

공시일	2023-11-15
기준일	2023-11-14

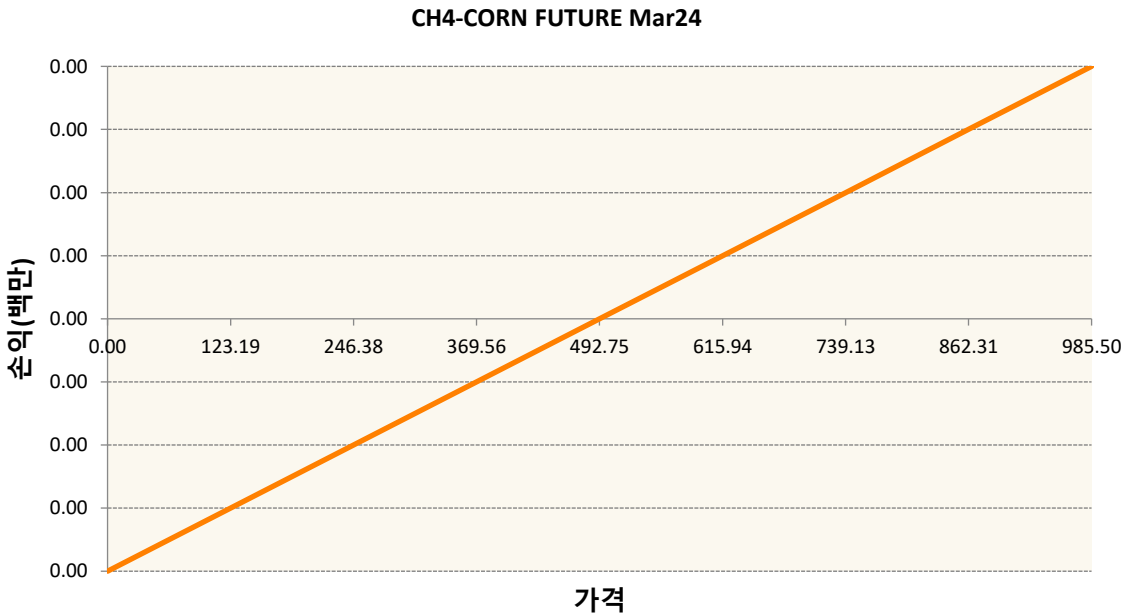
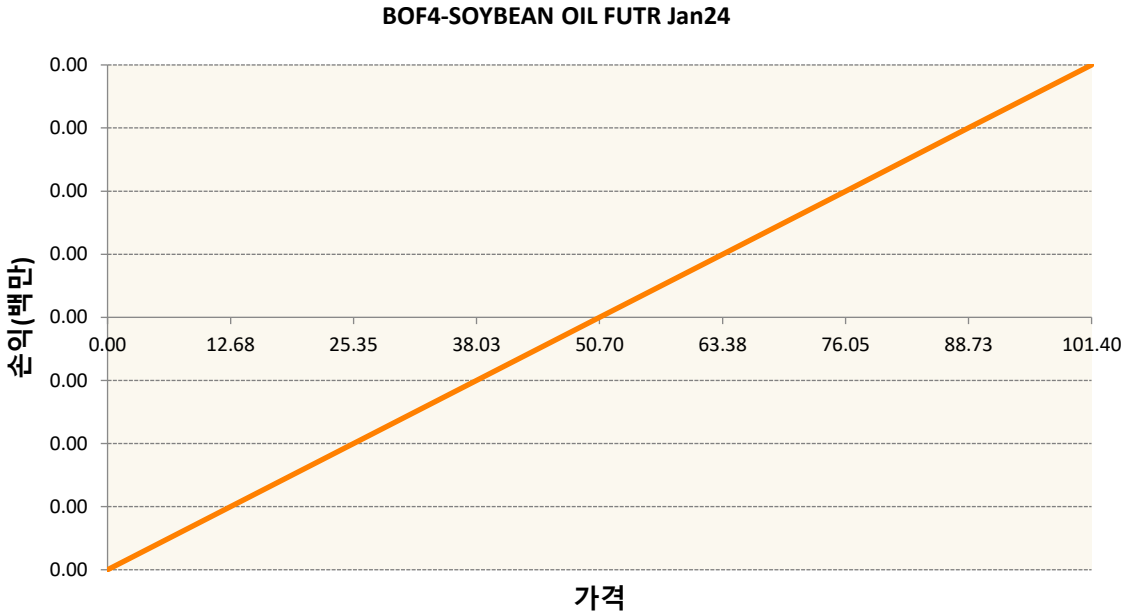
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

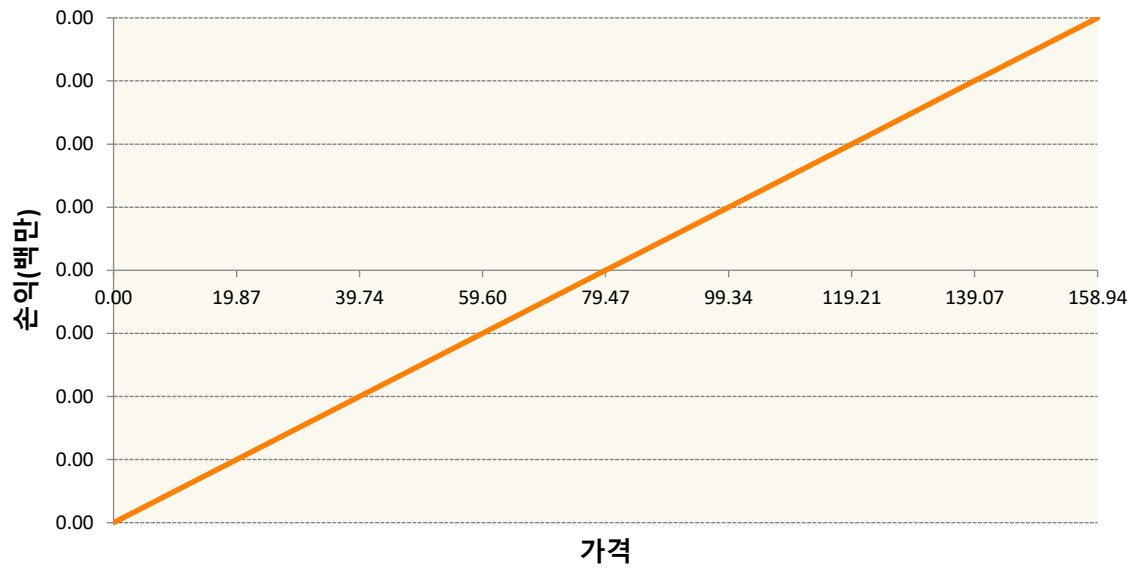
(단위:USD 백만)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	66	-66	장내
누계	유가증권	선물	5,064	0	5,064	
누계	통화	선물	0	704	-704	장내

