

공시일	2023-10-31
기준일	2023-10-30

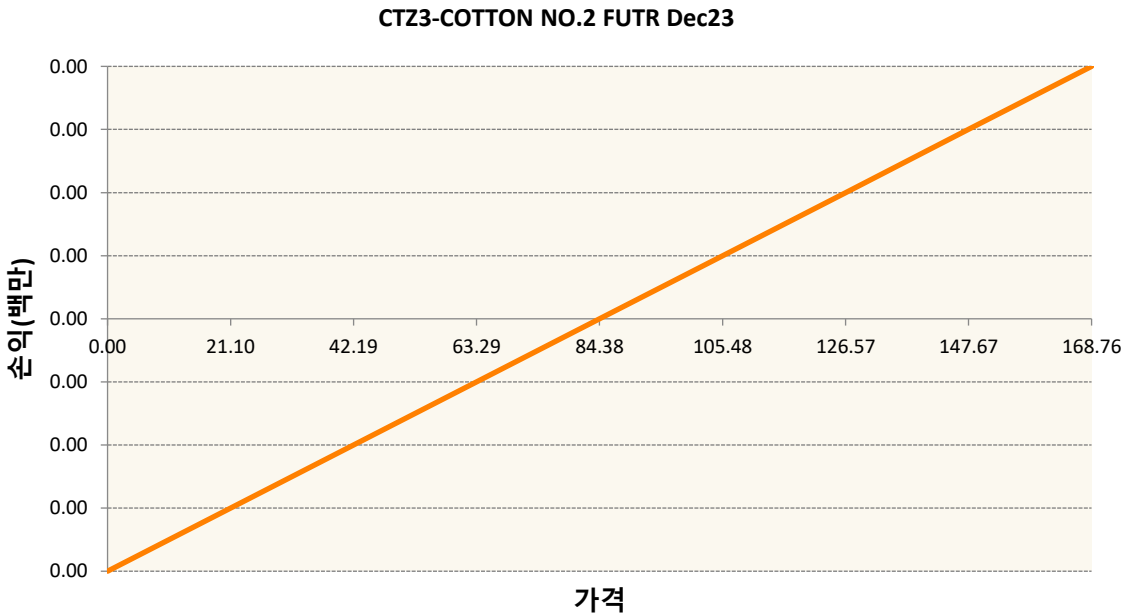
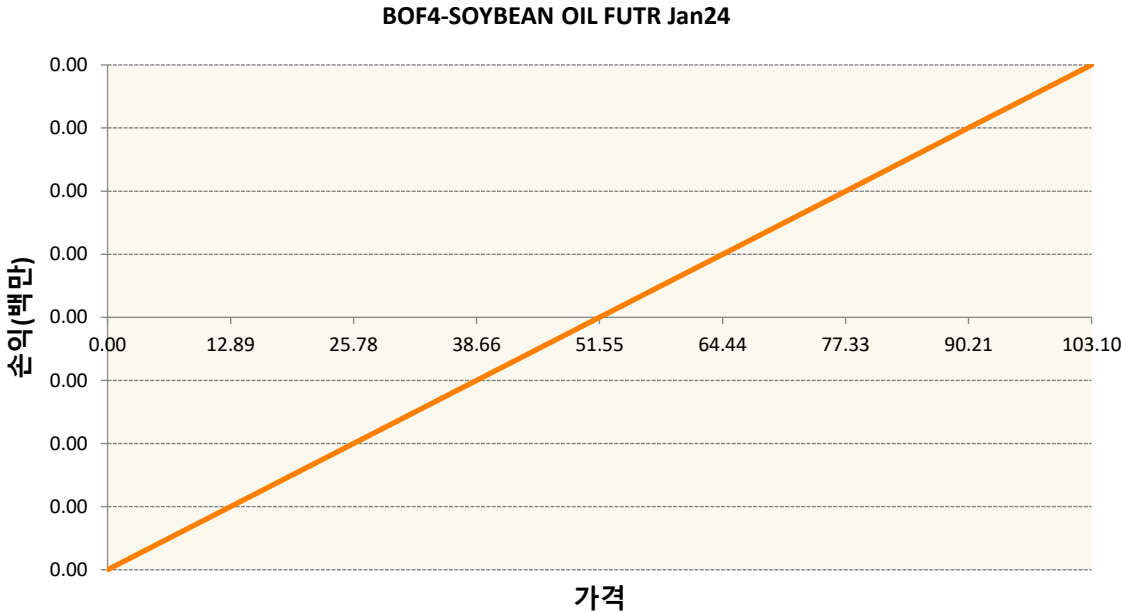
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

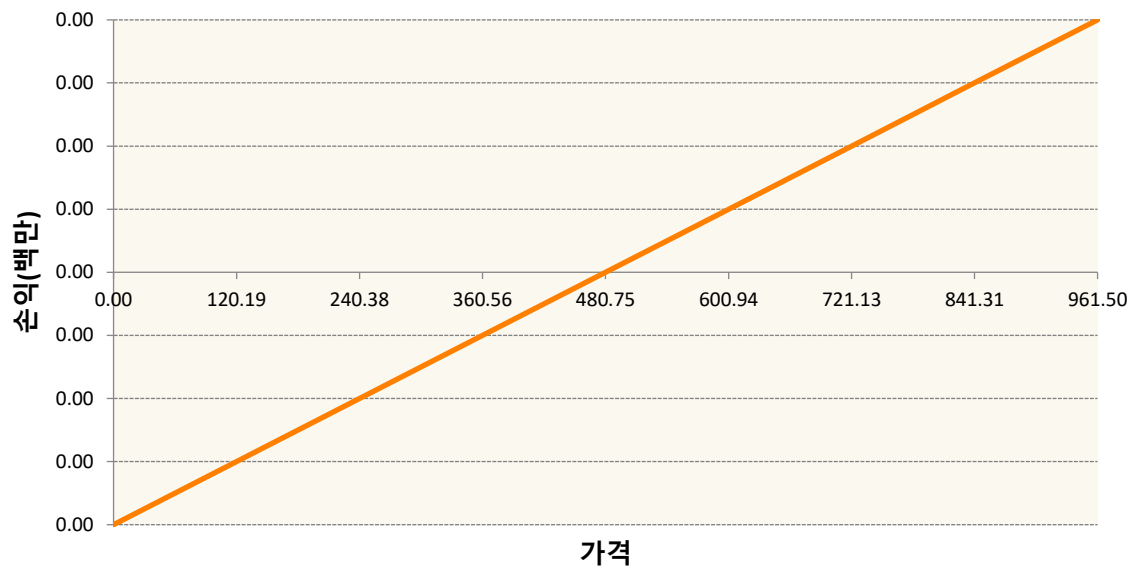
(단위:USD 백만)

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	4,826	0	4,826	
누계	통화	선물	0	594	-594	장내

