공시일	2026-11-19
기준일	2026-11-18

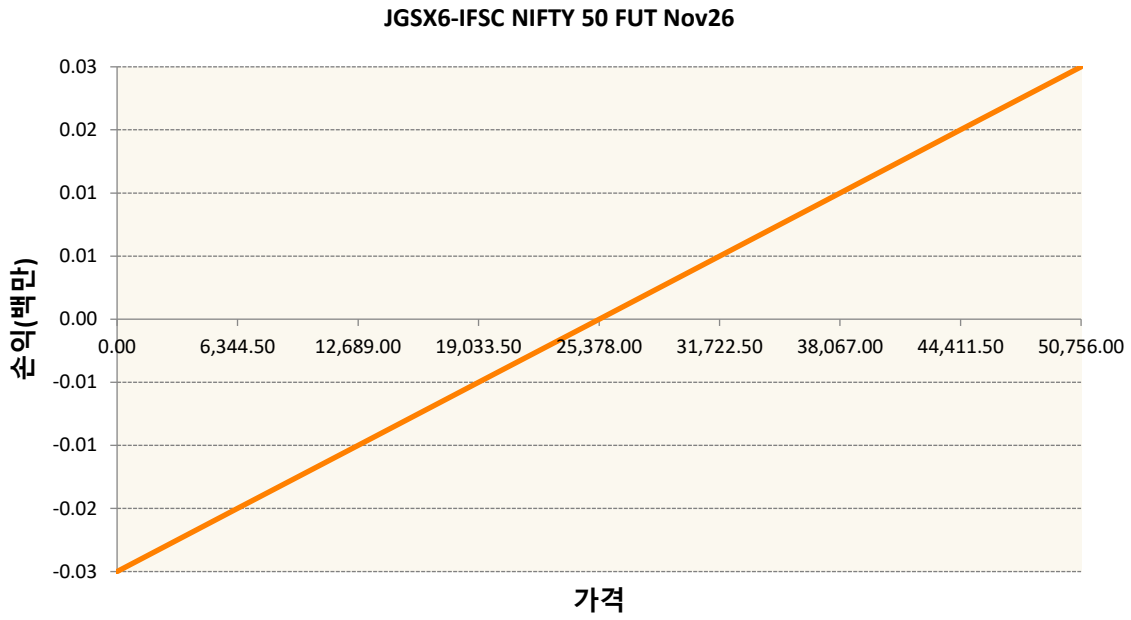
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	336	0	336	

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	2026-11-19
기준일	2026-11-18

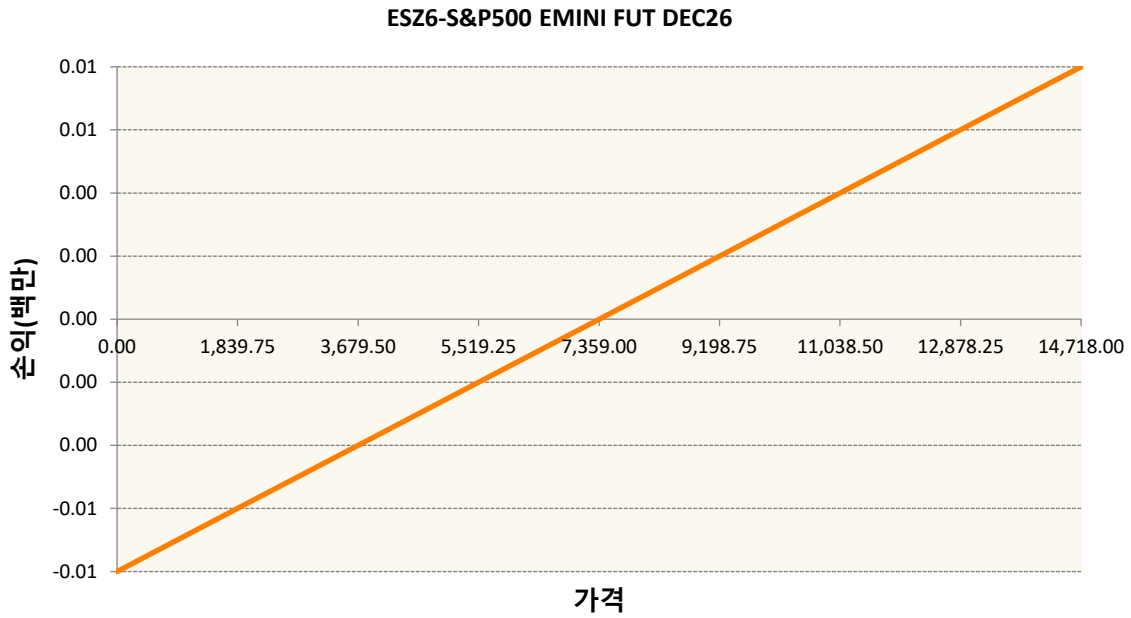
SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	510	0	510	

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	2026-11-19
기준일	2026-11-18

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	2026-11-19
기준일	2026-11-18

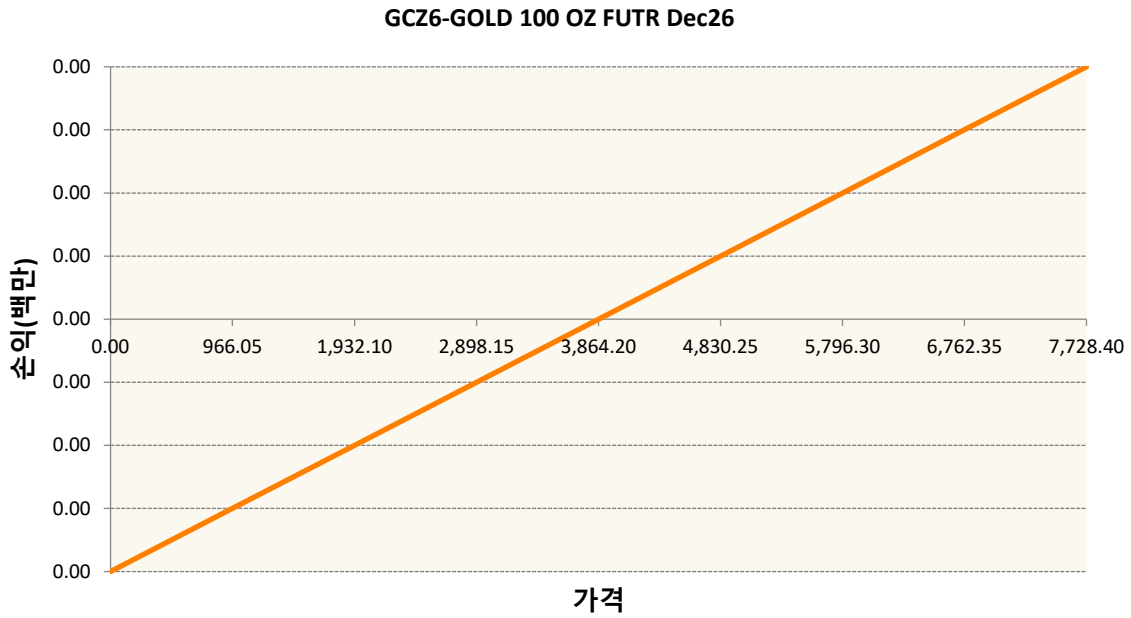
SOL골드커버드콜액티브특별자산상장지수(금

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			5,533	0	5,533	
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	443

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

(단위:백만원)

575

공시일	2026-11-19
기준일	2026-11-18

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	141
AOPLTRAP17 PLTR US 11/20/26 P177.5 EQUITY	4

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

(단위:백만원)

500

공시일	2026-11-19
기준일	2026-11-18

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	2026-11-19
기준일	2026-11-18

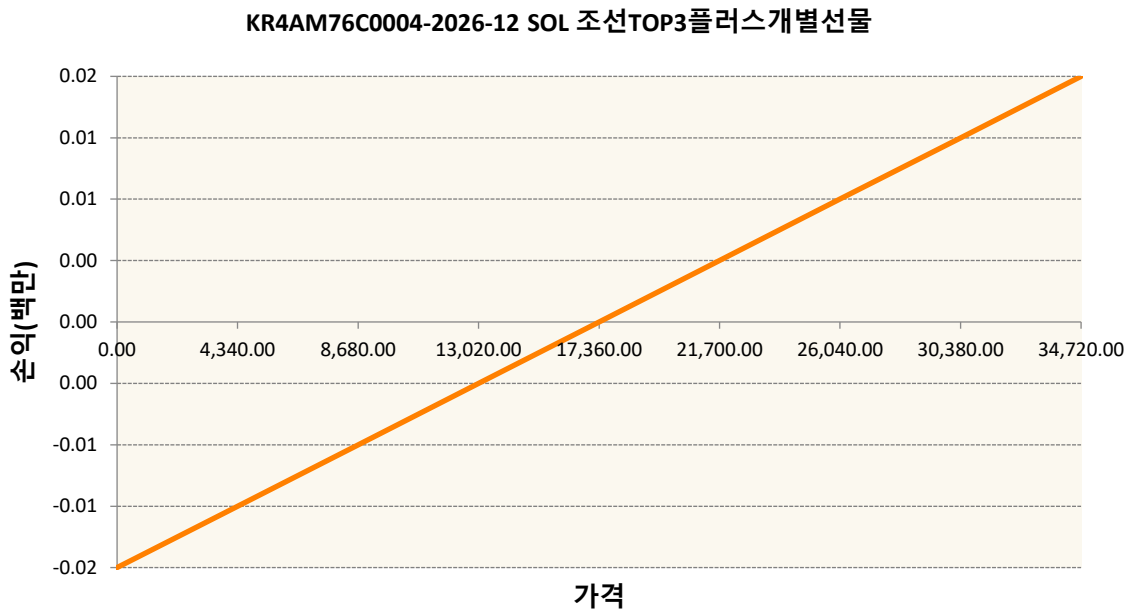
SOL조선TOP3플러스레버리지상장지수(주식)

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	4,617	0	4,617	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4AM76C0004	2026-12 SOL 조선TOP3플러스개별선물						3,701
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-3,701	-3,701	-3,701	-3,701	-3,701	-3,701	-3,701
-5.33%	-2,467	-2,467	-2,467	-2,467	-2,467	-2,467	-2,467
-2.67%	-1,234	-1,234	-1,234	-1,234	-1,234	-1,234	-1,234
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	1,234	1,234	1,234	1,234	1,234	1,234	1,234
5.33%	2,467	2,467	2,467	2,467	2,467	2,467	2,467
8.00%	3,701	3,701	3,701	3,701	3,701	3,701	3,701

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

6,394

공시일	2026-11-19
기준일	2026-11-18

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	2026-11-19
기준일	2026-11-18

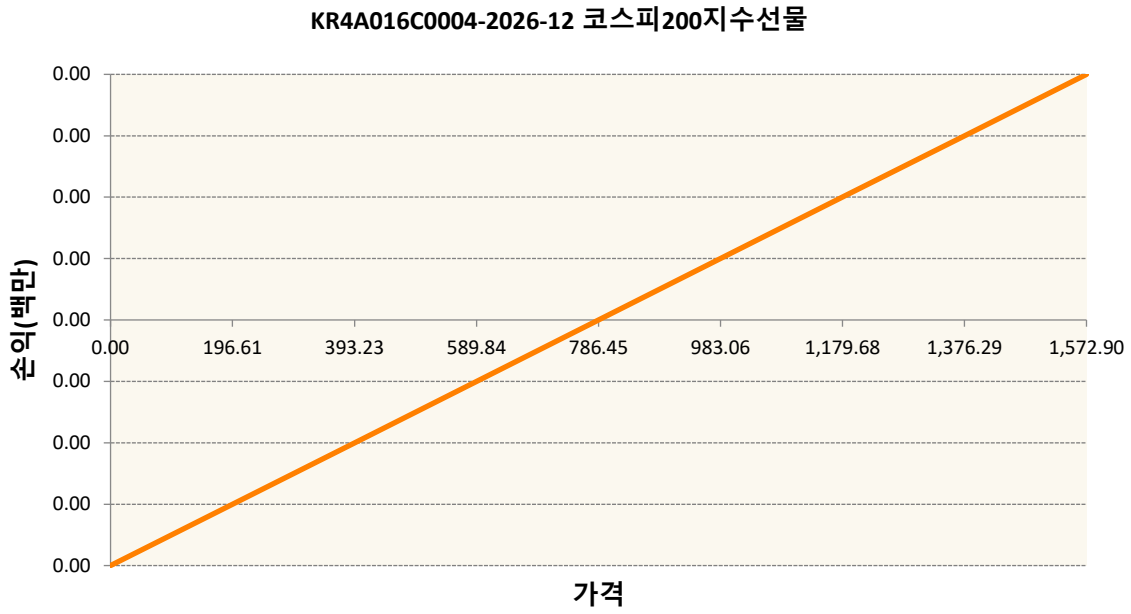
SOL 200타겟위클리커버드콜상장지수(주식)

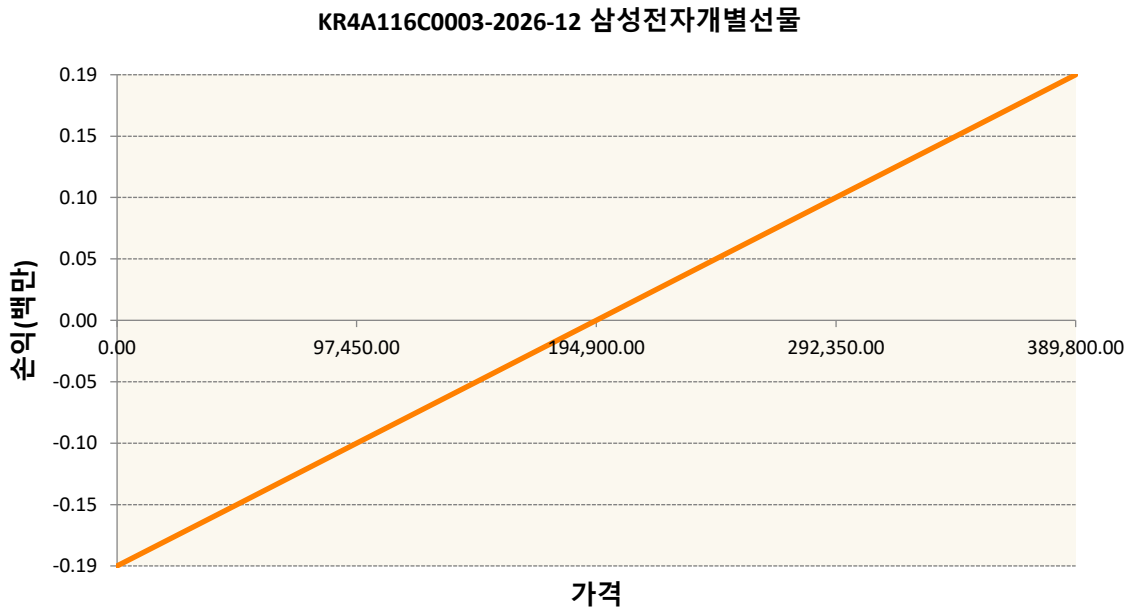
1. 계약금액

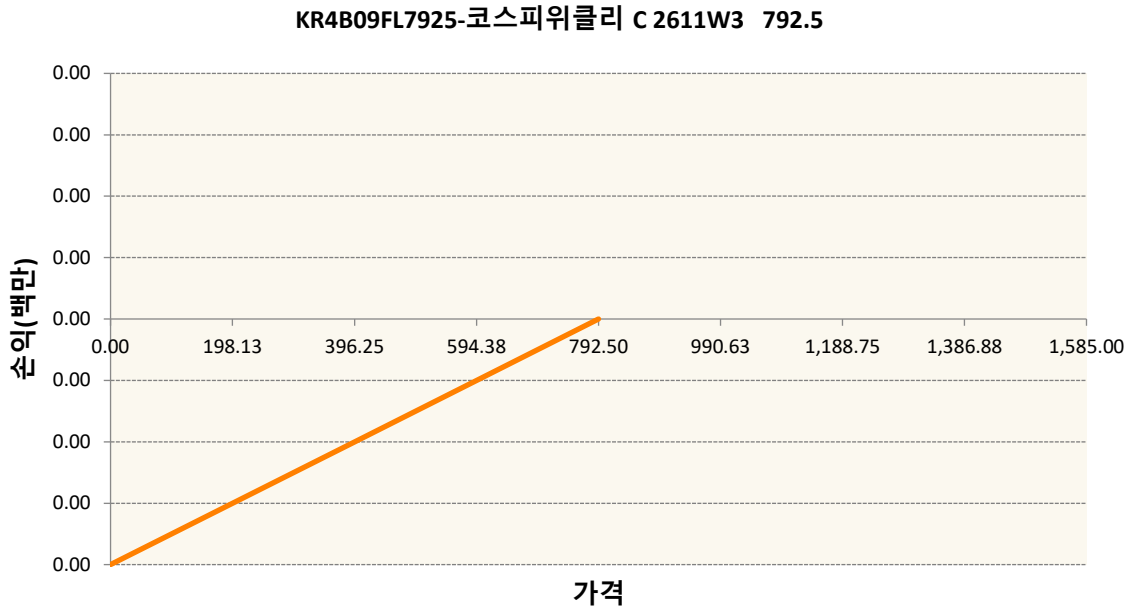
(단위:백만원)

