

공시일	2023-12-07
기준일	2023-12-06

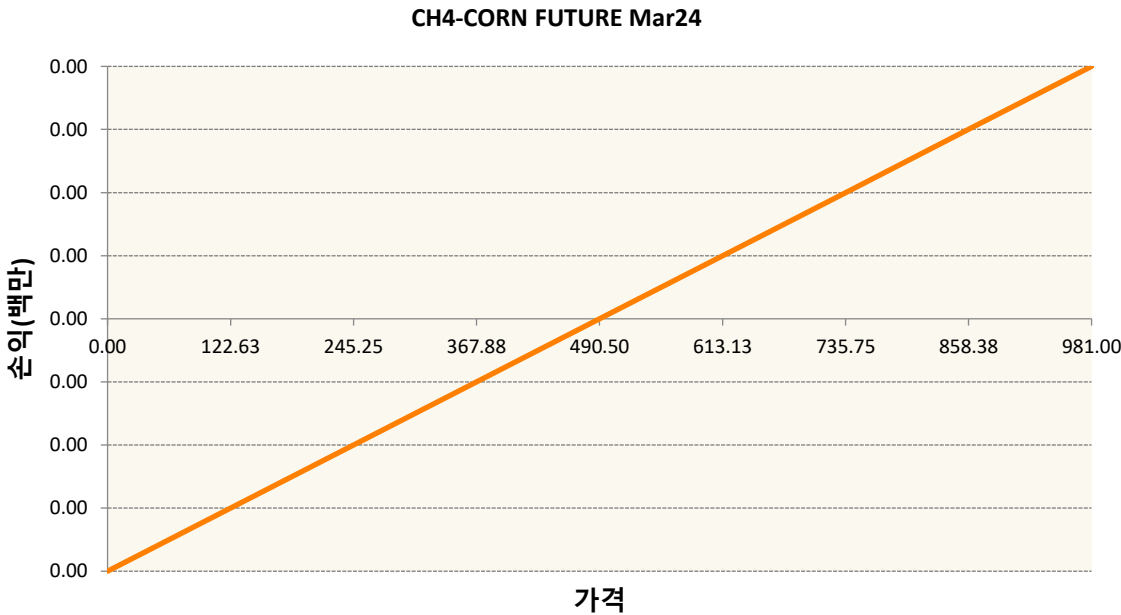
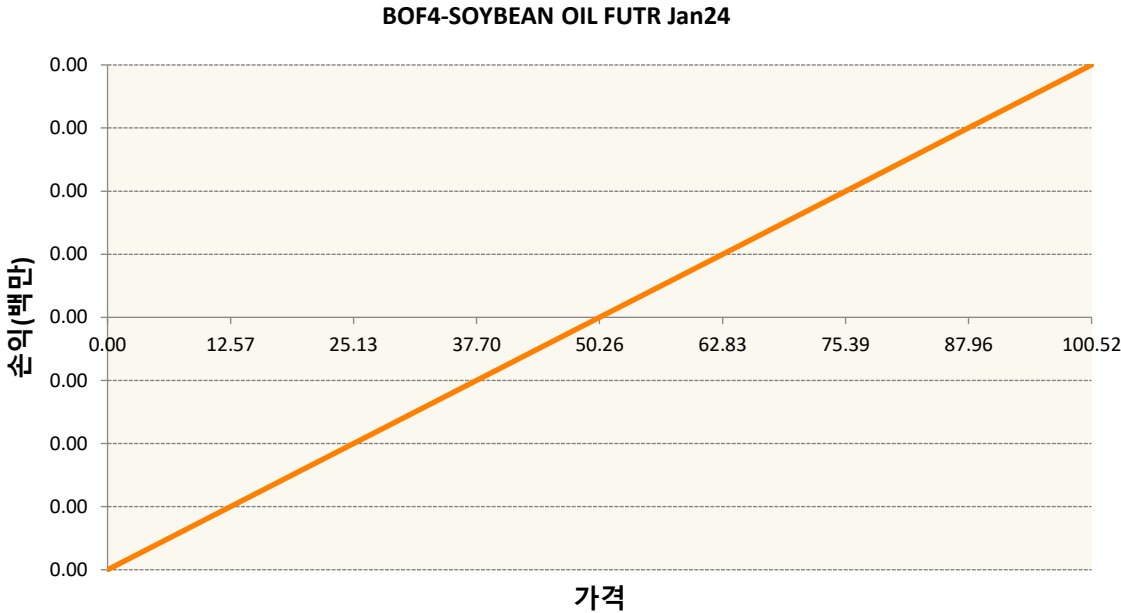
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

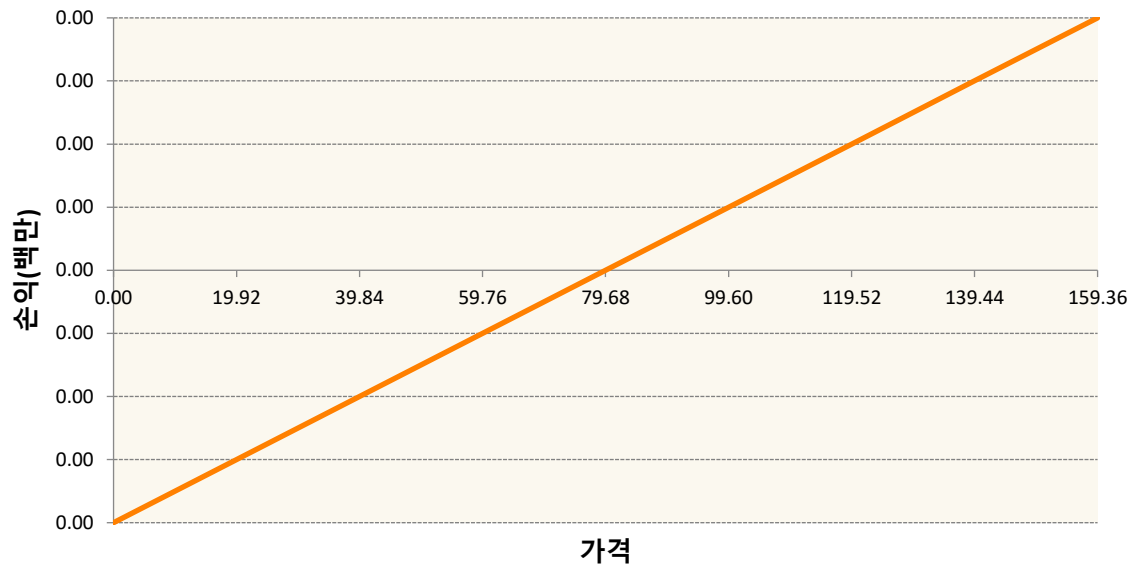
(단위:USD 백만)

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	4,972	0	4,972	
누계	통화	선물	0	551	-551	장내

