

공시일	2023-11-09
기준일	2023-11-08

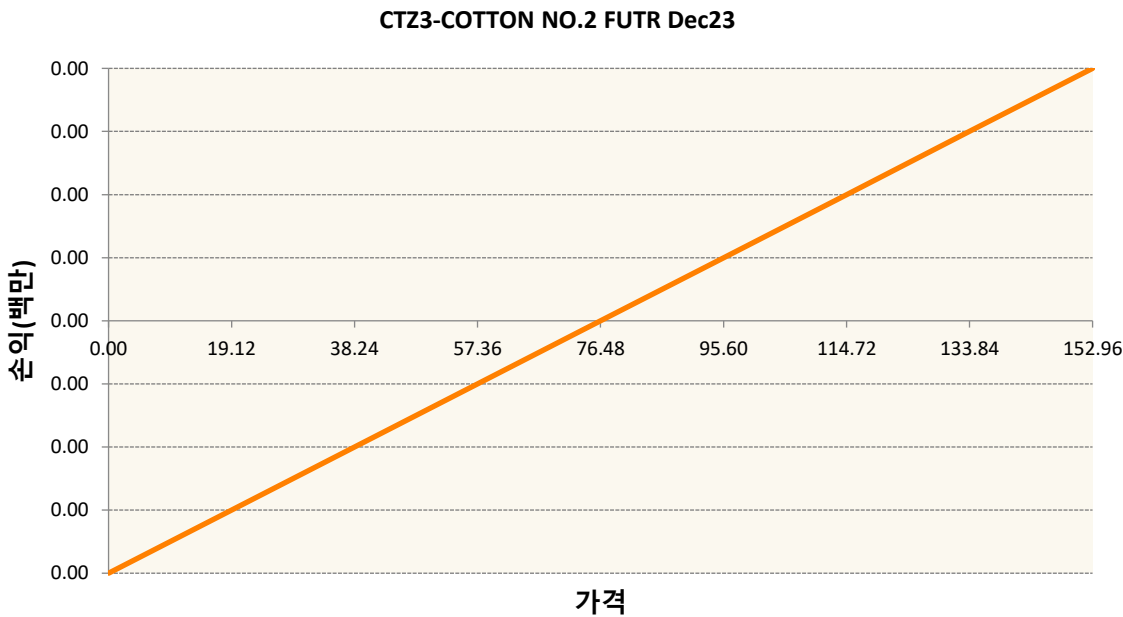
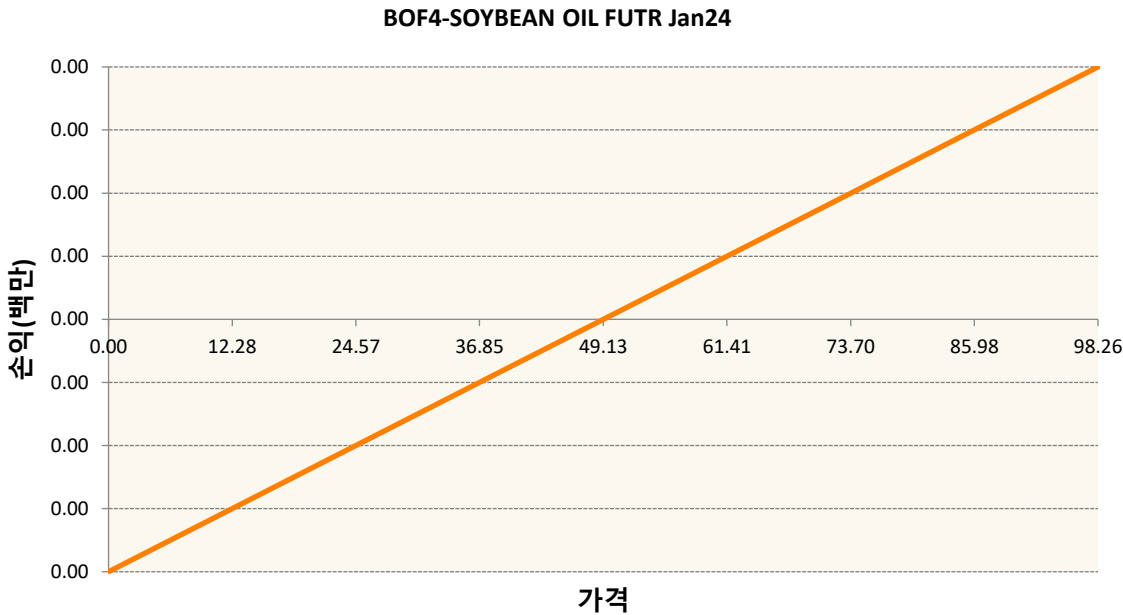
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

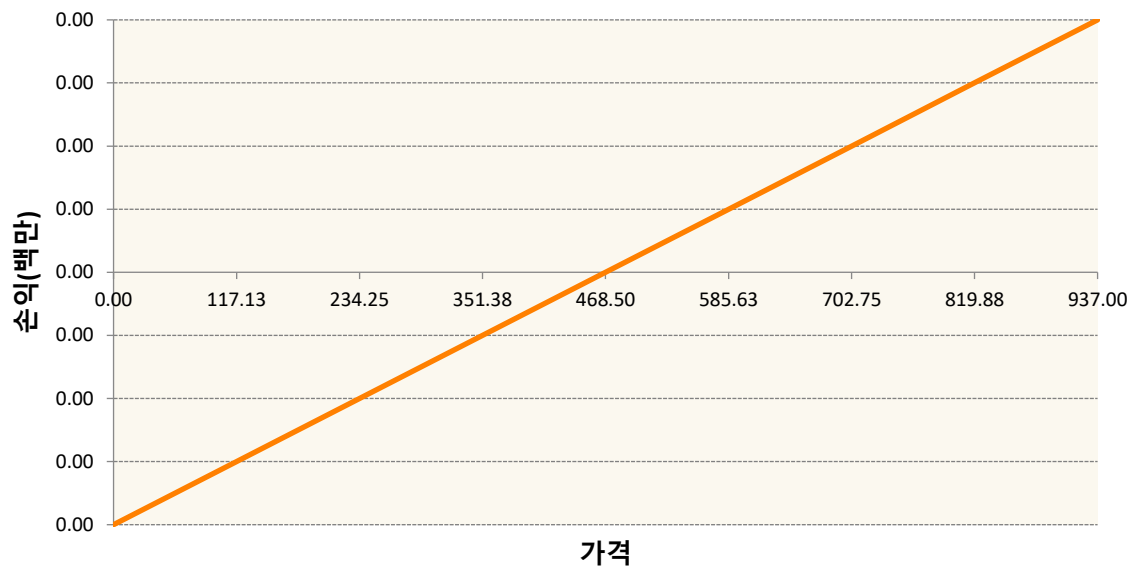
(단위:USD 백만)

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	4,988	0	4,988	
누계	통화	선물	0	576	-576	장내