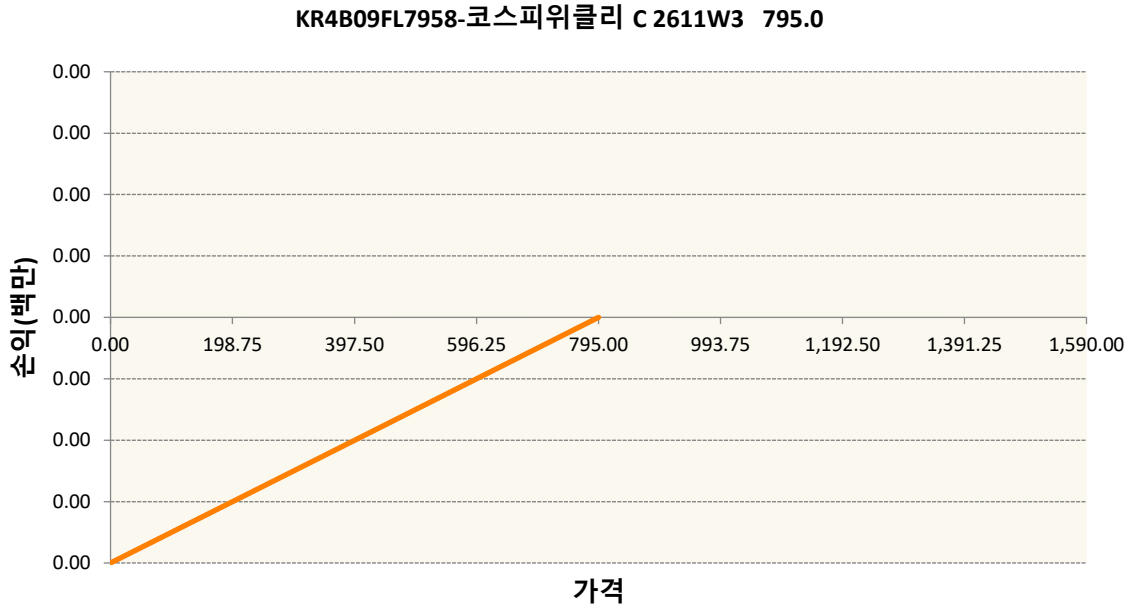
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	15,637	0	15,637	장내
누계	유가증권	옵션	0	30,748	-30,748	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

	KR4A016C0004	2026-12 코스피200지수선물					410
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-410	-410	-410	-410	-410	-410	-410
-5.33%	-273	-273	-273	-273	-273	-273	-273
-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%	273	273	273	273	273	273	273
8.00%	410	410	410	410	410	410	410
	KR4A116C0003	2026-12 삼성전자개별선물					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
	KR4B09FL7925		코스피위클리 C 2611W3 792.5				1,300
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,299	-1,299	-1,299	-1,299	-1,299	-1,300	-1,300
-5.33%	-811	-811	-812	-814	-817	-820	-824
-2.67%	-334	-341	-349	-358	-368	-379	-390
0%	53	35	18	0	-18	-36	-53
2.67%	236	224	210	196	181	166	150
5.33%	274	271	267	262	256	249	241
8.00%	277	277	276	275	274	272	270
	KR4B09FL7958		코스피위클리 C 2611W3 795.0				882
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-881	-881	-881	-881	-881	-881	-882
-5.33%	-556	-556	-556	-557	-559	-561	-563
-2.67%	-236	-239	-244	-249	-255	-262	-269
0%	34	23	11	0	-12	-23	-35
2.67%	173	164	154	144	133	123	112
5.33%	205	203	200	196	191	186	179
8.00%	208	208	208	207	206	204	202

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

9,026

공시일	2026-11-19
기준일	2026-11-18

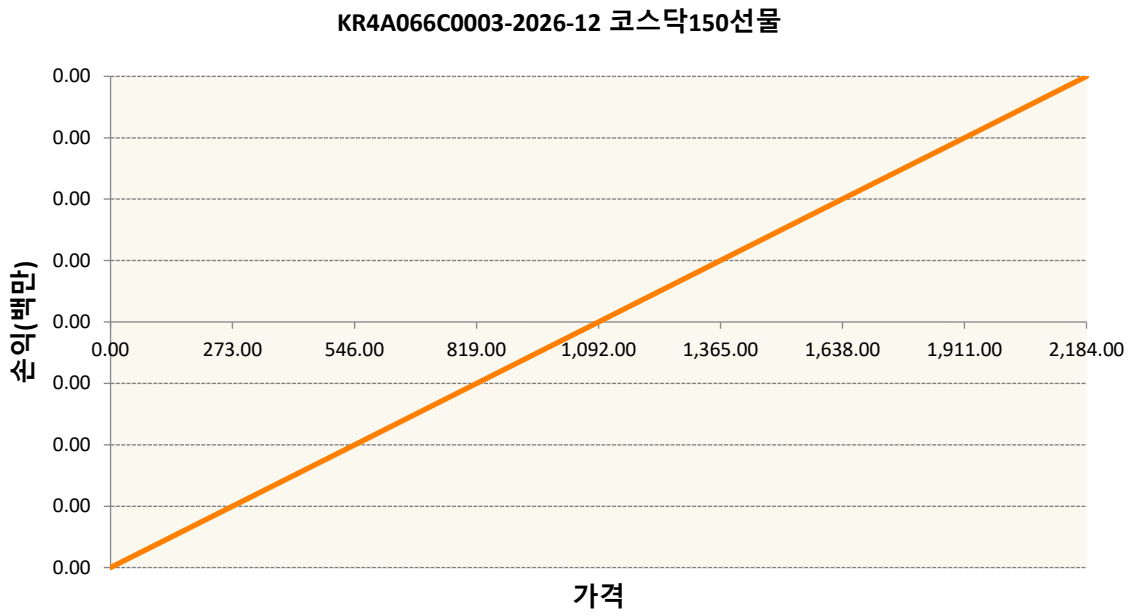
SOL코스닥150인덱스(주식-파생형)

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	437	0	437	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	2026-11-19
기준일	2026-11-18

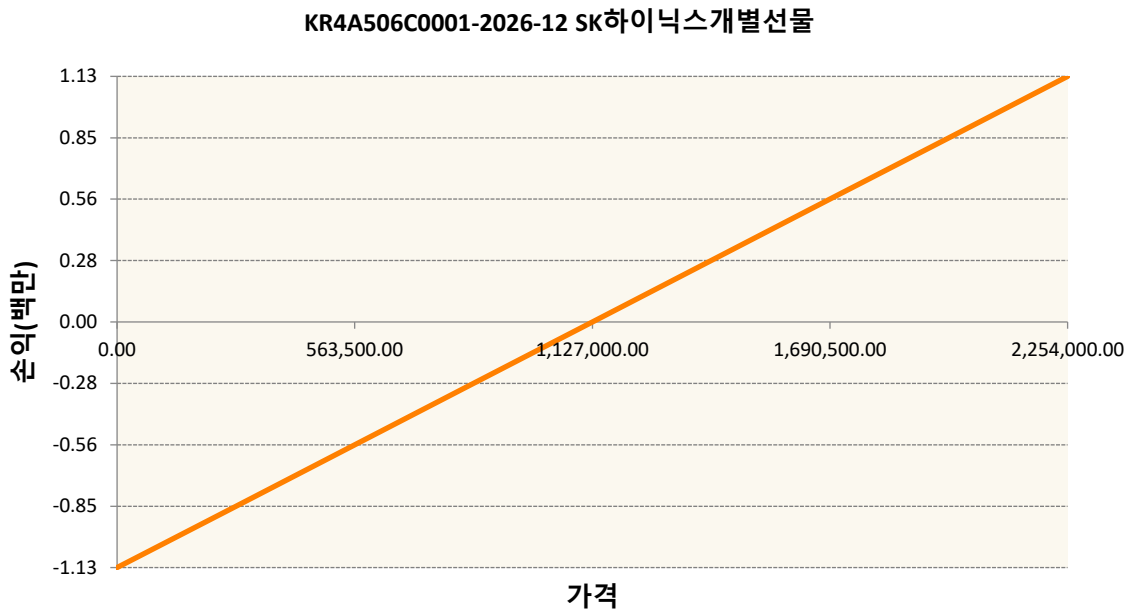
SOLSK하이닉스단일종목레버리지상장지수

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	282	0	282	장내
누계	유가증권	선물	16,319	0	16,319	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A506C0001	2026-12 SK하이닉스개별선물	1,325

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,325	-1,325	-1,325	-1,325	-1,325	-1,325	-1,325
-5.33%	-883	-883	-883	-883	-883	-883	-883
-2.67%	-442	-442	-442	-442	-442	-442	-442
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	442	442	442	442	442	442	442
5.33%	883	883	883	883	883	883	883
8.00%	1,325	1,325	1,325	1,325	1,325	1,325	1,325

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

6,651

공시일	2026-11-19
기준일	2026-11-18

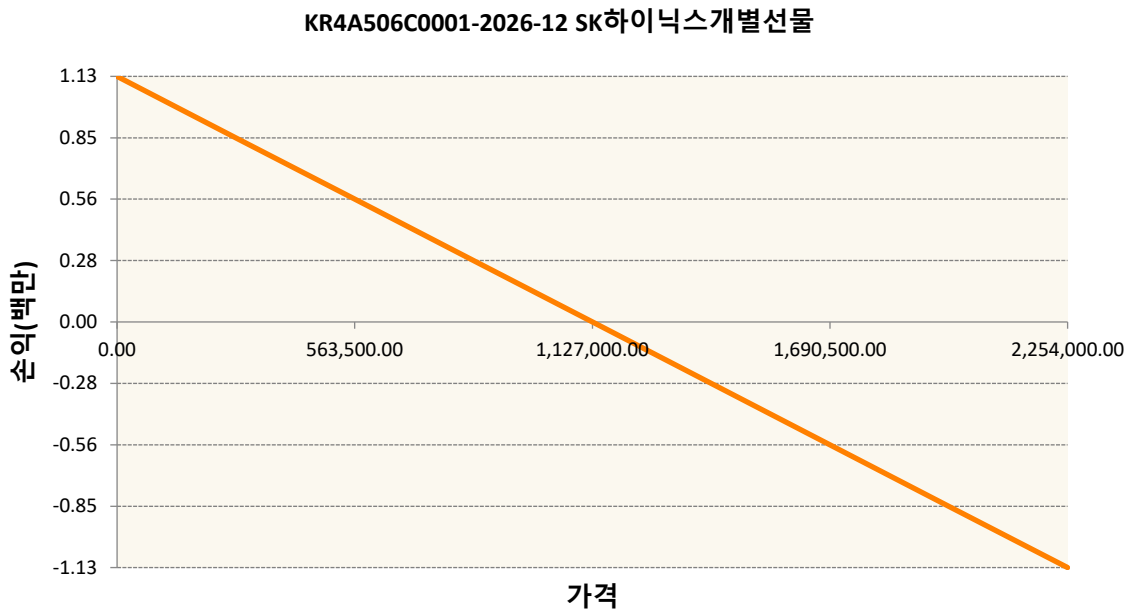
SOLSK하이닉스선물단일종목인버스2X상장지

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	40,252	0	40,252	장내
누계	유가증권	선물	0	155,109	-155,109	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A506C0001	2026-12 SK하이닉스개별선물	12,596

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	12,596	12,596	12,596	12,596	12,596	12,596	12,596
-5.33%	8,397	8,397	8,397	8,397	8,397	8,397	8,397
-2.67%	4,199	4,199	4,199	4,199	4,199	4,199	4,199
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-4,199	-4,199	-4,199	-4,199	-4,199	-4,199	-4,199
5.33%	-8,397	-8,397	-8,397	-8,397	-8,397	-8,397	-8,397
8.00%	-12,596	-12,596	-12,596	-12,596	-12,596	-12,596	-12,596

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

63,217

공시일	2026-11-19
기준일	2026-11-18

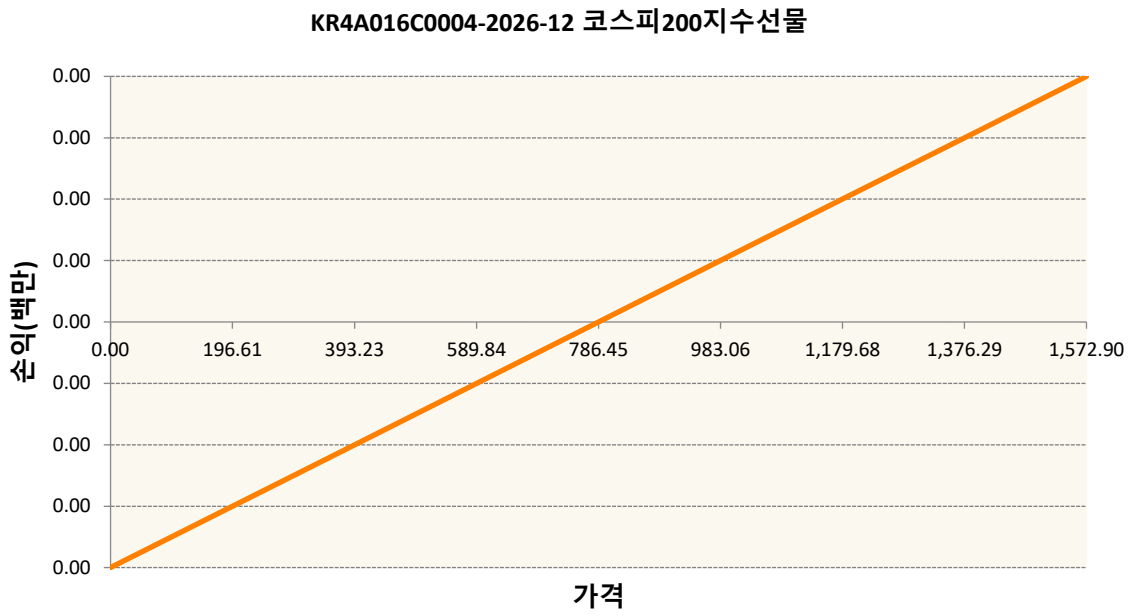
SOL200커버드콜액티브상장지수(주식-파생형

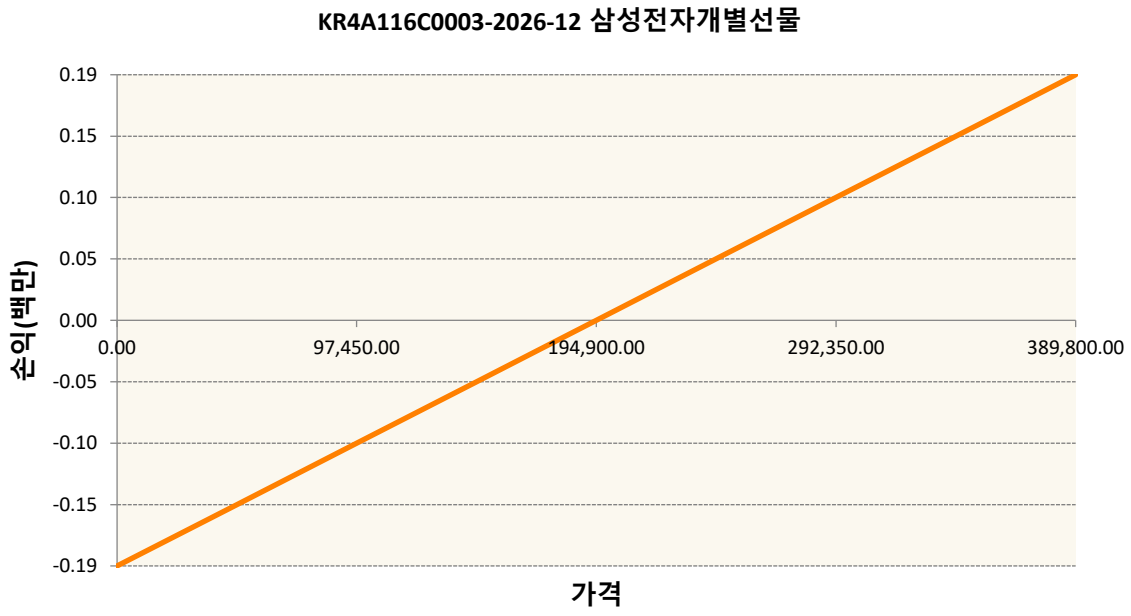
1. 계약금액

(단위:백만원)

