

공시일	2023-11-16
기준일	2023-11-15

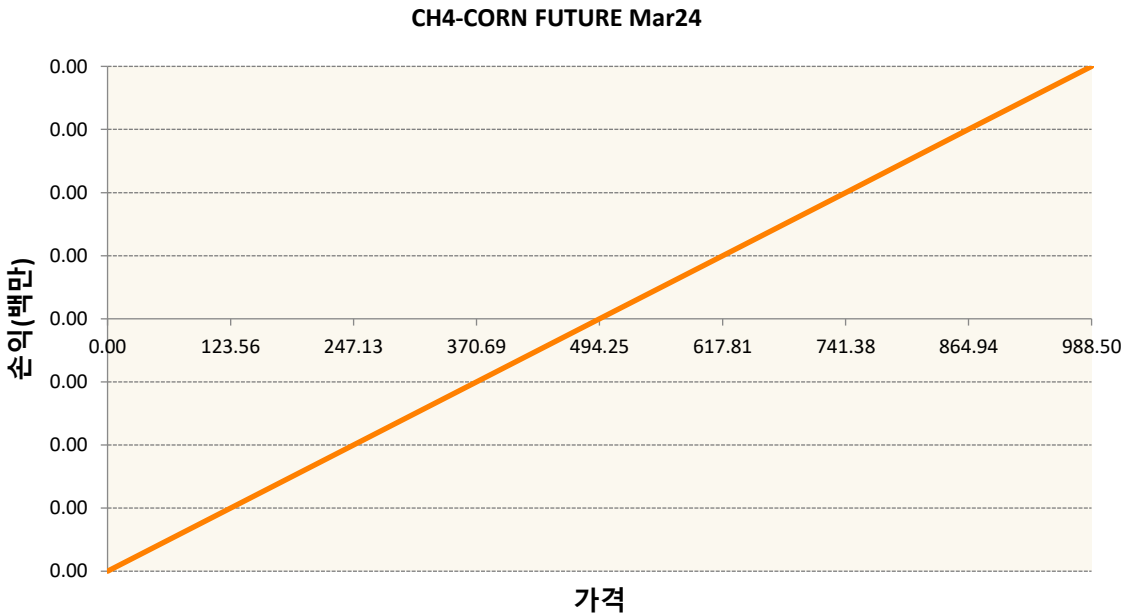
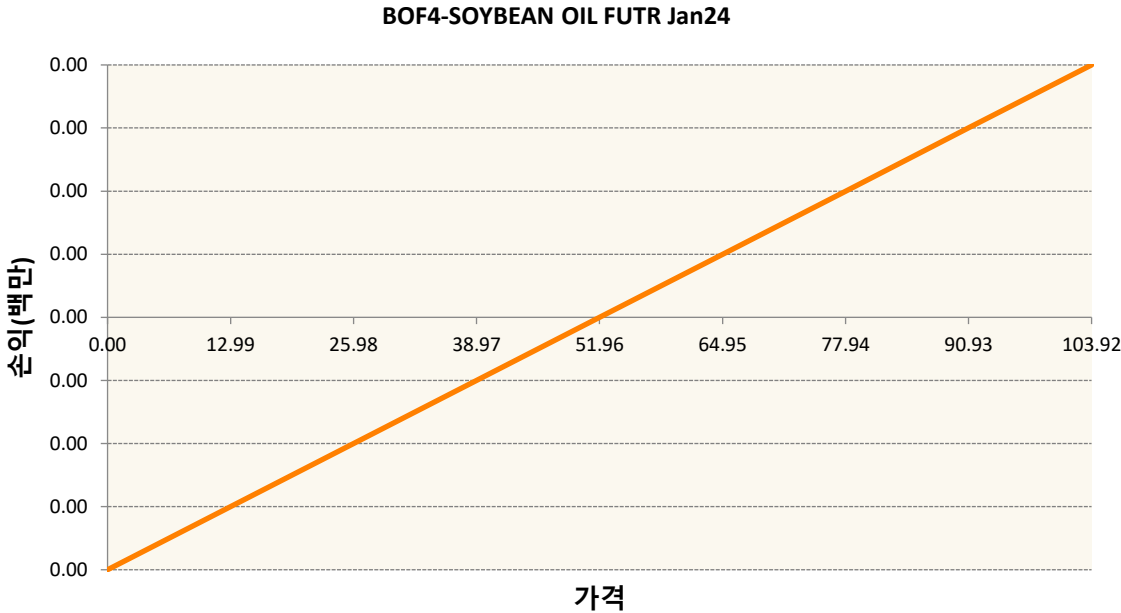
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

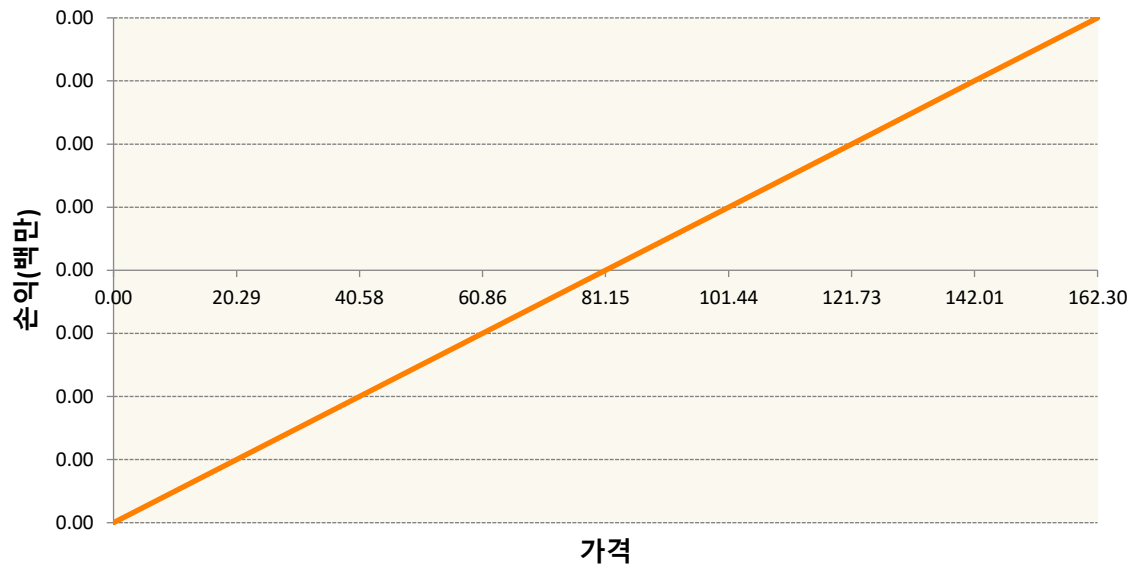
(단위:USD 백만)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	52	-52	장내
누계	유가증권	선물	4,979	0	4,979	
누계	통화	선물	0	742	-742	장내

