

공시일	2023-10-12
기준일	2023-10-11

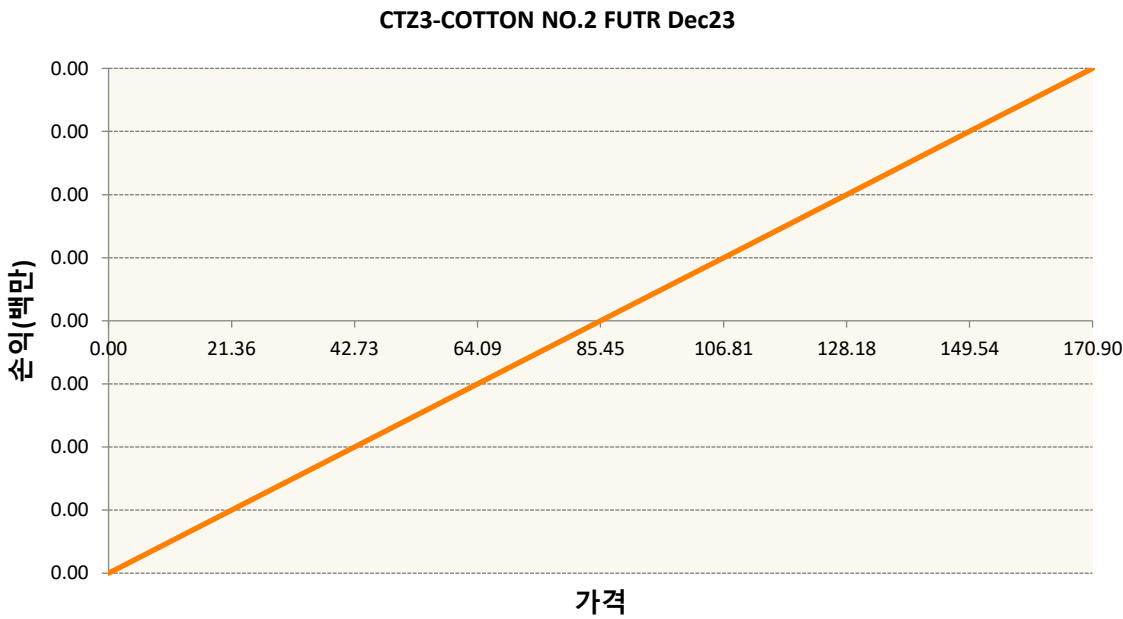
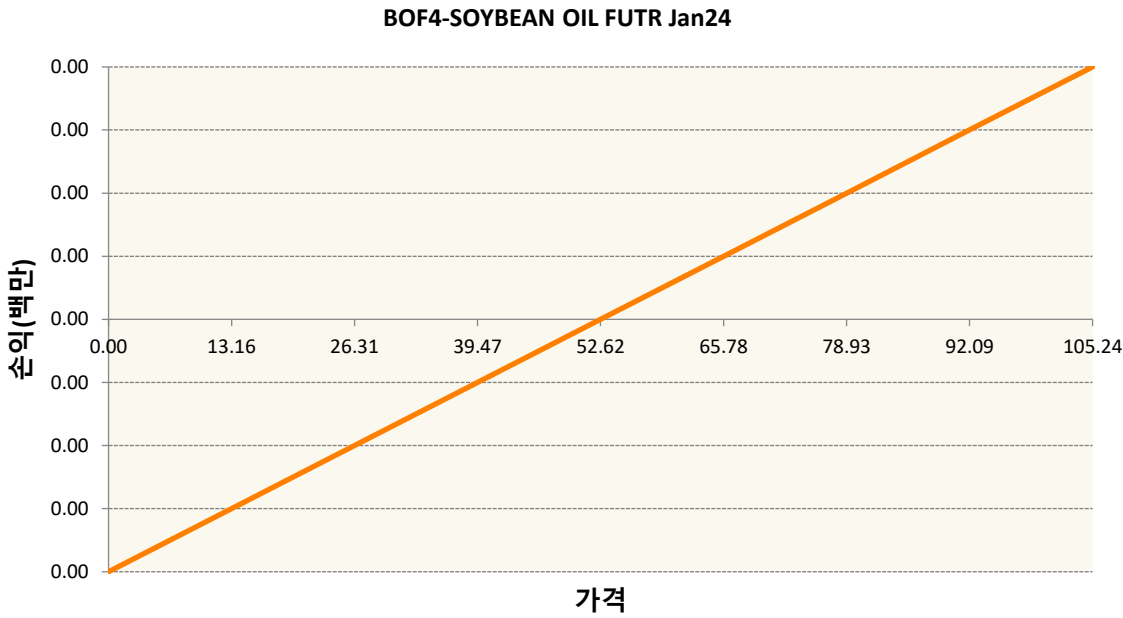
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

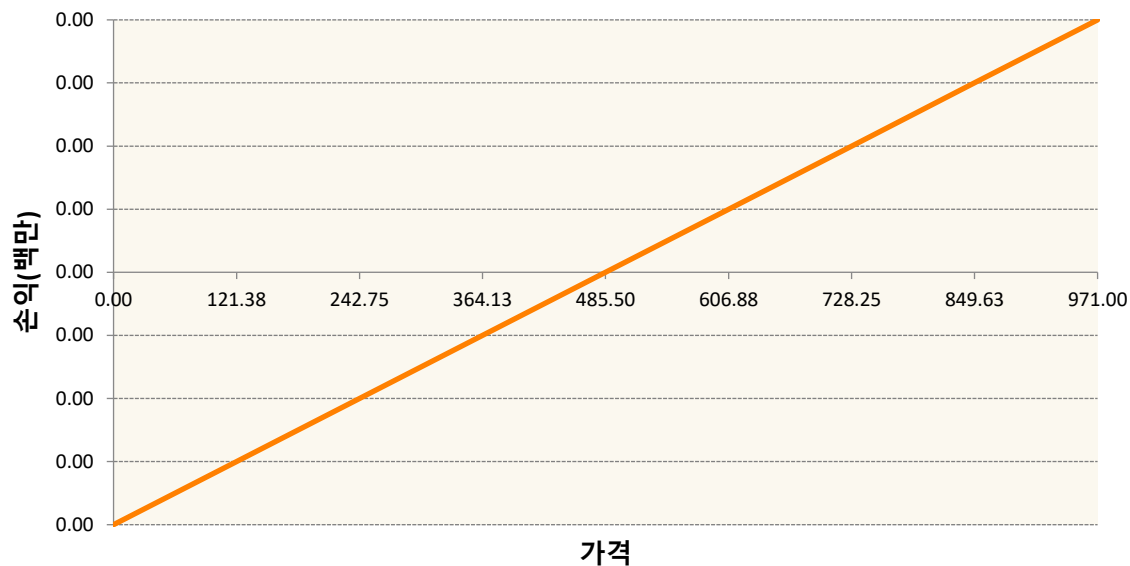
(단위:USD 백만)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	4,699	0	4,699	
누계	통화	선물	0	481	-481	장내