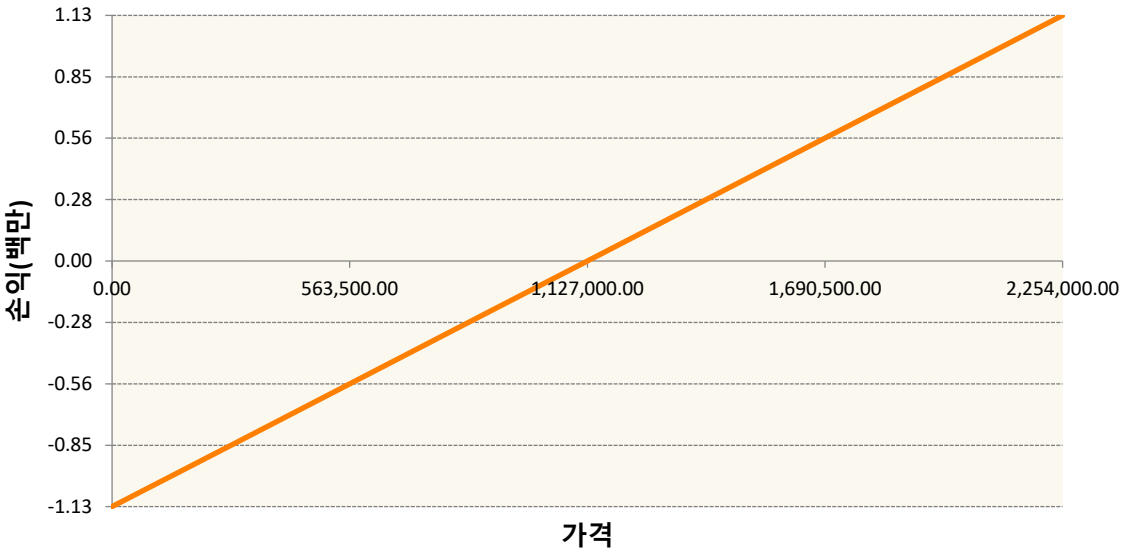
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,154	0	3,154	장내
누계	유가증권	옵션	0	2,769	-2,769	장내

2. 만기시점의 손익구조

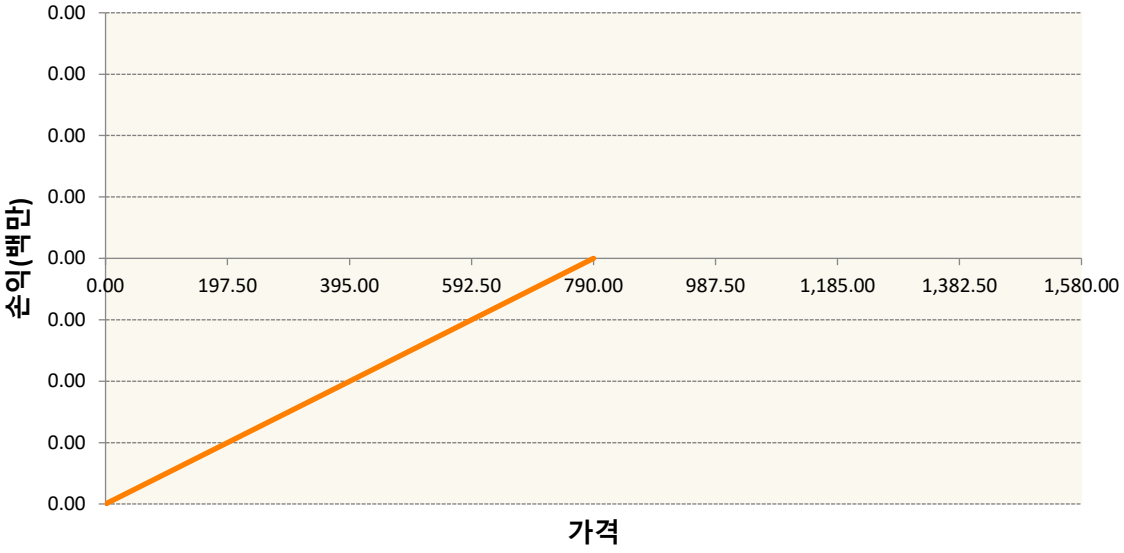




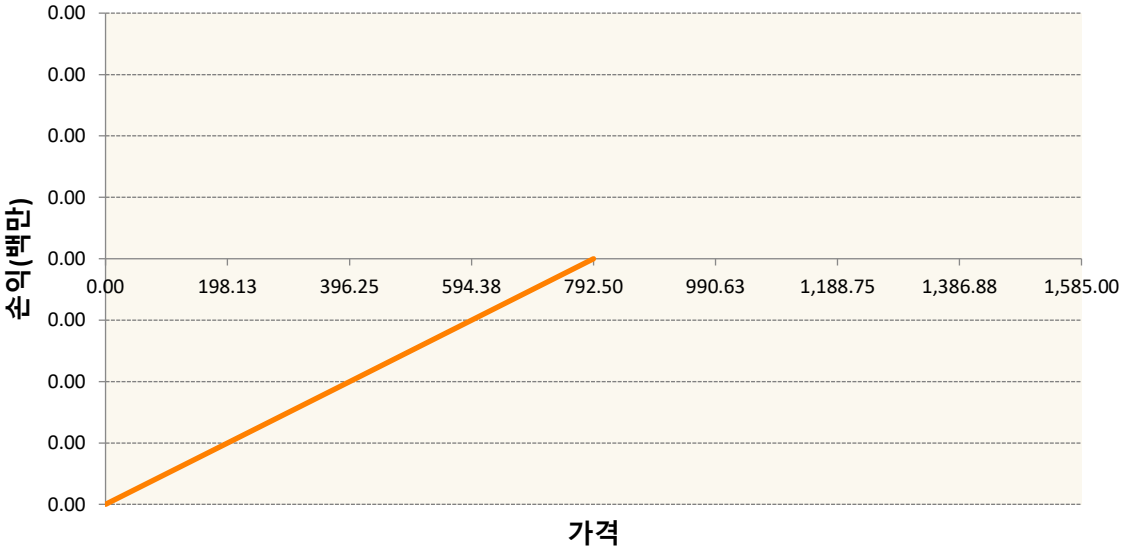
KR4A506C0001-2026-12 SK하이닉스개별선물



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					33
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-33	-33	-33	-33	-33	-33	-33
-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%	33	33	33	33	33	33	33

	KR4A506C0001	2026-12 SK하이닉스개별선물					79
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-79	-79	-79	-79	-79	-79	-79
-5.33%	-52	-52	-52	-52	-52	-52	-52
-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%	52	52	52	52	52	52	52
8.00%	79	79	79	79	79	79	79

	KR4B09FL7909	코스피위클리 C 2611W3 790.0					110
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-110	-110	-110	-110	-110	-110	-110
-5.33%	-68	-68	-68	-68	-68	-69	-69
-2.67%	-27	-28	-28	-29	-30	-31	-32
0%	5	3	2	0	-2	-3	-5
2.67%	18	17	16	15	14	13	12
5.33%	21	21	20	20	20	19	18
8.00%	21	21	21	21	21	21	20

	KR4B09FL7925	코스피위클리 C 2611W3 792.5					84
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-84	-84	-84	-84	-84	-84	-84
-5.33%	-52	-52	-52	-53	-53	-53	-53
-2.67%	-22	-22	-22	-23	-24	-24	-25
0%	3	2	1	0	-1	-2	-3
2.67%	15	14	14	13	12	11	10
5.33%	18	18	17	17	17	16	16
8.00%	18	18	18	18	18	18	17

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

1,388

공시일	2026-11-19
기준일	2026-11-18

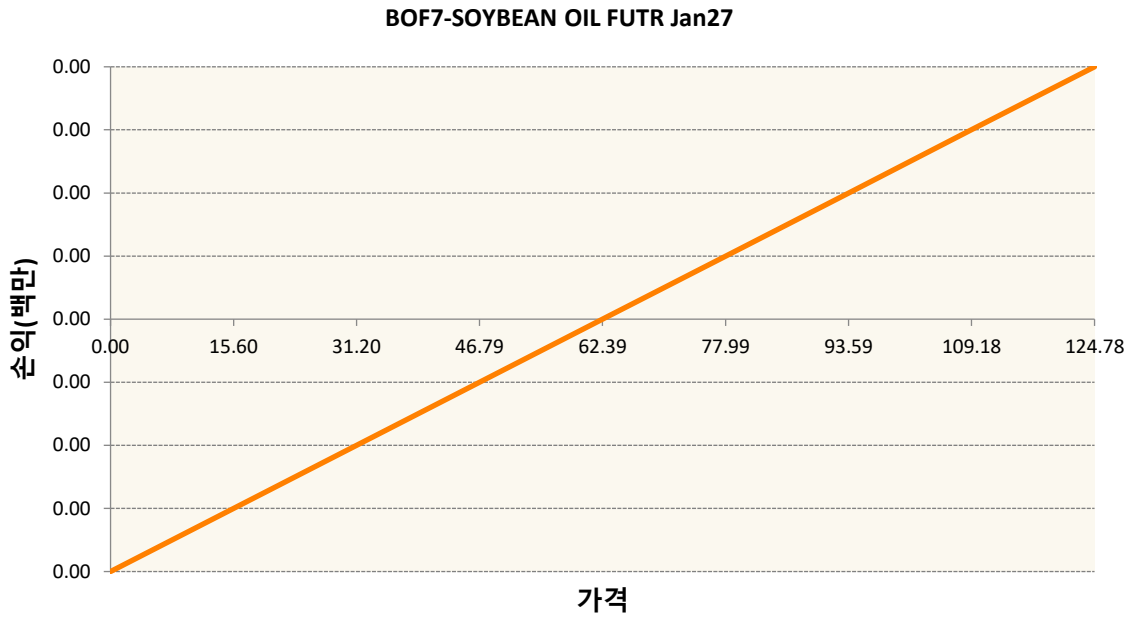
포커스농산물모(채권-파생형)

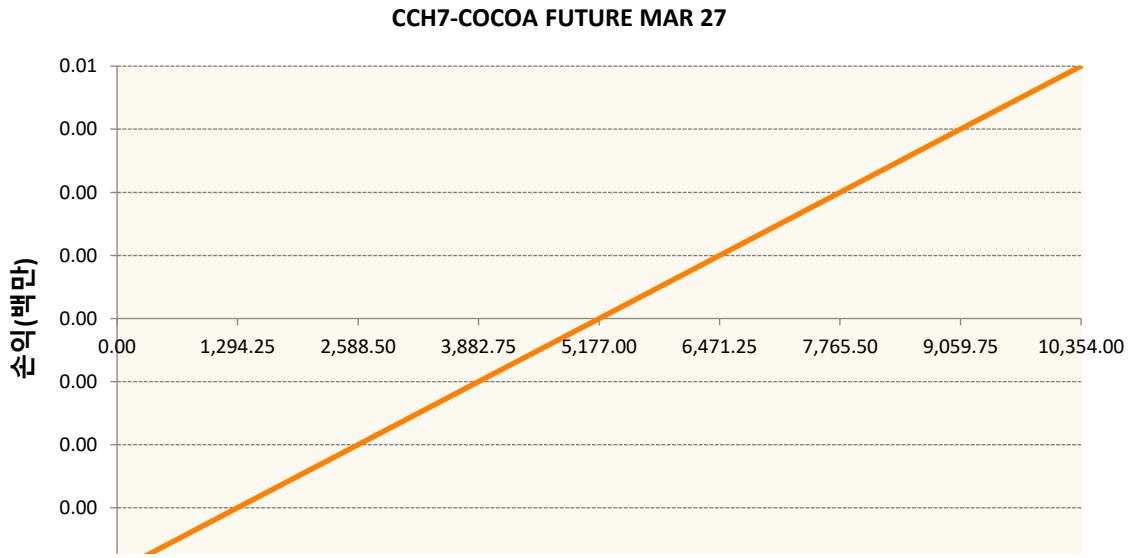
1. 계약금액

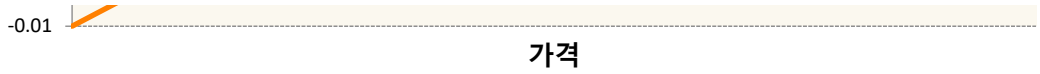
(단위:USD 백만)

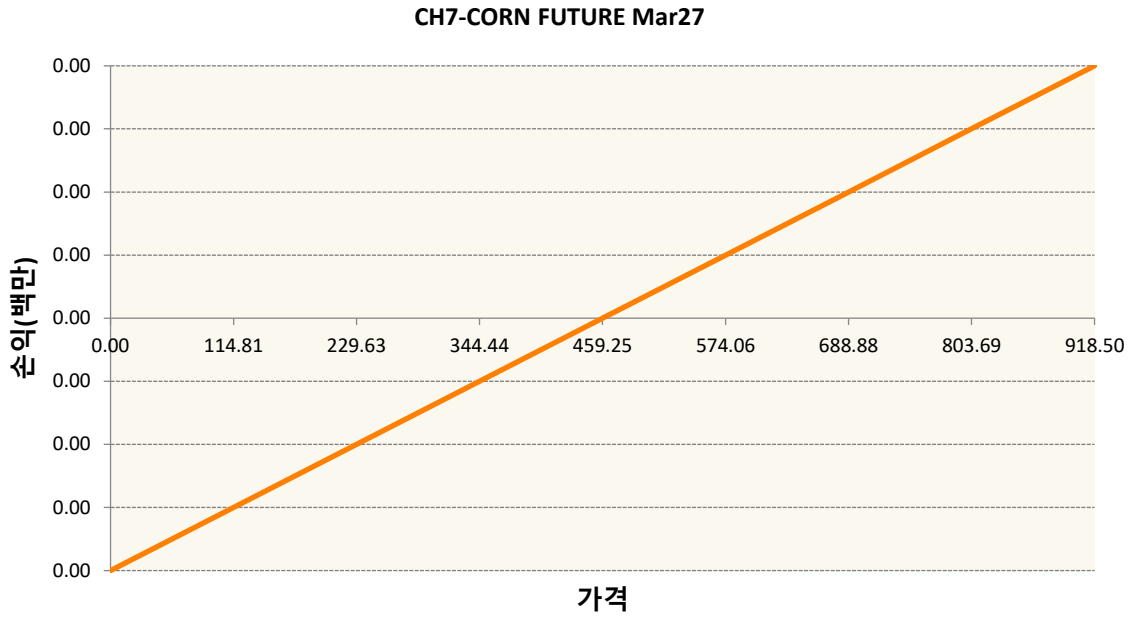
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	실물자산	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	실물자산	선물	321	0	321	
누계	유가증권	선물	1,999	0	1,999	
누계	통화	선물	0	53	-53	장내

