

공시일	2023-12-18
기준일	2023-12-15

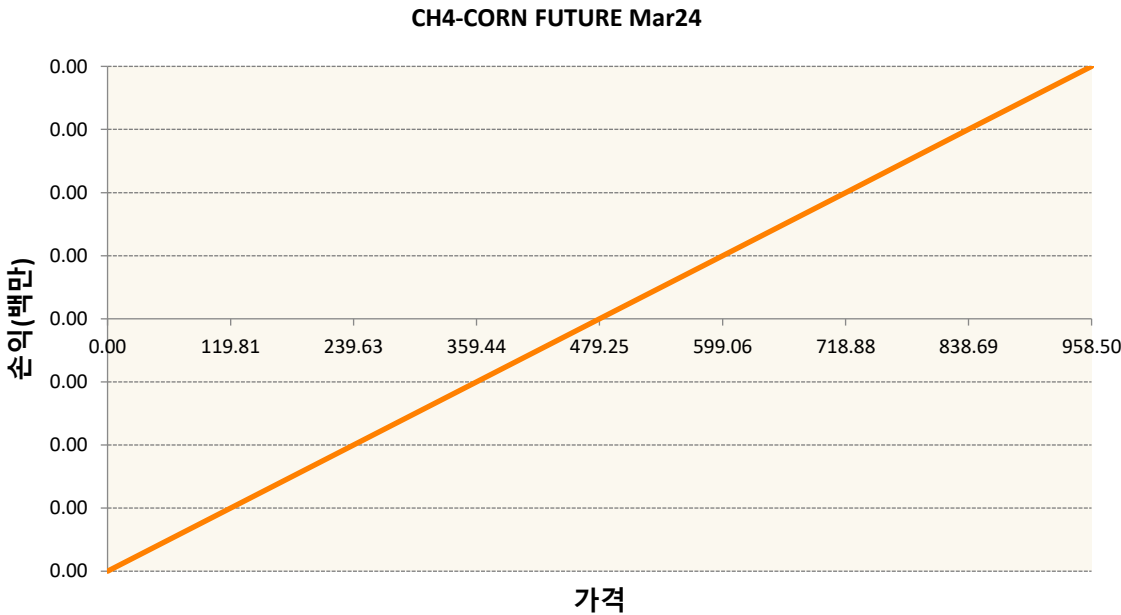
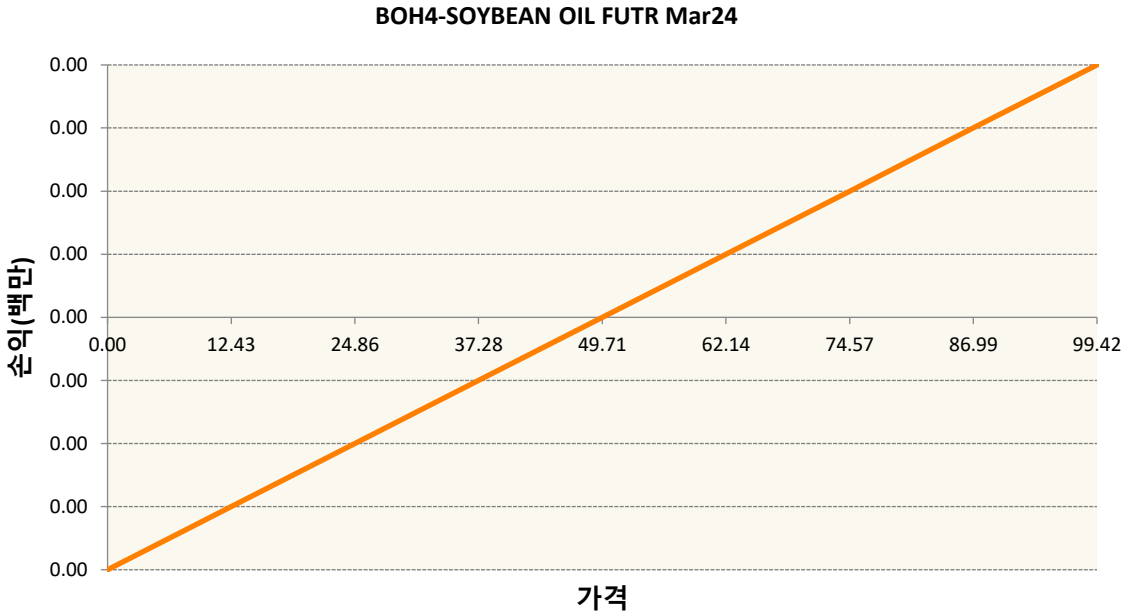
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