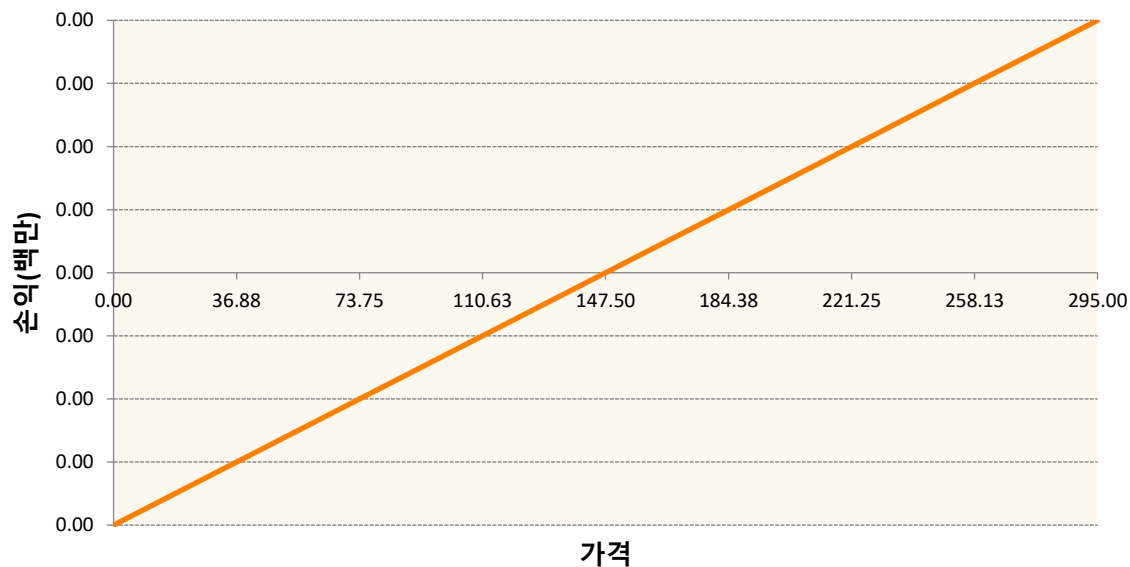
2. 만기시점의 손익구조



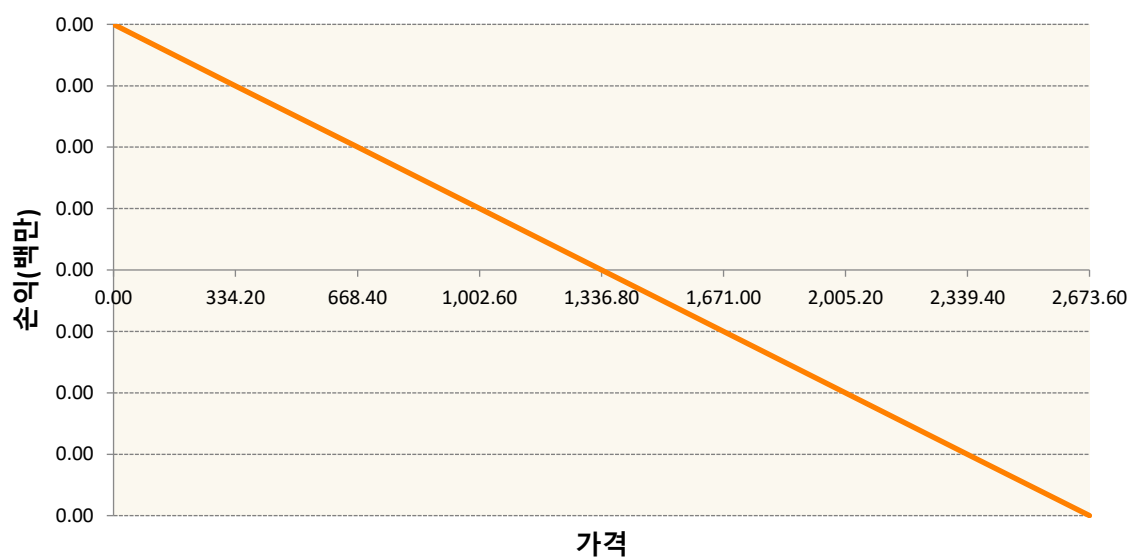
CZ3-CORN FUTURE Dec23



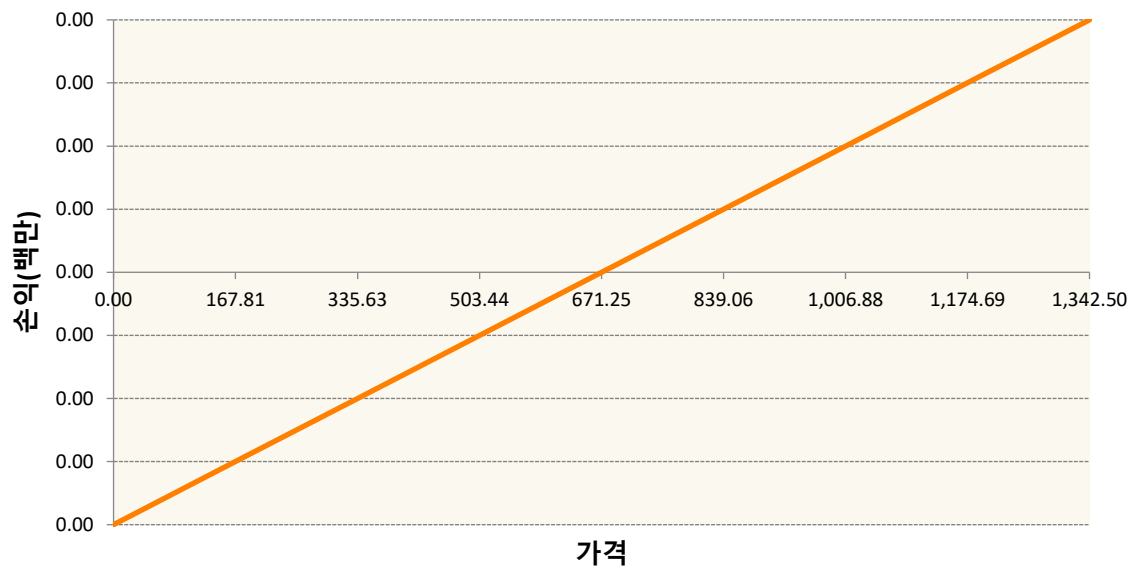
KCZ3-COFFEE 'C' FUTURE DEC23



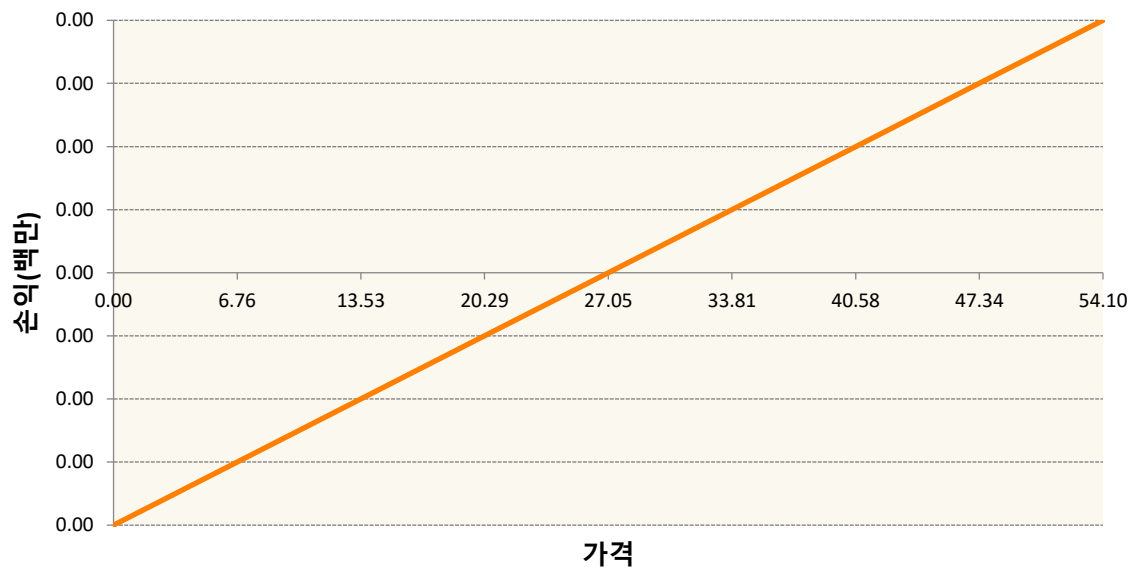
KR4175TA0001-2023-10 달러선물



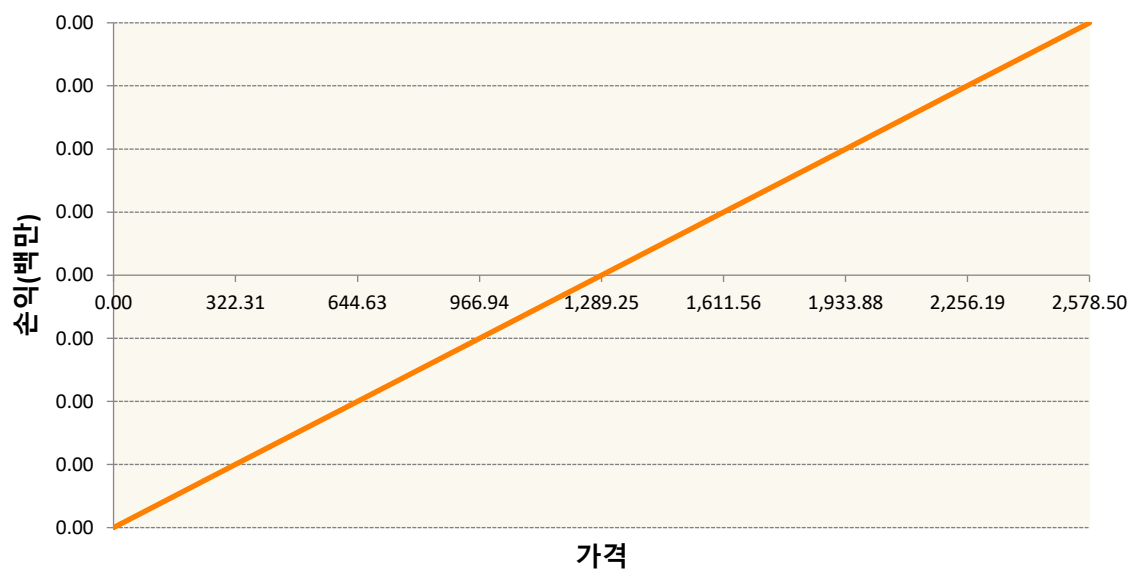
KWZ3-KC HRW WHEAT FUT DEC23



SBH4-Sugar #11 (WORLD) Mar24



SF4-SOYBEAN FUTURE Jan24



The graph illustrates a linear relationship between price and profit/loss. The x-axis, labeled '가격' (Price), ranges from 0.00 to 752.40 with major ticks every 94.05 units. The y-axis, labeled '손익(백만)' (Profit/Loss in millions), ranges from 0.00 to 0.00 with major ticks every 0.00 units. A blue line starts at the origin (0, 0) and extends to the point (752.40, 0.00), indicating a constant rate of change.

가격	손익(백만)
0.00	0.00
94.05	0.00
188.10	0.00
282.15	0.00
376.20	0.00
470.25	0.00
564.30	0.00
658.35	0.00
752.40	0.00

The graph illustrates a linear relationship between Price (가격) and Net Income (순이익(백만)). The x-axis represents Price, ranging from 0.00 to 1,117.00. The y-axis represents Net Income, ranging from 0.00 to 0.00. A solid orange line shows that as the price increases, the net income also increases linearly.

가격	순이익(백만)
0.00	0.00
139.63	0.00
279.25	0.00
418.88	0.00
558.50	0.00
698.13	0.00
837.75	0.00
977.38	0.00
1,117.00	0.00

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

공시일	2023-10-12
기준일	2023-10-11

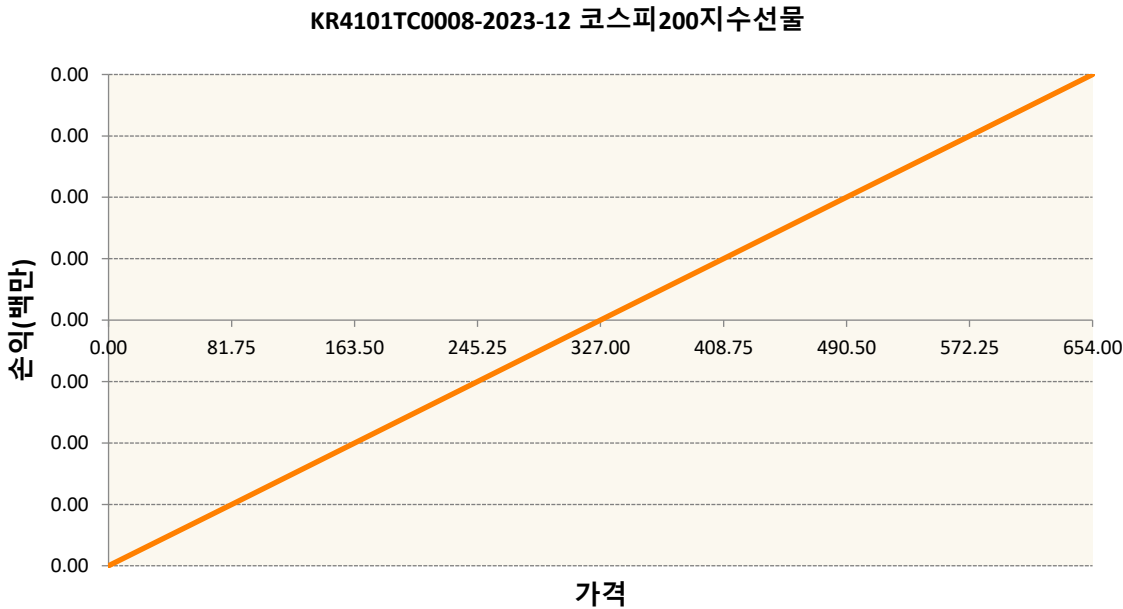
스마트인덱스모

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	1,880	0	1,880	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101TC0008			2023-12 코스피200지수선물				149
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-149	-149	-149	-149	-149	-149	-149
-5.33%	-100	-100	-100	-100	-100	-100	-100
-2.67%	-50	-50	-50	-50	-50	-50	-50
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	50	50	50	50	50	50	50
5.33%	100	100	100	100	100	100	100
8.00%	149	149	149	149	149	149	149

공시일	2023-10-12
기준일	2023-10-11

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	3,903	0	3,903	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 신한CSI500미래230314	314
-----------------------------	-----

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

303

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2023-10-12
기준일	2023-10-11

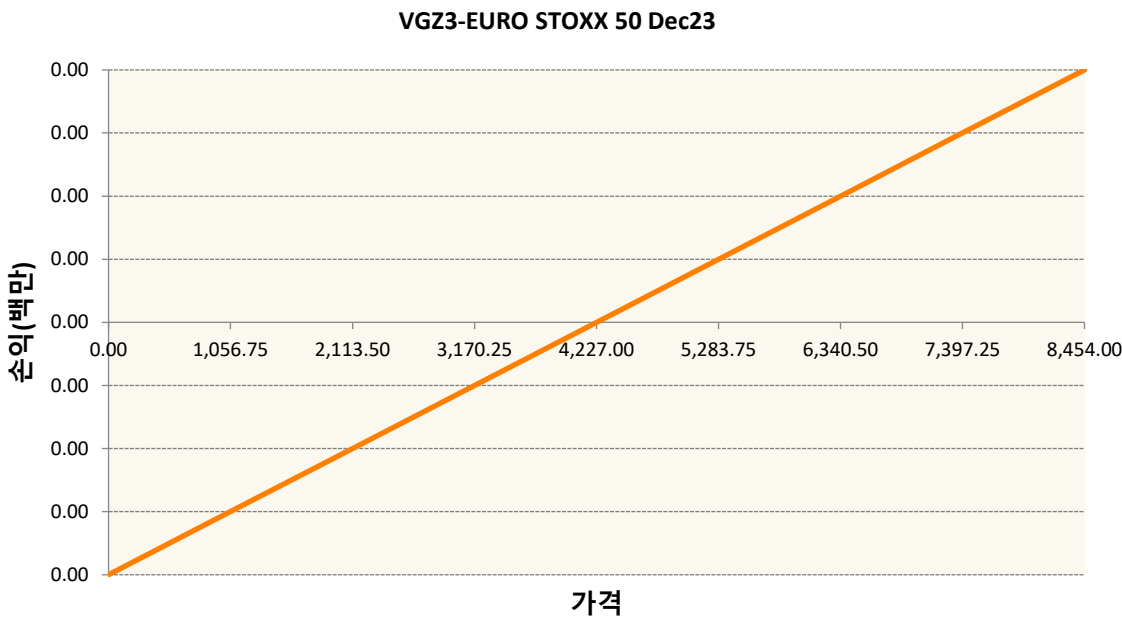
유로인덱스모(주식-파생형)

