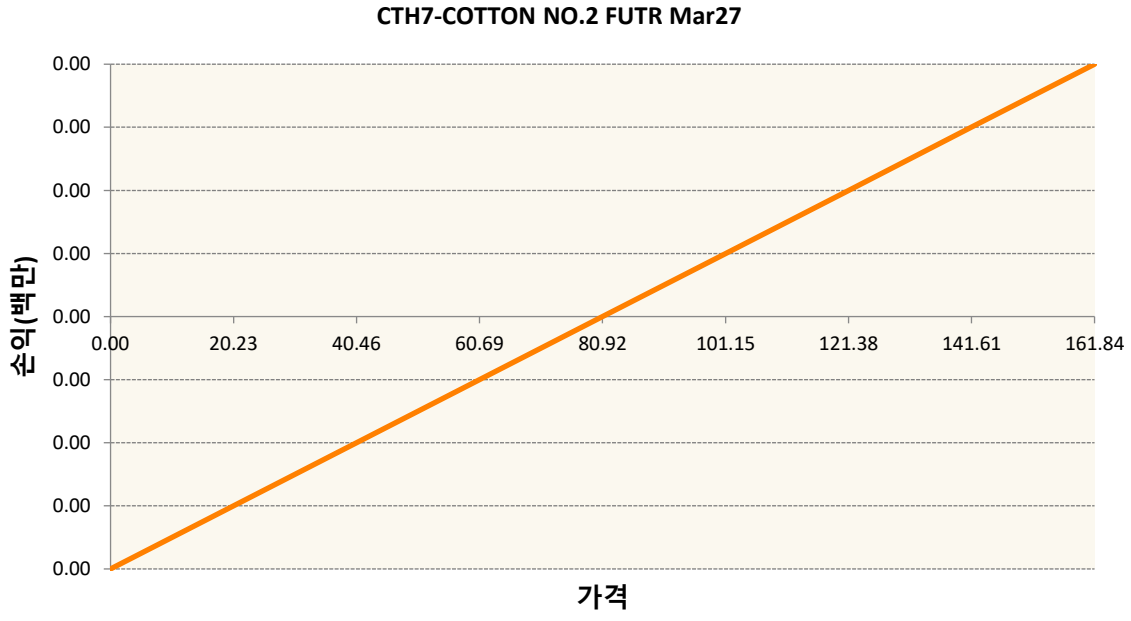
2. 만기시점의 손익구조

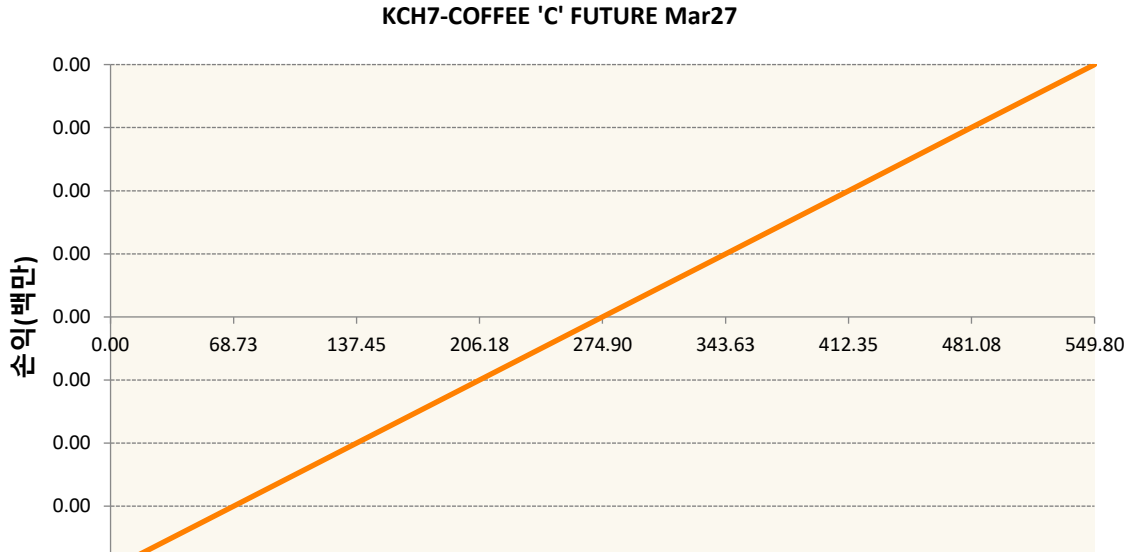


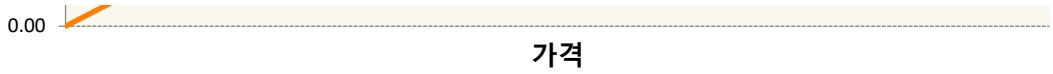



-0.01
가격

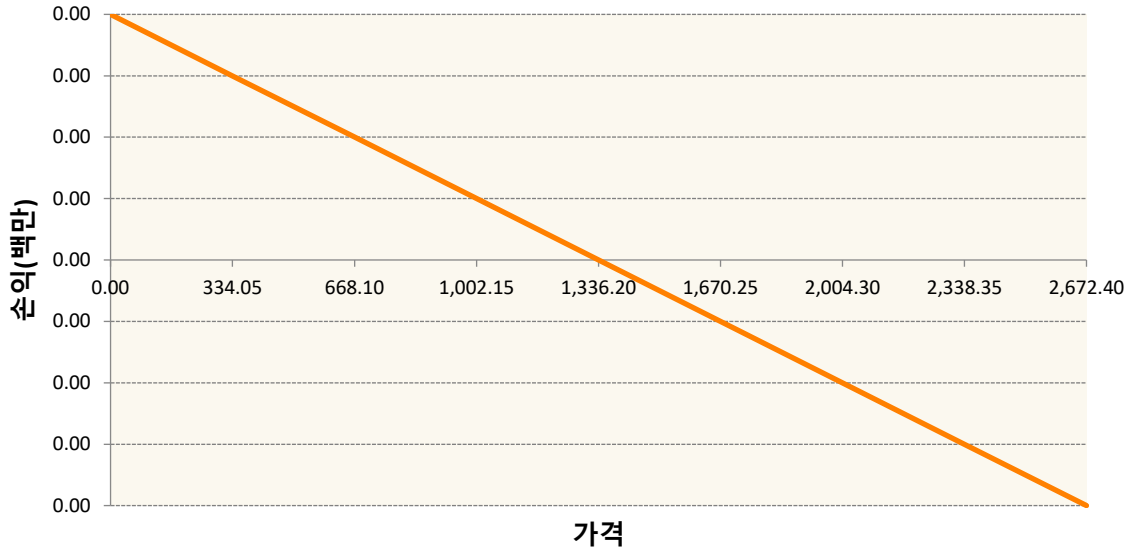

CH7-CORN FUTURE Mar27
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
114.75
229.50
344.25
459.00
573.75
688.50
803.25
918.00
손익(백만)
가격


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
20.23
40.46
60.69
80.92
101.15
121.38
141.61
161.84
손익(백만)
가격

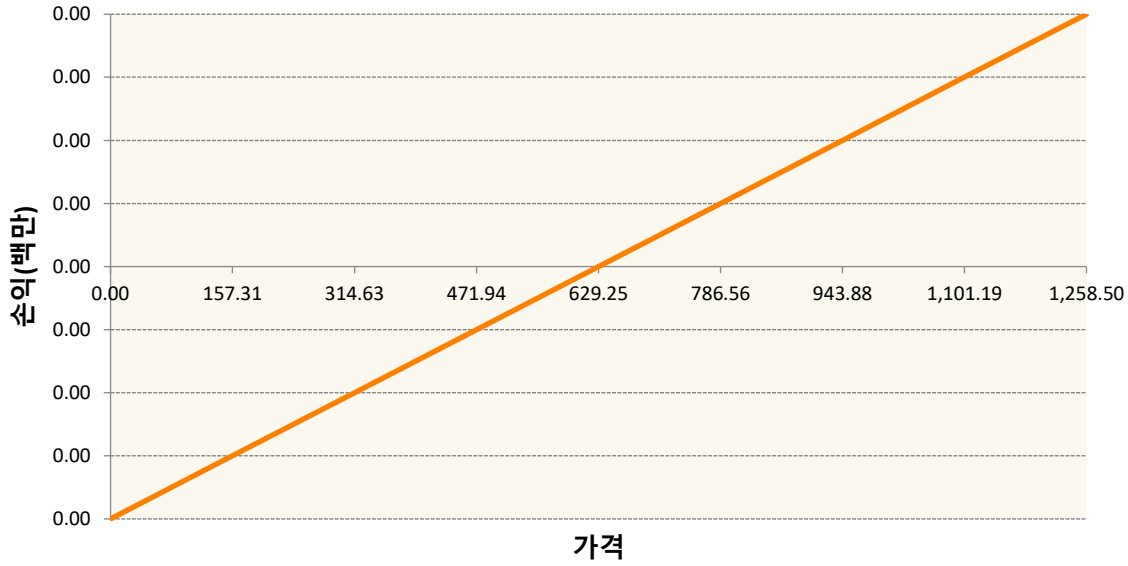

KCH7-COFFEE 'C' FUTURE Mar27
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
68.73
137.45
206.18
274.90
343.63
412.35
481.08
549.80
손익(백만)