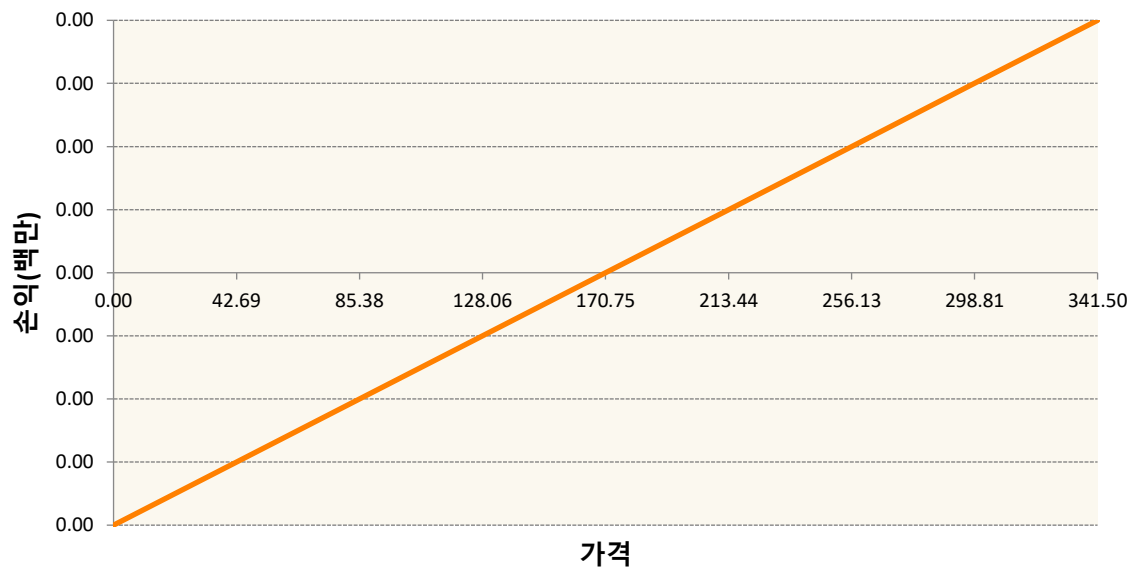
2. 만기시점의 손익구조



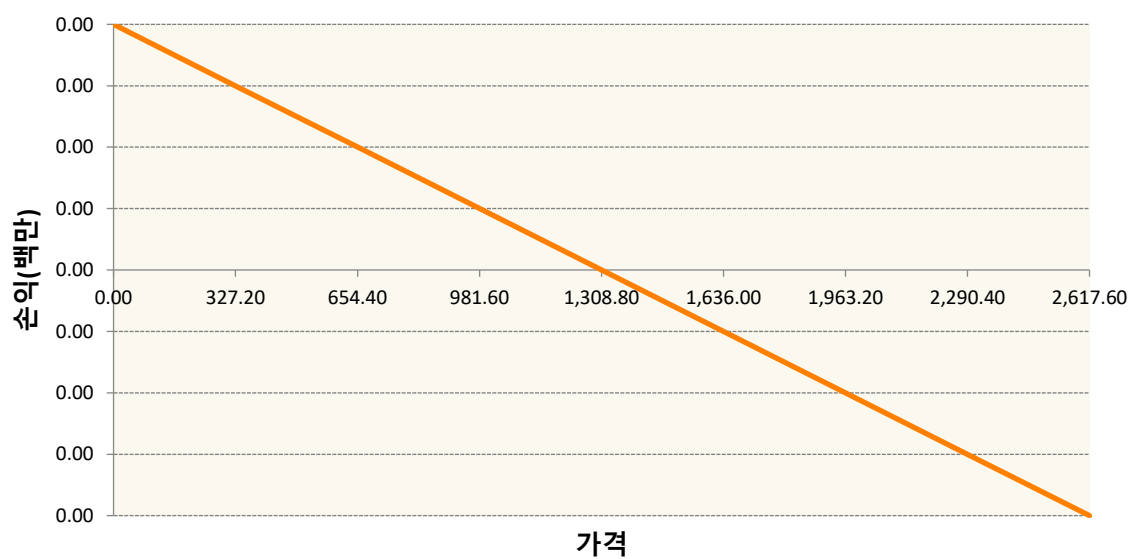
CZ3-CORN FUTURE Dec23



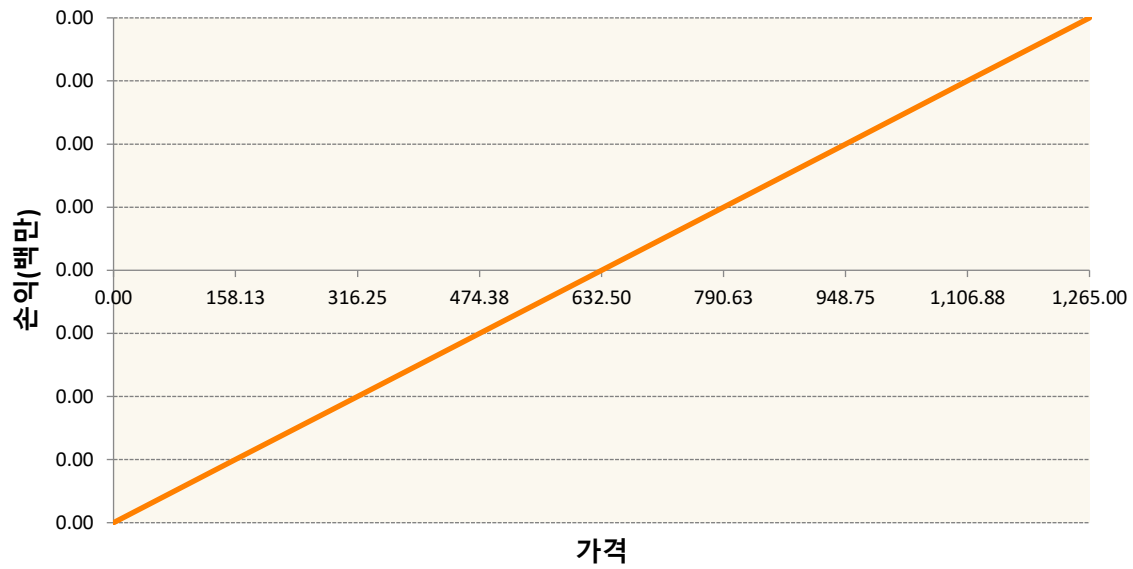
KCZ3-COFFEE 'C' FUTURE DEC23



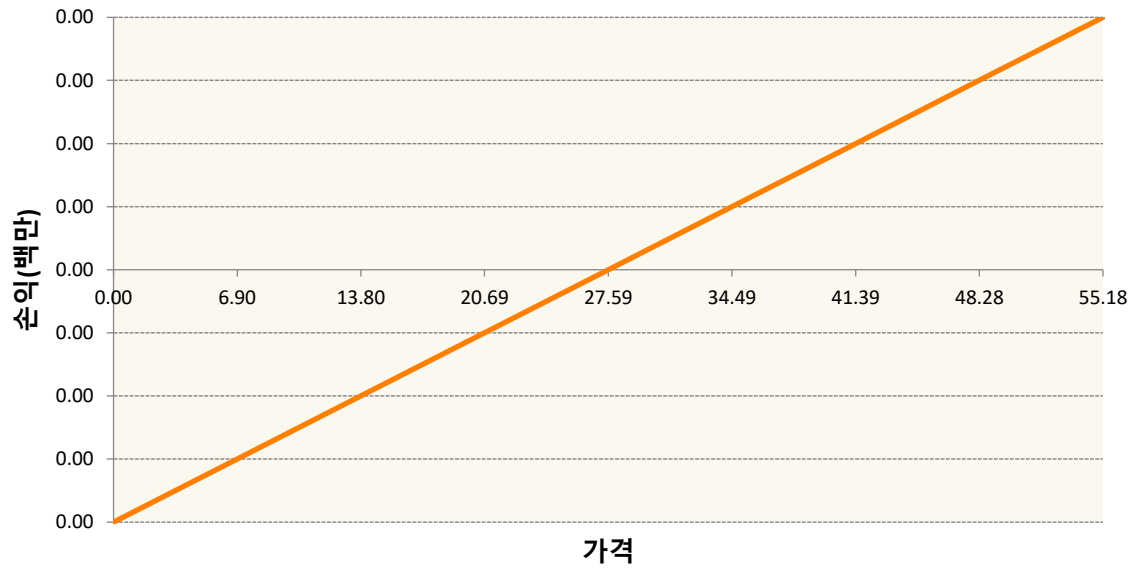
KR4175TB0000-2023-11 달러선물



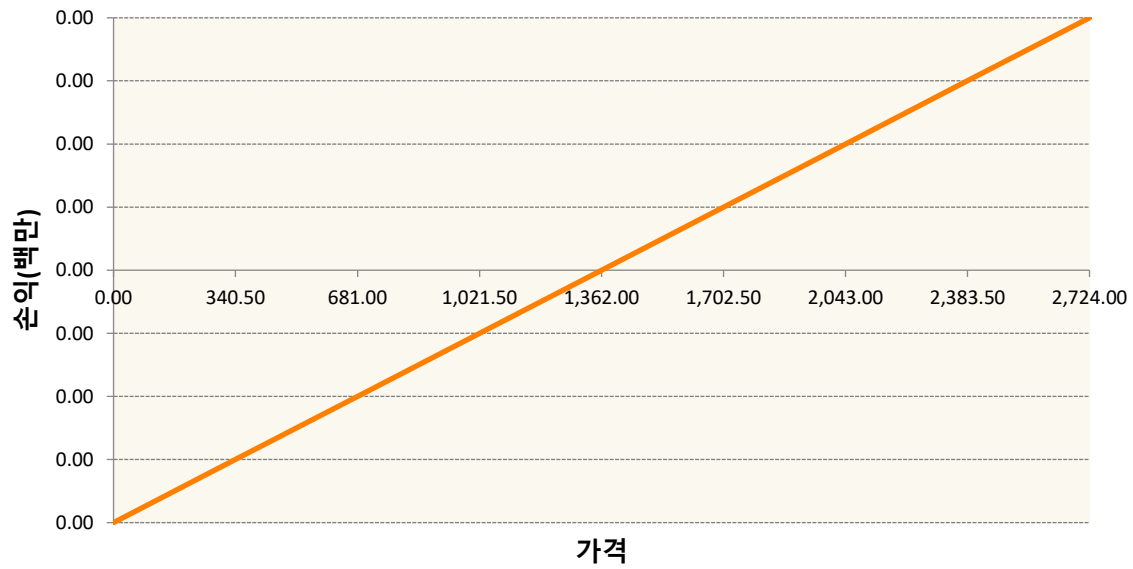
KWZ3-KC HRW WHEAT FUT DEC23



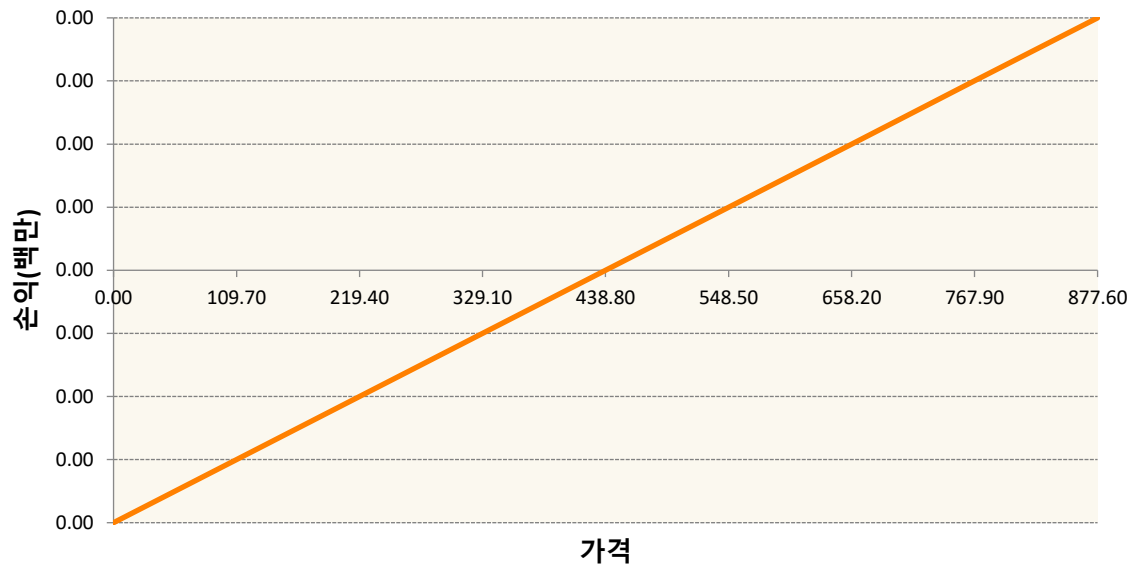
SBH4-Sugar #11 (WORLD) Mar24



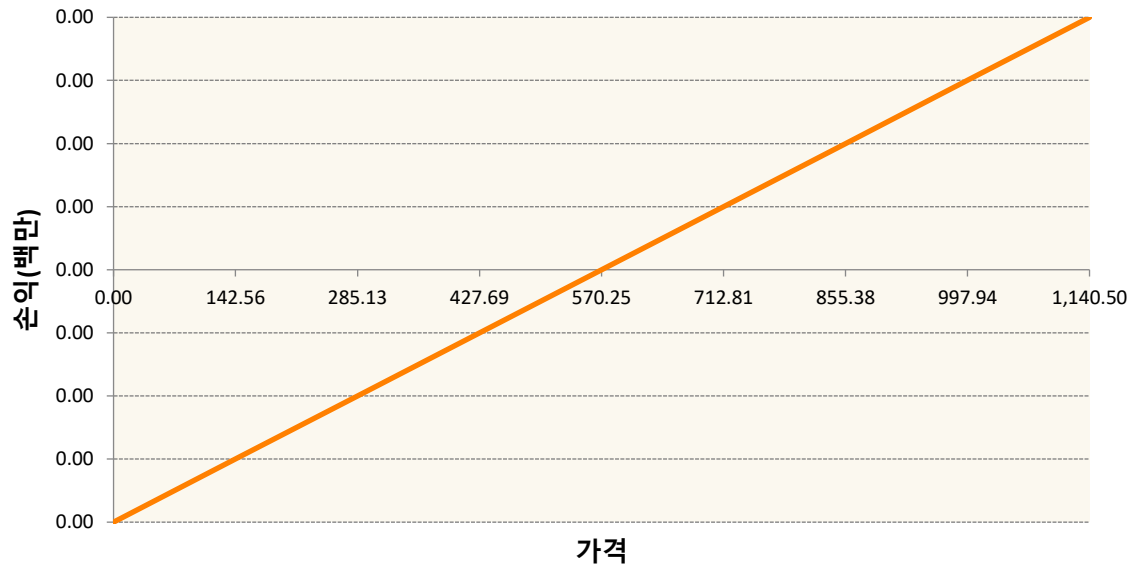
SF4-SOYBEAN FUTURE Jan24



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	2023-11-09
기준일	2023-11-08

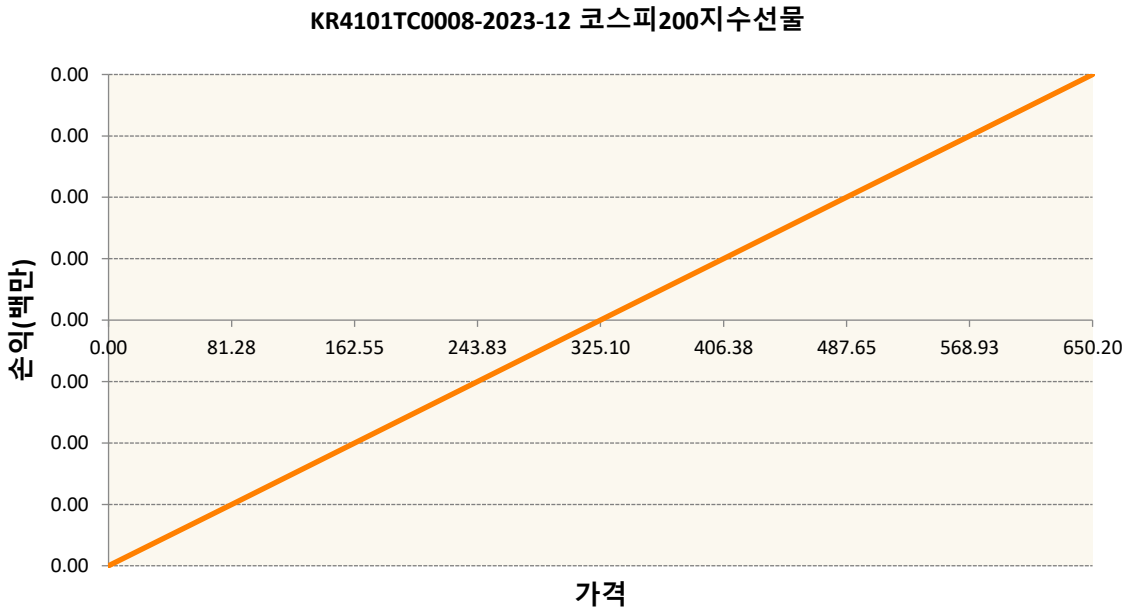
스마트인덱스모

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	163	-163	장내
누계	유가증권	선물	1,300	0	1,300	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101TC0008			2023-12 코스피200지수선물				104
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-104	-104	-104	-104	-104	-104	-104
-5.33%	-69	-69	-69	-69	-69	-69	-69
-2.67%	-35	-35	-35	-35	-35	-35	-35
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	35	35	35	35	35	35	35
5.33%	69	69	69	69	69	69	69
8.00%	104	104	104	104	104	104	104