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	962	0	962	
누계	통화	선도	213	0	213	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213D9M EUR/KRW 22-12-23E	17
VGZ3 EURO STOXX 50 Dec23	77

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

(단위:백만원)

79

공시일	2023-10-12
기준일	2023-10-11

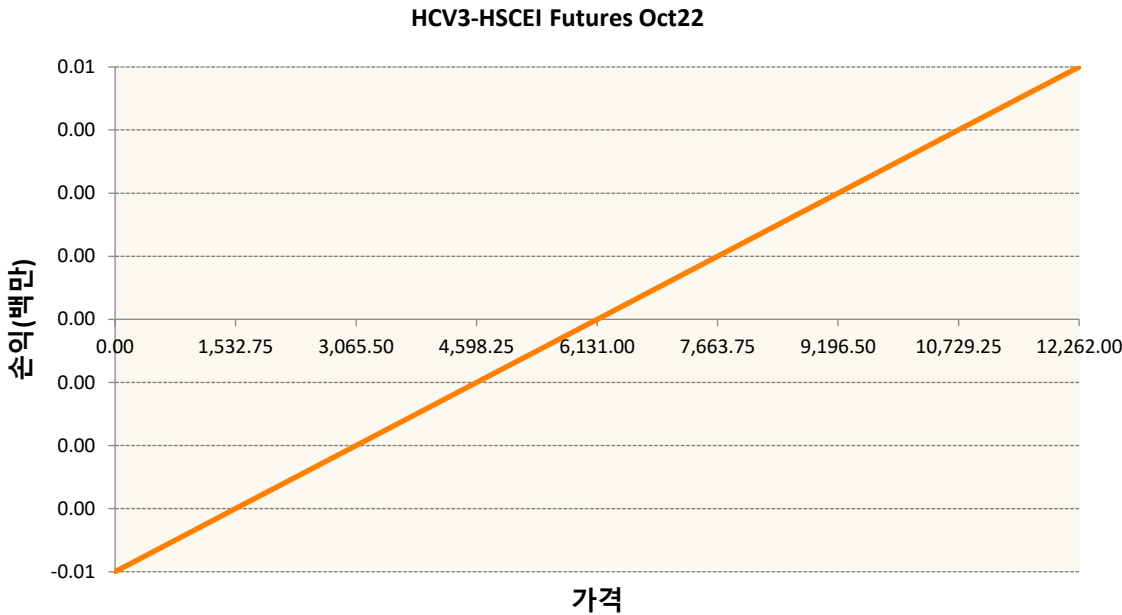
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,110	0	1,110	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCV3	HSCEI Futures Oct22	89
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

132

공시일	2023-10-12
기준일	2023-10-11

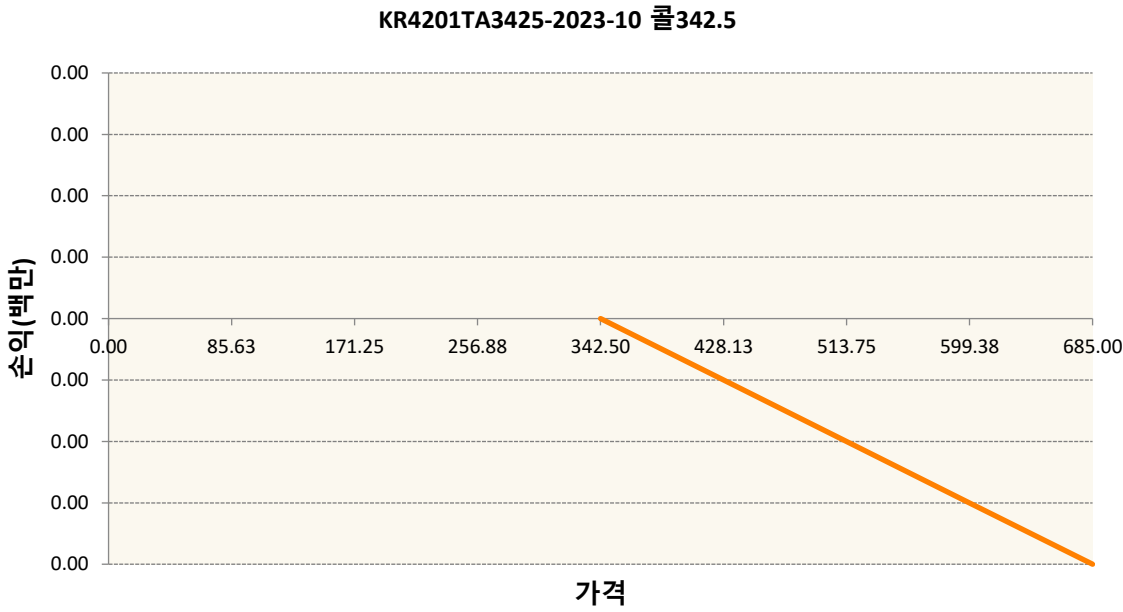
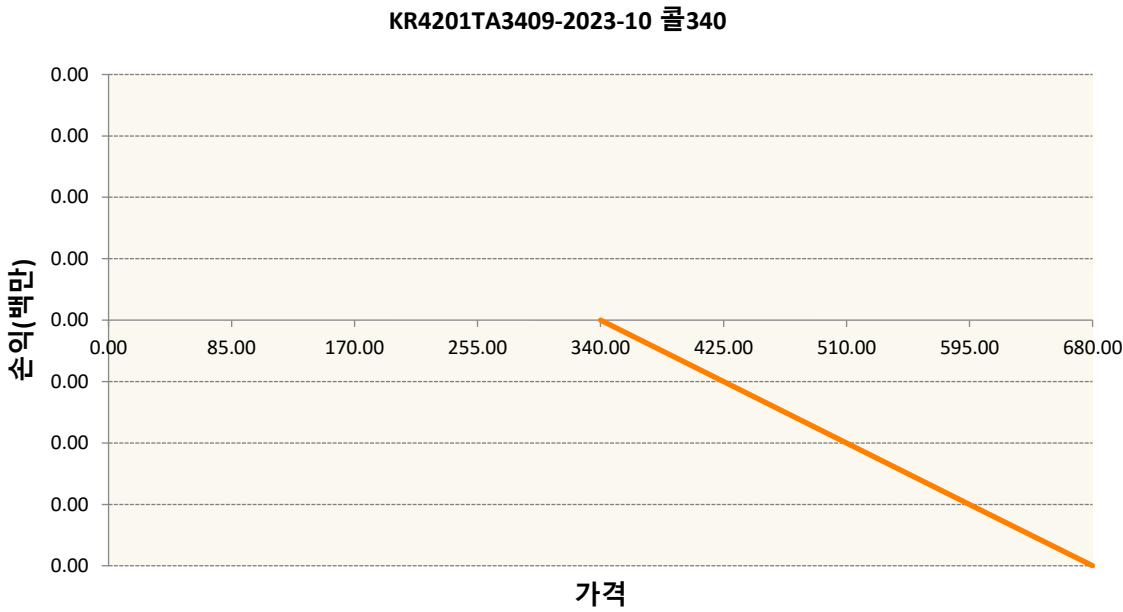
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

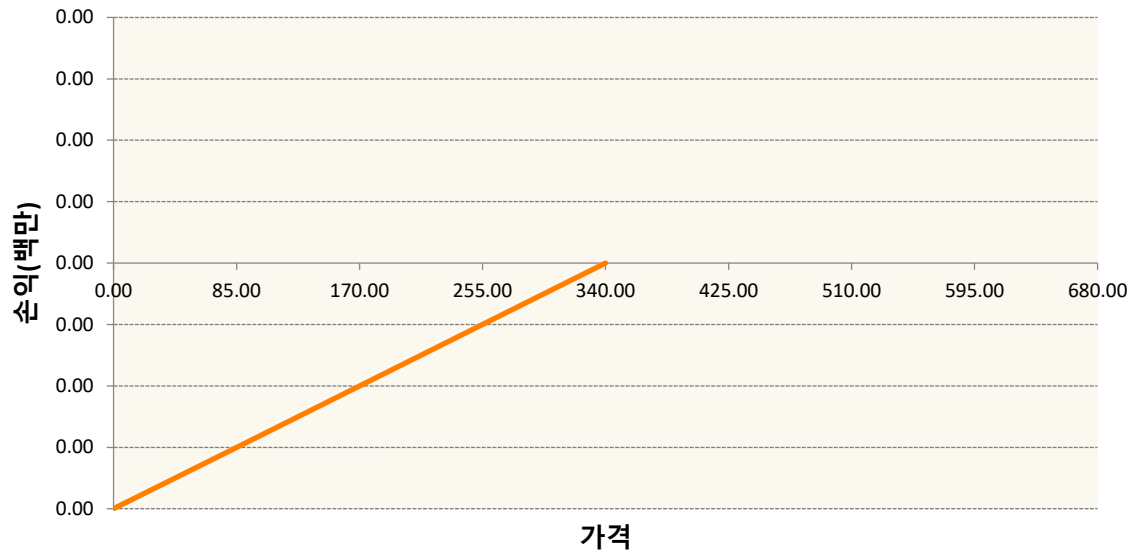
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	53,908	-53,908	장내

2. 만기시점의 손익구조



KR4301TA3408-2023-10 풋340



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201TA3409		2023-10 콜340						604
		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	0
-5.33%	0	0	0	0	0	0	0	0
-2.67%	0	0	0	0	0	0	0	0
0%	0	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	0	0	0	-1	-1	-2	-3	
5.33%	-129	-133	-138	-142	-147	-151	-156	
8.00%	-604	-604	-604	-604	-604	-604	-604	-604
KR4201TA3425		2023-10 콜342.5						621
		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	0
-5.33%	0	0	0	0	0	0	0	0
-2.67%	0	0	0	0	0	0	0	0
0%	0	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	0	0	0	0	0	0	0	-1
5.33%	-54	-62	-69	-77	-84	-92	-100	
8.00%	-620	-620	-620	-620	-620	-620	-621	-621
KR4301TA3408		2023-10 풋340						688
		기초자산의 변동성						
가격		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-688	-688	-688	-688	-688	-688	-688	-688
-5.33%	-459	-459	-459	-459	-459	-459	-459	-459
-2.67%	-229	-229	-229	-229	-229	-229	-229	-229
0%	0	0	0	0	0	0	0	0

2.67%	229	229	229	229	229	228	228
5.33%	398	396	394	392	390	388	385
8.00%	404	404	404	404	404	404	404

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

(단위:백만원)

703

공시일	2023-10-12
기준일	2023-10-11

H2O글로벌본드(USD)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	0	0	
누계	유가증권	수익증권	1,995	0	1,995	

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

공시일	2023-10-12
기준일	2023-10-11

H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	0	0	
누계	유가증권	수익증권	4,452	0	4,452	

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

공시일	2023-10-12
기준일	2023-10-11

H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	0	0	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	16,743	0	16,743	
누계	통화	선도	469	17,437	-16,968	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213D7T(KRW/USD 31-10-23E	266
FXW213D8W KRW/USD 30-11-23E	609
FXW213D9R(KRW/USD 29-12-23E	519
FXW213DA5 USD/KRW 31-10-23E	37
IE00BD8RGM75	