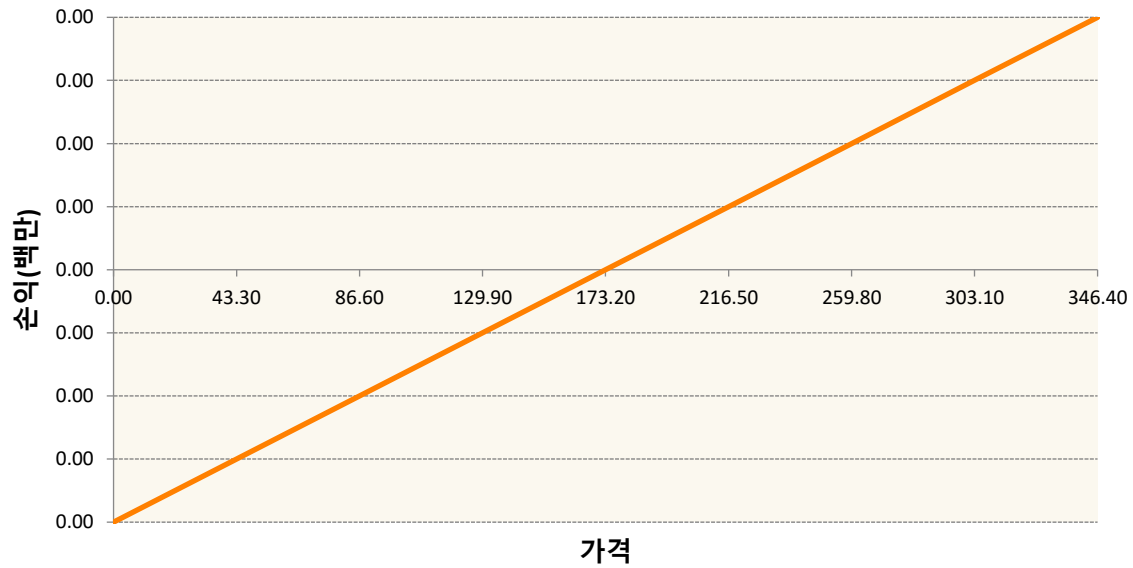
2. 만기시점의 손익구조



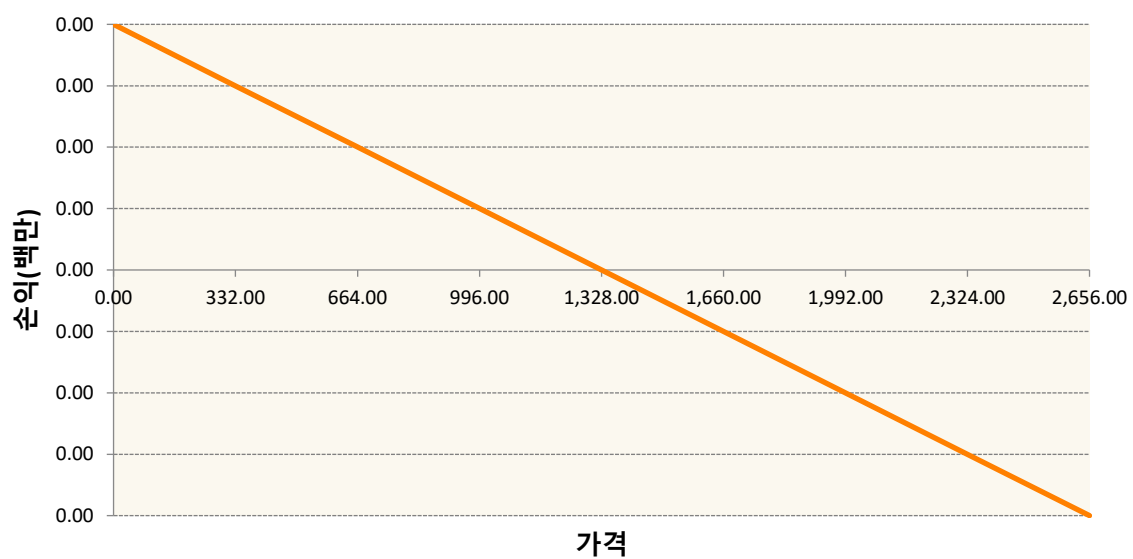
CTH4-COTTON NO.2 FUTR Mar24



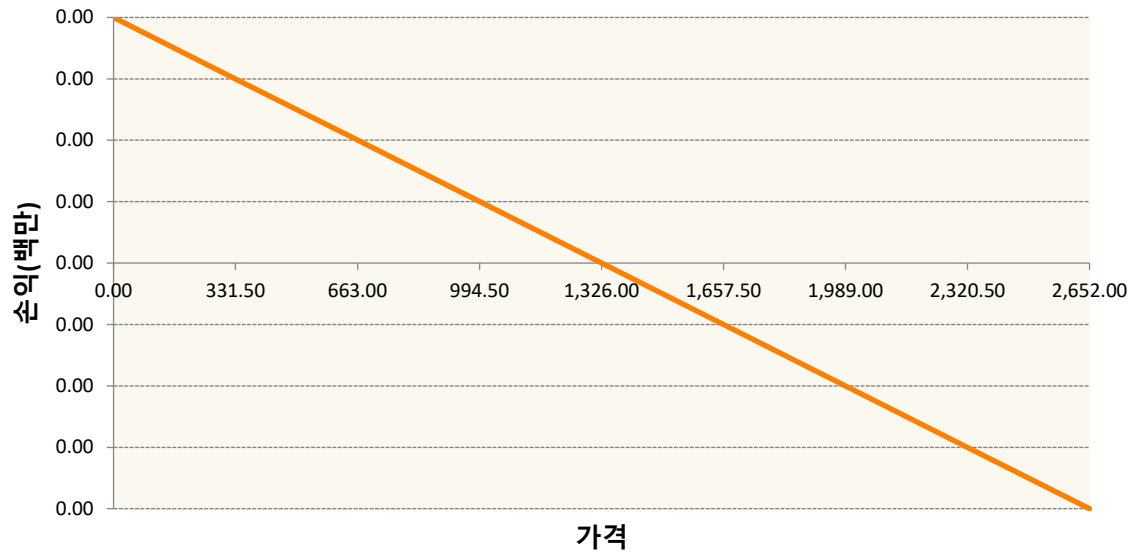
KCH4-COFFEE 'C' FUTURE Mar24



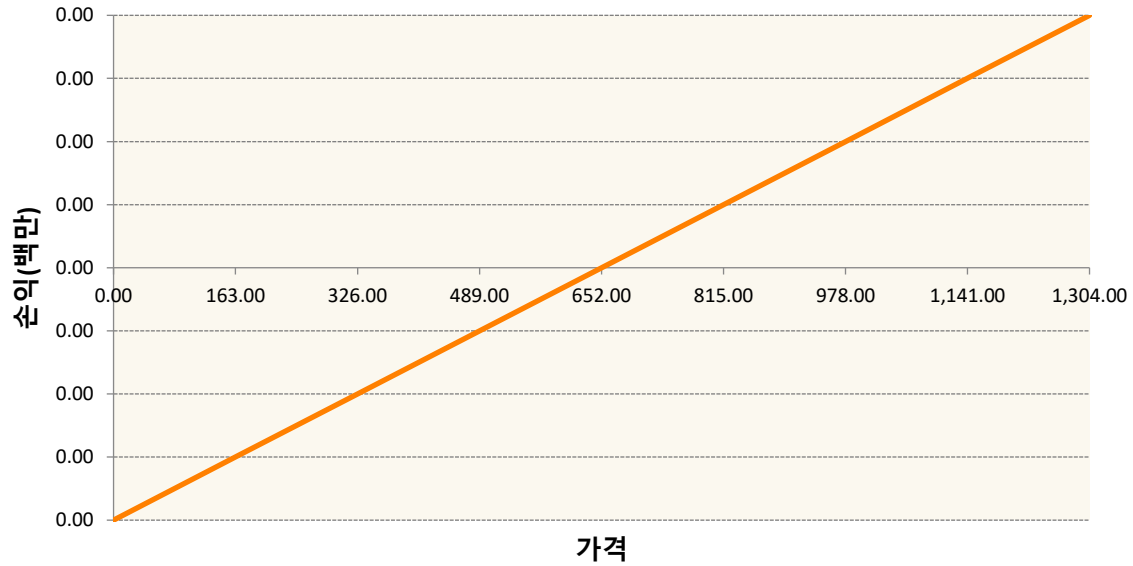
KR4175TB0000-2023-11 달러선물



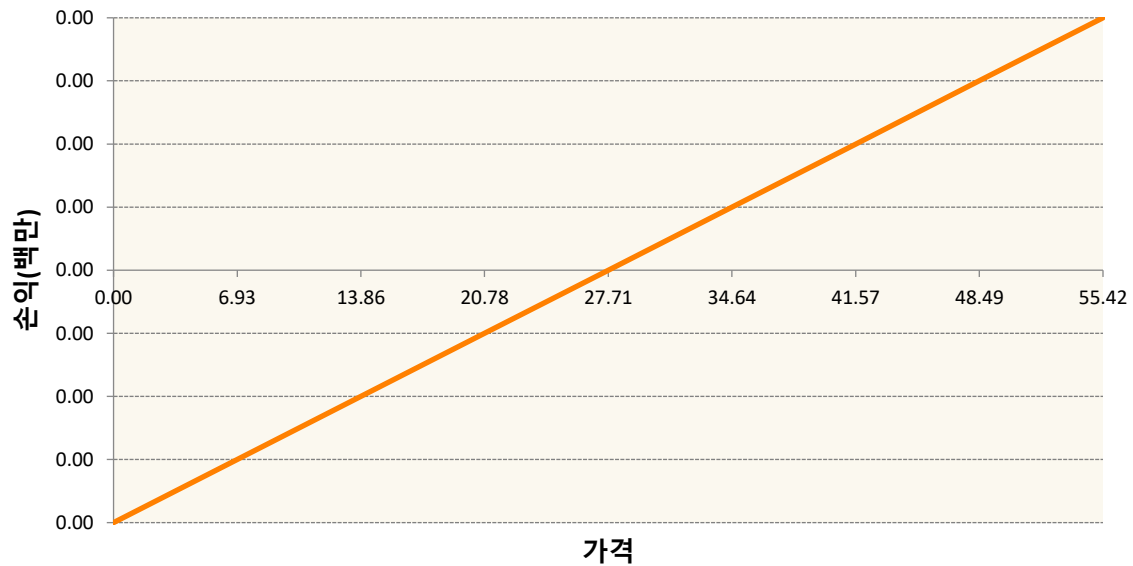
KR4175TC0009-2023-12 달러선물



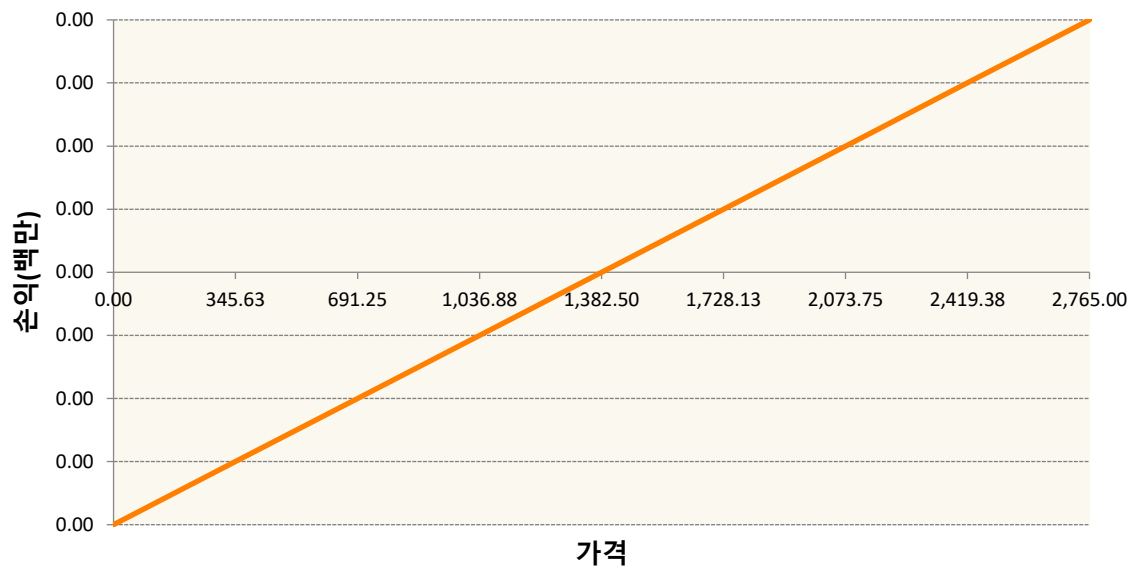
KWH4-KC HRW WHEAT FUT Mar24



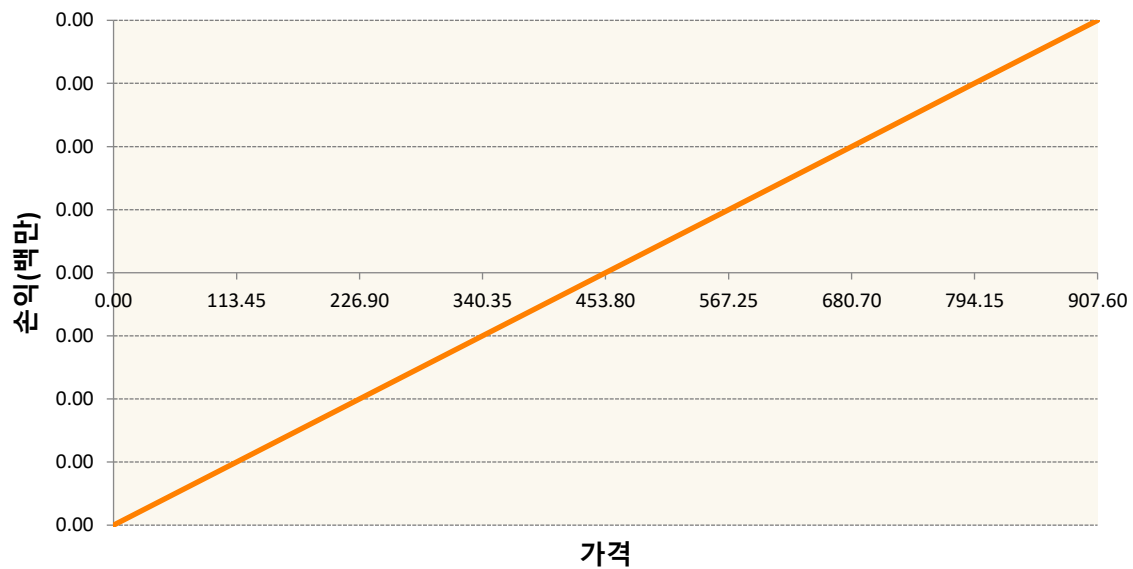
SBH4-Sugar #11 (WORLD) Mar24



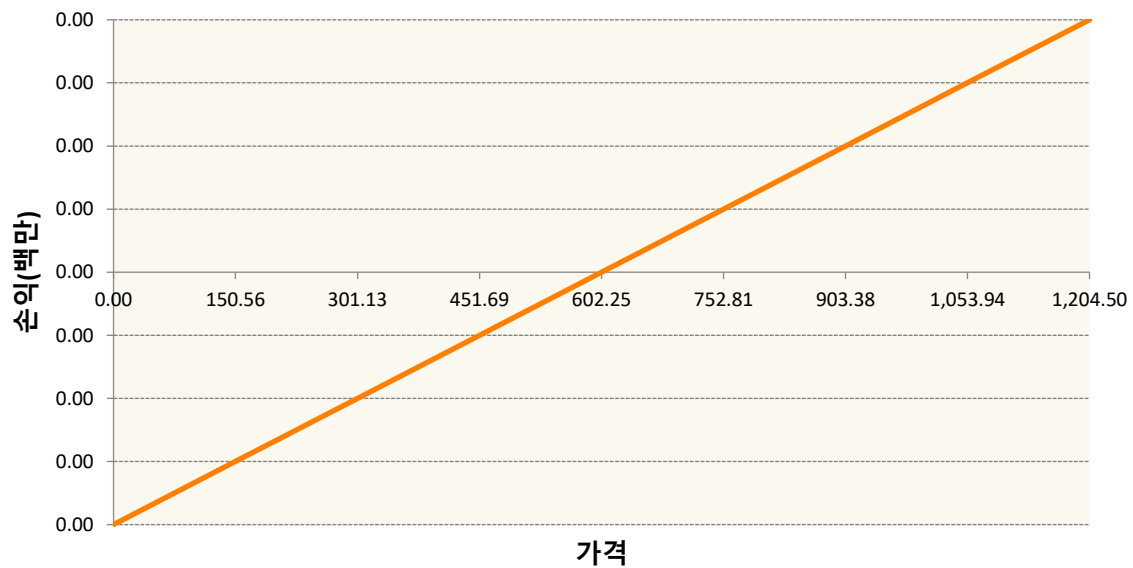
SF4-SOYBEAN FUTURE Jan24



SMF4-SOYBEAN MEAL FUTR Jan24



WH4-WHEAT FUTURE(CBT) Mar24



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

공시일	2023-11-15
기준일	2023-11-14

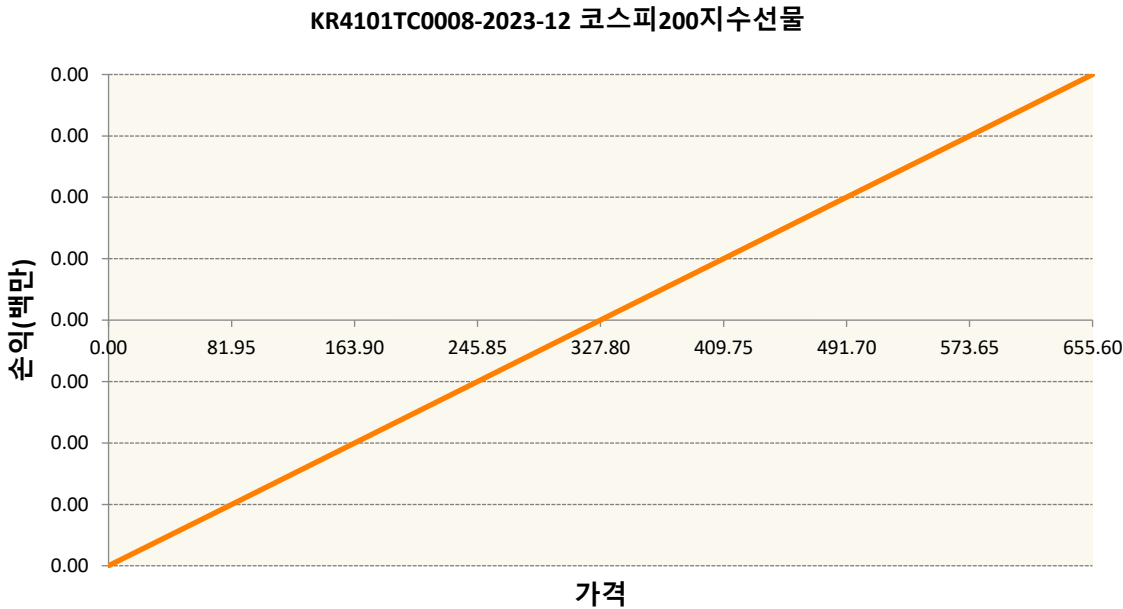
스마트인덱스모

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	1,393	0	1,393	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101TC0008			2023-12 코스피200지수선물				111
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-111	-111	-111	-111	-111	-111	-111
-5.33%	-74	-74	-74	-74	-74	-74	-74
-2.67%	-37	-37	-37	-37	-37	-37	-37
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	37	37	37	37	37	37	37
5.33%	74	74	74	74	74	74	74
8.00%	111	111	111	111	111	111	111

공시일	2023-11-15
기준일	2023-11-14

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)

284

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2023-11-15
기준일	2023-11-14

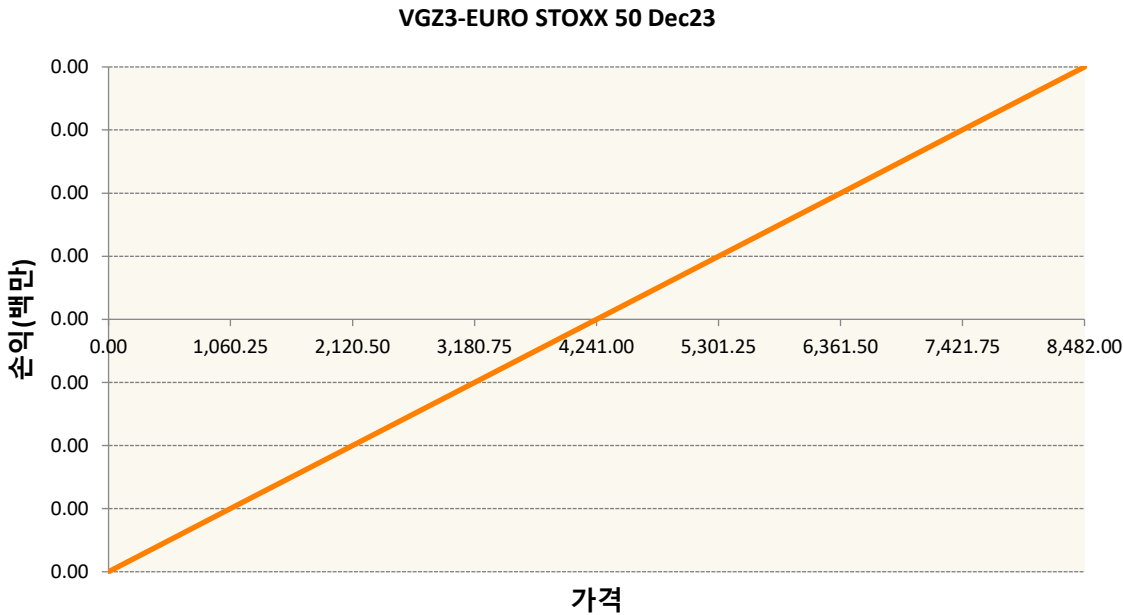
유로인덱스모(주식-파생형)