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

(단위:백만원)

100

공시일	2023-11-09
기준일	2023-11-08

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	313
-----------------------------	-----

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

285

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2023-11-09
기준일	2023-11-08

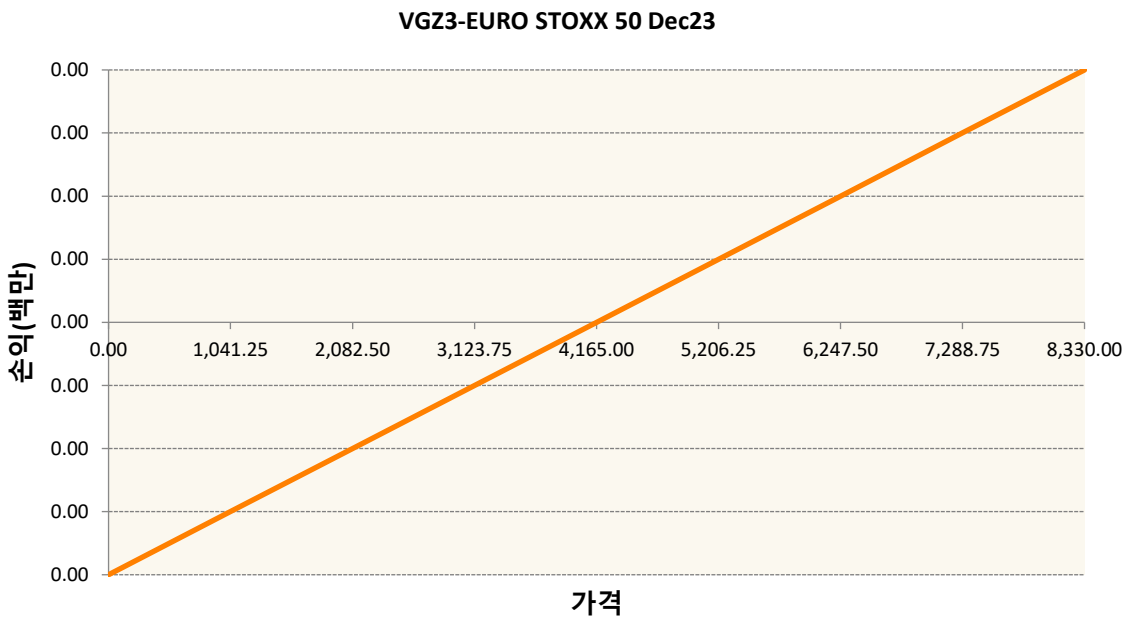
유로인덱스모(주식-파생형)

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	948	0	948	
누계	통화	선도	210	0	210	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213D9M EUR/KRW 22-12-23E	17
VGZ3 EURO STOXX 50 Dec23	76

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

(단위:백만원)

74

공시일	2023-11-09
기준일	2023-11-08

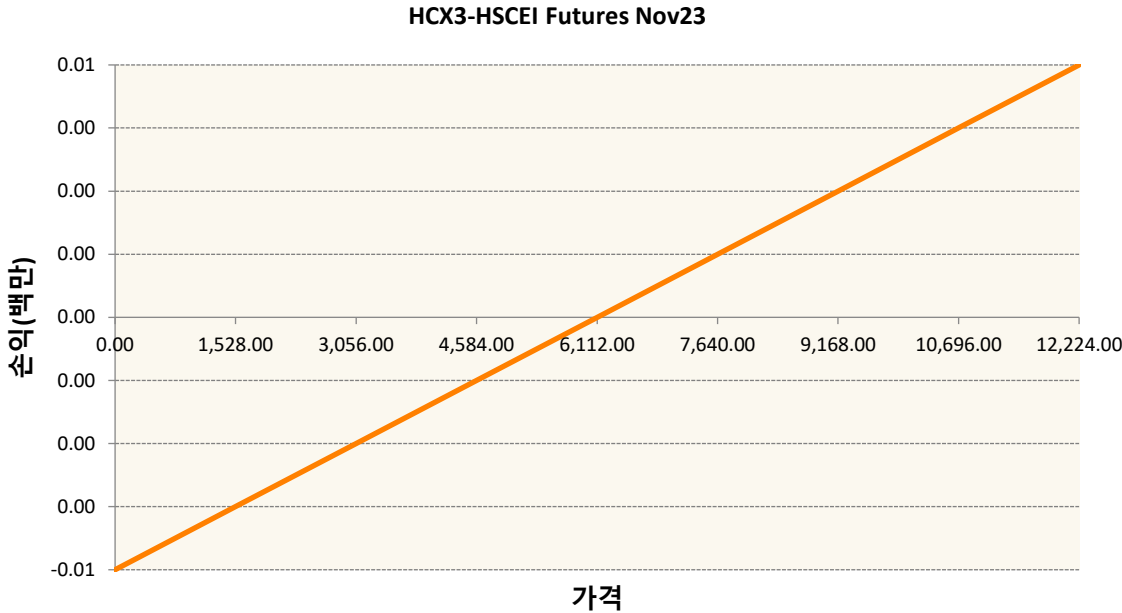
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,315	0	1,315	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HGX3	HSCEI Futures Nov23	105
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

154

공시일	2023-11-09
기준일	2023-11-08

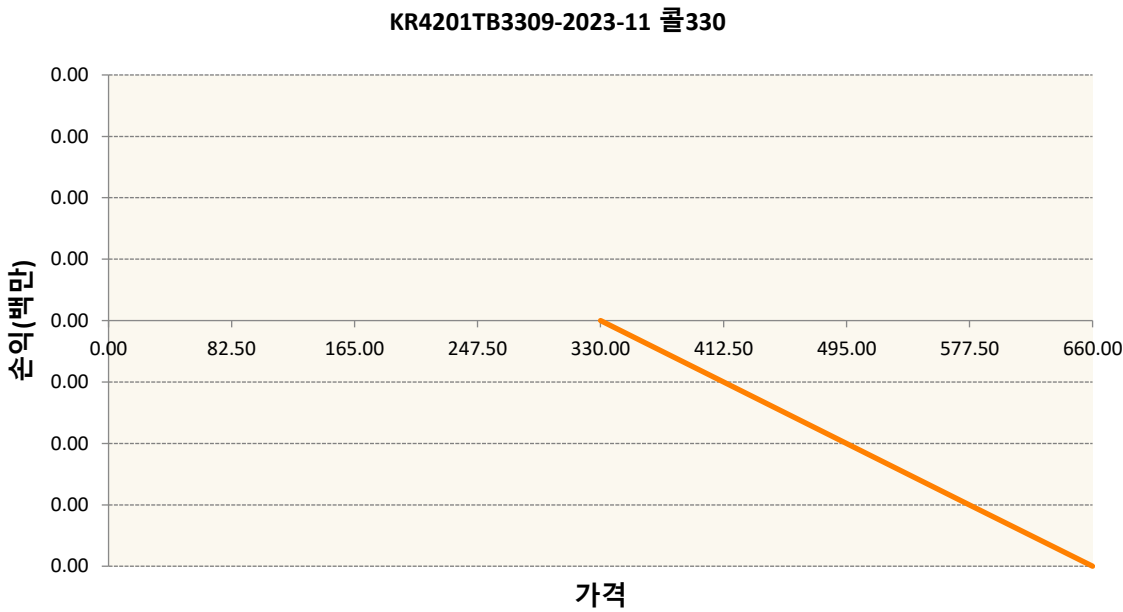
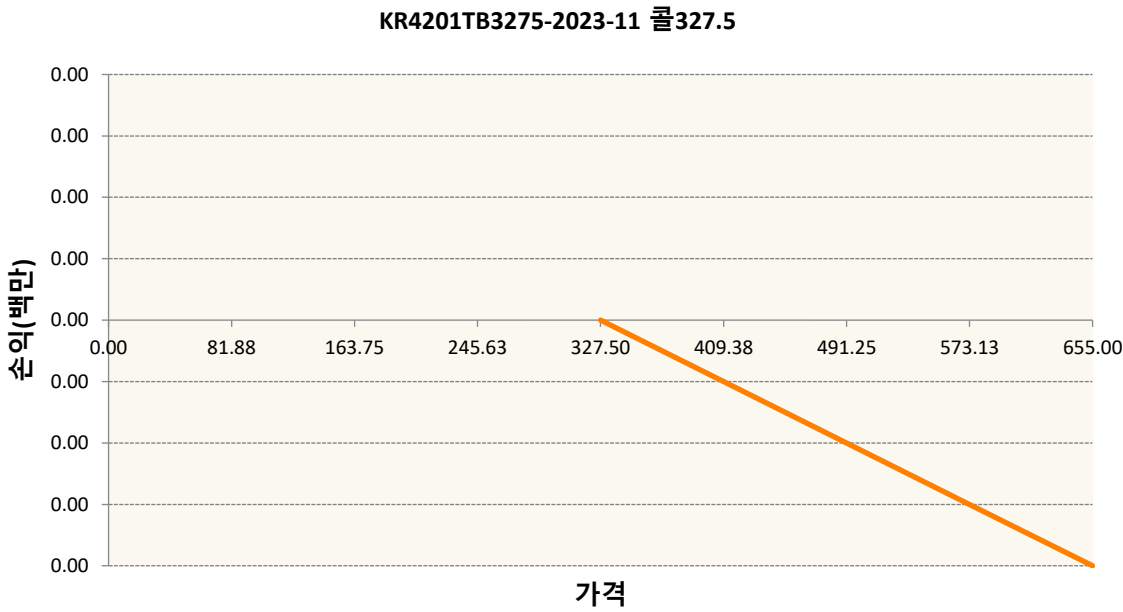
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

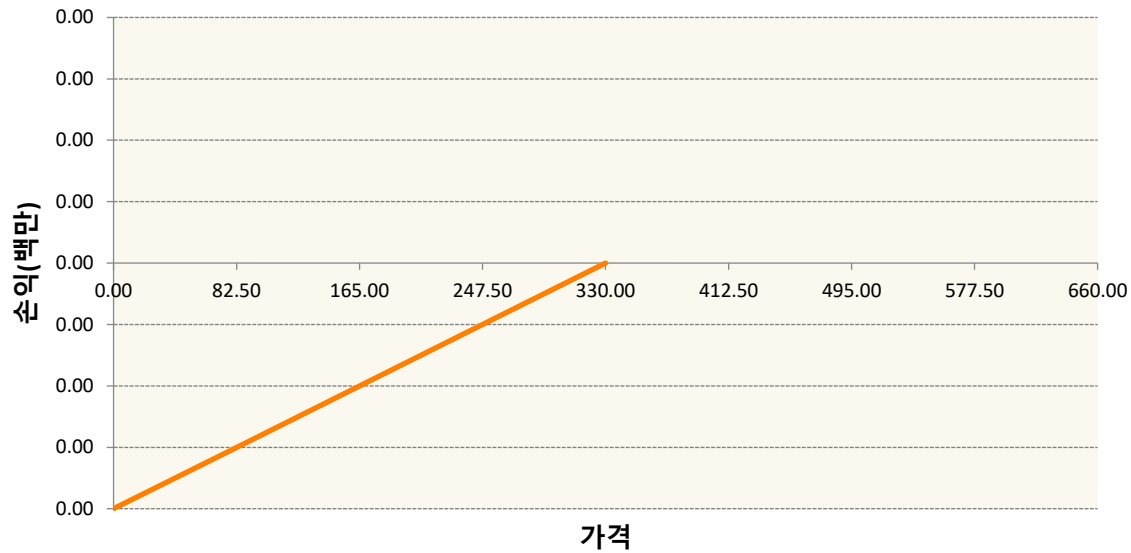
(단위:백만원)