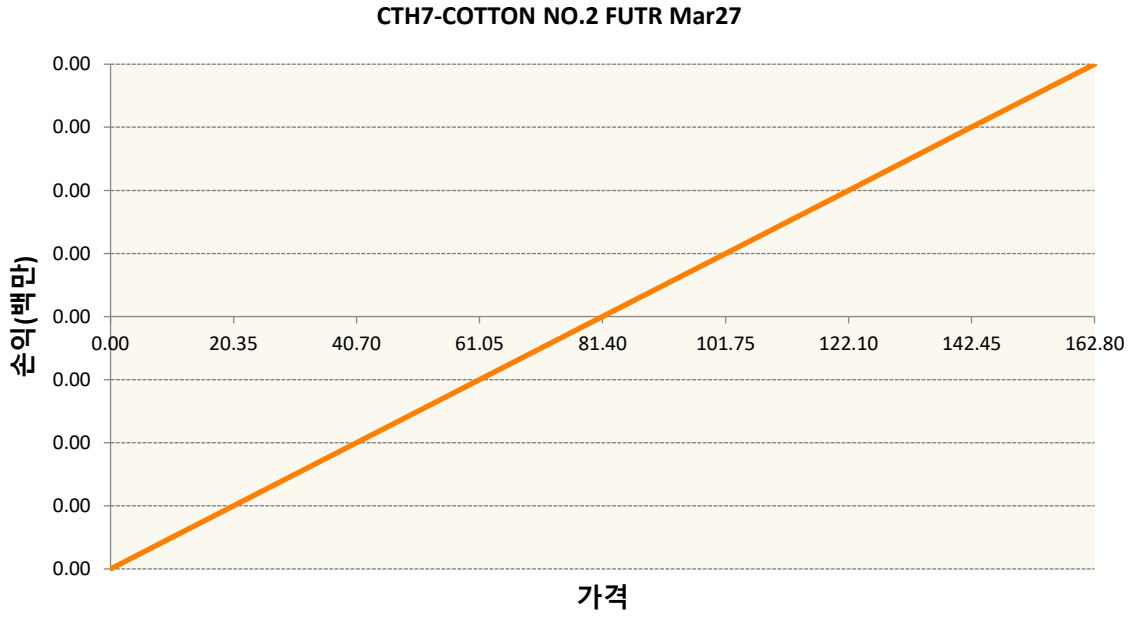
2. 만기시점의 손익구조

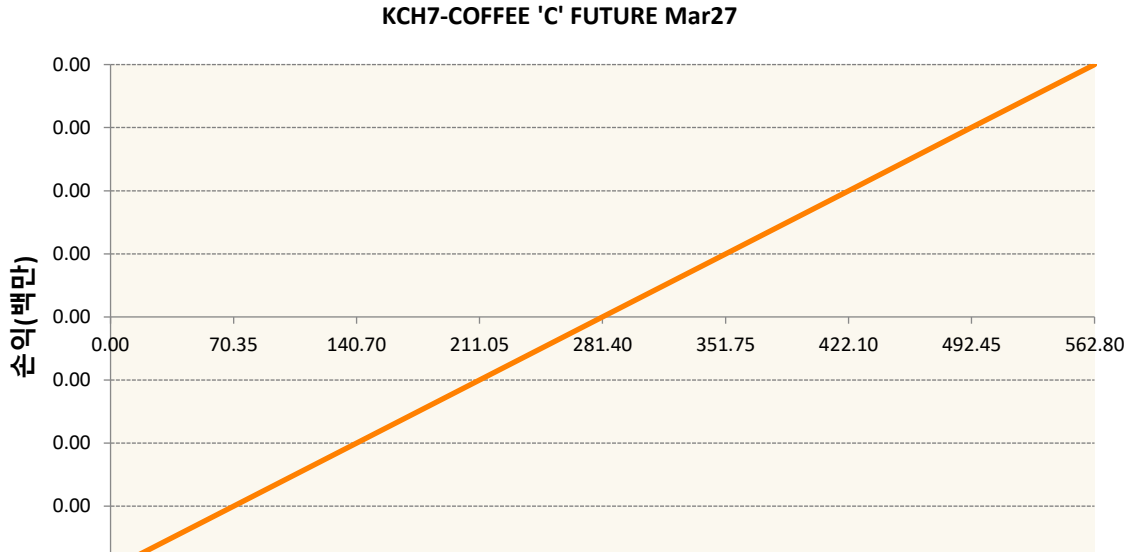


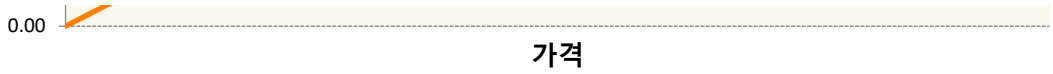



-0.01
가격

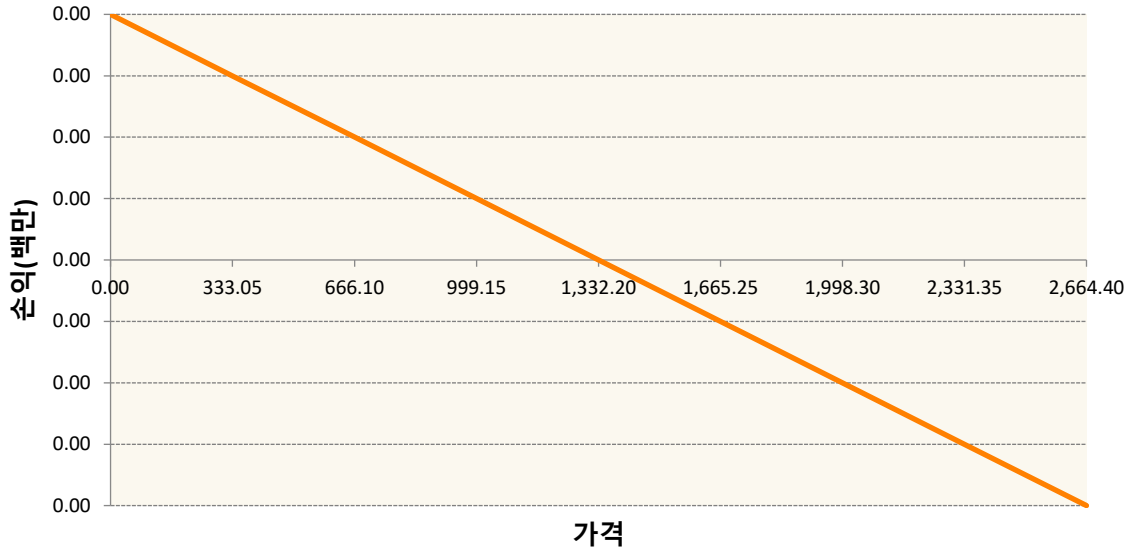

CH7-CORN FUTURE Mar27
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
114.81
229.63
344.44
459.25
574.06
688.88
803.69
918.50
손익(백만)
가격


CTH7-COTTON NO.2 FUTR Mar27
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
20.35
40.70
61.05
81.40
101.75
122.10
142.45
162.80
손익(백만)
가격

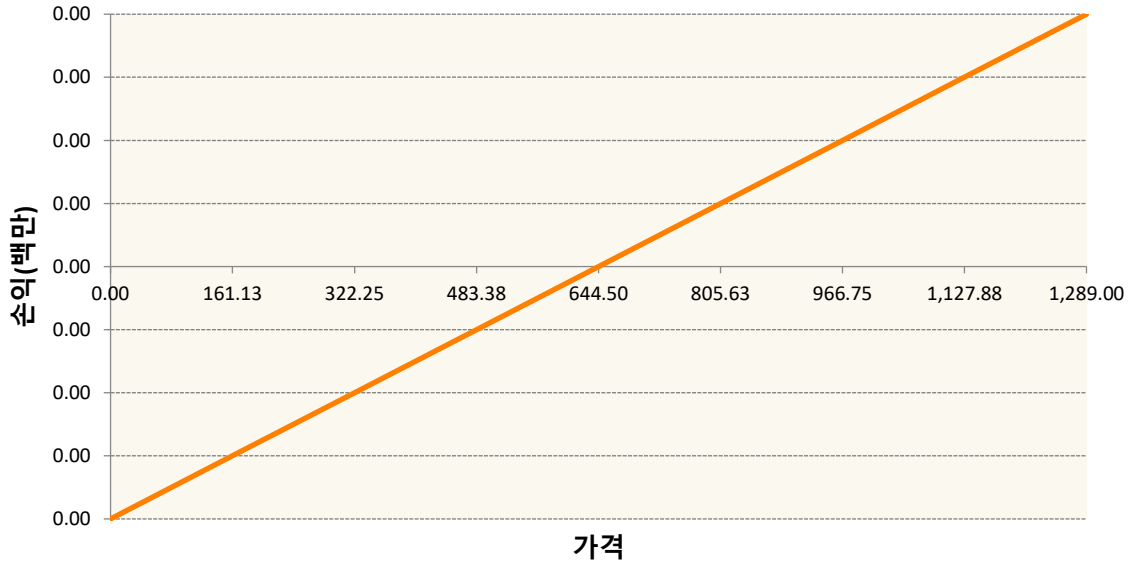

KCH7-COFFEE 'C' FUTURE Mar27
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
70.35
140.70
211.05
281.40
351.75
422.10
492.45
562.80
손익(백만)



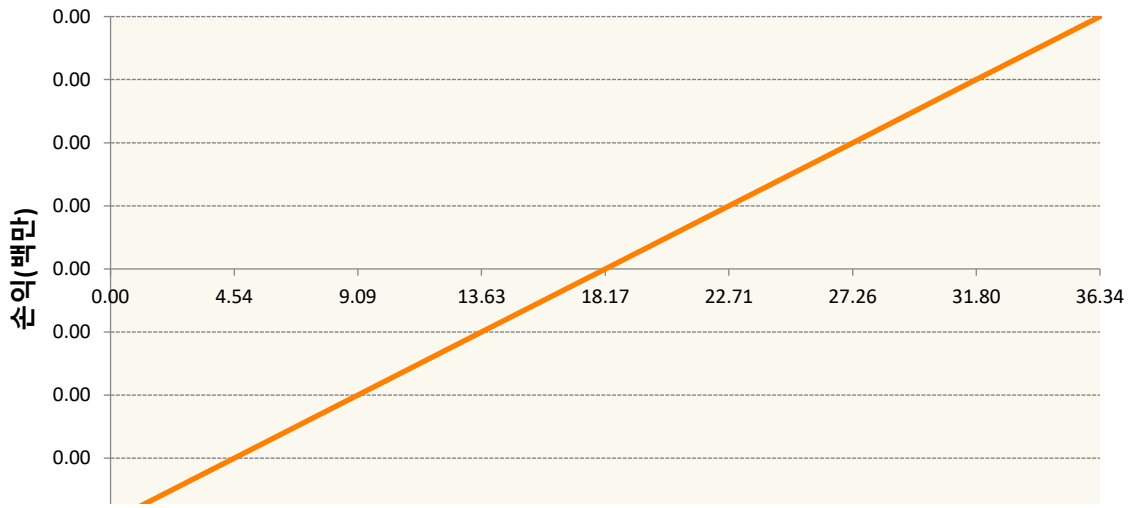
KR4A756C0008-2026-12 달러선물

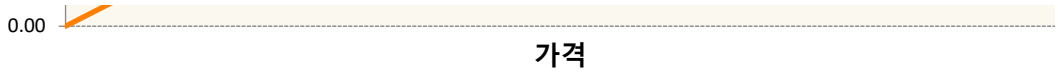


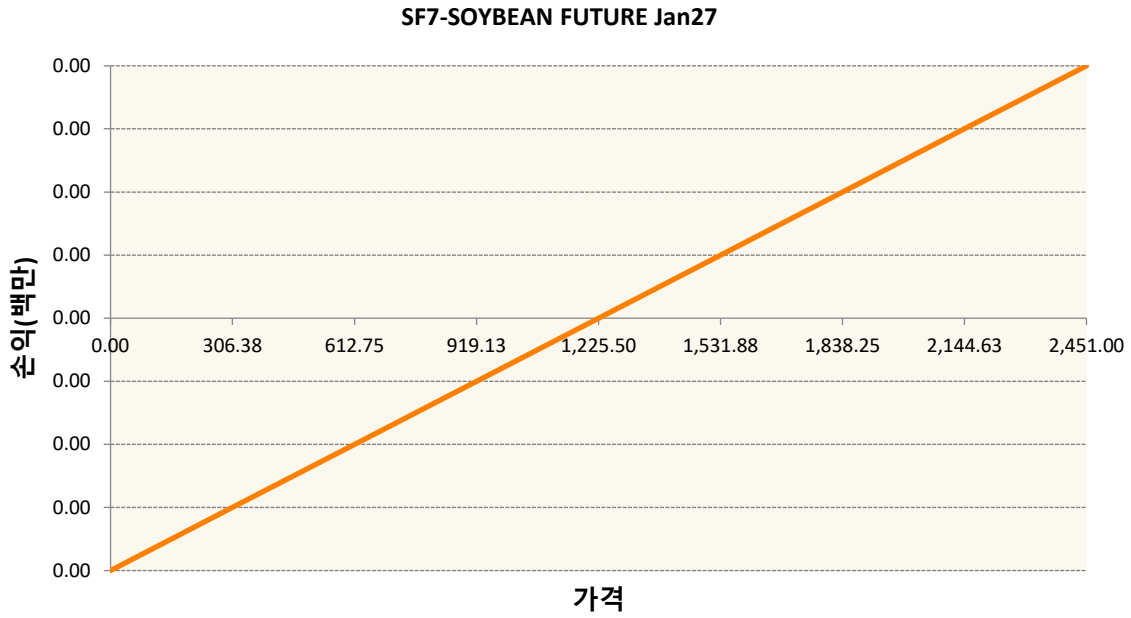
KWH7-KC HRW WHEAT FUT Mar27

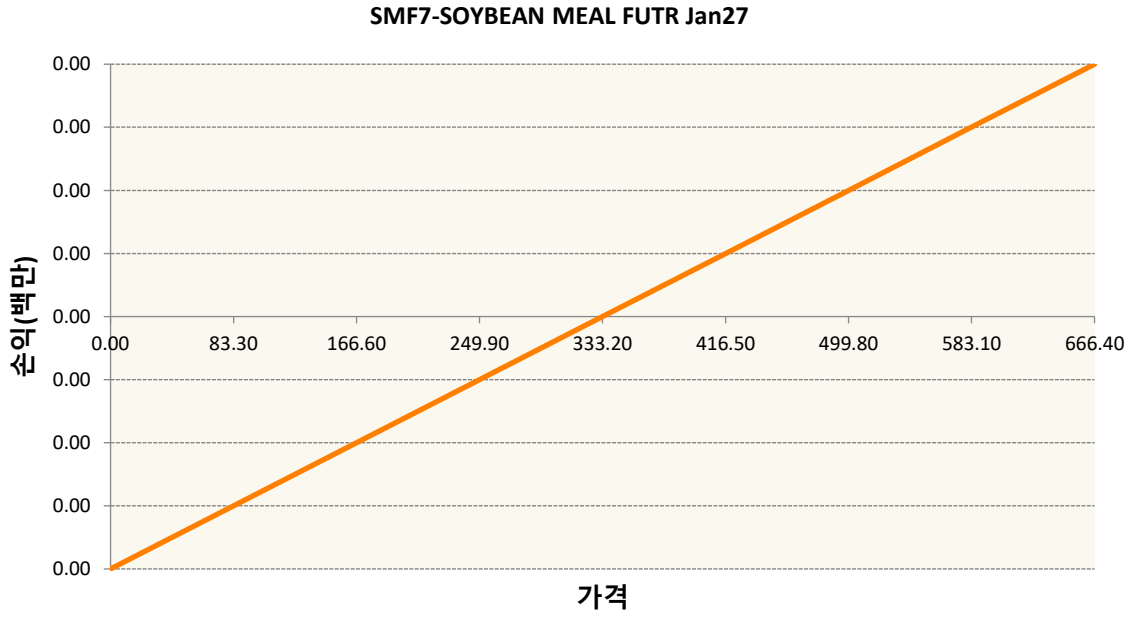


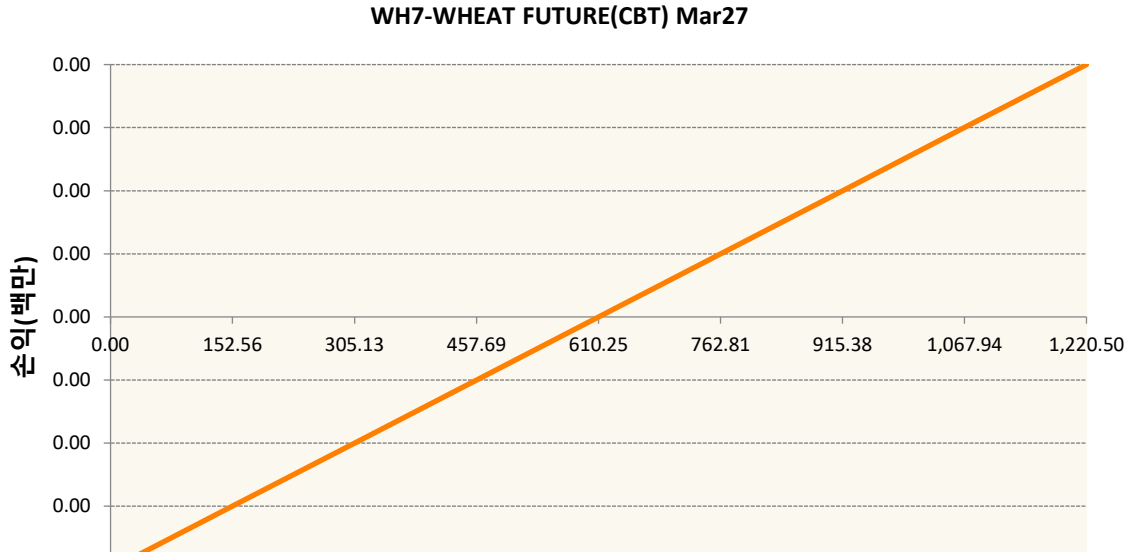
SBH7-SUGAR #11 (WORLD) MAR27




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
306.38
612.75
919.13
1,225.50
1,531.88
1,838.25
2,144.63
2,451.00
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
83.30
166.60
249.90
333.20
416.50
499.80
583.10
666.40
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
152.56
305.13
457.69
610.25
762.81
915.38
1,067.94
1,220.50
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	2026-11-19
기준일	2026-11-18