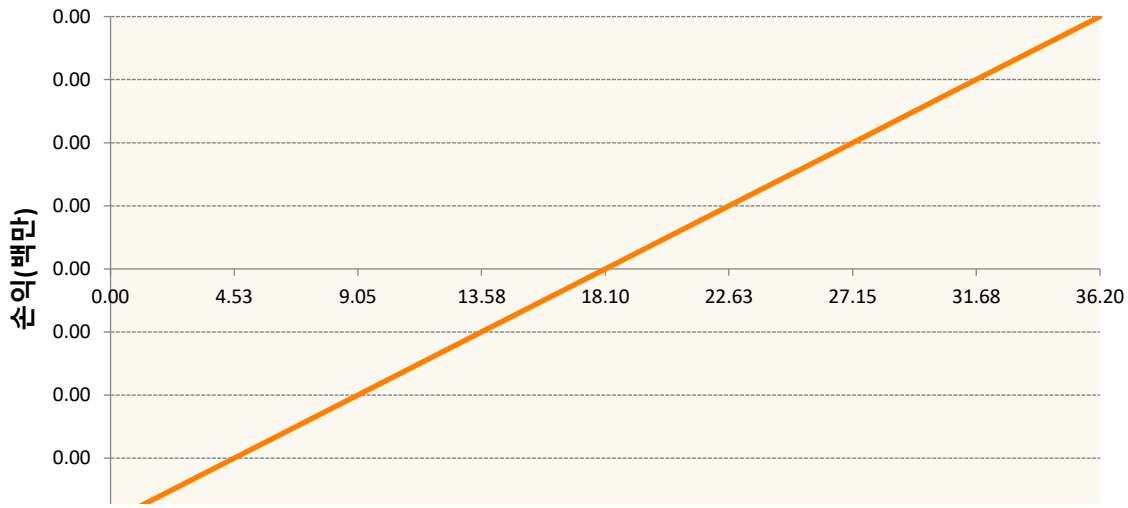
KR4A756C0008-2026-12 달러선물

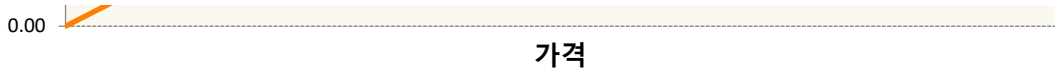


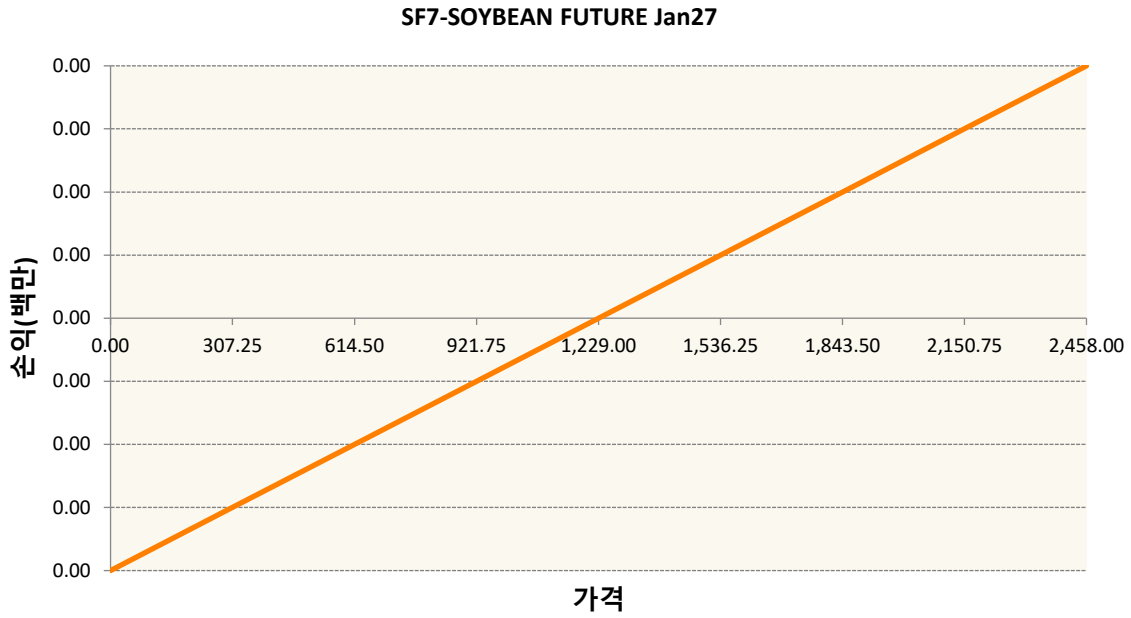
KWH7-KC HRW WHEAT FUT Mar27

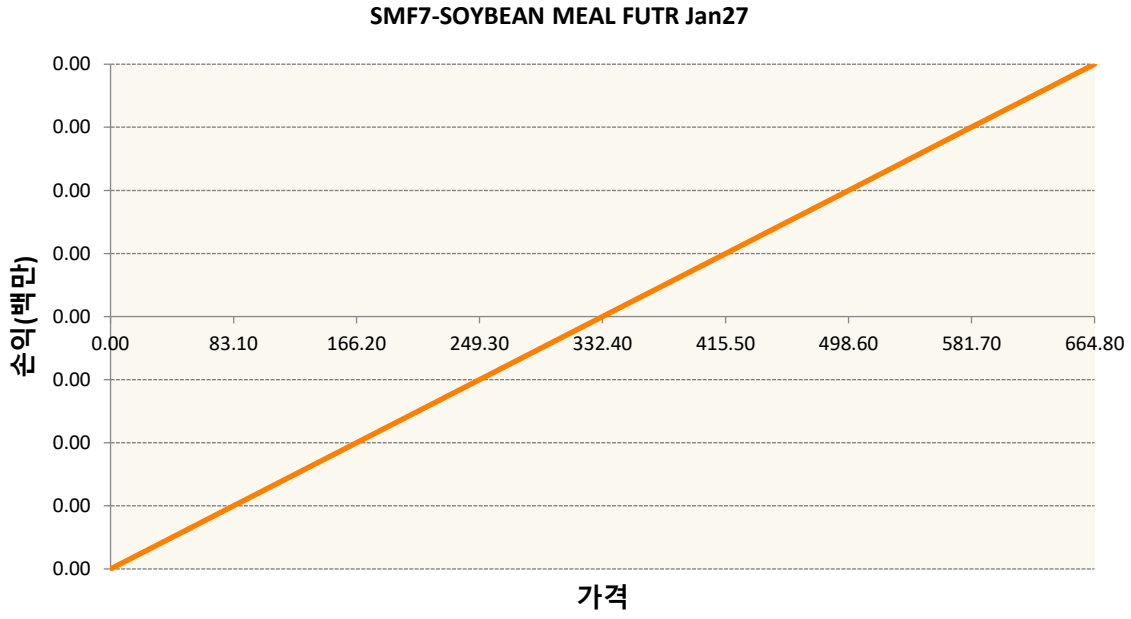


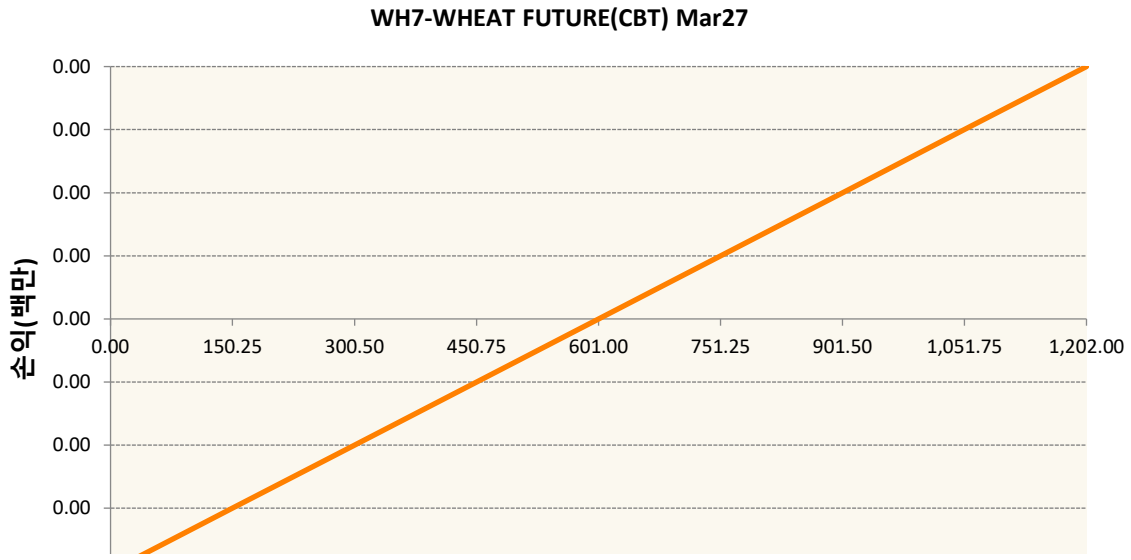
SBH7-SUGAR #11 (WORLD) MAR27




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
307.25
614.50
921.75
1,229.00
1,536.25
1,843.50
2,150.75
2,458.00
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
83.10
166.20
249.30
332.40
415.50
498.60
581.70
664.80
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
150.25
300.50
450.75
601.00
751.25
901.50
1,051.75
1,202.00
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	2026-11-18
기준일	2026-11-17