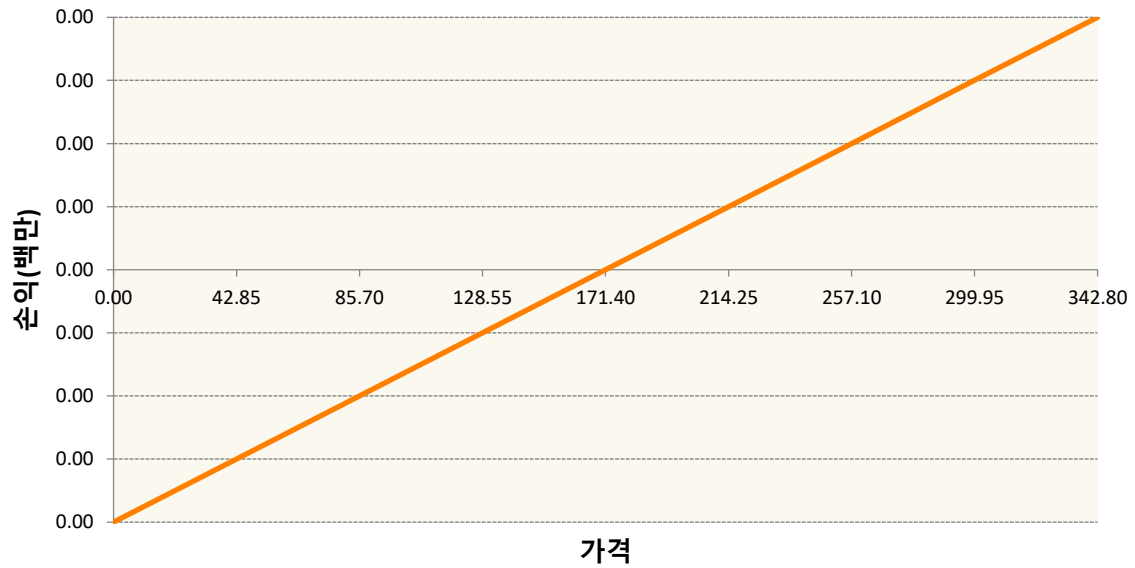
2. 만기시점의 손익구조



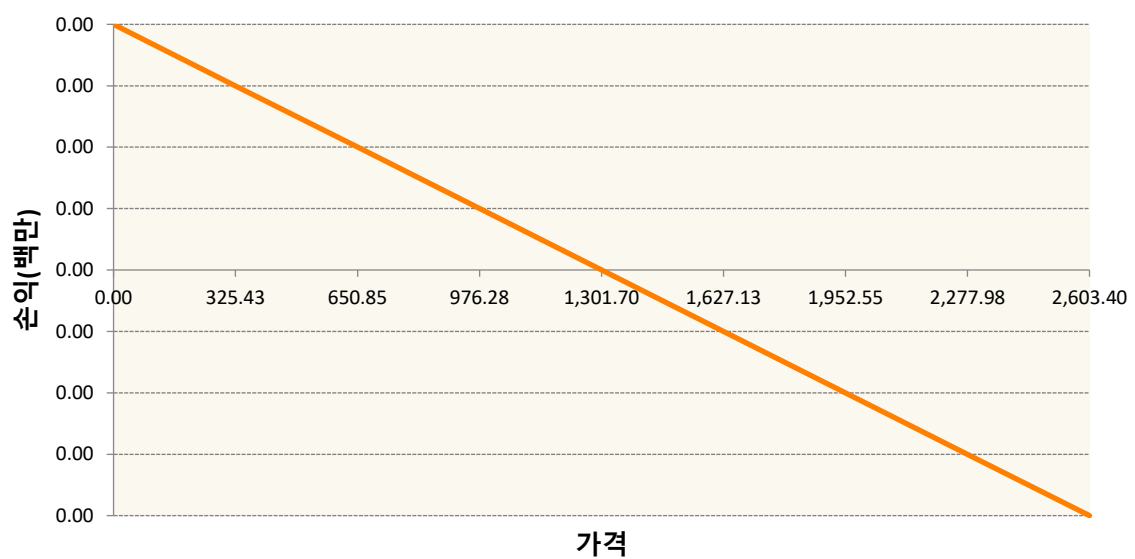
CTH4-COTTON NO.2 FUTR Mar24



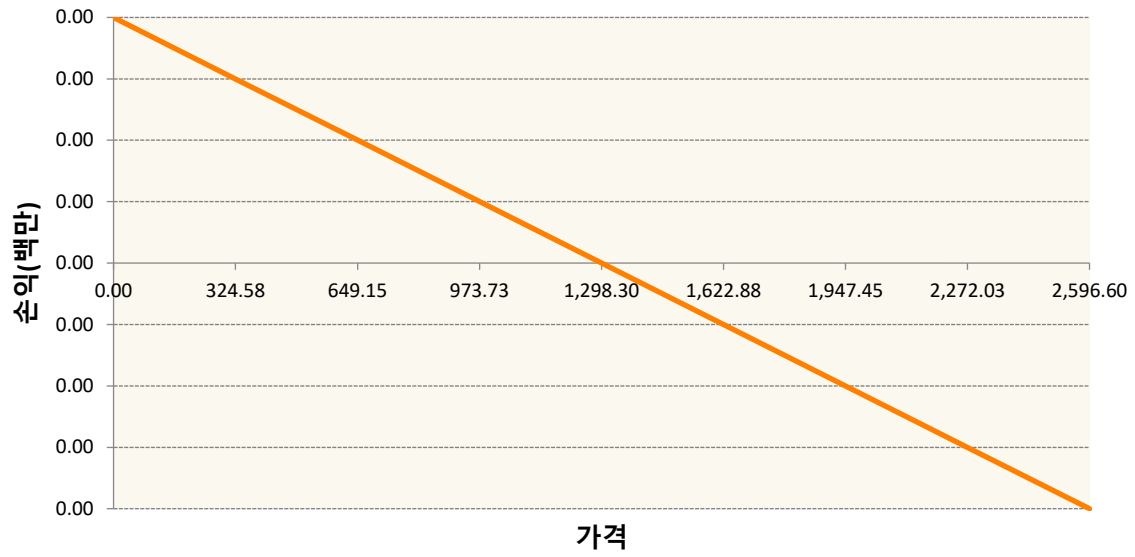
KCH4-COFFEE 'C' FUTURE Mar24



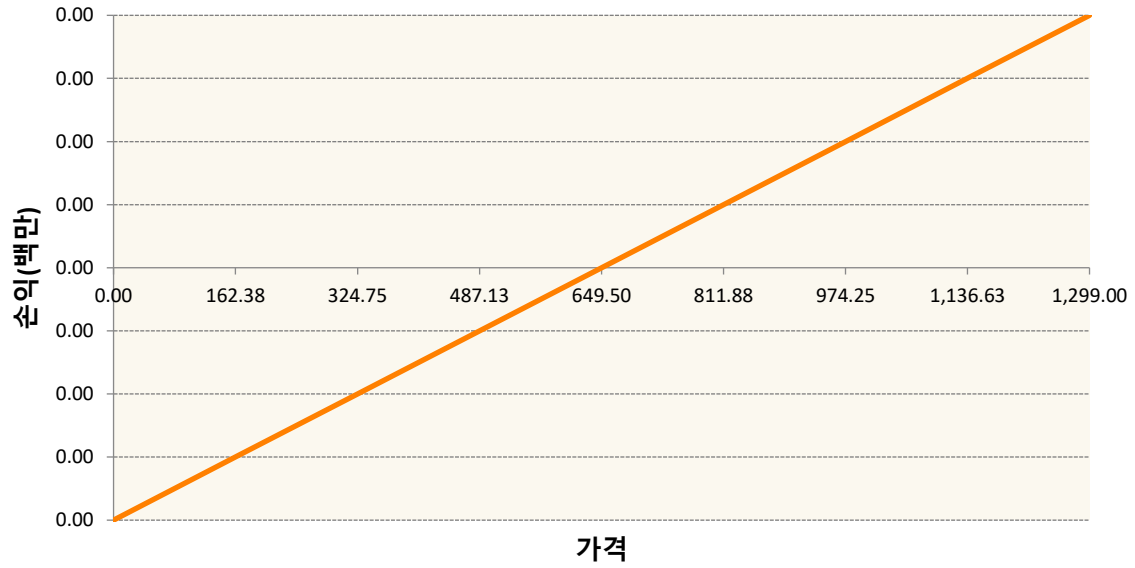
KR4175TB0000-2023-11 달러선물



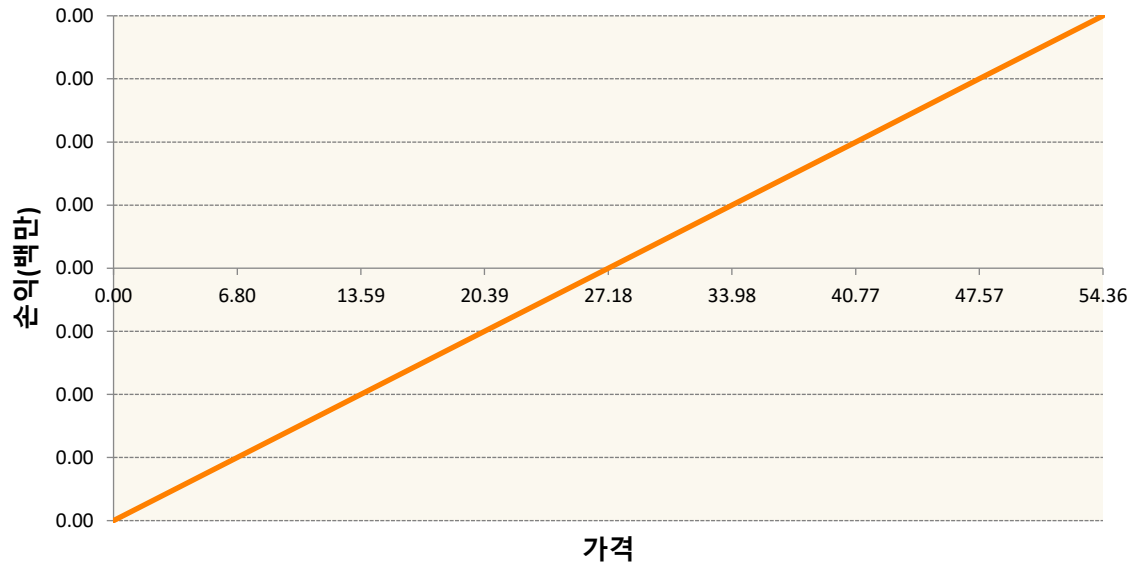
KR4175TC0009-2023-12 달러선물



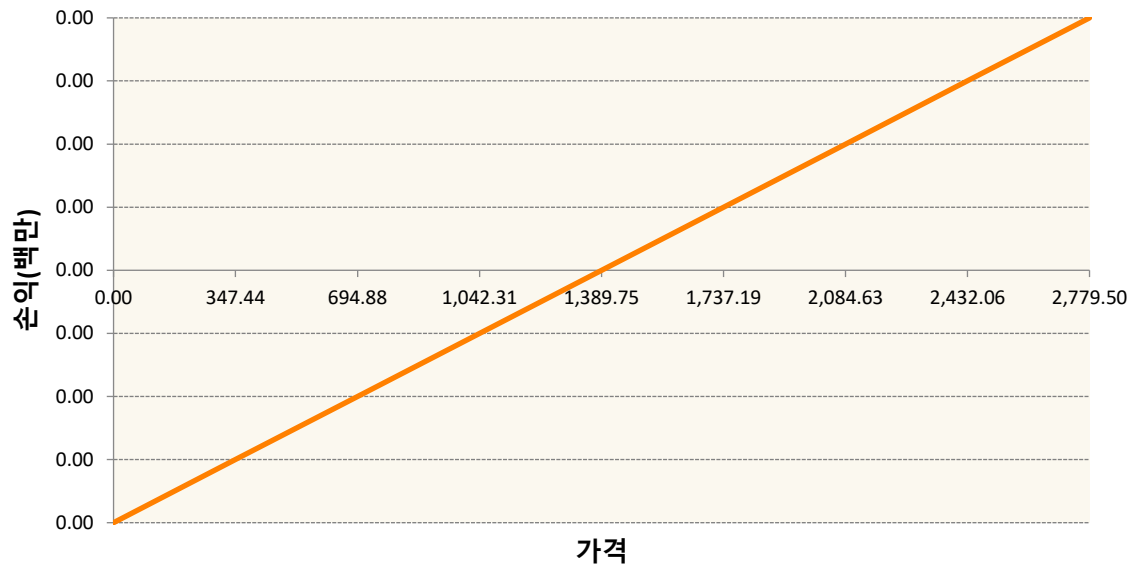
KWH4-KC HRW WHEAT FUT Mar24



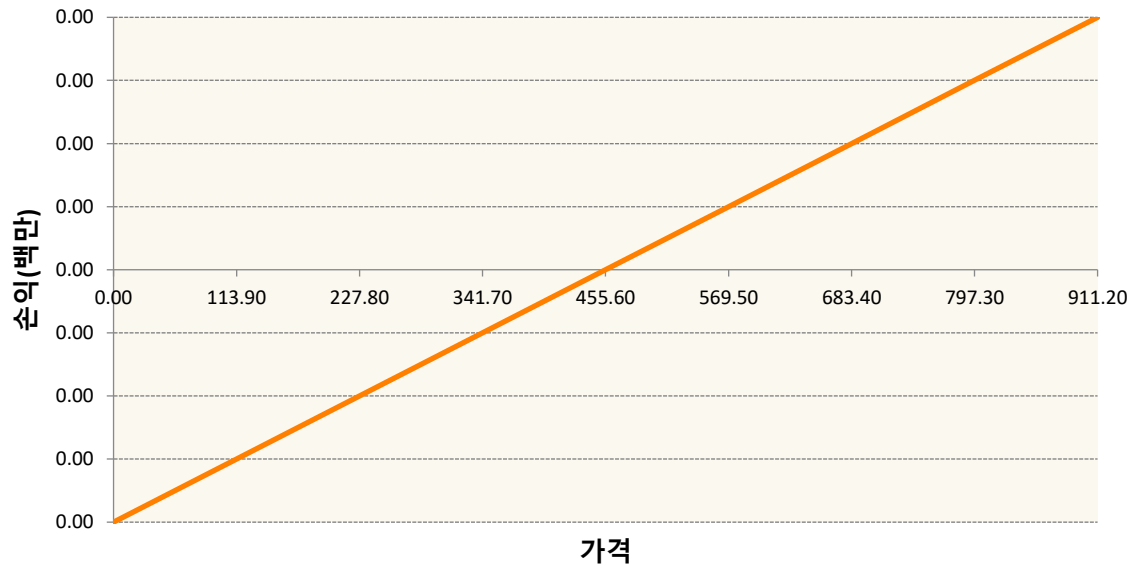
SBH4-Sugar #11 (WORLD) Mar24



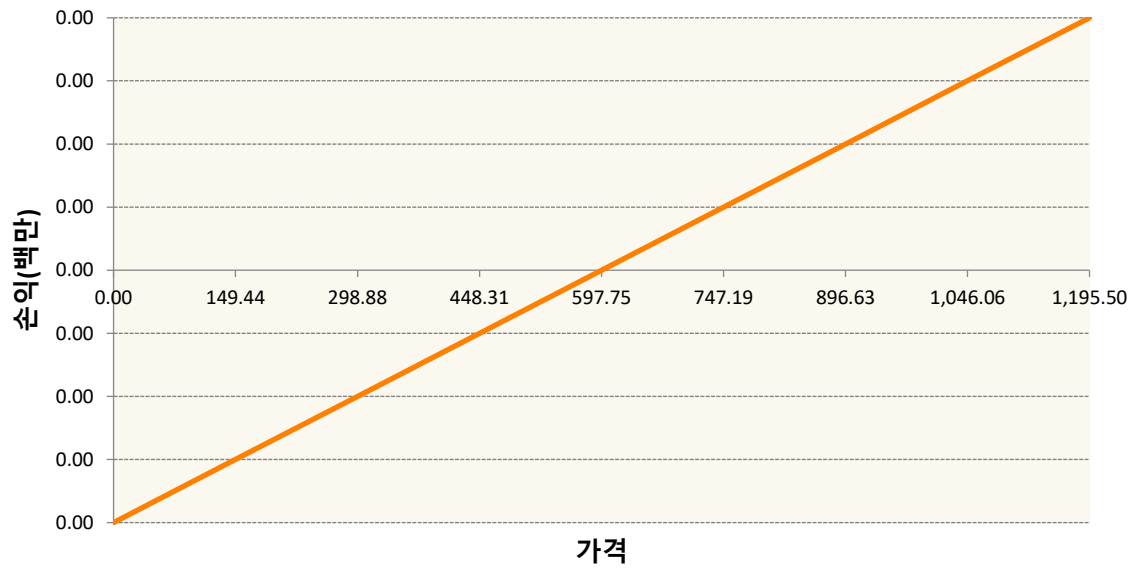
SF4-SOYBEAN FUTURE Jan24



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	2023-11-16
기준일	2023-11-15

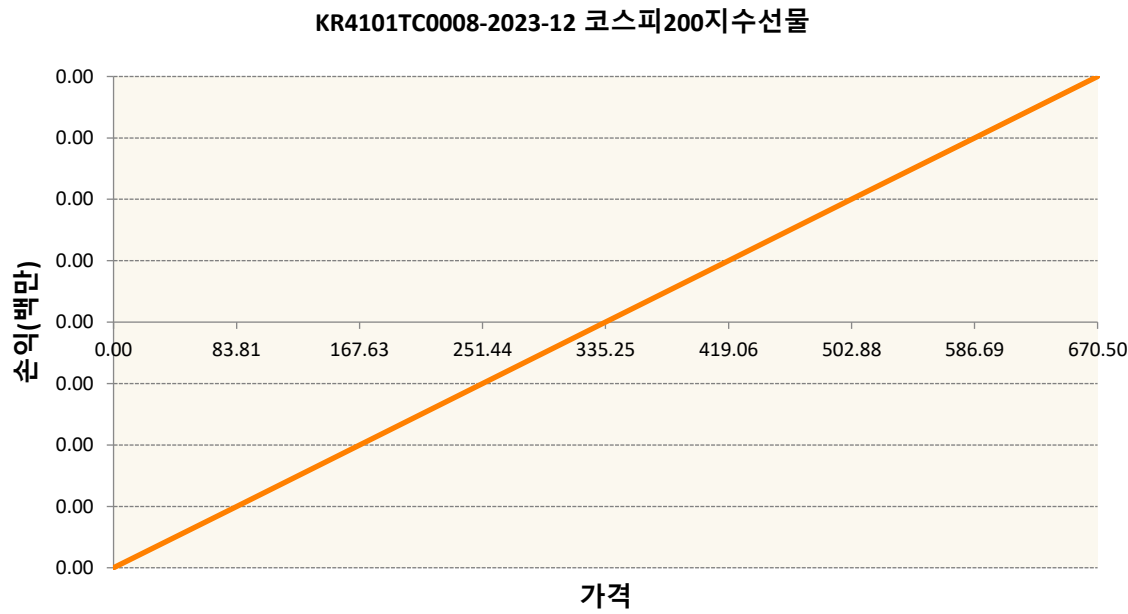
스마트인덱스모

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	1,425	0	1,425	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101TC0008			2023-12 코스피200지수선물				114
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-114	-114	-114	-114	-114	-114	-114
-5.33%	-76	-76	-76	-76	-76	-76	-76
-2.67%	-38	-38	-38	-38	-38	-38	-38
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	38	38	38	38	38	38	38
5.33%	76	76	76	76	76	76	76
8.00%	114	114	114	114	114	114	114

공시일	2023-11-16
기준일	2023-11-15

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)

281

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2023-11-16
기준일	2023-11-15

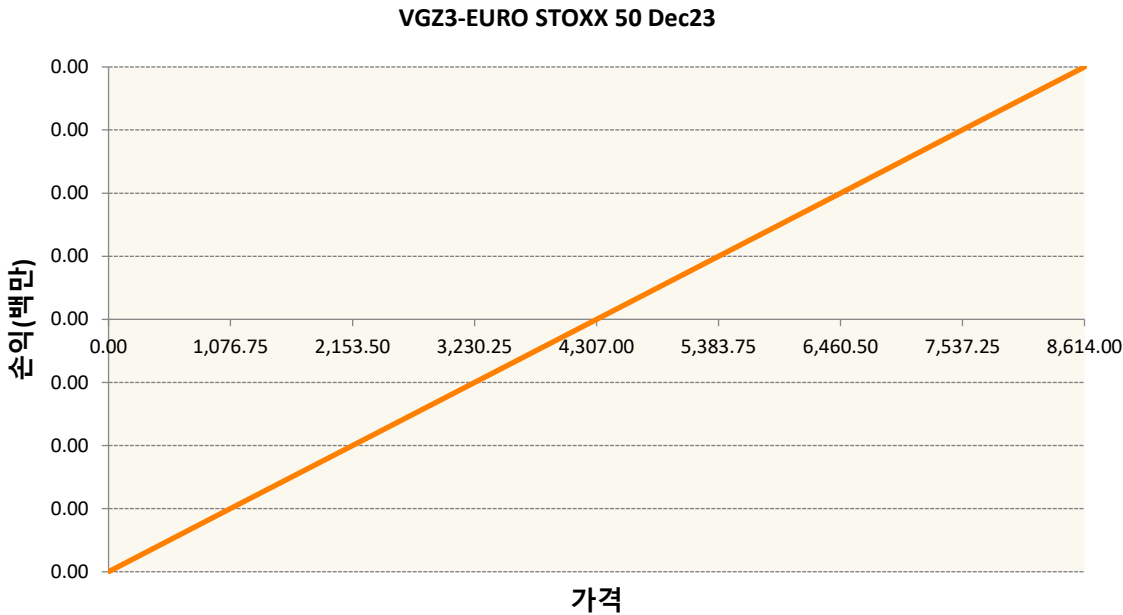
유로인덱스모(주식-파생형)

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	980	0	980	
누계	통화	선도	212	0	212	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
FXW213D9M EUR/KRW 22-12-23E			17
VGZ3	EURO STOXX 50 Dec23		78

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	76

공시일	2023-11-16
기준일	2023-11-15

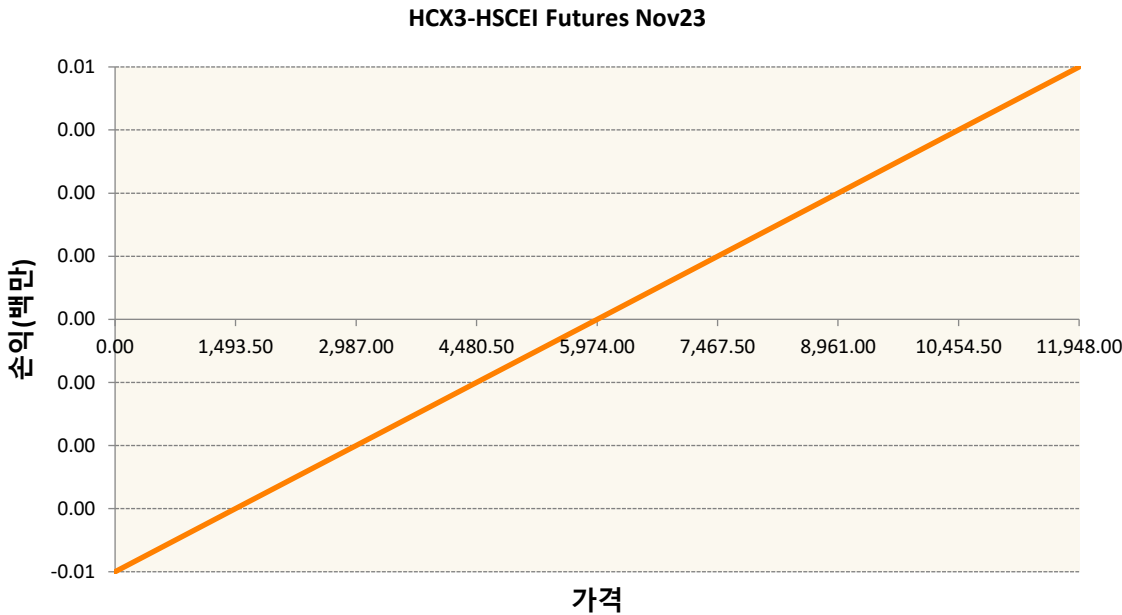
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,182	0	1,182	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HGX3	HSCEI Futures Nov23	95
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