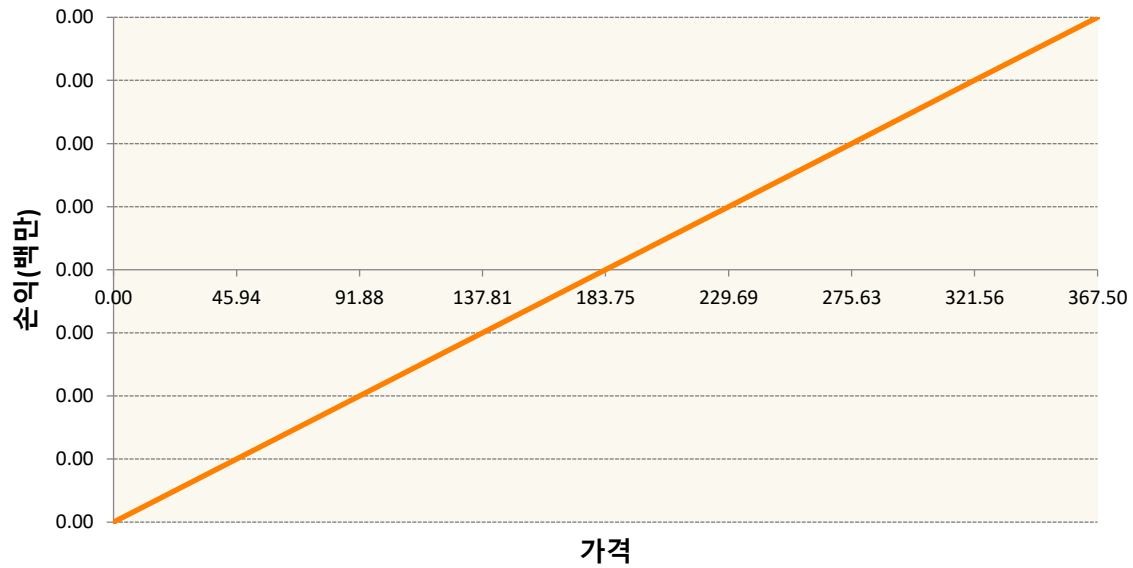
2. 만기시점의 손익구조



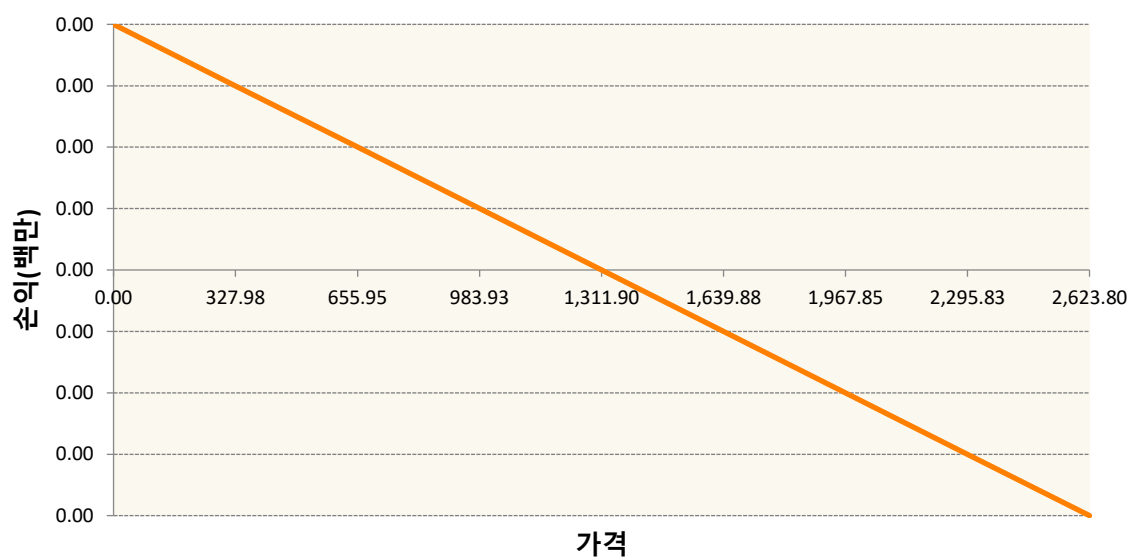
CTH4-COTTON NO.2 FUTR Mar24



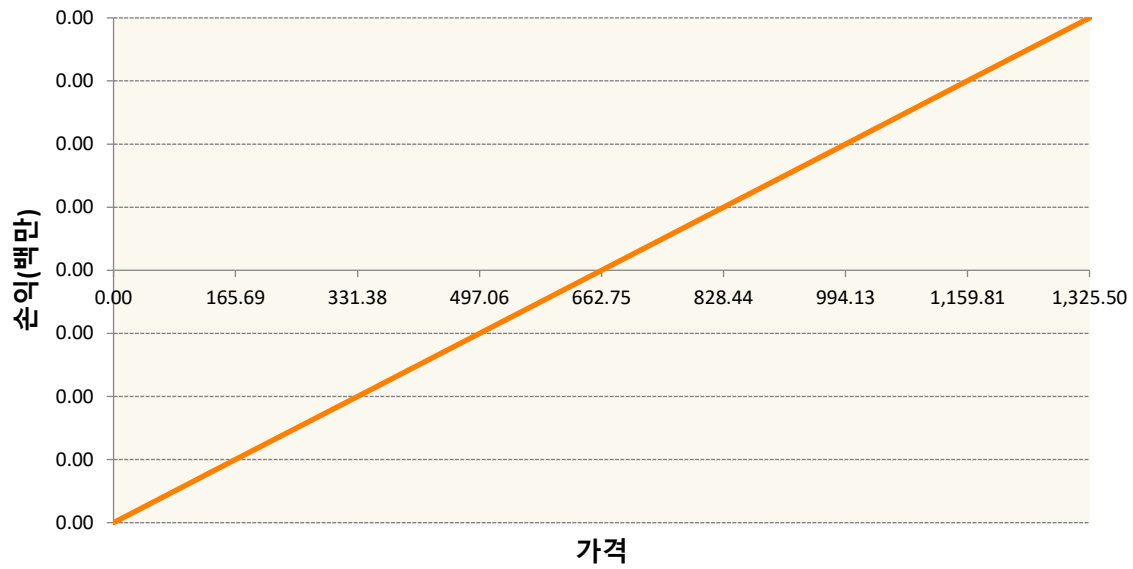
KCH4-COFFEE 'C' FUTURE Mar24



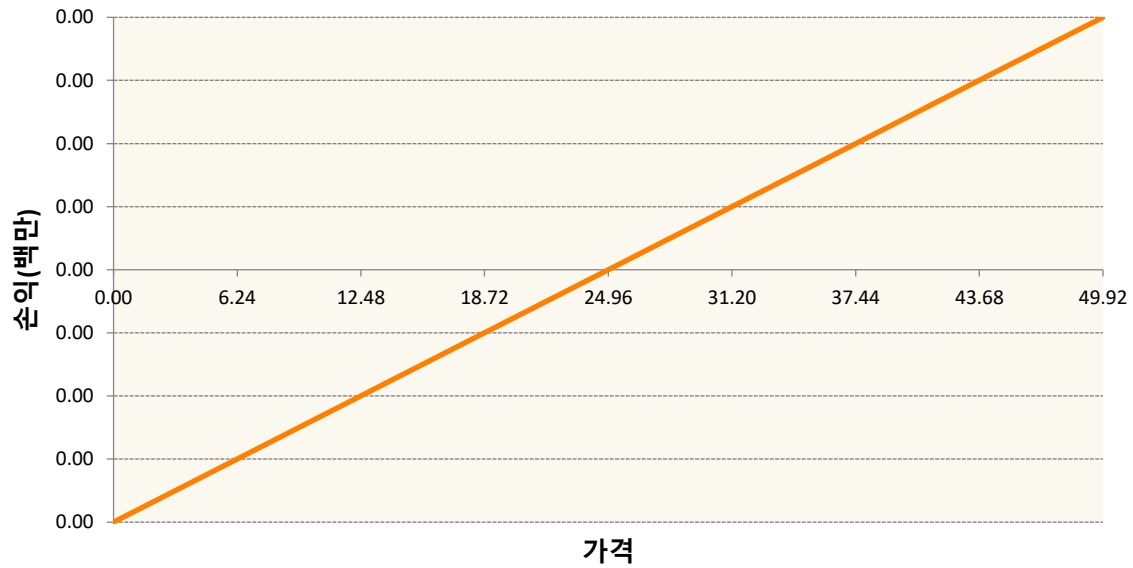
KR4175TC0009-2023-12 달러선물



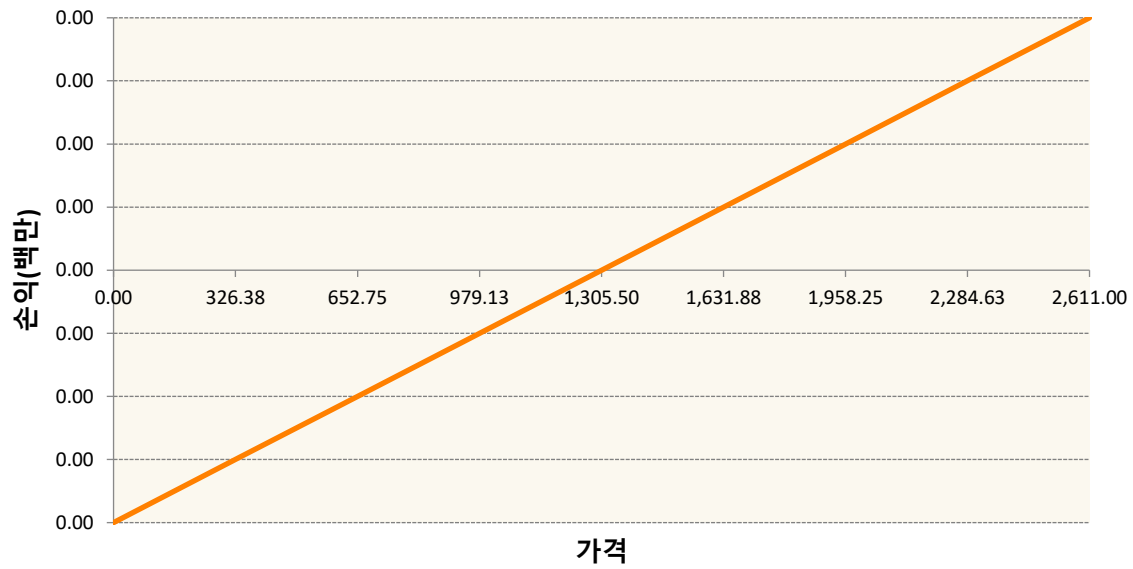
KWH4-KC HRW WHEAT FUT Mar24



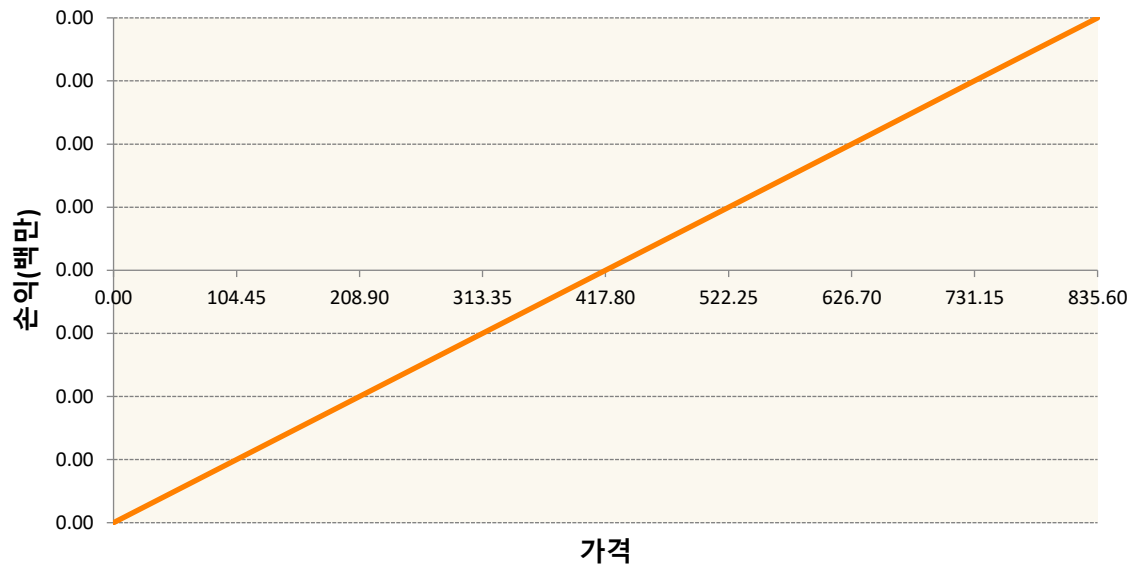
SBH4-Sugar #11 (WORLD) Mar24



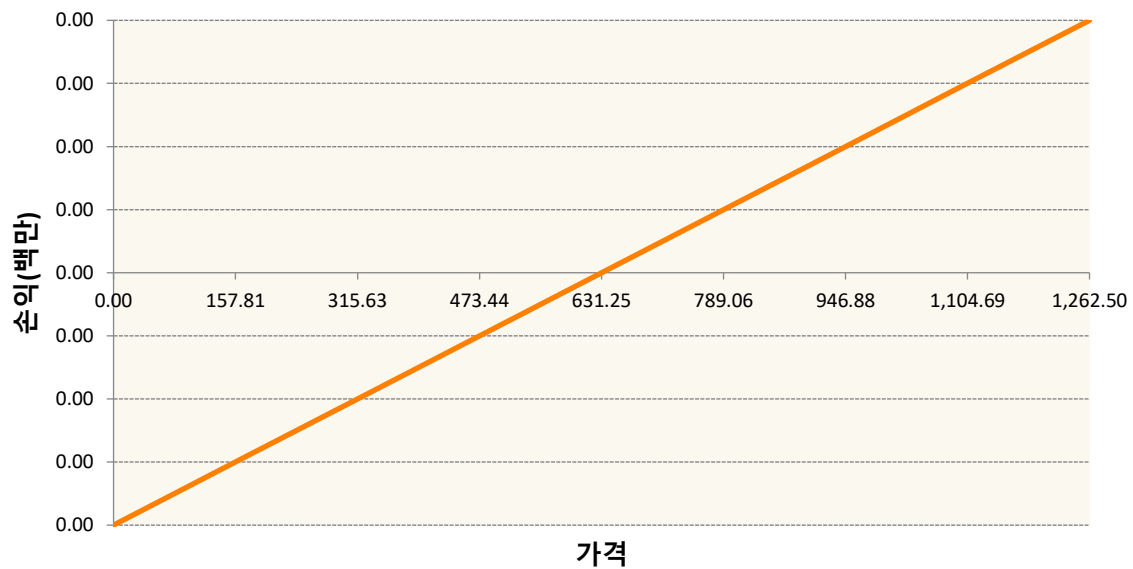
SF4-SOYBEAN FUTURE Jan24



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	2023-12-07
기준일	2023-12-06

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	311
-----------------------------	-----

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

276

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2023-12-07
기준일	2023-12-06

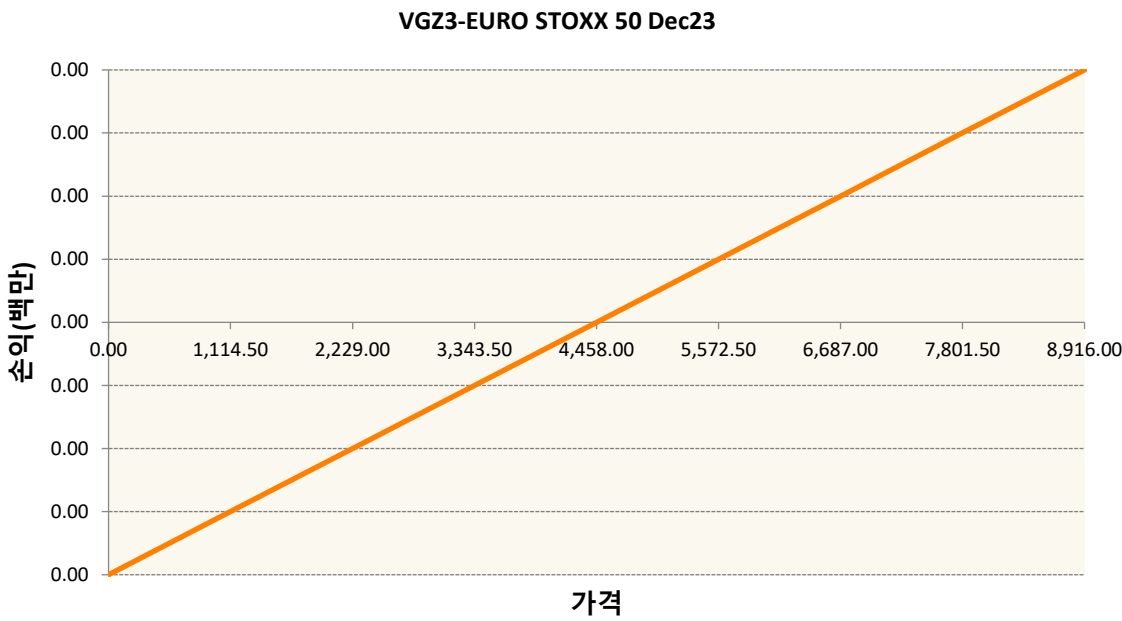
유로인덱스모(주식-파생형)

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	951	0	951	
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	76

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

(단위:백만원)

72

공시일	2023-12-07
기준일	2023-12-06

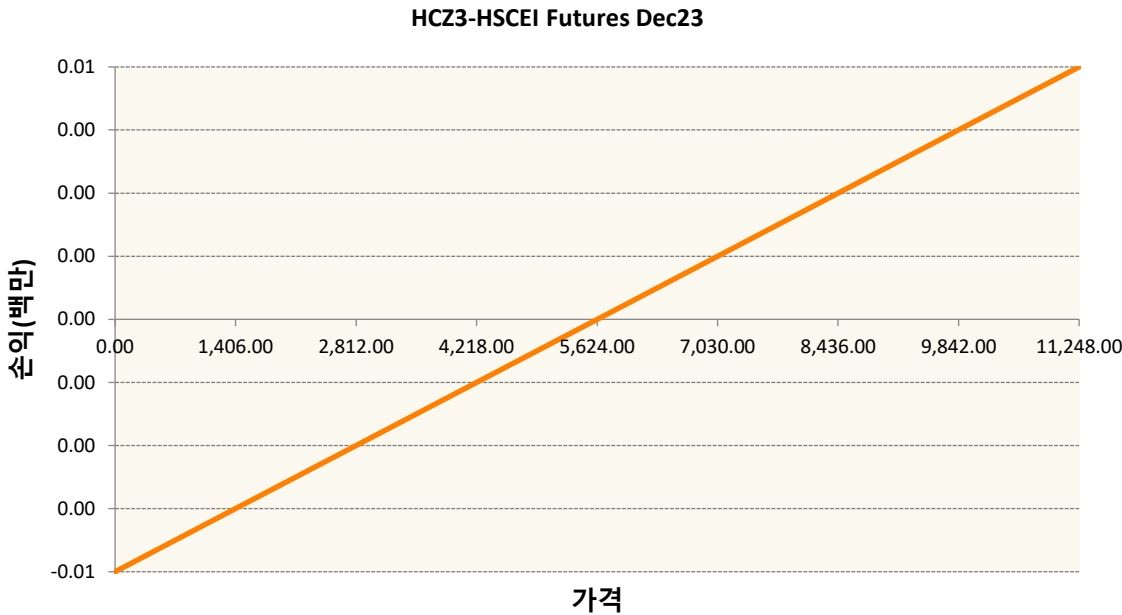
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,073	0	1,073	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCZ3	HSCEI Futures Dec23	86
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

125

공시일	2023-12-07
기준일	2023-12-06

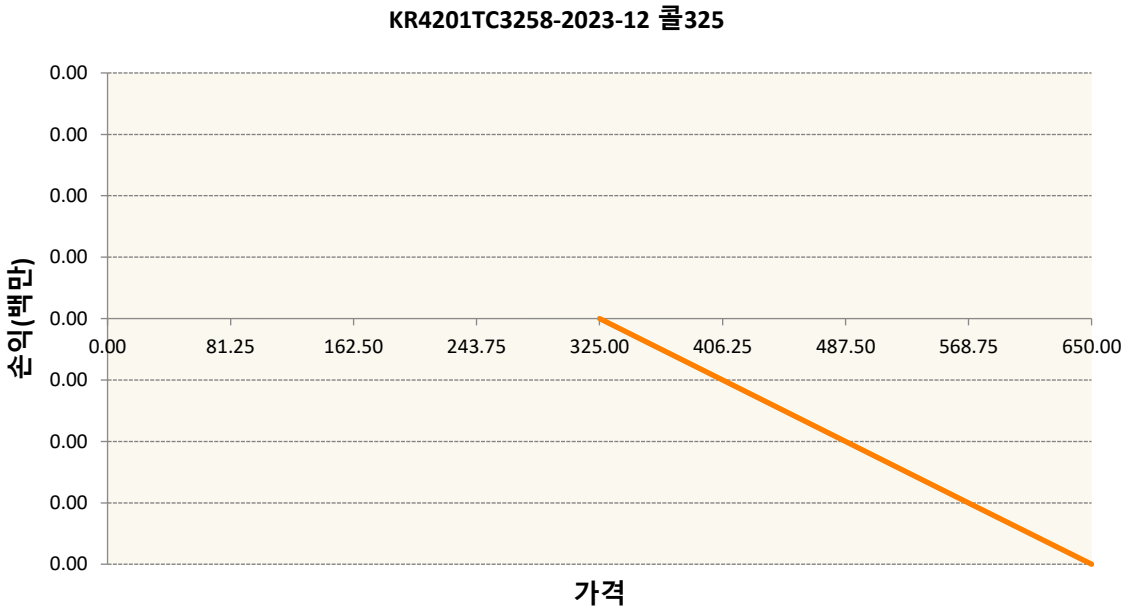
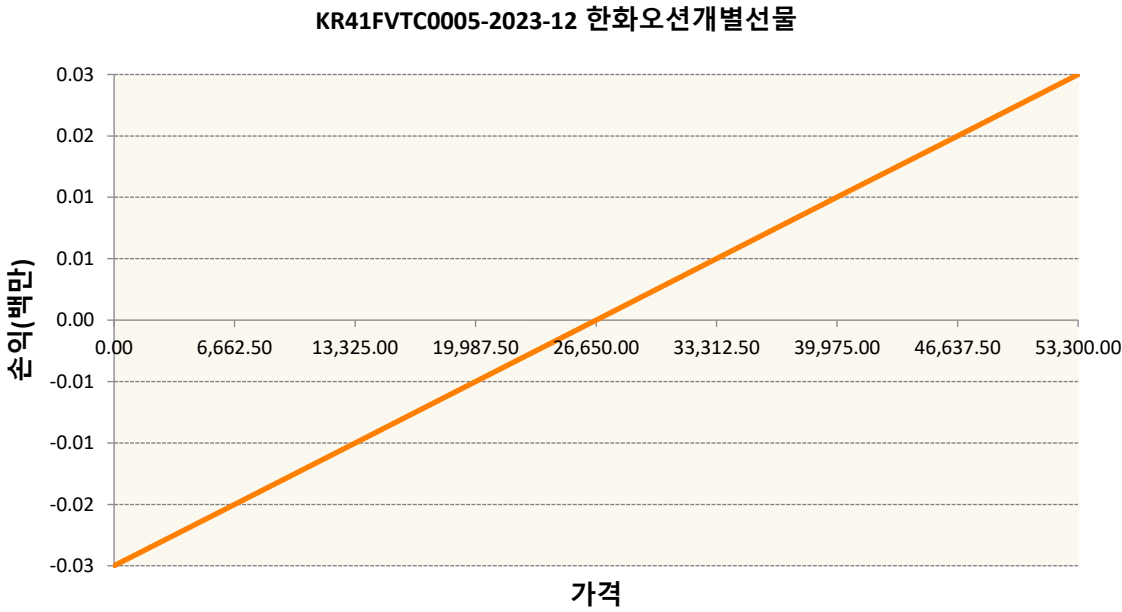
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	34	0	34	장내
누계	유가증권	옵션	0	50,663	-50,663	장내

2. 만기시점의 손익구조



The graph illustrates a linear relationship between price and profit/loss. The x-axis, labeled '가격' (Price), ranges from 0.00 to 655.00 with major ticks every 81.88 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 point (327.50, 0.00) and extends to the point (655.00, -0.00), indicating a negative slope.