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

797

공시일	2023-10-12
기준일	2023-10-11

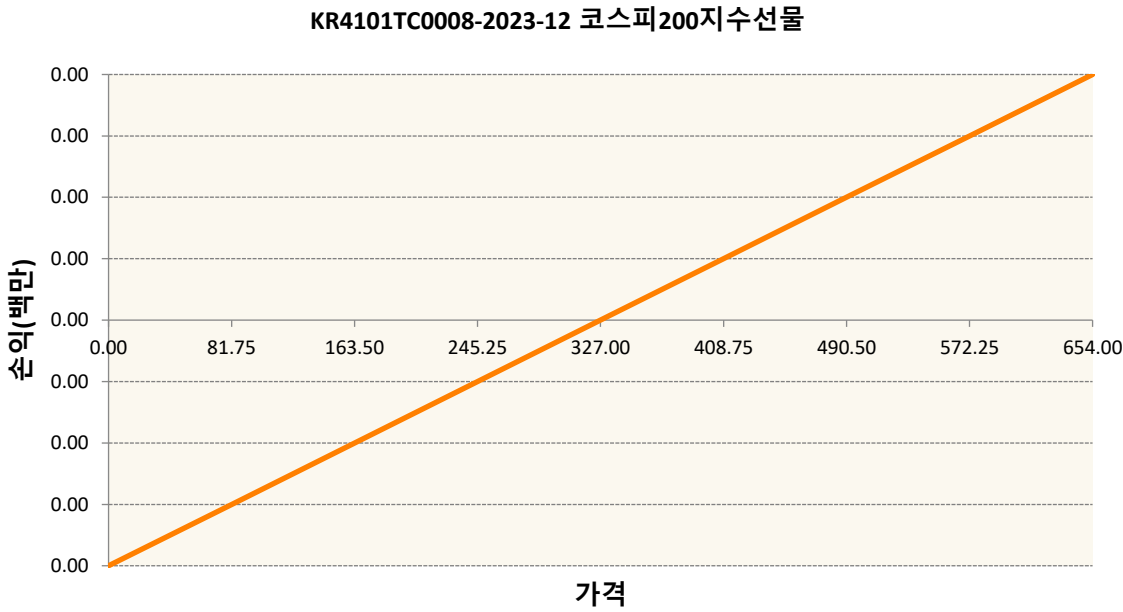
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

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	818	0	818	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101TC0008			2023-12 코스피200지수선물				65
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-65	-65	-65	-65	-65	-65	-65
-5.33%	-43	-43	-43	-43	-43	-43	-43
-2.67%	-22	-22	-22	-22	-22	-22	-22
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	22	22	22	22	22	22	22
5.33%	43	43	43	43	43	43	43
8.00%	65	65	65	65	65	65	65

공시일	2023-10-12
기준일	2023-10-11

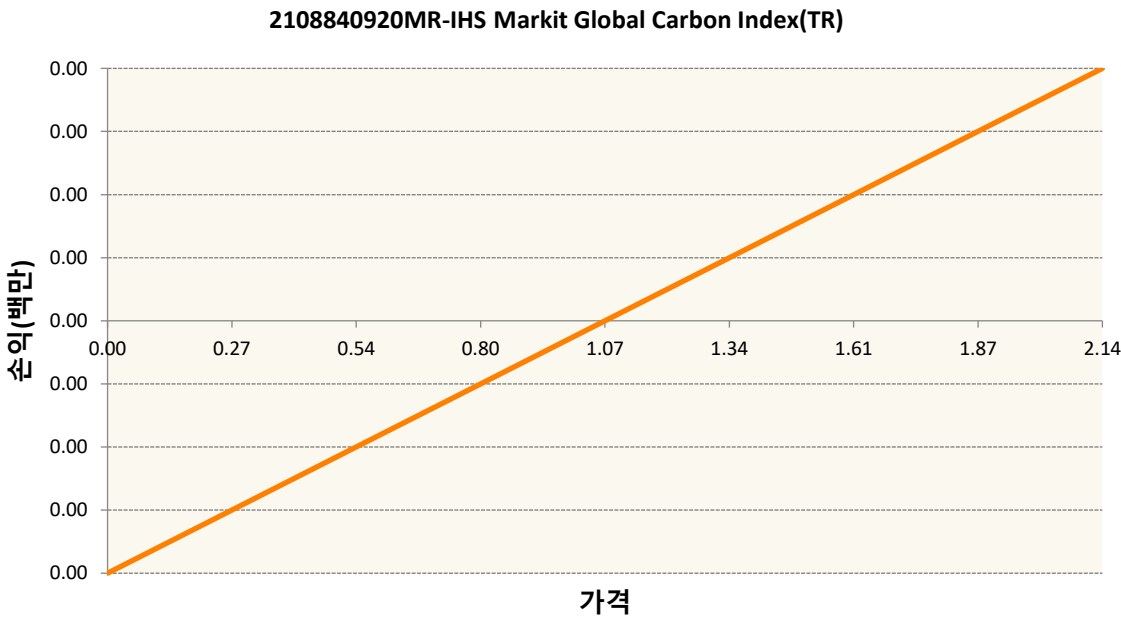
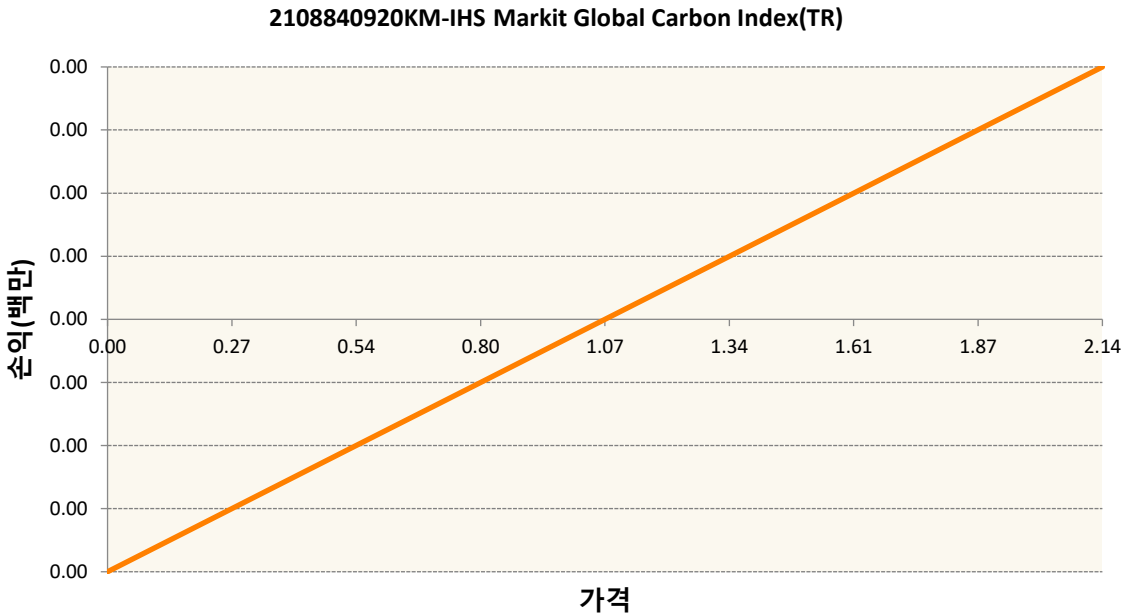
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

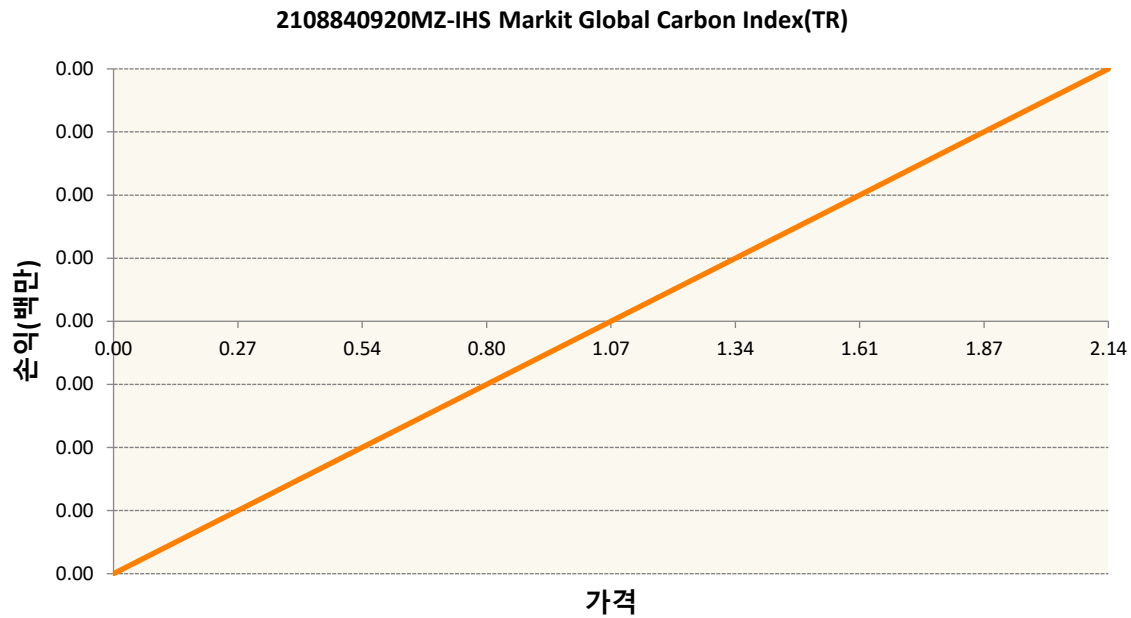
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	18,950	0	18,950	

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108840920IHS Markit Global Carbon Index(TR)		1,086
2108840920IHS Markit Global Carbon Index(TR)		217
2108840920IHS Markit Global Carbon Index(TR)		217

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)		(단위:백만원)
		2,048

공시일	2023-10-12
기준일	2023-10-11

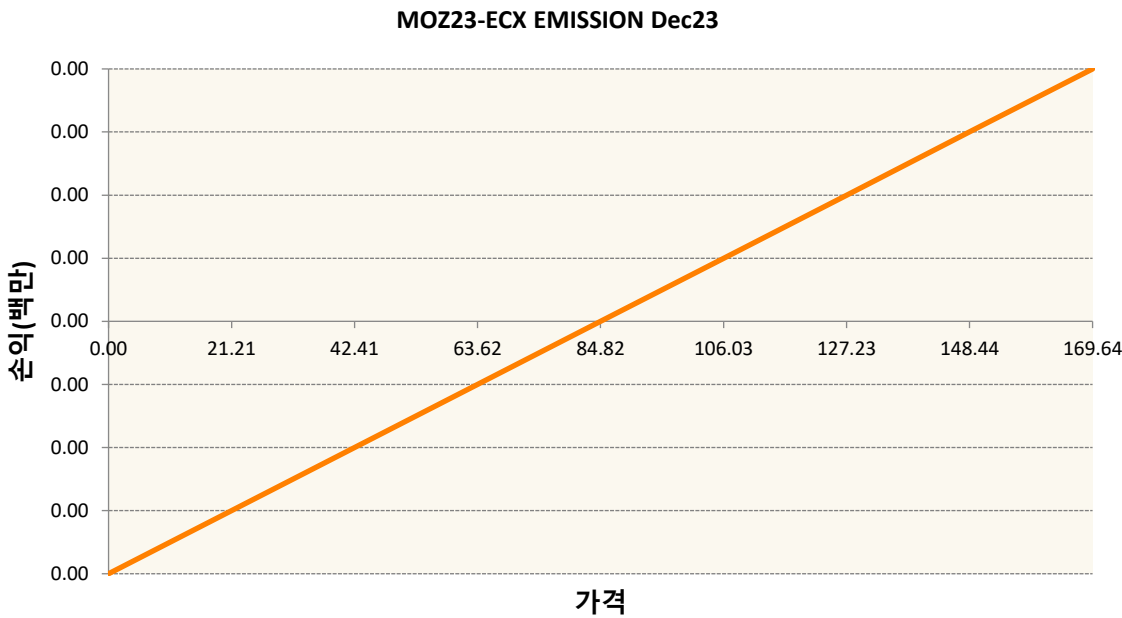
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	9,434	0	9,434	
누계	지수	스왑	479	0	479	장외
누계	통화	선도	0	1,820	-1,820	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213D9R\ KRW/EUR 31-10-23E	146
MOZ23 ECX EMISSION Dec23	755
SWICEUACN ICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX	0.42

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

(단위:백만원)

1,500

공시일	2023-10-12
기준일	2023-10-11

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	5,887	0	5,887	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI00000 신한CSI Index 230622 (NH)	2
SWCSI00000 신한CSI Index 230622 (미래)	2
SWCSI00000 신한CSI Index 230622 (메리츠)	2
SWCSI00000 신한CSI Index 230922 (키움)	2