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	965	0	965	
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)
	75

공시일	2023-11-15
기준일	2023-11-14

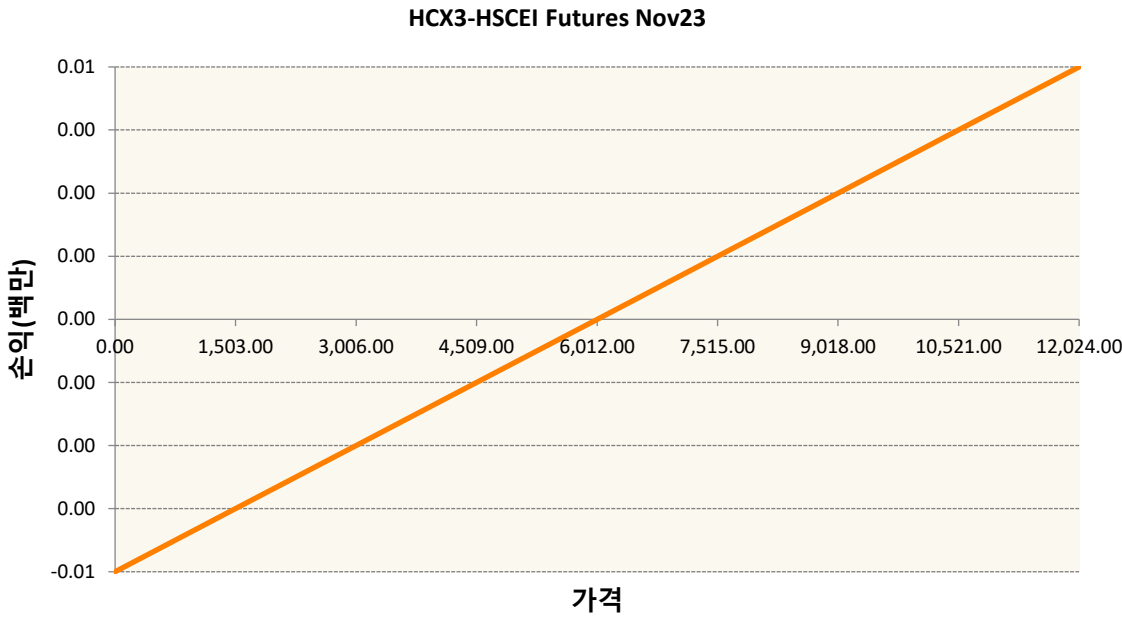
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,242	0	1,242	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HGX3	HSCEI Futures Nov23	99
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

144

공시일	2023-11-15
기준일	2023-11-14

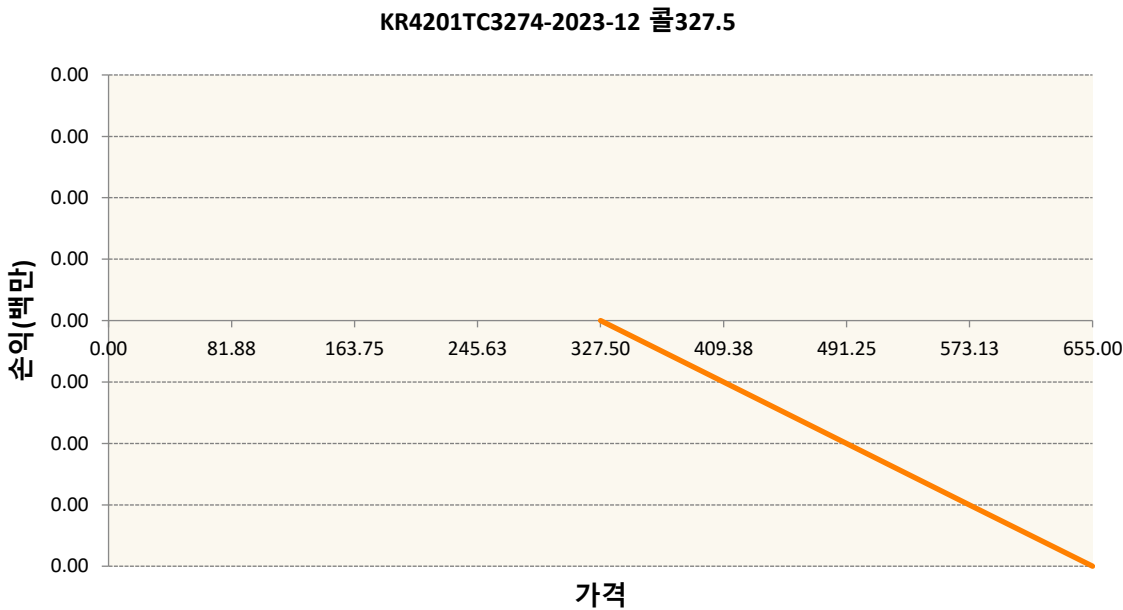
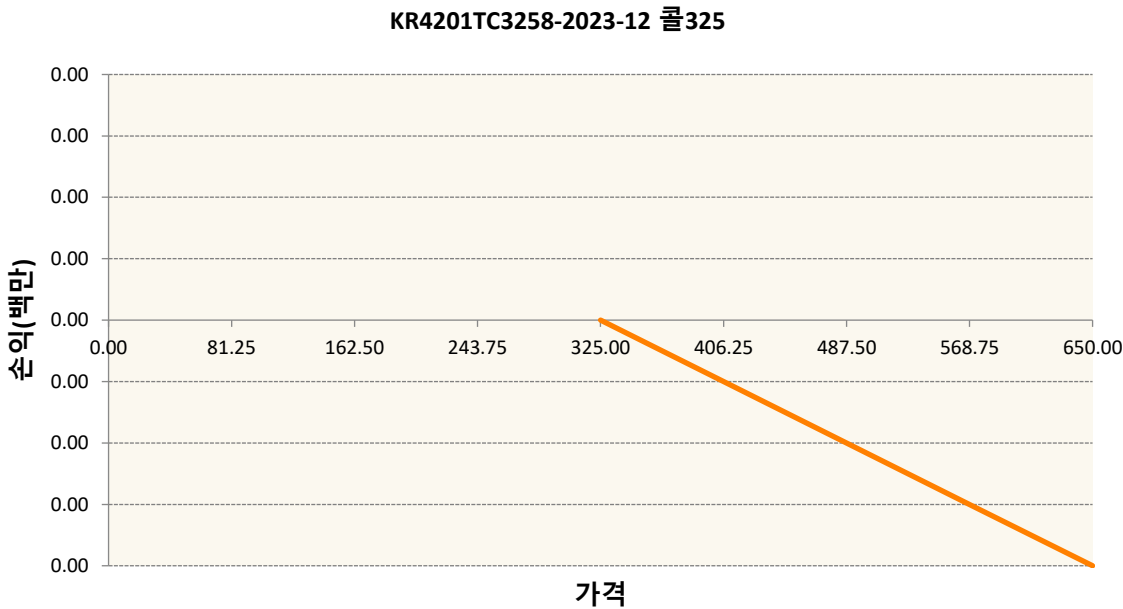
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

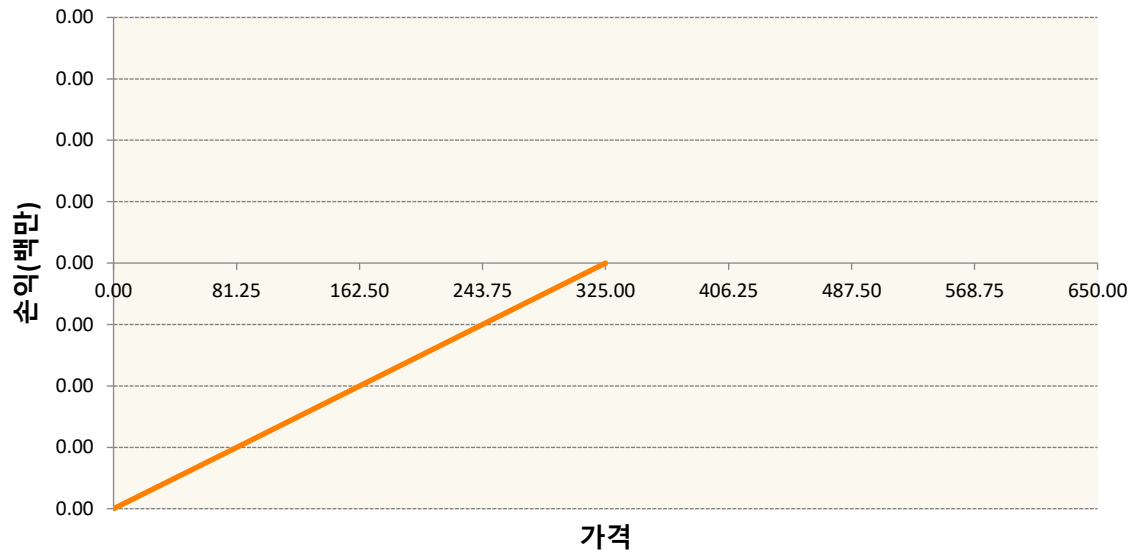
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	52,209	-52,209	장내

2. 만기시점의 손익구조



KR4301TC3257-2023-12 풋325



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201TC3258			2023-12 콜325				2,344
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,111	1,077	1,038	993	943	890	833
-5.33%	982	923	860	793	724	652	579
-2.67%	715	633	551	468	385	301	217
0%	263	175	88	0	-88	-175	-263
2.67%	-379	-454	-532	-612	-693	-775	-858
5.33%	-1,174	-1,228	-1,286	-1,349	-1,416	-1,486	-1,558
8.00%	-2,071	-2,102	-2,140	-2,184	-2,233	-2,287	-2,344
KR4201TC3274			2023-12 콜327.5				368
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	161	156	151	144	137	129	121
-5.33%	144	136	126	116	106	95	84
-2.67%	108	95	83	70	56	43	30
0%	43	29	14	0	-14	-29	-43
2.67%	-53	-66	-80	-93	-107	-121	-135
5.33%	-176	-186	-196	-208	-219	-232	-244
8.00%	-318	-324	-331	-339	-348	-358	-368
KR4301TC3257			2023-12 풋325				534
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-464	-473	-483	-494	-507	-520	-534
-5.33%	-249	-264	-280	-296	-314	-332	-350
-2.67%	-68	-89	-109	-130	-151	-172	-193
0%	66	44	22	0	-22	-44	-66

2.67%	153	134	114	94	74	53	32
5.33%	201	187	173	157	140	123	104
8.00%	223	216	206	195	183	169	155

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

(단위:백만원)

3,116

공시일	2023-11-15
기준일	2023-11-14

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	1,972	0	1,972	

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	2023-11-15
기준일	2023-11-14

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	4,547	0	4,547	

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	2023-11-15
기준일	2023-11-14

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	17,180	0	17,180	
누계	통화	선도	0	16,977	-16,977	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213D8W KRW/USD 30-11-23E	605
FXW213D9R KRW/USD 29-12-23E	516
FXW213DAT KRW/USD 31-01-24E	190
FXW213DB7 KRW/USD 30-11-23E	48
IE00BD8RGM75	

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

720

공시일	2023-11-15
기준일	2023-11-14

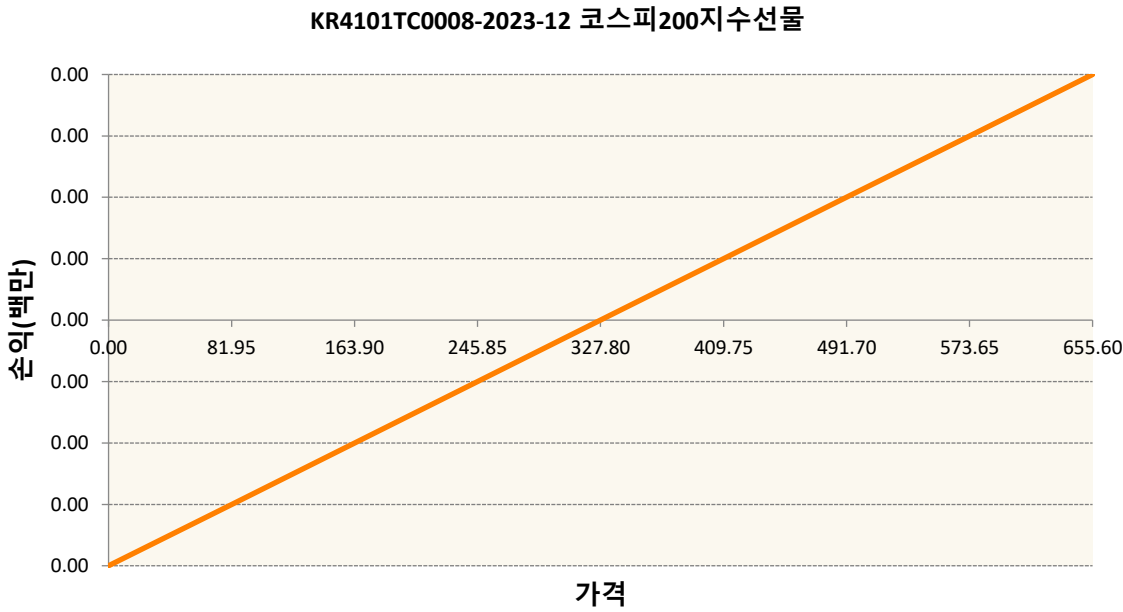
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

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	492	0	492	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101TC0008			2023-12 코스피200지수선물					39
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-39	-39	-39	-39	-39	-39	-39	
-5.33%	-26	-26	-26	-26	-26	-26	-26	
-2.67%	-13	-13	-13	-13	-13	-13	-13	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	13	13	13	13	13	13	13	
5.33%	26	26	26	26	26	26	26	
8.00%	39	39	39	39	39	39	39	