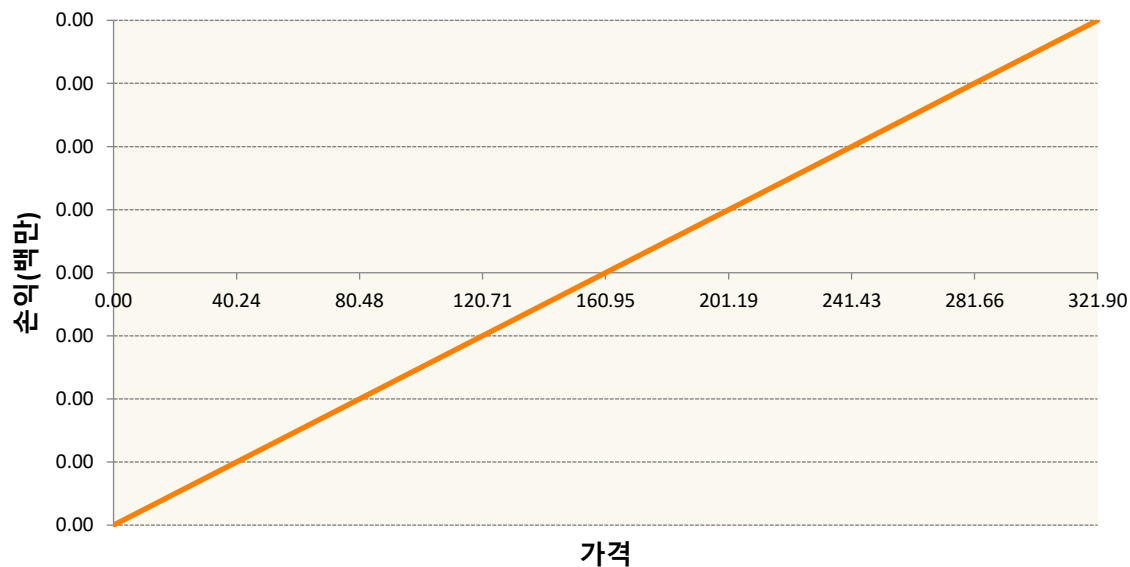
2. 만기시점의 손익구조



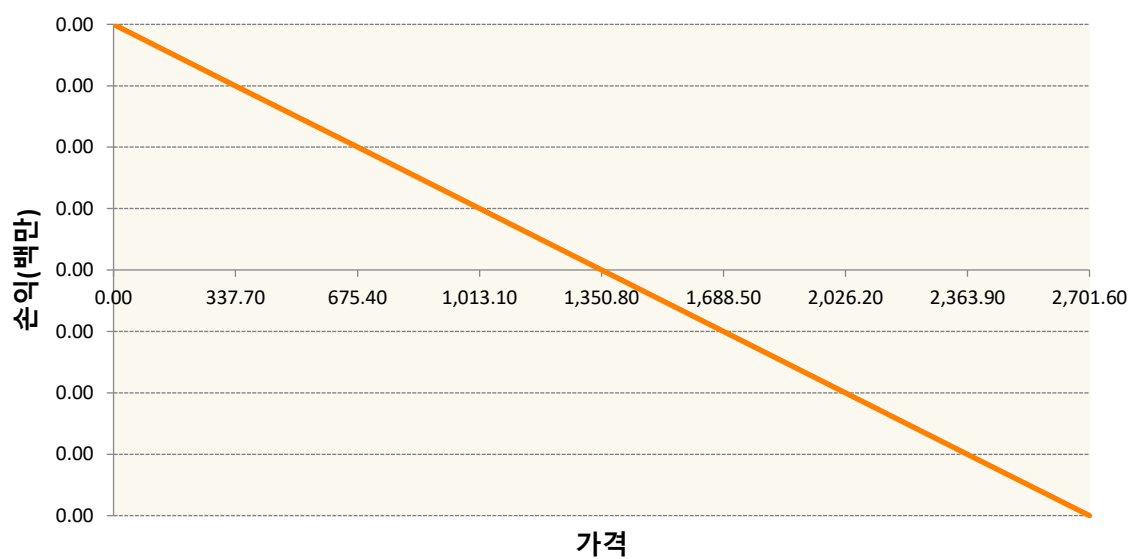
CZ3-CORN FUTURE Dec23



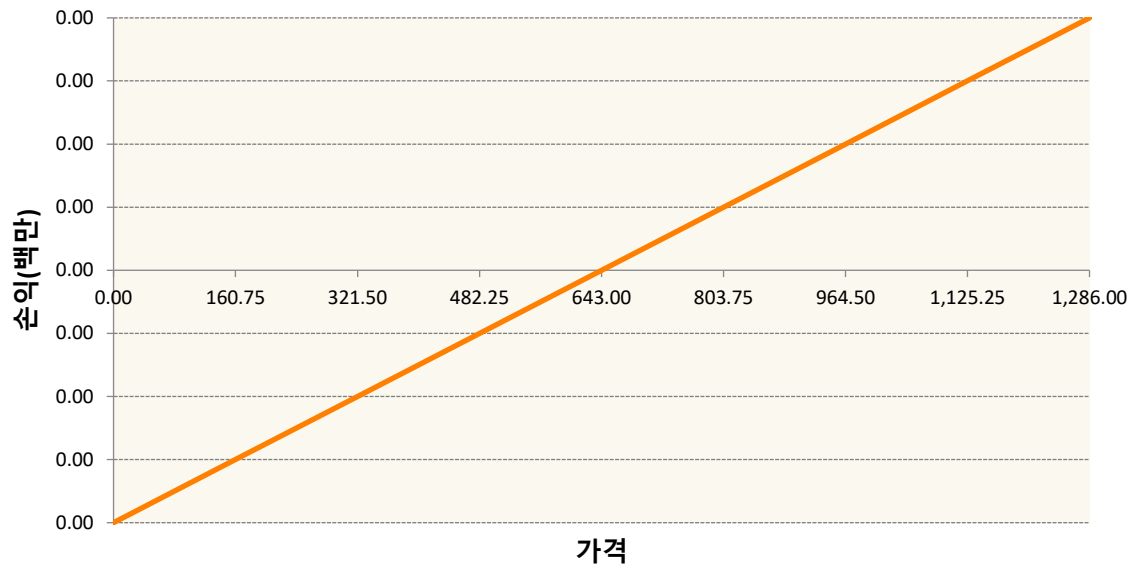
KCZ3-COFFEE 'C' FUTURE DEC23



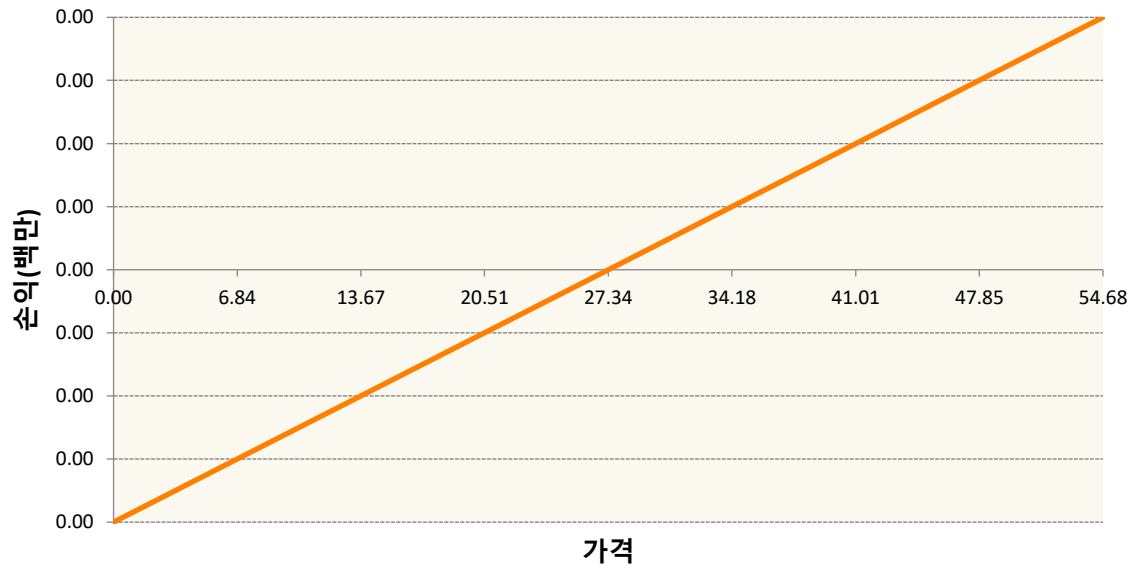
KR4175TB0000-2023-11 달러선물



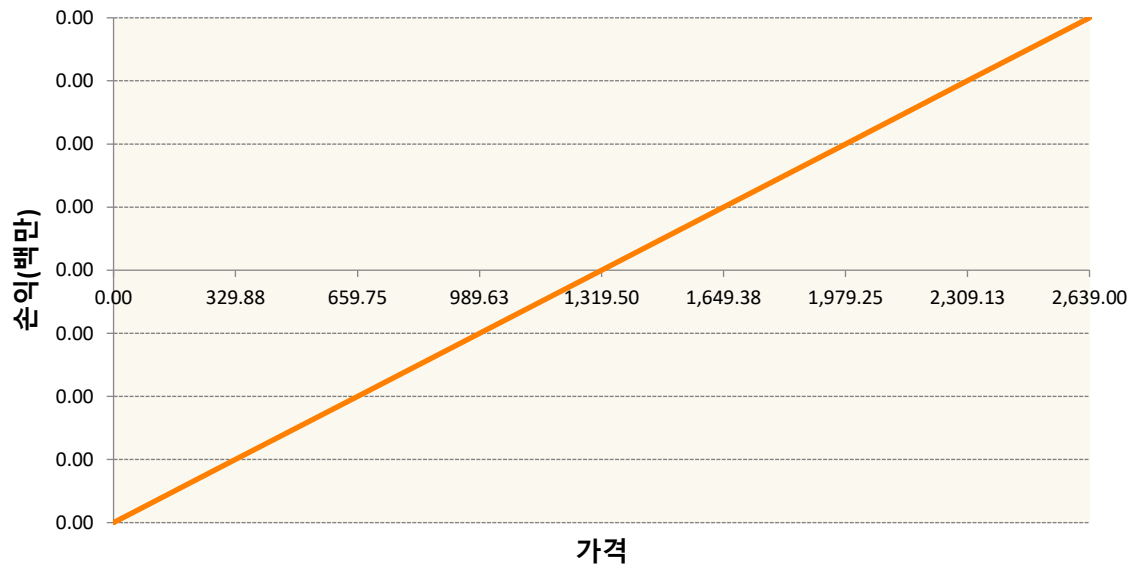
KWZ3-KC HRW WHEAT FUT DEC23



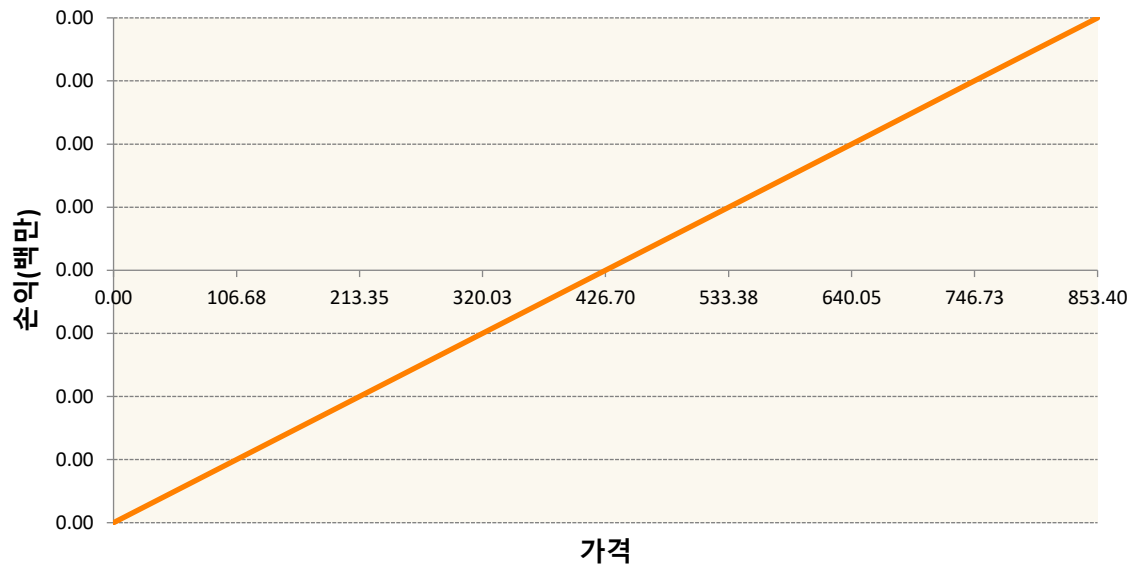
SBH4-Sugar #11 (WORLD) Mar24



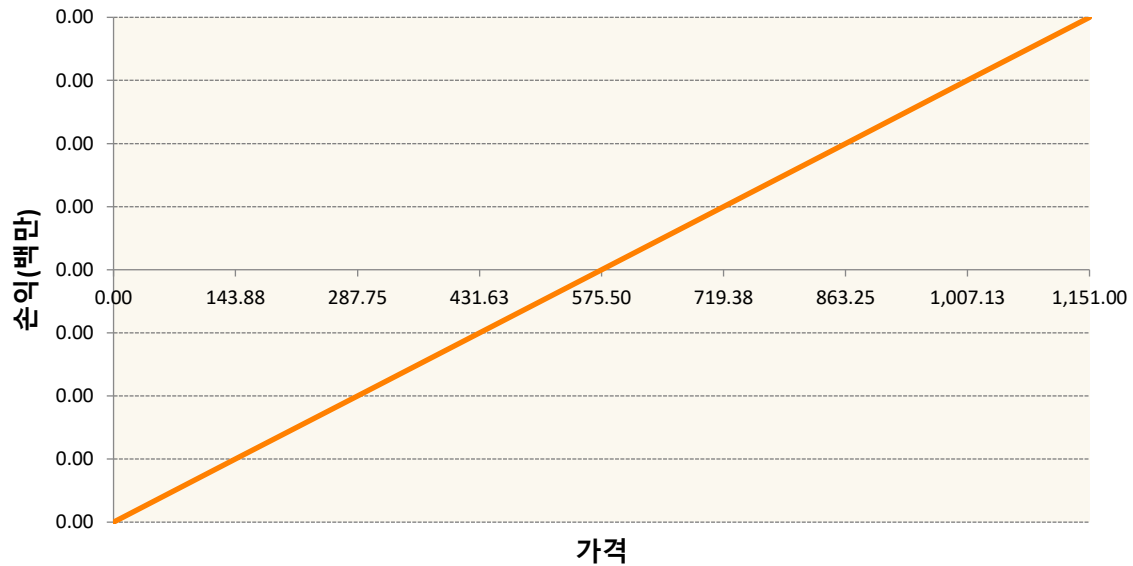
SF4-SOYBEAN FUTURE Jan24



SMF4-SOYBEAN MEAL FUTR Jan24



WZ3-WHEAT FUTURE(CBT) Dec23



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

공시일	2023-10-31
기준일	2023-10-30

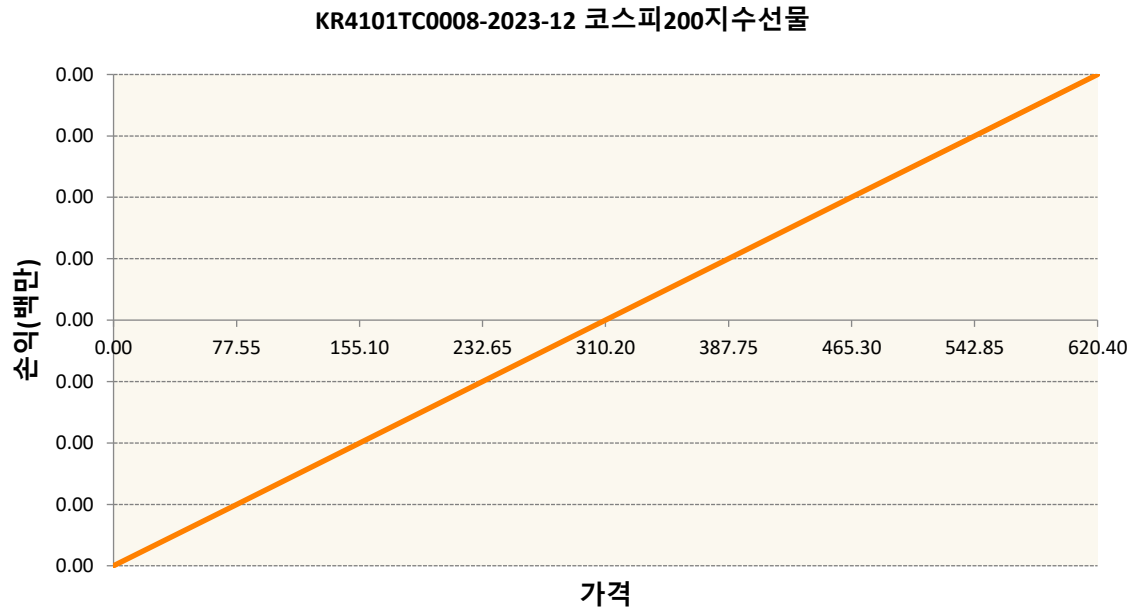
스마트인덱스모

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	155	-155	장내
누계	유가증권	선물	1,784	0	1,784	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101TC0008			2023-12 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