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

(단위:백만원)

11

공시일	2023-10-12
기준일	2023-10-11

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	6,424	0	6,424	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 230116(NH)	3
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 230116(메리츠)	5
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 230116(미래)	4
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 230427(키움)	1

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

(단위:백만원)

15

공시일	2023-10-12
기준일	2023-10-11

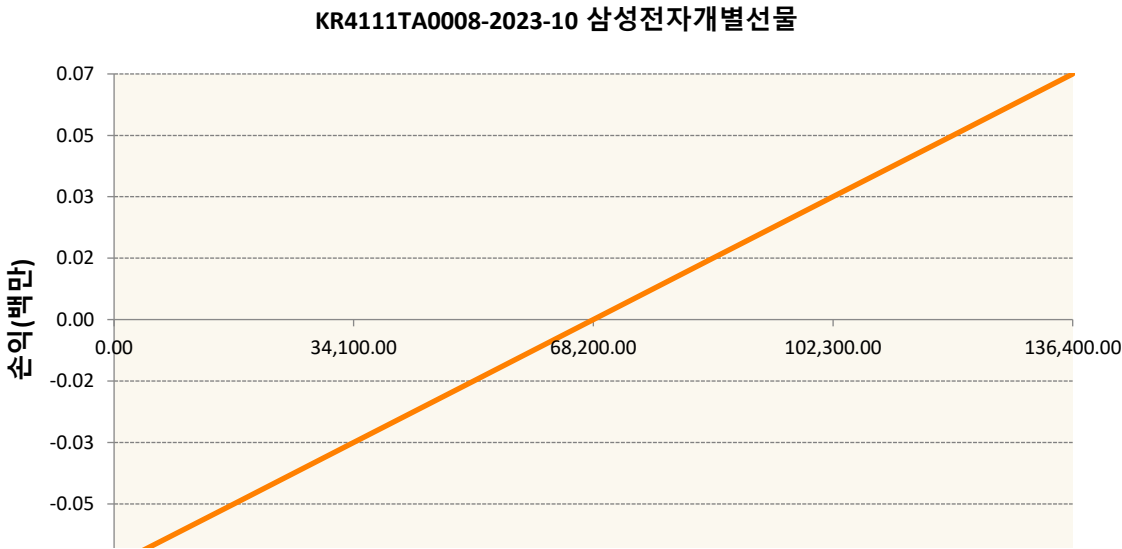
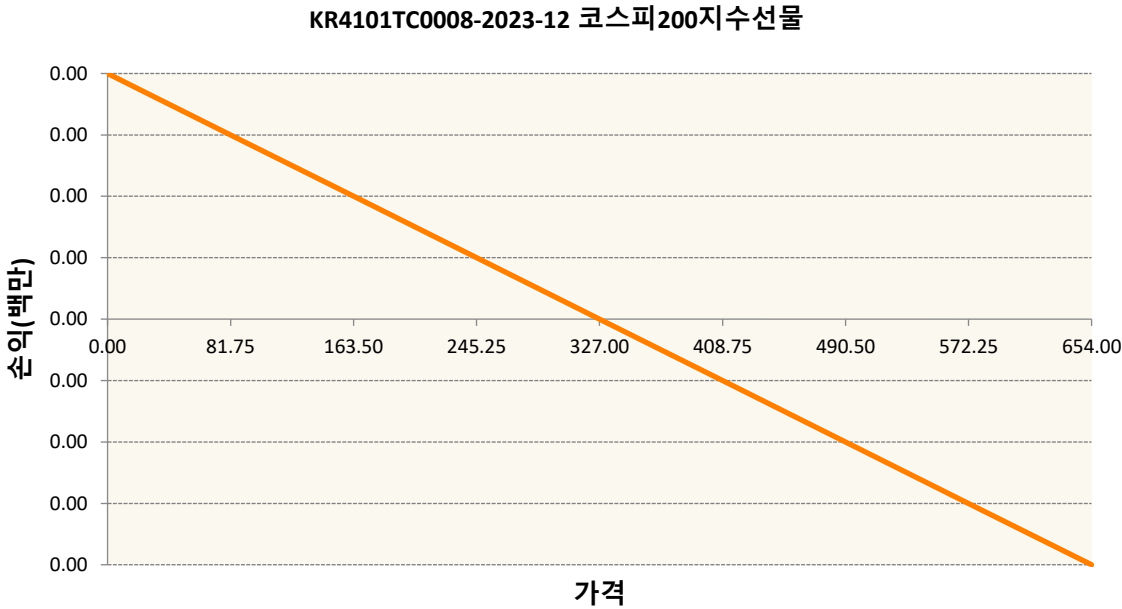
에퀴티알파일반사모혼합자산

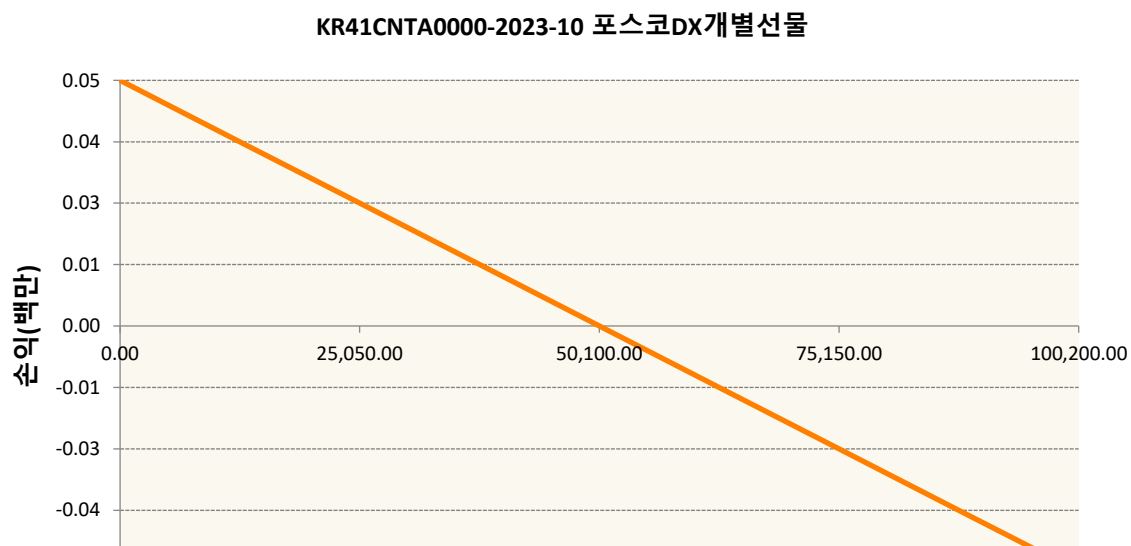
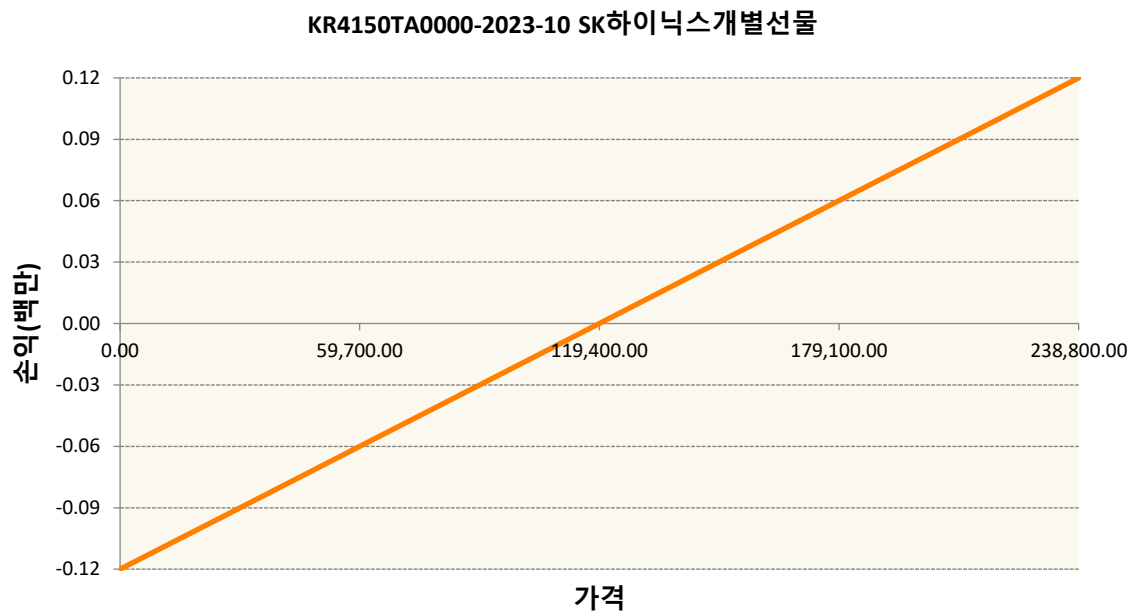
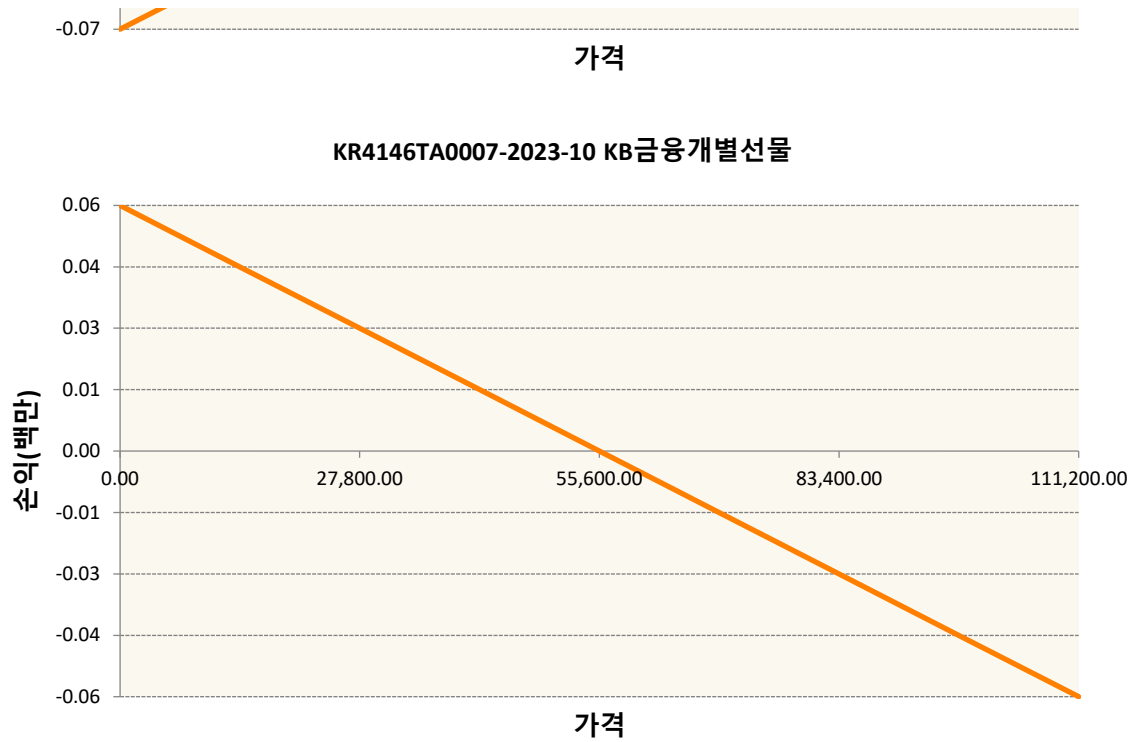
1. 계약금액