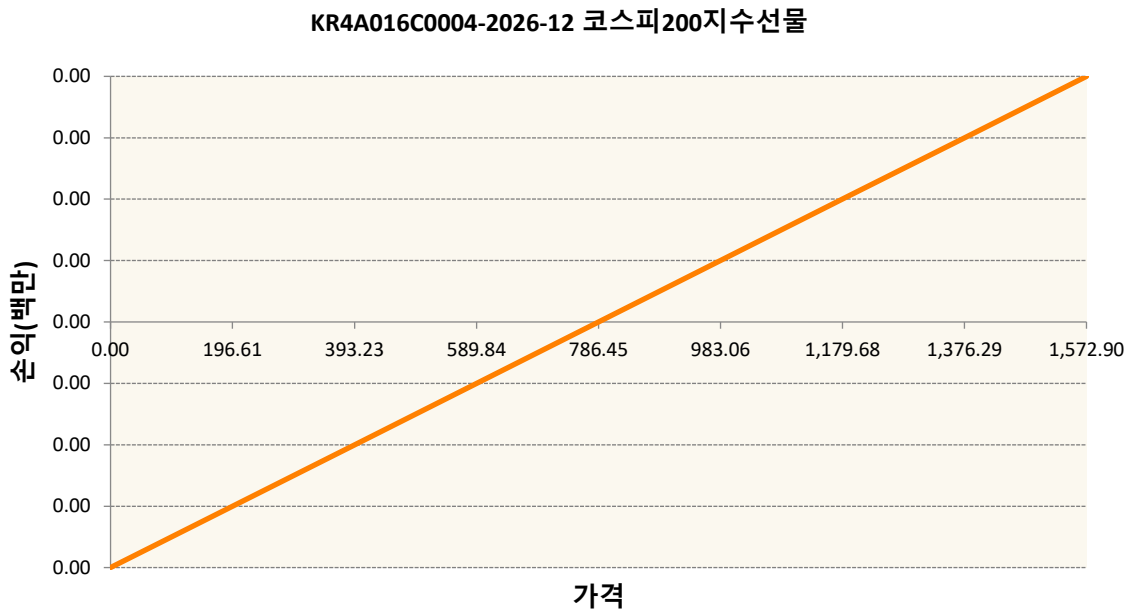
스마트인덱스모

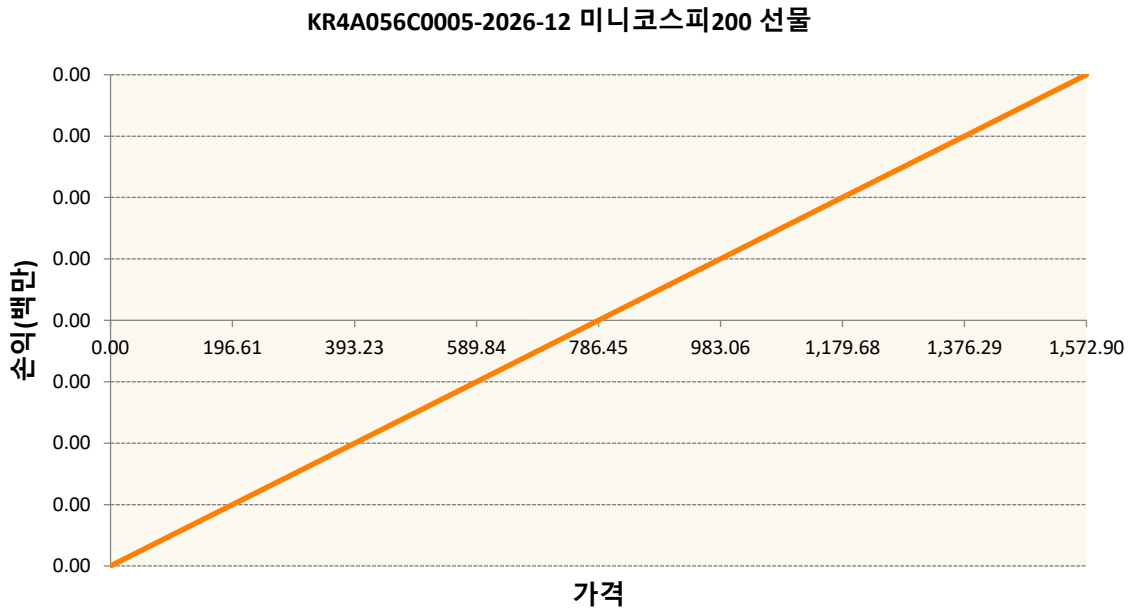
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	1,783	2,979	-1,196	장내
누계	유가증권	선물	7,865	0	7,865	장내

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4A016C0004	2026-12 코스피200지수선물						583
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-583	-583	-583	-583	-583	-583	-583
-5.33%	-389	-389	-389	-389	-389	-389	-389
-2.67%	-194	-194	-194	-194	-194	-194	-194
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	194	194	194	194	194	194	194
5.33%	389	389	389	389	389	389	389
8.00%	583	583	583	583	583	583	583

KR4A056C0005	2026-12 미니코스피200 선물						9
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-9	-9	-9	-9	-9	-9	-9
-5.33%	-6	-6	-6	-6	-6	-6	-6
-2.67%	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-3
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	3	3	3	3	3	3	3
5.33%	6	6	6	6	6	6	6
8.00%	9	9	9	9	9	9	9

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

2,106

공시일	2026-11-19
기준일	2026-11-18

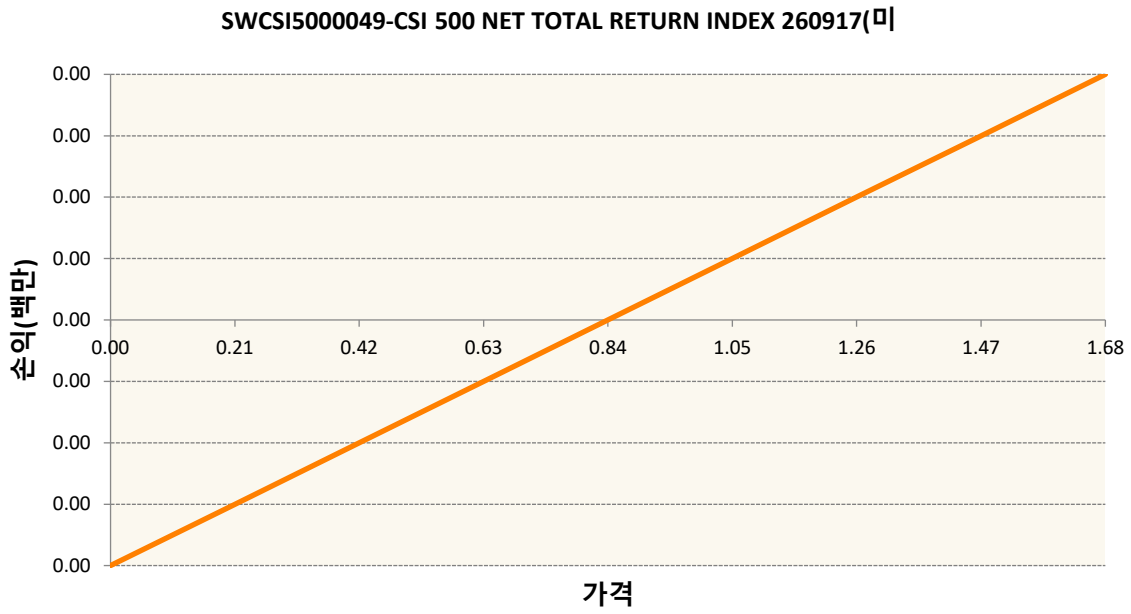
SOL차이나강소기업CSI500상장

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)

598

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2026-11-19
기준일	2026-11-18

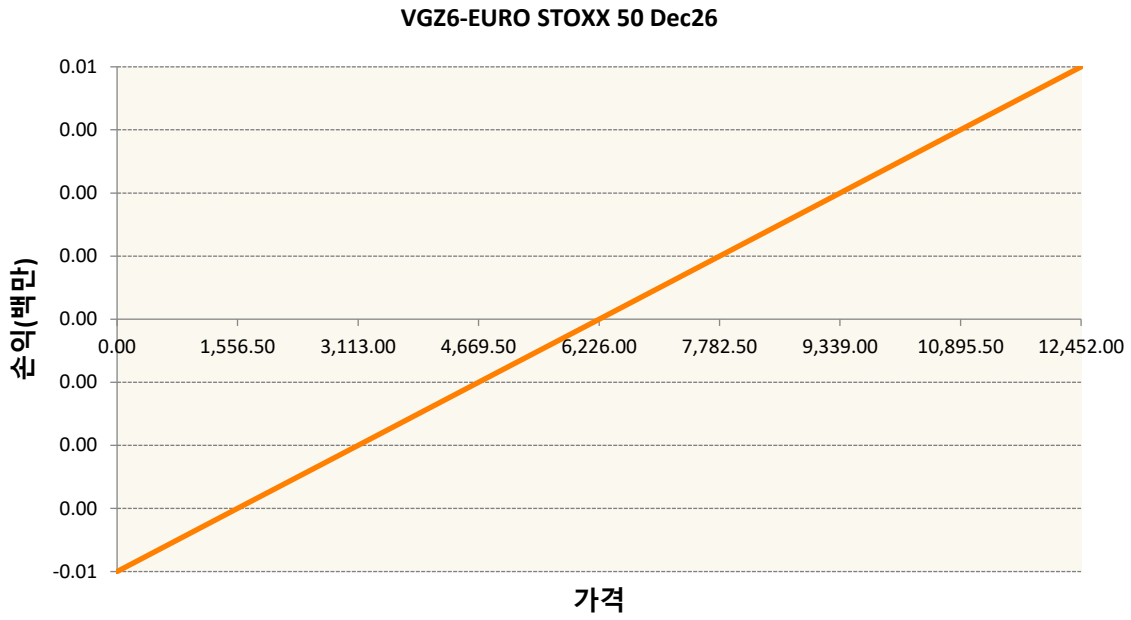
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,083	0	1,083	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGZ6	EURO STOXX 50 Dec26	87

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

(단위:백만원)

65

공시일	2026-11-19
기준일	2026-11-18

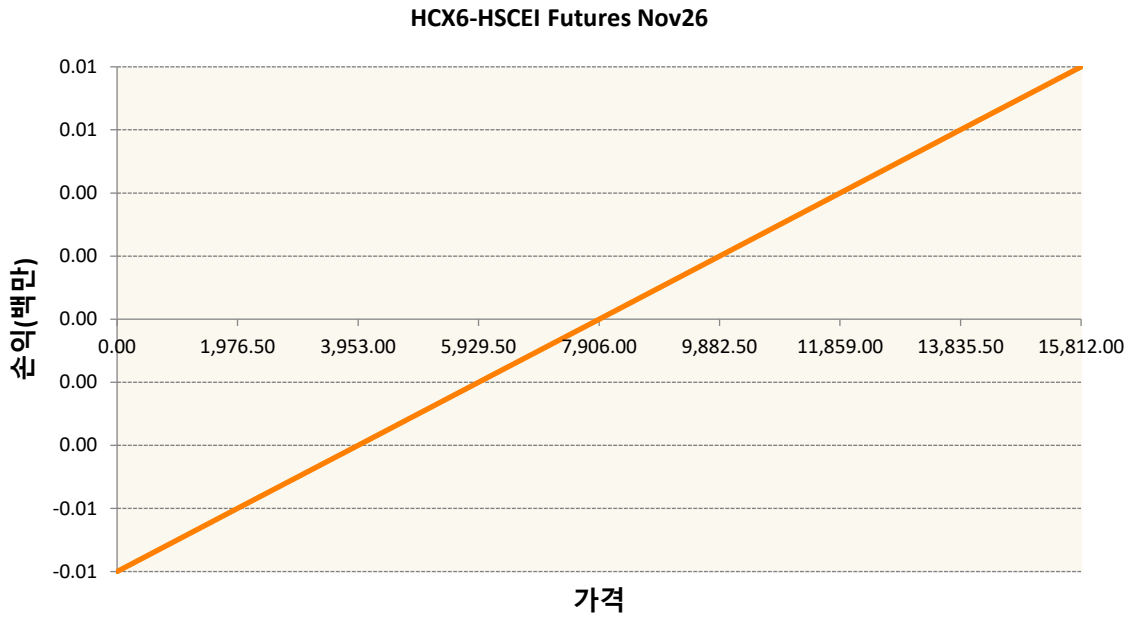
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,146	0	1,146	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	2026-11-19
기준일	2026-11-18

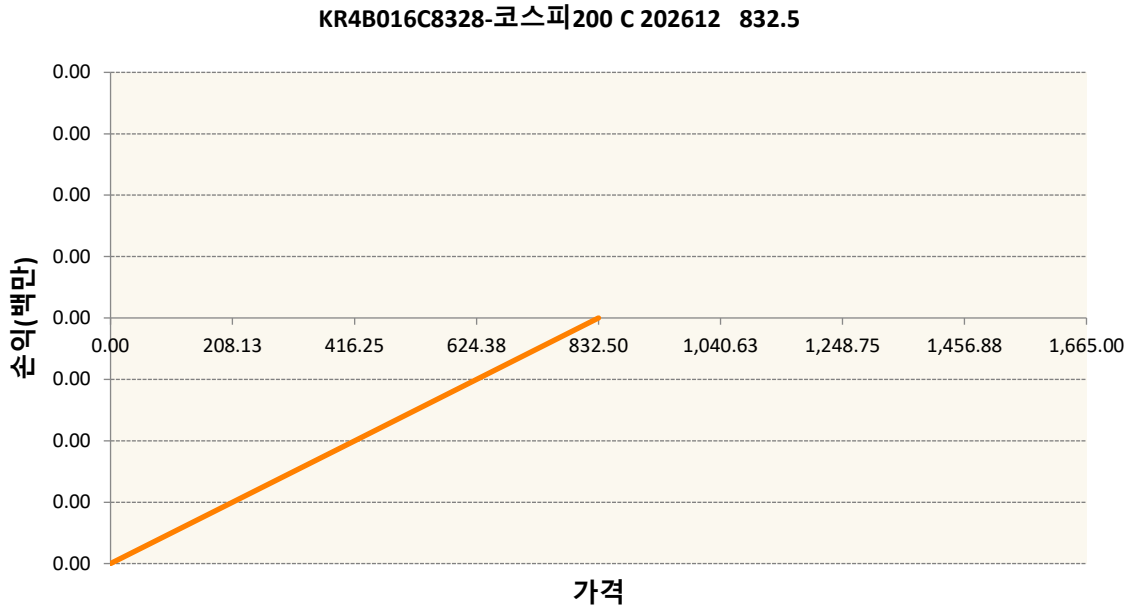
커버드콜모(주식혼합-파생형)