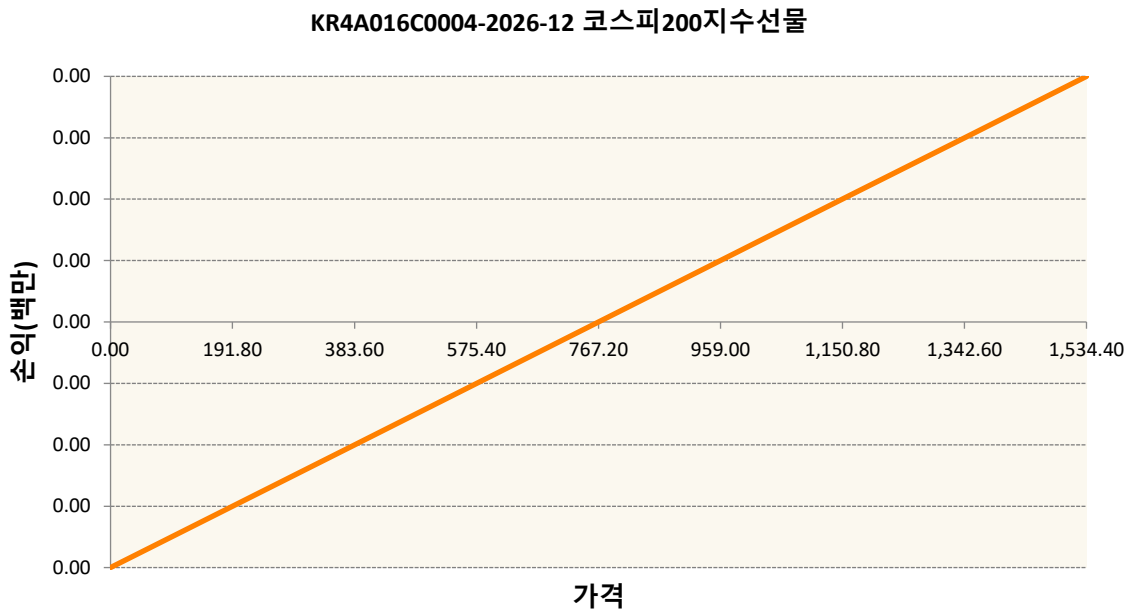
스마트인덱스모

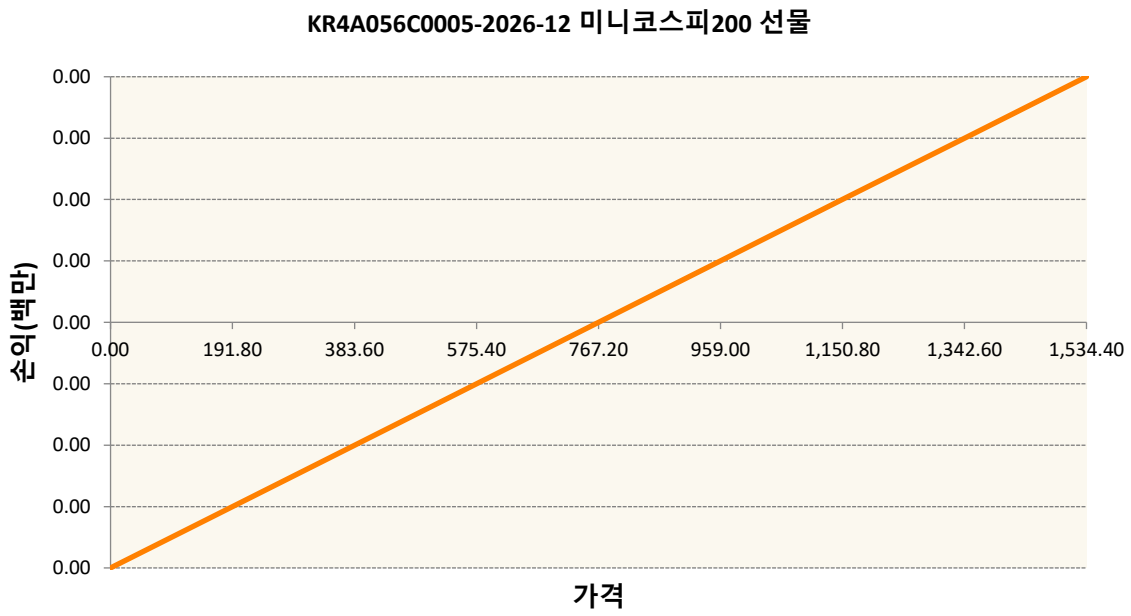
1. 계약금액

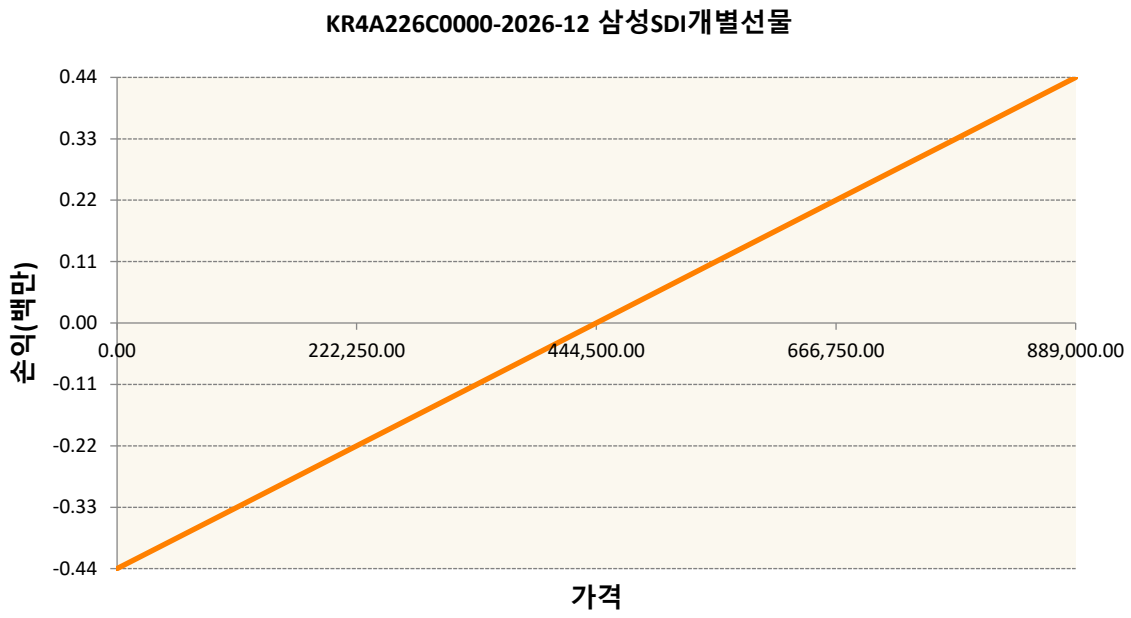
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	387	0	387	장내
누계	유가증권	선물	9,009	0	9,009	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A016C0004	2026-12 코스피200지수선물						432
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-432	-432	-432	-432	-432	-432	-432
-5.33%	-288	-288	-288	-288	-288	-288	-288
-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%	288	288	288	288	288	288	288
8.00%	432	432	432	432	432	432	432

KR4A056C0005	2026-12 미니코스피200 선물						55
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-55	-55	-55	-55	-55	-55	-55
-5.33%	-37	-37	-37	-37	-37	-37	-37
-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%	37	37	37	37	37	37	37
8.00%	55	55	55	55	55	55	55

KR4A226C0000	2026-12 삼성SDI개별선물						15
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-15	-15	-15	-15	-15	-15	-15
-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%	15	15	15	15	15	15	15

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

1,768

공시일	2026-11-18
기준일	2026-11-17

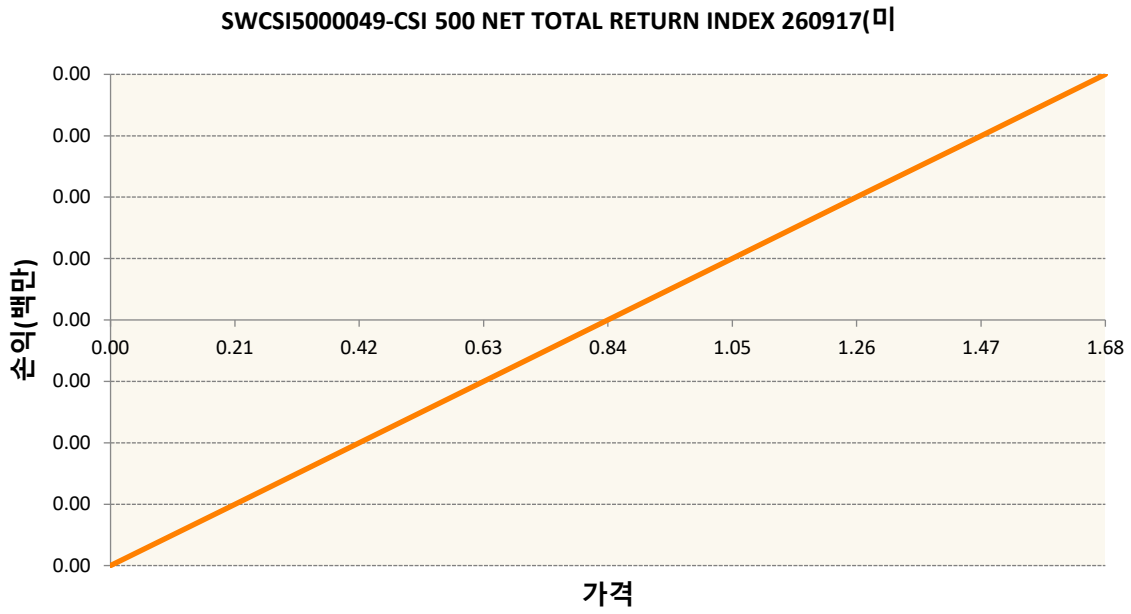
SOL차이나강소기업CSI500상장

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	4,470	0	4,470	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 CSI 500 NET TOTAL RETURN INDEX 260917(미	359

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

599

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2026-11-18
기준일	2026-11-17

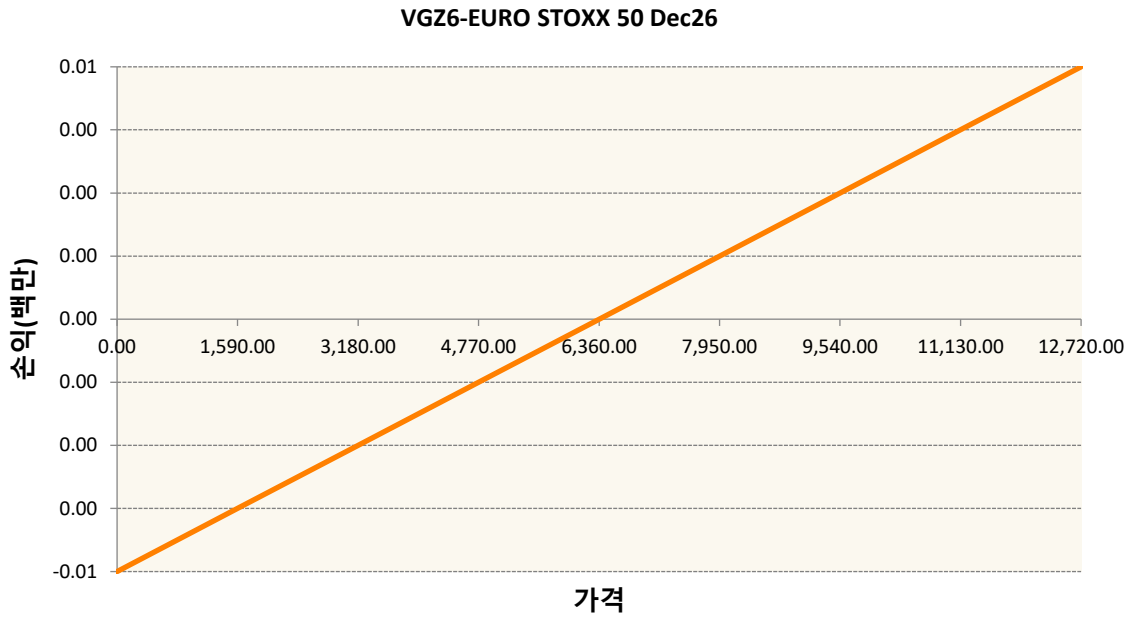
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,104	0	1,104	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGZ6	EURO STOXX 50 Dec26	88

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

(단위:백만원)

66

공시일	2026-11-18
기준일	2026-11-17

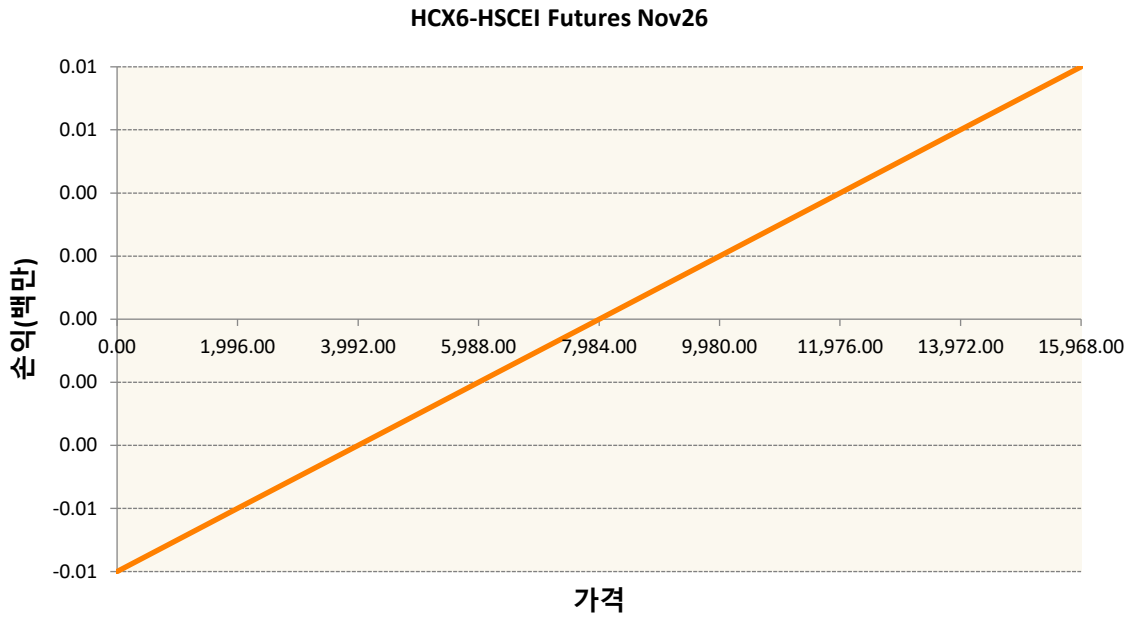
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,157	0	1,157	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCX6	HSCEI Futures Nov26	93