가격	손익(백만)
327.50	0.00
655.00	-0.00

가격	손익 (백만)
0.00	0.00
81.25	-20.00
162.50	-40.00
243.75	-60.00
325.00	0.00

(단위:백만원)

KR41FVTC0005		2023-12 한화오션개별선물					3
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-3
-5.33%	-2	-2	-2	-2	-2	-2	-2
-2.67%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	1	1	1	1	1	1	1
5.33%	2	2	2	2	2	2	2
8.00%	3	3	3	3	3	3	3
KR4201TC3258		2023-12 콜325					2,772
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,147	1,140	1,130	1,117	1,102	1,084	1,063
-5.33%	1,073	1,044	1,013	981	946	910	874
-2.67%	763	718	672	627	581	536	490
0%	101	70	36	0	-37	-76	-115
2.67%	-799	-809	-823	-839	-859	-881	-905
5.33%	-1,775	-1,777	-1,780	-1,785	-1,791	-1,800	-1,811
8.00%	-2,763	-2,763	-2,763	-2,764	-2,766	-2,769	-2,772

KR4201TC3274

2023-12 콜327.5

424

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	150	149	148	147	145	143	140
-5.33%	143	140	136	131	127	122	117
-2.67%	108	101	94	87	80	73	66
0%	19	13	6	0	-7	-13	-20
2.67%	-115	-118	-121	-124	-128	-132	-137
5.33%	-267	-267	-268	-269	-271	-273	-275
8.00%	-422	-422	-422	-423	-423	-424	-424

KR4301TC3257

2023-12 풋325

462

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-442	-443	-446	-449	-453	-457	-462
-5.33%	-220	-227	-234	-242	-250	-259	-268
-2.67%	-55	-66	-77	-88	-99	-110	-121
0%	25	17	9	0	-9	-18	-28
2.67%	46	44	40	36	32	26	20
5.33%	49	49	48	47	45	43	40
8.00%	49	49	49	49	49	48	47

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

(단위:백만원)

4,045

공시일	2023-12-07
기준일	2023-12-06

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	1,919	0	1,919	

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	2023-12-07
기준일	2023-12-06

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	4,539	0	4,539	

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	2023-12-07
기준일	2023-12-06

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	17,578	0	17,578	
누계	통화	선도	0	16,775	-16,775	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213D9R\KRW/USD 29-12-23E	509
FXW213DAT\KRW/USD 31-01-24E	188
FXW213DBV\KRW/USD 29-02-24E	645
IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

699

공시일	2023-12-07
기준일	2023-12-06

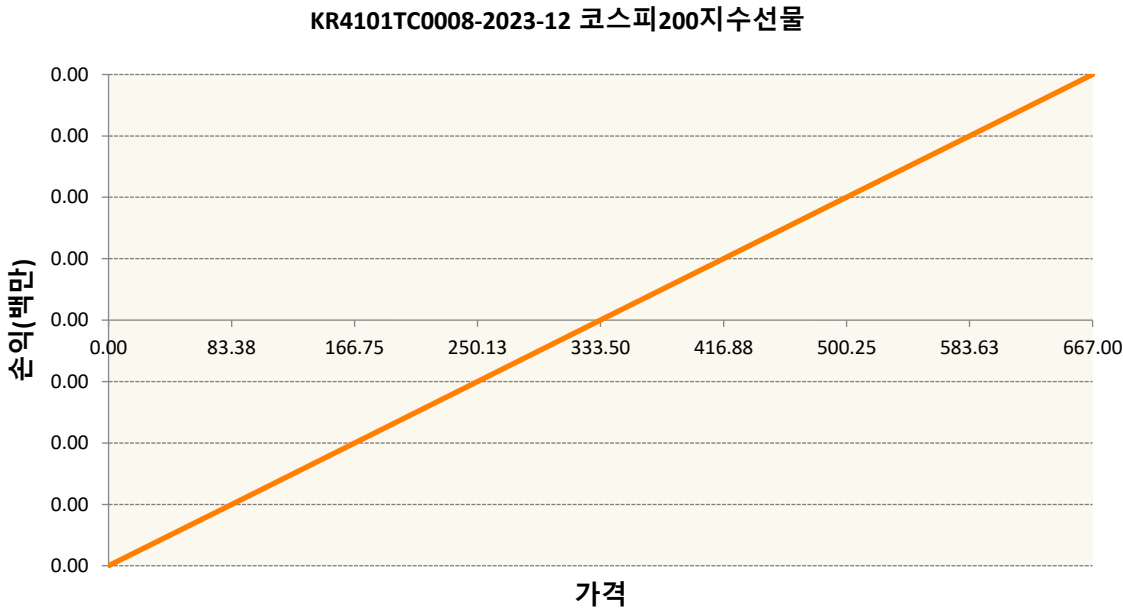
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

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	667	0	667	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101TC0008			2023-12 코스피200지수선물				53
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-53	-53	-53	-53	-53	-53	-53
-5.33%	-36	-36	-36	-36	-36	-36	-36
-2.67%	-18	-18	-18	-18	-18	-18	-18
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	18	18	18	18	18	18	18
5.33%	36	36	36	36	36	36	36
8.00%	53	53	53	53	53	53	53

공시일	2023-12-07
기준일	2023-12-06

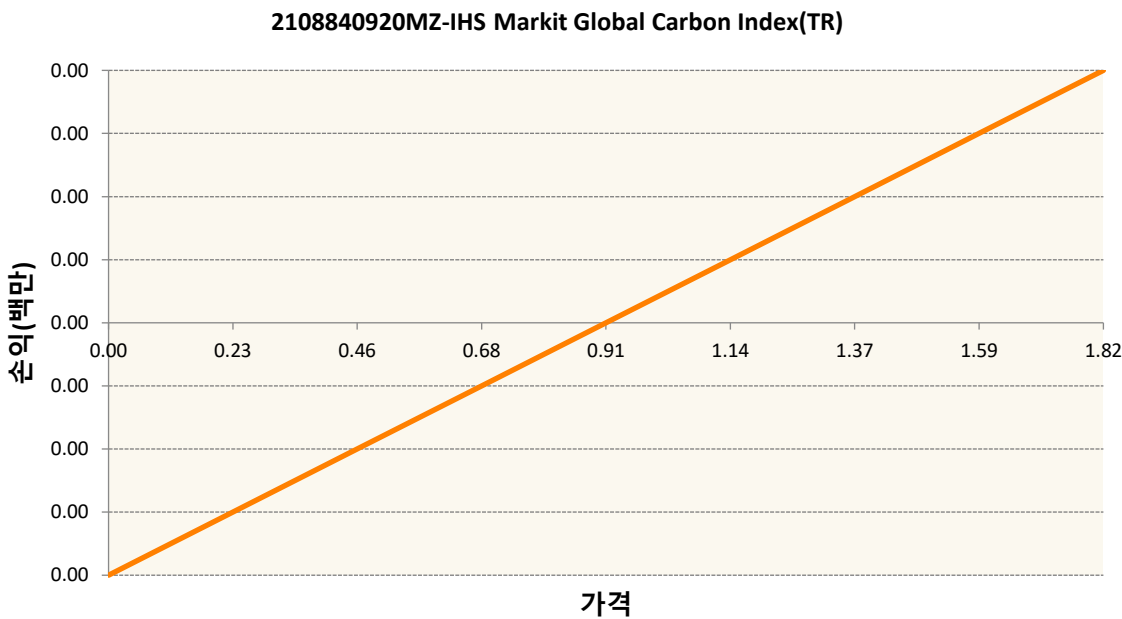
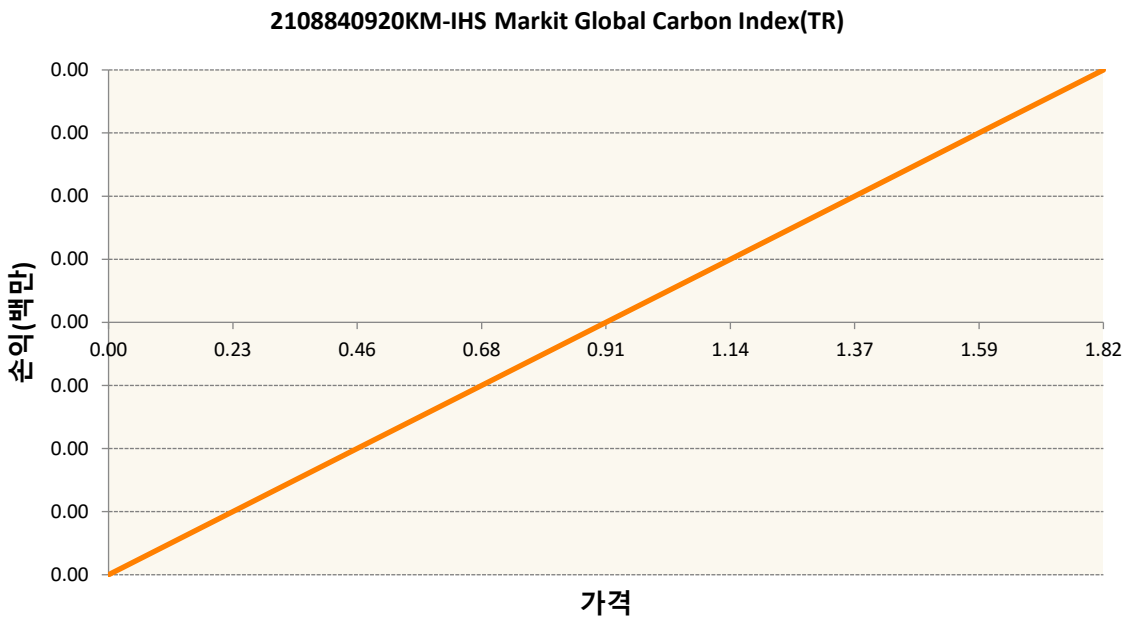
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

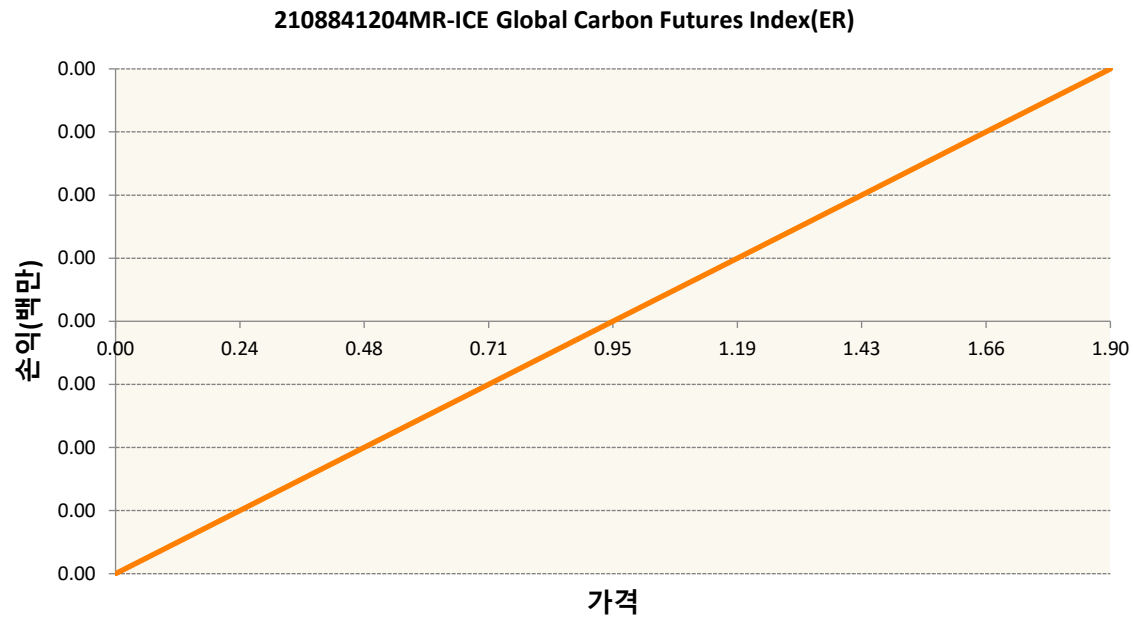
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	18,400	0	18,400	

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108840920IIHS Markit Global Carbon Index(TR)		920
2108840920IIHS Markit Global Carbon Index(TR)		184
2108841204IIICE Global Carbon Futures Index(ER)		368

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)		(단위:백만원)
		1,869

공시일	2023-12-07
기준일	2023-12-06

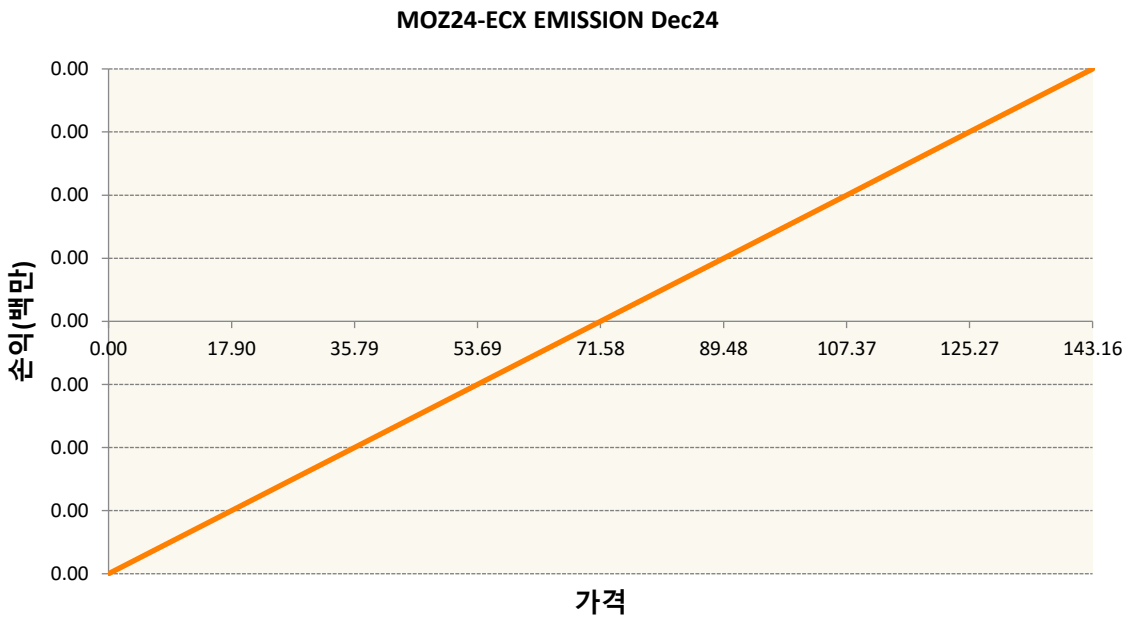
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	7,762	0	7,762	
누계	지수	스왑	479	0	479	장외
누계	통화	선도	0	1,429	-1,429	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213DBV KRW/EUR 28-12-23E	114
MOZ24 ECX EMISSION Dec24	621
SWICEUACN ICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX	7