공시일	2023-11-15
기준일	2023-11-14

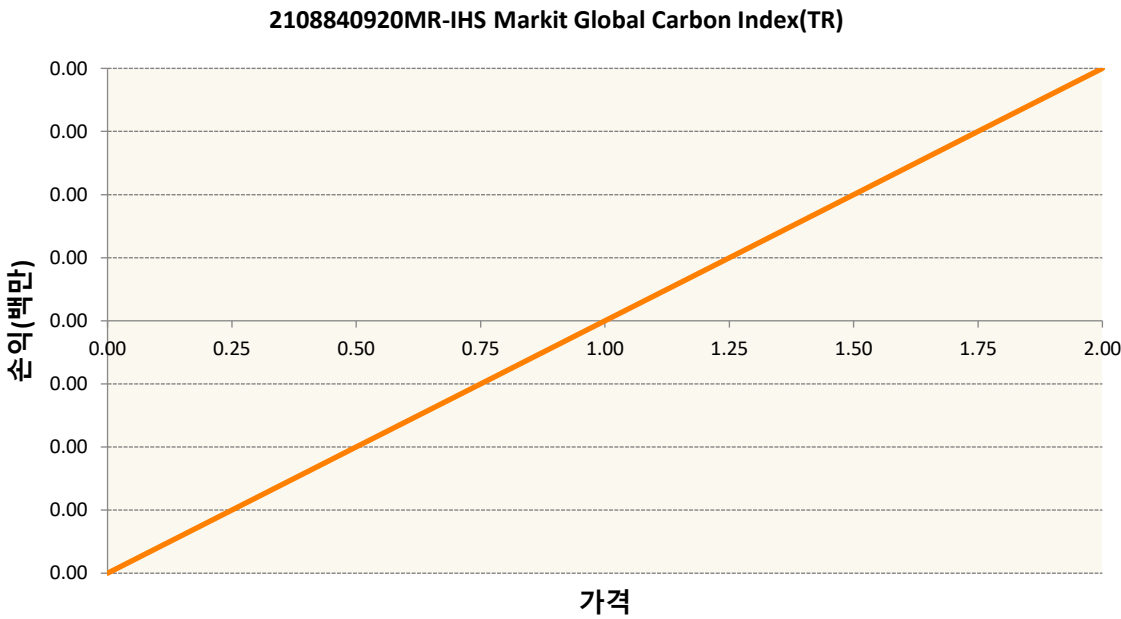
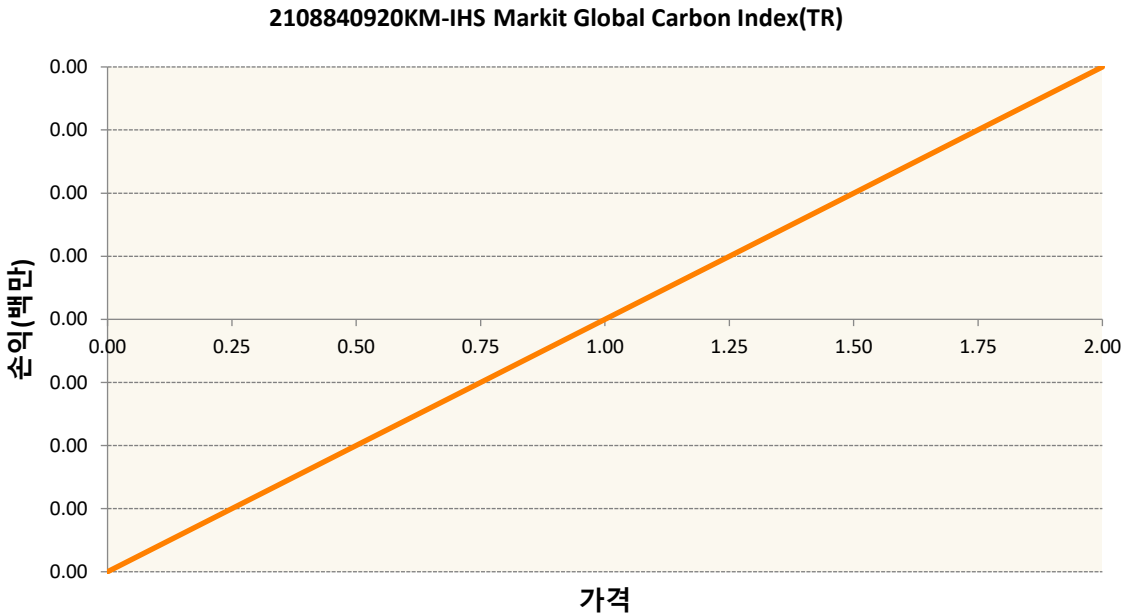
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

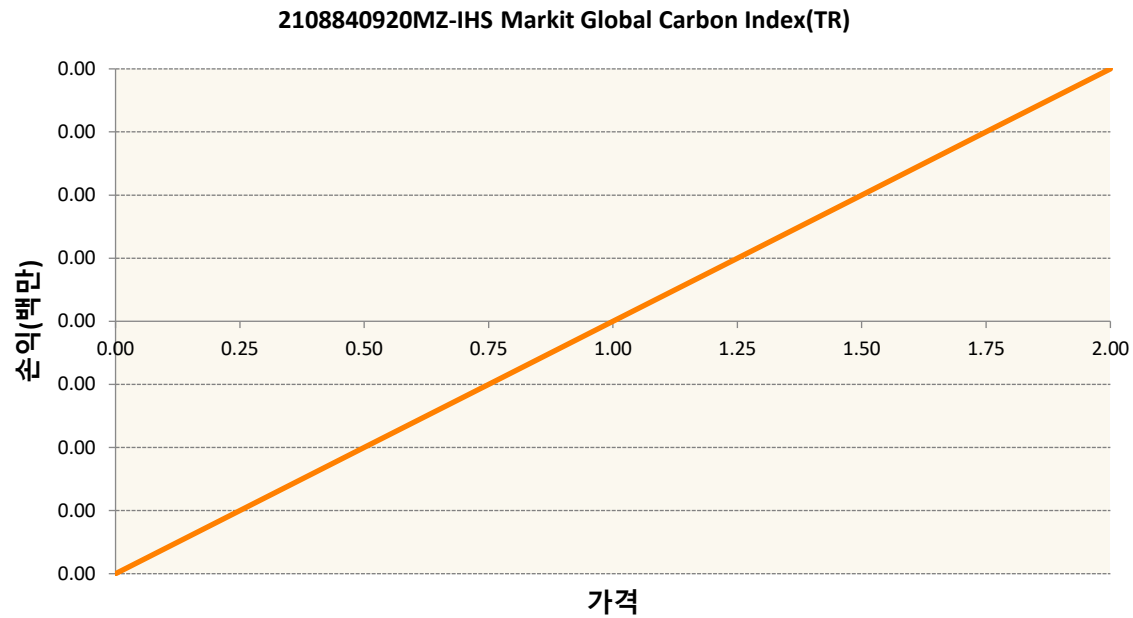
1. 계약금액

(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)		1,010
2108840920IHS Markit Global Carbon Index(TR)		202
2108840920IHS Markit Global Carbon Index(TR)		202

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)		(단위:백만원)
		1,815

공시일	2023-11-15
기준일	2023-11-14

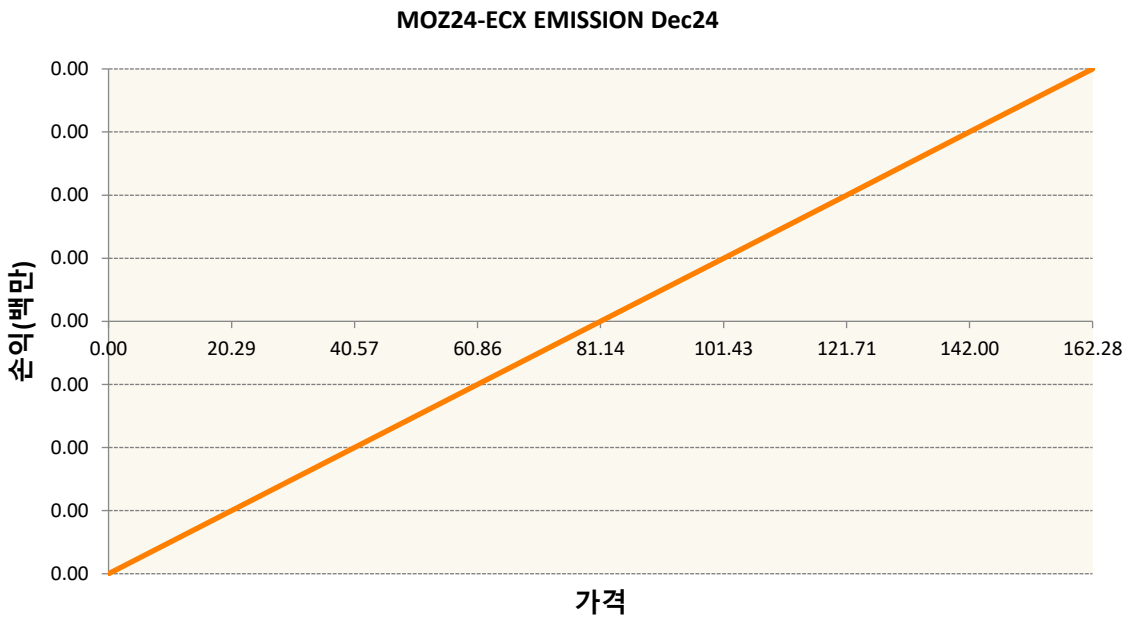
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	8,805	0	8,805	
누계	지수	스왑	479	0	479	장외
누계	통화	선도	0	1,450	-1,450	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213DAT KRW/EUR 30-11-23E	116
MOZ24 ECX EMISSION Dec24	704
SWICEUACN ICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX	3

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

(단위:백만원)

1,350

공시일	2023-11-15
기준일	2023-11-14

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)	3
SWCSI00000 신한CSI Index 231013 (NH)	5

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

(단위:백만원)

29

공시일	2023-11-15
기준일	2023-11-14

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)	4
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 230116(메리츠)	6
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 230116(미래)	5
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 230427(키움)	1

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

(단위:백만원)

17

공시일	2023-11-15
기준일	2023-11-14

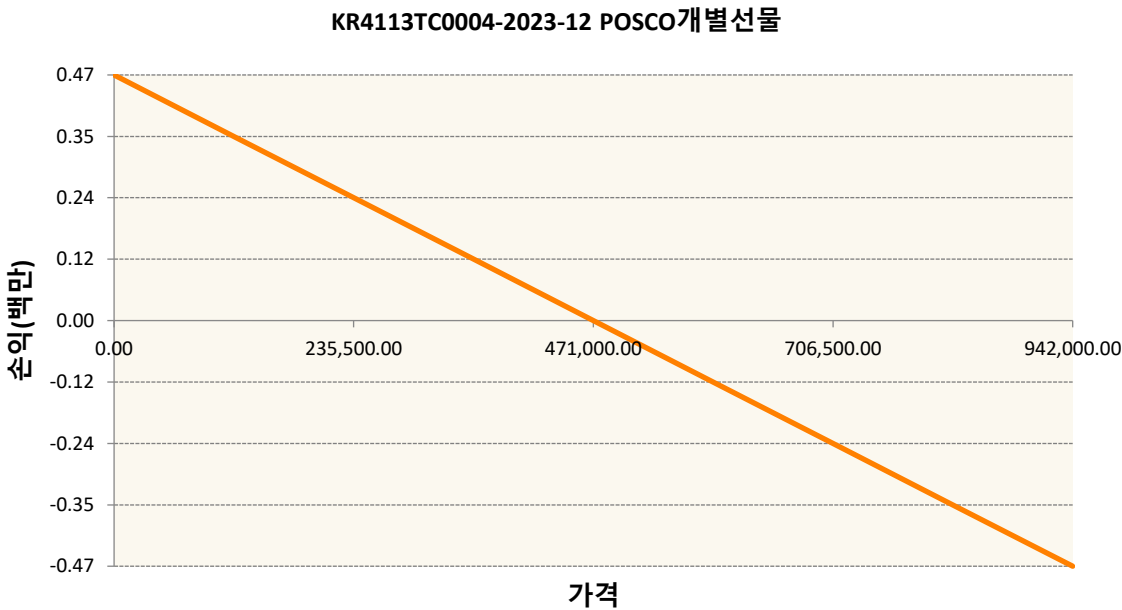
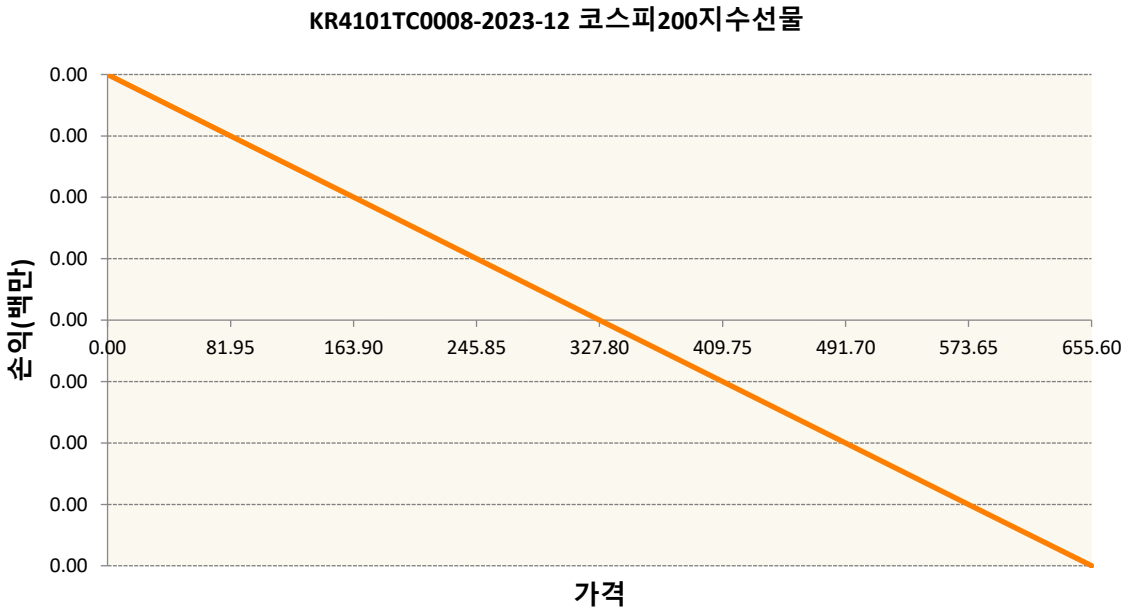
에퀴티알파일반사모혼합자산