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						1,647
		기초자산의 변동성						
가격		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	36	36	36	36	36	36	36	36
-5.33%	36	36	36	36	36	36	36	36
-2.67%	36	36	36	36	36	35	35	35
0%	20	14	7	0	-8	-16	-24	-24
2.67%	-356	-359	-364	-368	-374	-380	-386	-386
5.33%	-999	-999	-999	-999	-999	-999	-999	-999
8.00%	-1,647	-1,647	-1,647	-1,647	-1,647	-1,647	-1,647	-1,647
KR4201TB3309		2023-11 콜330						1,128
		기초자산의 변동성						
가격		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	8	8	8	8	8	8	8	8
-5.33%	8	8	8	8	8	8	8	8
-2.67%	8	8	8	8	8	8	8	8
0%	6	5	3	0	-3	-7	-11	-11
2.67%	-164	-170	-176	-183	-189	-196	-203	-203
5.33%	-635	-635	-636	-636	-636	-637	-637	-637
8.00%	-1,128	-1,128	-1,128	-1,128	-1,128	-1,128	-1,128	-1,128
KR4301TB3308		2023-11 풋330						734
		기초자산의 변동성						
가격		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-734	-734	-734	-734	-734	-734	-734	-734
-5.33%	-488	-488	-488	-488	-488	-488	-488	-488
-2.67%	-242	-242	-242	-242	-242	-242	-242	-242
0%	3	2	1	0	-2	-3	-5	-5

2.67%	164	161	158	155	152	148	145
5.33%	175	175	175	175	174	174	174
8.00%	175	175	175	175	175	175	175

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

(단위:백만원)

4,162

공시일	2023-11-09
기준일	2023-11-08

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	1,949	0	1,949	

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	2023-11-09
기준일	2023-11-08

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	4,495	0	4,495	

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	2023-11-09
기준일	2023-11-08

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	16,984	0	16,984	
누계	통화	선도	0	16,743	-16,743	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213D8W KRW/USD 30-11-23E	597
FXW213D9R KRW/USD 29-12-23E	509
FXW213DAT KRW/USD 31-01-24E	187
FXW213DB7 KRW/USD 30-11-23E	47
IE00BD8RGM75	

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

752

공시일	2023-11-09
기준일	2023-11-08

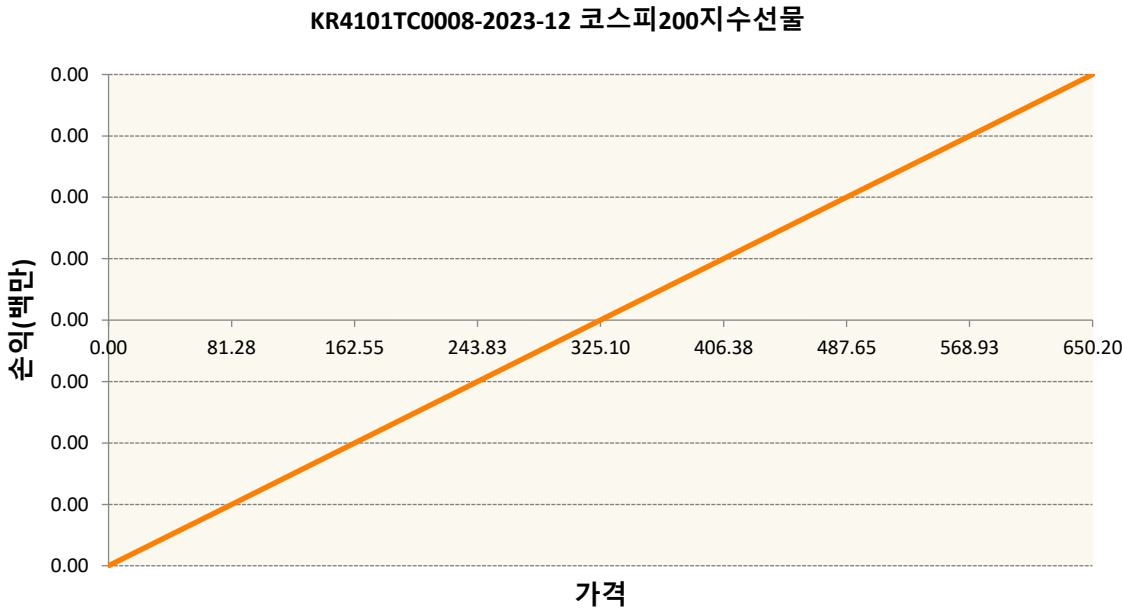
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	81	-81	장내
누계	유가증권	선물	569	0	569	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101TC0008			2023-12 코스피200지수선물				45
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-45	-45	-45	-45	-45	-45	-45
-5.33%	-30	-30	-30	-30	-30	-30	-30
-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%	30	30	30	30	30	30	30
8.00%	45	45	45	45	45	45	45

공시일	2023-11-09
기준일	2023-11-08

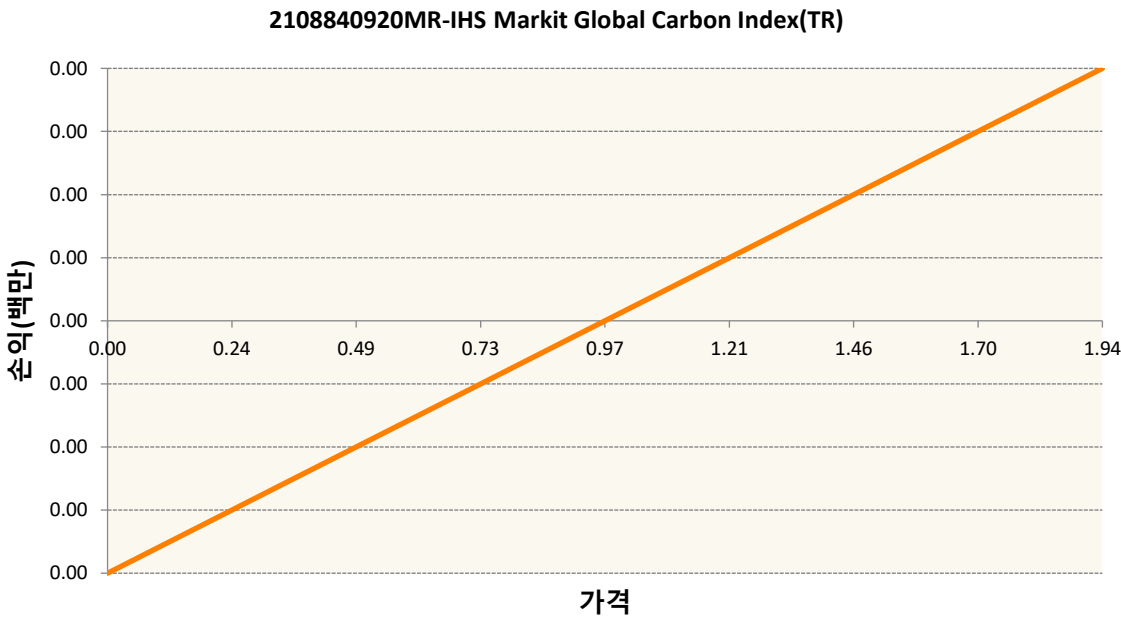
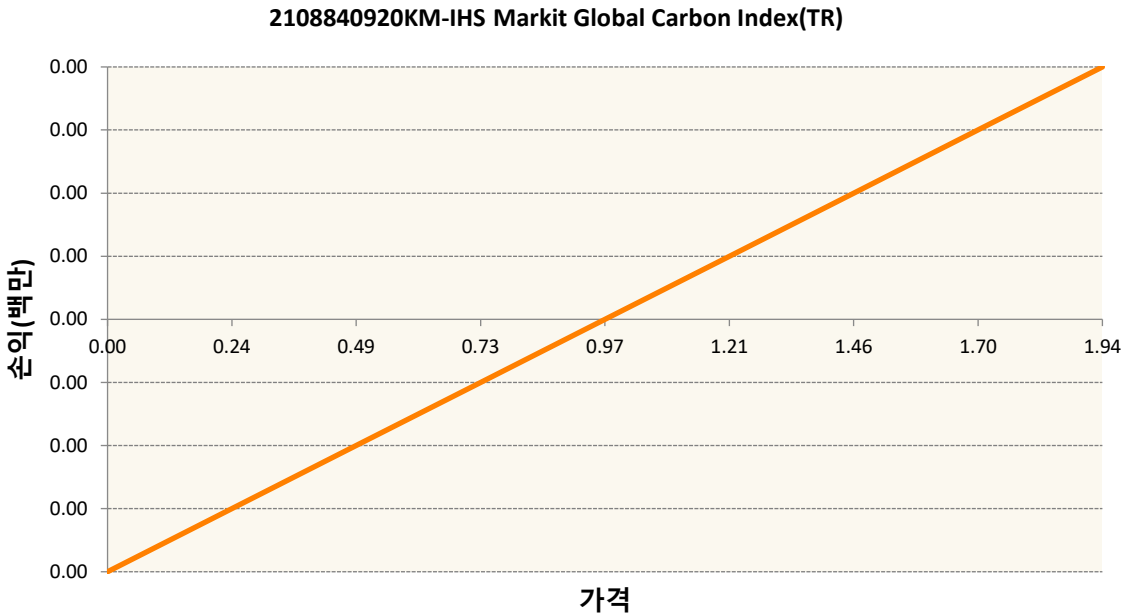
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

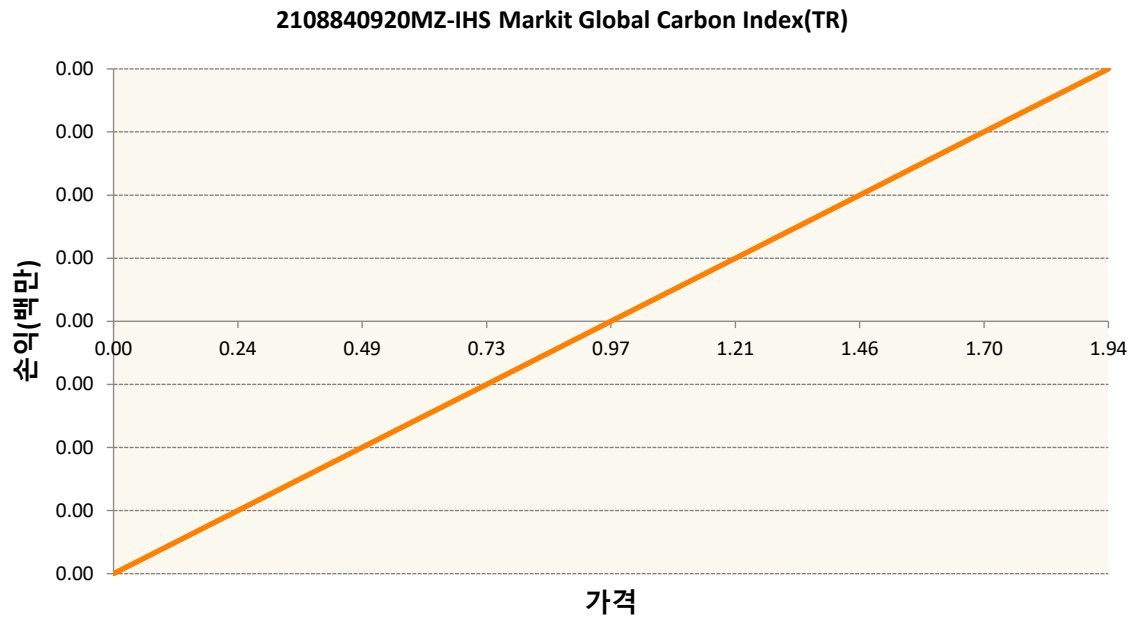
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	17,179	0	17,179	

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108840920IHS Markit Global Carbon Index(TR)		985
2108840920IHS Markit Global Carbon Index(TR)		197
2108840920IHS Markit Global Carbon Index(TR)		197