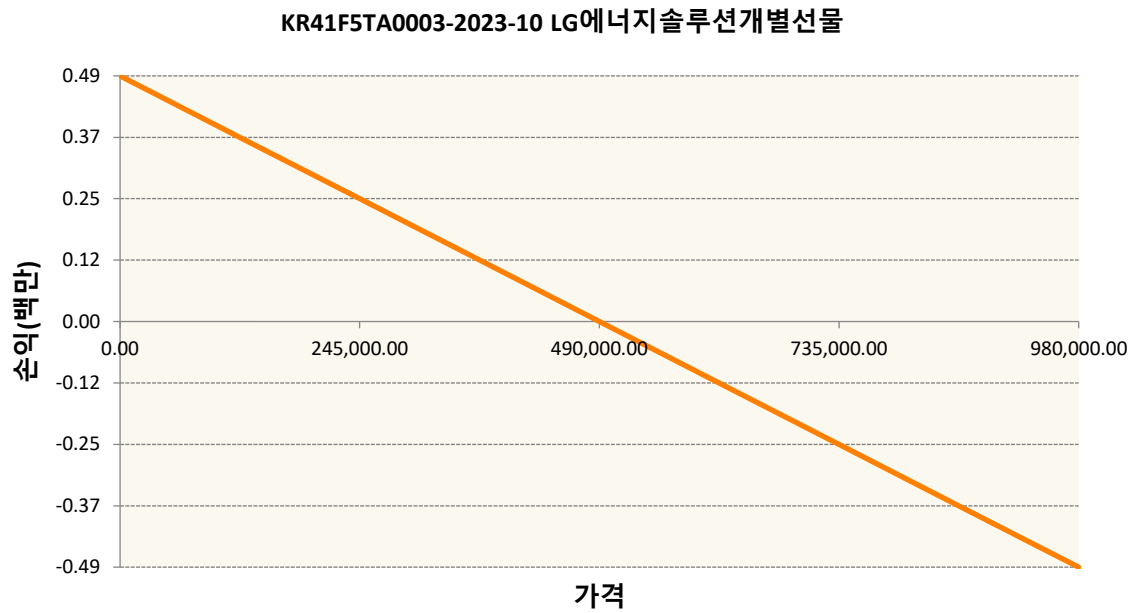
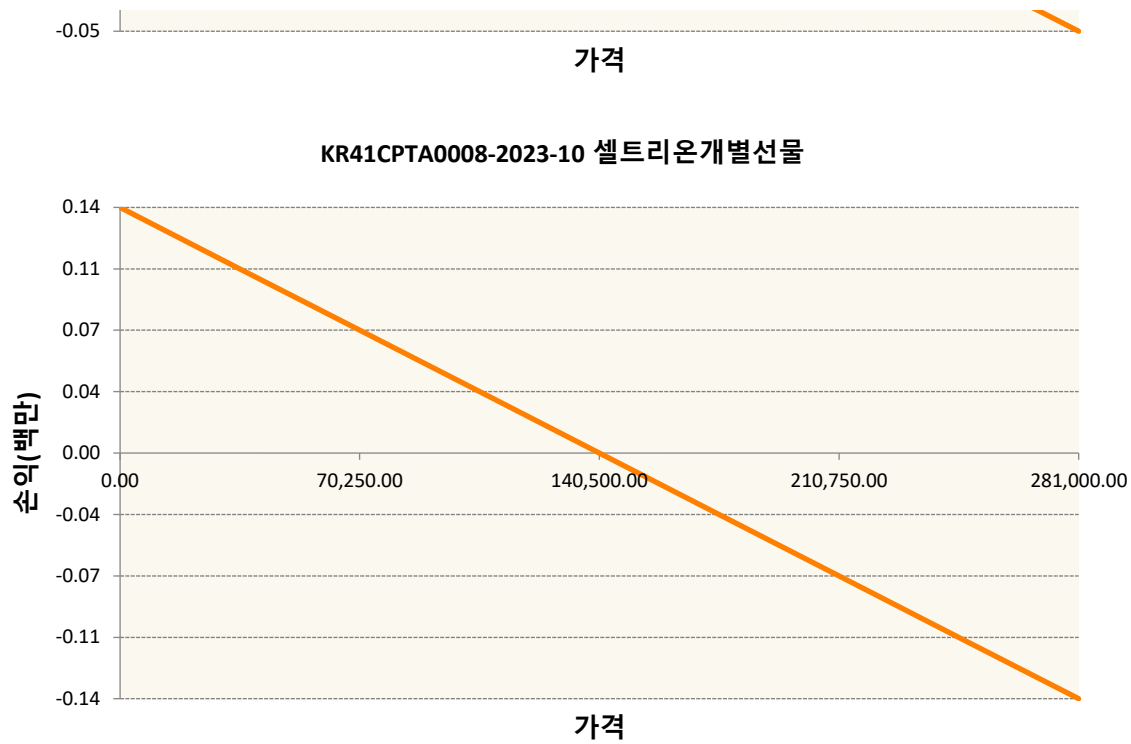
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	490	102	387	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	ELS	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,067	2,585	-1,519	장내
누계	유가증권	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	ELS	0	0	0	장외

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101TC00 2023-12 코스피200지수선물	164
KR4111TA00 2023-10 삼성전자개별선물	60
KR4146TA00 2023-10 KB금융개별선물	11
KR4150TA00 2023-10 SK하이닉스개별선물	25
KR41CNTA00 2023-10 포스코DX개별선물	7
KR41CPTA00 2023-10 셀트리온개별선물	13
KR41F5TA00 2023-10 LG에너지솔루션개별선물	12
KRS0004572 ELWKB금융_주식스왑	1
KRS0004618 ELWS-Oil_주식스왑5	0.3

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

(단위:백만원)

382

공시일	2023-10-12
기준일	2023-10-11

코리아인덱스(주식-파생형)(종)

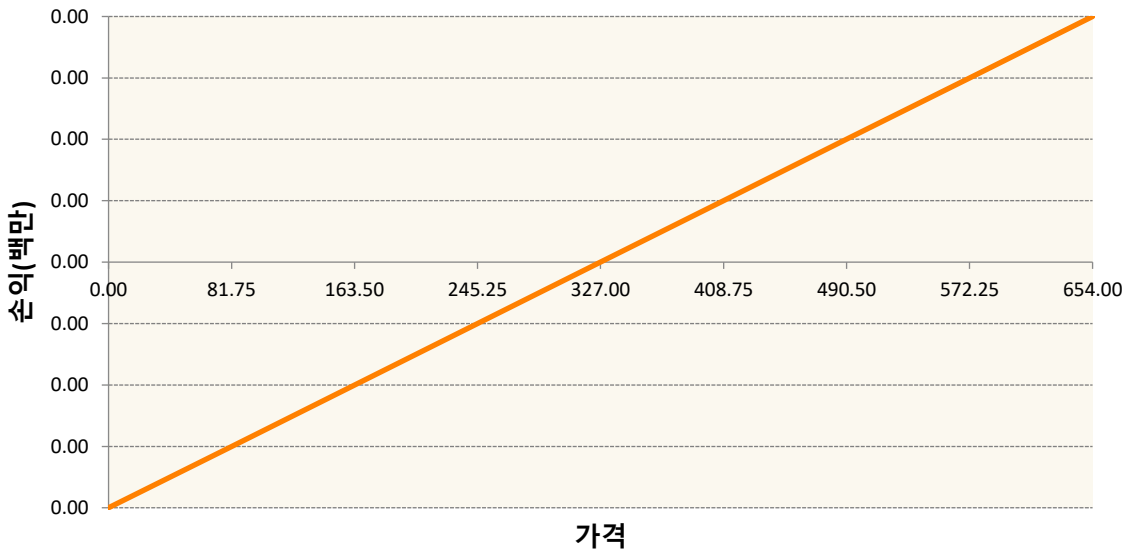
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	981	0	981	장내
누계	유가증권	선물	5,069	0	5,069	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101TC0008-2023-12 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101TC0008			2023-12 코스피200지수선물				403
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-403	-403	-403	-403	-403	-403	-403
-5.33%	-268	-268	-268	-268	-268	-268	-268
-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%	268	268	268	268	268	268	268
8.00%	403	403	403	403	403	403	403

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

(단위:백만원)

368

공시일	2023-10-12
기준일	2023-10-11

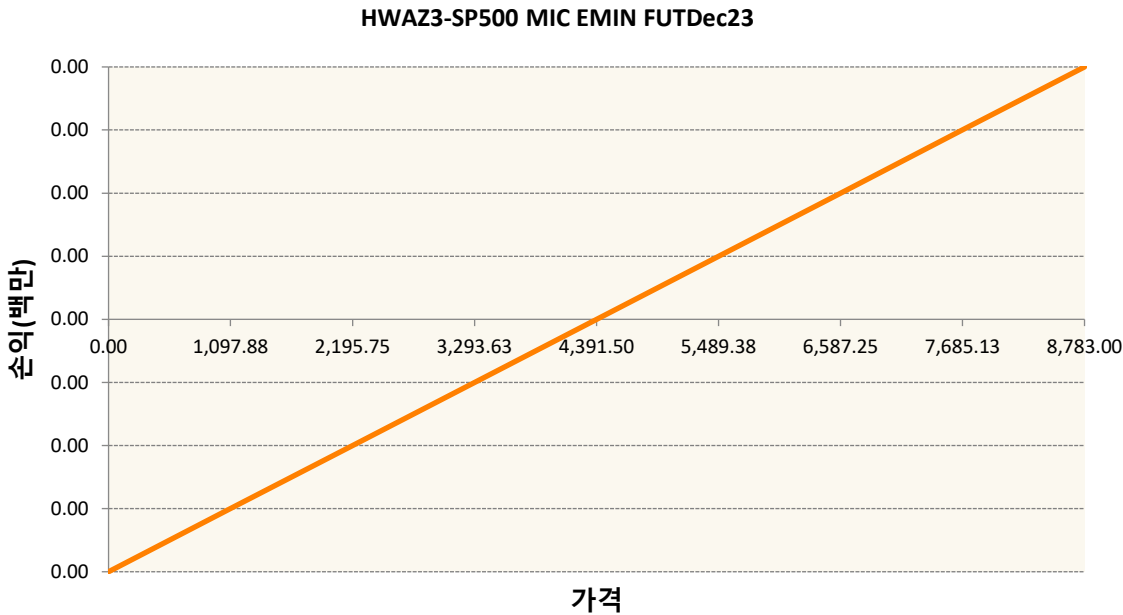
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

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	1,196	0	1,196	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HWAZ3	SP500 MIC EMIN FUTDec23	96
-------	-------------------------	----

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

(단위:백만원)

91

공시일	2023-10-12
기준일	2023-10-11

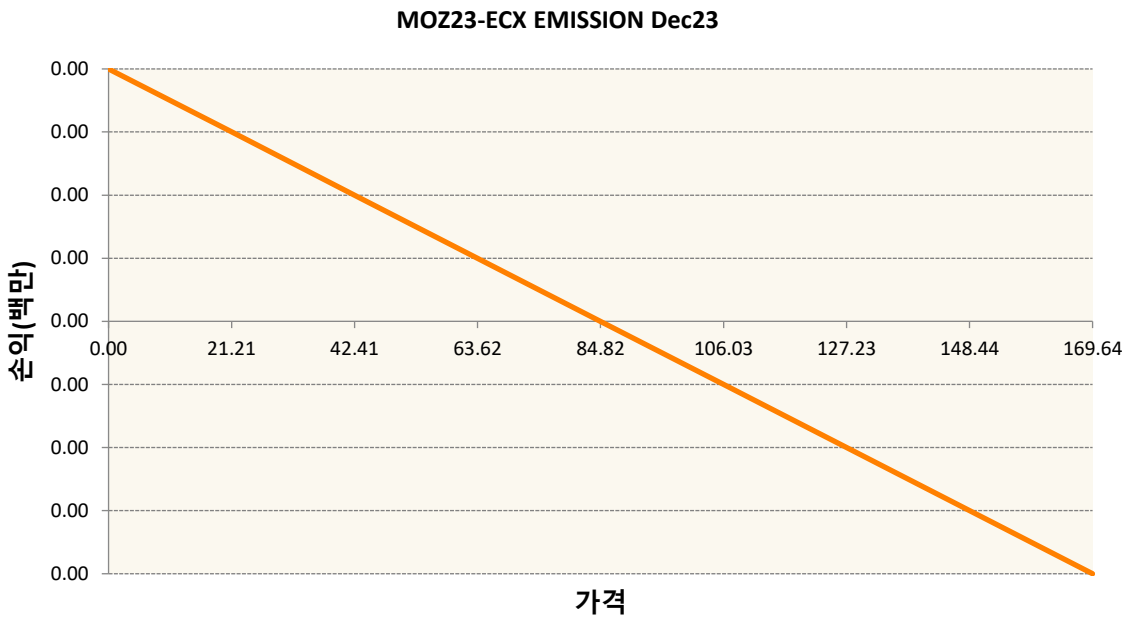
SOL유럽탄소배출권선물인버스ICE특별자산상

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	0	8,005	-8,005	
누계	지수	스왑	479	0	479	장외
누계	통화	선도	0	1,766	-1,766	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213D9R\ KRW/EUR 31-10-23E	141
MOZ23 ECX EMISSION Dec23	640
SWICEUACN ICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX	0.47