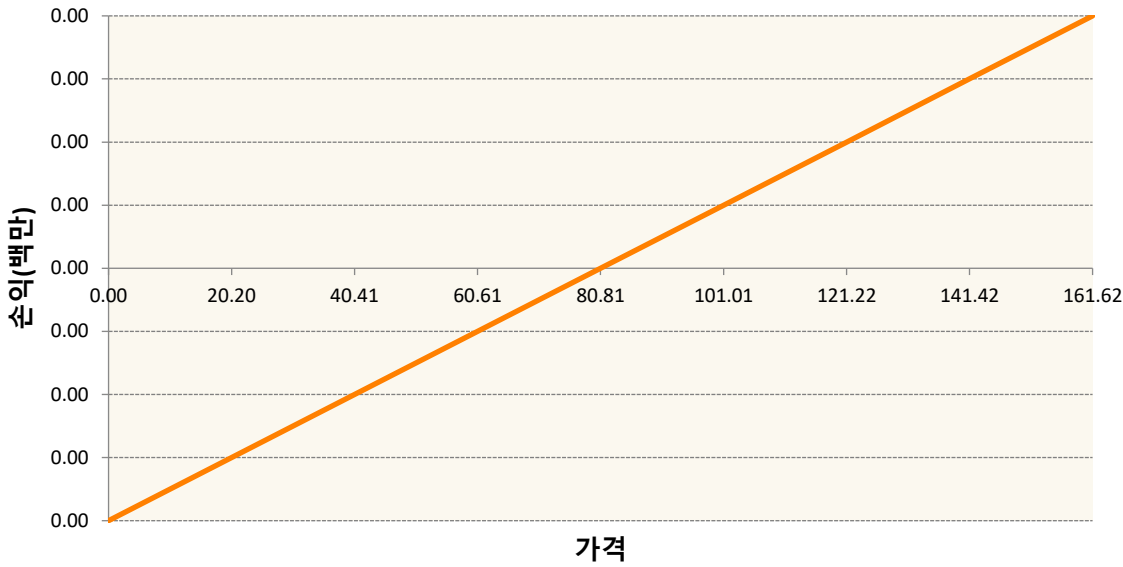
(단위:USD 백만)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	478	-478	장내
누계	유가증권	선물	4,754	0	4,754	
누계	통화	선물	0	479	-479	장내