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

(단위:백만원)

88

공시일	2026-11-18
기준일	2026-11-17

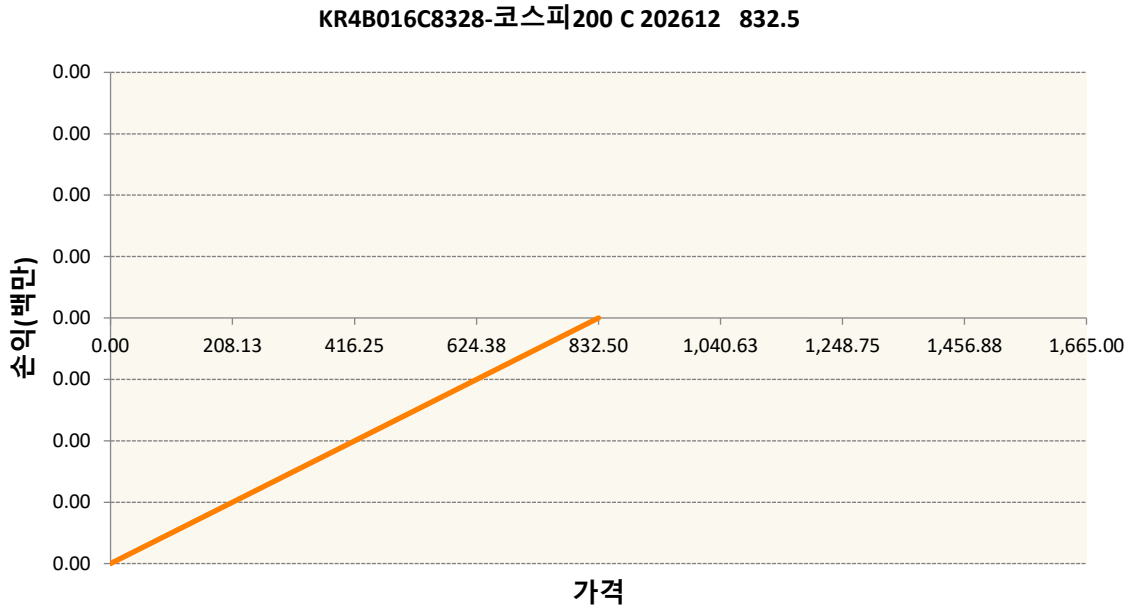
커버드콜모(주식혼합-파생형)

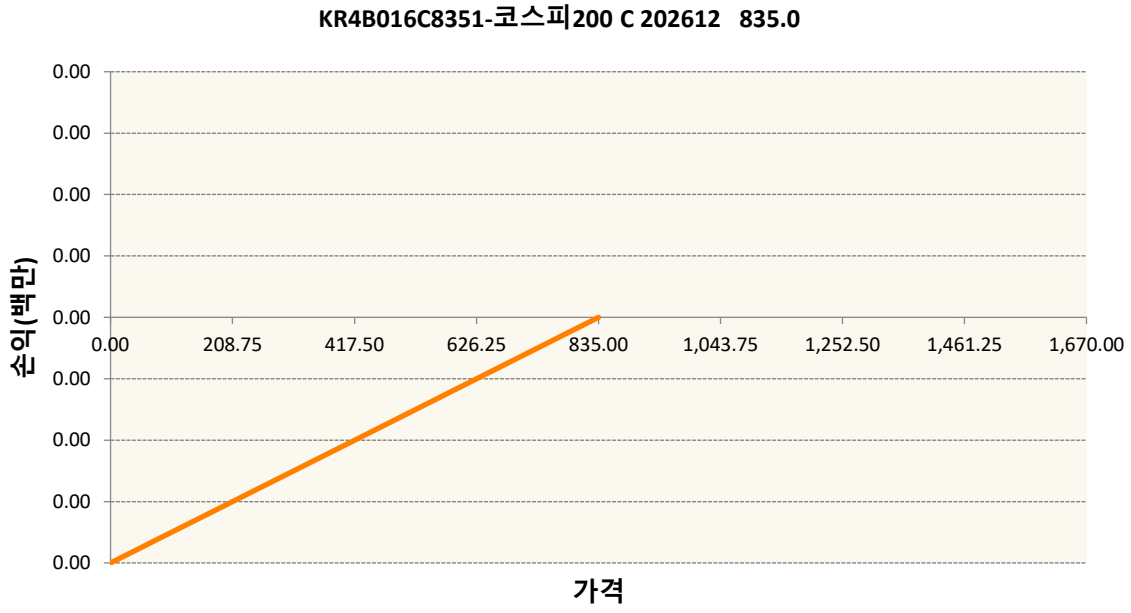
1. 계약금액

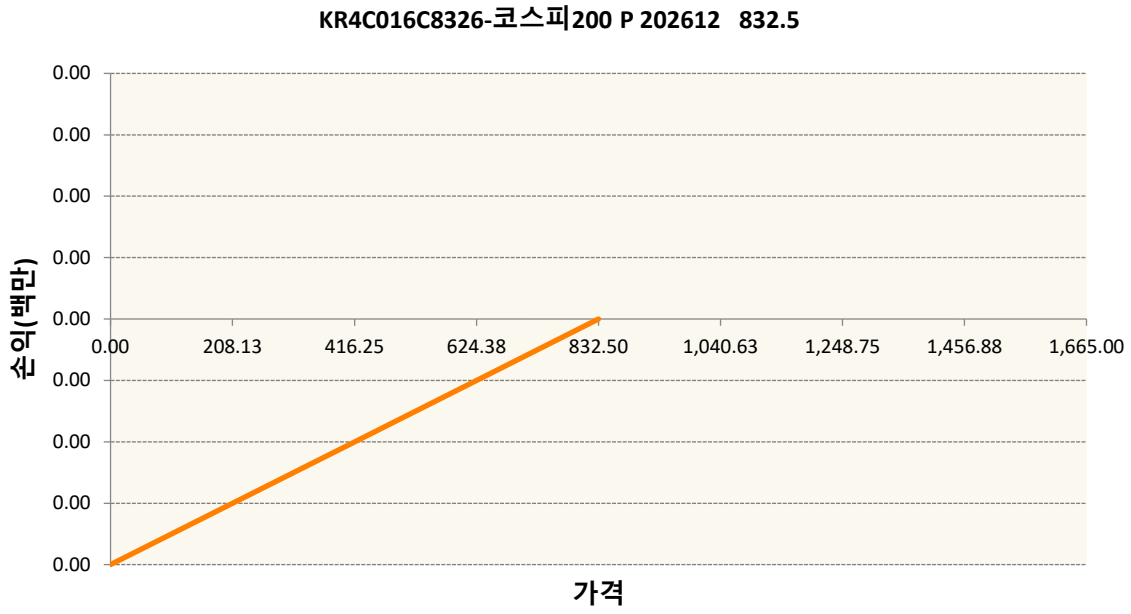
(단위:백만원)

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						1,052
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-810	-840	-874	-913	-956	-1,003	-1,052
-5.33%	-453	-493	-537	-586	-638	-693	-750
-2.67%	-116	-168	-223	-281	-341	-404	-468
0%	193	131	66	0	-68	-137	-207
2.67%	471	400	328	255	181	107	32
5.33%	715	638	560	483	405	327	250
8.00%	922	843	763	683	604	524	445
KR4B016C8351	코스피200 C 202612 835.0						1,166
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-905	-936	-973	-1,015	-1,061	-1,112	-1,166
-5.33%	-508	-551	-599	-652	-708	-768	-830
-2.67%	-135	-190	-250	-313	-379	-447	-517
0%	210	143	72	0	-74	-150	-226
2.67%	521	443	364	284	204	122	40
5.33%	794	709	624	539	454	368	282
8.00%	1,028	940	852	764	676	588	501
KR4C016C8326	코스피200 P 202612 832.5						485
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-374	-387	-403	-421	-441	-463	-485
-5.33%	-209	-227	-248	-270	-294	-320	-346
-2.67%	-54	-77	-103	-130	-158	-186	-216
0%	89	60	31	0	-31	-63	-95

2.67%	217	185	151	118	84	49	15
5.33%	330	294	259	223	187	151	115
8.00%	426	389	352	315	279	242	205

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

4,443

공시일	2026-11-18
기준일	2026-11-17

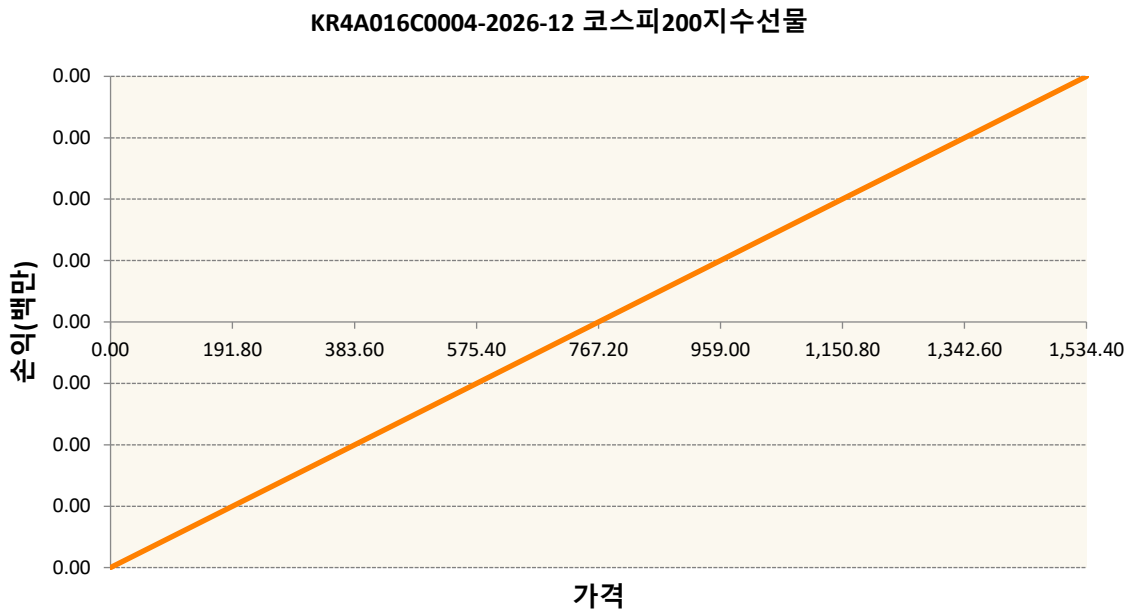
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