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

(단위:백만원)

1,205

공시일	2023-12-07
기준일	2023-12-06

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)	20
SWCSI00000 신한CSI Index 230622 (메리츠)	20
SWCSI00000 신한CSI Index 230922 (키움)	13
SWCSI00000 신한CSI Index 231013 (NH)	15

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

(단위:백만원)

99

공시일	2023-12-07
기준일	2023-12-06

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)	4
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)

12

공시일	2023-12-07
기준일	2023-12-06

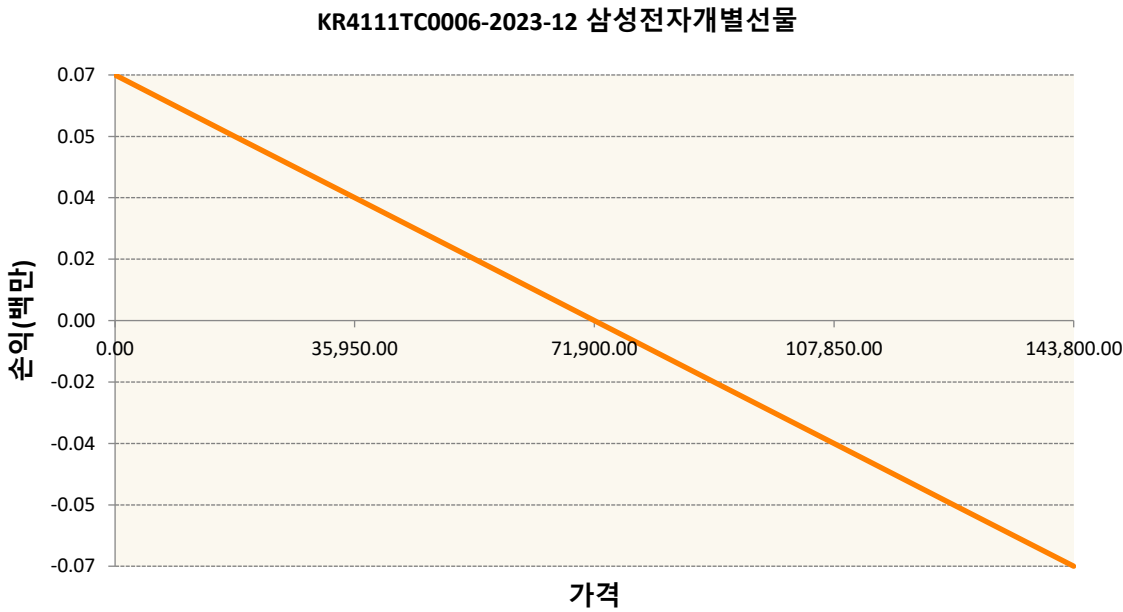
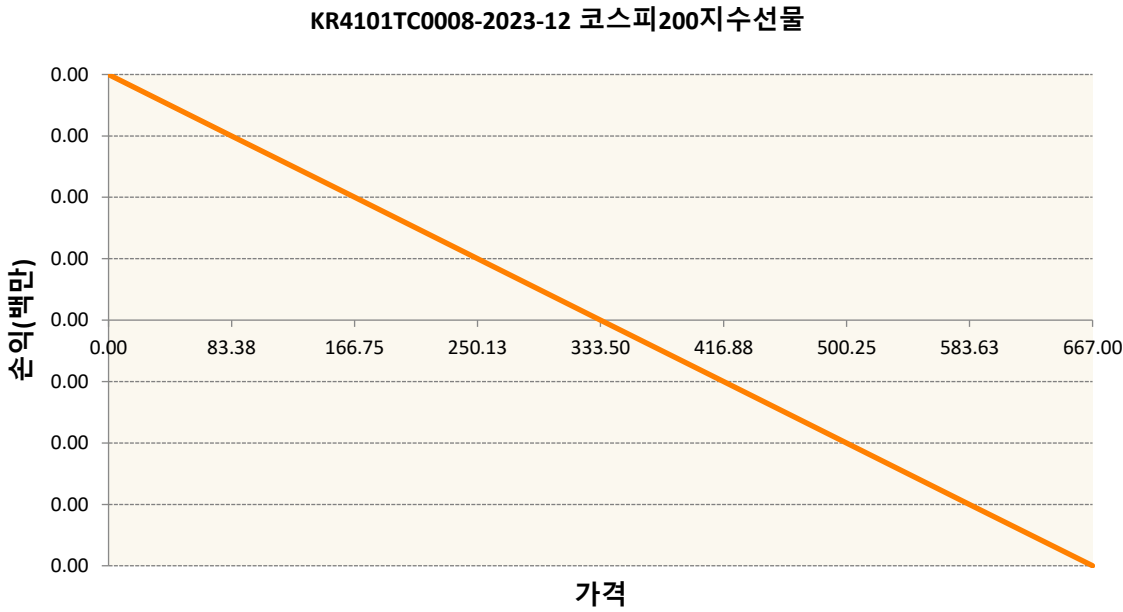
에퀴티알파일반사모혼합자산

1. 계약금액

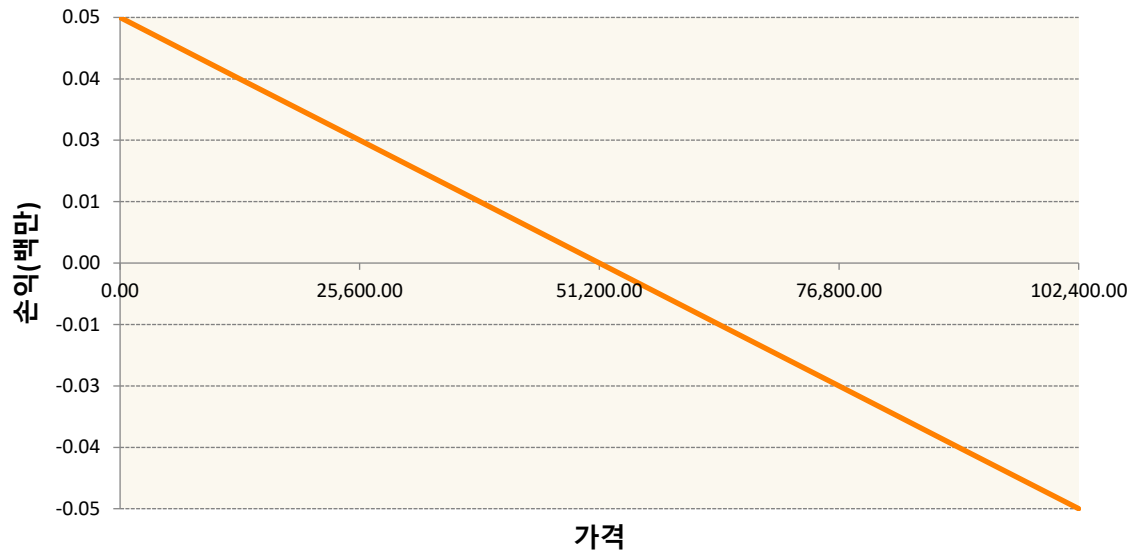
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	195	-195	장내
누계	유가증권	선물	0	3,136	-3,136	장내