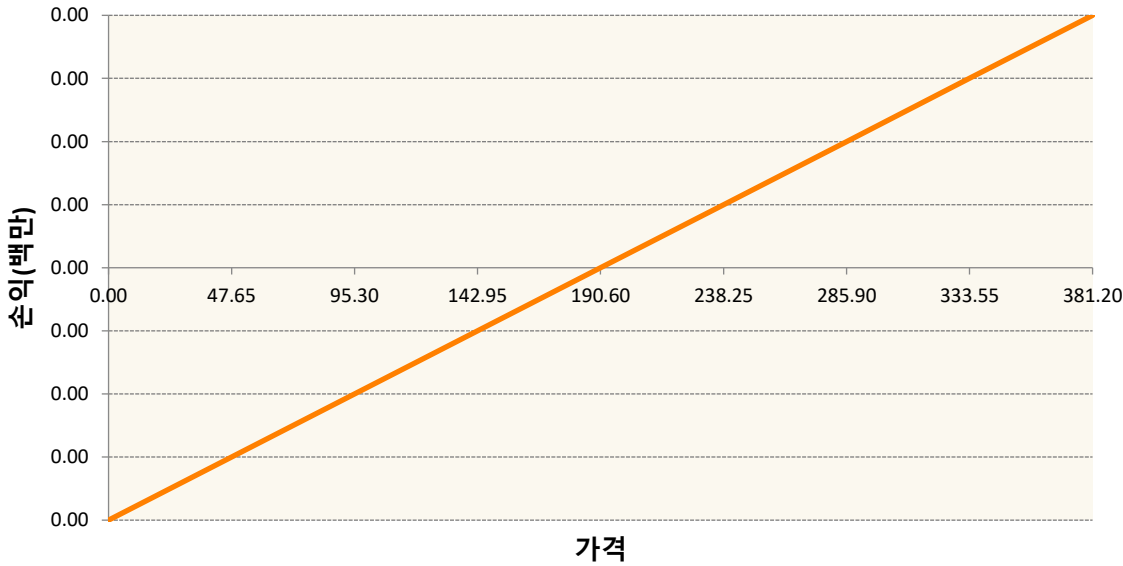
2. 만기시점의 손익구조



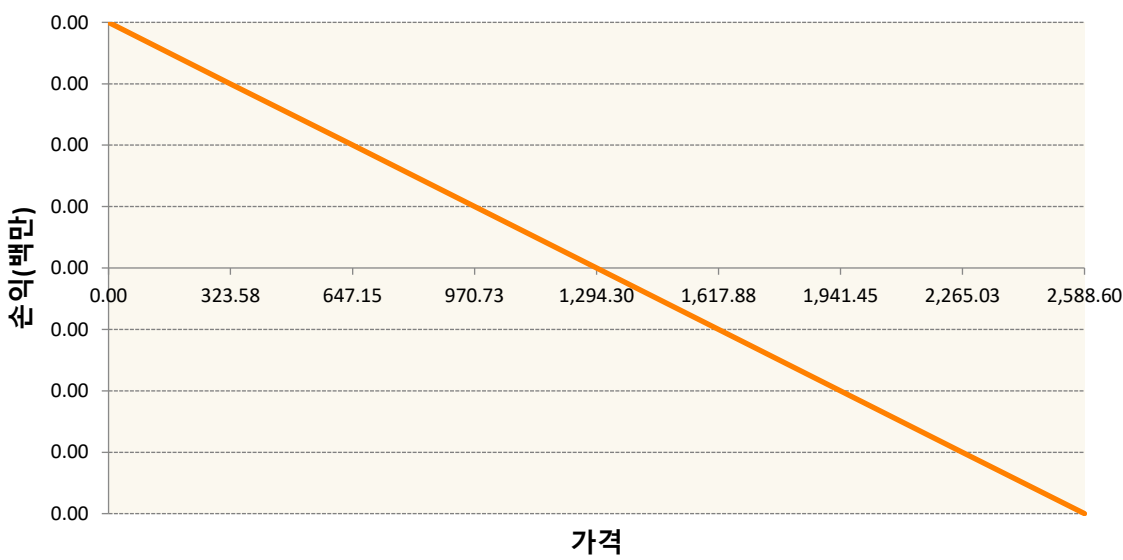
CTH4-COTTON NO.2 FUTR Mar24



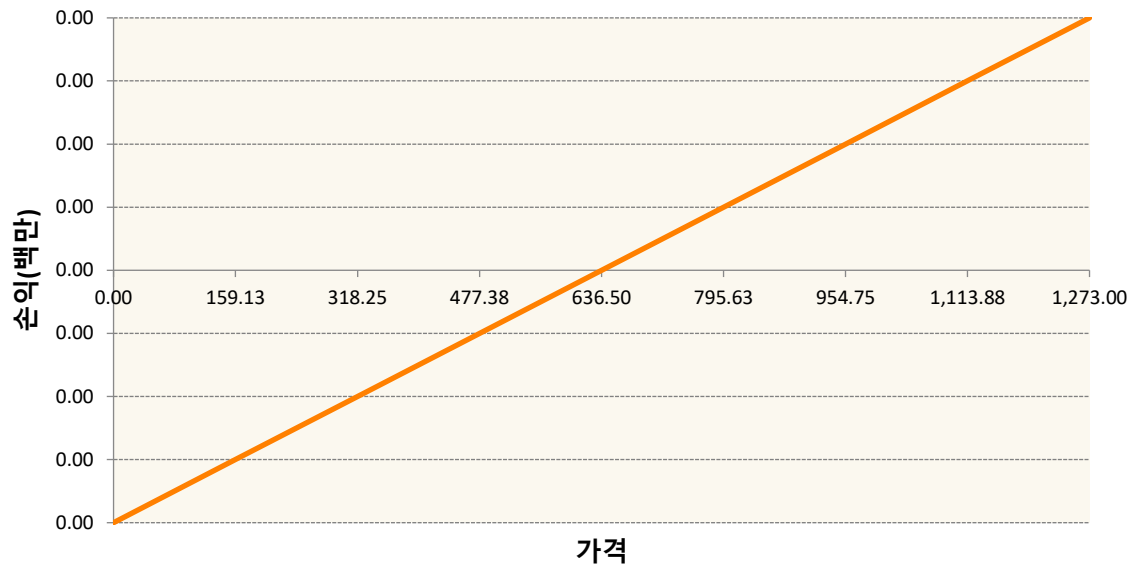
KCH4-COFFEE 'C' FUTURE Mar24



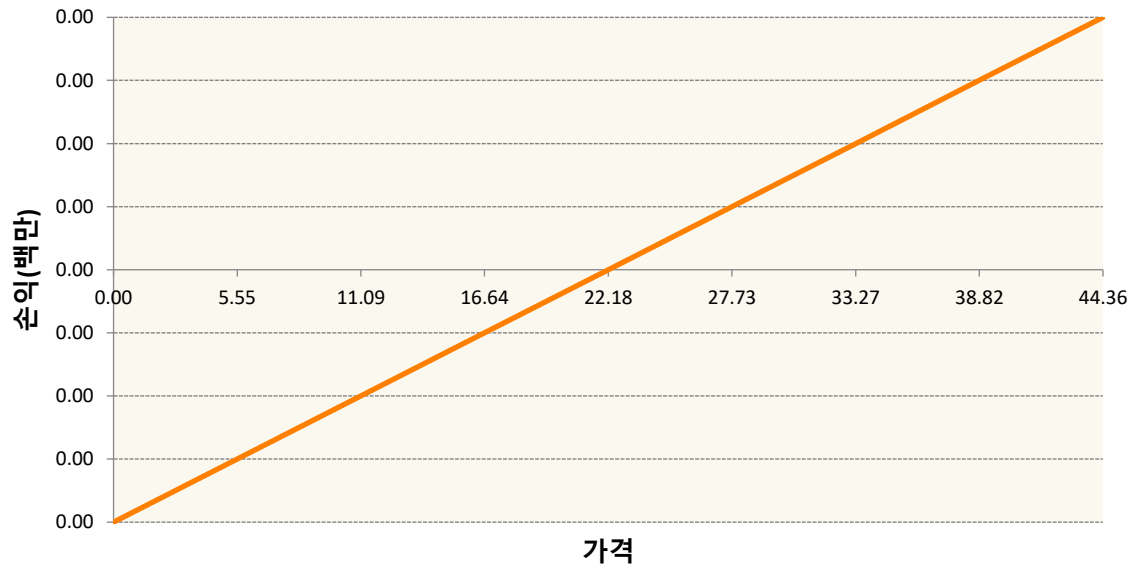
KR4175V10001-2024-01 달러선물



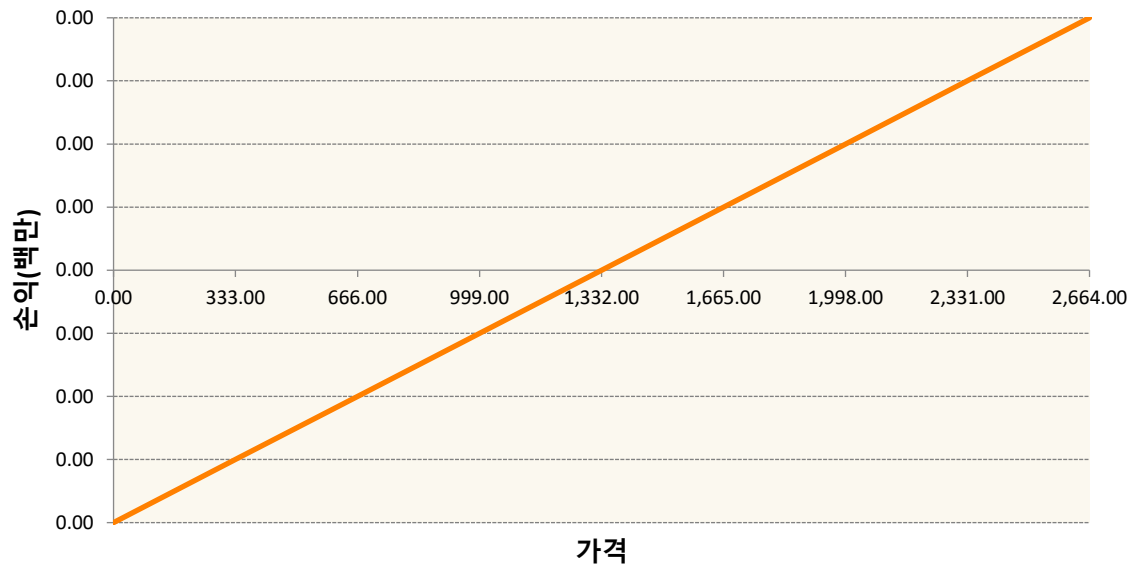
KWH4-KC HRW WHEAT FUT Mar24