1. 계약금액

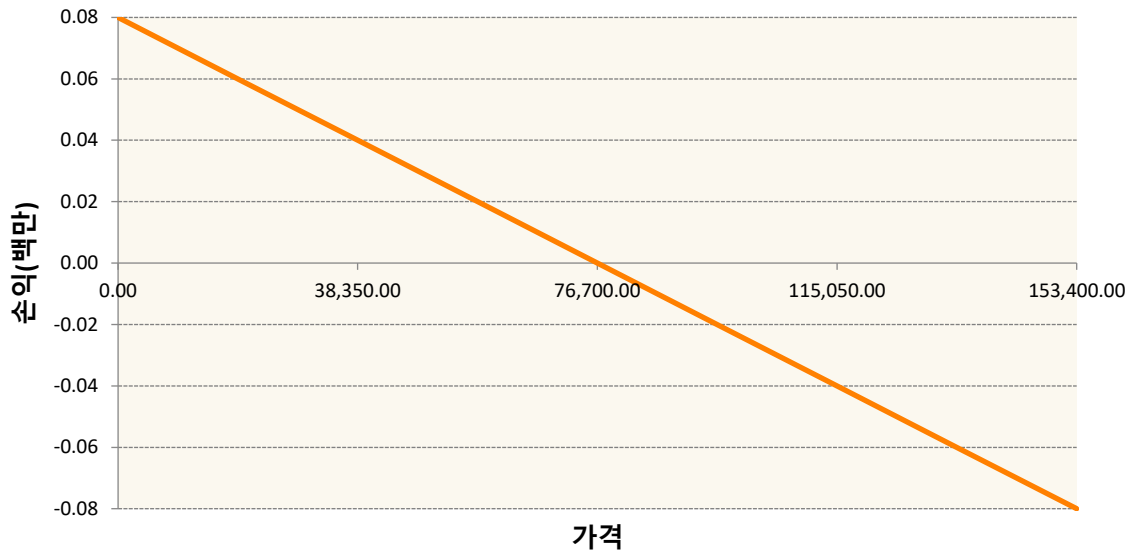
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	28	37	-9	장내
누계	유가증권	선물	28	2,857	-2,829	장내