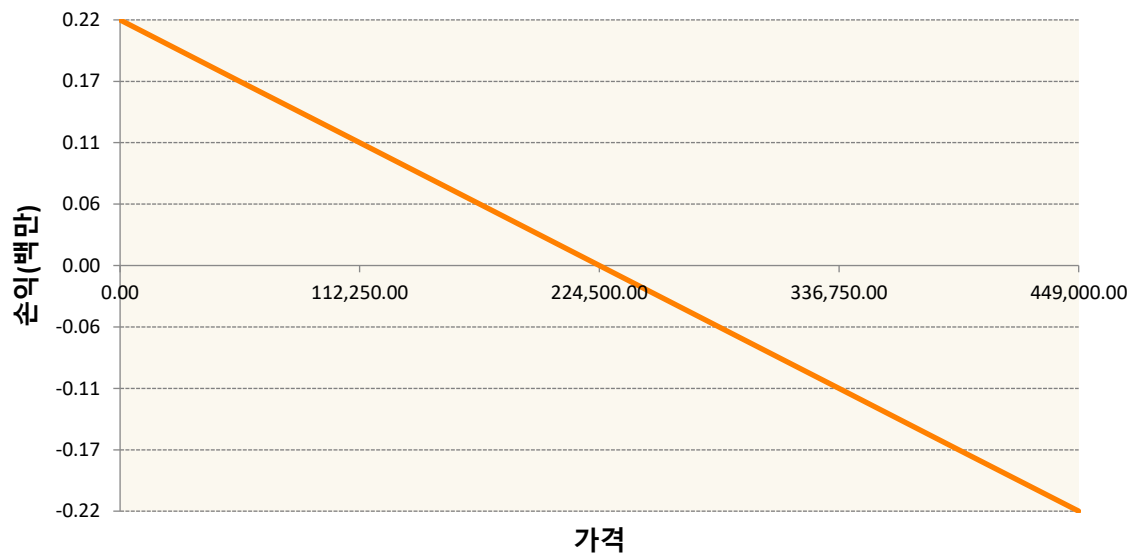
2. 만기시점의 손익구조



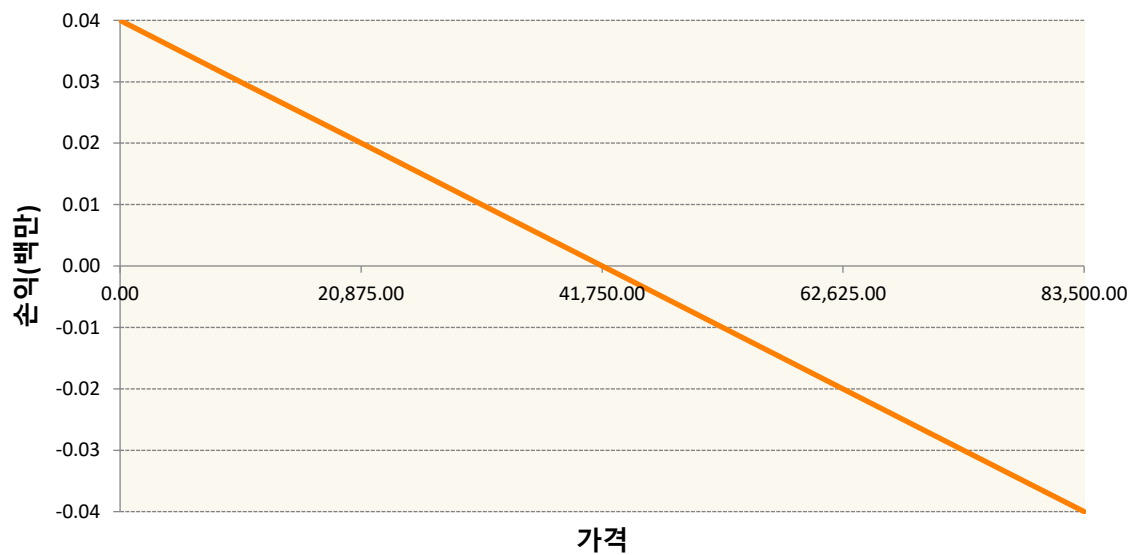
KR4112TC0005-2023-12 SK텔레콤개별선물



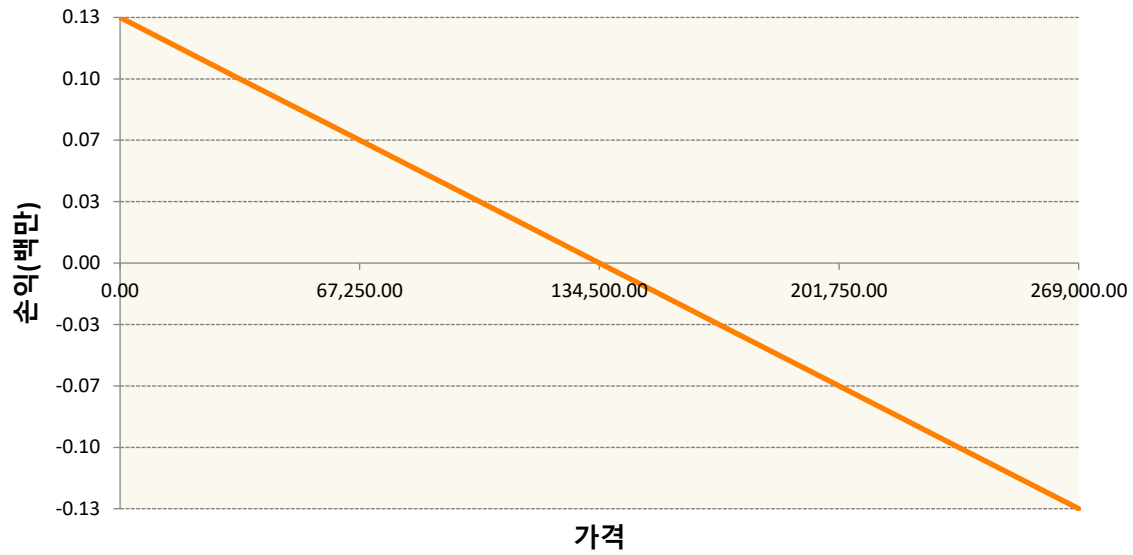
KR4120TC0005-2023-12 현대모비스개별선물



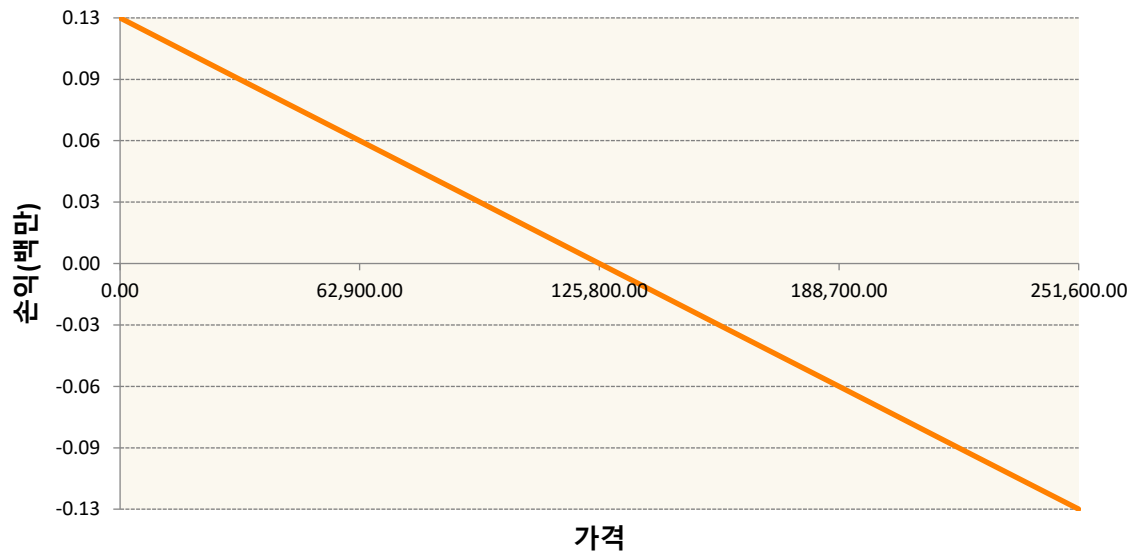
KR4140TC0001-2023-12 하나금융지주개별선물



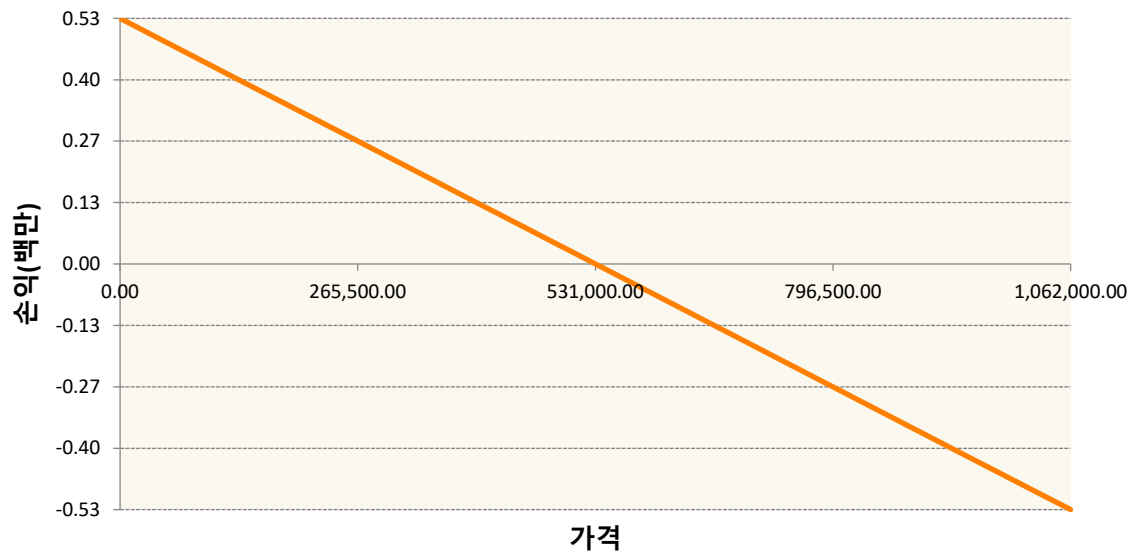
KR4141TC0000-2023-12 SK이노베이션개별선물



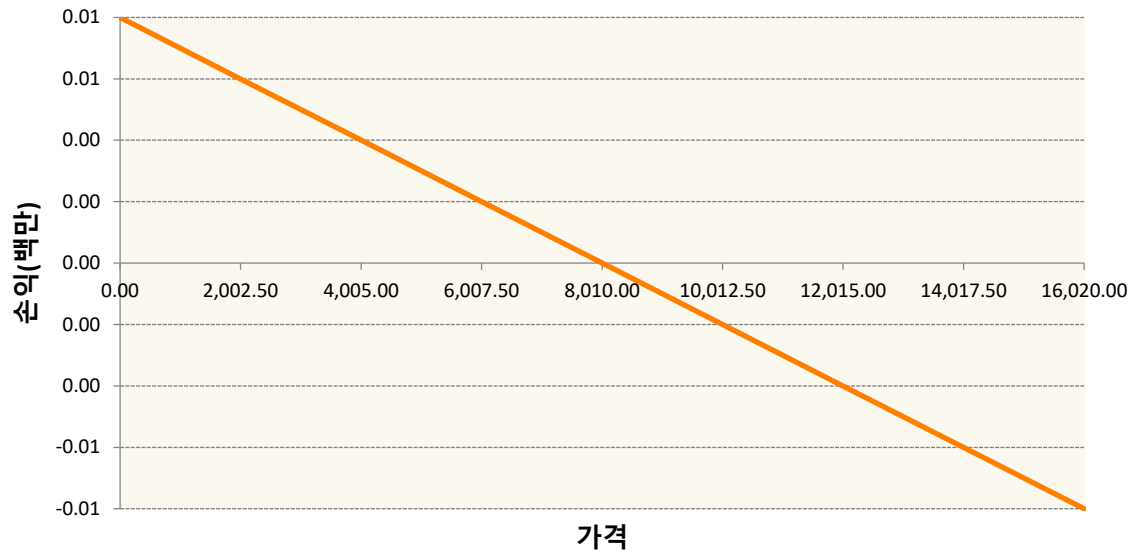
KR4150TC0008-2023-12 SK하이닉스개별선물



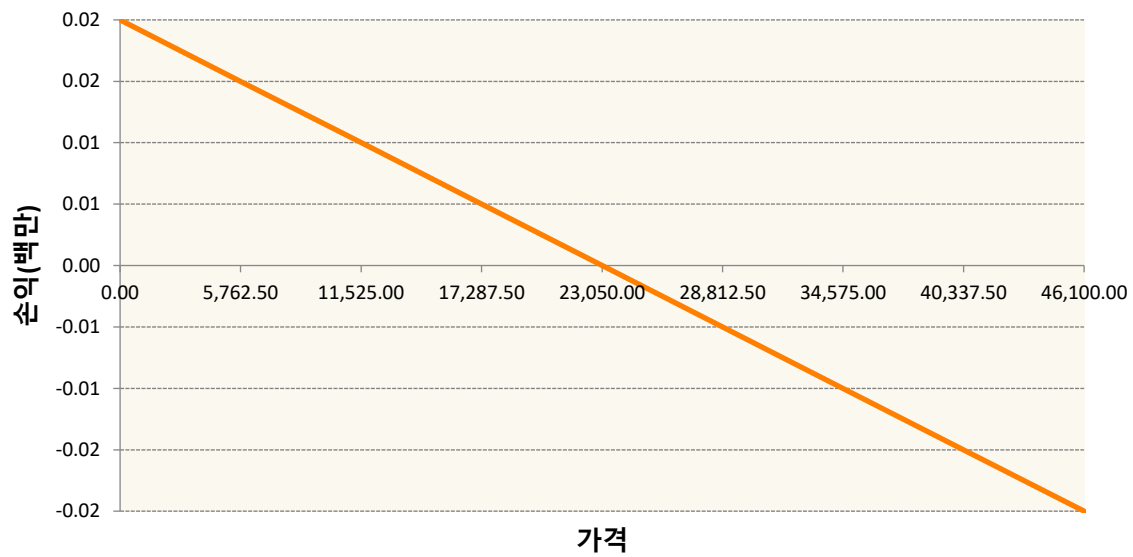
KR41B3TC0002-2023-12 고려아연개별선물



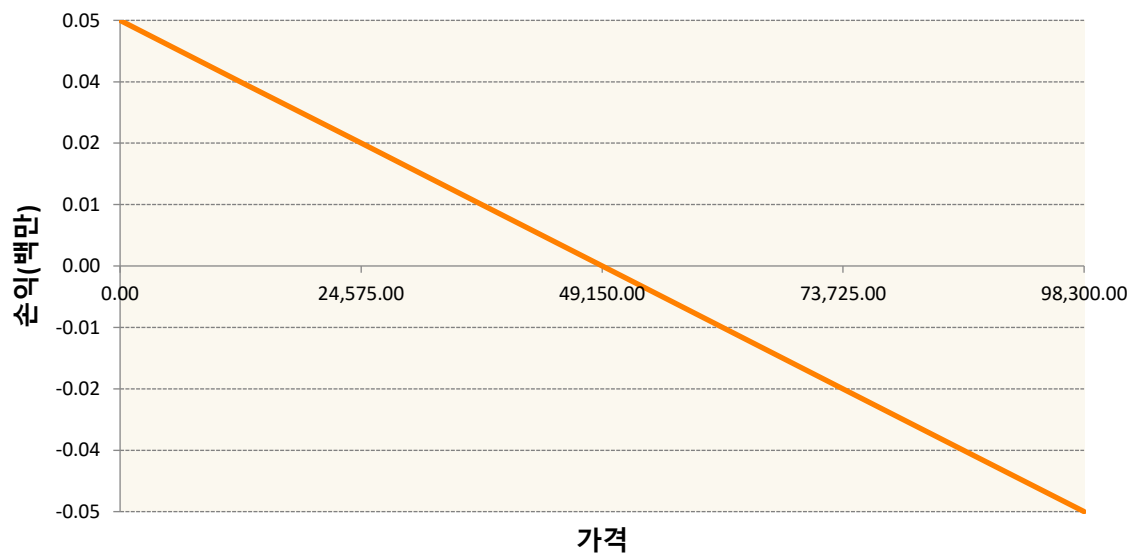
KR41BFTC0009-2023-12 삼성중공업개별선물



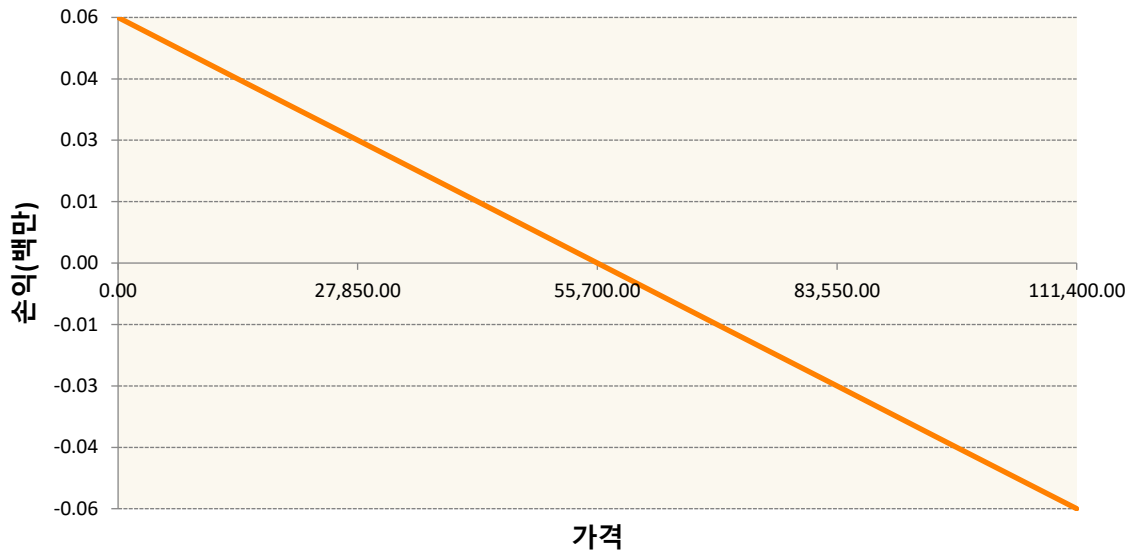
KR41BKTC0002-2023-12 하이트진로개별선물



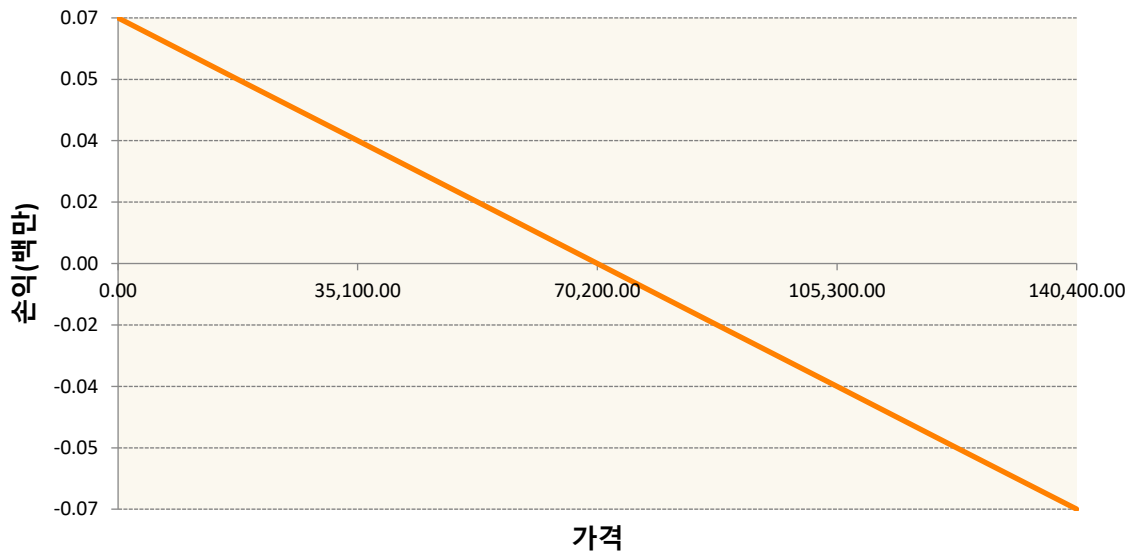
KR41CNTC0008-2023-12 포스코 ICT개별선물



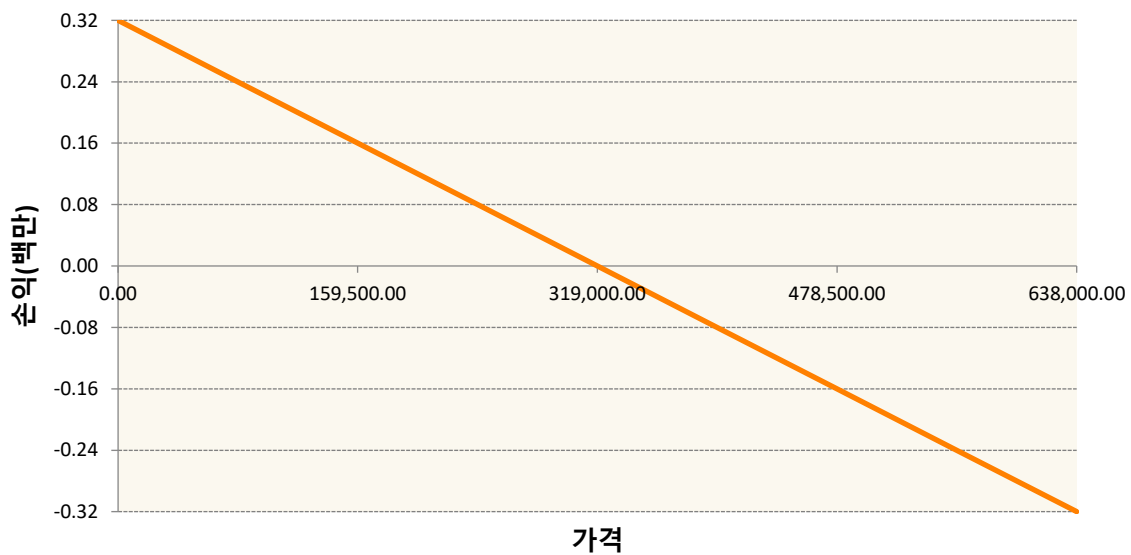
KR41E5TC0004-2023-12 넷마블개별선물



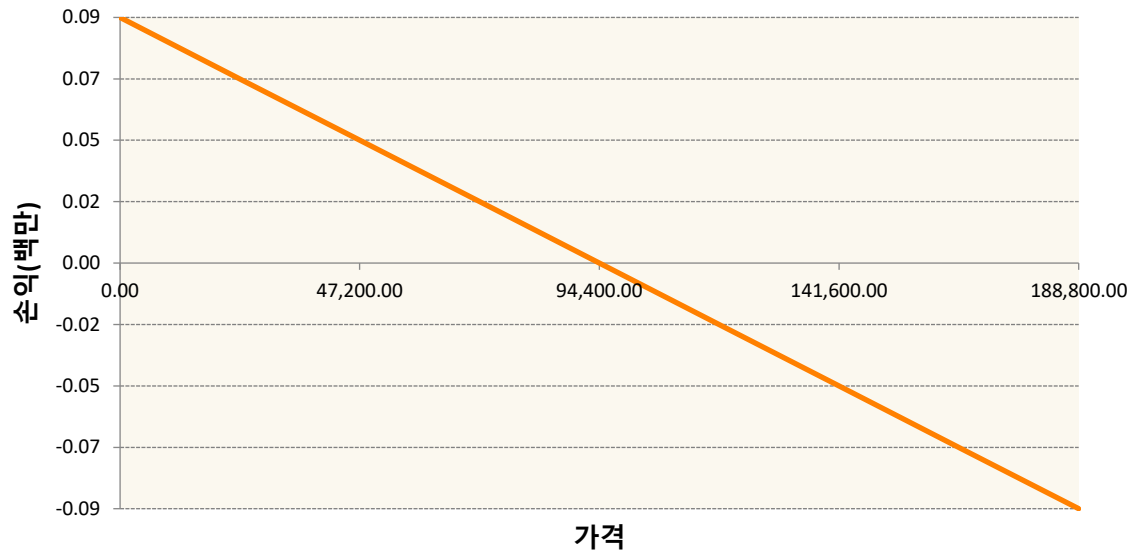
KR41E6TC0003-2023-12 셀트리온헬스케어개별선물



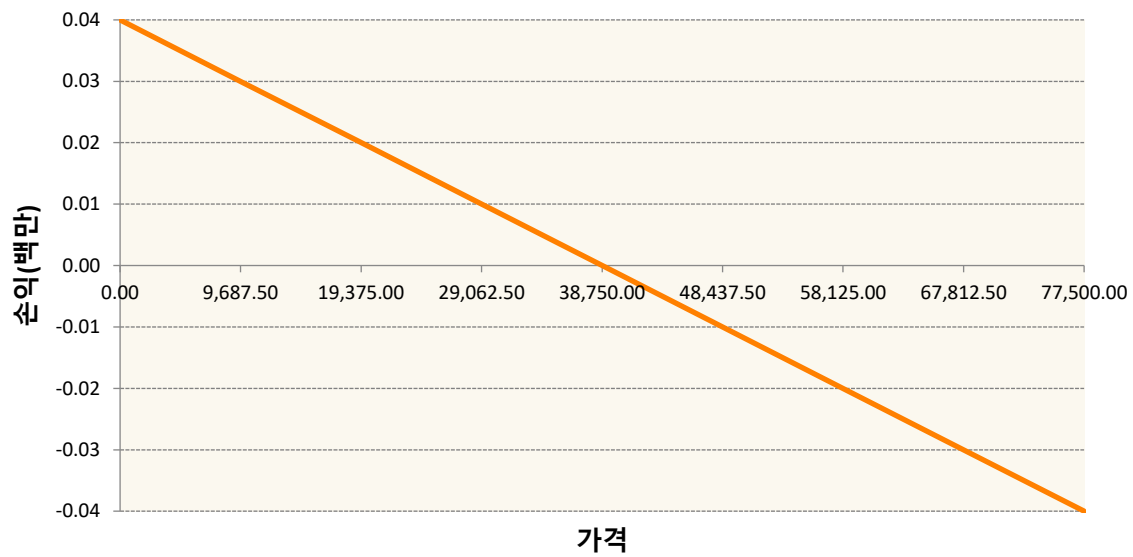
KR41E8TC0001-2023-12 포스코케미칼개별선물



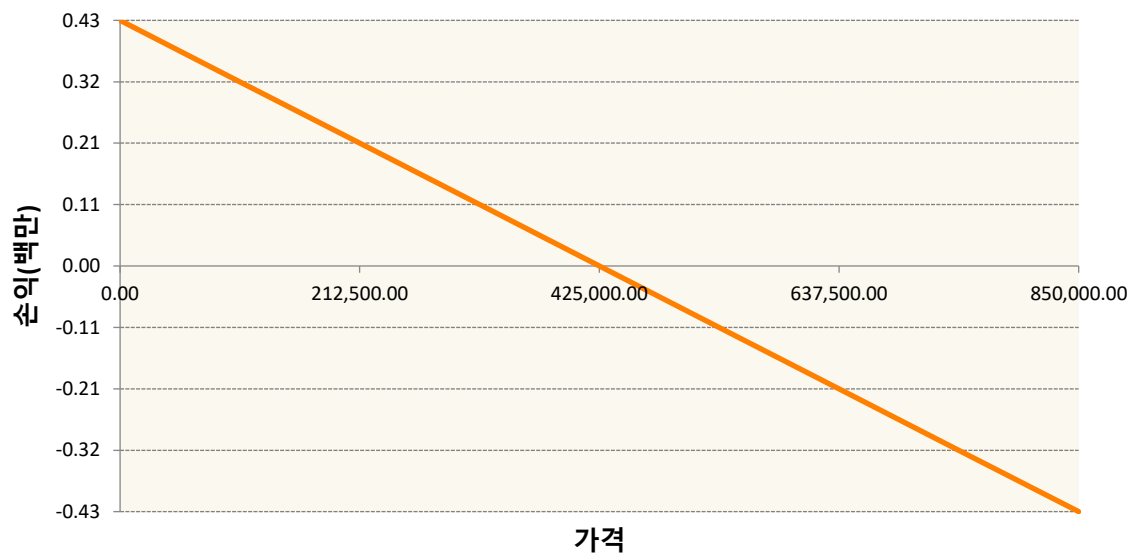
KR41EFTC0006-2023-12 JYP Ent.개별선물



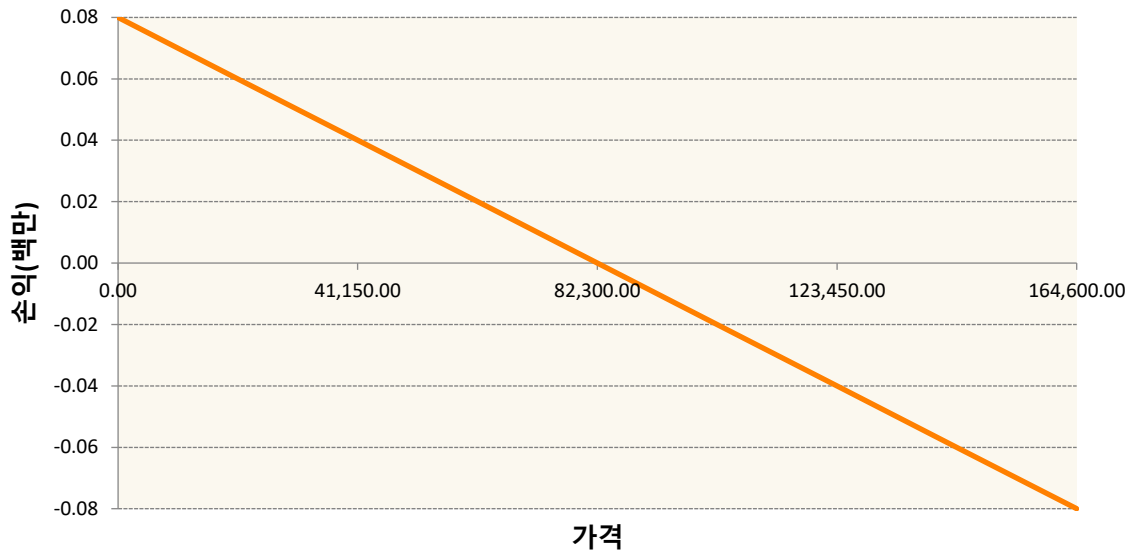
KR41ERTC0002-2023-12 DL이앤씨개별선물



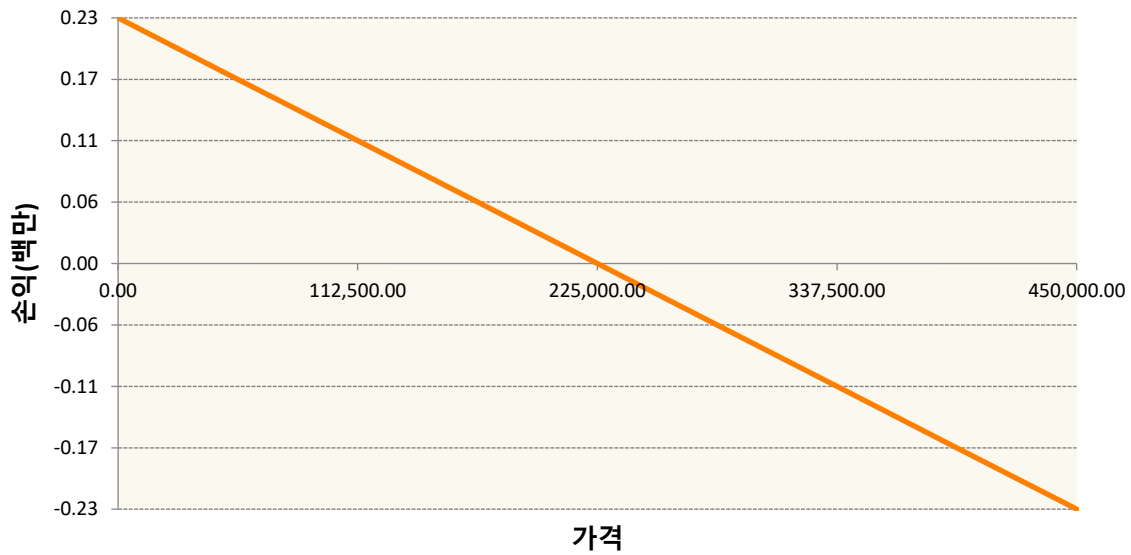
KR41F5TC0001-2023-12 LG에너지솔루션개별선물



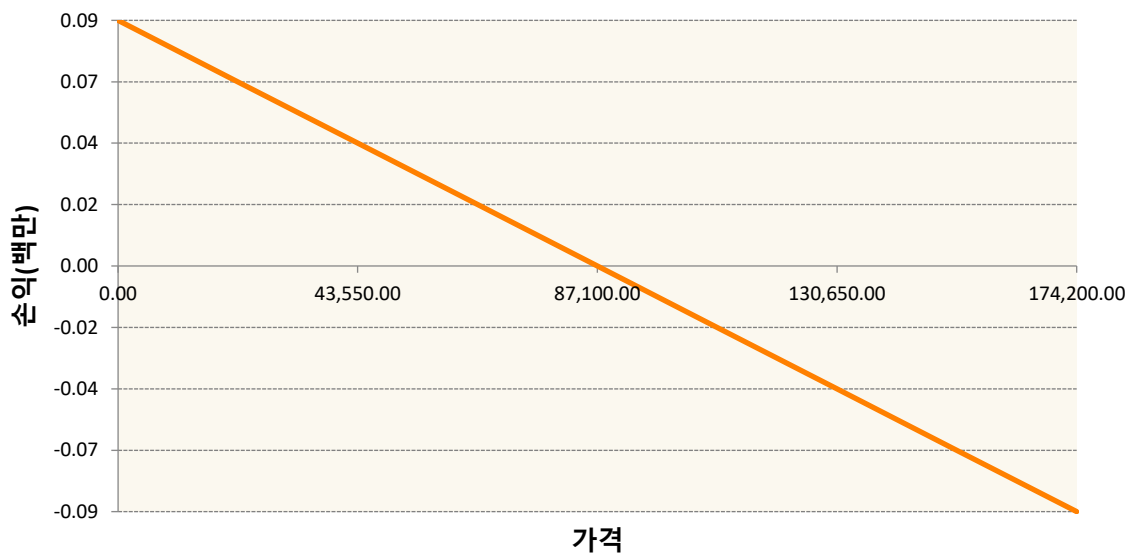
KR41FBTC0009-2023-12 SK아이이테크놀로지개별선물



KR41FCTC0008-2023-12 하이브개별선물



KR41FSTC0000-2023-12 LS개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101TC00 2023-12 코스피200지수선물	187