공시일	2023-10-31
기준일	2023-10-30

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	305
-----------------------------	-----

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

289

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2023-10-31
기준일	2023-10-30

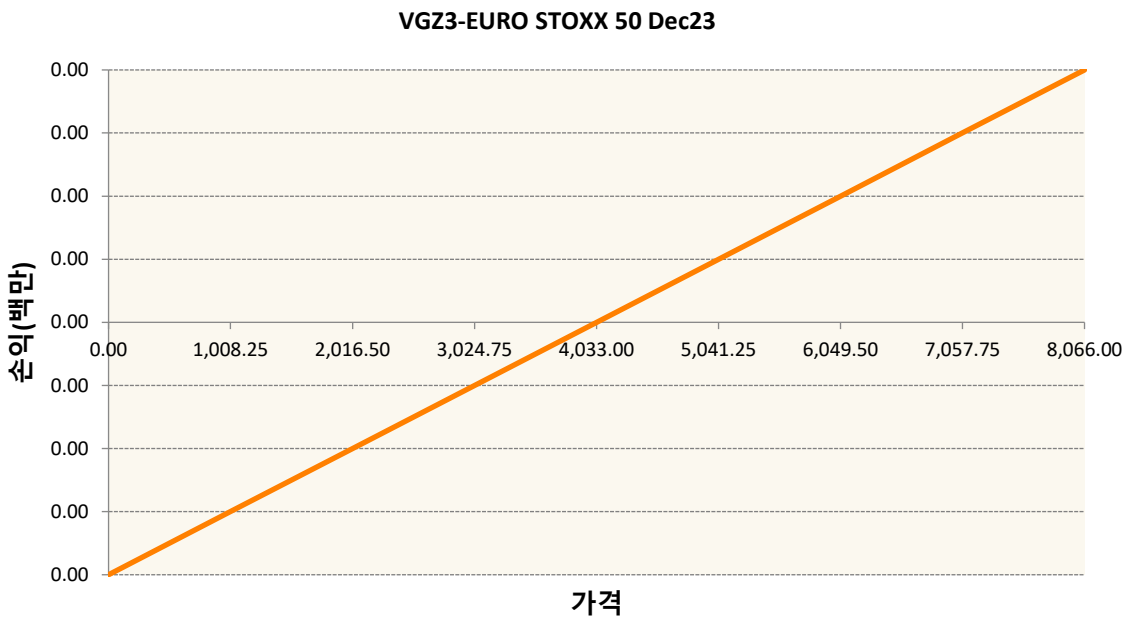
유로인덱스모(주식-파생형)

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	917	0	917	
누계	통화	선도	214	0	214	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213D9M EUR/KRW 22-12-23E	17
VGZ3 EURO STOXX 50 Dec23	73

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

(단위:백만원)

75

공시일	2023-10-31
기준일	2023-10-30

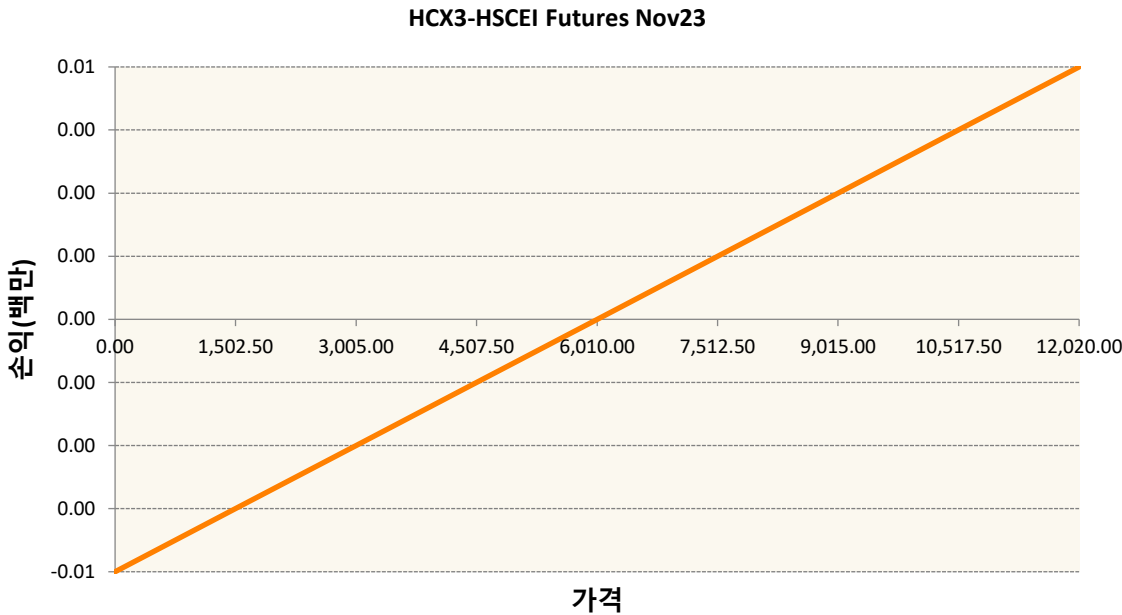
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,094	0	1,094	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HGX3	HSCEI Futures Nov23	88
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

129

공시일	2023-10-31
기준일	2023-10-30

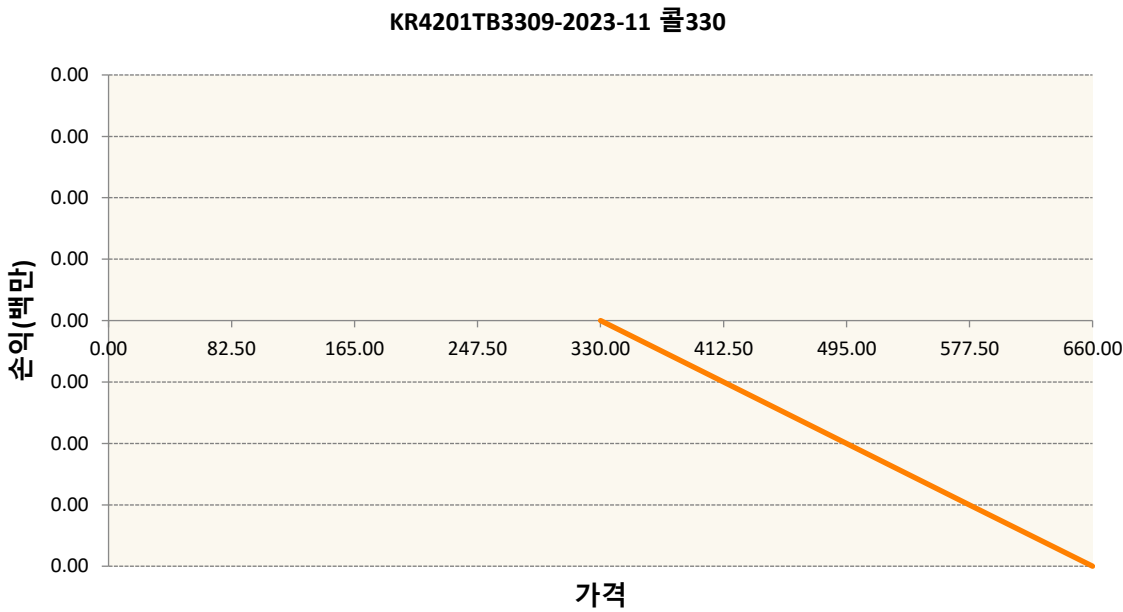
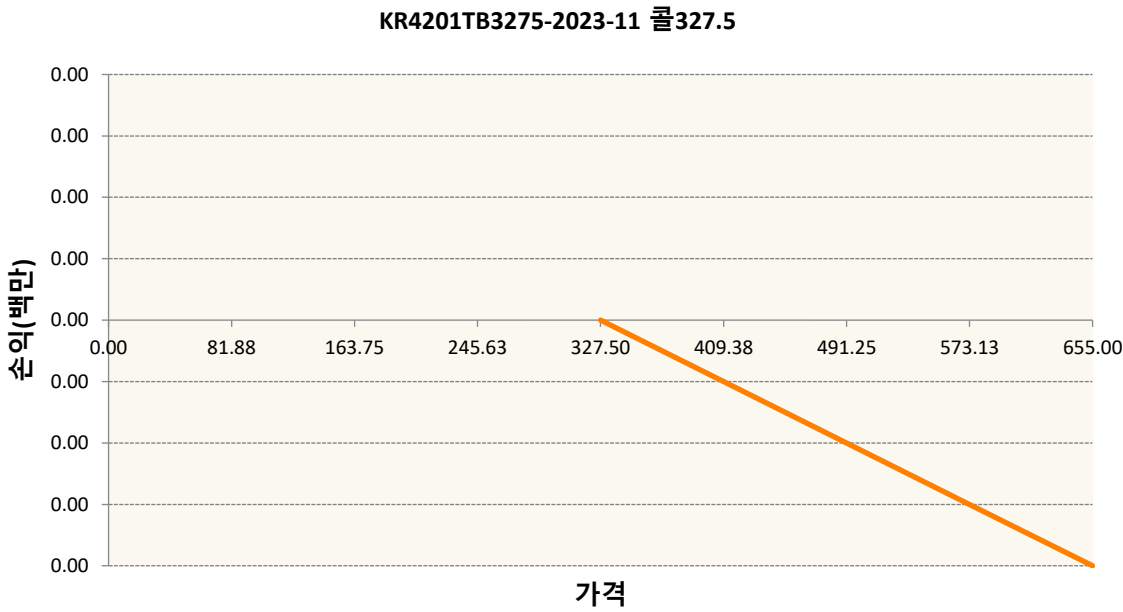
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

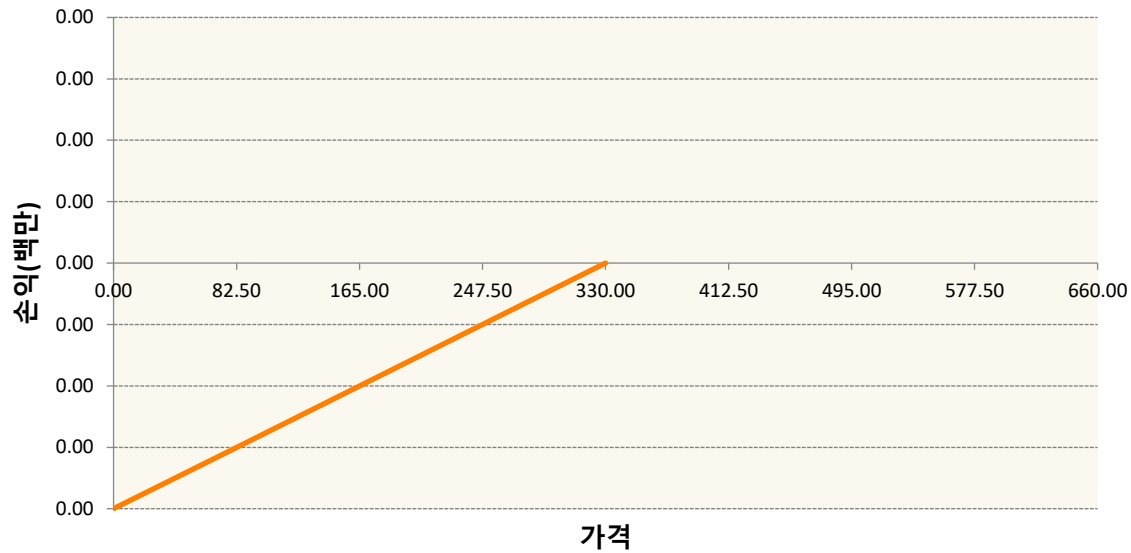
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	52,778	-52,778	장내