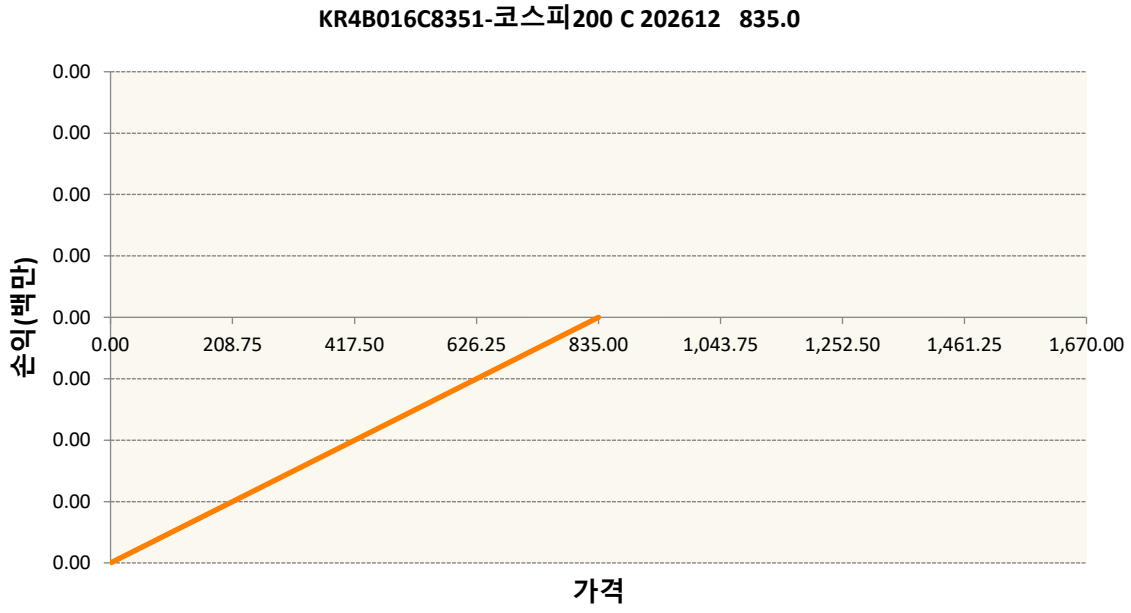
1. 계약금액

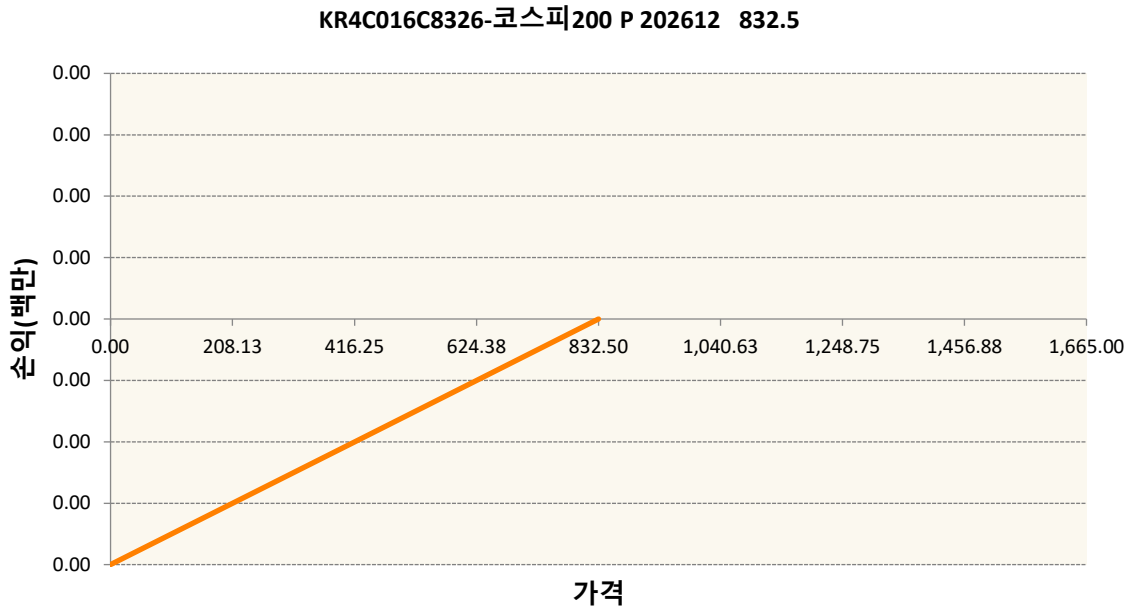
(단위:백만원)

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						1,035
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-784	-816	-853	-894	-938	-986	-1,035
-5.33%	-428	-472	-519	-570	-623	-678	-735
-2.67%	-99	-154	-211	-271	-332	-395	-458
0%	197	133	67	0	-68	-136	-205
2.67%	456	385	313	241	169	96	24
5.33%	676	601	527	452	377	303	228
8.00%	856	782	708	633	559	484	409
KR4B016C8351	코스피200 C 202612 835.0						1,149
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-877	-911	-951	-995	-1,043	-1,094	-1,149
-5.33%	-482	-529	-580	-635	-693	-753	-815
-2.67%	-116	-175	-237	-302	-369	-437	-507
0%	215	145	73	0	-74	-149	-225
2.67%	506	428	349	270	190	110	30
5.33%	753	671	588	506	424	341	259
8.00%	957	875	792	710	627	544	462
KR4C016C8326	코스피200 P 202612 832.5						478
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-362	-377	-394	-413	-433	-455	-478
-5.33%	-198	-218	-240	-263	-287	-313	-339
-2.67%	-46	-71	-97	-125	-153	-182	-212
0%	91	61	31	0	-31	-63	-95

2.67%	211	178	145	111	78	44	11
5.33%	312	278	243	209	174	140	105
8.00%	395	361	327	292	258	223	189

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

4,304

공시일	2026-11-19
기준일	2026-11-18

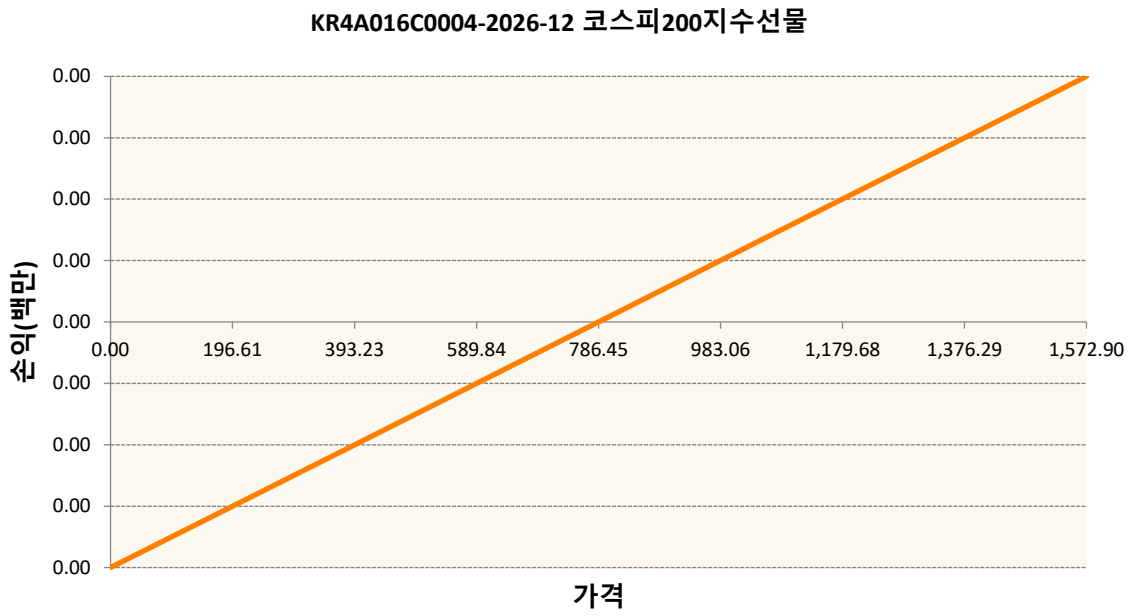
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

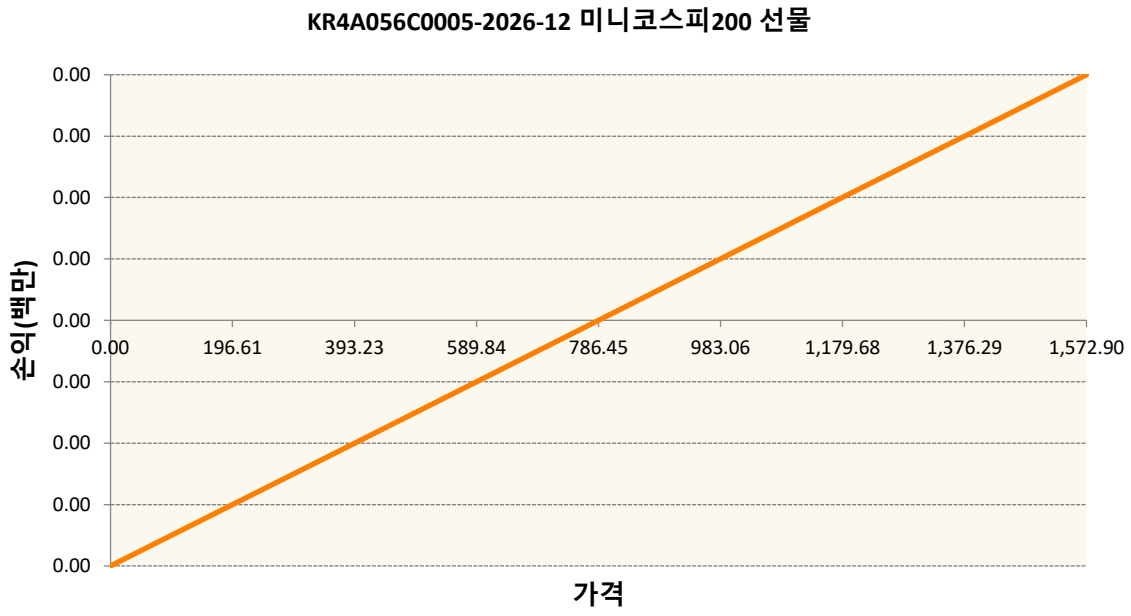
1. 계약금액

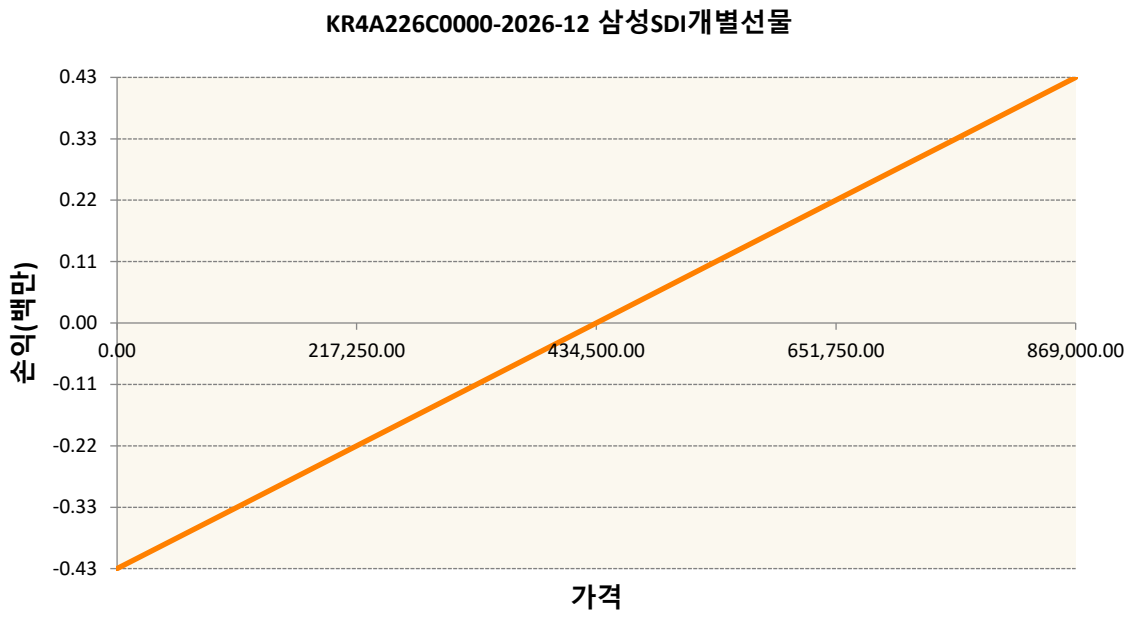
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	194	230	-36	장내
누계	유가증권	선물	1,774	0	1,774	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

KR4A226C0000	2026-12 삼성SDI개별선물						0
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	0	0	0	0	0	0	0
-5.33%	0	0	0	0	0	0	0
-2.67%	0	0	0	0	0	0	0
0%	0	0	0	0	0	0	0

2.67%	0	0	0	0	0	0	0
5.33%	0	0	0	0	0	0	0
8.00%	0	0	0	0	0	0	0

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

236

공시일	2026-11-19
기준일	2026-11-18

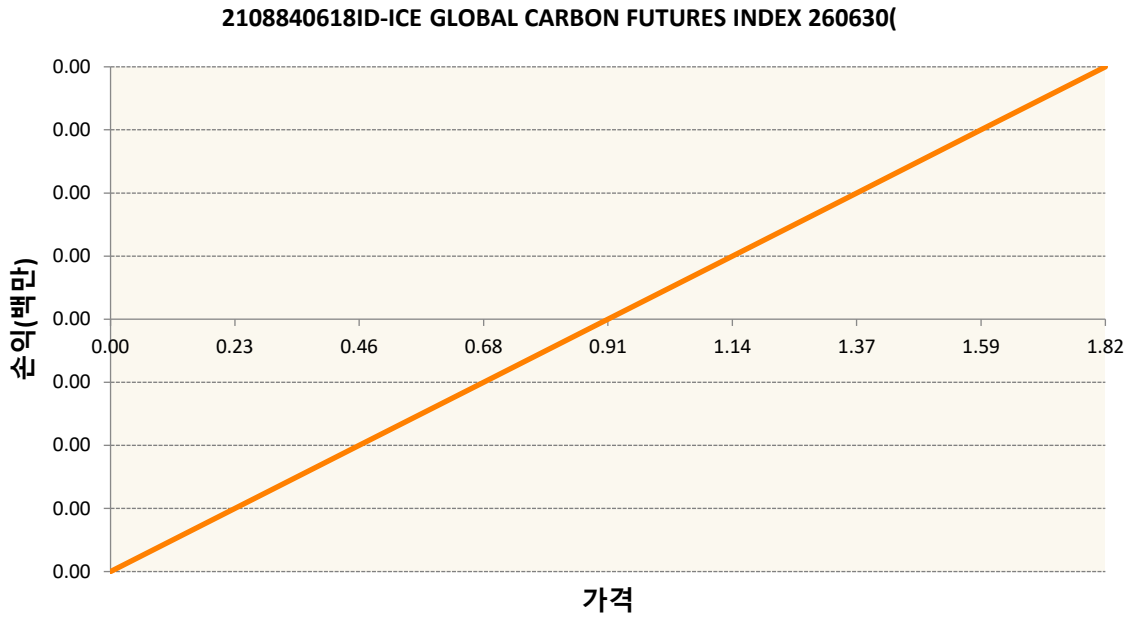
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