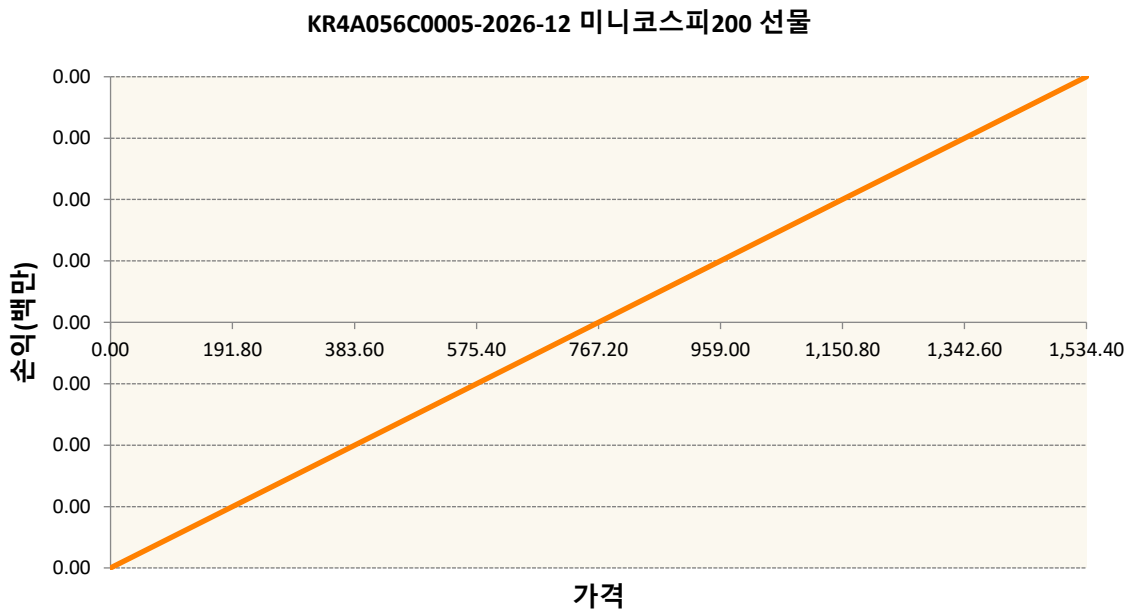
1. 계약금액

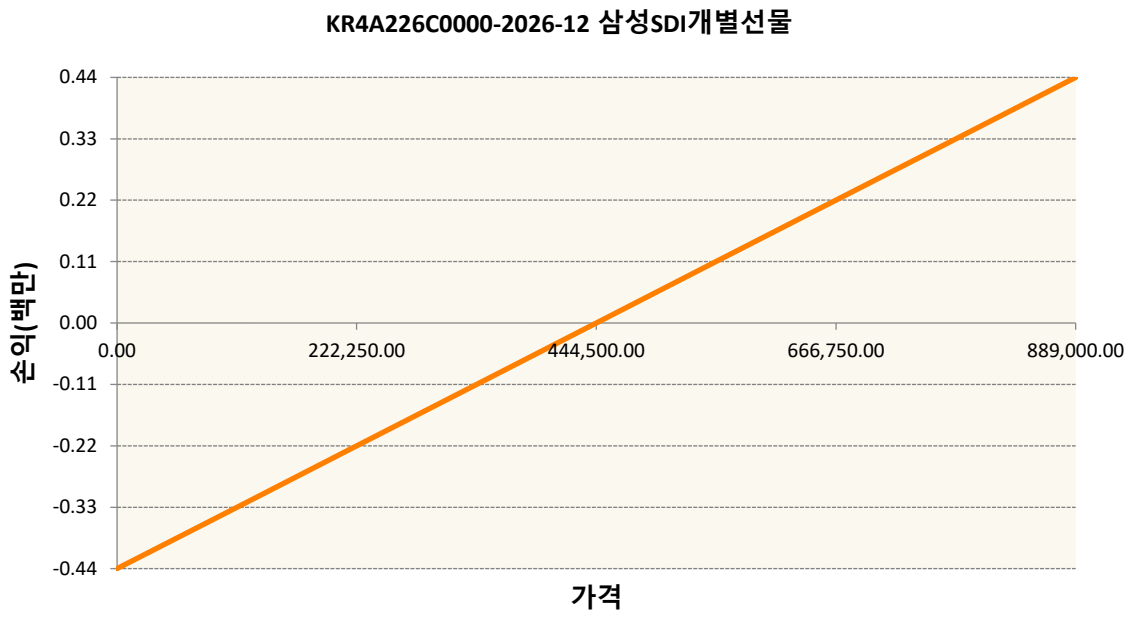
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,762	0	1,762	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A016C0004	2026-12 코스피200지수선물						46
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-46	-46	-46	-46	-46	-46	-46
-5.33%	-31	-31	-31	-31	-31	-31	-31
-2.67%	-15	-15	-15	-15	-15	-15	-15
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	15	15	15	15	15	15	15
5.33%	31	31	31	31	31	31	31
8.00%	46	46	46	46	46	46	46
KR4A056C0005	2026-12 미니코스피200 선물						18
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-18	-18	-18	-18	-18	-18	-18
-5.33%	-12	-12	-12	-12	-12	-12	-12
-2.67%	-6	-6	-6	-6	-6	-6	-6
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	6	6	6	6	6	6	6
5.33%	12	12	12	12	12	12	12
8.00%	18	18	18	18	18	18	18
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)

237

공시일	2026-11-18
기준일	2026-11-17

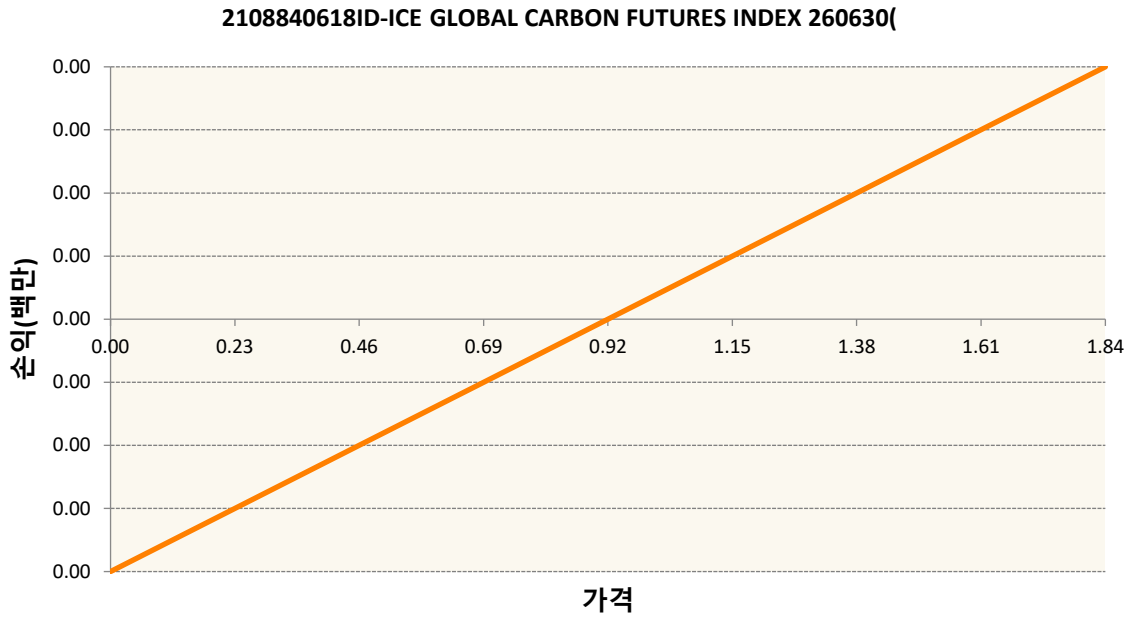
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

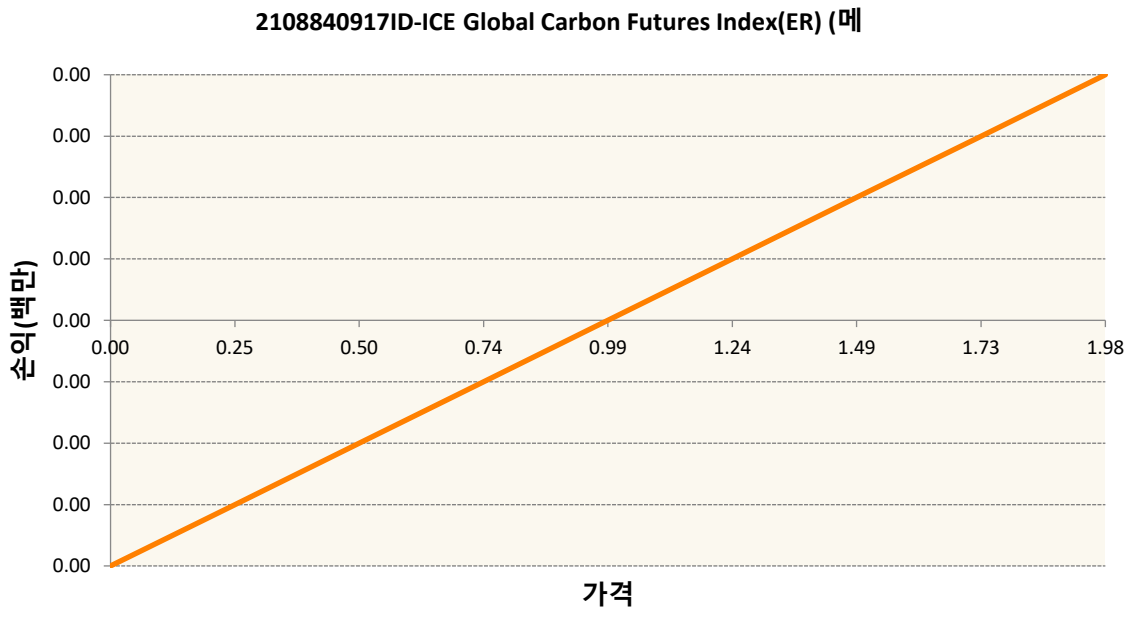
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	7,000	0	7,000	장외

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2108840618ICE GLOBAL CARBON FUTURES INDEX 260630(	447
2108840917ICE Global Carbon Futures Index(ER) (메	113