137

공시일	2023-11-16
기준일	2023-11-15

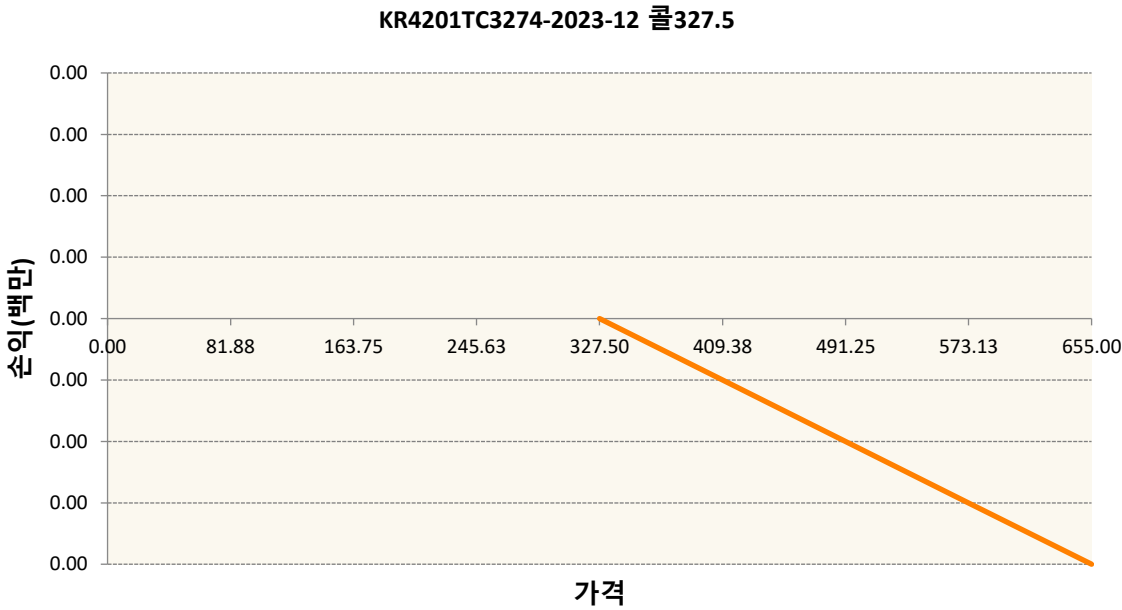
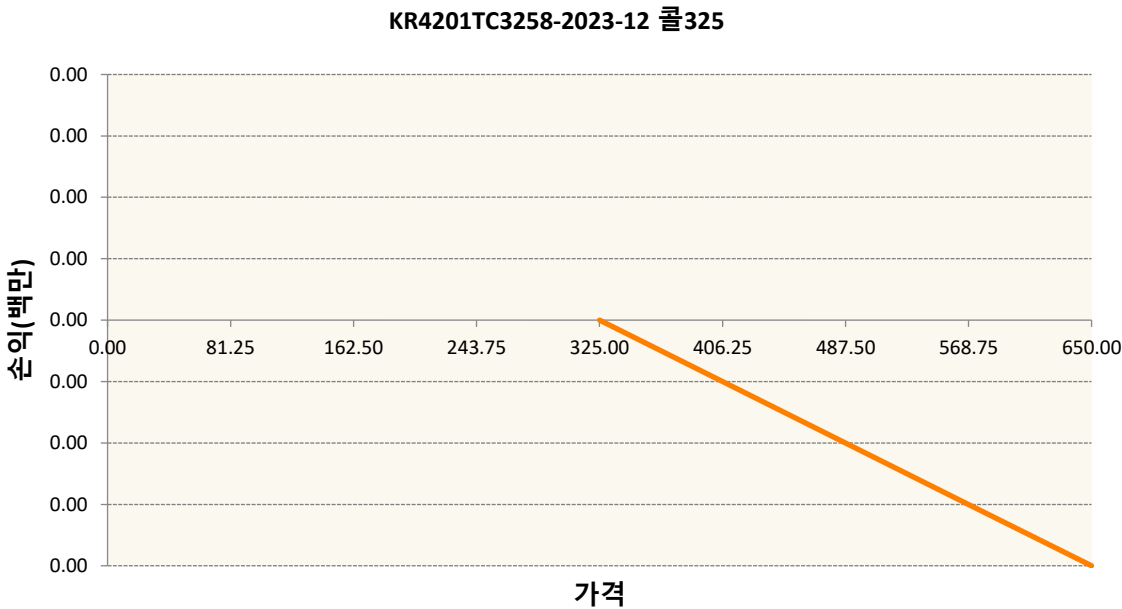
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

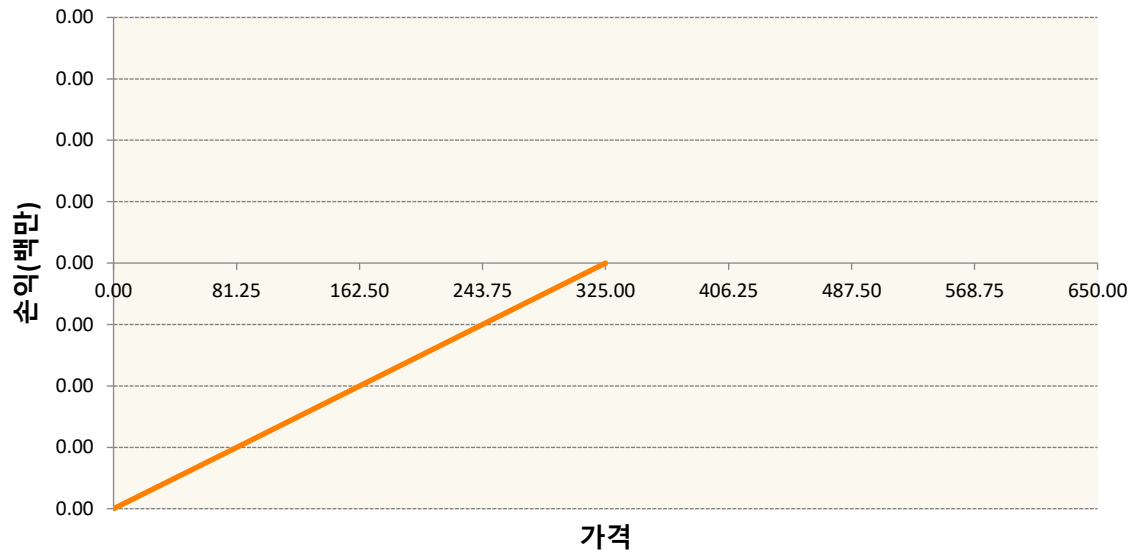
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	484	0	484	장내
누계	유가증권	옵션	0	51,721	-51,721	장내

2. 만기시점의 손익구조



KR4301TC3257-2023-12 풋325



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201TC3258			2023-12 콜325				2,761
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,334	1,314	1,290	1,262	1,231	1,197	1,160
-5.33%	1,193	1,147	1,099	1,050	1,000	949	896
-2.67%	813	754	696	637	578	520	461
0%	141	96	49	0	-50	-102	-155
2.67%	-743	-764	-790	-819	-852	-888	-926
5.33%	-1,721	-1,728	-1,737	-1,750	-1,767	-1,787	-1,810
8.00%	-2,725	-2,726	-2,729	-2,733	-2,740	-2,749	-2,761
KR4201TC3274			2023-12 콜327.5				438
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	188	186	183	179	175	170	165
-5.33%	172	165	159	151	144	136	128
-2.67%	122	113	103	94	84	75	65
0%	26	17	9	0	-9	-18	-27
2.67%	-111	-115	-120	-126	-132	-139	-146
5.33%	-267	-269	-271	-274	-277	-281	-286
8.00%	-430	-430	-431	-432	-433	-435	-438
KR4301TC3257			2023-12 풋325				447
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-349	-364	-379	-395	-412	-429	-447
-5.33%	-169	-189	-209	-229	-250	-271	-292
-2.67%	-32	-54	-76	-98	-120	-142	-164
0%	61	41	21	0	-21	-42	-63

2.67%	115	100	84	67	49	31	12
5.33%	142	133	122	109	96	81	65
8.00%	154	149	142	134	125	114	102

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

(단위:백만원)

3,855

공시일	2023-11-16
기준일	2023-11-15

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	1,934	0	1,934	

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	2023-11-16
기준일	2023-11-15

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	4,460	0	4,460	

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	2023-11-16
기준일	2023-11-15

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	16,850	0	16,850	
누계	통화	선도	0	16,618	-16,618	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
FXW213D8W KRW/USD 30-11-23E		592
FXW213D9R KRW/USD 29-12-23E		505
FXW213DAT KRW/USD 31-01-24E		186
FXW213DB7 KRW/USD 30-11-23E		47
IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	700

공시일	2023-11-16
기준일	2023-11-15

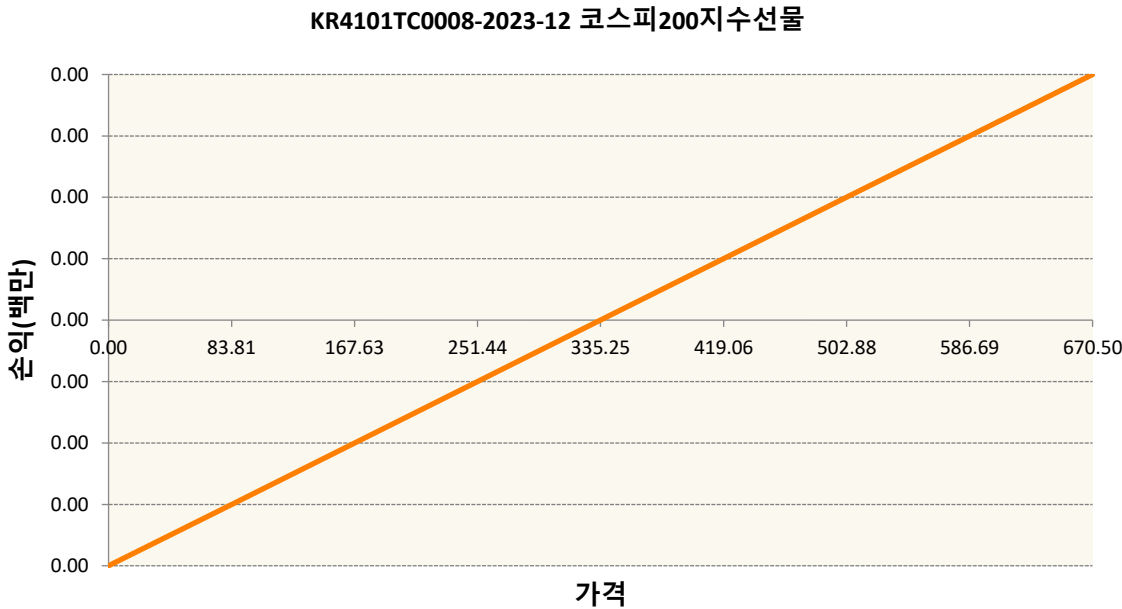
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

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	503	0	503	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101TC0008			2023-12 코스피200지수선물				40
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-40	-40	-40	-40	-40	-40	-40
-5.33%	-27	-27	-27	-27	-27	-27	-27
-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%	27	27	27	27	27	27	27
8.00%	40	40	40	40	40	40	40

공시일	2023-11-16
기준일	2023-11-15

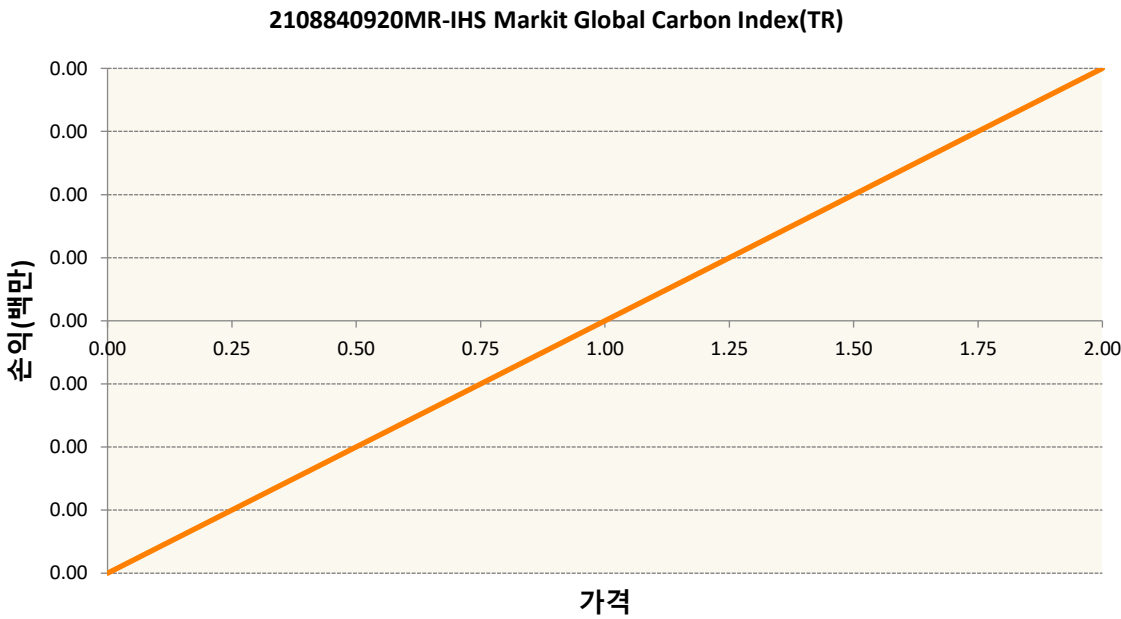
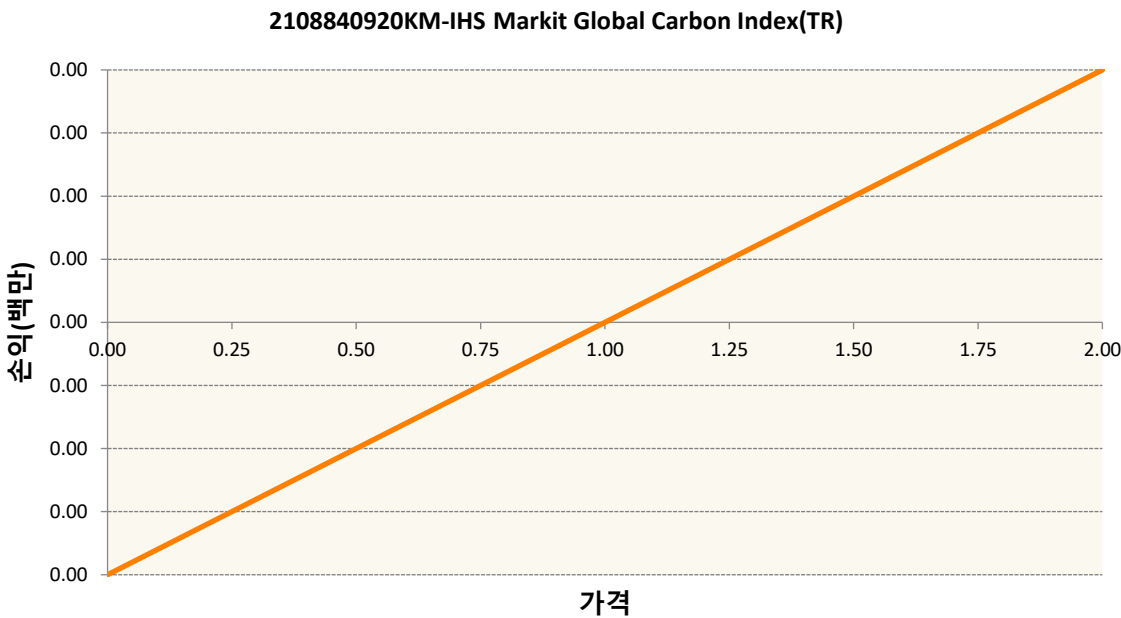
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