2. 만기시점의 손익구조



KR4301TB3308-2023-11 풋330



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201TB3275			2023-11 콜327.5				676
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	13	13	13	13	13	13	13
-5.33%	13	13	13	13	13	12	12
-2.67%	13	13	12	11	10	8	6
0%	11	8	5	0	-6	-14	-23
2.67%	-16	-29	-44	-60	-77	-96	-115
5.33%	-164	-190	-217	-243	-270	-296	-323
8.00%	-539	-560	-581	-604	-627	-651	-676
KR4201TB3309			2023-11 콜330				427
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	5	5	5	5	5	5	5
-5.33%	5	5	5	5	5	5	5
-2.67%	5	5	5	5	4	3	2
0%	5	4	2	0	-3	-8	-13
2.67%	-6	-12	-21	-30	-41	-52	-65
5.33%	-80	-98	-116	-135	-154	-173	-193
8.00%	-310	-329	-348	-368	-387	-407	-427
KR4301TB3308			2023-11 풋330				701
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-701	-701	-701	-701	-701	-701	-701
-5.33%	-467	-467	-467	-467	-467	-467	-467
-2.67%	-232	-232	-232	-232	-232	-233	-234
0%	2	2	1	0	-2	-4	-6

2.67%	232	228	224	220	214	209	202
5.33%	429	420	411	402	392	383	373
8.00%	549	539	530	520	510	500	491

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

(단위:백만원)

1,244

공시일	2023-10-31
기준일	2023-10-30

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	1,931	0	1,931	

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	2023-10-31
기준일	2023-10-30

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	4,520	0	4,520	

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	2023-10-31
기준일	2023-10-30

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	16,997	0	16,997	
누계	통화	선도	473	20,007	-19,534	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
FXW213D7T(KRW/USD 31-10-23E	269
FXW213D8W KRW/USD 30-11-23E	615
FXW213D9R(KRW/USD 29-12-23E	524
FXW213DA5 USD/KRW 31-10-23E	38
FXW213DAT(KRW/USD 31-01-24E	193
IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	897

공시일	2023-10-31
기준일	2023-10-30

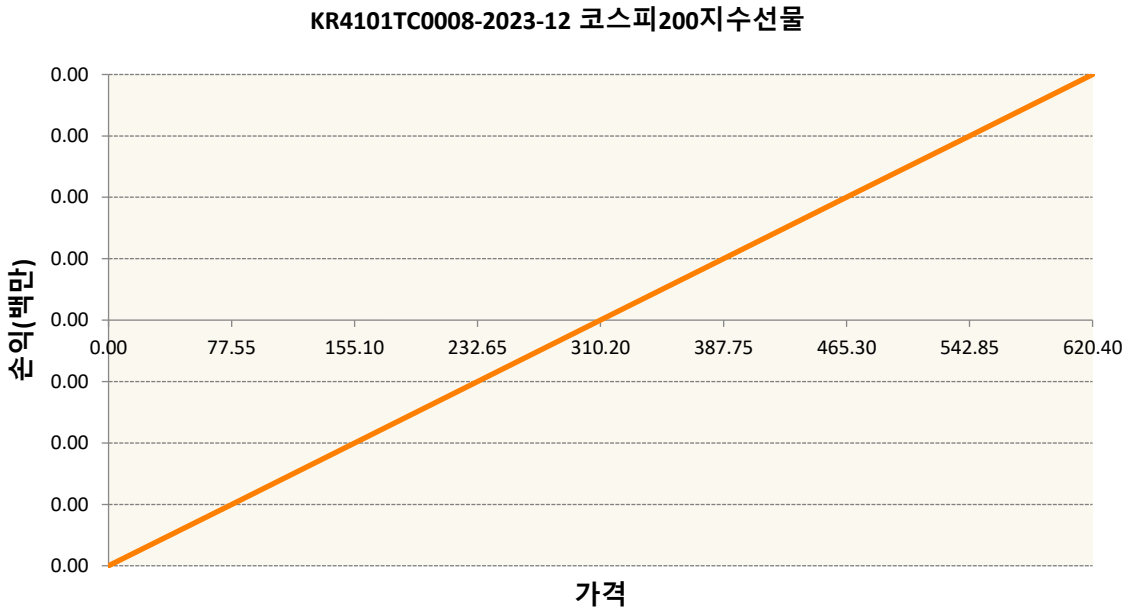
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	233	-233	장내
누계	유가증권	선물	620	0	620	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101TC0008			2023-12 코스피200지수선물				49
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-49	-49	-49	-49	-49	-49	-49
-5.33%	-33	-33	-33	-33	-33	-33	-33
-2.67%	-16	-16	-16	-16	-16	-16	-16
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	16	16	16	16	16	16	16
5.33%	33	33	33	33	33	33	33
8.00%	49	49	49	49	49	49	49

공시일	2023-10-31
기준일	2023-10-30

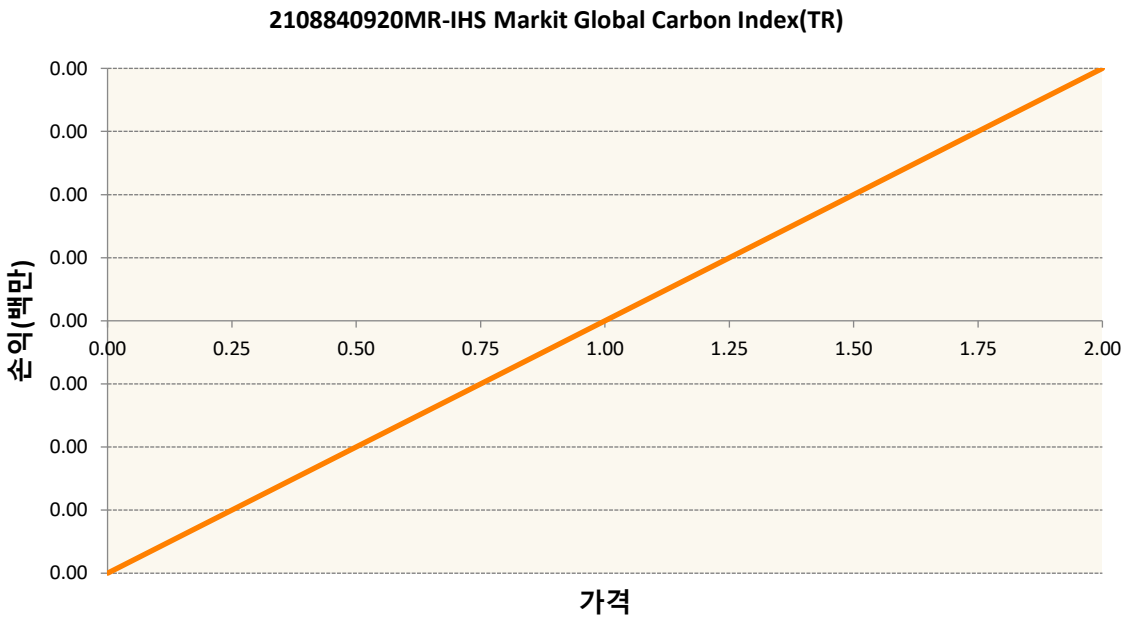
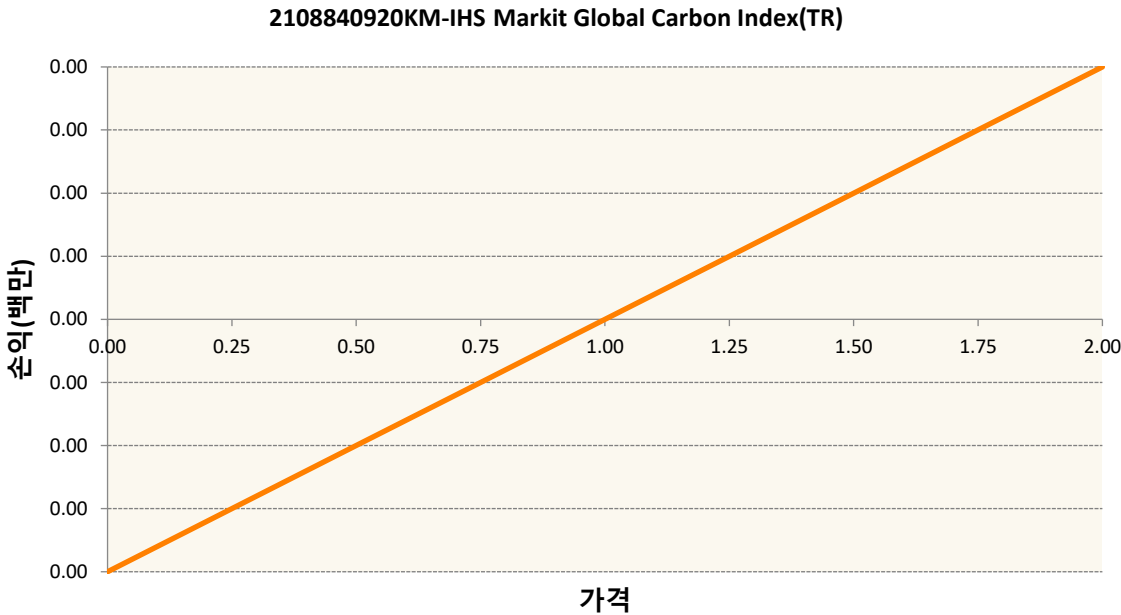
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

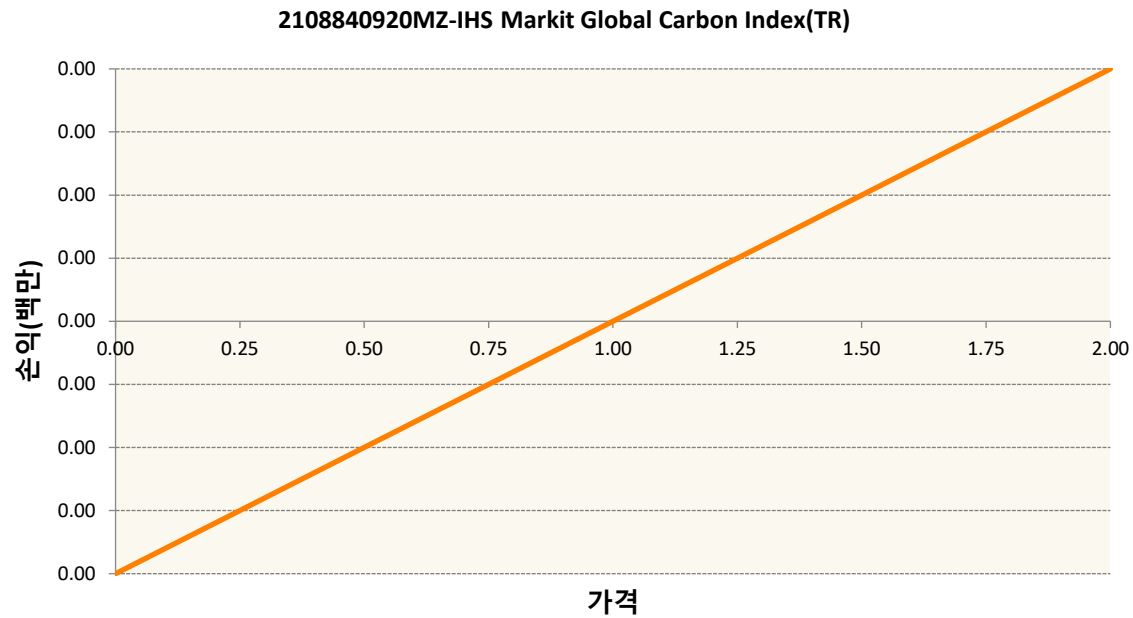
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	17,710	0	17,710	