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

576

공시일	2026-11-18
기준일	2026-11-17

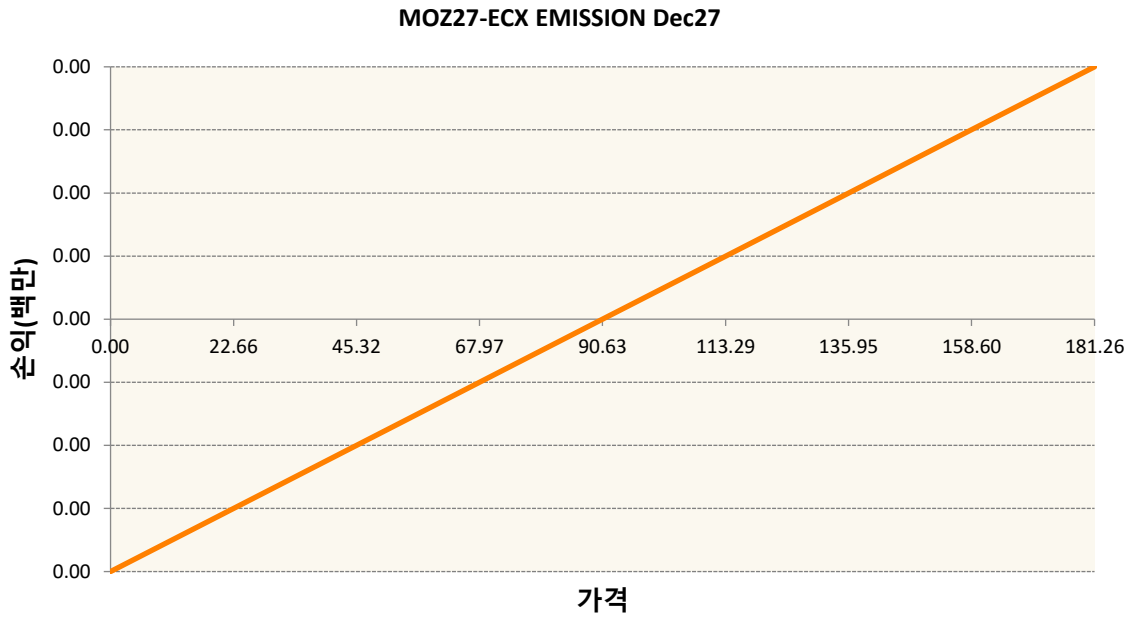
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	5,801	0	5,801	
누계	통화	선도	0	2,762	-2,762	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213GAV KRW/EUR 30-11-26E	221
MOZ27 ECX EMISSION Dec27	464

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

(단위:백만원)

709

공시일	2026-11-18
기준일	2026-11-17

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	-993	0	-993	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWSOL0000(CSI PHOTOVOLTAIC INDUSTRY INDEX 260325(	13
SWSOL0000(CSI PHOTOVOLTAIC INDUSTRY INDEX 260630(N	13
SWSOL0000(CSI PHOTOVOLTAIC INDUSTRY INDEX 260630(	20
SWSOL0000(CSI PHOTOVOLTAIC INDUSTRY INDEX 260923(	33

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

(단위:백만원)

124

공시일	2026-11-18
기준일	2026-11-17

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	-6,941	0	-6,941	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 251218(NH)	63
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 260714(미래)	356
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 260917(메리츠)	133

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

(단위:백만원)

1,101

공시일	2026-11-18
기준일	2026-11-17

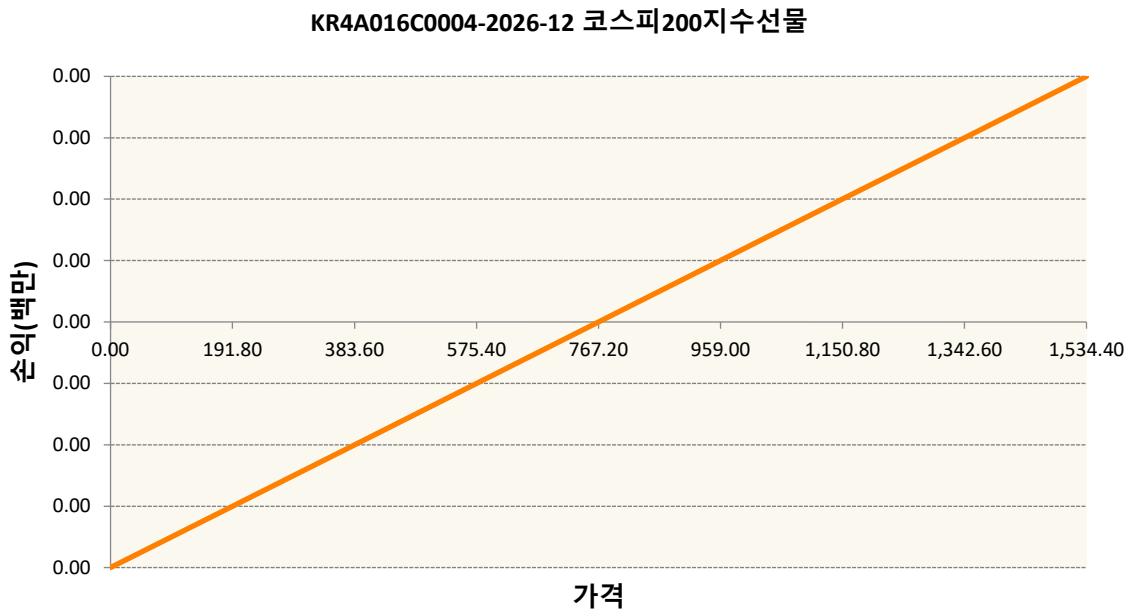
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

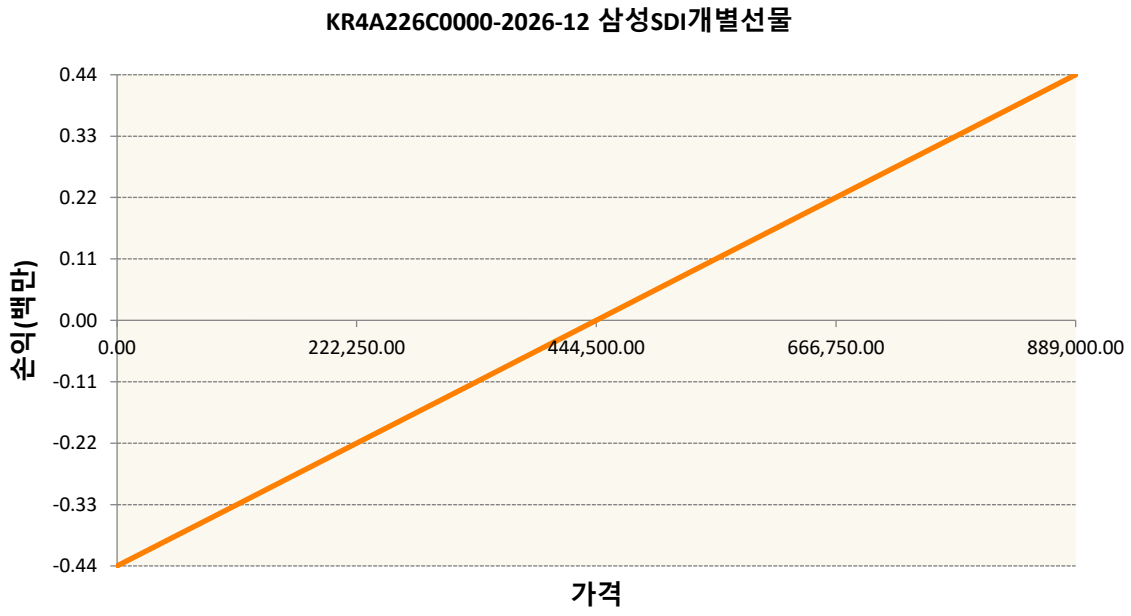
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	770	0	770	장내
누계	유가증권	선물	12,140	0	12,140	장내

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4A016C0004	2026-12 코스피200지수선물						940
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-940	-940	-940	-940	-940	-940	-940
-5.33%	-627	-627	-627	-627	-627	-627	-627
-2.67%	-313	-313	-313	-313	-313	-313	-313
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	313	313	313	313	313	313	313
5.33%	627	627	627	627	627	627	627
8.00%	940	940	940	940	940	940	940

KR4A226C0000	2026-12 삼성SDI개별선물						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)

3,429

공시일	2026-11-18
기준일	2026-11-17

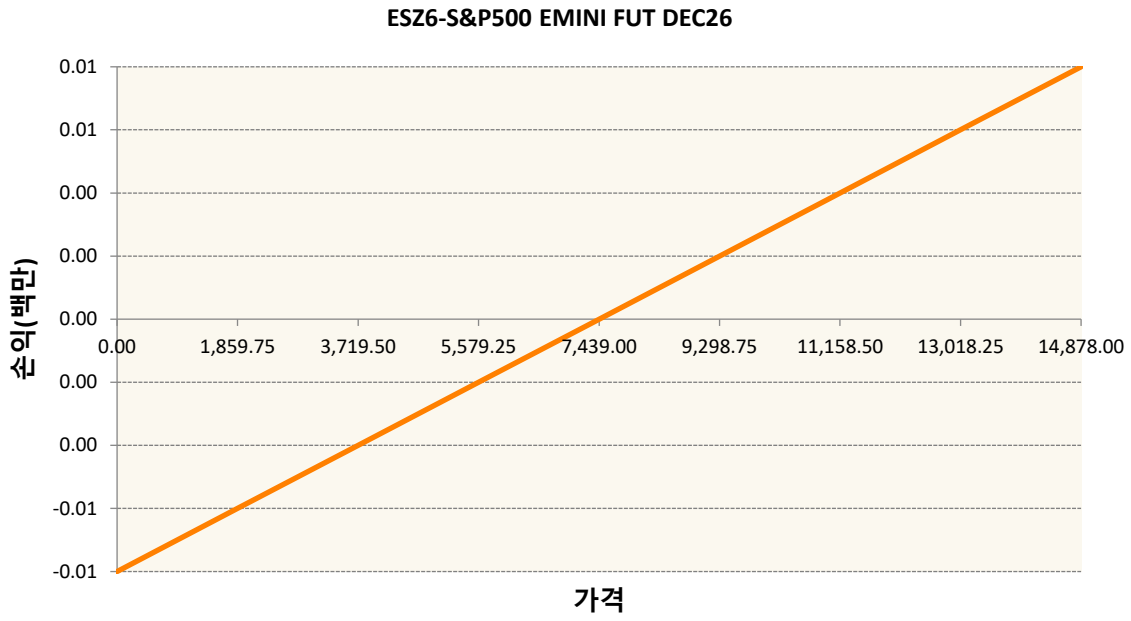
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