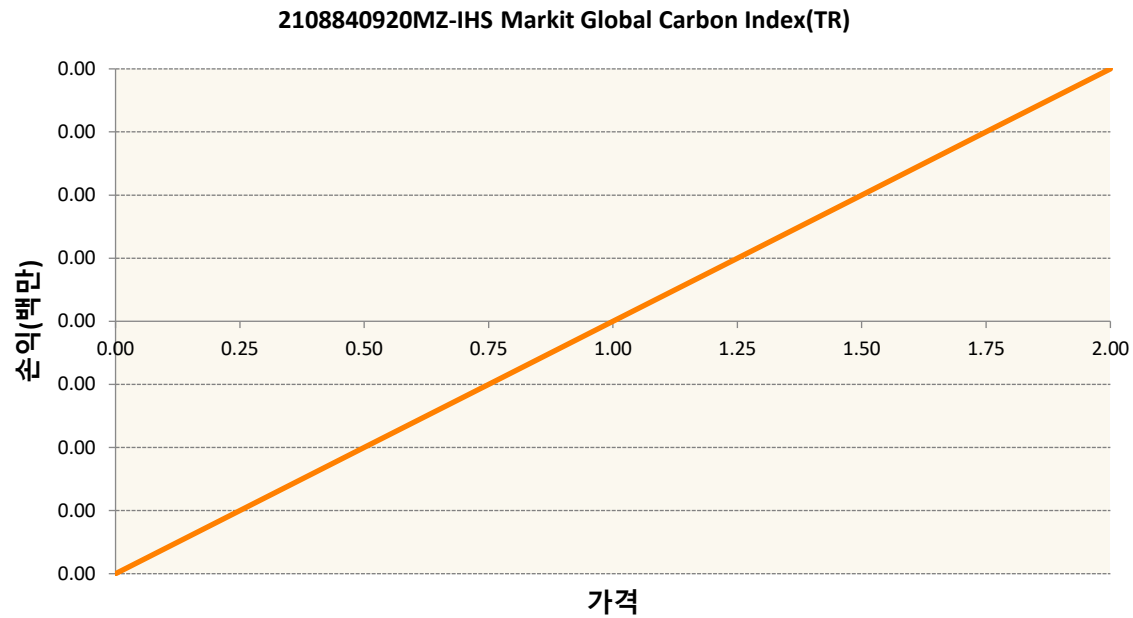
1. 계약금액

(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)		1,009
2108840920IHS Markit Global Carbon Index(TR)		202
2108840920IHS Markit Global Carbon Index(TR)		202

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,816

공시일	2023-11-16
기준일	2023-11-15

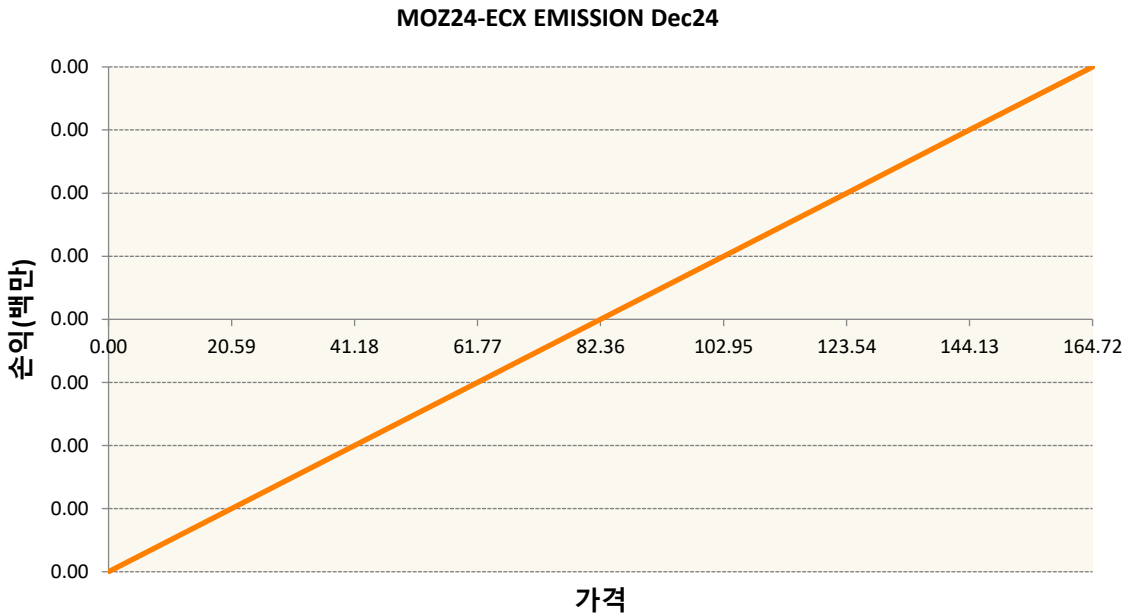
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	8,937	0	8,937	
누계	지수	스왑	479	0	479	장외
누계	통화	선도	0	1,442	-1,442	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213DAT KRW/EUR 30-11-23E	115
MOZ24 ECX EMISSION Dec24	715
SWICEUACN ICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX	2

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

(단위:백만원)

1,368

공시일	2023-11-16
기준일	2023-11-15

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)	7
SWCSI00000 신한CSI Index 230622 (메리츠)	7
SWCSI00000 신한CSI Index 230922 (키움)	5
SWCSI00000 신한CSI Index 231013 (NH)	6

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

(단위:백만원)

38

공시일	2023-11-16
기준일	2023-11-15

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)

14

공시일	2023-11-16
기준일	2023-11-15

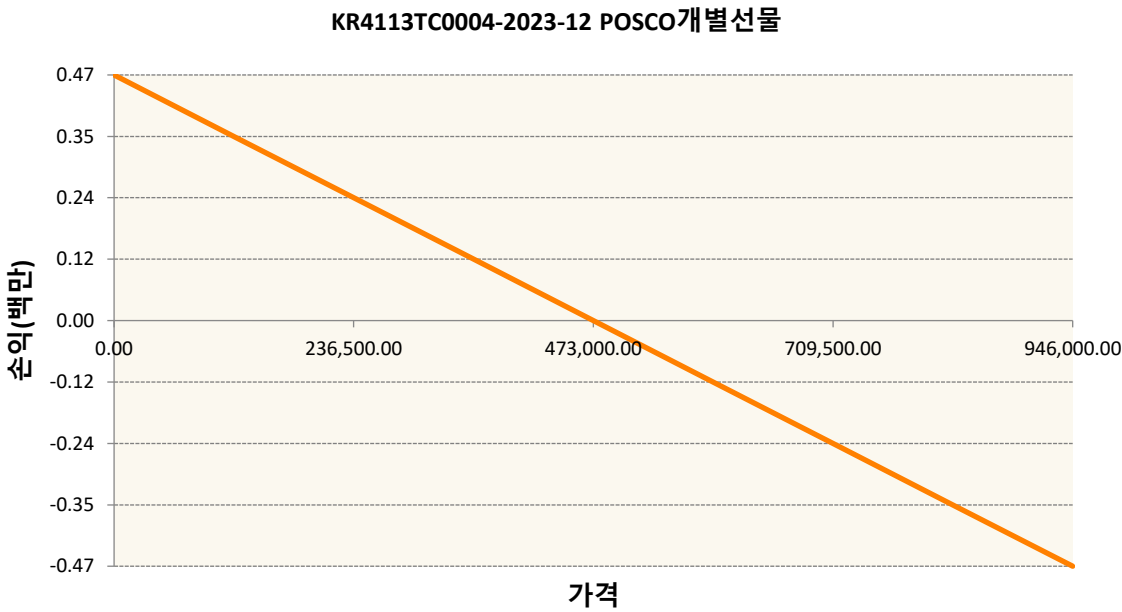
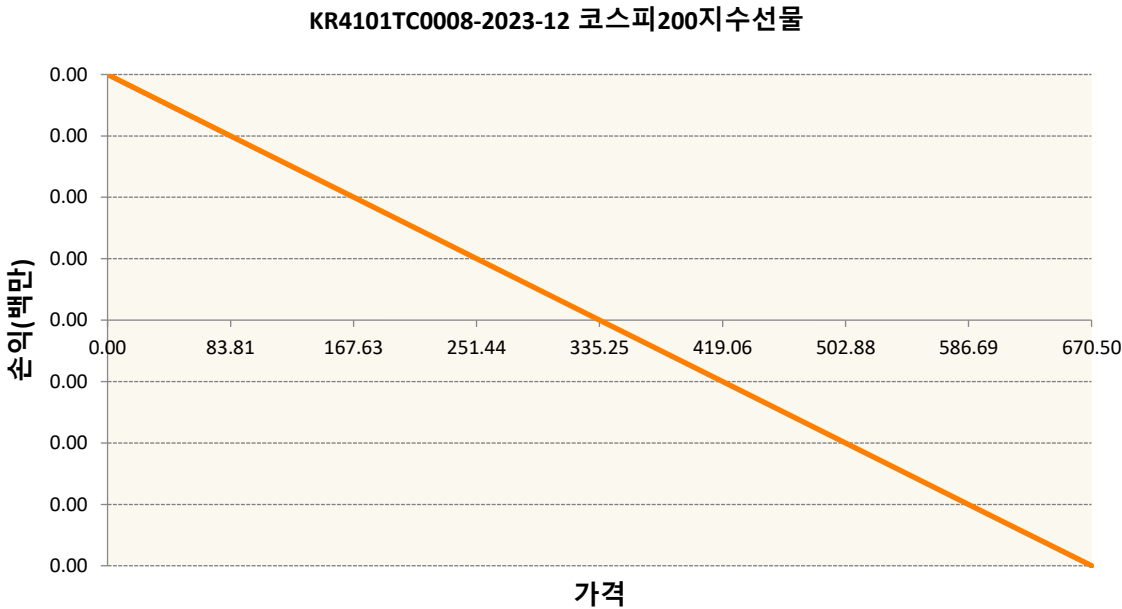
에퀴티알파일반사모혼합자산

1. 계약금액

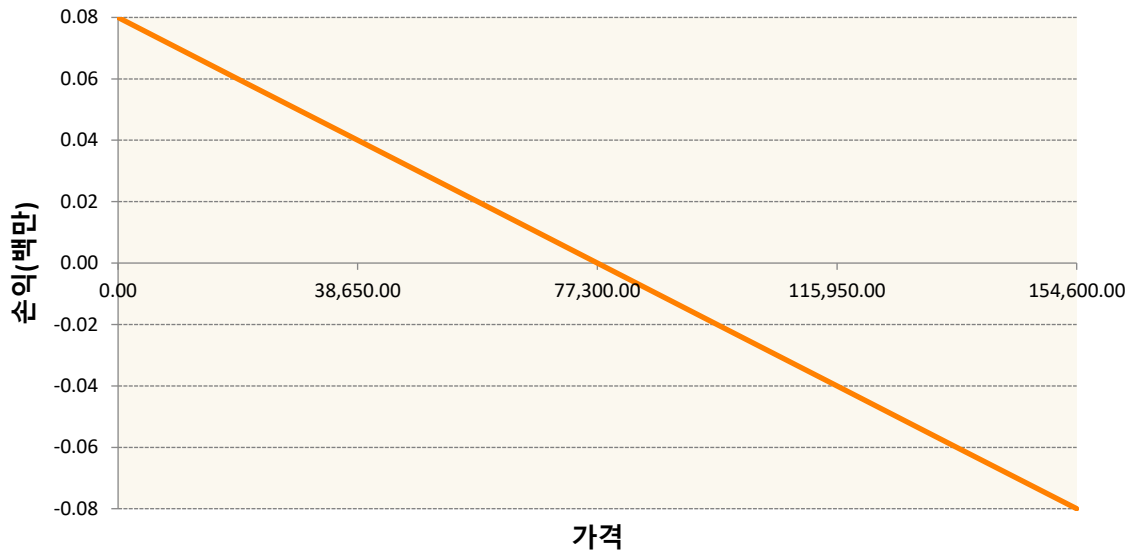
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	418	235	183	장내
누계	유가증권	선물	40	2,741	-2,701	장내