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)		(단위:백만원)
		1,785

공시일	2023-11-09
기준일	2023-11-08

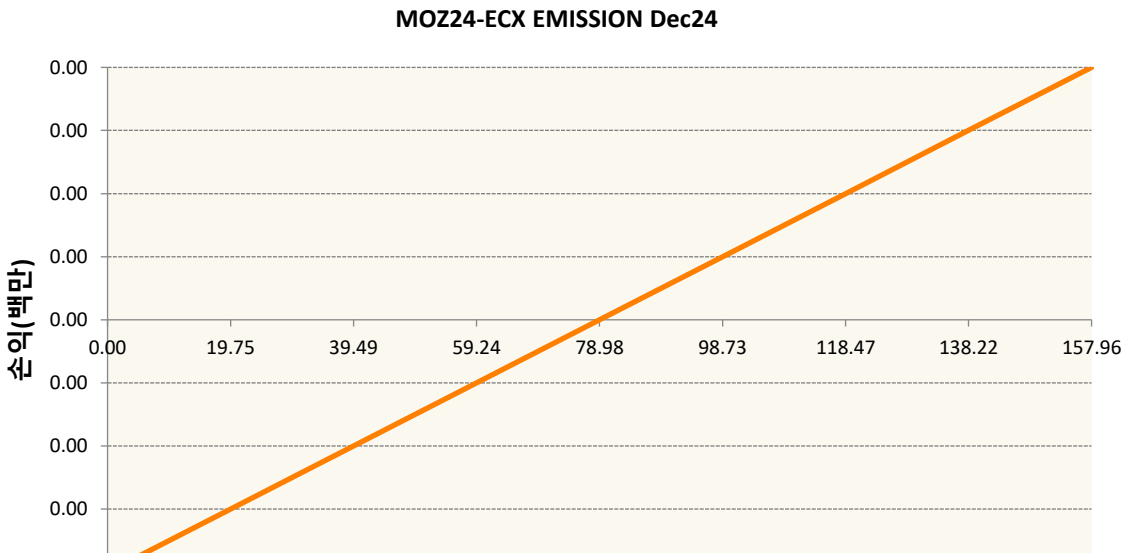
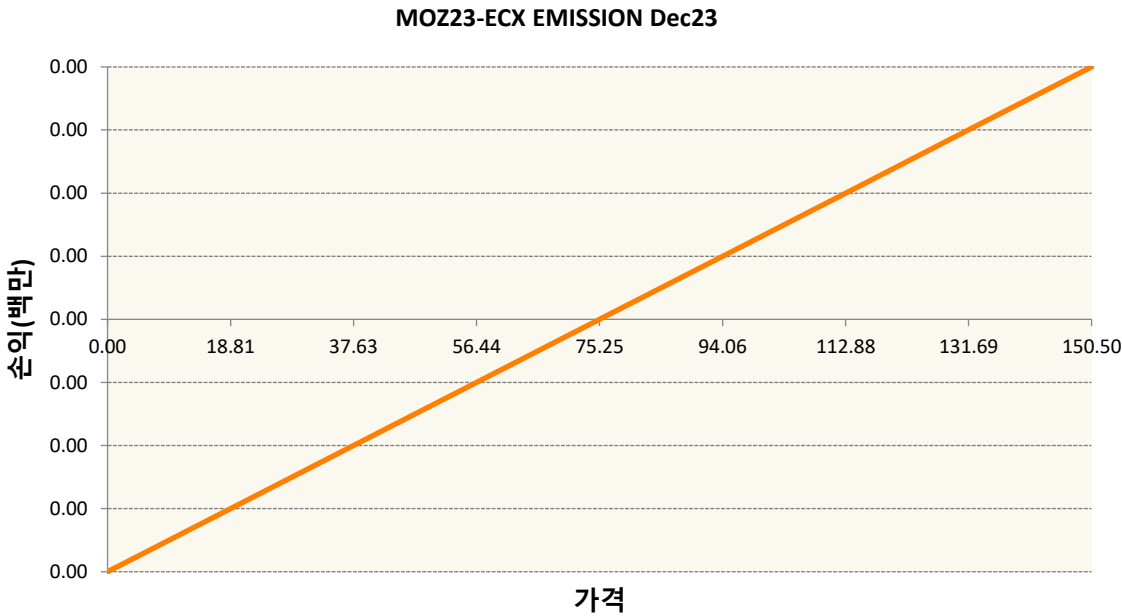
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	8,676	0	8,676	
누계	지수	스왑	479	0	479	장외
누계	통화	선도	0	1,428	-1,428	장외

2. 만기시점의 손익구조



0.00

가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
FXW213DAT KRW/EUR 30-11-23E		114
MOZ23 ECX EMISSION Dec23		561
MOZ24 ECX EMISSION Dec24		133
SWICEUACN ICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX		4

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,338

공시일	2023-11-09
기준일	2023-11-08

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)	8
SWCSI00000 신한CSI Index 230622 (메리츠)	8
SWCSI00000 신한CSI Index 230922 (키움)	5
SWCSI00000 신한CSI Index 231013 (NH)	7

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

(단위:백만원)

44

공시일	2023-11-09
기준일	2023-11-08

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)	2
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 230116(메리츠)	3
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 230116(미래)	2
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 230427(키움)	1

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

(단위:백만원)

8

공시일	2023-11-09
기준일	2023-11-08

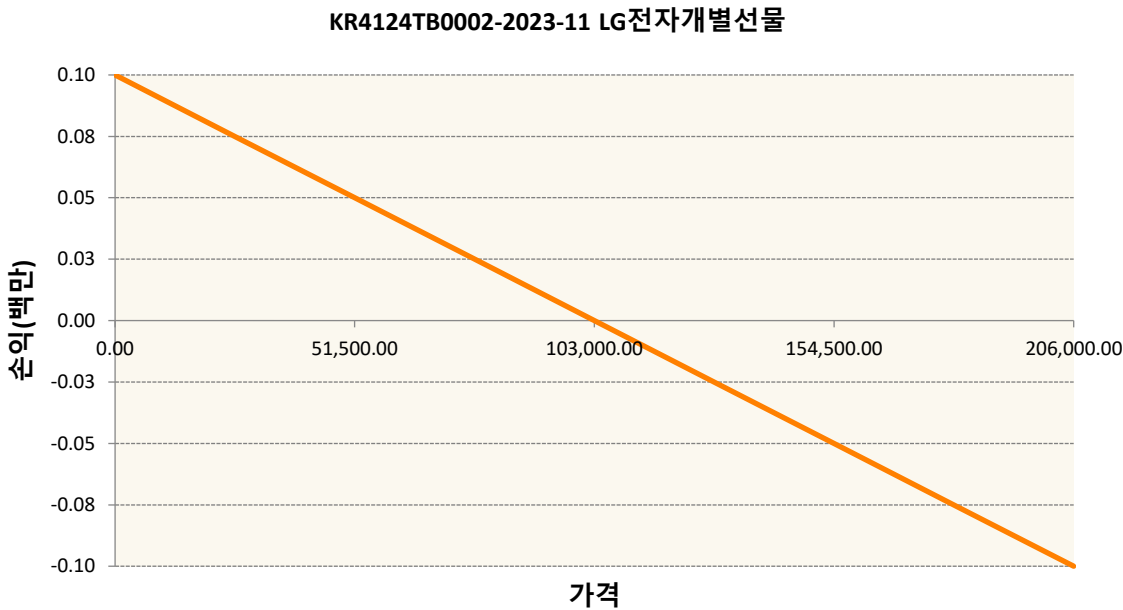
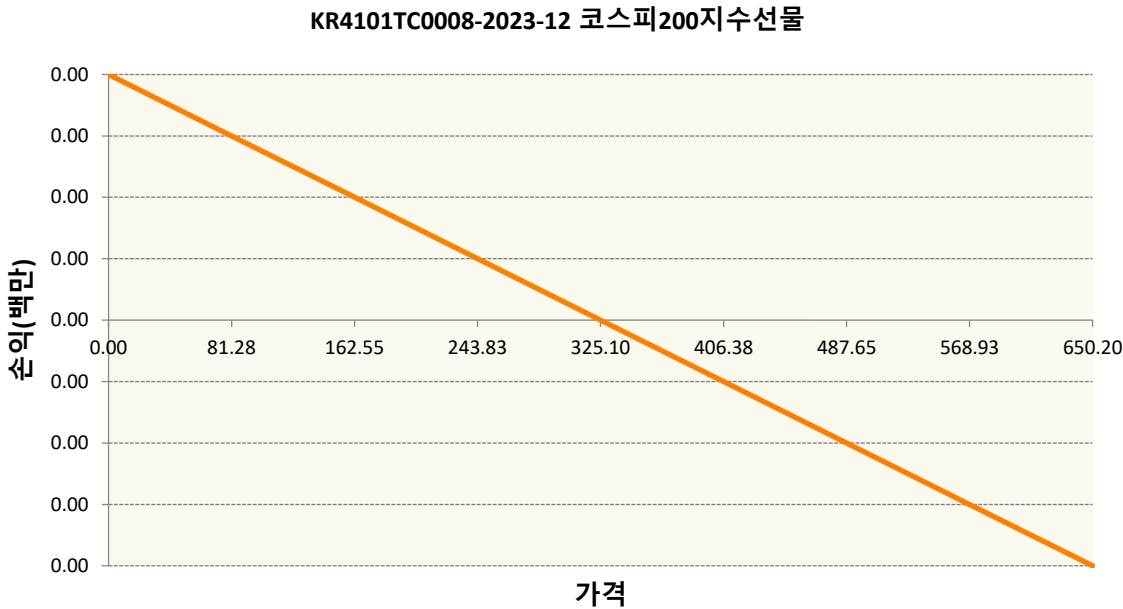
에퀴티알파일반사모혼합자산

1. 계약금액

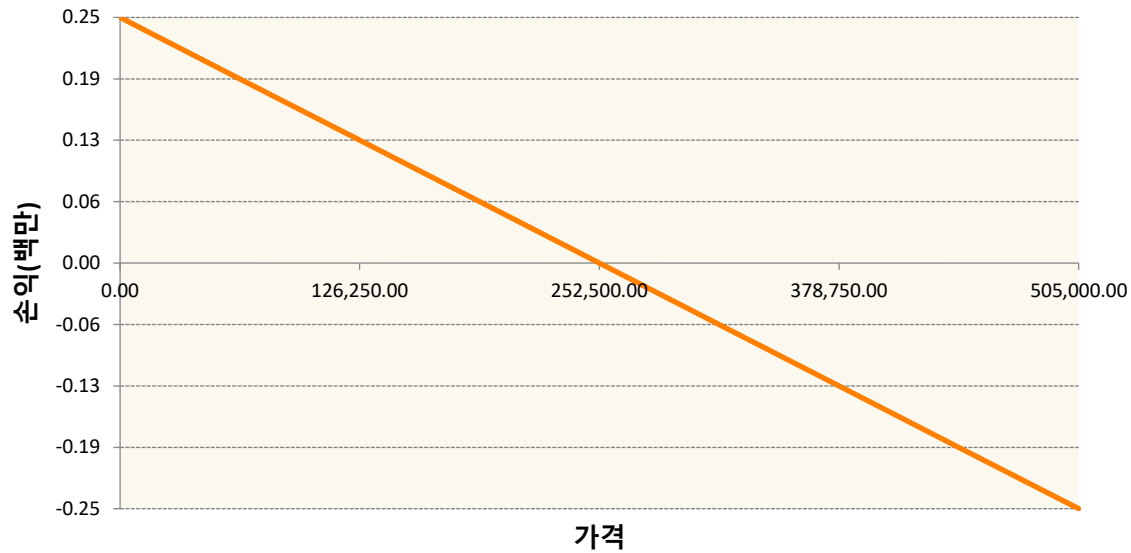
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	247	21	226	장내
누계	유가증권	선물	0	2,630	-2,630	장내