KR4111TC00 2023-12 삼성전자개별선물	19
KR4112TC00 2023-12 SK텔레콤개별선물	4
KR4120TC00 2023-12 현대모비스개별선물	3
KR4140TC00 2023-12 하나금융지주개별선물	2
KR4141TC00 2023-12 SK이노베이션개별선물	1
KR4150TC00 2023-12 SK하이닉스개별선물	1
KR41B3TC00 2023-12 고려아연개별선물	0.42
KR41BFTC00 2023-12 삼성중공업개별선물	2
KR41BKTC00 2023-12 하이트진로개별선물	5
KR41CNTC00 2023-12 포스코 ICT개별선물	2
KR41E5TC00 2023-12 넷마블개별선물	7
KR41E6TC00 2023-12 셀트리온헬스케어개별선물	2
KR41E8TC00 2023-12 포스코케미칼개별선물	4
KR41EFTC00 2023-12 JYP Ent.개별선물	1
KR41ERTC00 2023-12 DL이앤씨개별선물	4
KR41F5TC00 2023-12 LG에너지솔루션개별선물	2
KR41FBTC00 2023-12 SK아이이테크놀로지개별선물	2
KR41FCTC00 2023-12 하이브개별선물	2
KR41FSTC00 2023-12 LS개별선물	1

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

299

공시일	2023-12-07
기준일	2023-12-06

코리아인덱스(주식-파생형)(종)

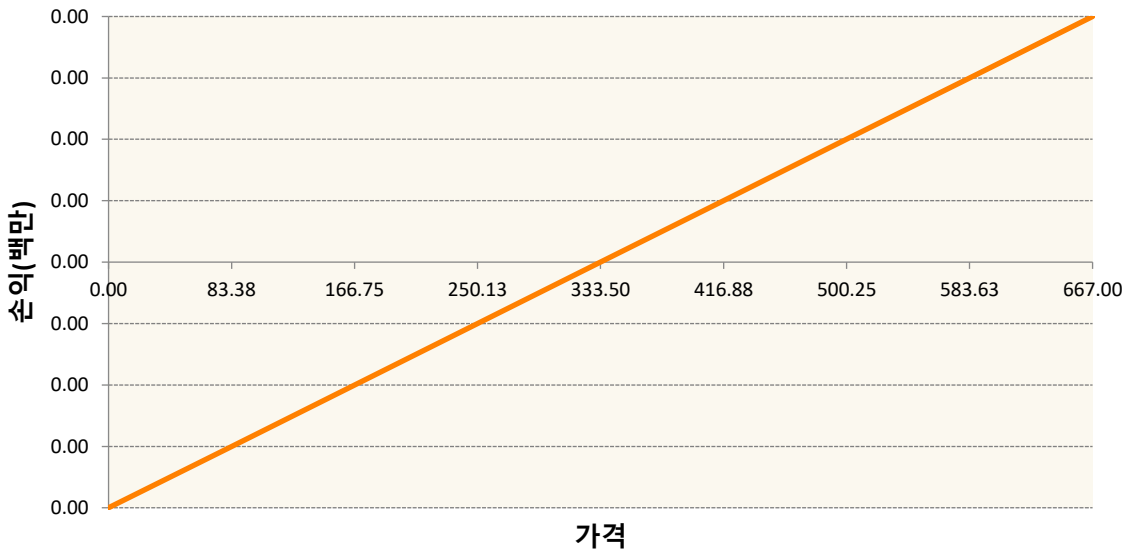
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	4,336	0	4,336	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101TC0008-2023-12 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101TC0008			2023-12 코스피200지수선물				347
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-347	-347	-347	-347	-347	-347	-347
-5.33%	-231	-231	-231	-231	-231	-231	-231
-2.67%	-116	-116	-116	-116	-116	-116	-116
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	116	116	116	116	116	116	116
5.33%	231	231	231	231	231	231	231
8.00%	347	347	347	347	347	347	347