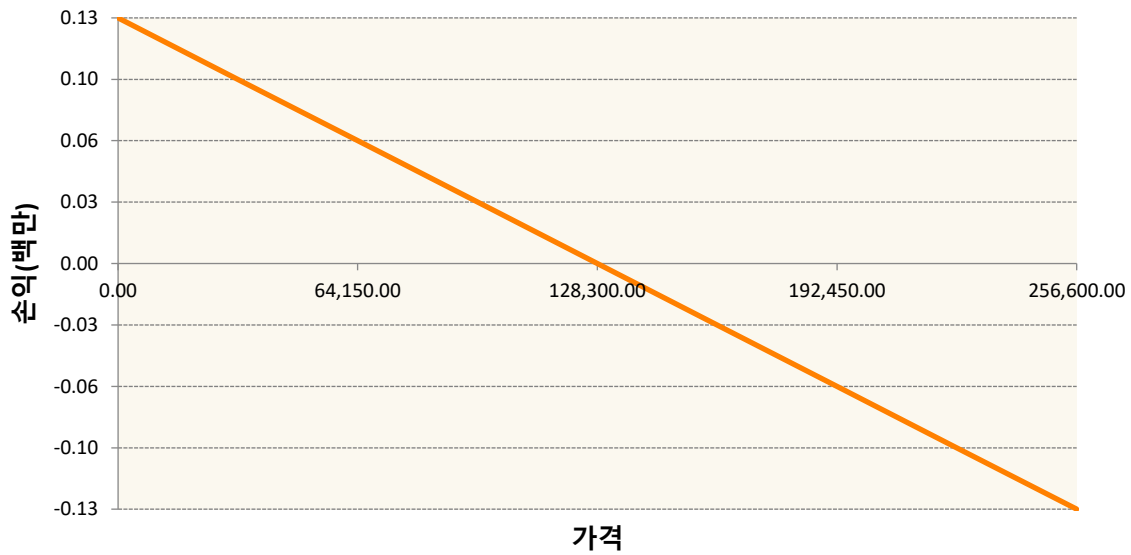
2. 만기시점의 손익구조



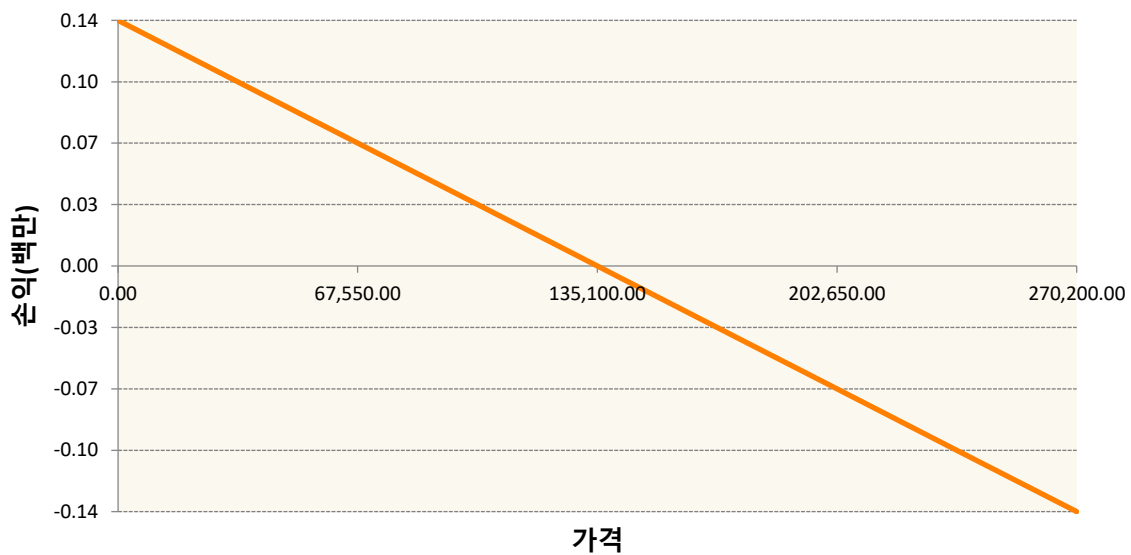
KR4154TC0004-2023-12 이마트개별선물



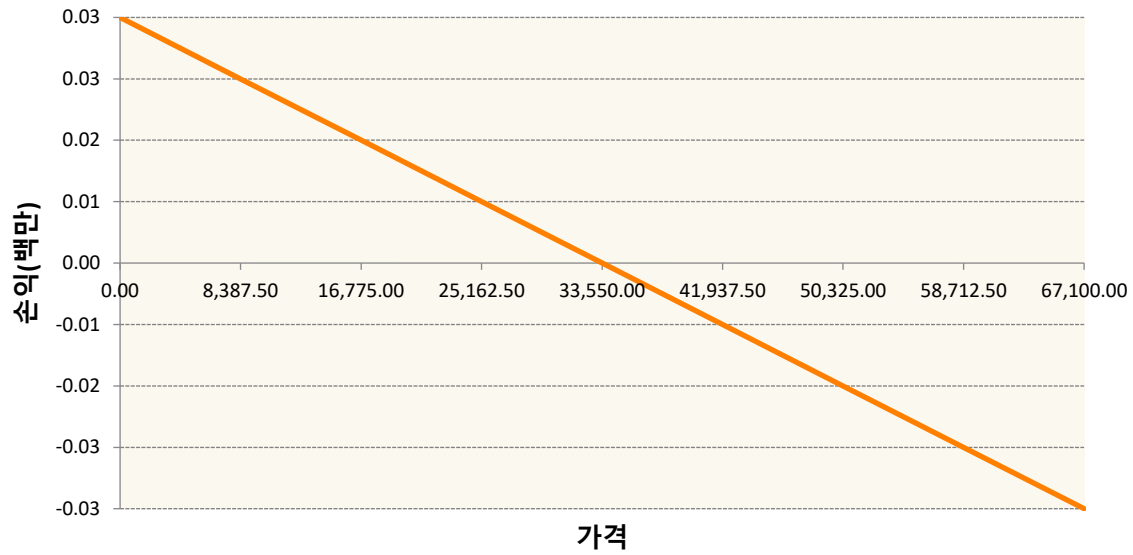
KR41BHTC0007-2023-12 한화에어로스페이스개별선물



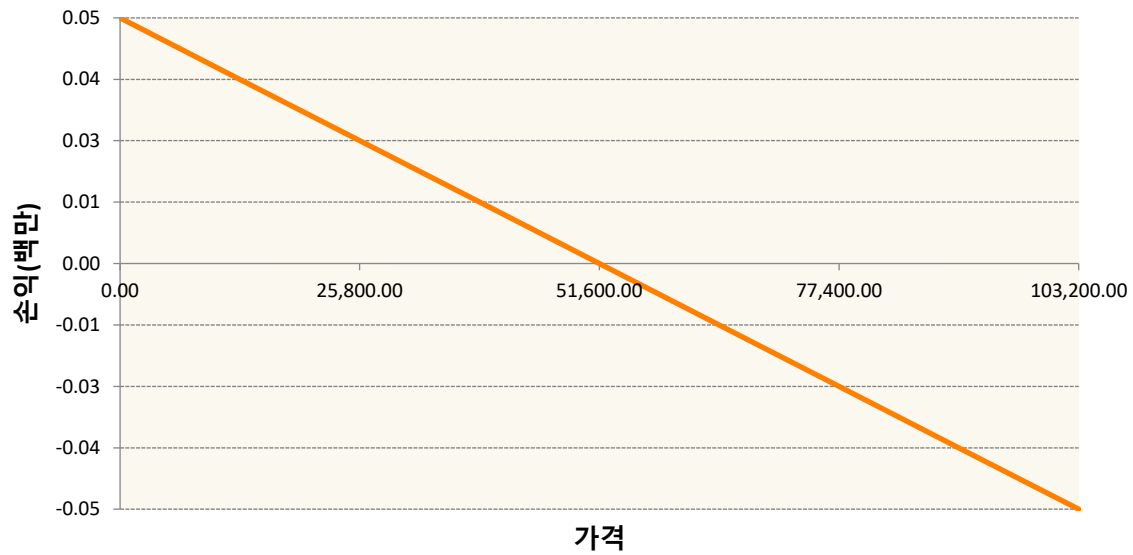
KR41C6TC0007-2023-12 아모레퍼시픽개별선물



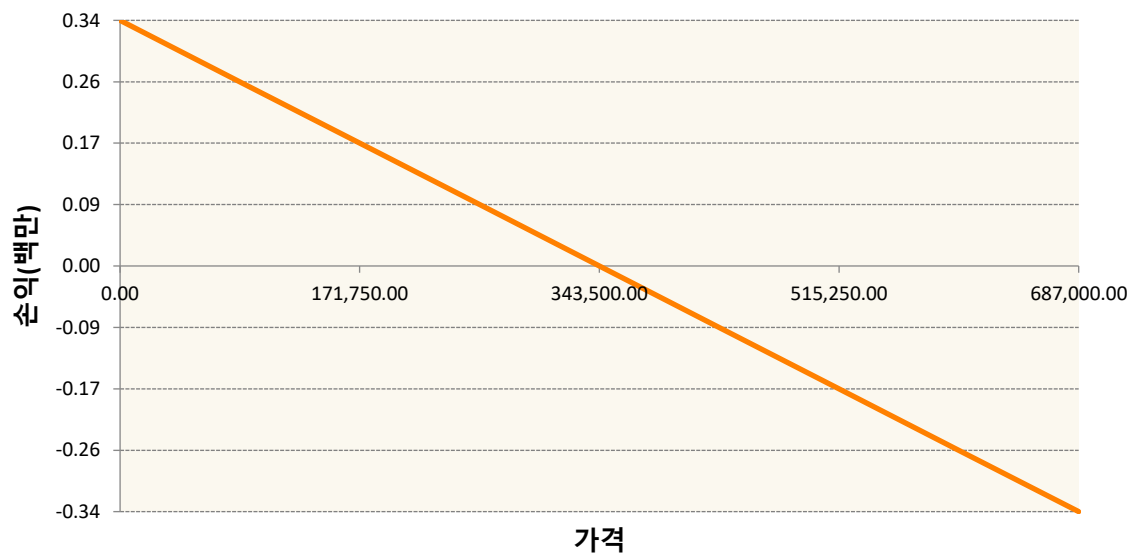
KR41CBTC0002-2023-12 한화솔루션개별선물



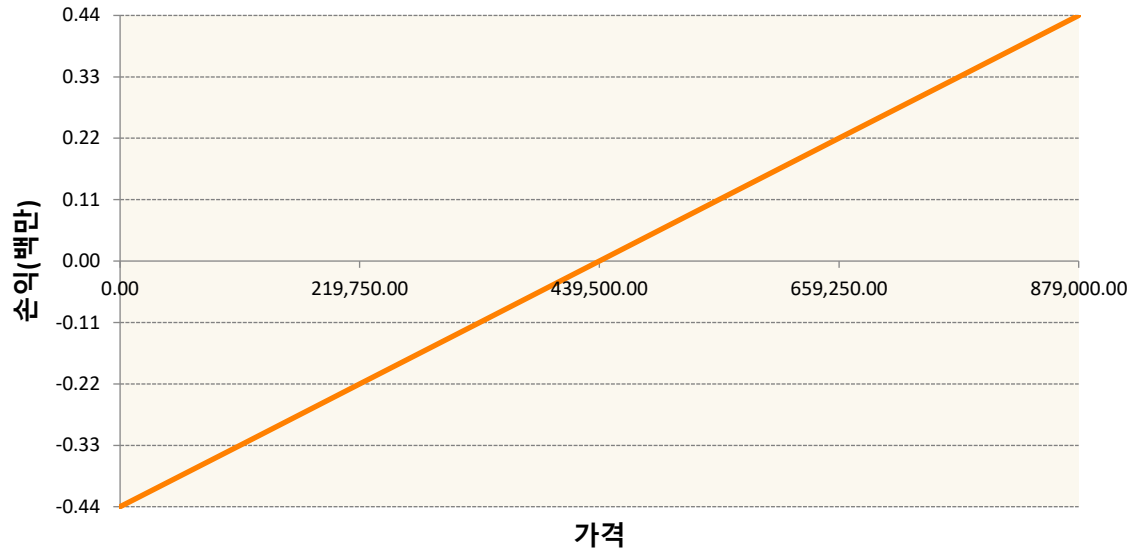
KR41CNTC0008-2023-12 포스코 ICT개별선물



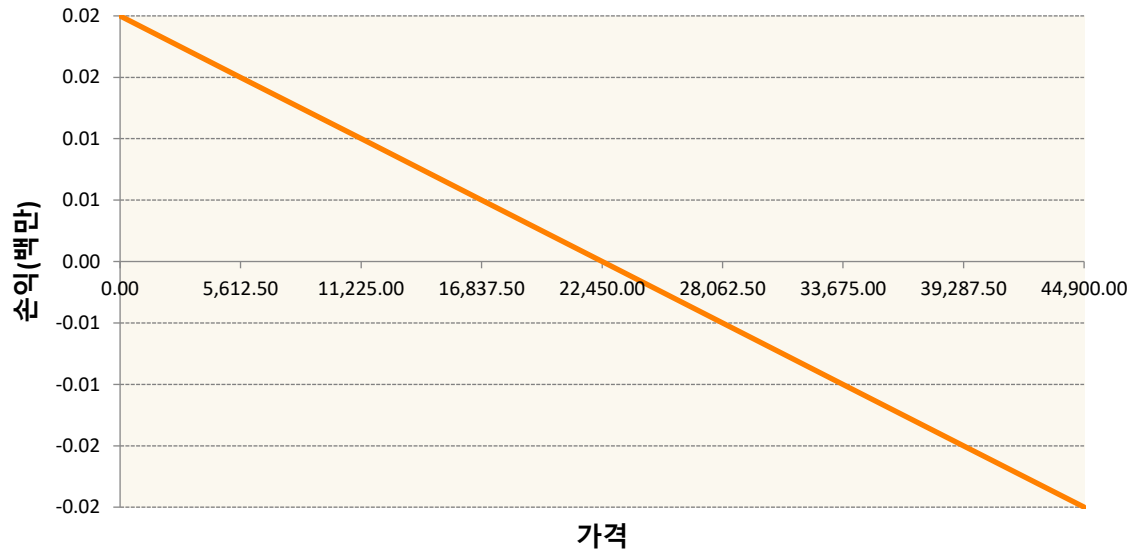
KR41CRTC0004-2023-12 LG생활건강개별선물



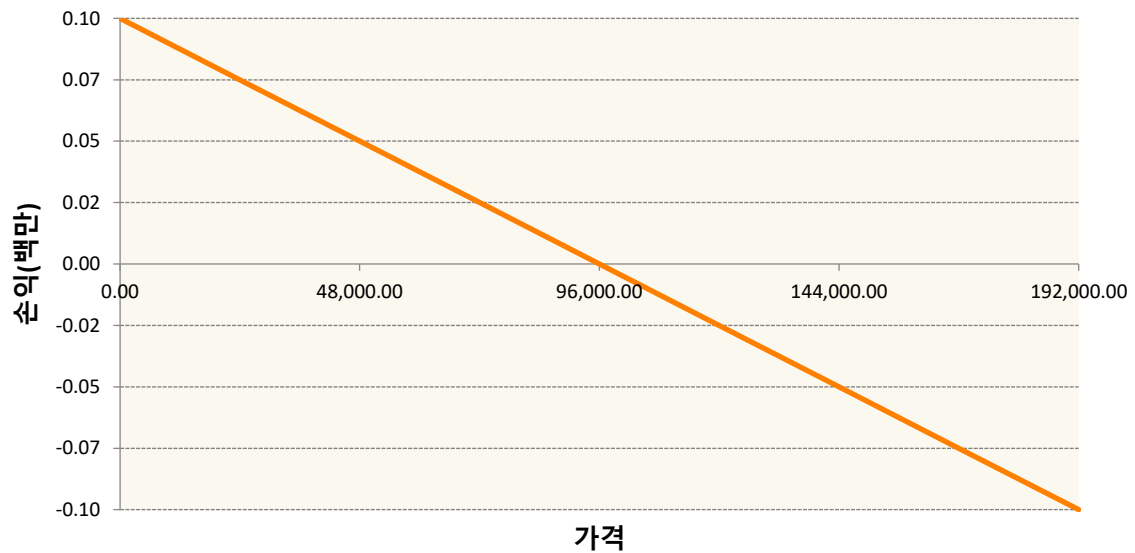
KR41DATC0002-2023-12 농심개별선물



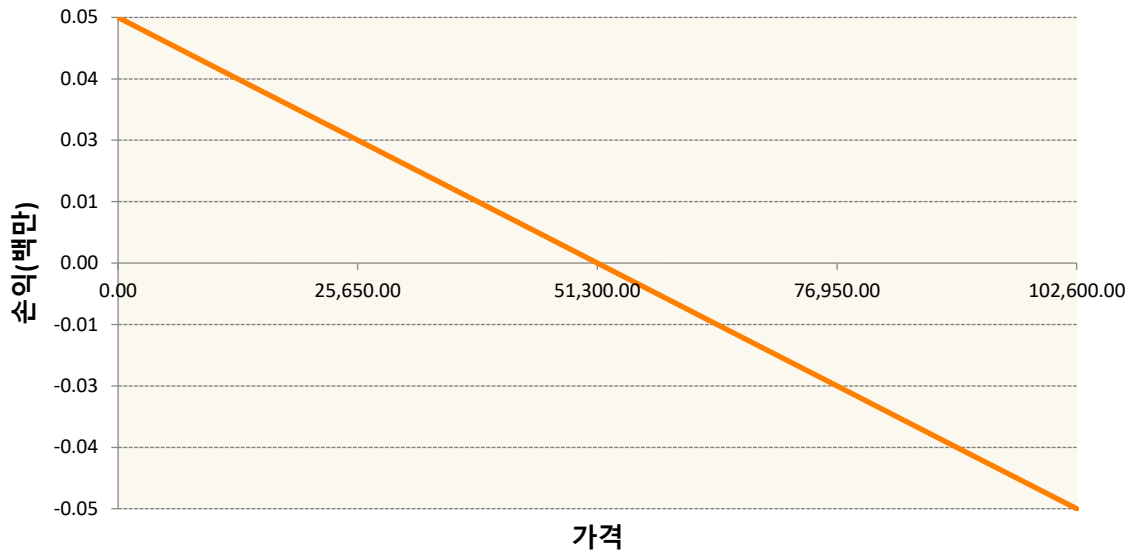
KR41DZTC0003-2023-12 한세실업개별선물



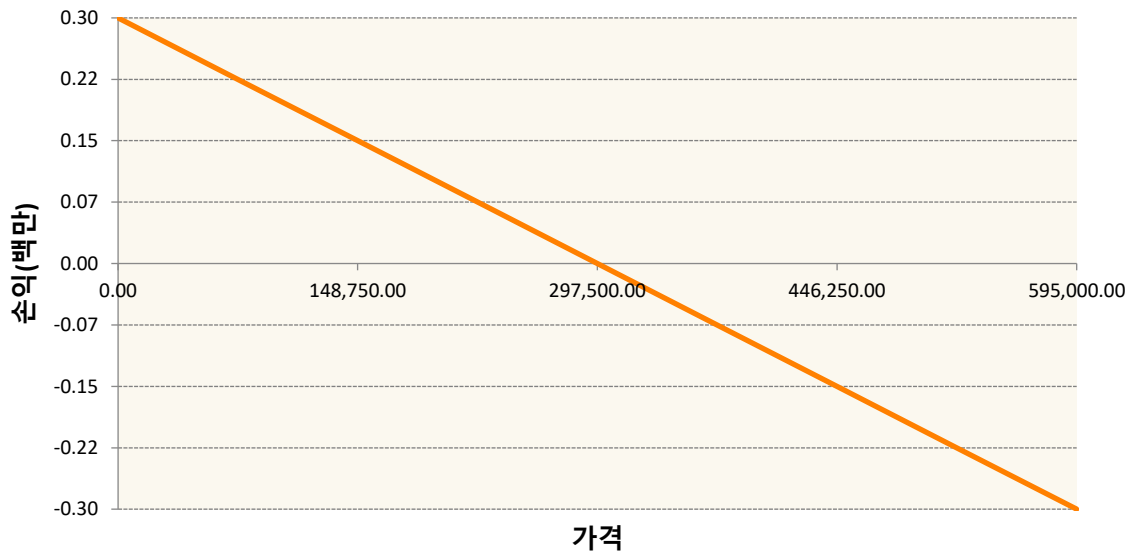
KR41E4TC0005-2023-12 에스엠개별선물



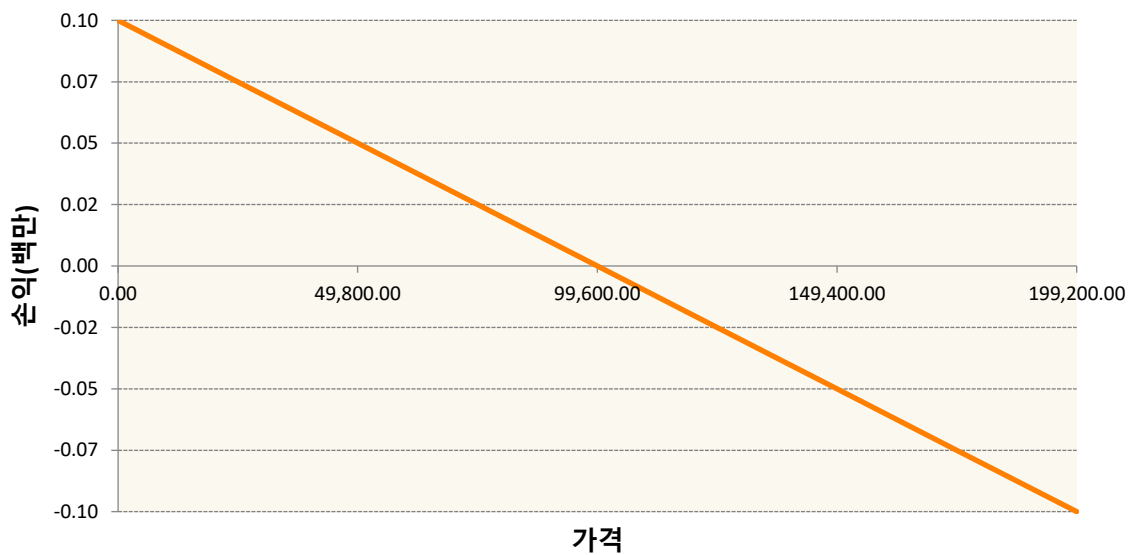
KR41E5TC0004-2023-12 넷마블개별선물



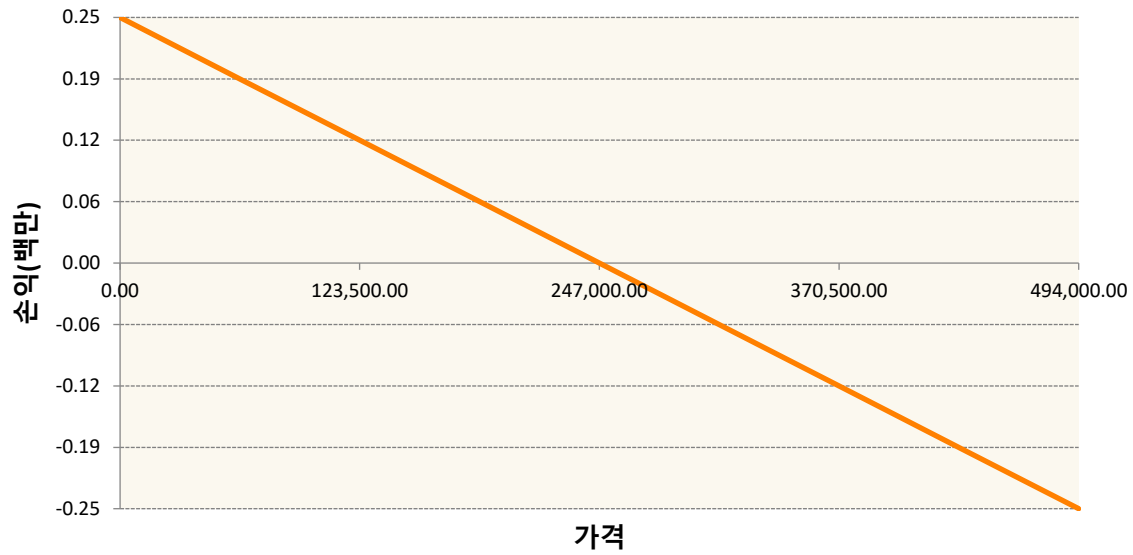
KR41E8TC0001-2023-12 포스코케미칼개별선물



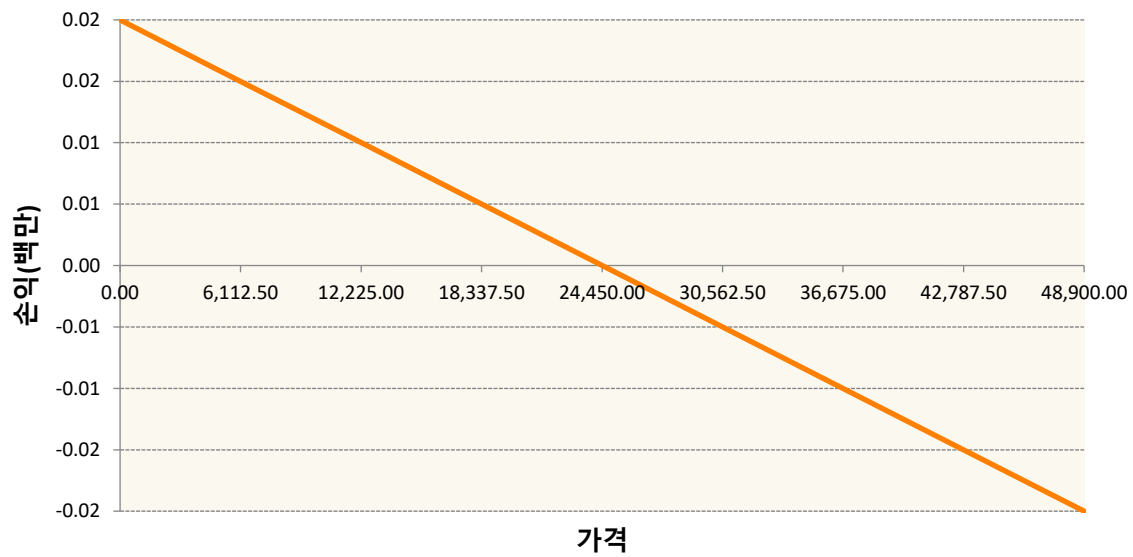
KR41EFTC0006-2023-12 JYP Ent.개별선물



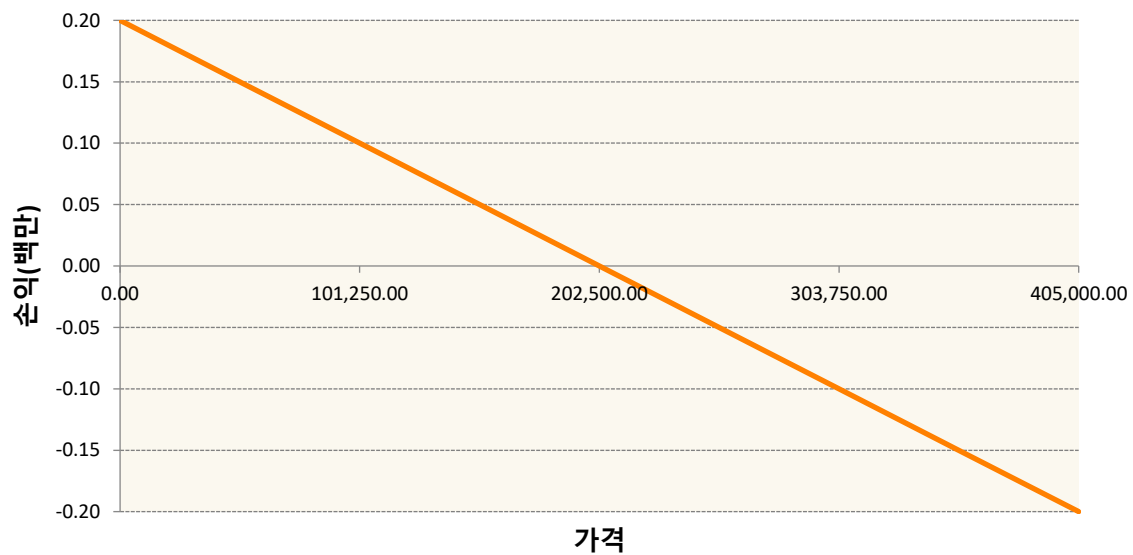
KR41EYTC0003-2023-12 에코프로비엠개별선물



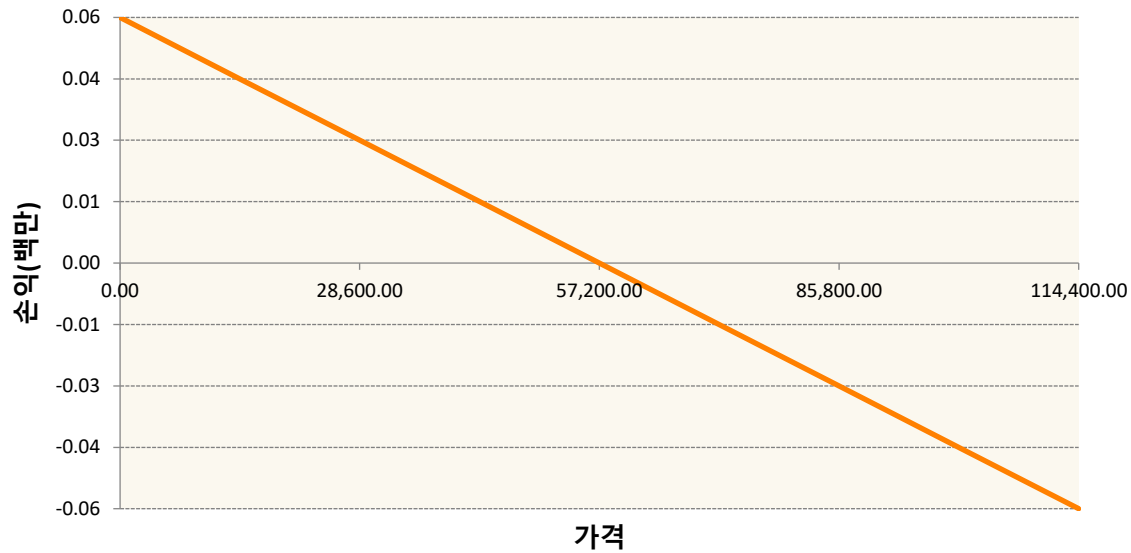
KR41F6TC0000-2023-12 카카오뱅크개별선물



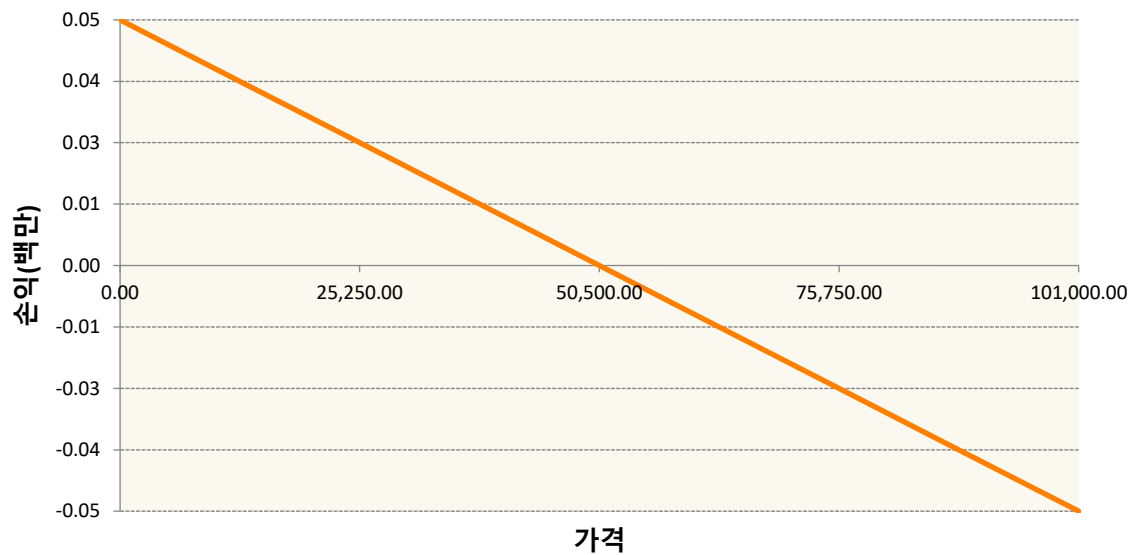
KR41F8TC0008-2023-12 크래프톤개별선물



KR41FNTC0005-2023-12 위메이드개별선물