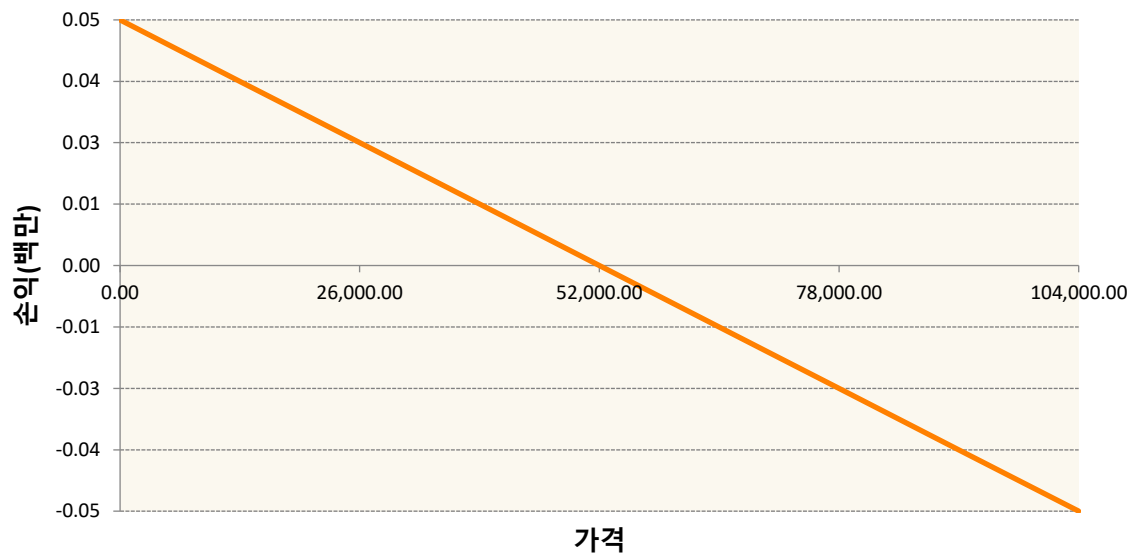
2. 만기시점의 손익구조



KR41EYTC0003-2023-12 에코프로비엠개별선물



KR41FNTC0005-2023-12 위메이드개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101TC00 2023-12 코스피200지수선물	202
KR4124TB00 2023-11 LG전자개별선물	6
KR41EYTC00 2023-12 에코프로비엠개별선물	2
KR41FNTC00 2023-12 위메이드개별선물	1

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

(단위:백만원)

219

공시일	2023-11-09
기준일	2023-11-08

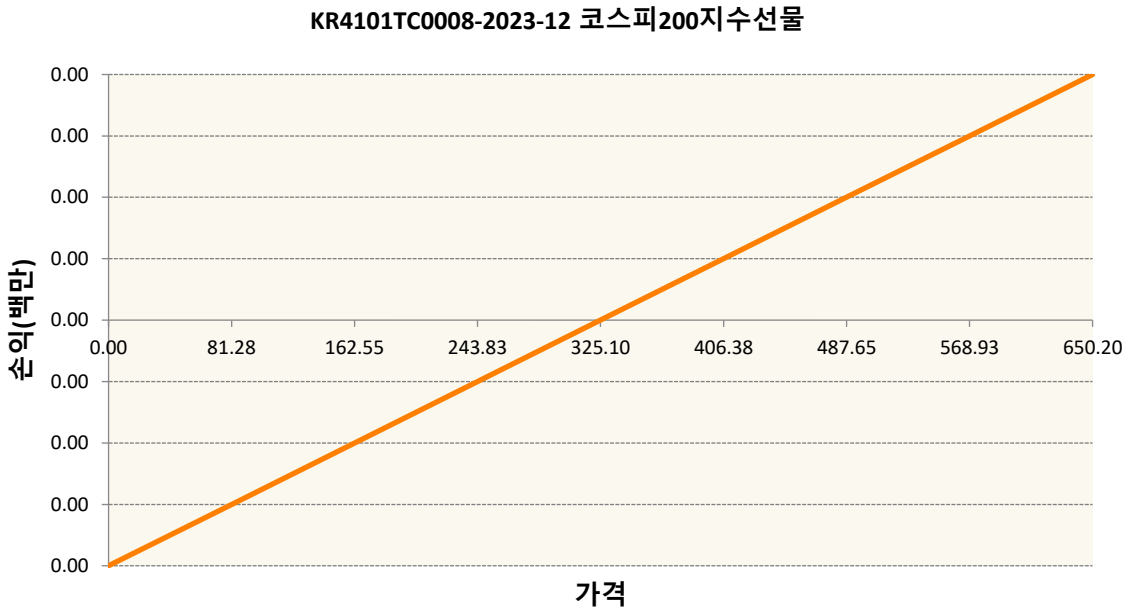
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	407	-407	장내
누계	유가증권	선물	4,226	0	4,226	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101TC0008		2023-12 코스피200지수선물					337
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-337	-337	-337	-337	-337	-337	-337
-5.33%	-225	-225	-225	-225	-225	-225	-225
-2.67%	-112	-112	-112	-112	-112	-112	-112
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	112	112	112	112	112	112	112
5.33%	225	225	225	225	225	225	225
8.00%	337	337	337	337	337	337	337

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

(단위:백만원)

326

공시일	2023-11-09
기준일	2023-11-08

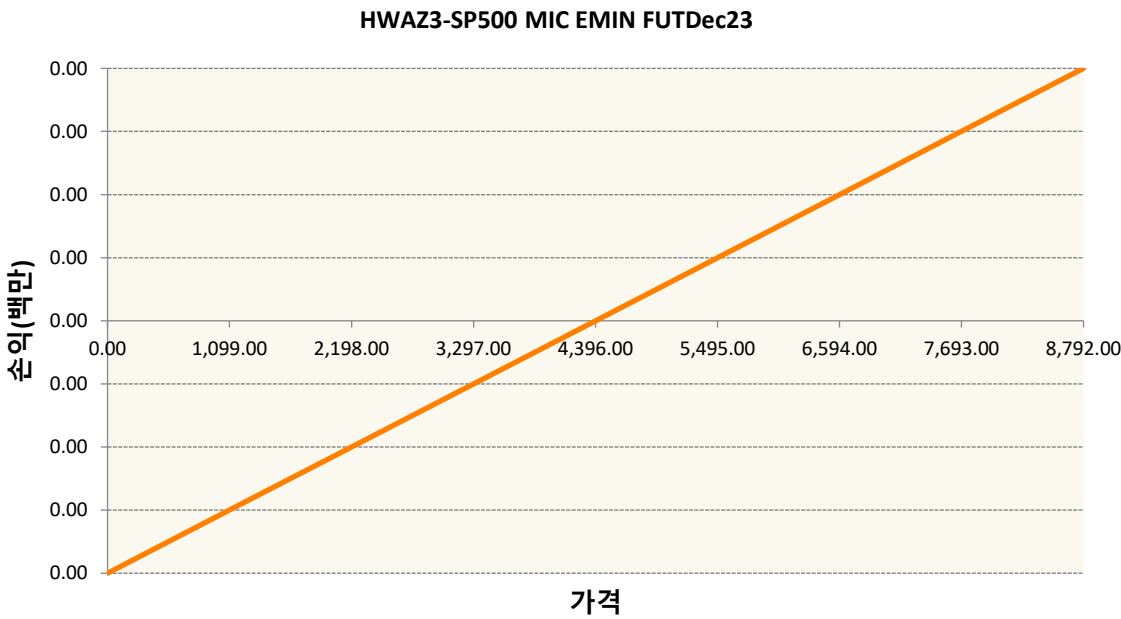
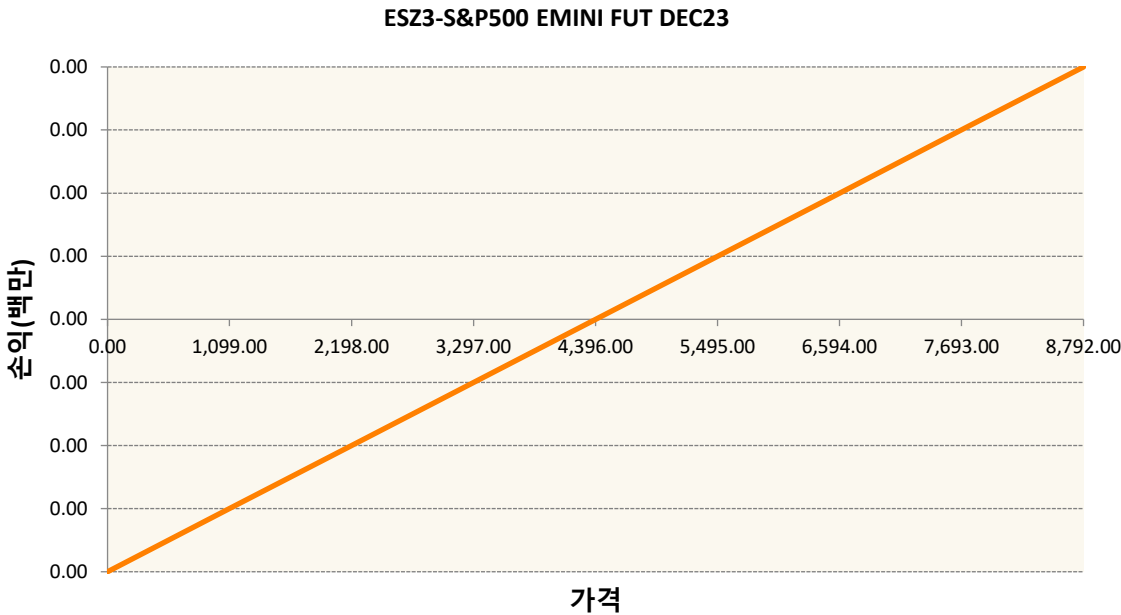
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

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	298	0	298	
누계	유가증권	선물	2,169	0	2,169	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESZ3	S&P500 EMINI FUT DEC23	24
HWAZ3	SP500 MIC EMIN FUTDec23	174

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	179

공시일	2023-11-09
기준일	2023-11-08

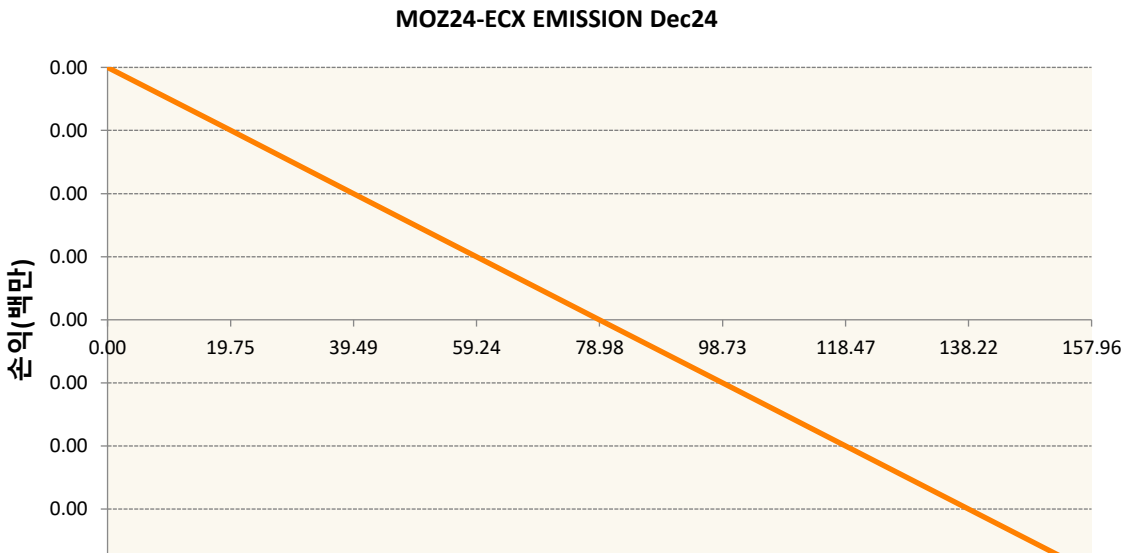
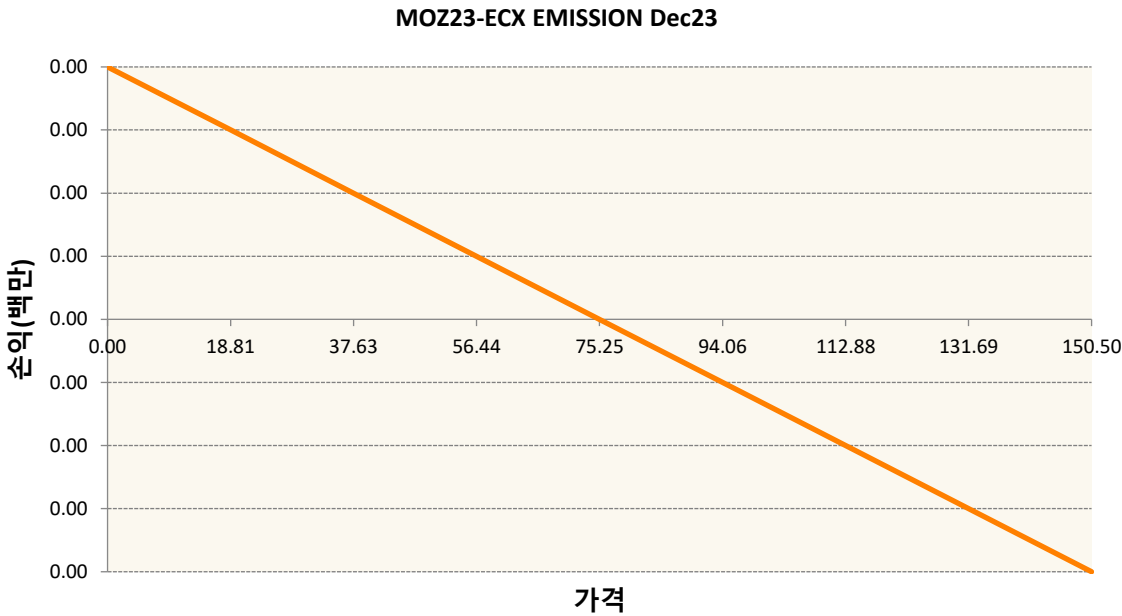
SOL유럽탄소배출권선물인버스ICE특별자산상