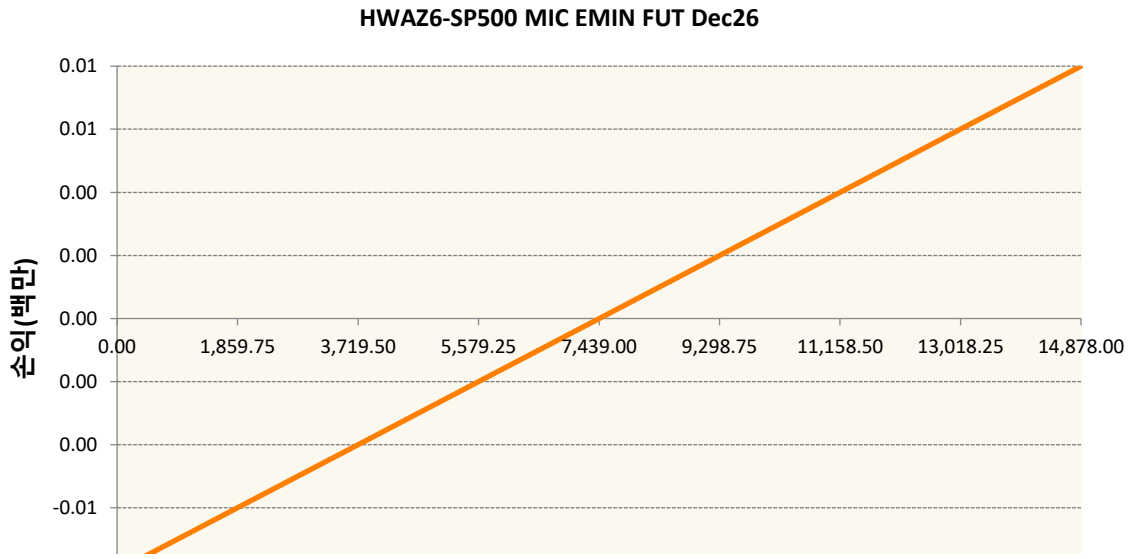
1. 계약금액

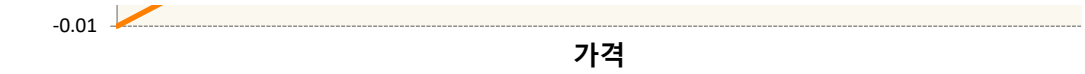
(단위:백만원)

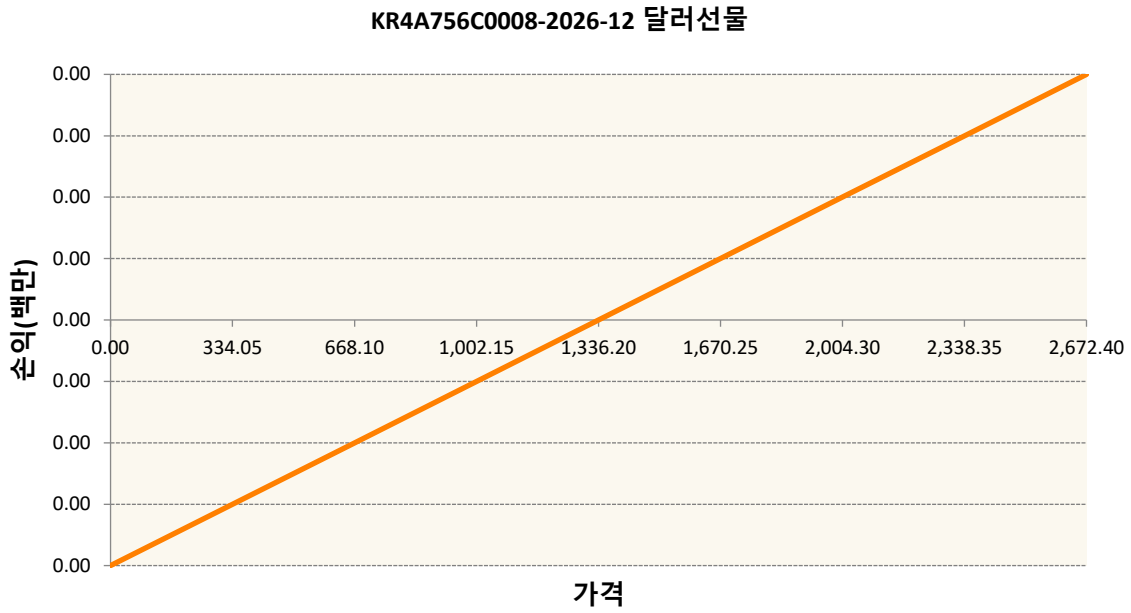
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
신규	지수	선물	0	0	0	장내
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	지수	선물	73,927	0	73,927	
누계	지수	선물	360	0	360	장내
누계	통화	선물	22,582	0	22,582	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESZ6	S&P500 EMINI FUT DEC26	5,914
HWAZ6	SP500 MIC EMIN FUT Dec26	29
KR4A756C00	2026-12 달러선물	1,807

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	3,802

공시일	2026-11-18
기준일	2026-11-17

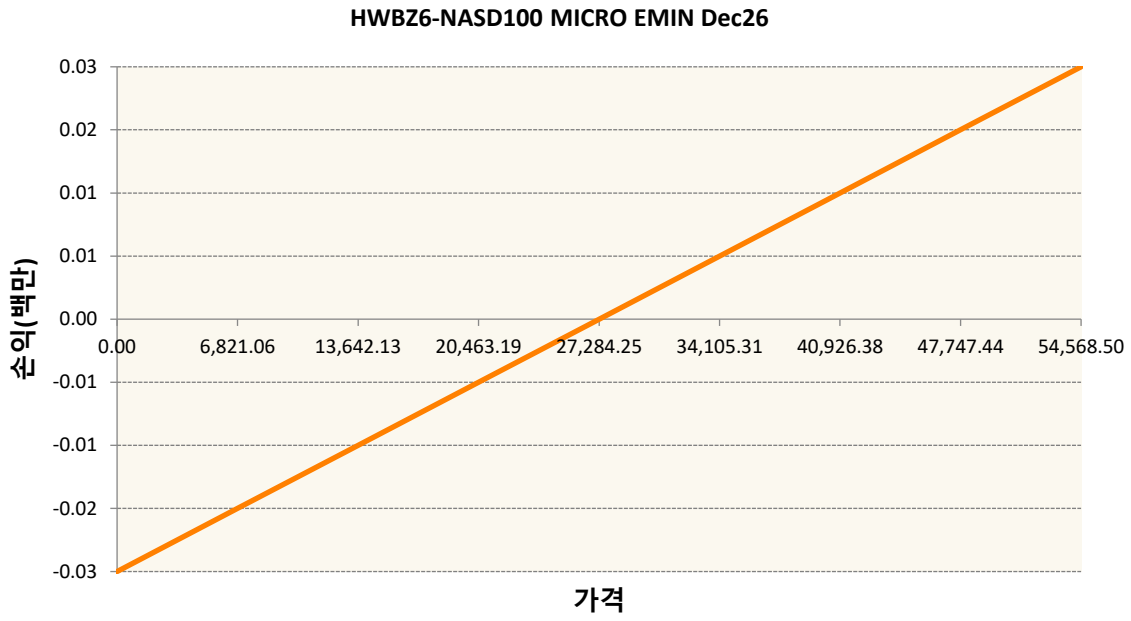
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

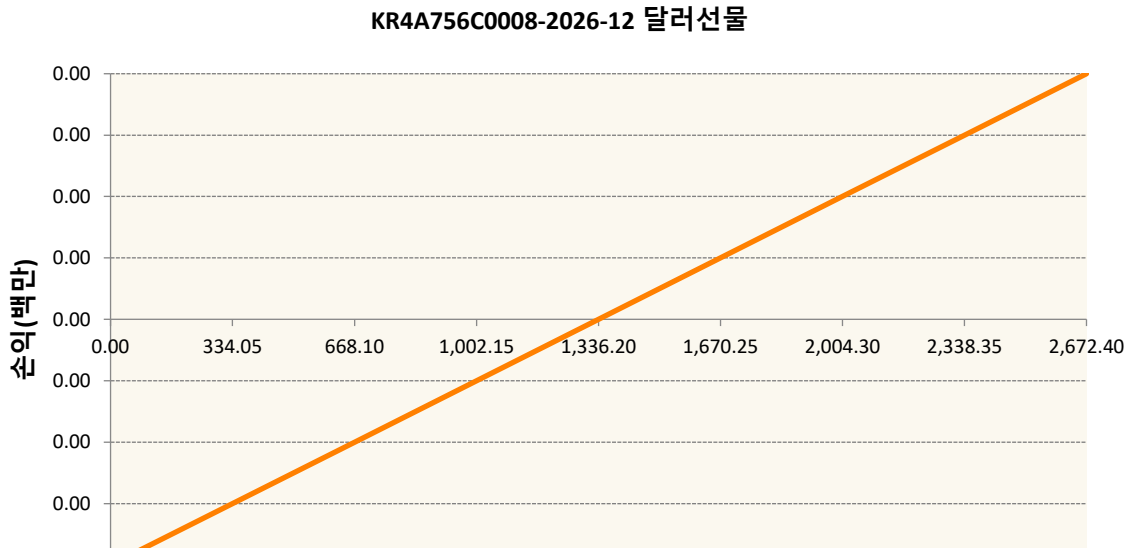
1. 계약금액

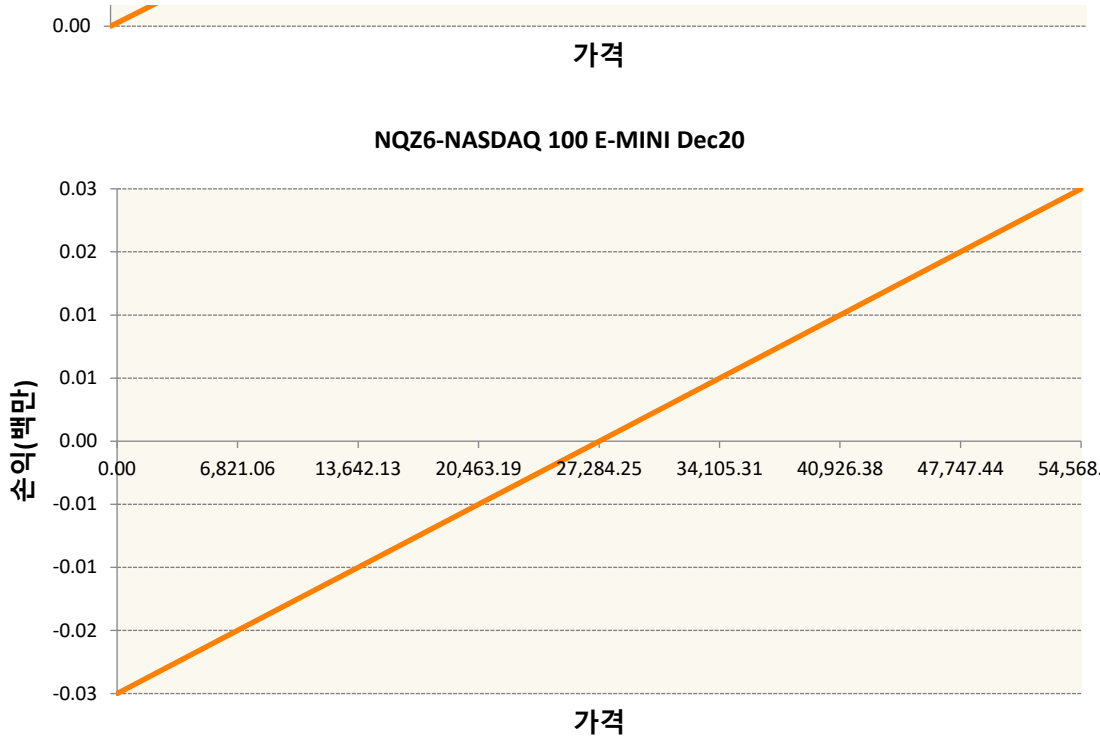
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
신규	지수	선물	0	0	0	장내
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	지수	선물	30,208	0	30,208	
누계	지수	선물	378	0	378	장내
누계	통화	선물	10,235	0	10,235	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HWBZ6	NASD100 MICRO EMIN Dec26	30
KR4A756C00	2026-12 달러선물	819
NQZ6	NASDAQ 100 E-MINI Dec20	2,417