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

(단위:백만원)

321

공시일	2023-12-07
기준일	2023-12-06

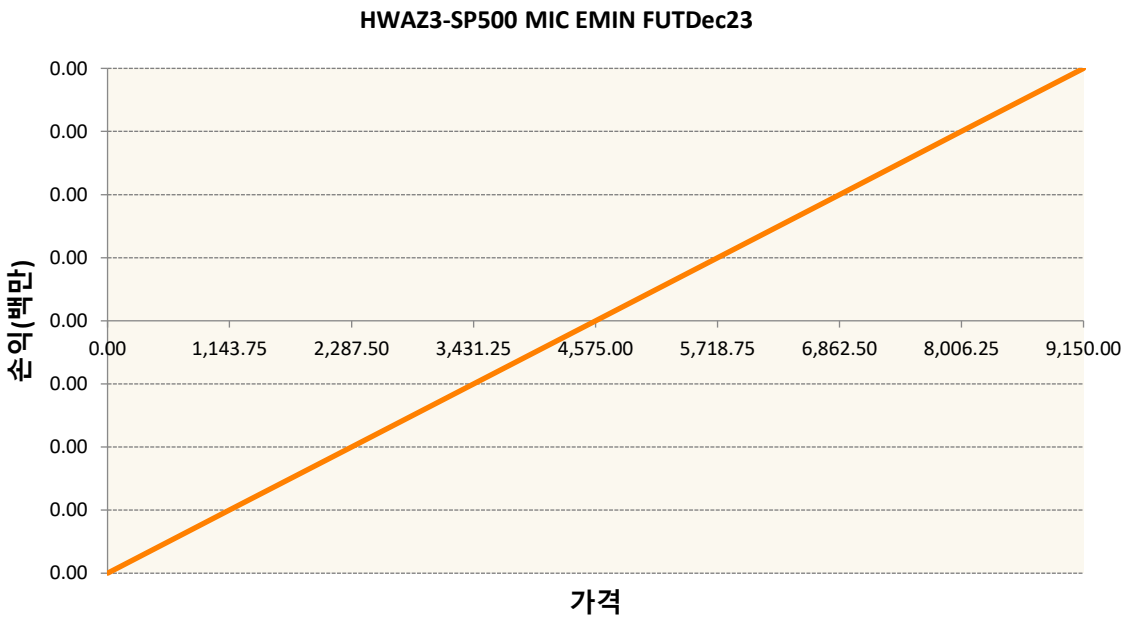
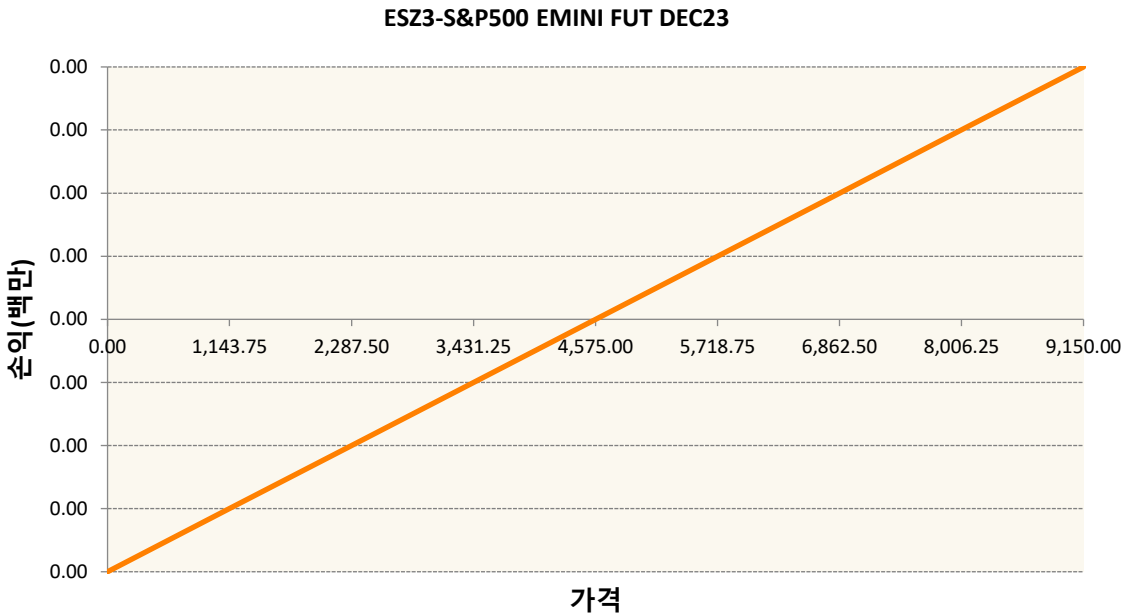
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

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	309	0	309	
누계	유가증권	선물	1,840	0	1,840	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESZ3	S&P500 EMINI FUT DEC23	25
HWAZ3	SP500 MIC EMIN FUTDec23	147

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	146

공시일	2023-12-07
기준일	2023-12-06

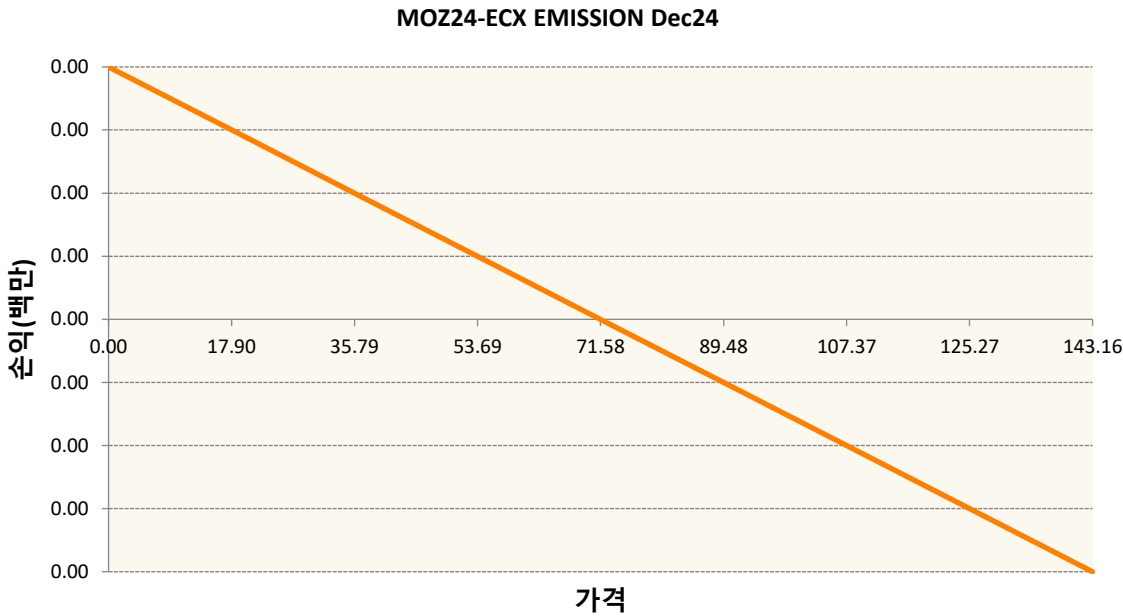
SOL유럽탄소배출권선물인버스ICE특별자산상

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	7,214	-7,214	
누계	지수	스왑	479	0	479	장외
누계	통화	선도	0	1,717	-1,717	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213DBV KRW/EUR 28-12-23E	7
FXW213DBV KRW/EUR 28-12-23E	130
MOZ24 ECX EMISSION Dec24	577
SWICEUACN ICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX	7

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

(단위:백만원)

1,142

공시일	2023-12-07
기준일	2023-12-06

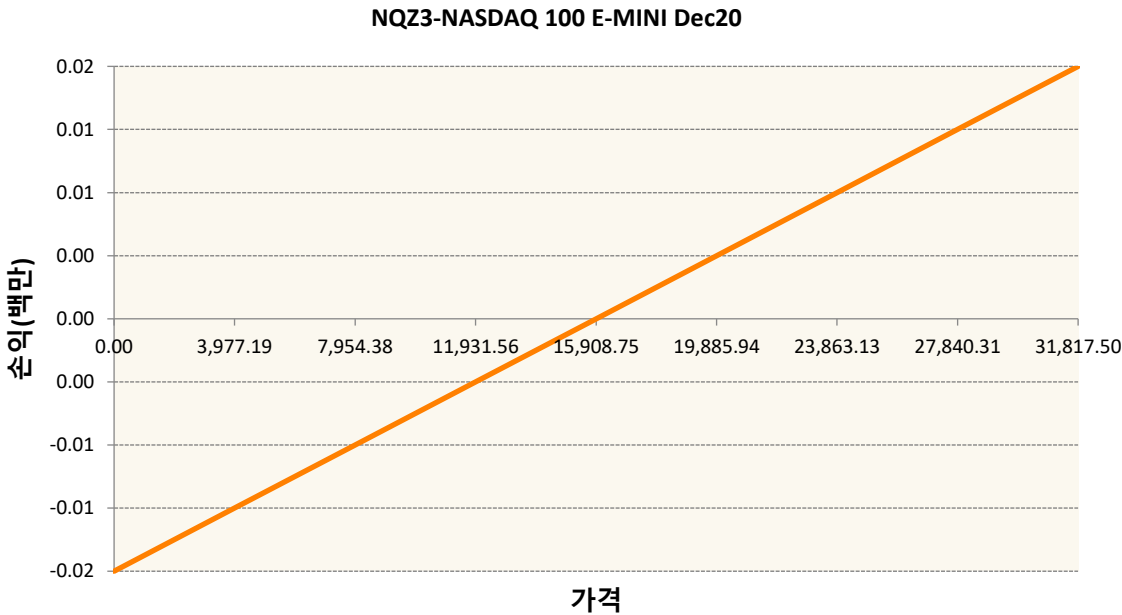
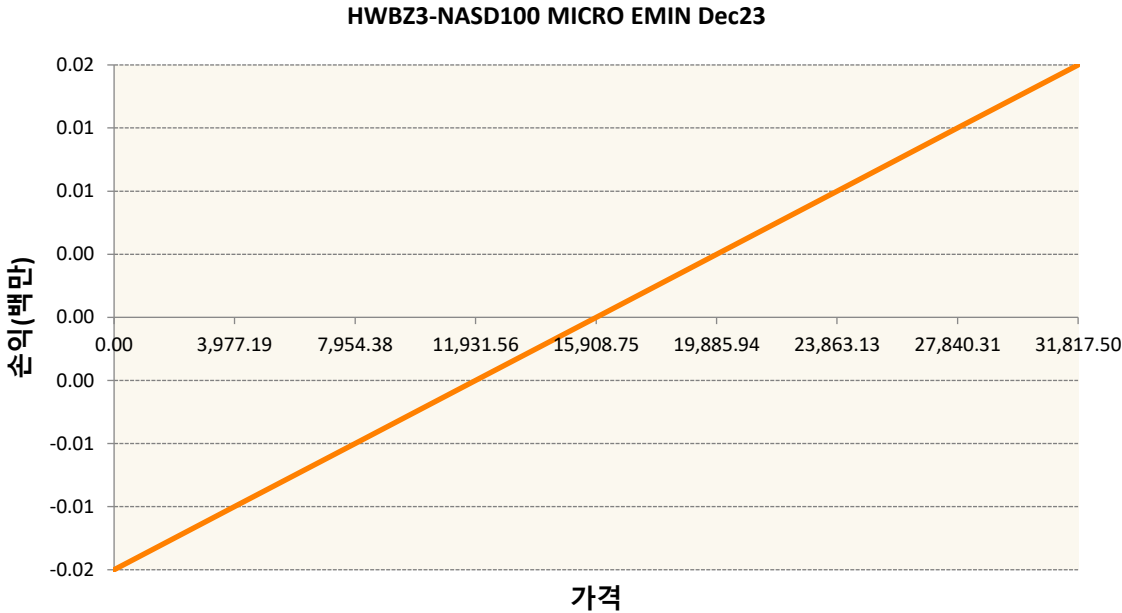
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

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	430	0	430	
누계	유가증권	선물	1,667	0	1,667	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HWBZ3	NASD100 MICRO EMIN Dec23	133
NQZ3	NASDAQ 100 E-MINI Dec20	34

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	152

공시일	2023-12-07
기준일	2023-12-06

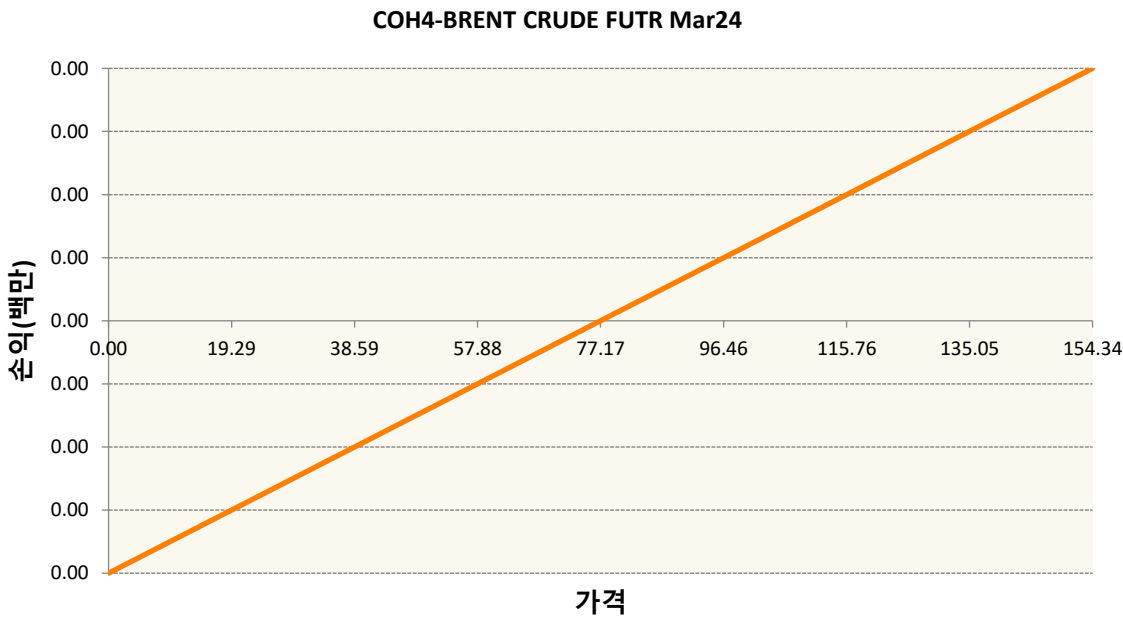
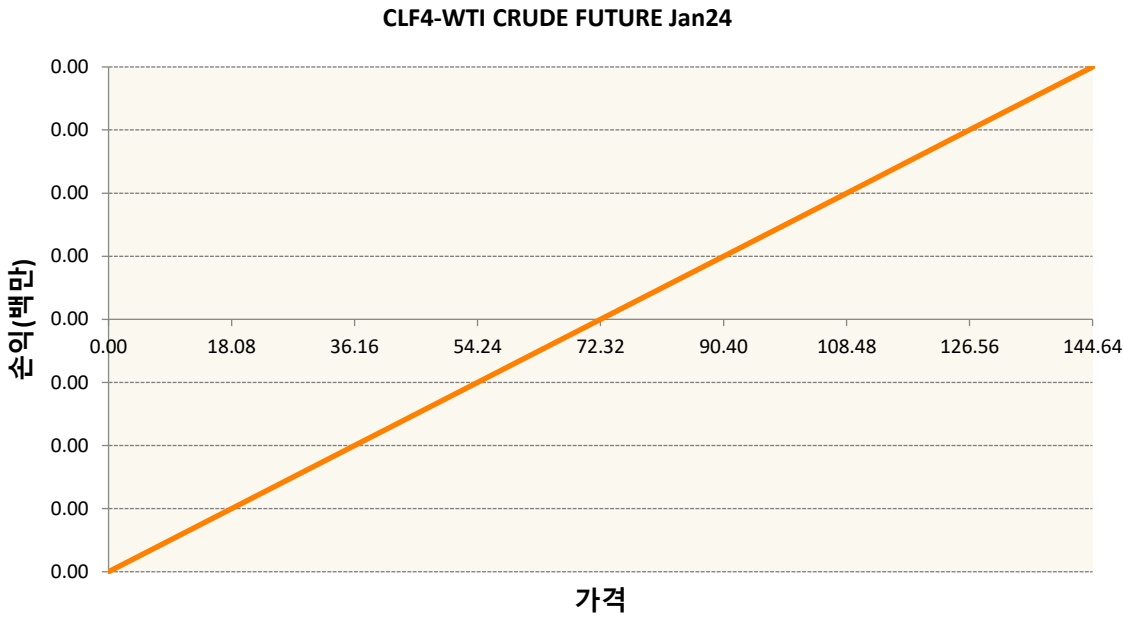
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