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	6,209	-6,209	
누계	지수	스왑	479	0	479	장외
누계	통화	선도	0	2,205	-2,205	장외

2. 만기시점의 손익구조



0.00

가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
FXW213DAT KRW/EUR 30-11-23E		48
FXW213DAT KRW/EUR 30-11-23E		128
MOZ23	ECX EMISSION Dec23	408
MOZ24	ECX EMISSION Dec24	88
SWICEUACN ICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX		4

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,025

공시일	2023-11-09
기준일	2023-11-08

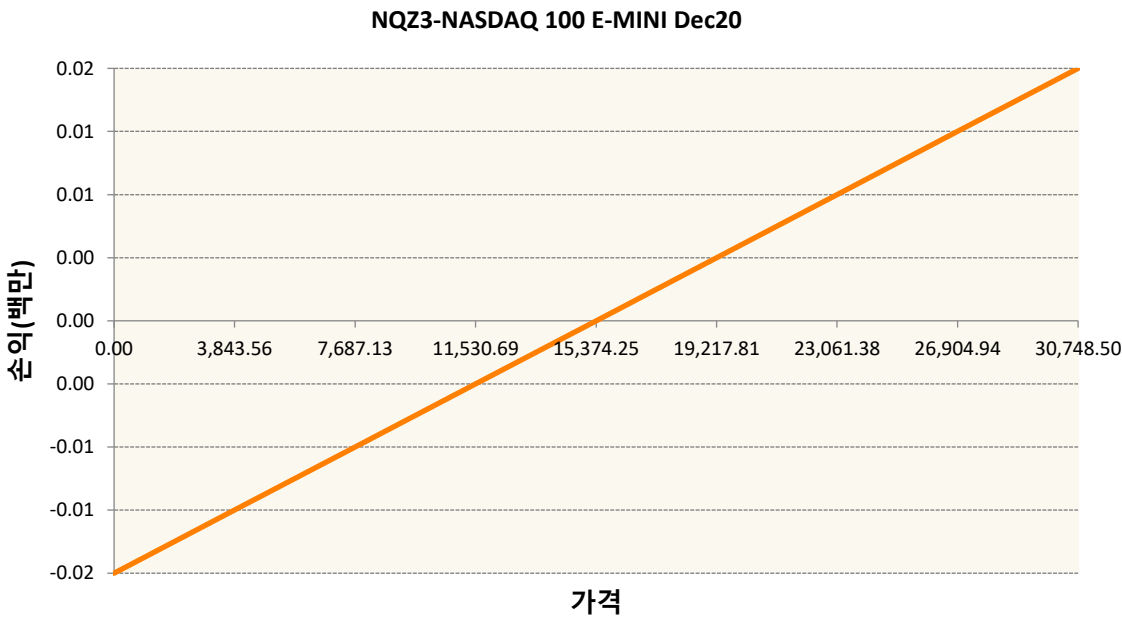
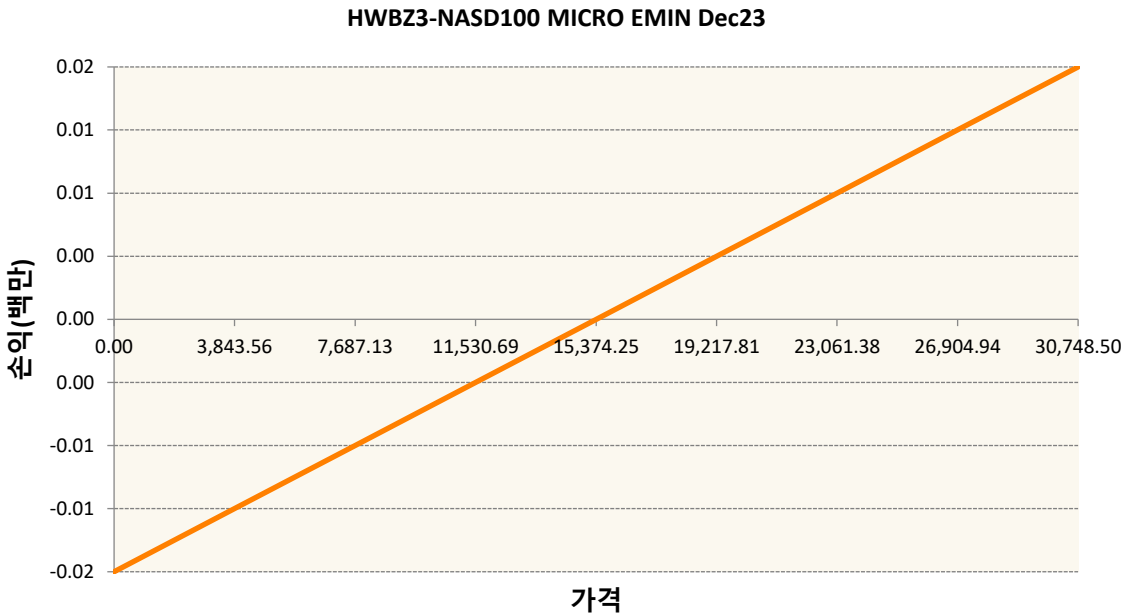
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

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	416	0	416	
누계	유가증권	선물	2,171	0	2,171	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HWBZ3	NASD100 MICRO EMIN Dec23	174
NQZ3	NASDAQ 100 E-MINI Dec20	33

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	198

공시일	2023-11-09
기준일	2023-11-08

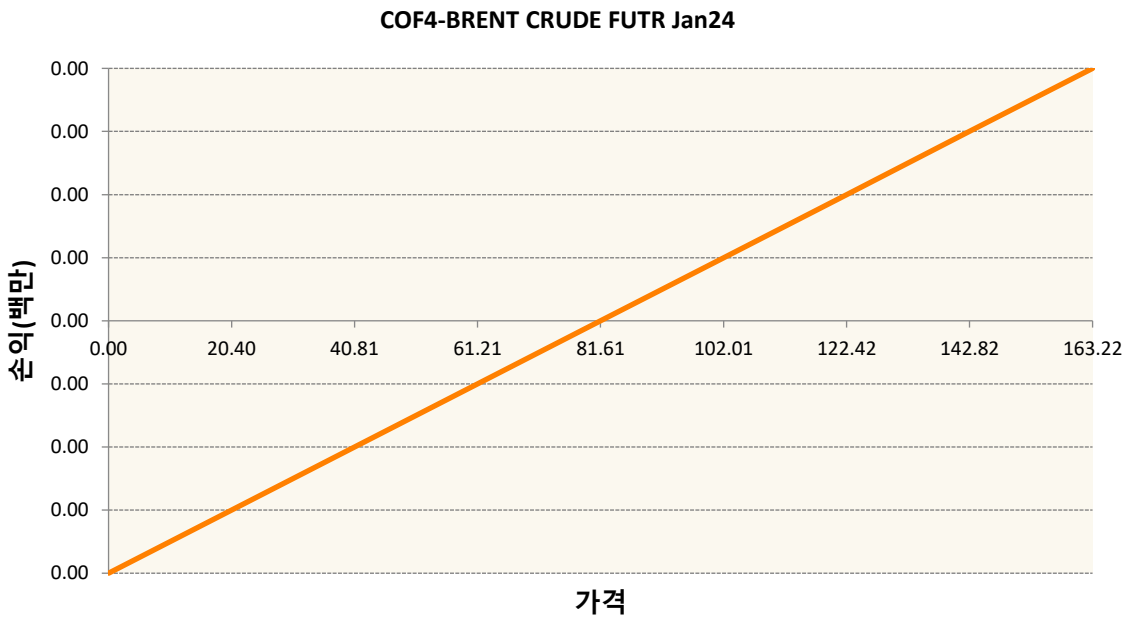
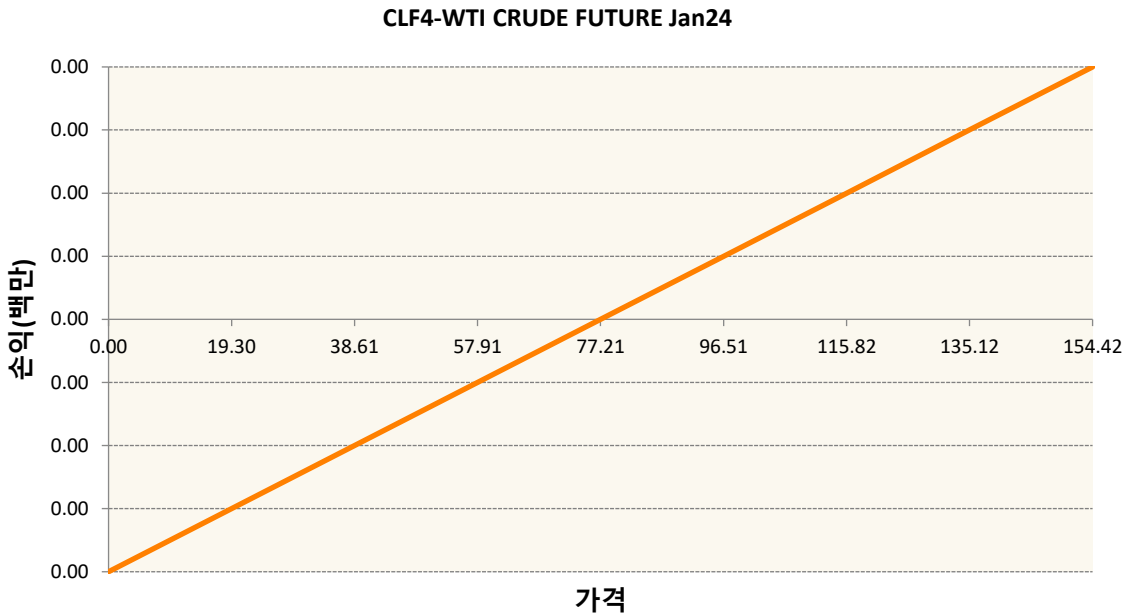
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

1. 계약금액

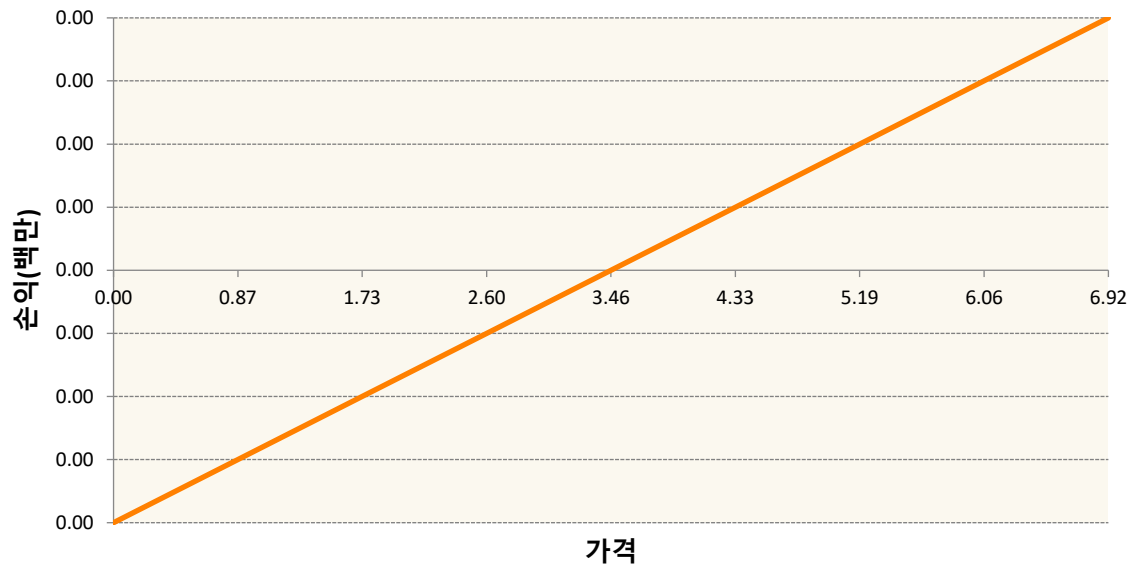
(단위:백만원)