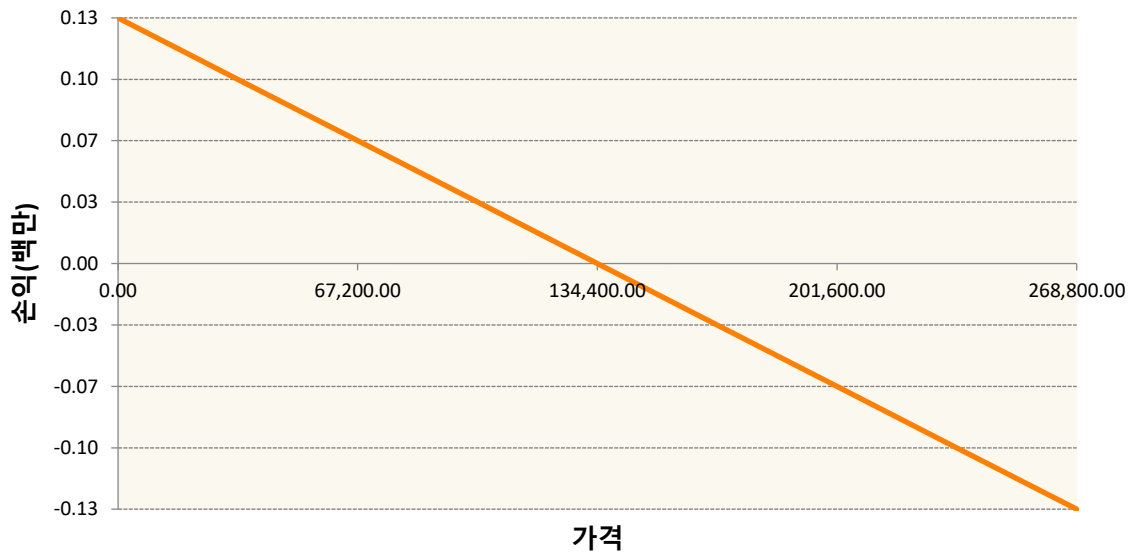
2. 만기시점의 손익구조



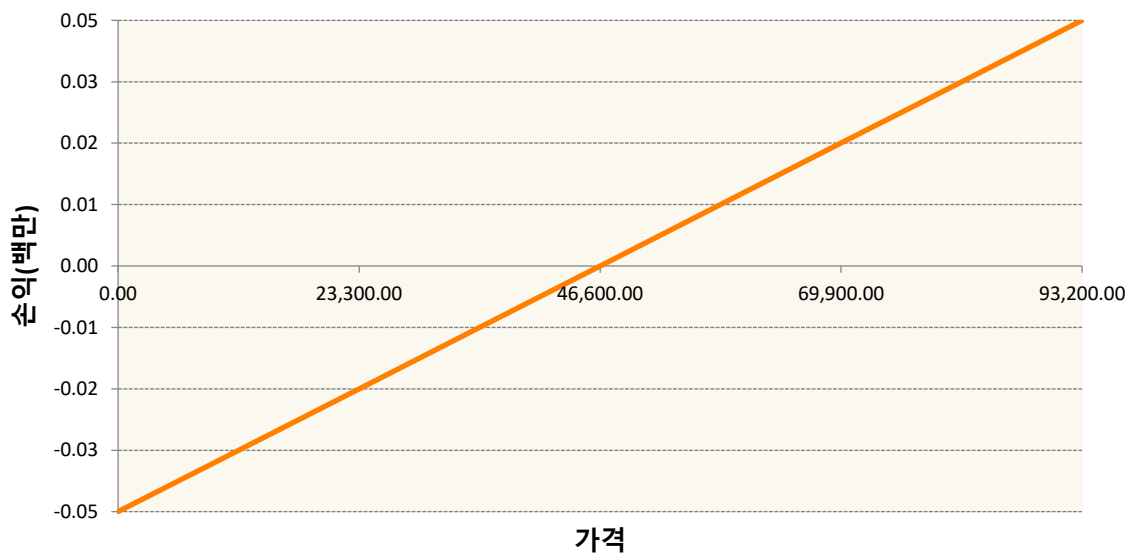
KR4154TC0004-2023-12 이마트개별선물



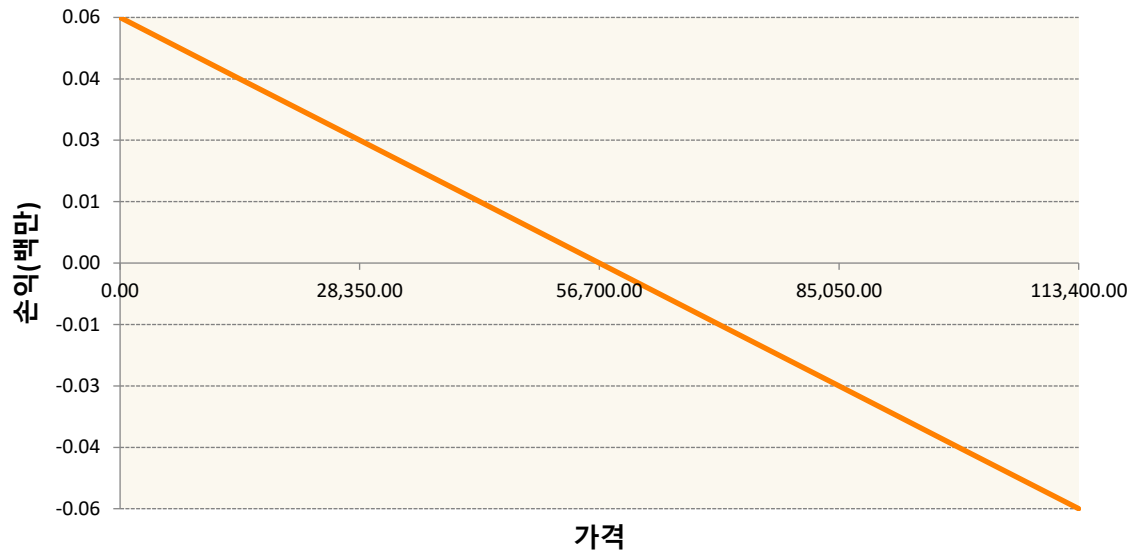
KR41C6TC0007-2023-12 아모레퍼시픽개별선물



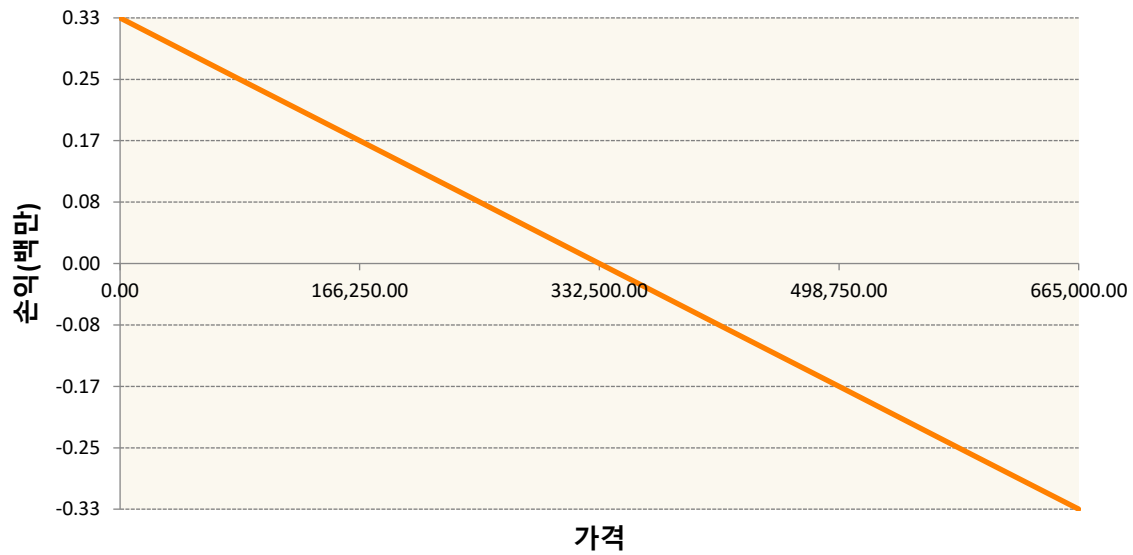
KR41CFTC0008-2023-12 카카오개별선물



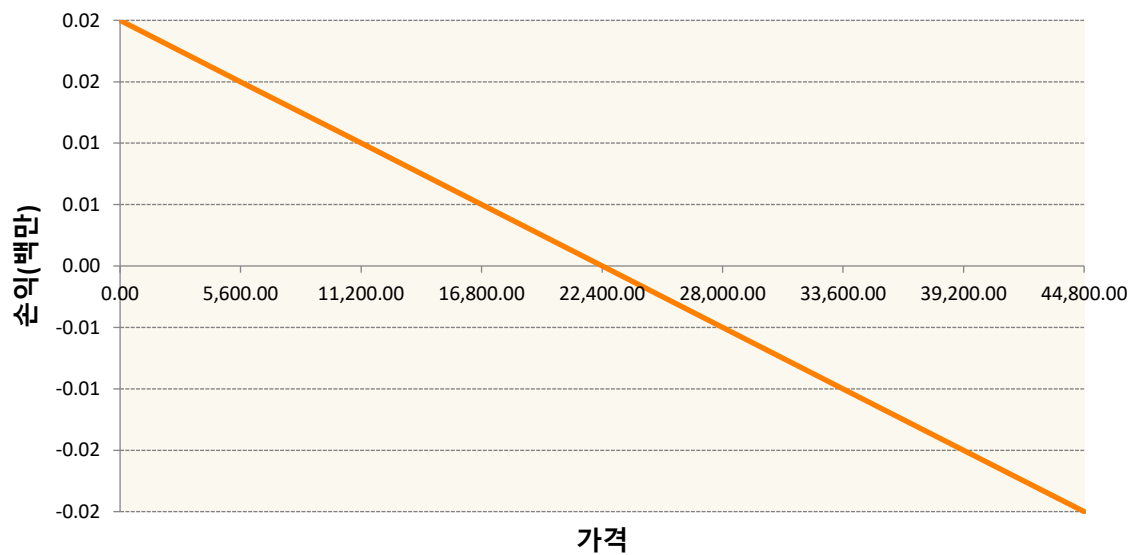
KR41CNTC0008-2023-12 포스코 ICT개별선물



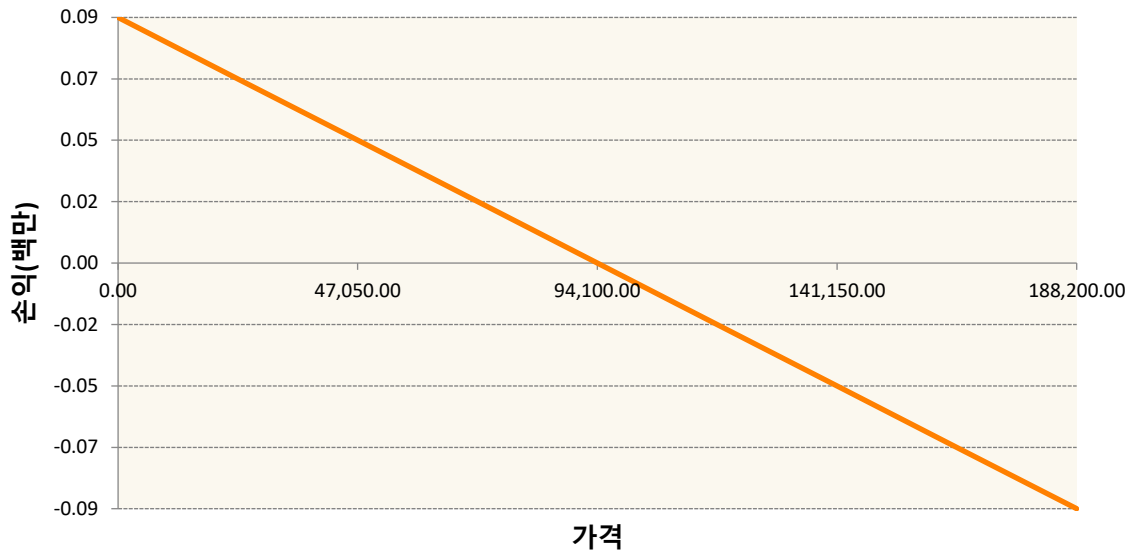
KR41CRTC0004-2023-12 LG생활건강개별선물



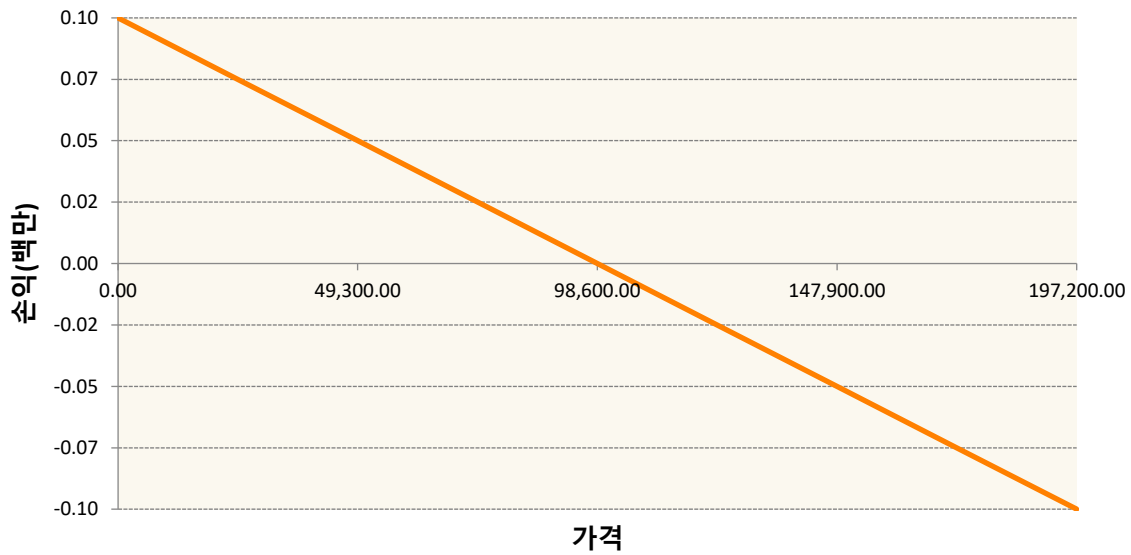
KR41DZTC0003-2023-12 한세실업개별선물



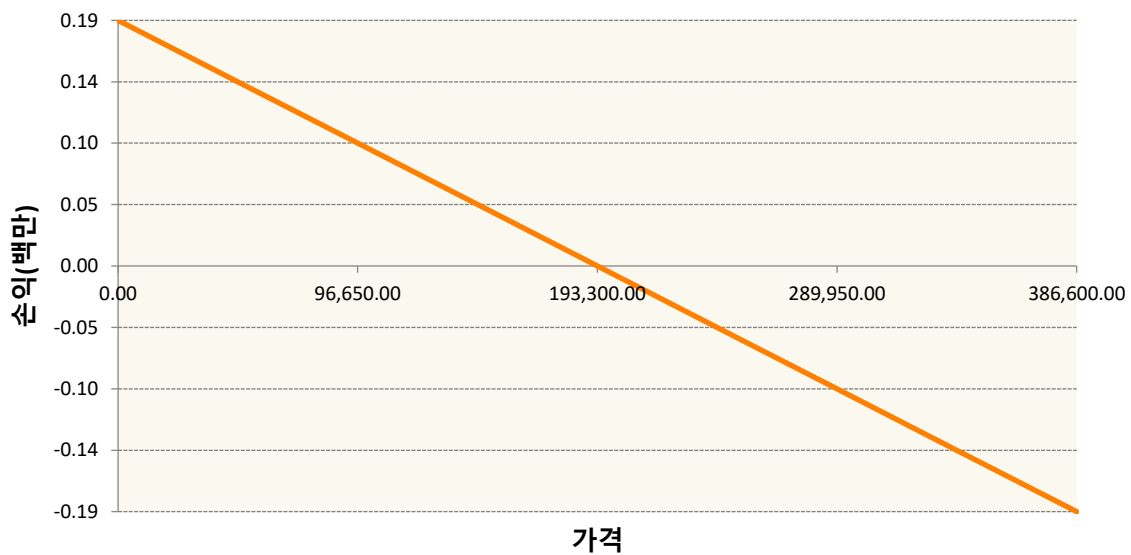
KR41E4TC0005-2023-12 에스엠개별선물



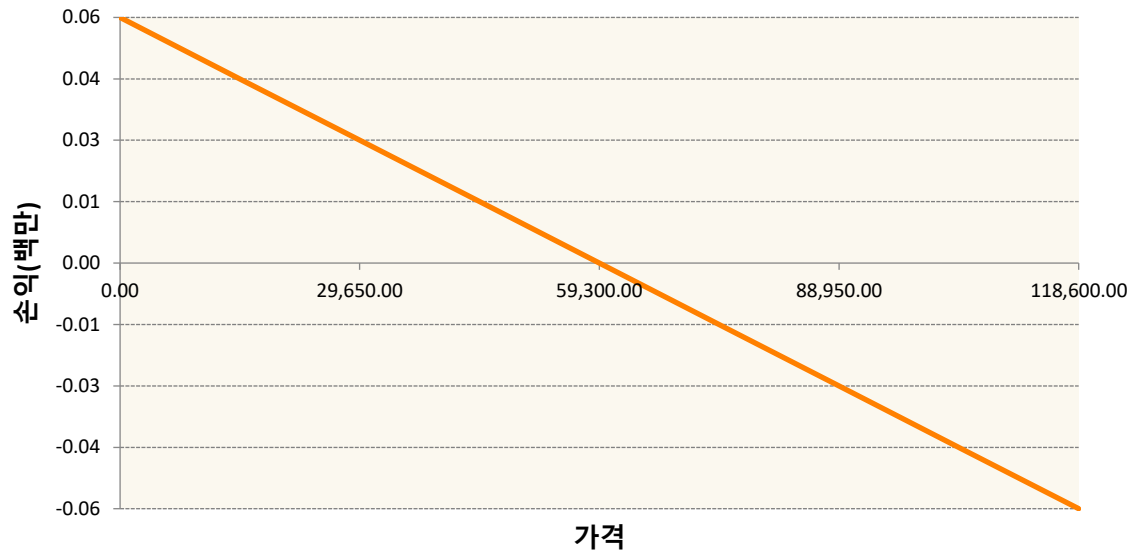
KR41EFTC0006-2023-12 JYP Ent.개별선물



KR41F8TC0008-2023-12 크래프톤개별선물



KR41FNTC0005-2023-12 위메이드개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101TC00 2023-12 코스피200지수선물	203
KR4113TC00 2023-12 POSCO개별선물	2
KR4154TC00 2023-12 이마트개별선물	1
KR41C6TC00 2023-12 아모레퍼시픽개별선물	3
KR41CFTC00 2023-12 카카오개별선물	2
KR41CNTC00 2023-12 포스코 ICT개별선물	2
KR41CRTC00 2023-12 LG생활건강개별선물	2
KR41DZTC00 2023-12 한세실업개별선물	2
KR41E4TC00 2023-12 에스엠개별선물	5
KR41EFTC00 2023-12 JYP Ent.개별선물	2
KR41F8TC00 2023-12 크래프톤개별선물	2
KR41FNTC00 2023-12 위메이드개별선물	3

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

(단위:백만원)

279

공시일	2023-11-15
기준일	2023-11-14

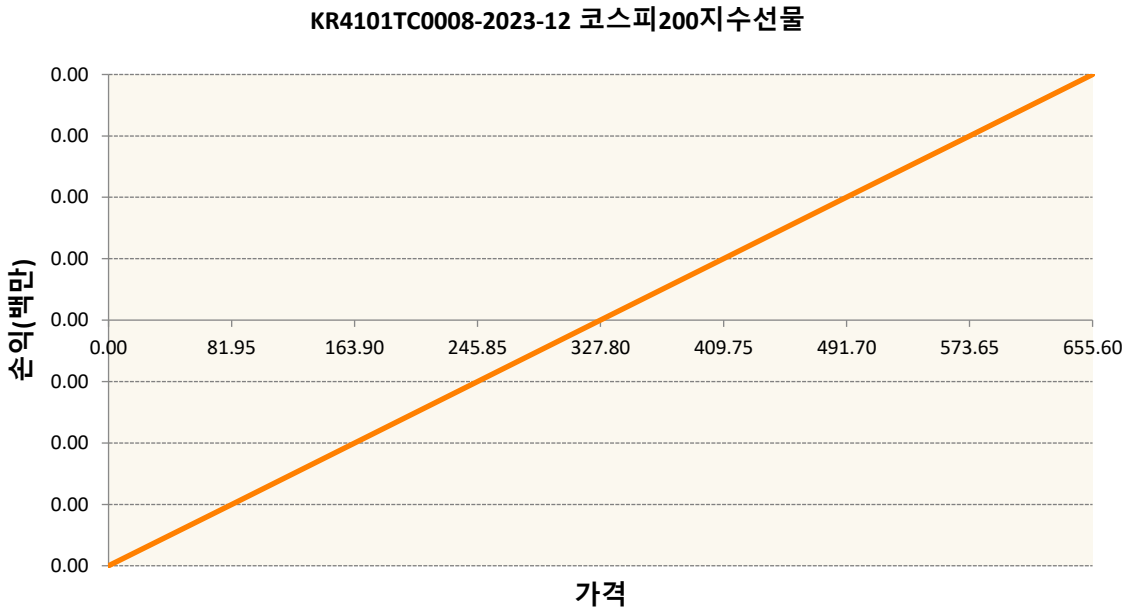
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

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	2,868	0	2,868	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101TC0008		2023-12 코스피200지수선물					229
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-229	-229	-229	-229	-229	-229	-229
-5.33%	-152	-152	-152	-152	-152	-152	-152
-2.67%	-76	-76	-76	-76	-76	-76	-76
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	76	76	76	76	76	76	76
5.33%	152	152	152	152	152	152	152
8.00%	229	229	229	229	229	229	229

공시일	2023-11-15
기준일	2023-11-14

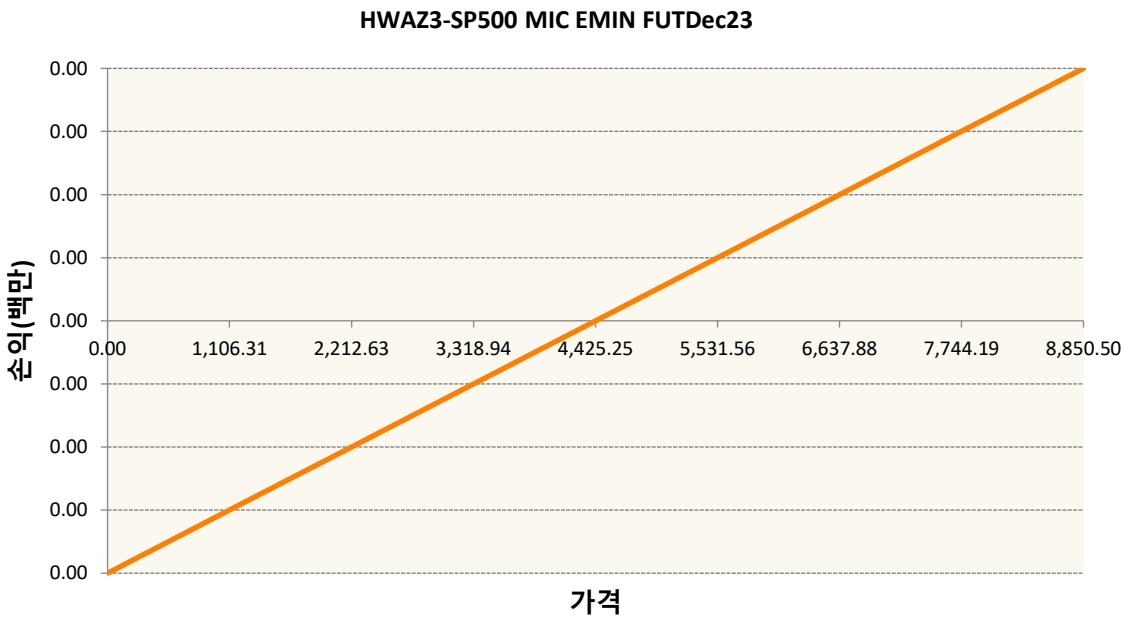
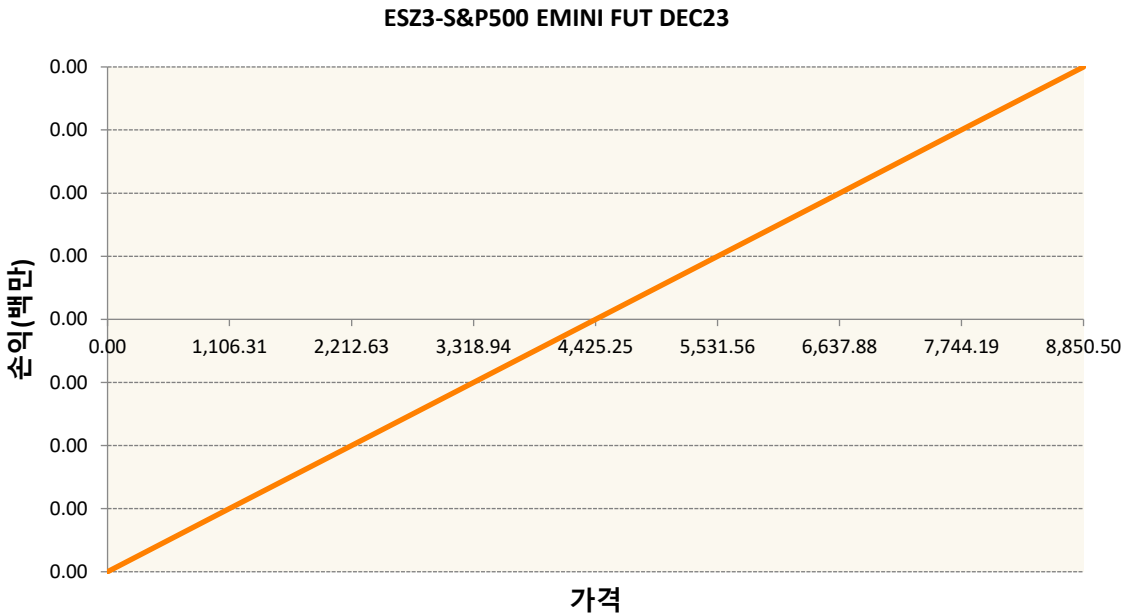
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