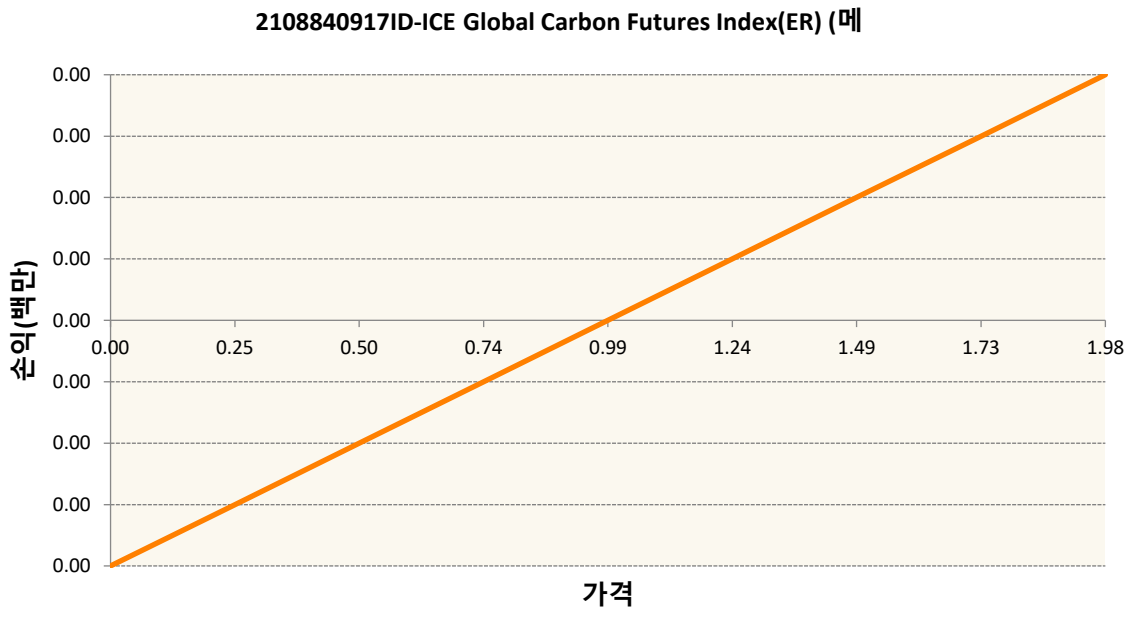
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	6,940	0	6,940	장외

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2108840618ICE GLOBAL CARBON FUTURES INDEX 260630(	445
2108840917ICE Global Carbon Futures Index(ER) (메	112

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

572

공시일	2026-11-19
기준일	2026-11-18

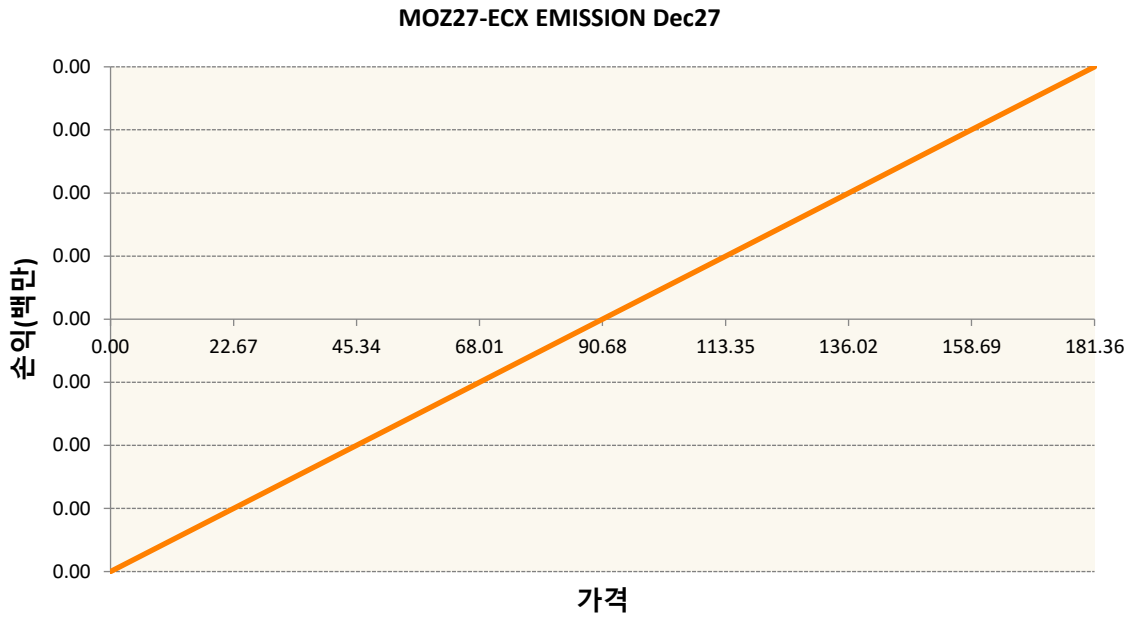
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	5,805	0	5,805	
누계	통화	선도	0	2,744	-2,744	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213GAV KRW/EUR 30-11-26E	220
MOZ27 ECX EMISSION Dec27	464

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

(단위:백만원)

709

공시일	2026-11-19
기준일	2026-11-18

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	-1,098	0	-1,098	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWSOL0000(CSI PHOTOVOLTAIC INDUSTRY INDEX 260325(	14
SWSOL0000(CSI PHOTOVOLTAIC INDUSTRY INDEX 260630(N	14
SWSOL0000(CSI PHOTOVOLTAIC INDUSTRY INDEX 260630(	21
SWSOL0000(CSI PHOTOVOLTAIC INDUSTRY INDEX 260923(	36

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

(단위:백만원)

135

공시일	2026-11-19
기준일	2026-11-18

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	-6,837	0	-6,837	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 251218(NH)	62
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 260714(미래)	355
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 260917(메리츠)	132

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

(단위:백만원)

1,097

공시일	2026-11-19
기준일	2026-11-18

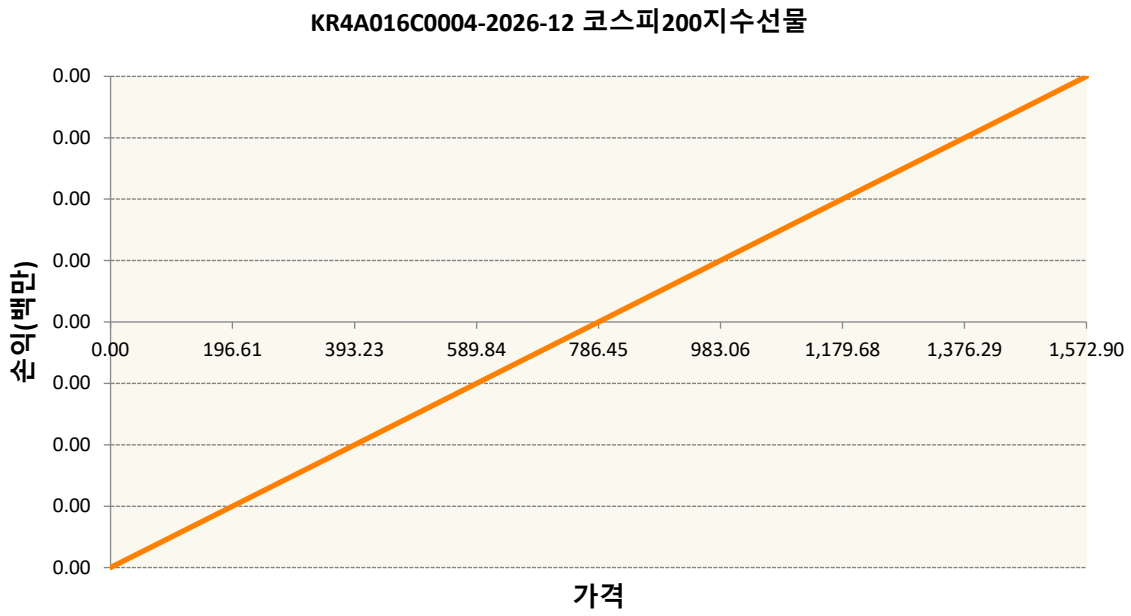
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	581	2,751	-2,170	장내
누계	유가증권	선물	9,831	0	9,831	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A016C0004 2026-12 코스피200지수선물 788

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-788	-788	-788	-788	-788	-788	-788
-5.33%	-525	-525	-525	-525	-525	-525	-525
-2.67%	-263	-263	-263	-263	-263	-263	-263
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	263	263	263	263	263	263	263
5.33%	525	525	525	525	525	525	525
8.00%	788	788	788	788	788	788	788

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

2,801

공시일	2026-11-19
기준일	2026-11-18

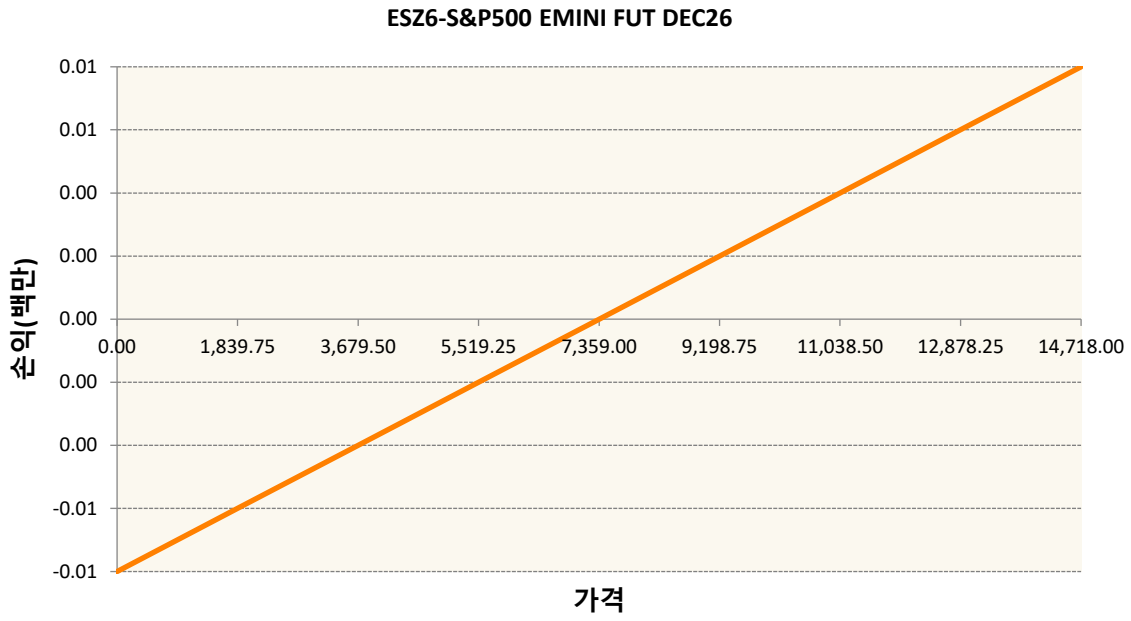
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

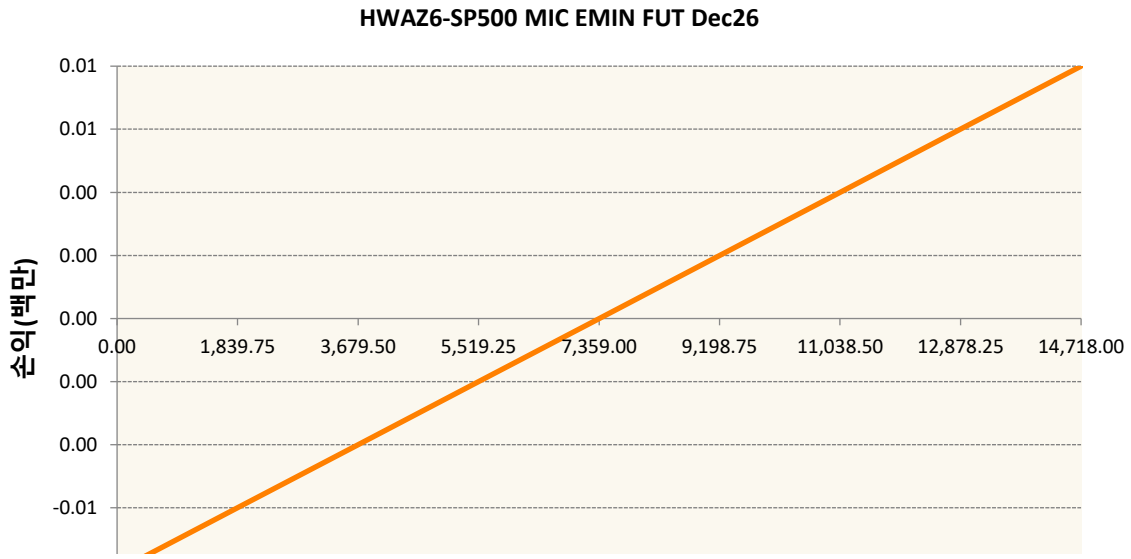
1. 계약금액

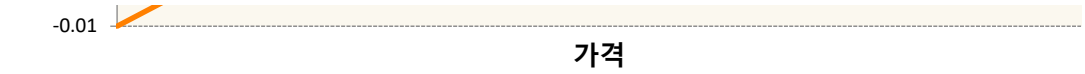
(단위:백만원)

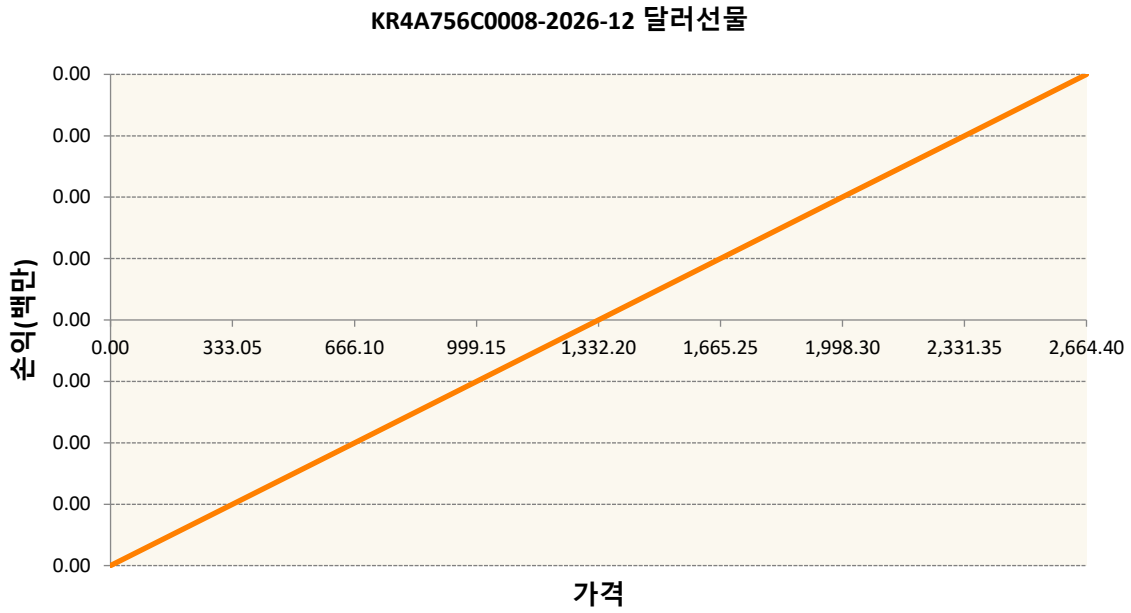
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
신규	지수	선물	0	0	0	장내
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	지수	선물	73,168	0	73,168	
누계	지수	선물	357	0	357	장내
누계	통화	선물	22,514	0	22,514	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESZ6	S&P500 EMINI FUT DEC26	5,853
HWAZ6	SP500 MIC EMIN FUT Dec26	29
KR4A756C00	2026-12 달러선물	1,801