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108840920IHS Markit Global Carbon Index(TR)		1,013
2108840920IHS Markit Global Carbon Index(TR)		203
2108840920IHS Markit Global Carbon Index(TR)		203

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)		(단위:백만원)
		1,843

공시일	2023-10-31
기준일	2023-10-30

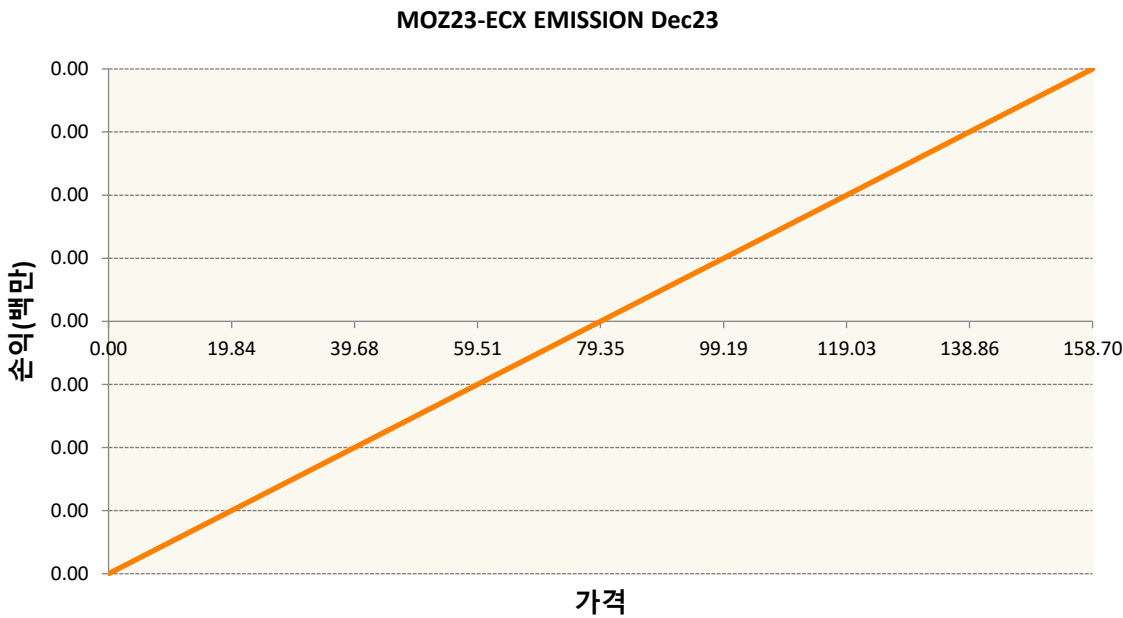
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	8,812	0	8,812	
누계	지수	스왑	479	0	479	장외
누계	통화	선도	0	3,282	-3,282	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213D9R KRW/EUR 31-10-23E	146
FXW213DAT KRW/EUR 30-11-23E	116
MOZ23 ECX EMISSION Dec23	705
SWICEUACN ICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX	2

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

(단위:백만원)

1,468

공시일	2023-10-31
기준일	2023-10-30

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	5,380	0	5,380	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI00000 신한CSI Index 230622 (미래)	6
SWCSI00000 신한CSI Index 230622 (메리츠)	6
SWCSI00000 신한CSI Index 230922 (키움)	4
SWCSI00000 신한CSI Index 231013 (NH)	5

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

(단위:백만원)

32

공시일	2023-10-31
기준일	2023-10-30

SOL차이나육성산업엑티브상장지

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)	1
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 230116(메리츠)	1
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 230116(미래)	1
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 230427(키움)	0.22

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

(단위:백만원)

3

공시일	2023-10-31
기준일	2023-10-30

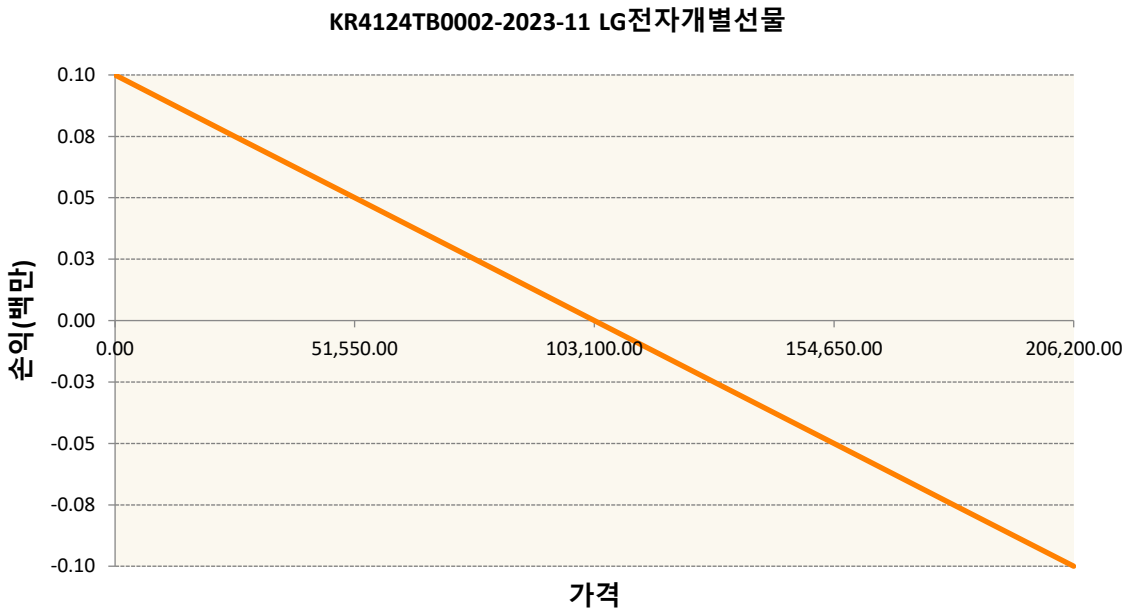
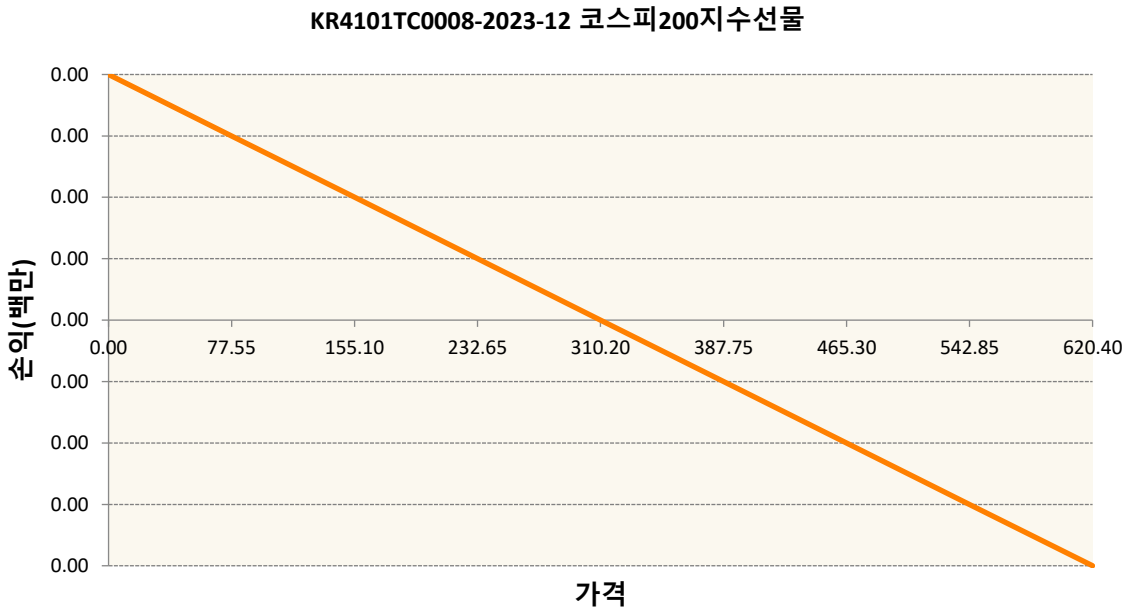
에퀴티알파일반사모혼합자산

1. 계약금액

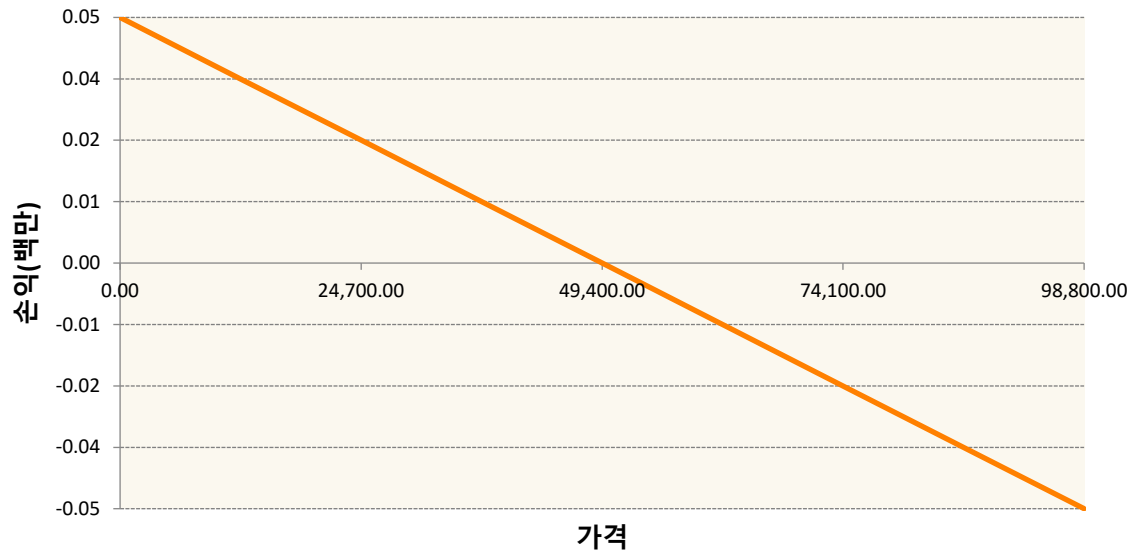
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	52	0	52	장내
누계	유가증권	선물	0	2,789	-2,789	장내

2. 만기시점의 손익구조



KR41CNTB0009-2023-11 포스코DX개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101TC00 2023-12 코스피200지수선물
 KR4124TB00 2023-11 LG전자개별선물
 KR41CNTB00 2023-11 포스코DX개별선물

211
8
4

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

(단위:백만원)