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	299	0	299	
누계	유가증권	선물	1,238	0	1,238	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESZ3	S&P500 EMINI FUT DEC23	24
HWAZ3	SP500 MIC EMIN FUTDec23	99

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	110

공시일	2023-11-15
기준일	2023-11-14

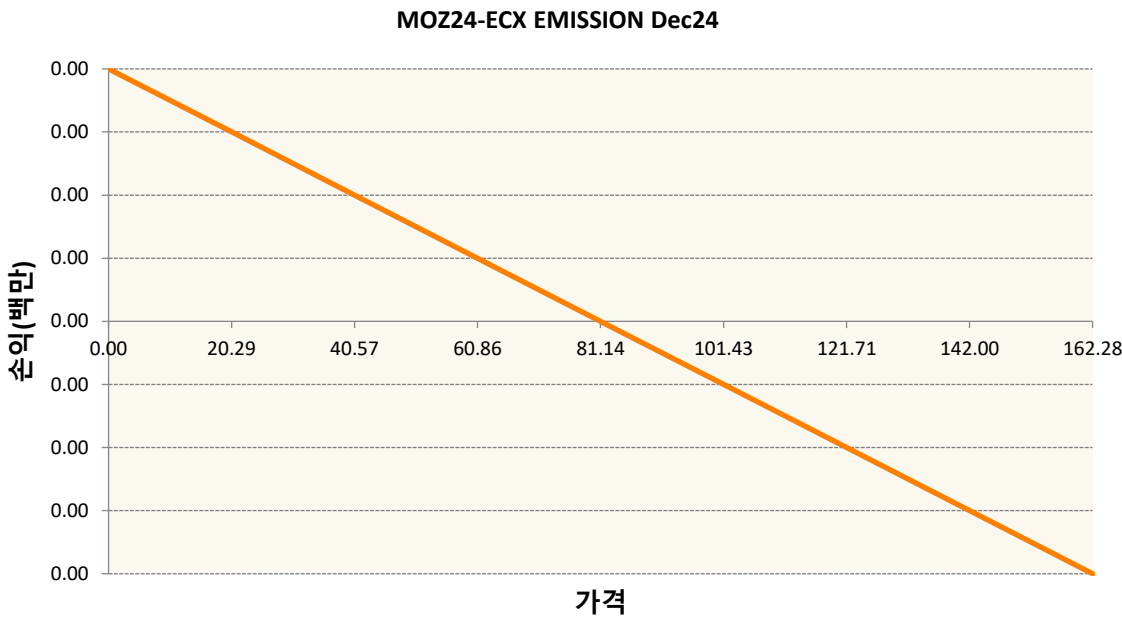
SOL유럽탄소배출권선물인버스ICE특별자산상

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	5,180	-5,180	
누계	지수	스왑	479	0	479	장외
누계	통화	선도	0	2,239	-2,239	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213DAT KRW/EUR 30-11-23E	49
FXW213DAT KRW/EUR 30-11-23E	130
MOZ24 ECX EMISSION Dec24	414
SWICEUACN ICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX	3

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

(단위:백만원)

871

공시일	2023-11-15
기준일	2023-11-14

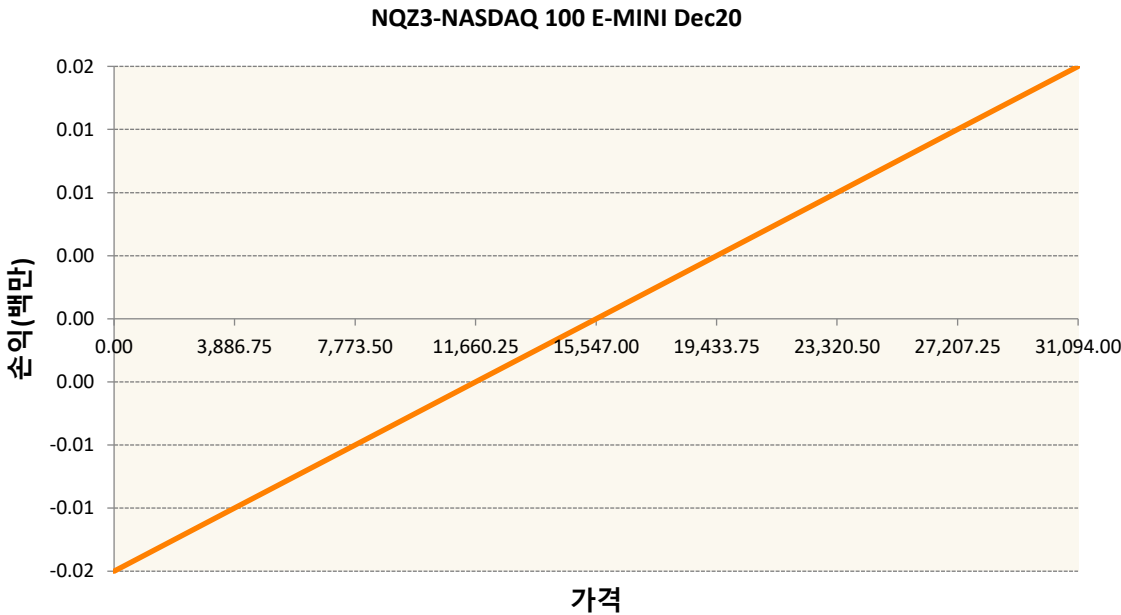
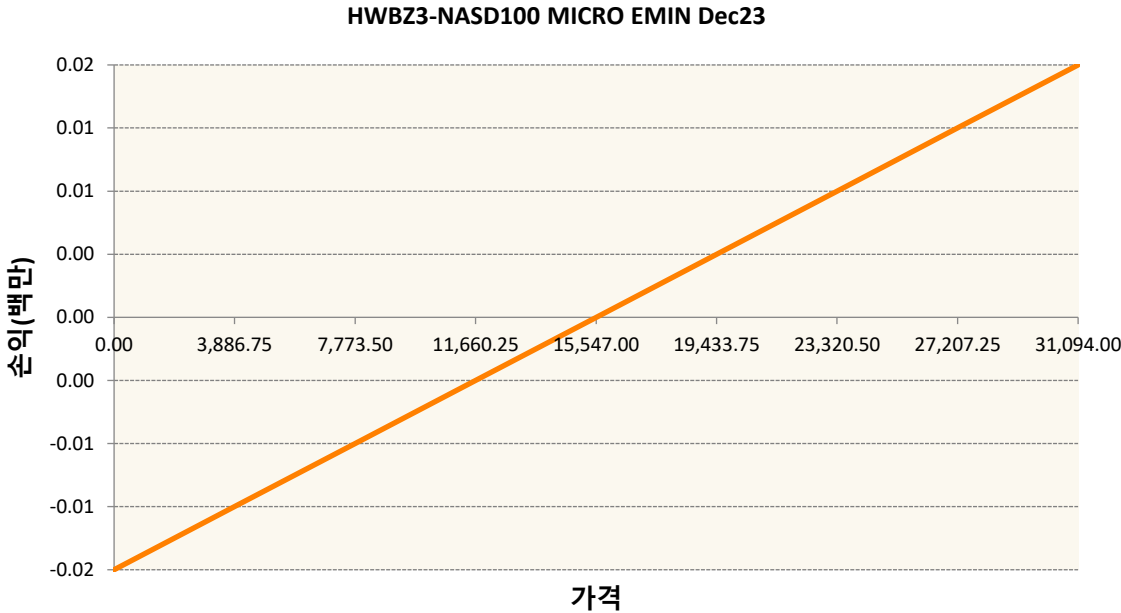
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

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	420	0	420	
누계	유가증권	선물	2,398	0	2,398	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HWBZ3	NASD100 MICRO EMIN Dec23	192
NQZ3	NASDAQ 100 E-MINI Dec20	34

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	212

공시일	2023-11-15
기준일	2023-11-14

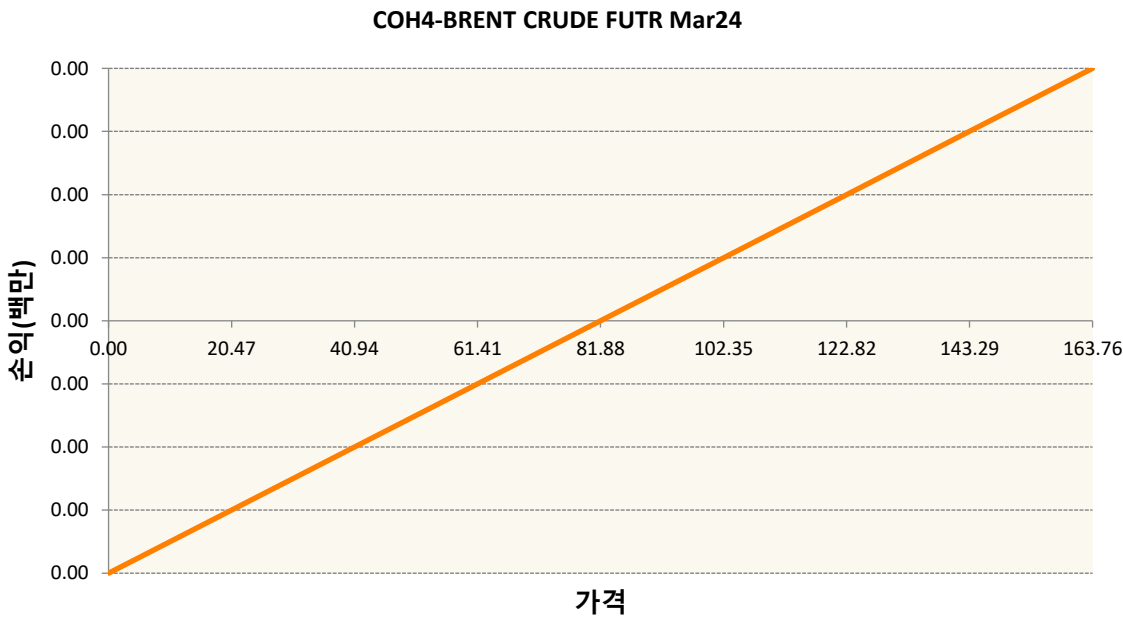
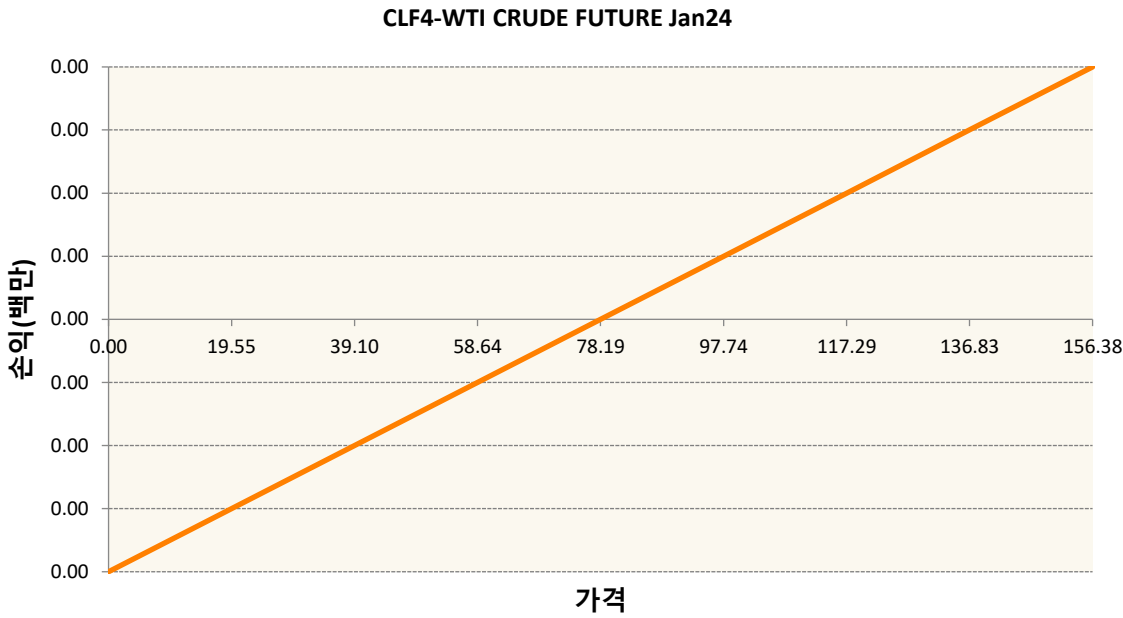
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

1. 계약금액

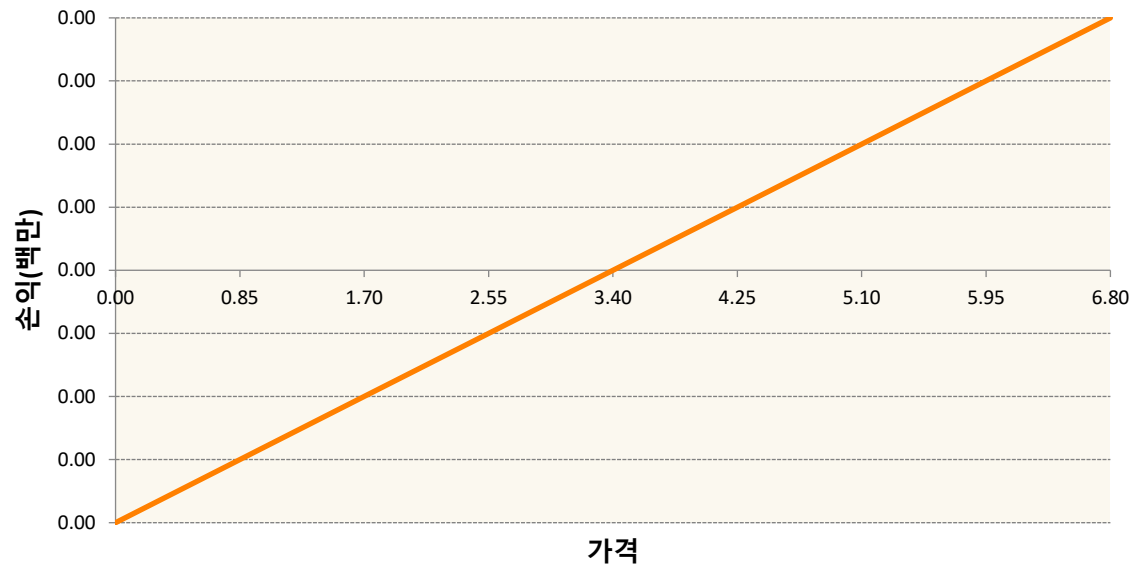
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	26	-26	장내
누계	유가증권	선물	1,355	0	1,355	
누계	통화	선물	0	199	-199	장내