KR41G0TC0004-2023-12 씨에스윈드개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101TC00 2023-12 코스피200지수선물	174
KR4113TC00 2023-12 POSCO개별선물	5
KR4154TC00 2023-12 이마트개별선물	1
KR41BHTC00 2023-12 한화에어로스페이스개별선물	6
KR41C6TC00 2023-12 아모레퍼시픽개별선물	3
KR41CBTC00 2023-12 한화솔루션개별선물	1
KR41CNTC00 2023-12 포스코 ICT개별선물	2
KR41CRTC00 2023-12 LG생활건강개별선물	2
KR41DATC00 2023-12 농심개별선물	3
KR41DZTC00 2023-12 한세실업개별선물	2
KR41E4TC00 2023-12 에스엠개별선물	6
KR41E5TC00 2023-12 넷마블개별선물	1

KR41E8TC00 2023-12 포스코케미칼개별선물	2
KR41EFTC00 2023-12 JYP Ent.개별선물	2
KR41EYTC00 2023-12 에코프로비엠개별선물	4
KR41F6TC00 2023-12 카카오뱅크개별선물	1
KR41F8TC00 2023-12 크래프톤개별선물	2
KR41FNTC00 2023-12 위메이드개별선물	3
KR41G0TC00 2023-12 씨에스원드개별선물	1

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

(단위:백만원)

310

공시일	2023-11-16
기준일	2023-11-15

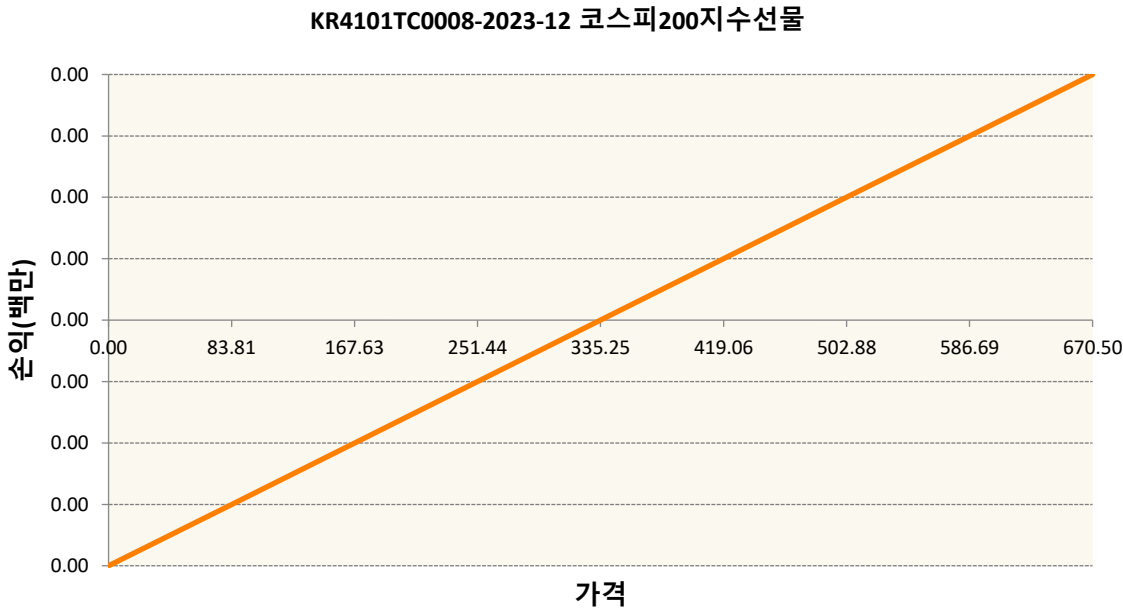
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	168	-168	장내
누계	유가증권	선물	2,766	0	2,766	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101TC0008			2023-12 코스피200지수선물				220
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-220	-220	-220	-220	-220	-220	-220
-5.33%	-147	-147	-147	-147	-147	-147	-147
-2.67%	-73	-73	-73	-73	-73	-73	-73
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	73	73	73	73	73	73	73
5.33%	147	147	147	147	147	147	147
8.00%	220	220	220	220	220	220	220