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

(단위:백만원)

1,286

공시일	2023-10-12
기준일	2023-10-11

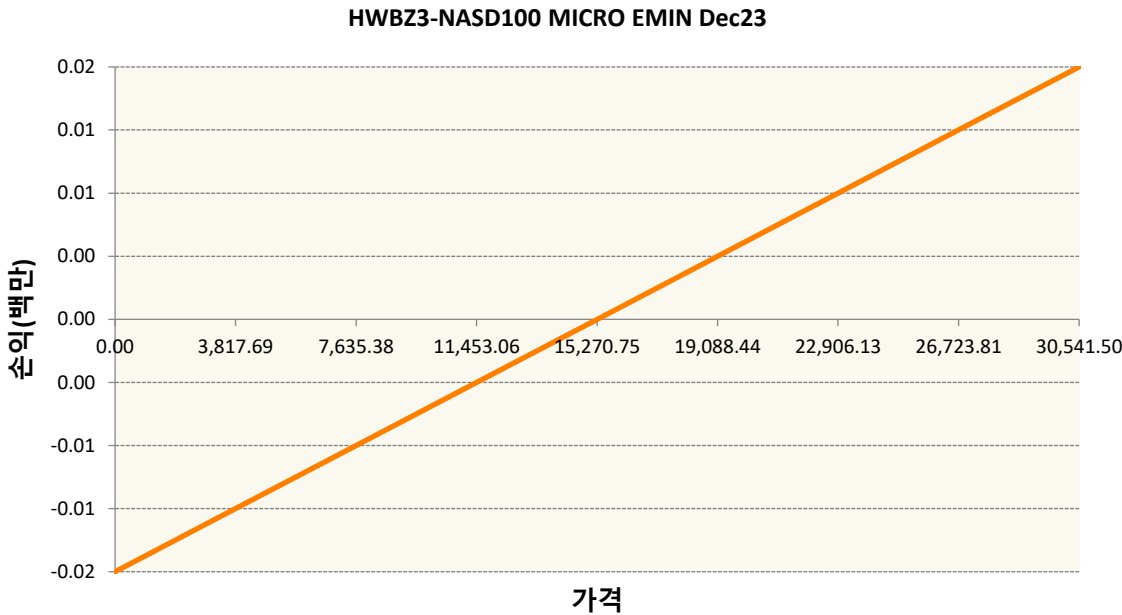
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

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	1,423	0	1,423	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HWBZ3 NASD100 MICRO EMIN Dec23

114

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

(단위:백만원)

108

공시일	2023-10-12
기준일	2023-10-11

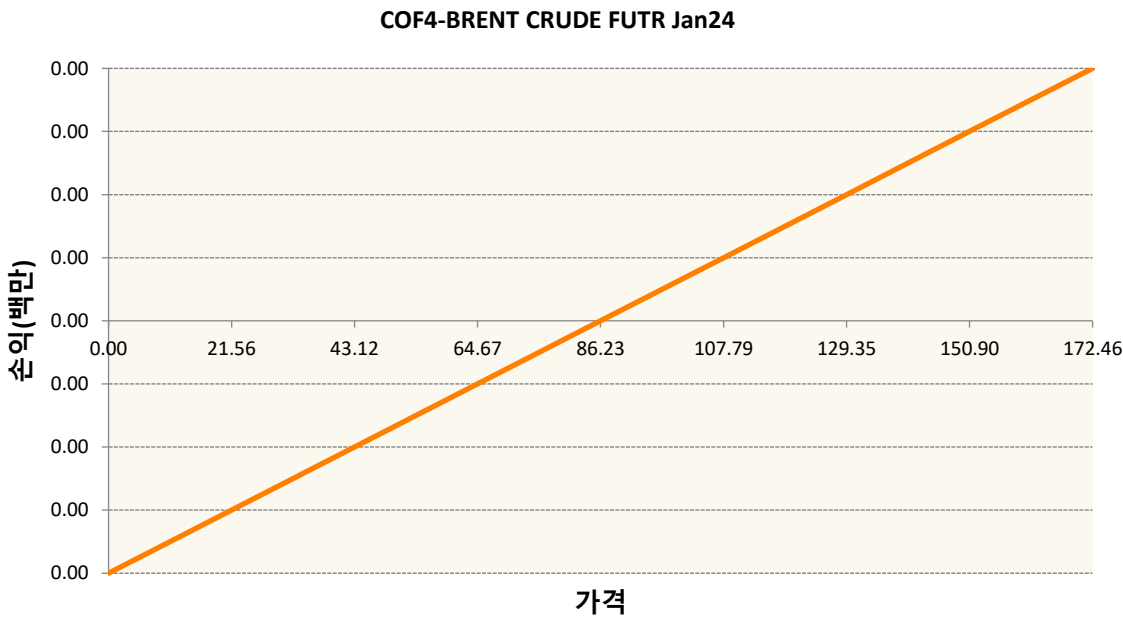
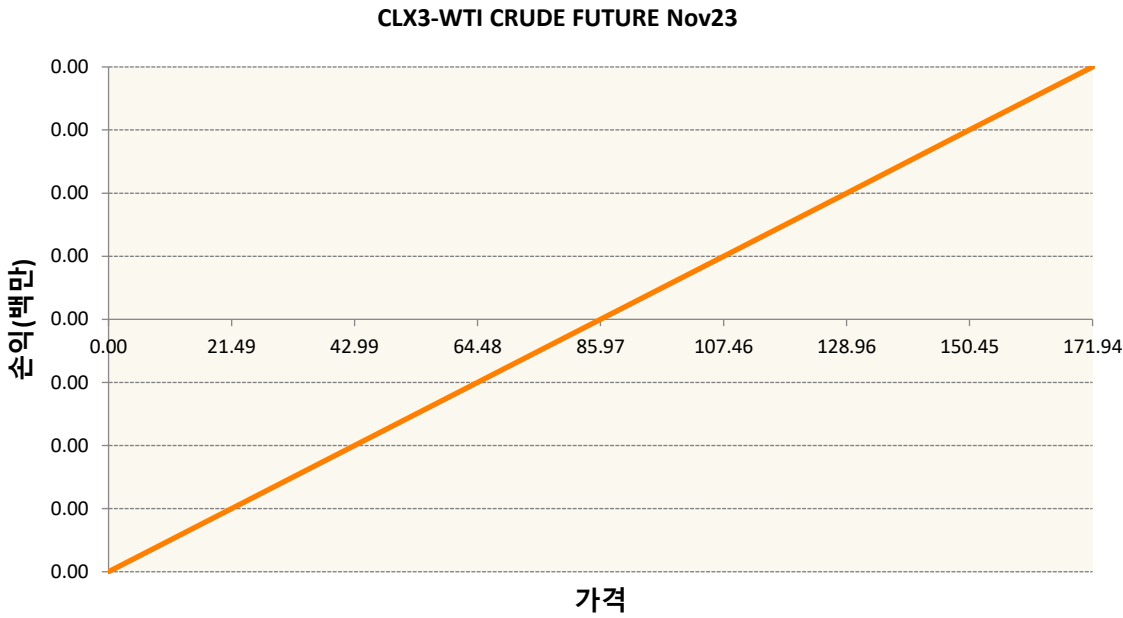
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

1. 계약금액

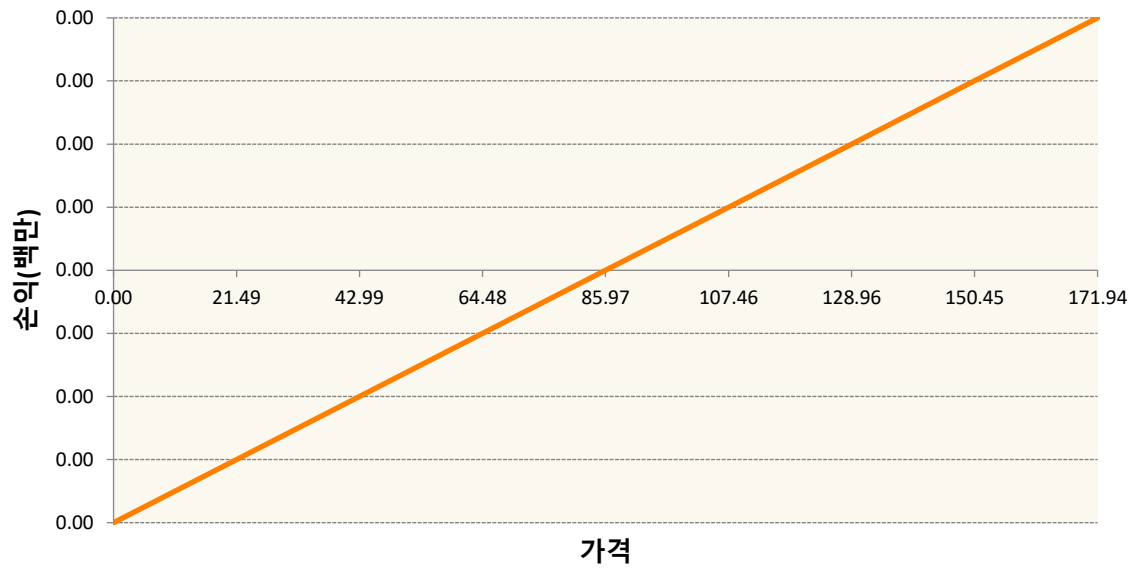
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,525	0	1,525	
누계	통화	선물	0	160	-160	장내