1. 계약금액

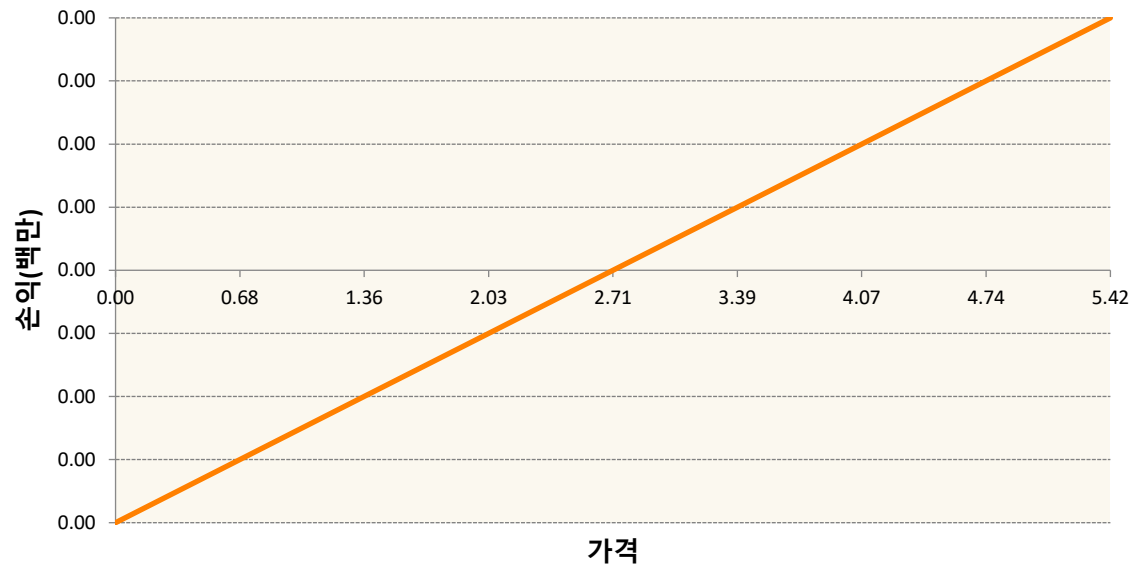
(단위:백만원)

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	1,213	0	1,213	
누계	통화	선물	0	118	-118	장내

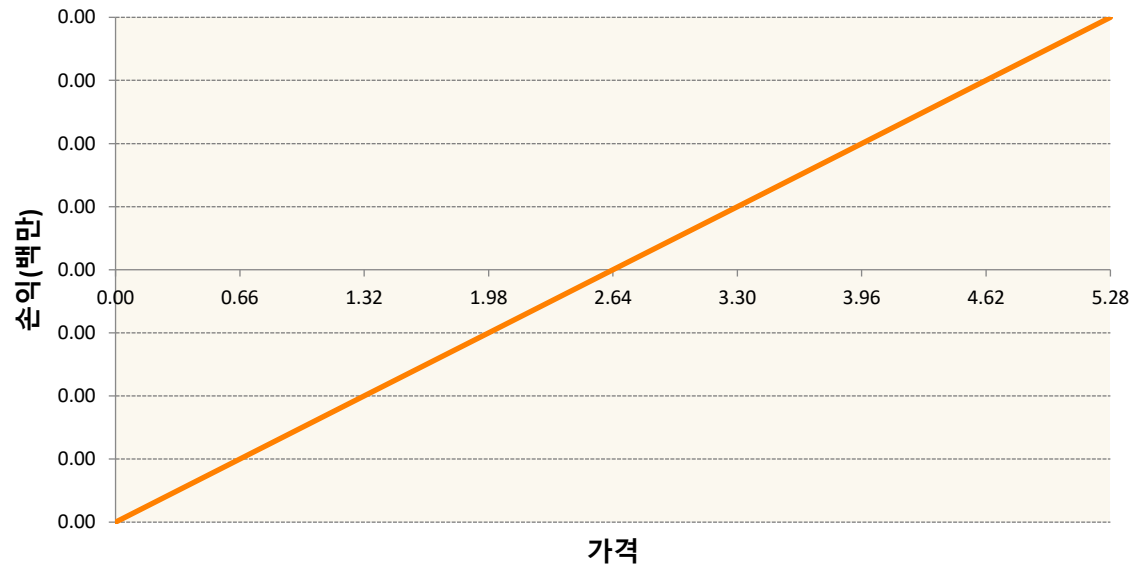
2. 만기시점의 손익구조



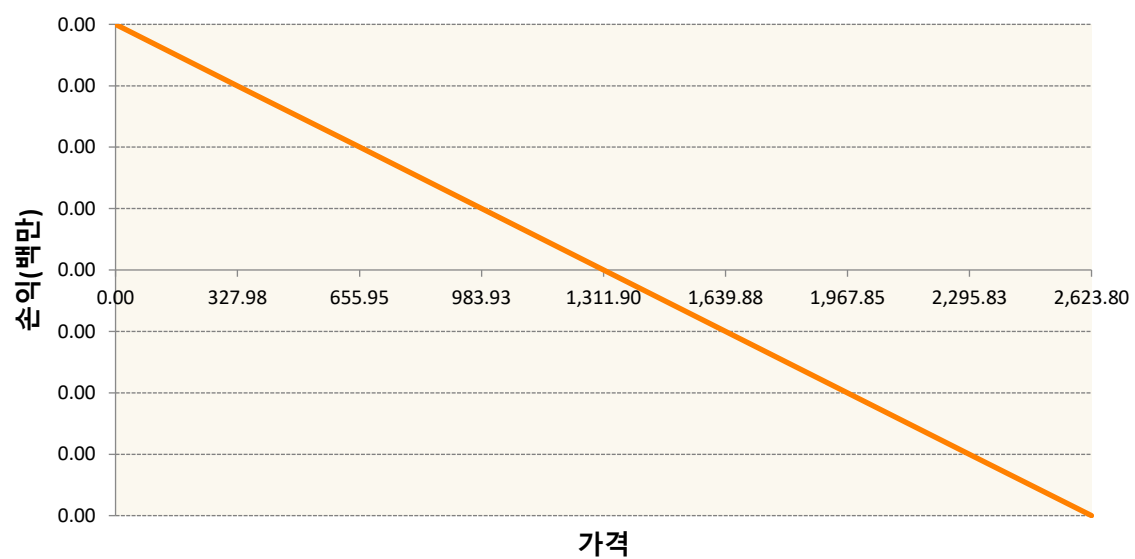
EOF4-E-MINI NATURAL GAS Jan24



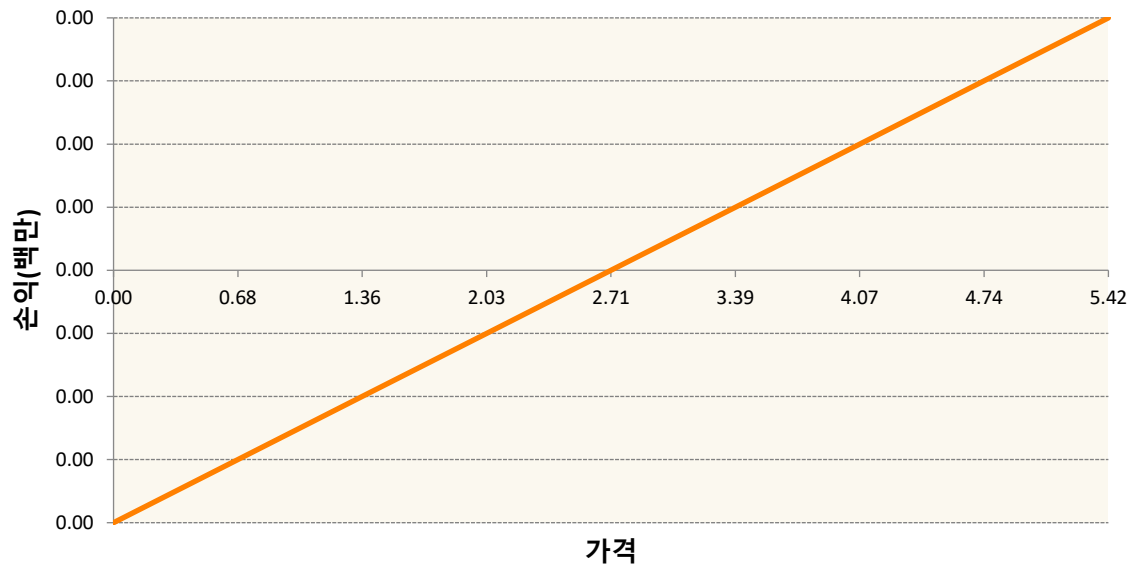
HOF4-NY Harb ULSD Fut Jan24



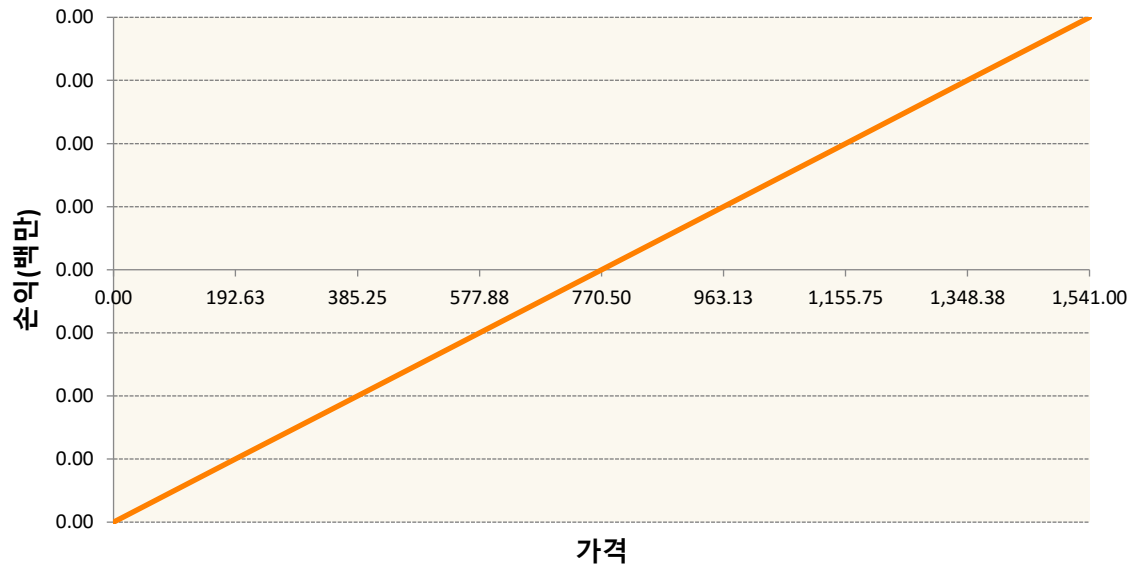
KR4175TC0009-2023-12 달러선물



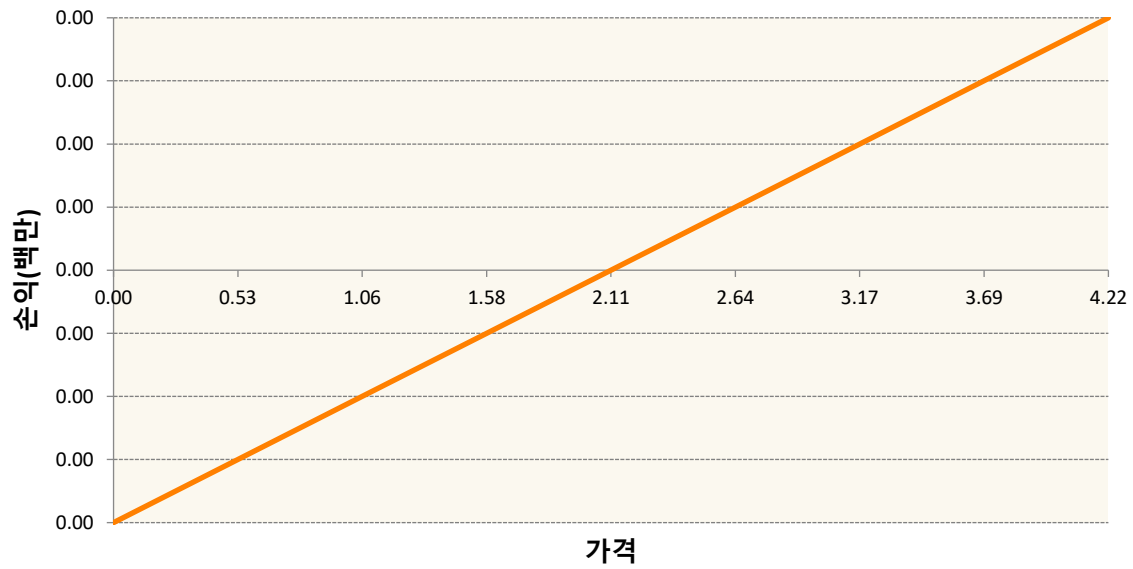
NGF24-NATURAL GAS FUTR Jan24



QSF4-Low Su Gasoil G Jan24



XBF4-GASOLINE RBOB FUT Jan24



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLF4	WTI CRUDE FUTURE Jan24	23
COH4	BRENT CRUDE FUTR Mar24	24
EOF4	E-MINI NATURAL GAS Jan24	2
HOF4	NY Harb ULSD Fut Jan24	12
KR4175TC00	2023-12 달러선물	9
NGF24	NATURAL GAS FUTR Jan24	18
QSF4	Low Su Gasoil G Jan24	8
XBF4	GASOLINE RBOB FUT Jan24	9

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

237