229

공시일	2023-10-31
기준일	2023-10-30

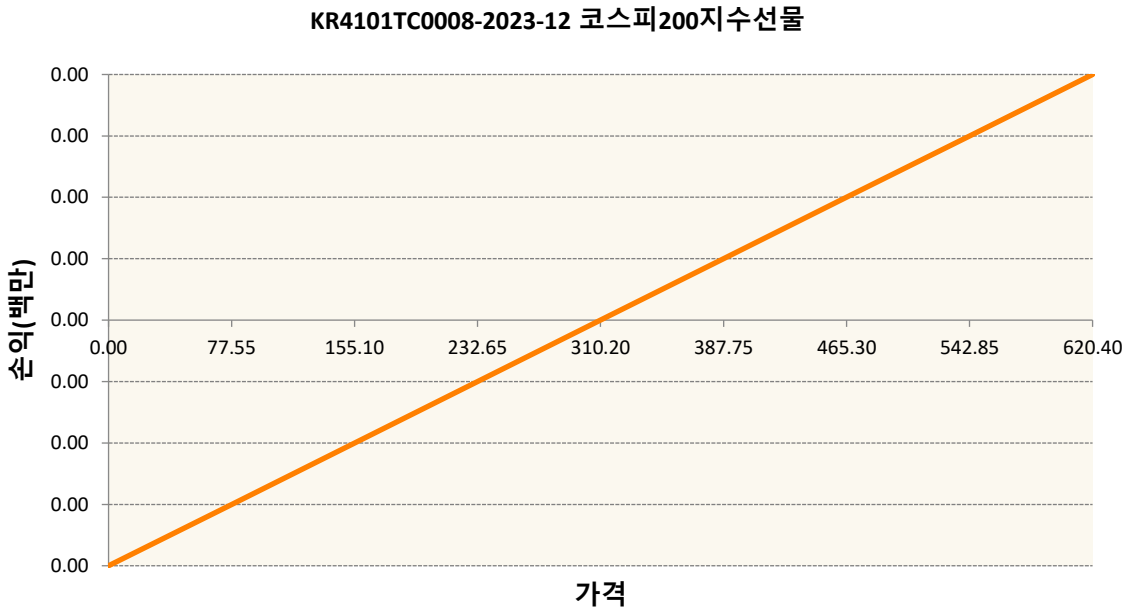
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	5,041	-5,041	장내
누계	유가증권	선물	4,420	0	4,420	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101TC0008			2023-12 코스피200지수선물				352
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-352	-352	-352	-352	-352	-352	-352
-5.33%	-235	-235	-235	-235	-235	-235	-235
-2.67%	-117	-117	-117	-117	-117	-117	-117
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	117	117	117	117	117	117	117
5.33%	235	235	235	235	235	235	235
8.00%	352	352	352	352	352	352	352

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

(단위:백만원)

324

공시일	2023-10-31
기준일	2023-10-30

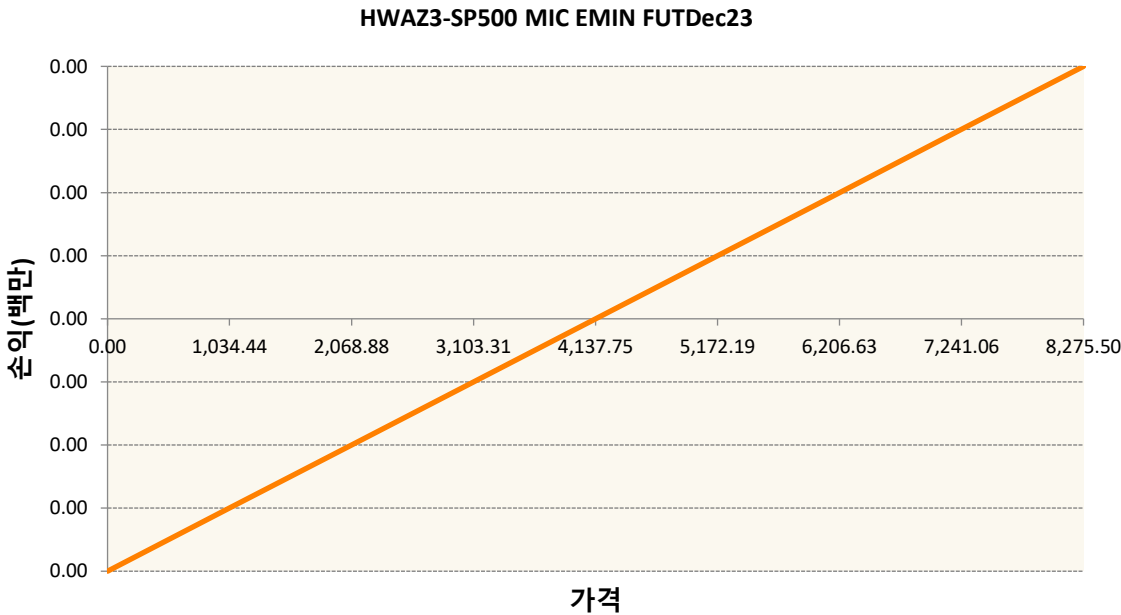
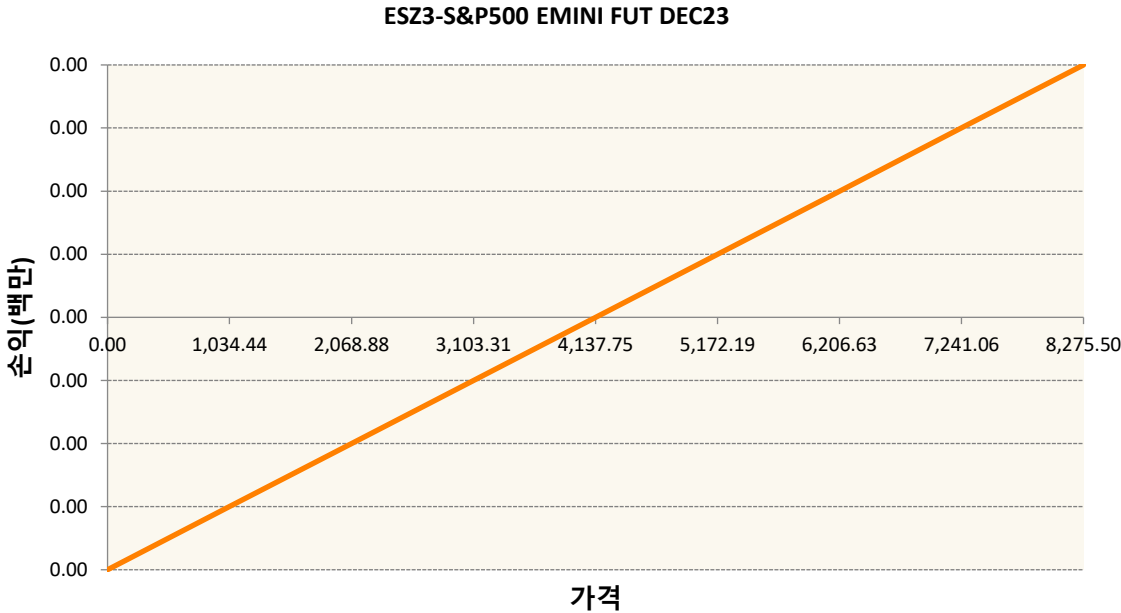
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	280	0	280	
누계	유가증권	선물	1,686	0	1,686	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESZ3	S&P500 EMINI FUT DEC23	22
HWAZ3	SP500 MIC EMIN FUTDec23	135

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	144

공시일	2023-10-31
기준일	2023-10-30

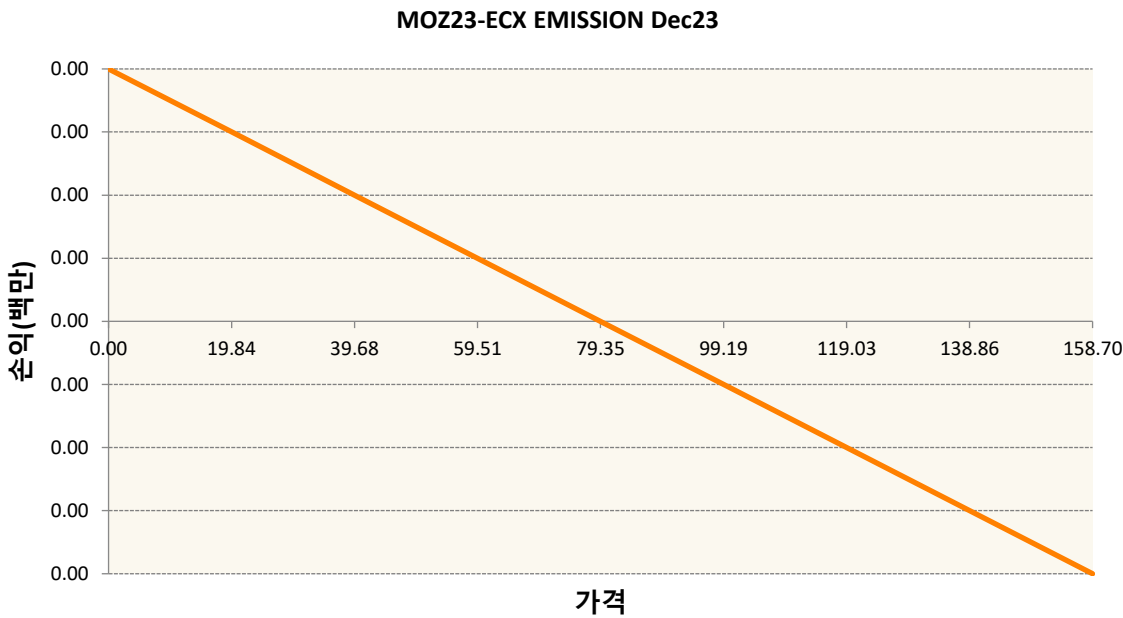
SOL유럽탄소배출권선물인버스ICE특별자산상

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	9,709	-9,709	
누계	지수	스왑	479	0	479	장외
누계	통화	선도	0	4,020	-4,020	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213D9R KRW/EUR 31-10-23E	142
FXW213DAT KRW/EUR 30-11-23E	49
FXW213DAT KRW/EUR 30-11-23E	130
MOZ23 ECX EMISSION Dec23	777
SWICEUACN ICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX	2

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

(단위:백만원)