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	1,358	0	1,358	
누계	통화	선물	0	196	-196	장내

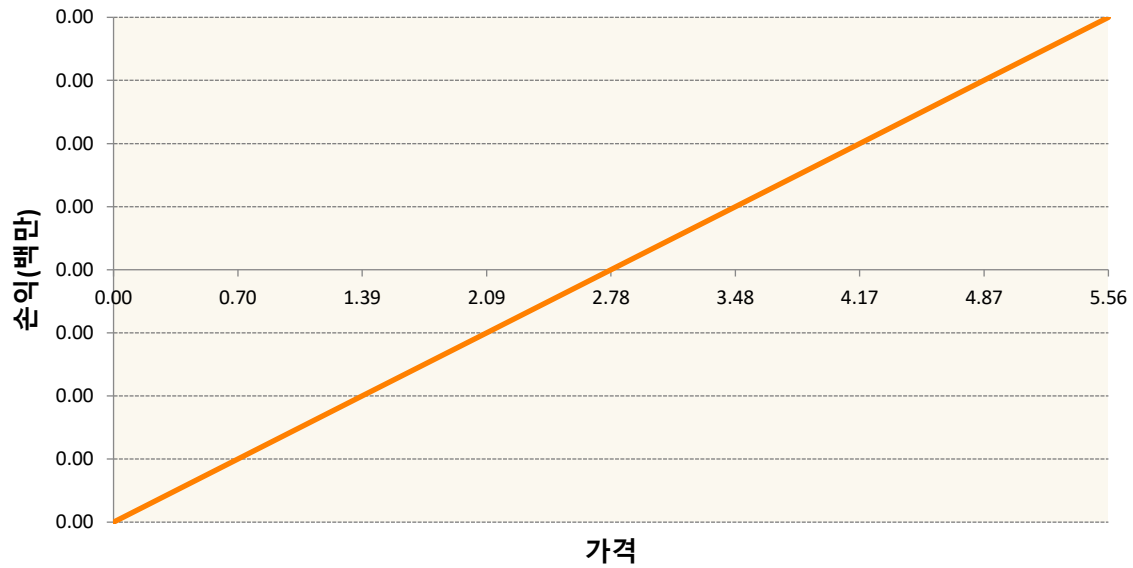
2. 만기시점의 손익구조



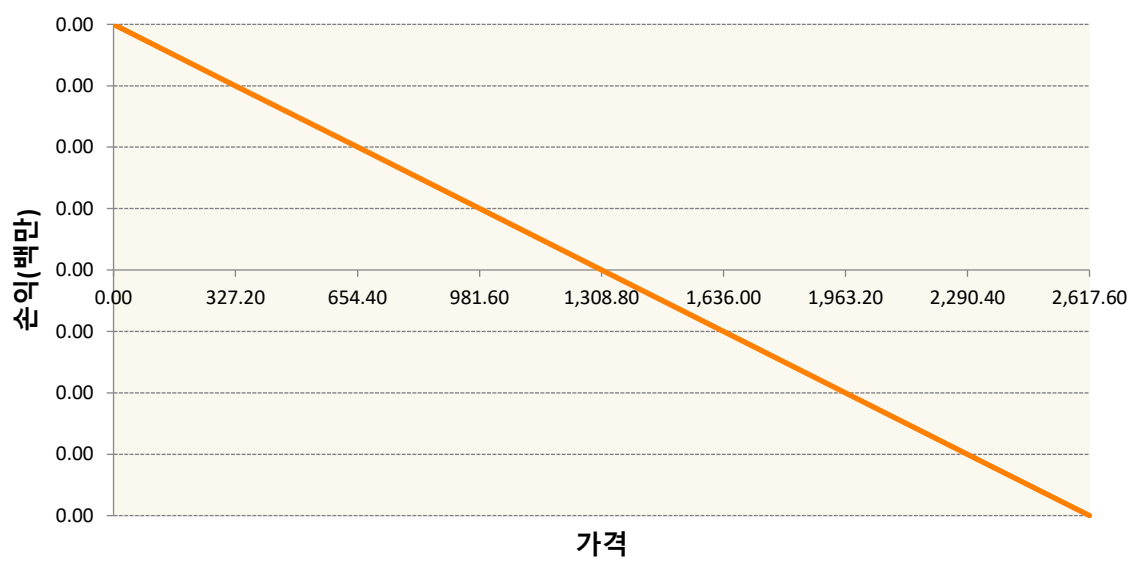
EOF4-E-MINI NATURAL GAS Jan24



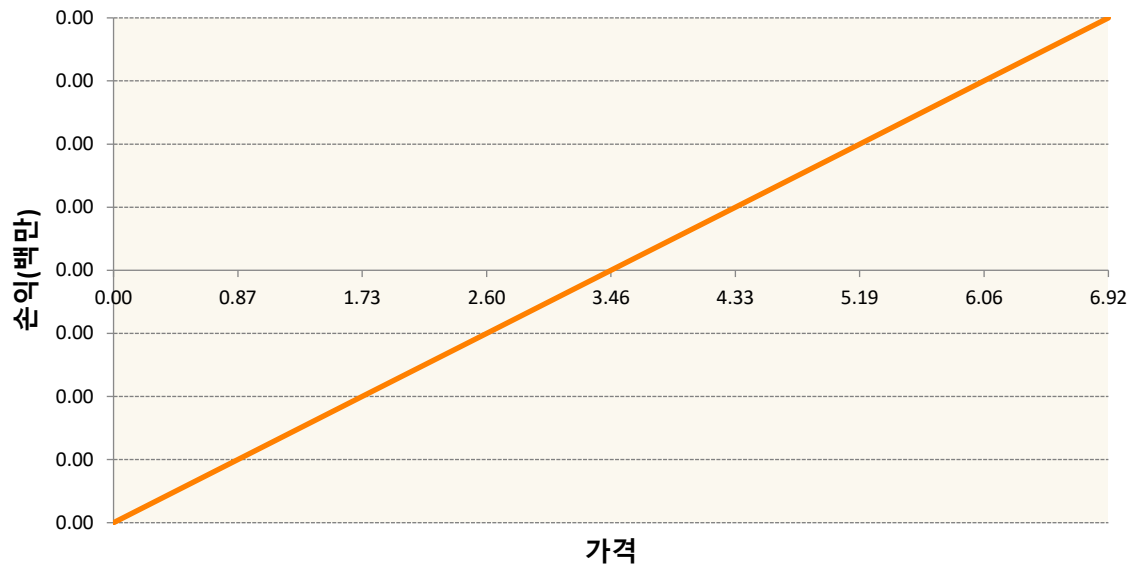
HOF4-NY Harb ULSD Fut Jan24



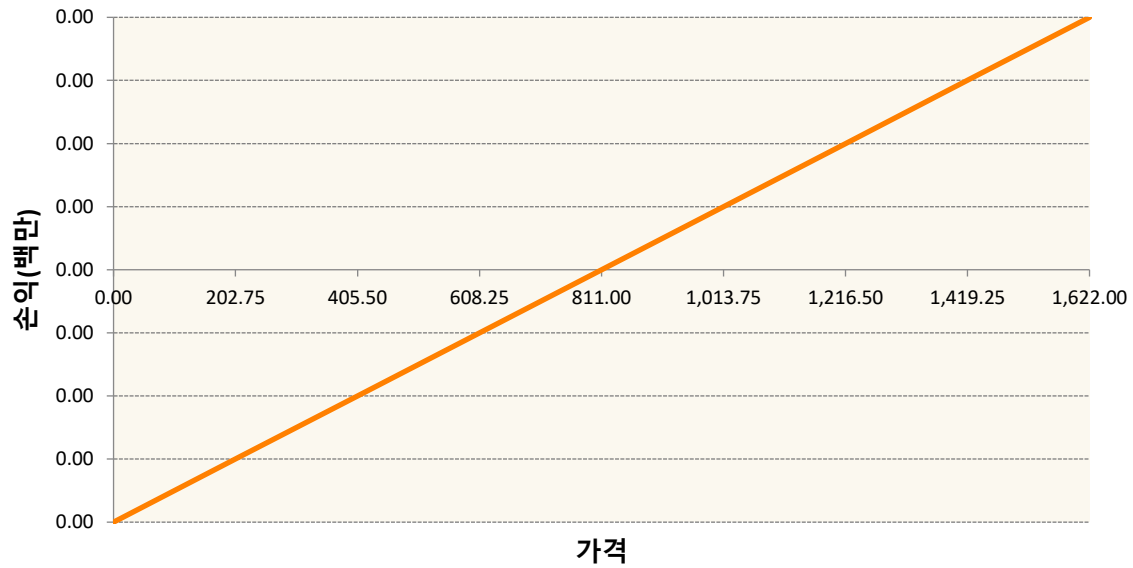
KR4175TB0000-2023-11 달러선물



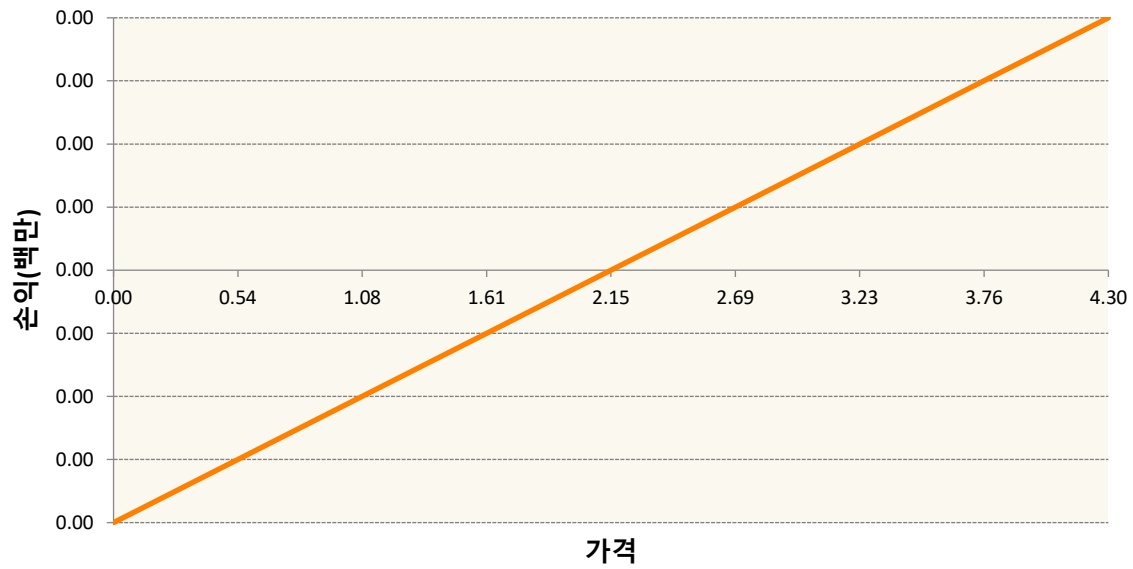
NGF24-NATURAL GAS FUTR Jan24



QSF4-Low Su Gasoil G Jan24



XBF4-GASOLINE RBOB FUT Jan24



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLF4	WTI CRUDE FUTURE Jan24	25
COF4	BRENT CRUDE FUTR Jan24	26
EOF4	E-MINI NATURAL GAS Jan24	5
HOF4	NY Harb ULSD Fut Jan24	13
KR4175TB00	2023-11 달러선물	16
NGF24	NATURAL GAS FUTR Jan24	22
QSF4	Low Su Gasoil G Jan24	9
XBF4	GASOLINE RBOB FUT Jan24	10

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

284