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

(단위:백만원)

2,369

공시일	2026-11-18
기준일	2026-11-17

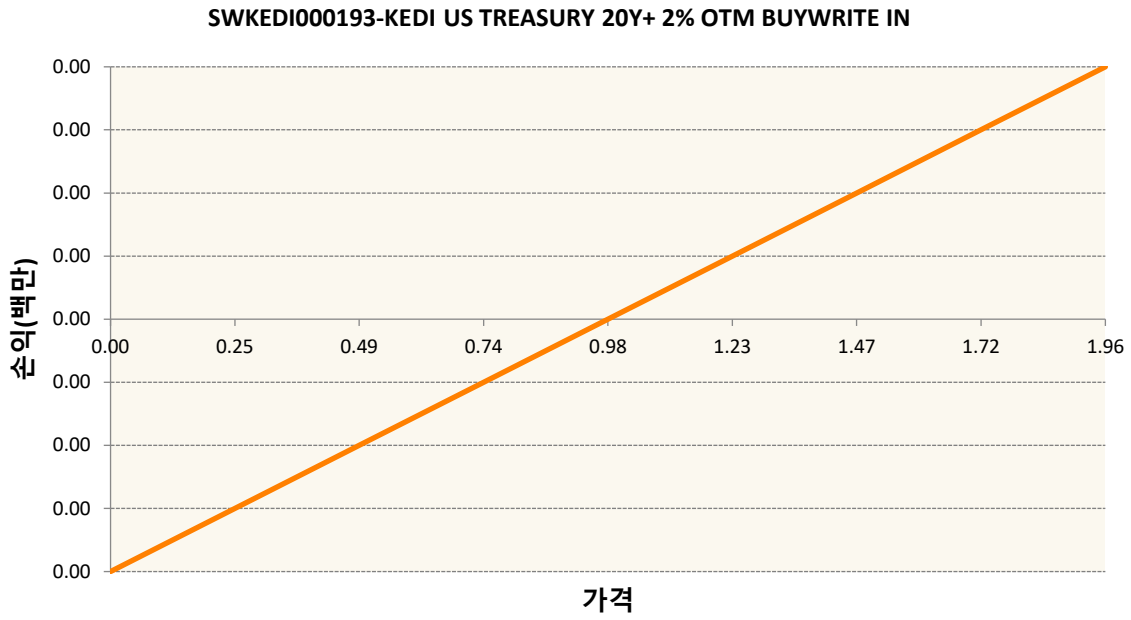
SOL미국30년국채커버드콜(합성)

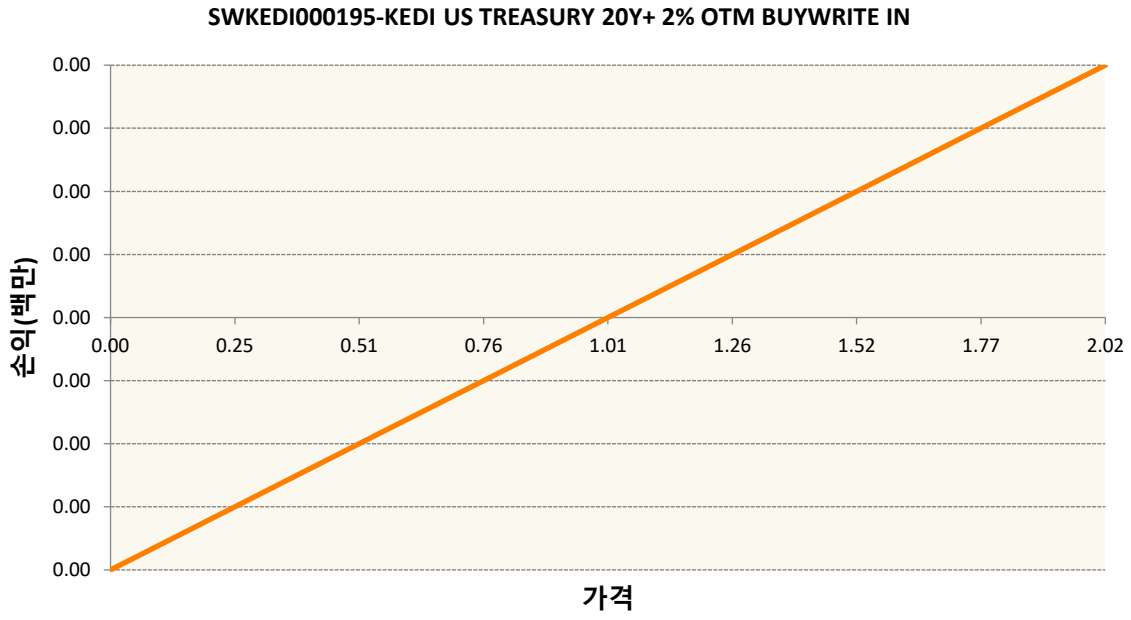
1. 계약금액

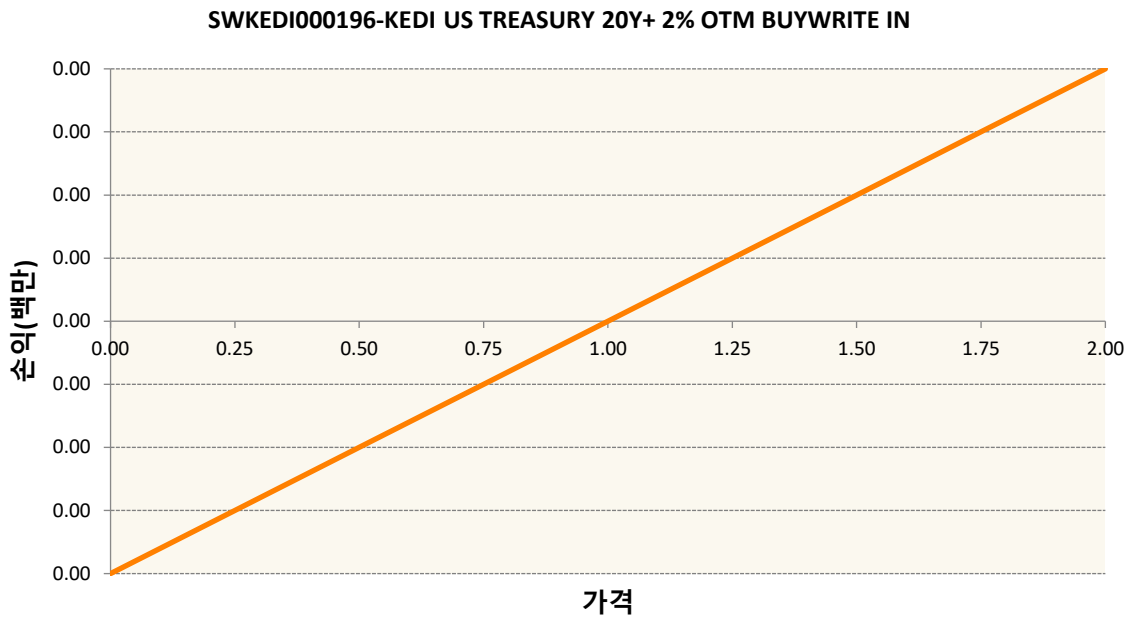
(단위:백만원)

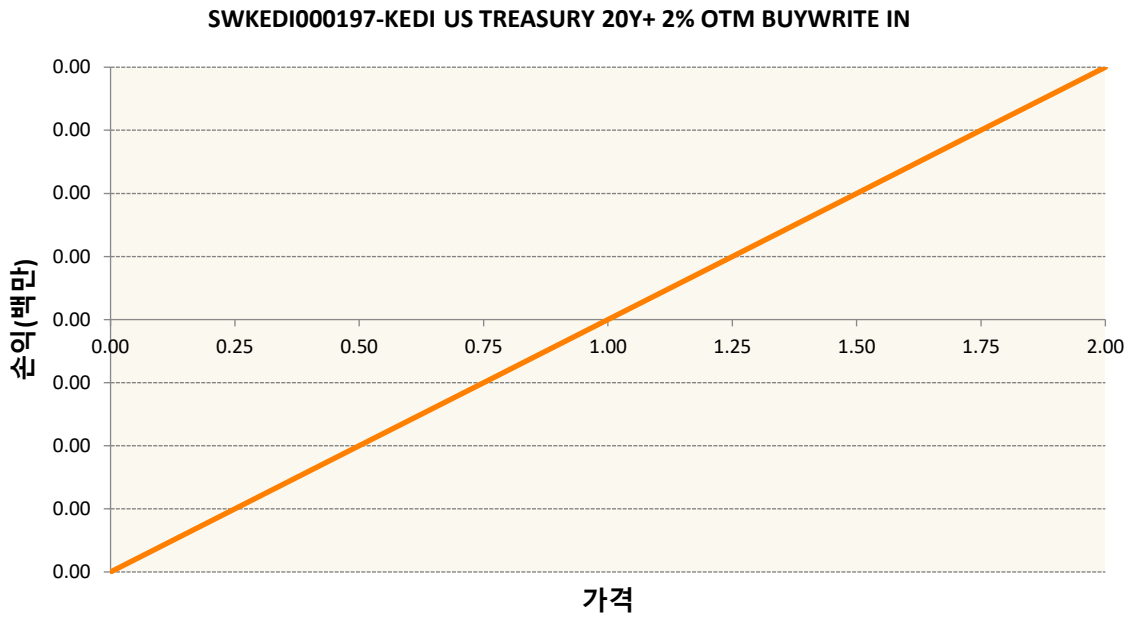
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	275,306	0	275,306	장외

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	6,940
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	7,820
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	2,573
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	4,670

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

8,544