1,639

공시일	2023-10-31
기준일	2023-10-30

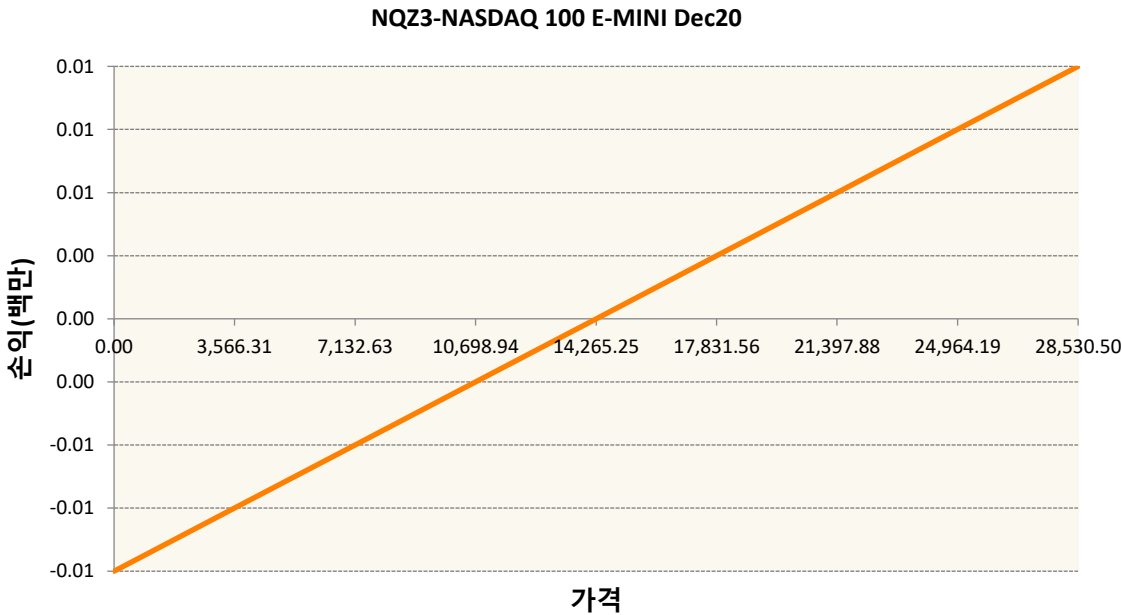
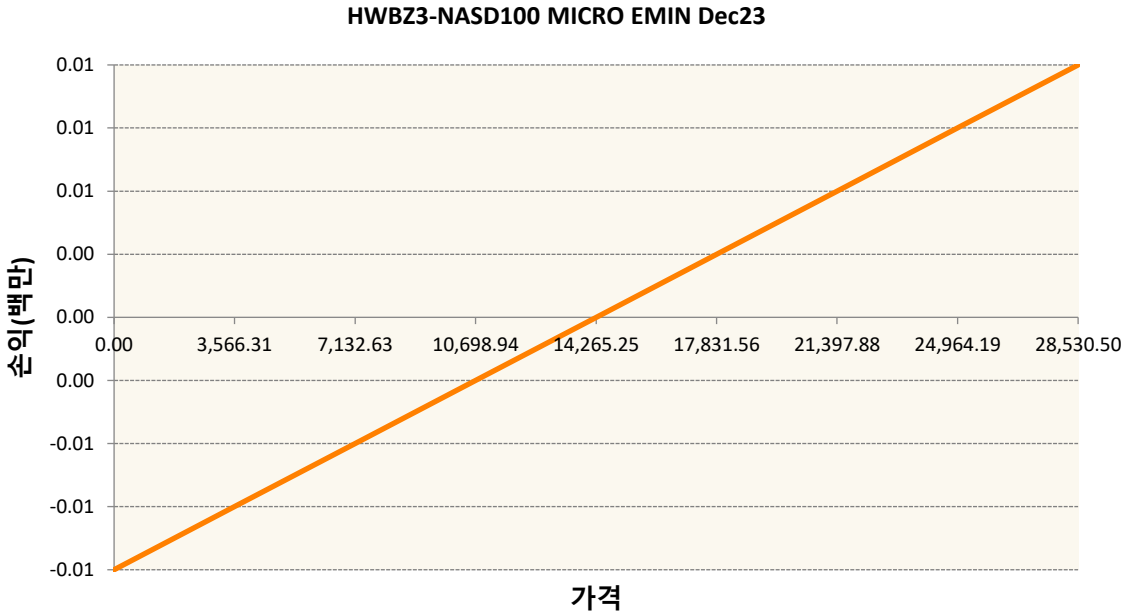
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	386	0	386	
누계	유가증권	선물	1,675	0	1,675	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HWBZ3	NASD100 MICRO EMIN Dec23	134
NQZ3	NASDAQ 100 E-MINI Dec20	31

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	161

공시일	2023-10-31
기준일	2023-10-30

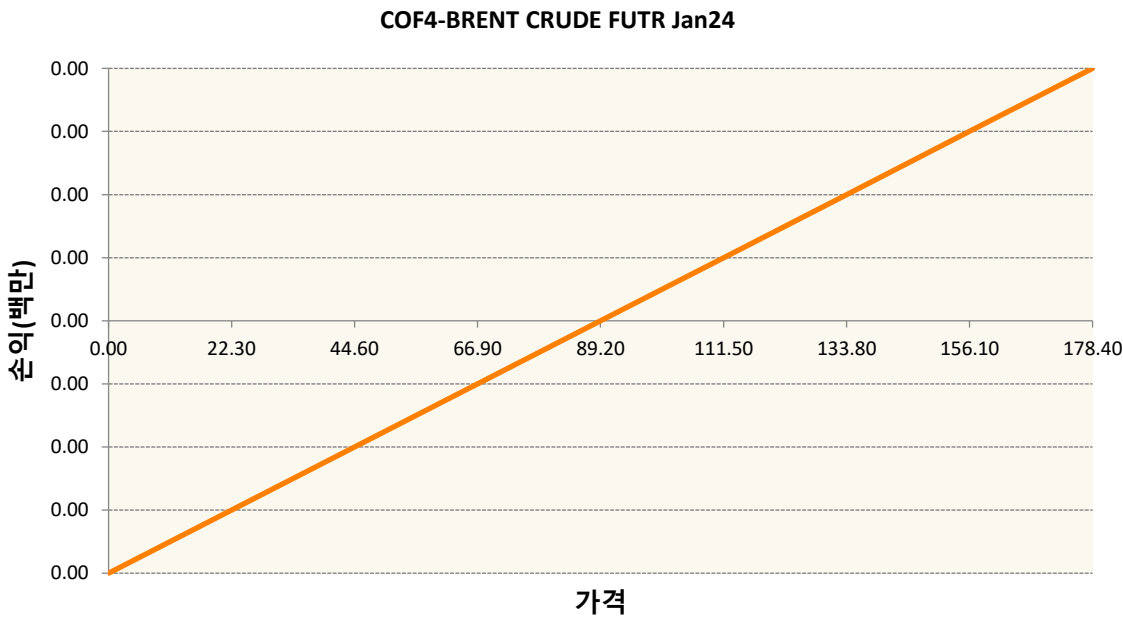
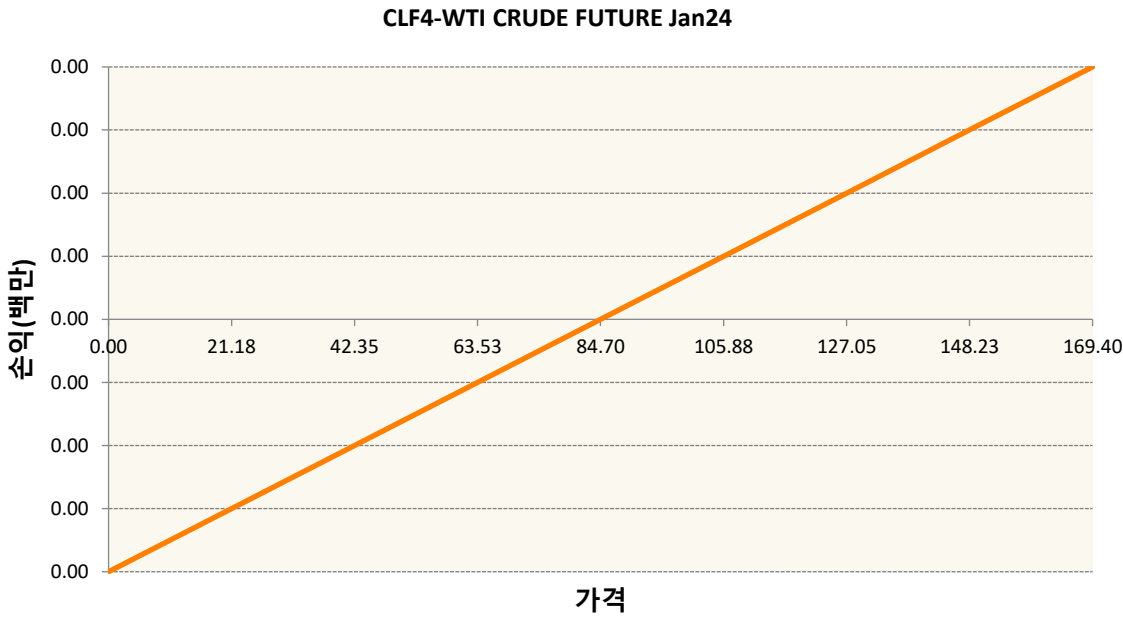
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

1. 계약금액

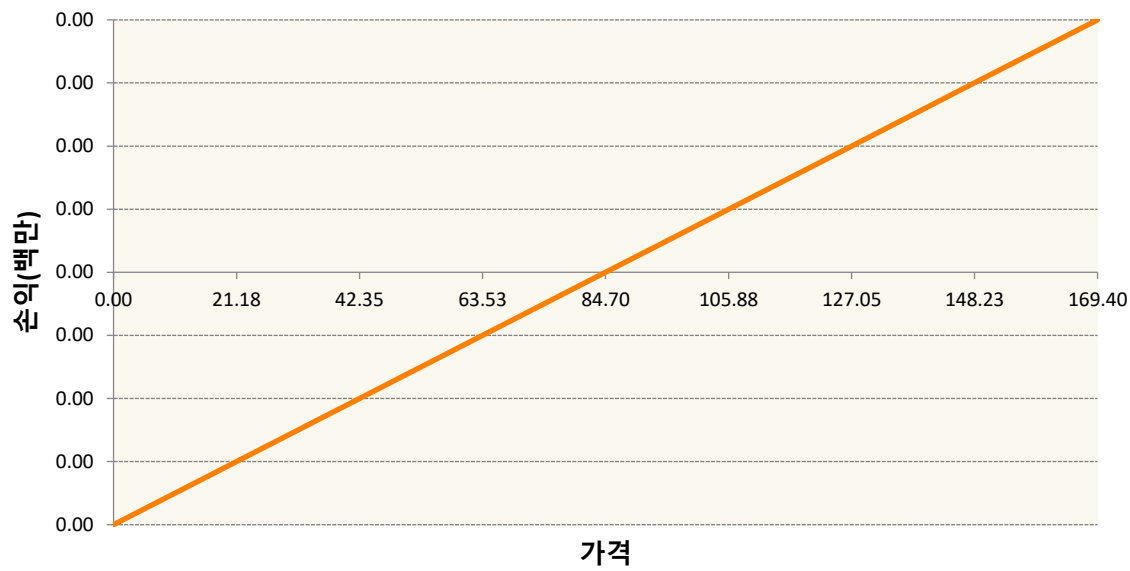
(단위:백만원)

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	1,493	0	1,493	
누계	통화	선물	0	203	-203	장내