공시일	2023-11-16
기준일	2023-11-15

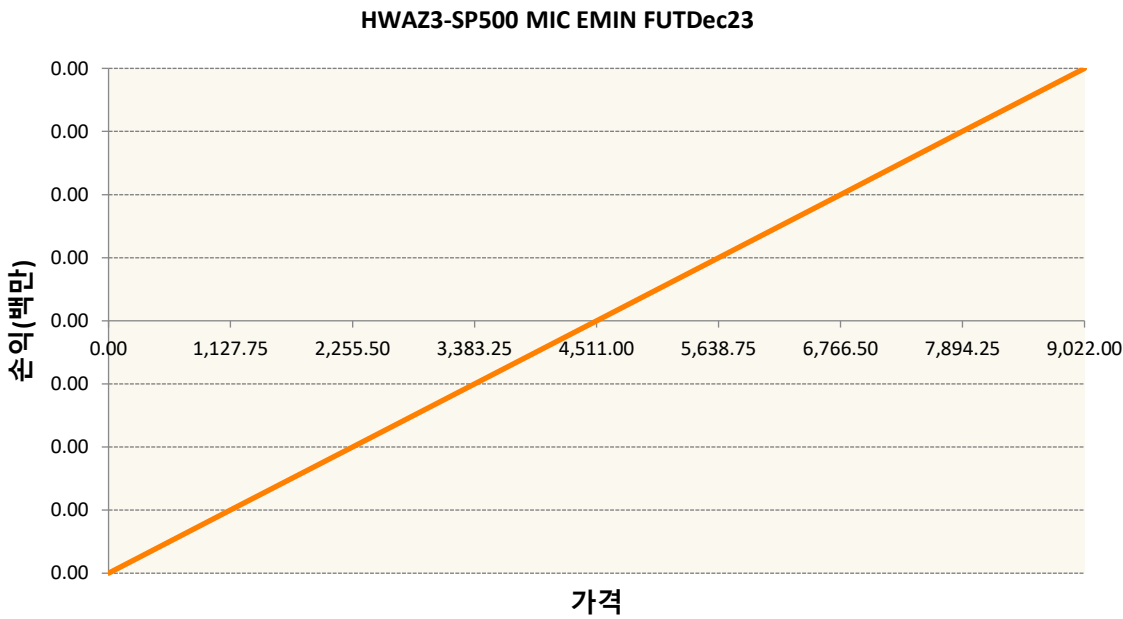
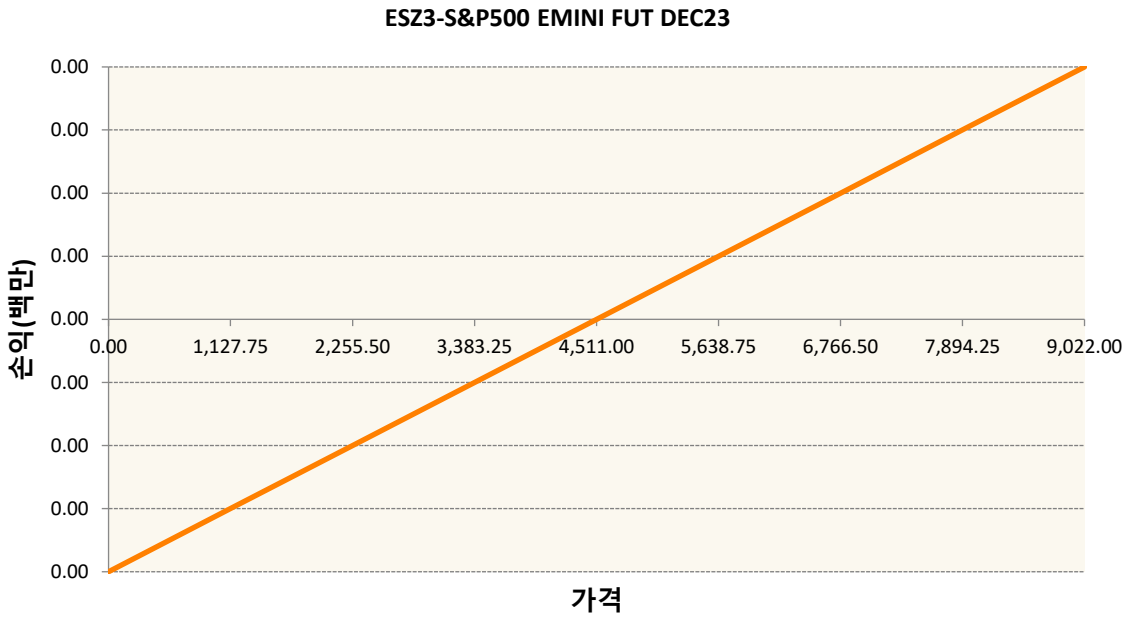
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

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	305	0	305	
누계	유가증권	선물	1,261	0	1,261	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESZ3	S&P500 EMINI FUT DEC23	24
HWAZ3	SP500 MIC EMIN FUTDec23	101

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	111

공시일	2023-11-16
기준일	2023-11-15

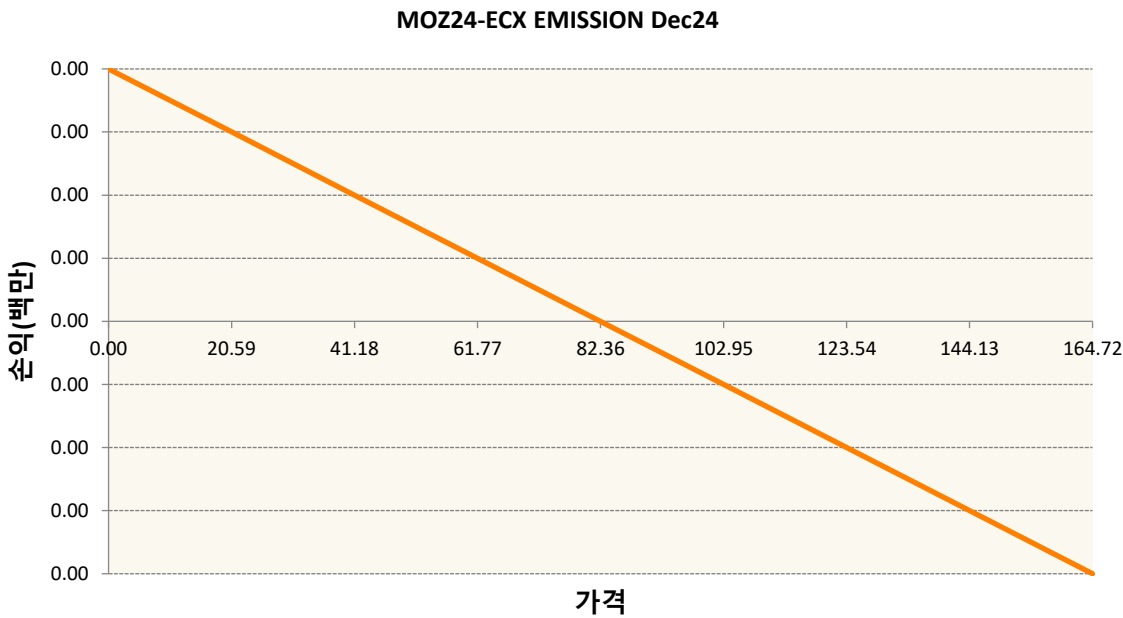
SOL유럽탄소배출권선물인버스ICE특별자산상

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	4,783	-4,783	
누계	지수	스왑	479	0	479	장외
누계	통화	선도	0	2,227	-2,227	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213DAT KRW/EUR 30-11-23E	49
FXW213DAT KRW/EUR 30-11-23E	129
MOZ24 ECX EMISSION Dec24	383
SWICEUACN ICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX	2

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

(단위:백만원)

812

공시일	2023-11-16
기준일	2023-11-15

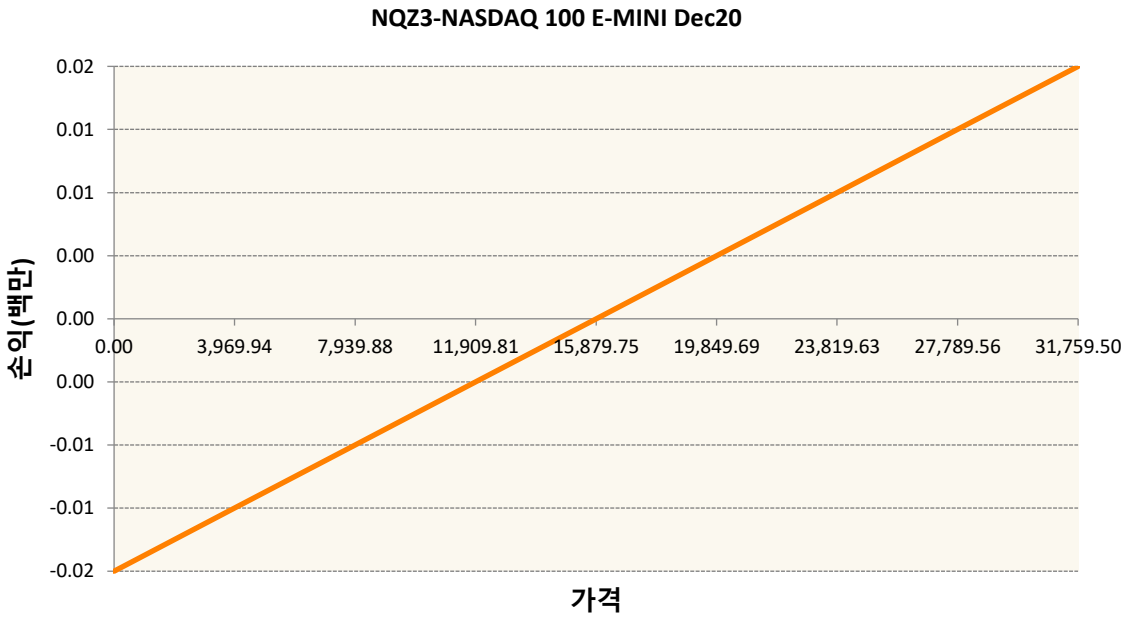
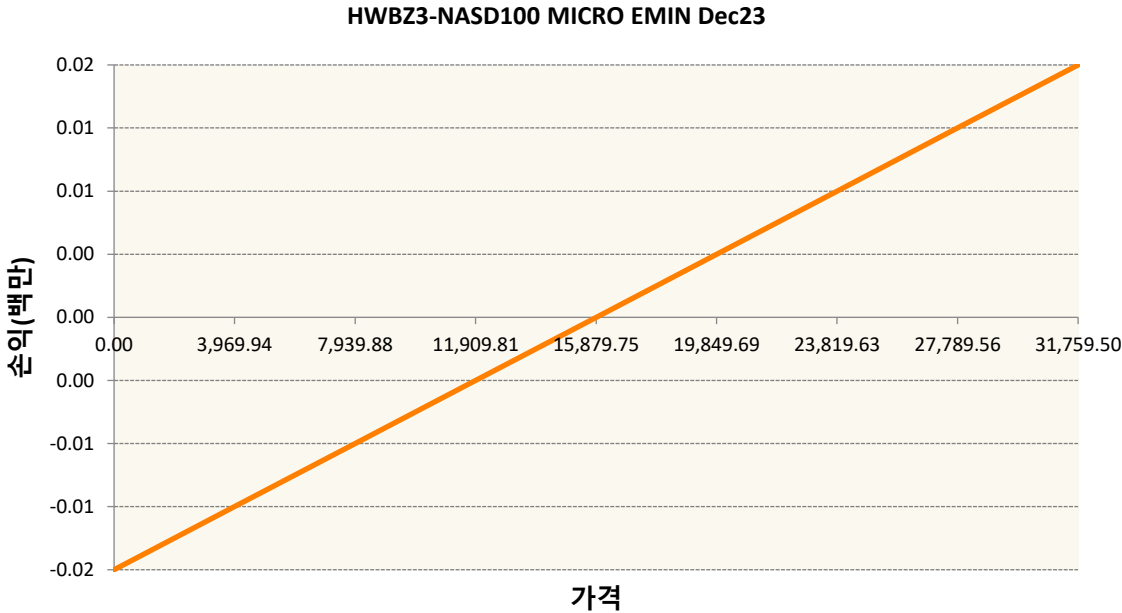
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

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	429	0	429	
누계	유가증권	선물	2,447	0	2,447	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HWBZ3	NASD100 MICRO EMIN Dec23	196
NQZ3	NASDAQ 100 E-MINI Dec20	34

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	214

공시일	2023-11-16
기준일	2023-11-15

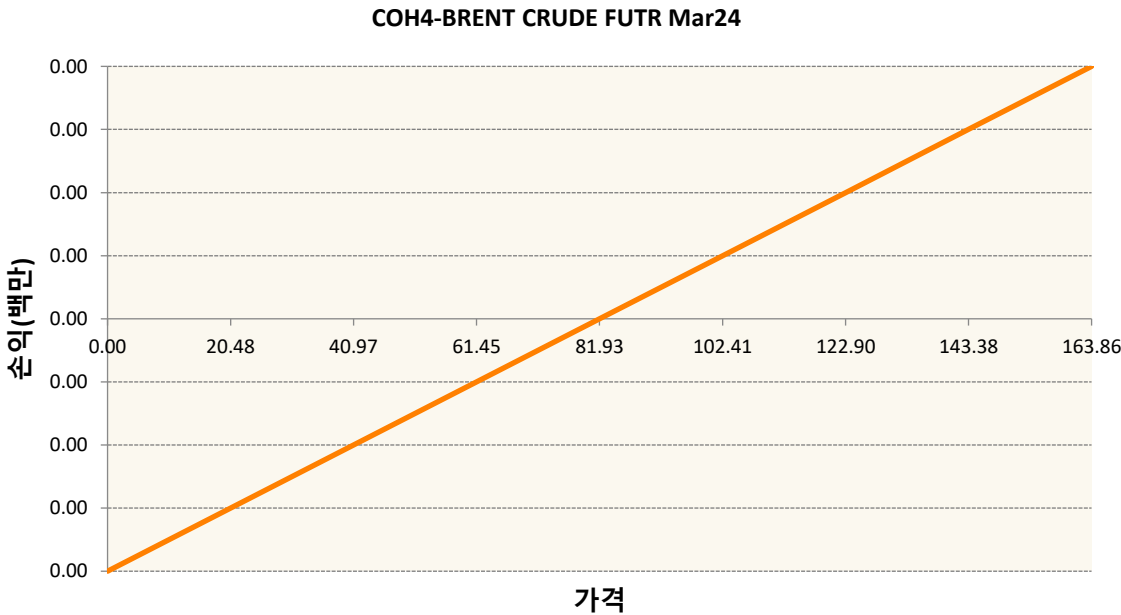
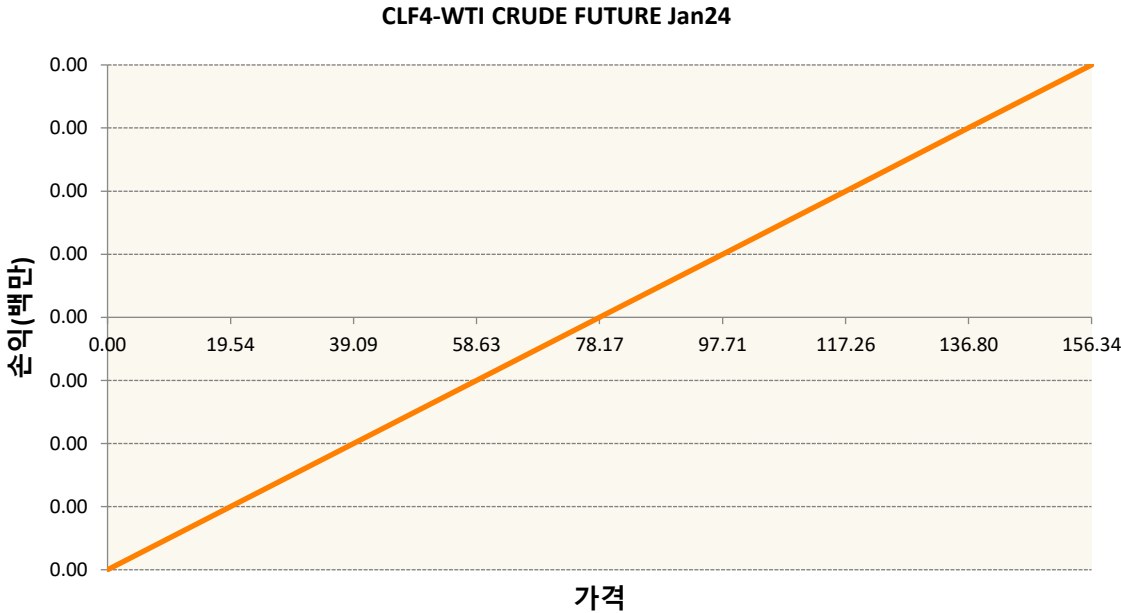
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