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	3,769

공시일	2026-11-19
기준일	2026-11-18

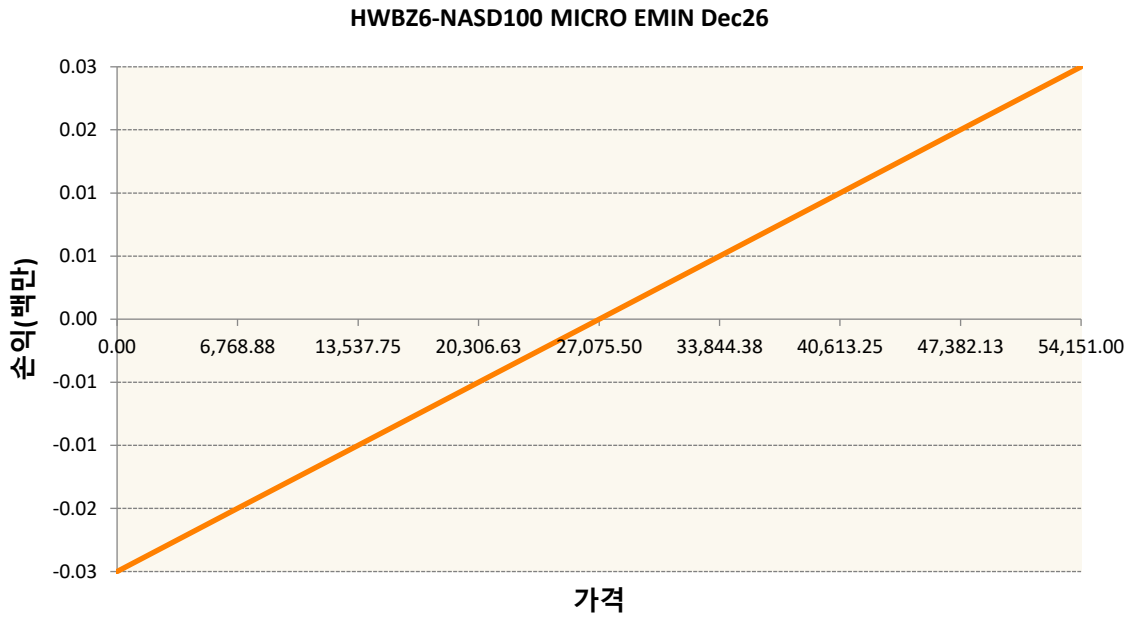
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

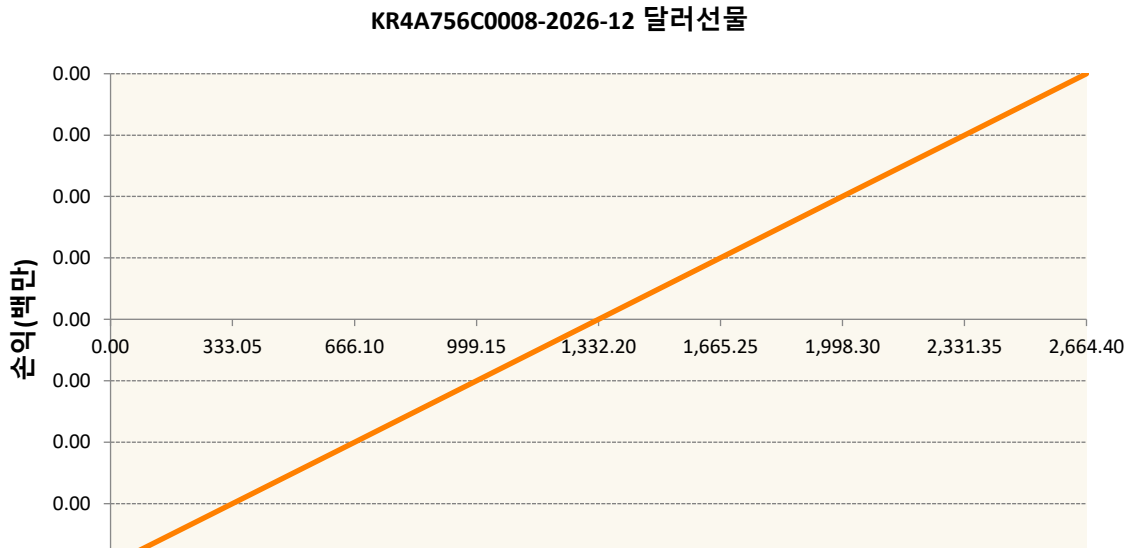
1. 계약금액

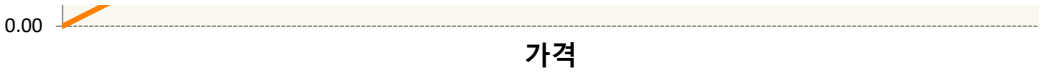
(단위:백만원)

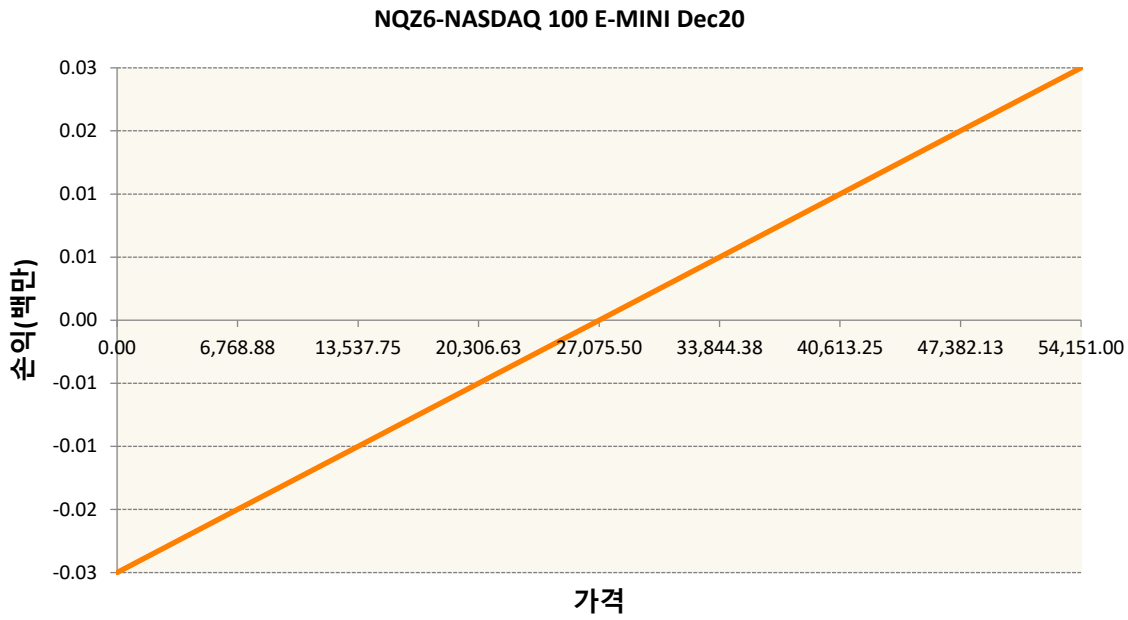
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
신규	지수	선물	0	0	0	장내
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	지수	선물	30,716	0	30,716	
누계	지수	선물	150	0	150	장내
누계	통화	선물	10,205	0	10,205	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HWBZ6	NASD100 MICRO EMIN Dec26	12
KR4A756C00	2026-12 달러선물	816
NQZ6	NASDAQ 100 E-MINI Dec20	2,457

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	2,395

공시일	2026-11-19
기준일	2026-11-18

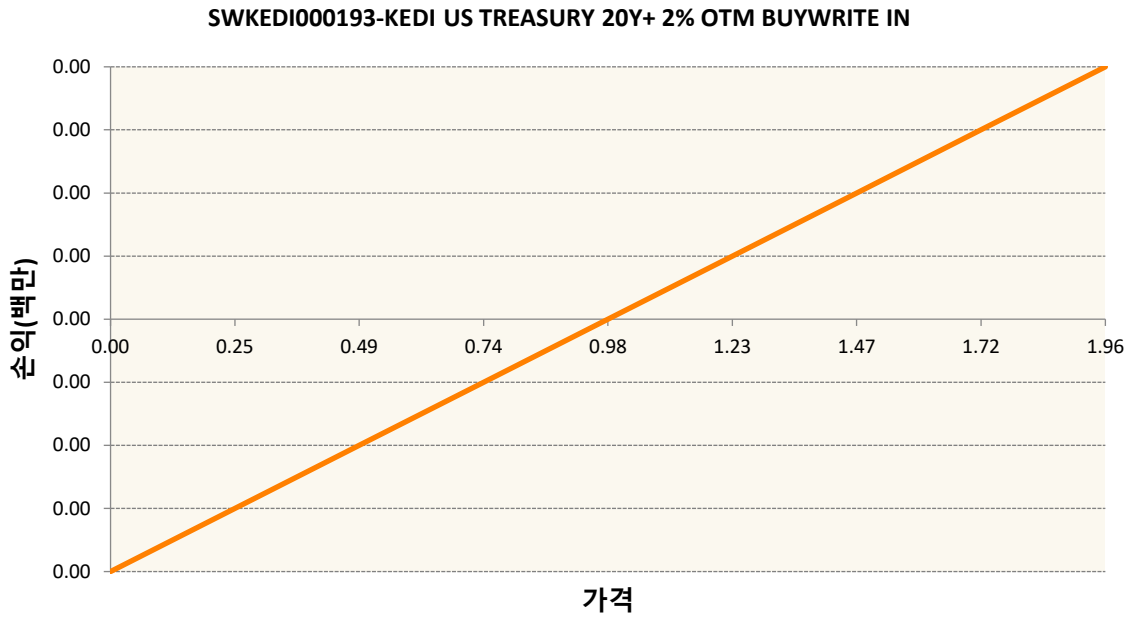
SOL미국30년국채커버드콜(합성)

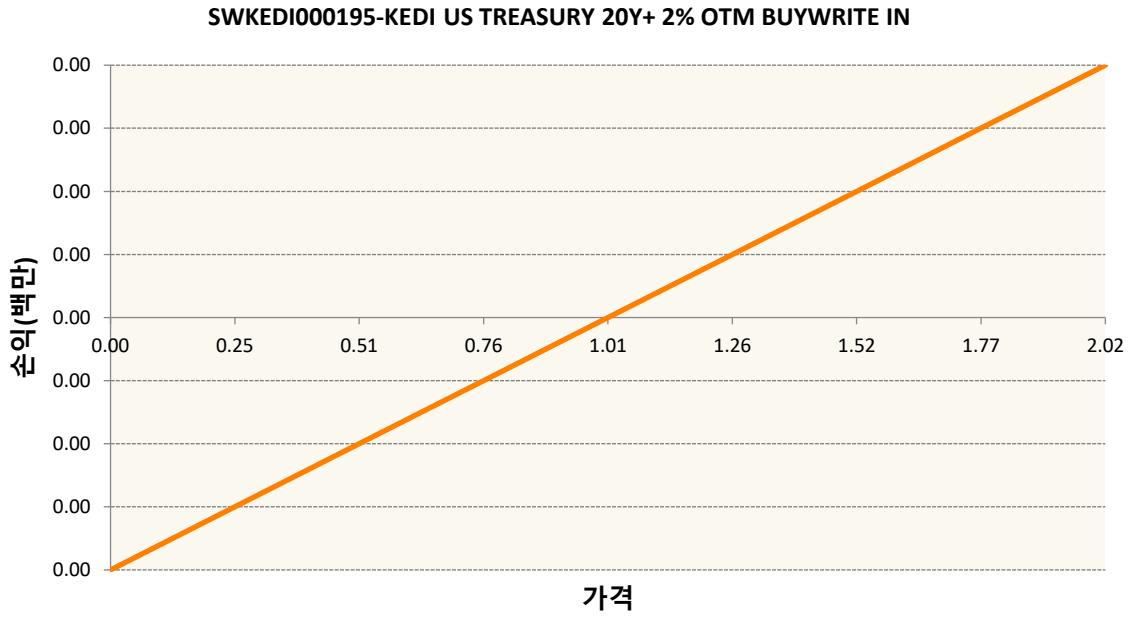
1. 계약금액

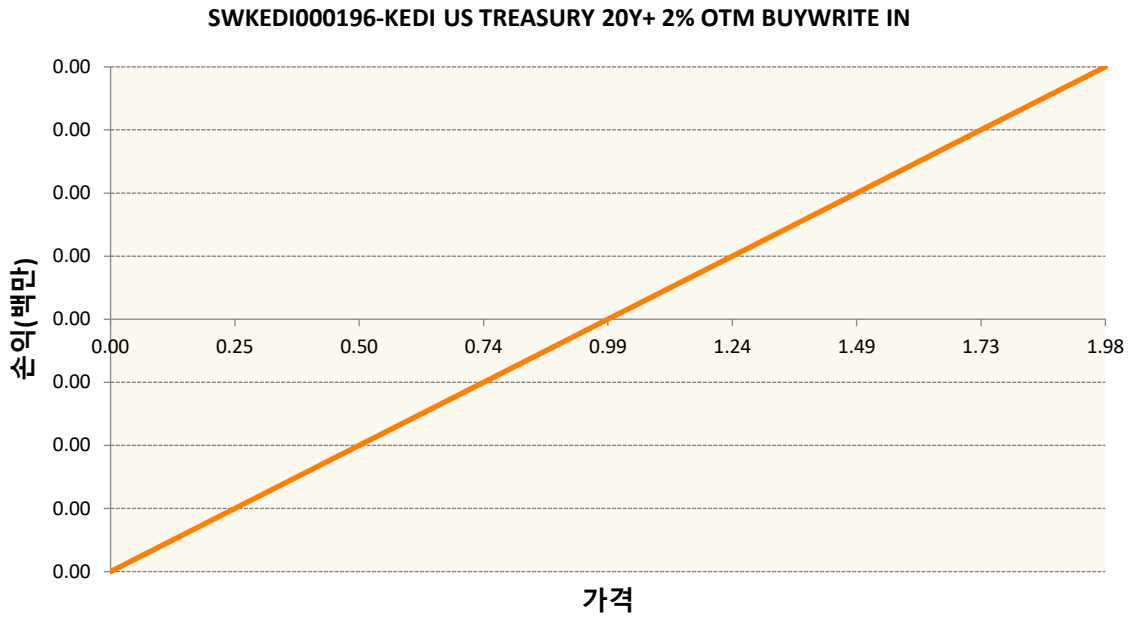
(단위:백만원)

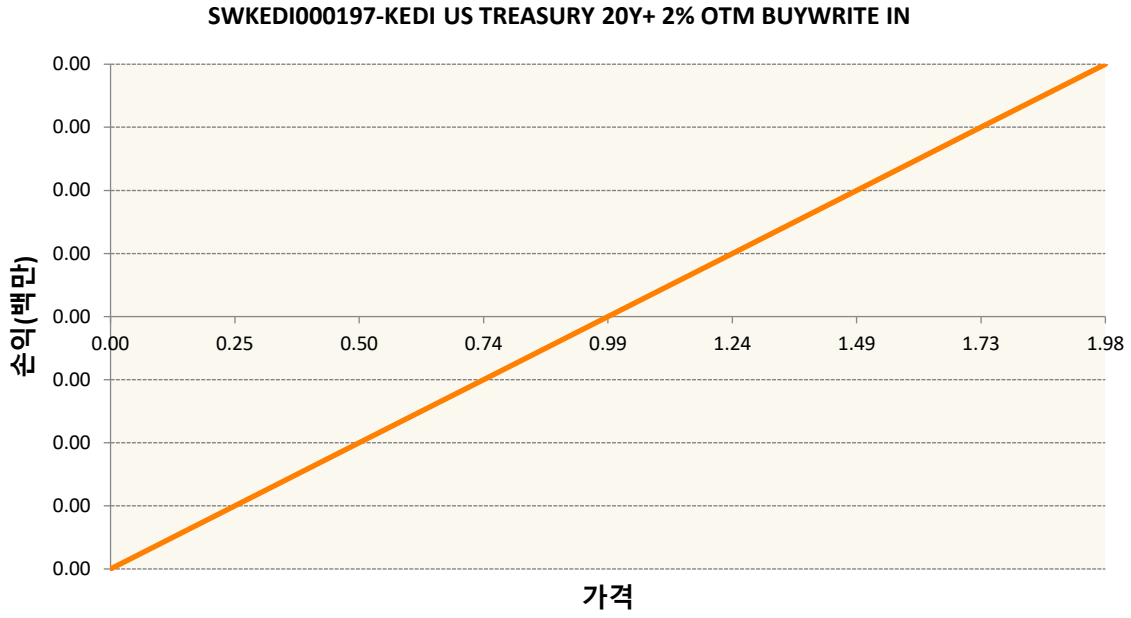
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	274,397	0	274,397	장외

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	6,924
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	7,802
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)

8,525