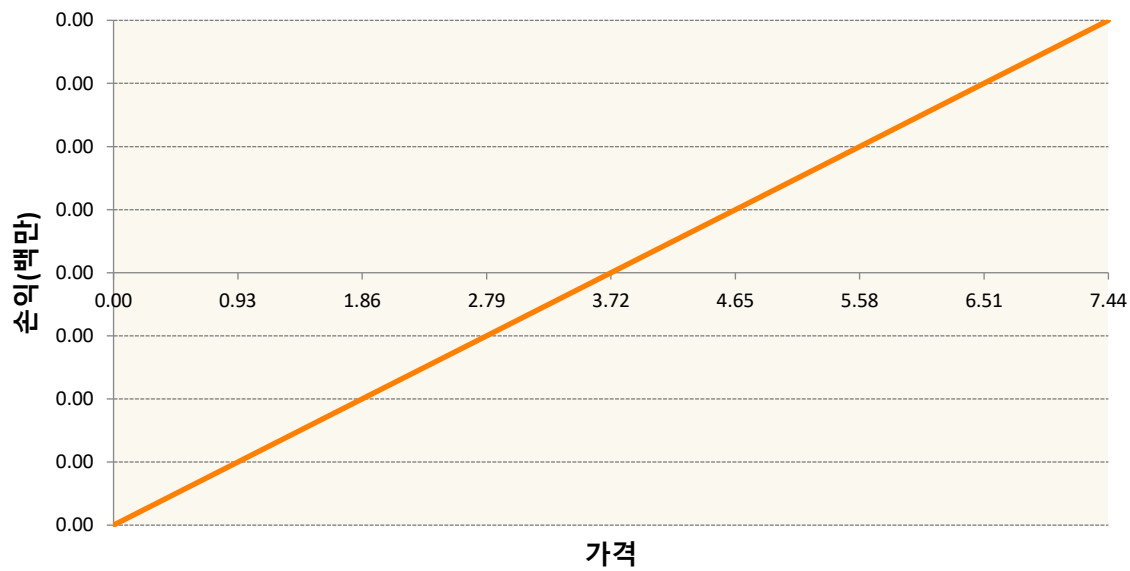
2. 만기시점의 손익구조



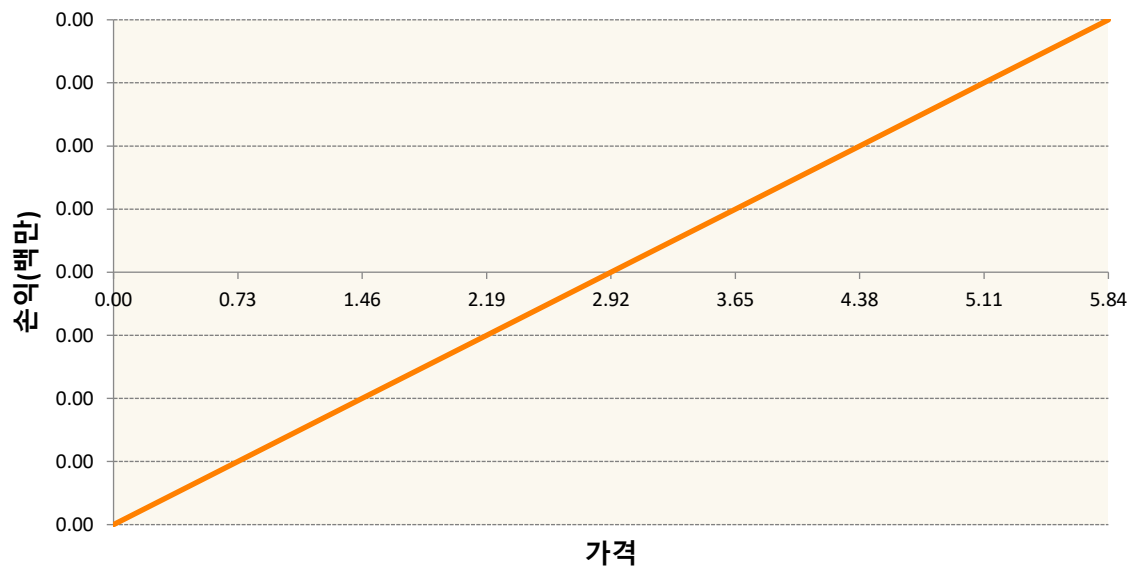
ECF4-E-MINI CRUDE OIL Jan24



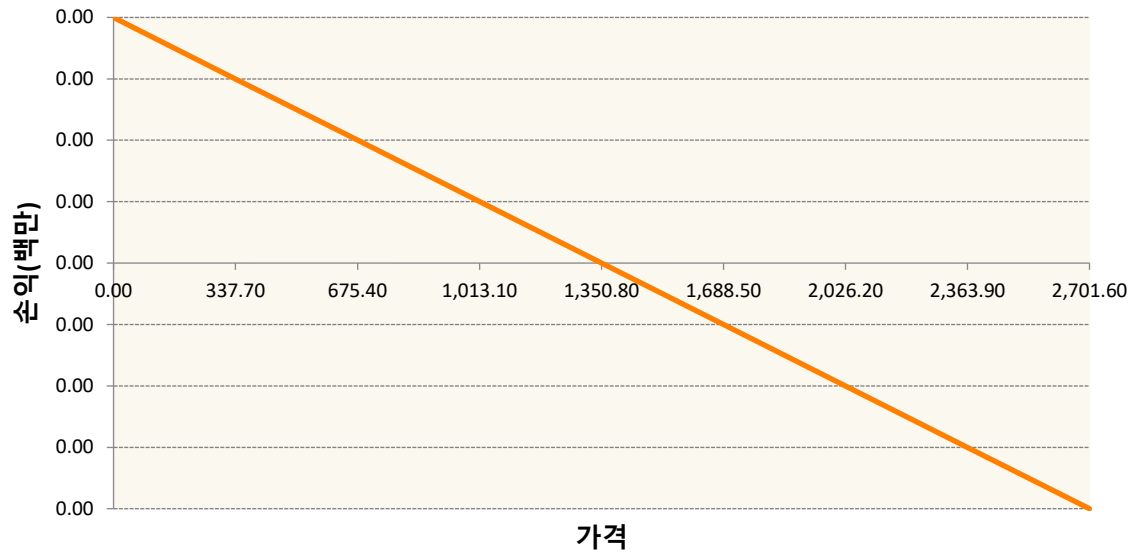
EOF4-E-MINI NATURAL GAS Jan24



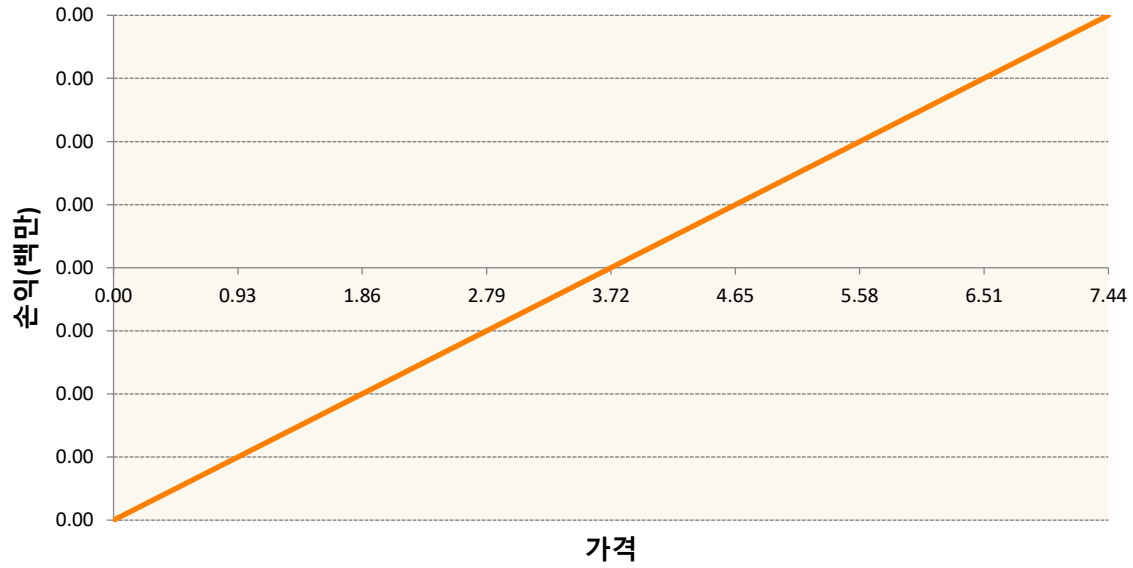
HOF4-NY Harb ULSD Fut Jan24



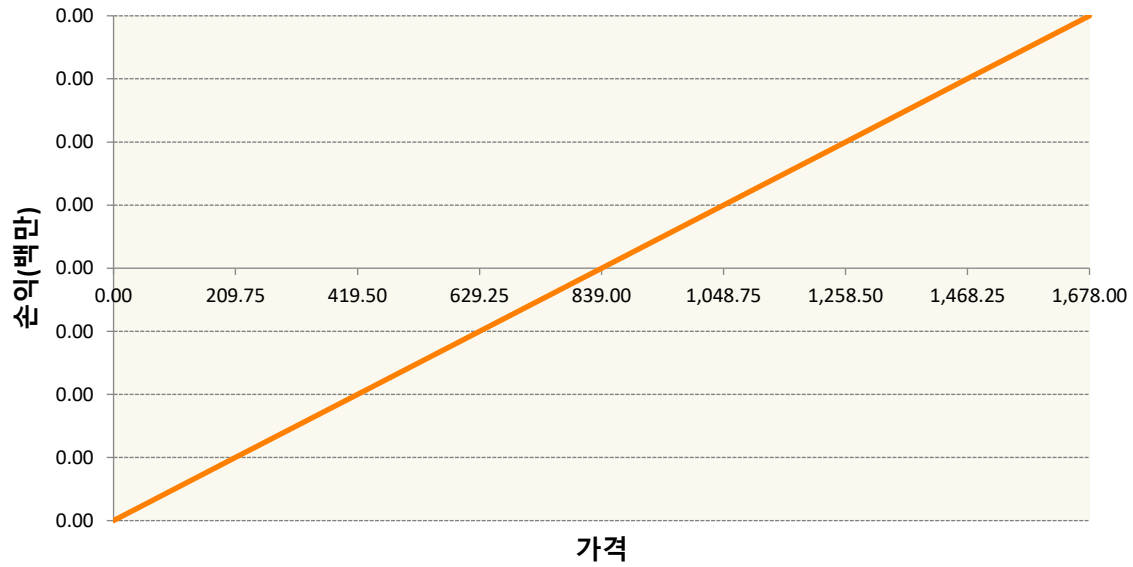
KR4175TB0000-2023-11 달러선물

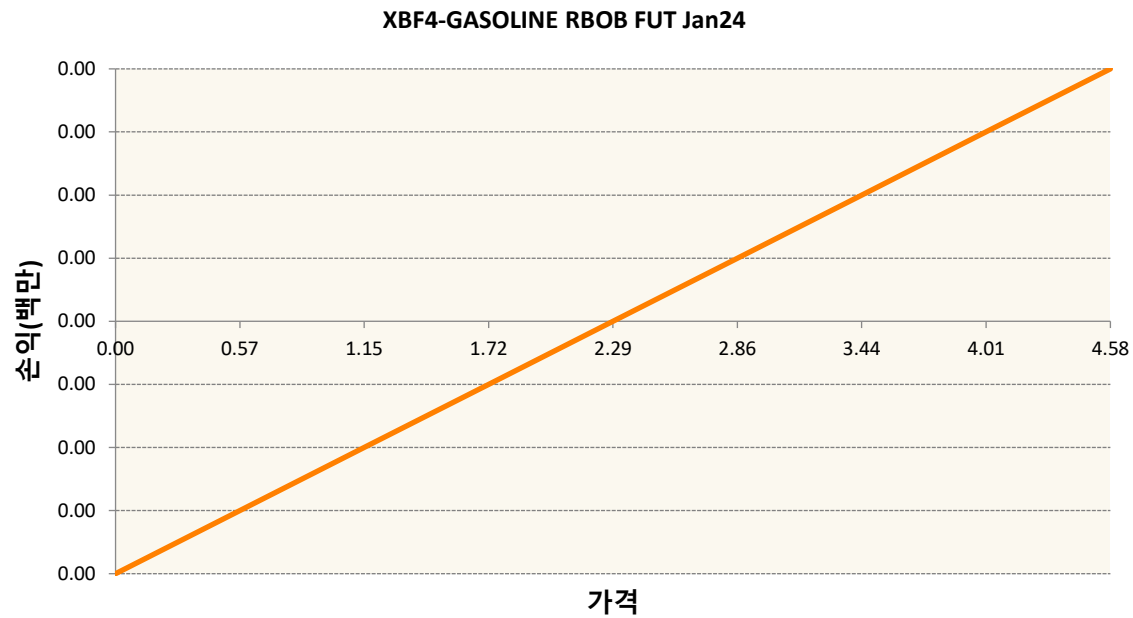


NGF24-NATURAL GAS FUTR Jan24



QSF4-Low Su Gasoil G Jan24





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
CLF4	WTI CRUDE FUTURE Jan24	27
COF4	BRENT CRUDE FUTR Jan24	28
ECF4	E-MINI CRUDE OIL Jan24	5
EOF4	E-MINI NATURAL GAS Jan24	3
HOF4	NY Harb ULSD Fut Jan24	13
KR4175TB00 2023-11 달러선물		16
NGF24	NATURAL GAS FUTR Jan24	24
QSF4	Low Su Gasoil G Jan24	9
XBF4	GASOLINE RBOB FUT Jan24	10

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	305