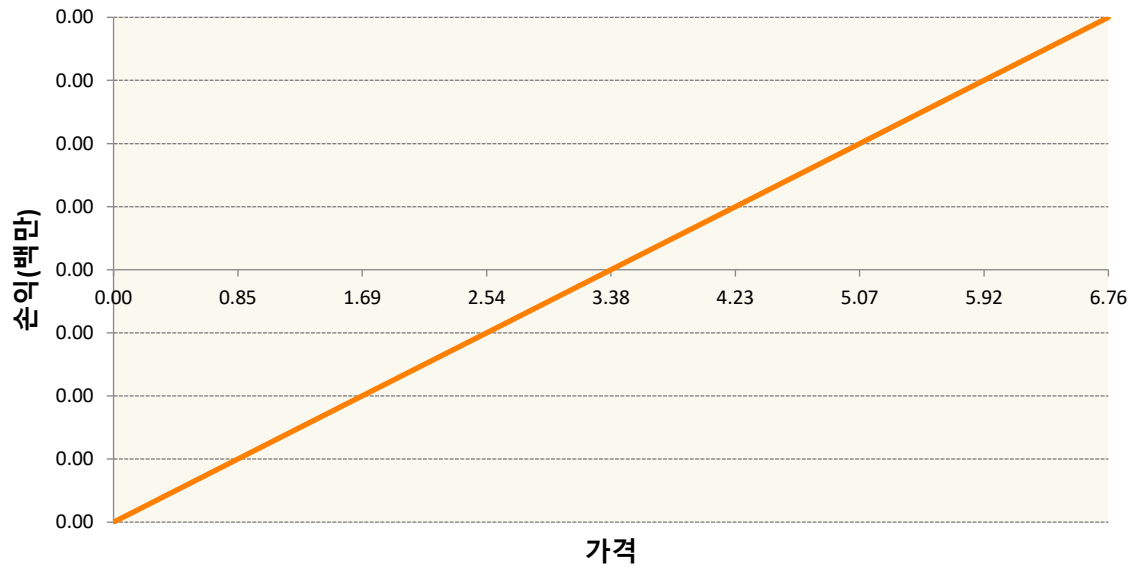
2. 만기시점의 손익구조



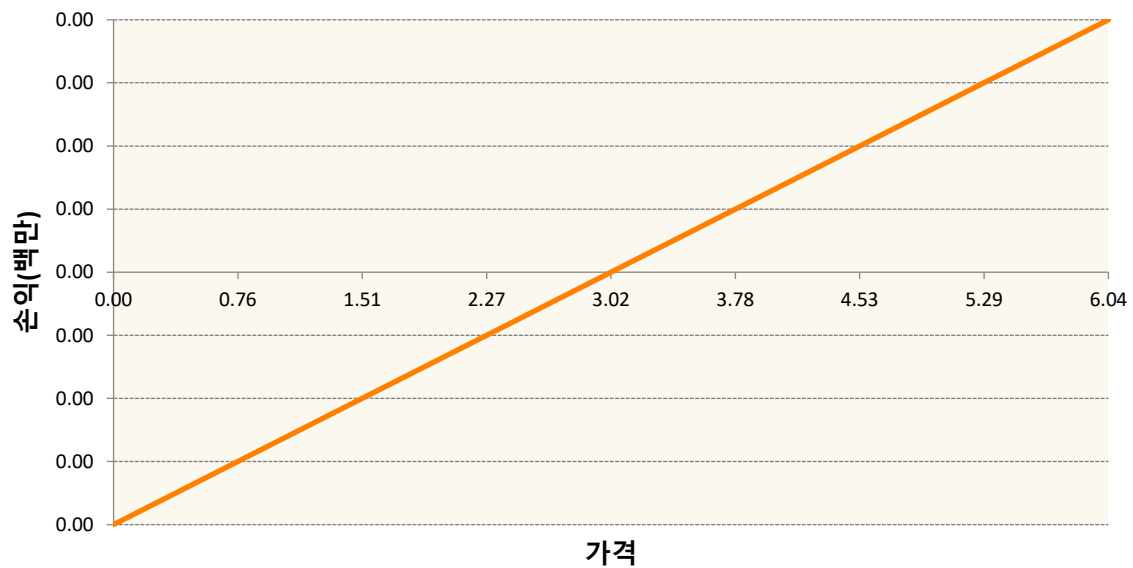
ECX3-E-MINI CRUDE OIL Nov23



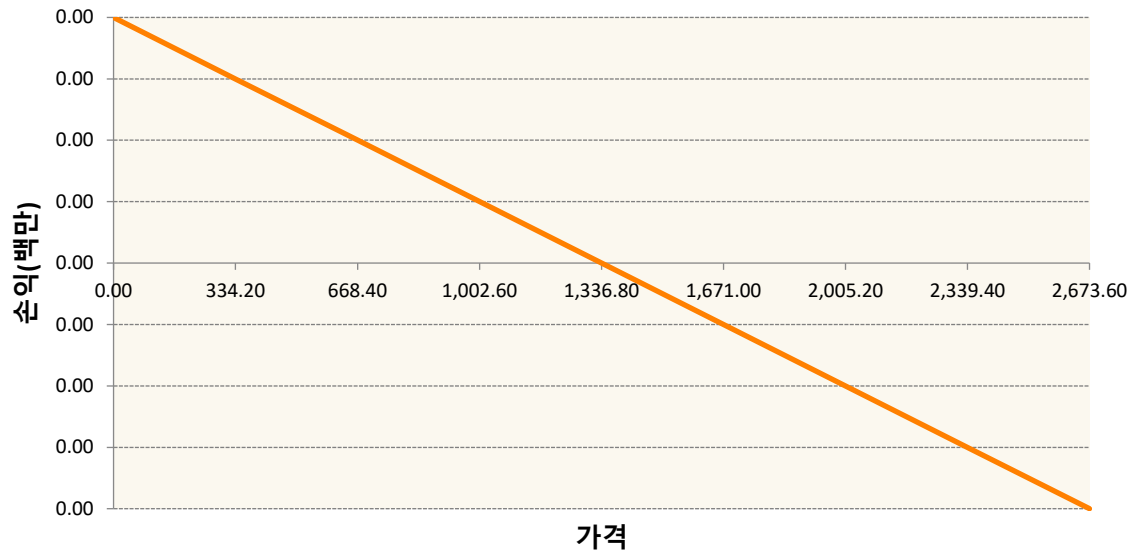
EOX3-E-MINI NATURAL GAS Nov23



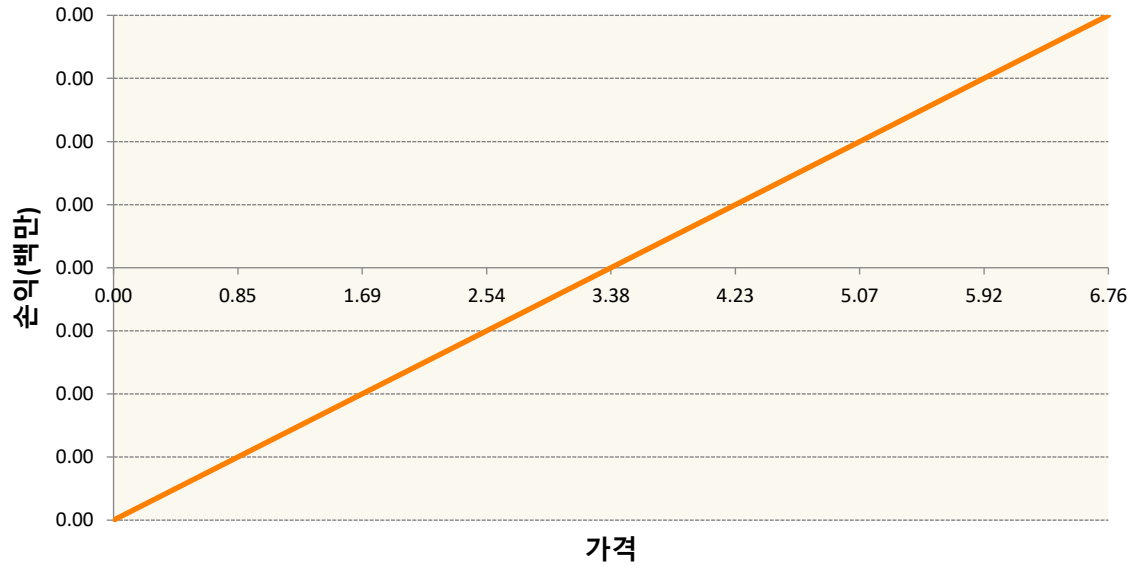
HOX3-NY Harb ULSD Fut Nov23



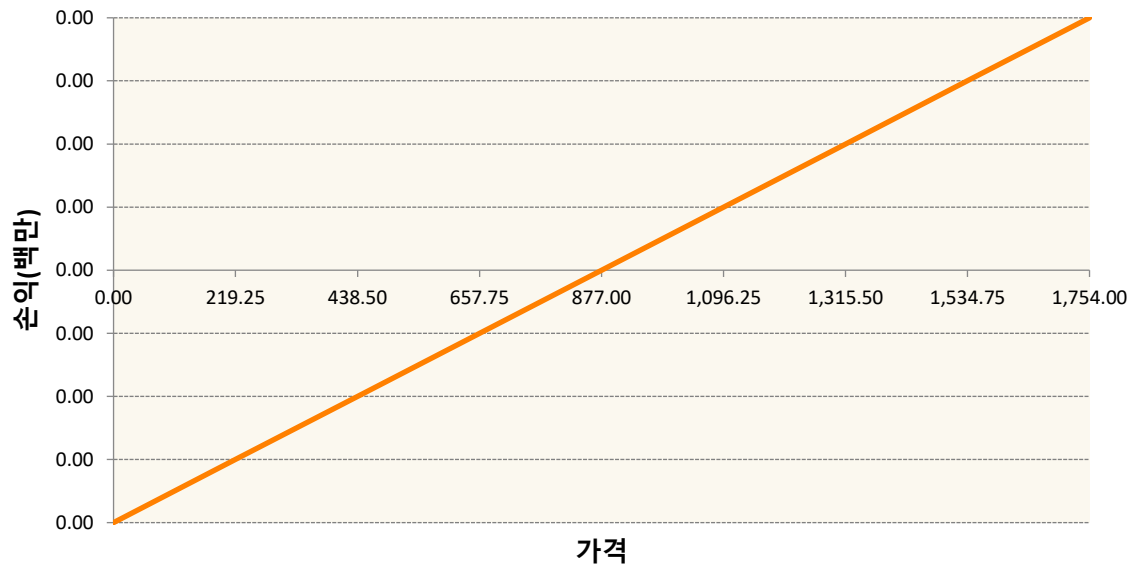
KR4175TA0001-2023-10 달러선물

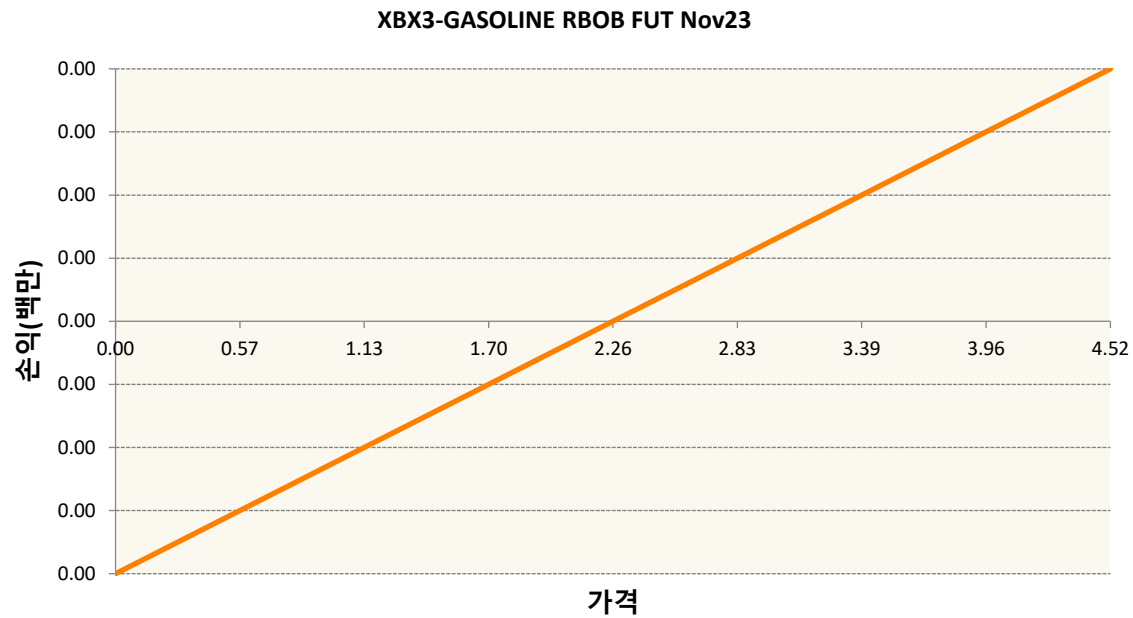


NGX23-NATURAL GAS FUTR Nov23



QX3-Low Su Gasoil G Nov23





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
CLX3	WTI CRUDE FUTURE Nov23	27
COF4	BRENT CRUDE FUTR Jan24	27
ECX3	E-MINI CRUDE OIL Nov23	5
EOX3	E-MINI NATURAL GAS Nov23	2
HOX3	NY Harb ULSD Fut Nov23	13
KR4175TA00 2023-10 달러선물		13
NGX23	NATURAL GAS FUTR Nov23	29
QSX3	Low Su Gasoil G Nov23	9
XBX3	GASOLINE RBOB FUT Nov23	10

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	317