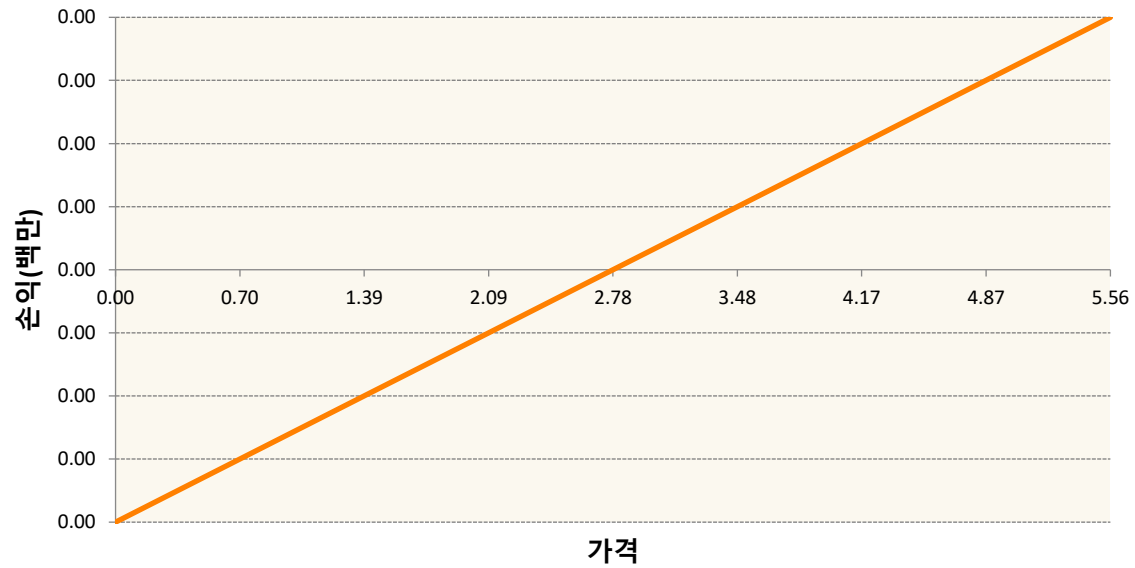
2. 만기시점의 손익구조



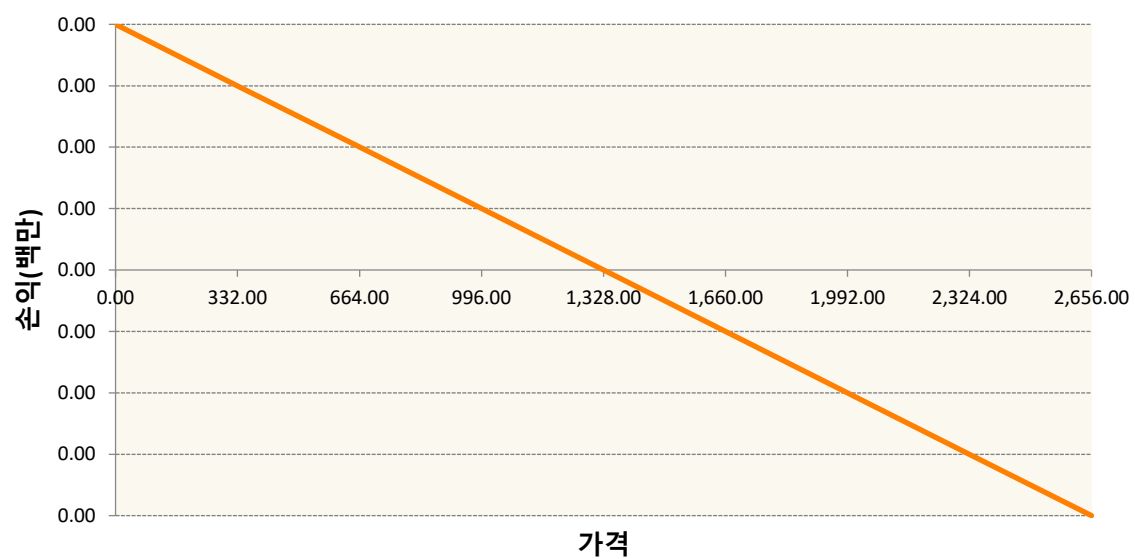
EOF4-E-MINI NATURAL GAS Jan24



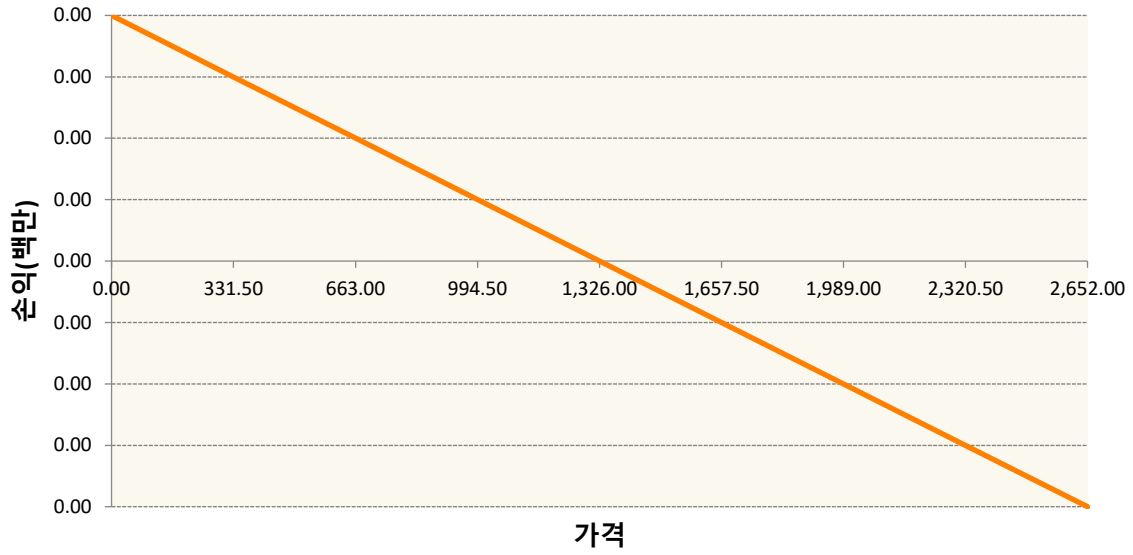
HOF4-NY Harb ULSD Fut Jan24



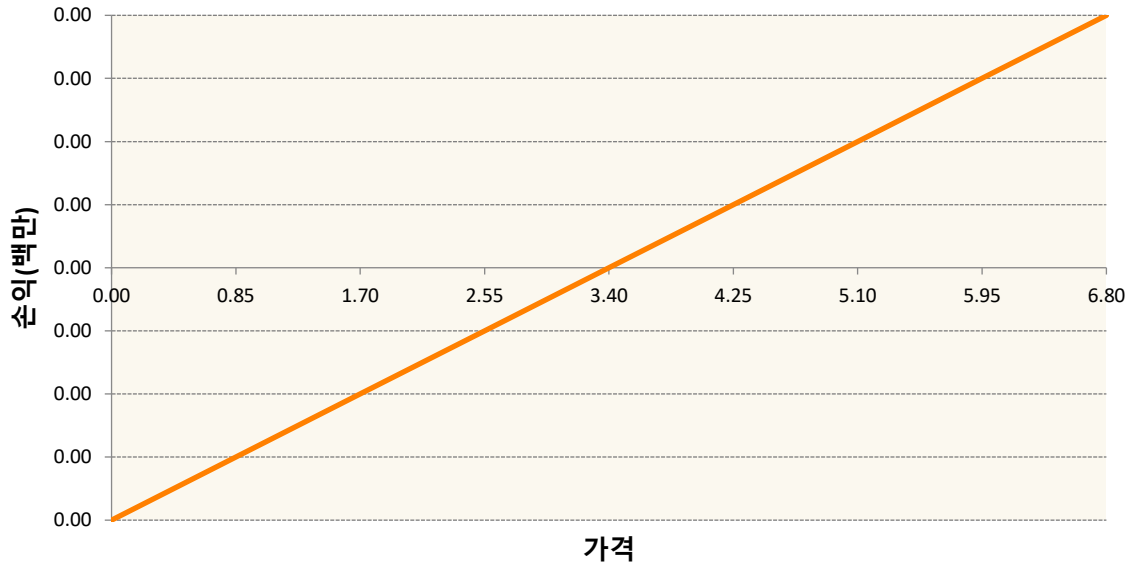
KR4175TB0000-2023-11 달러선물



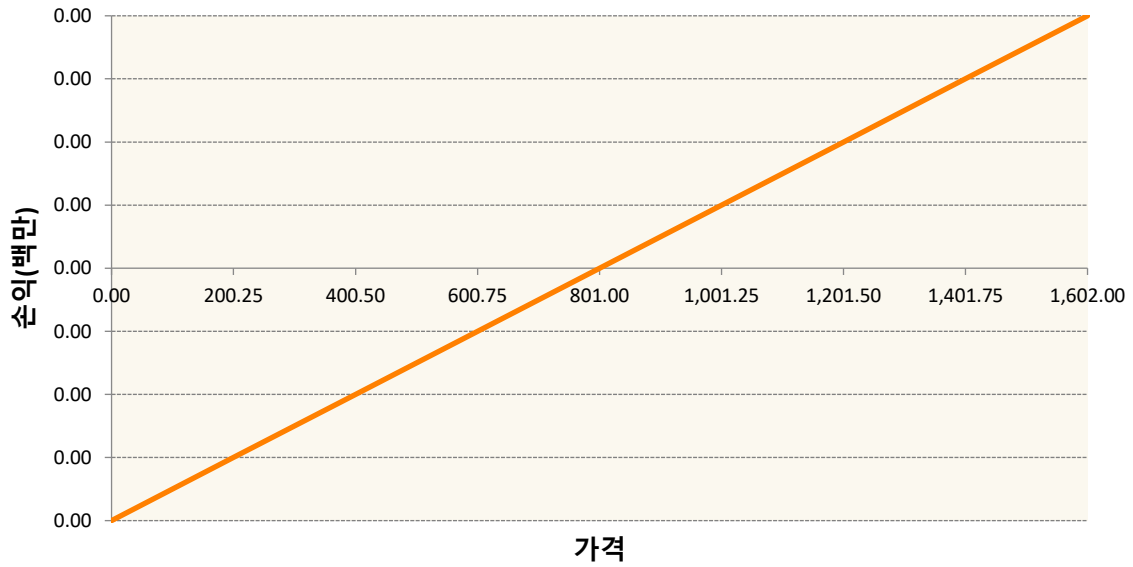
KR4175TC0009-2023-12 달러선물

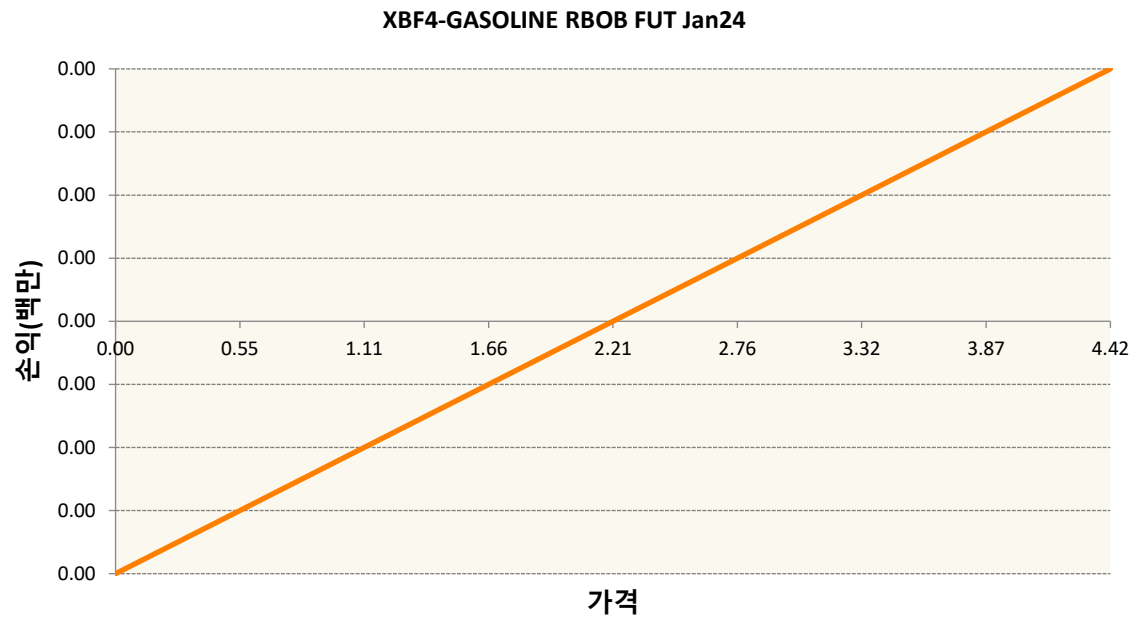


NGF24-NATURAL GAS FUTR Jan24



QSF4-Low Su Gasoil G Jan24





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
CLF4	WTI CRUDE FUTURE Jan24	25
COH4	BRENT CRUDE FUTR Mar24	26
EOF4	E-MINI NATURAL GAS Jan24	5
HOF4	NY Harb ULSD Fut Jan24	12
KR4175TB00 2023-11 달러선물		14
KR4175TC00 2023-12 달러선물		2
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)
	282