1. 계약금액

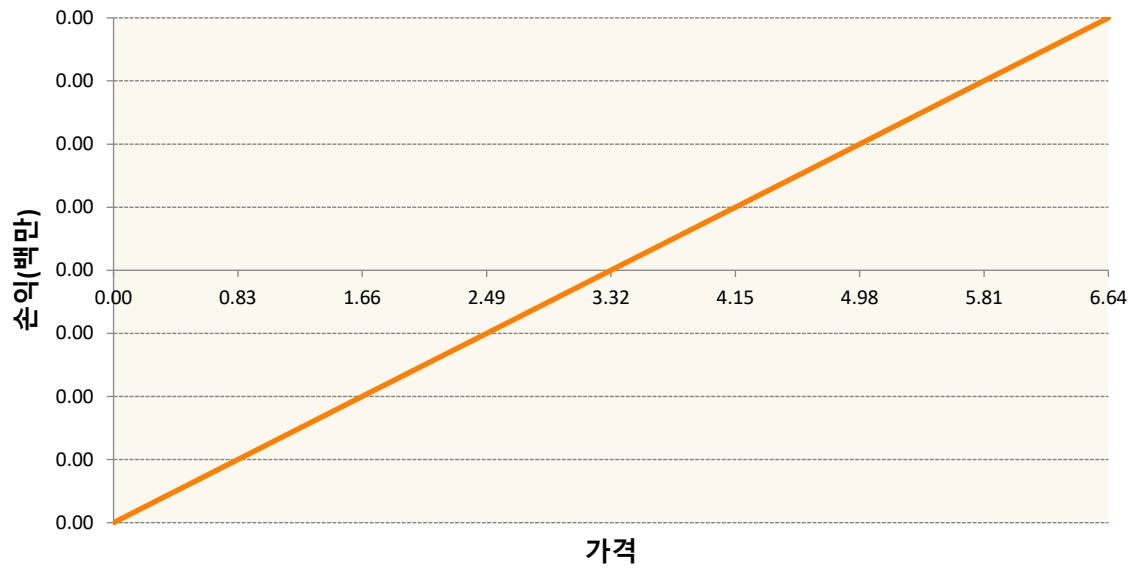
(단위:백만원)

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	1,349	0	1,349	
누계	통화	선물	0	195	-195	장내

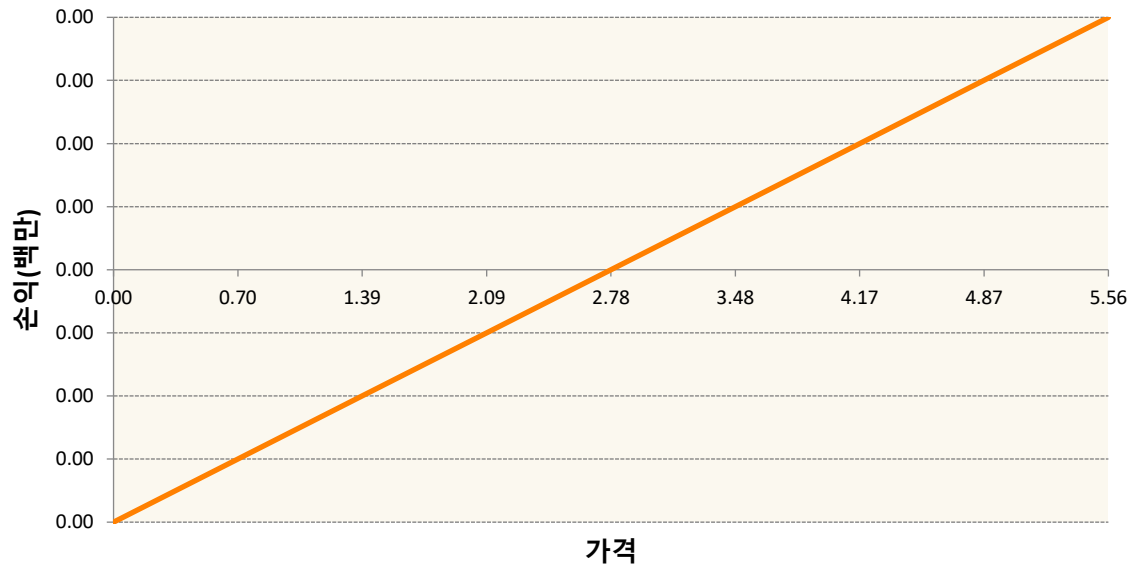
2. 만기시점의 손익구조



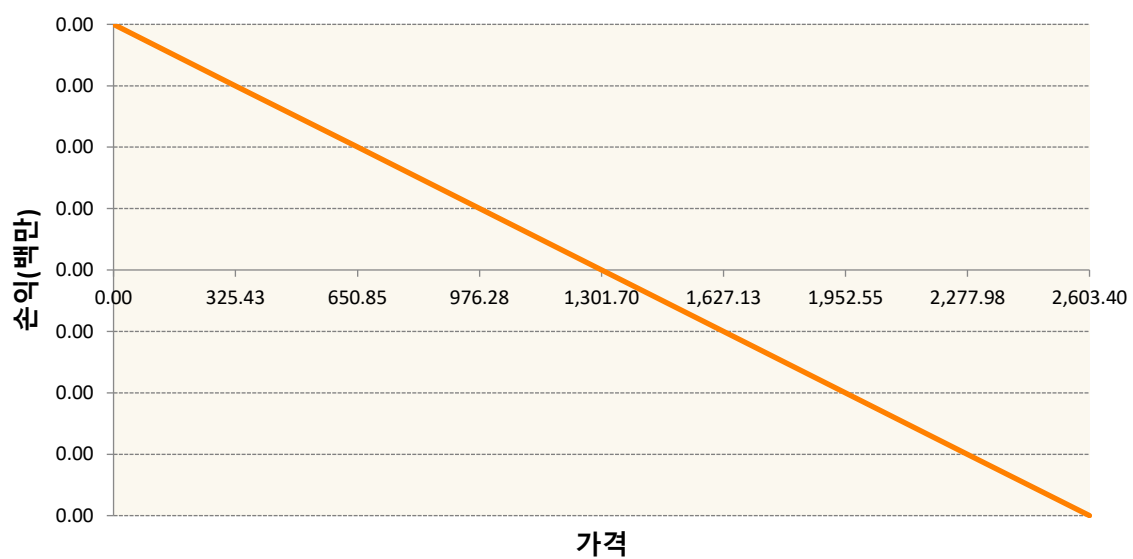
EOF4-E-MINI NATURAL GAS Jan24



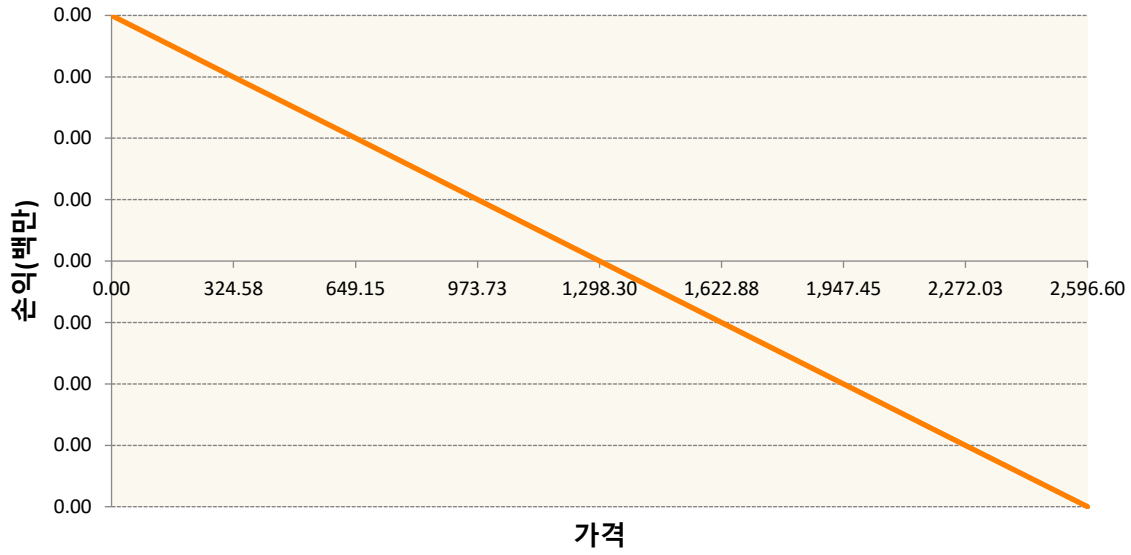
HOF4-NY Harb ULSD Fut Jan24



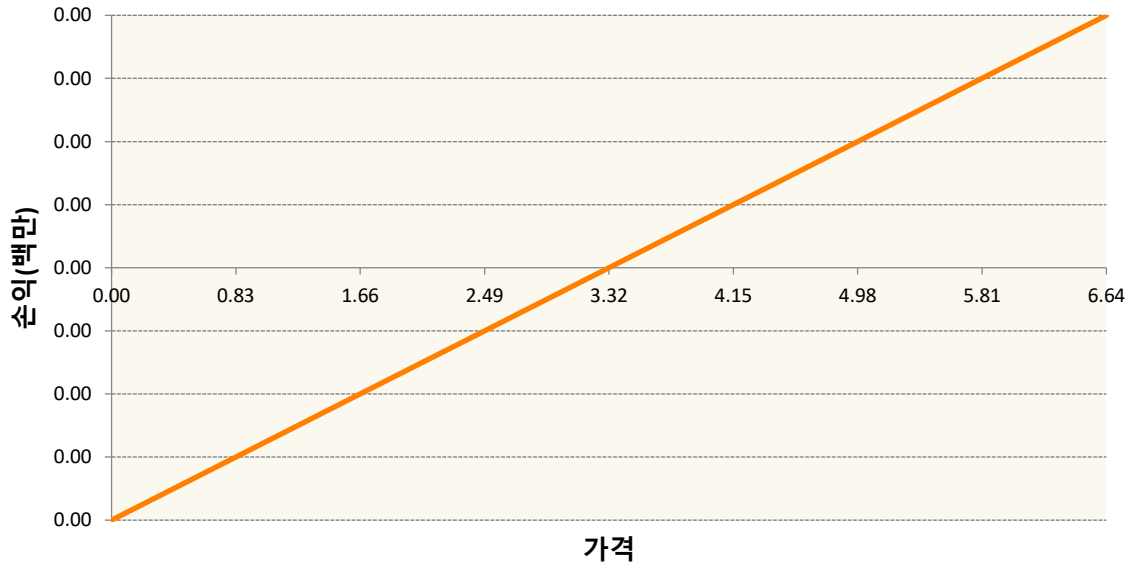
KR4175TB0000-2023-11 달러선물



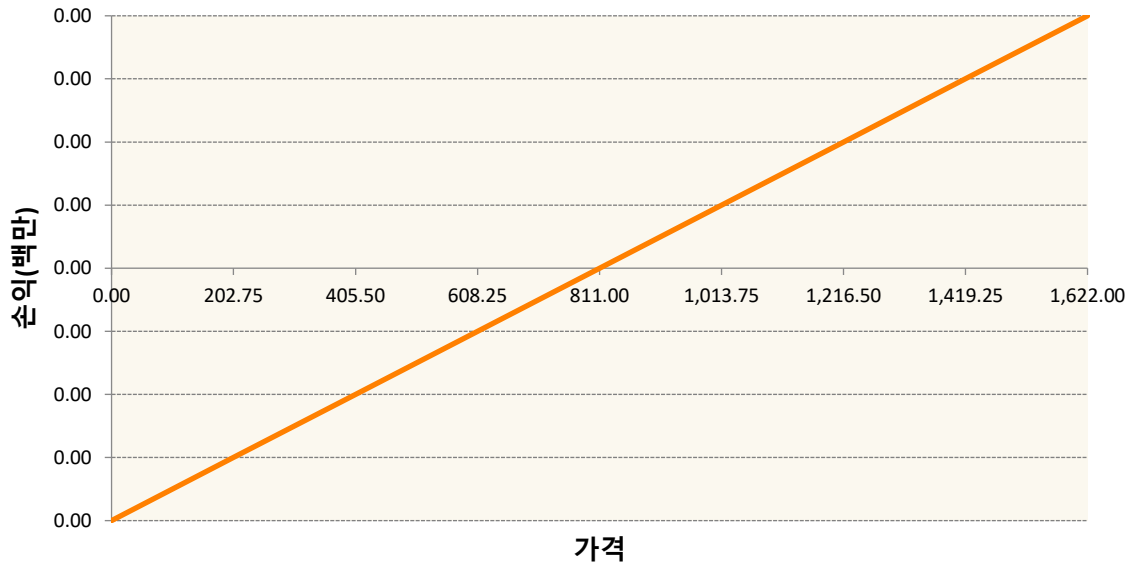
KR4175TC0009-2023-12 달러선물

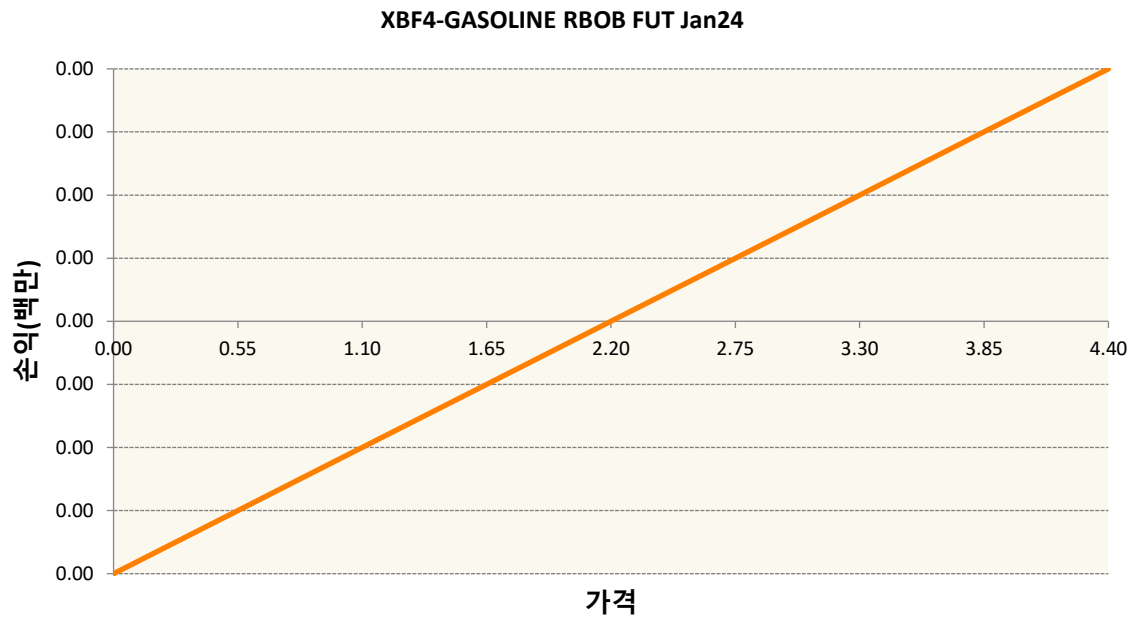


NGF24-NATURAL GAS FUTR Jan24



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	4
HOF4	NY Harb ULSD Fut Jan24	13
KR4175TB00 2023-11 달러선물		14
KR4175TC00 2023-12 달러선물		2
NGF24	NATURAL GAS FUTR Jan24	21
QSF4	Low Su Gasoil G Jan24	9
XBF4	GASOLINE RBOB FUT Jan24	10

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	279