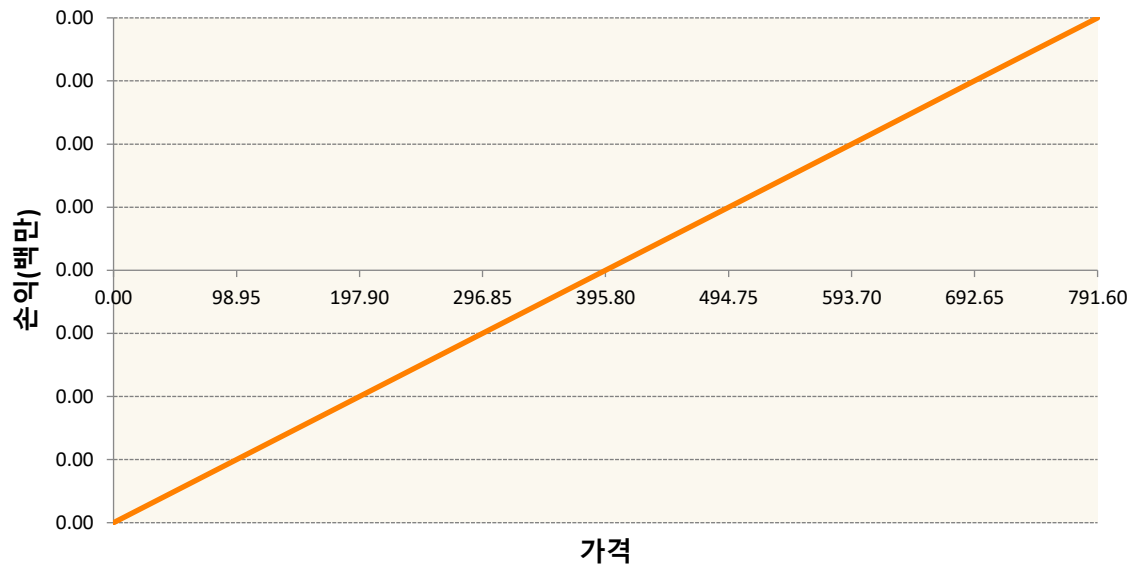
SBH4-Sugar #11 (WORLD) Mar24



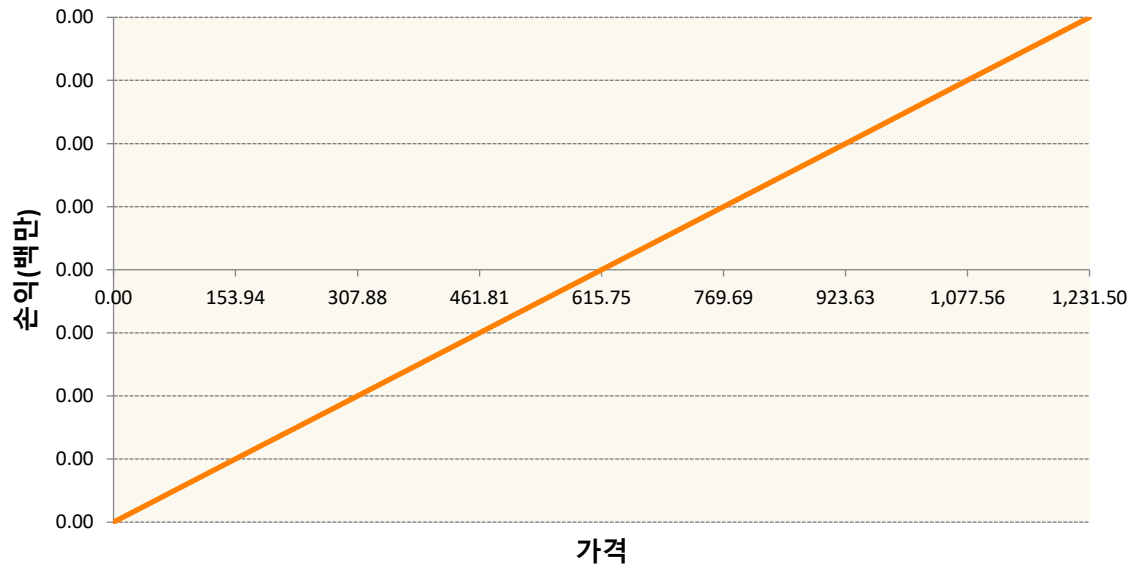
SH4-SOYBEAN FUTURE Mar24



SMH4-SOYBEAN MEAL FUTR Mar24



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	2023-12-18
기준일	2023-12-15

스마트인덱스모

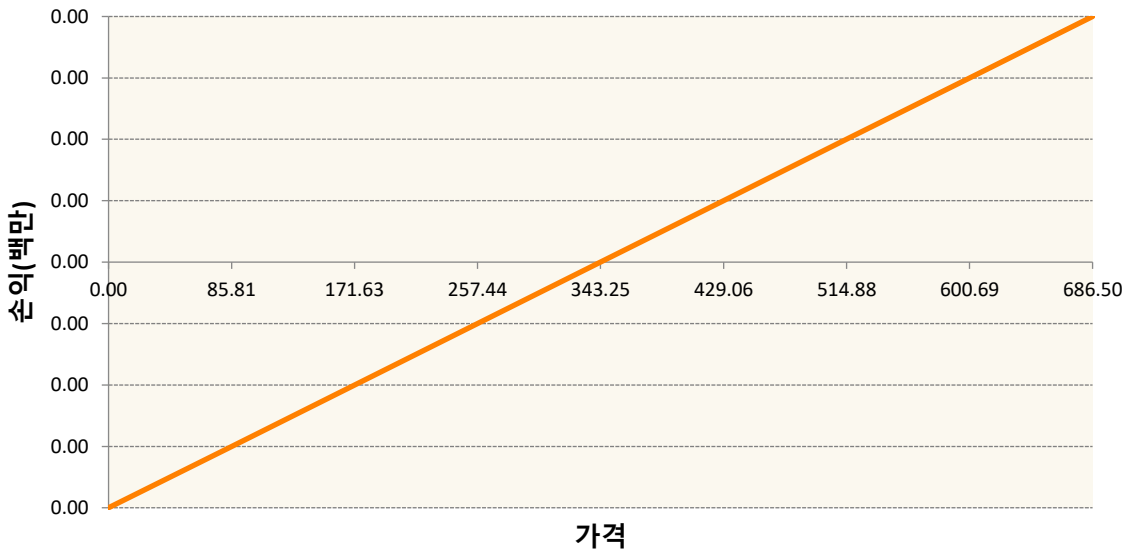
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,545	0	1,545	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101V30005-2024-03 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101V30005		2024-03 코스피200지수선물					124
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-124	-124	-124	-124	-124	-124	-124
-5.33%	-83	-83	-83	-83	-83	-83	-83
-2.67%	-41	-41	-41	-41	-41	-41	-41
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	41	41	41	41	41	41	41
5.33%	83	83	83	83	83	83	83
8.00%	124	124	124	124	124	124	124

공시일	2023-12-18
기준일	2023-12-15

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

* 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	2023-12-18
기준일	2023-12-15

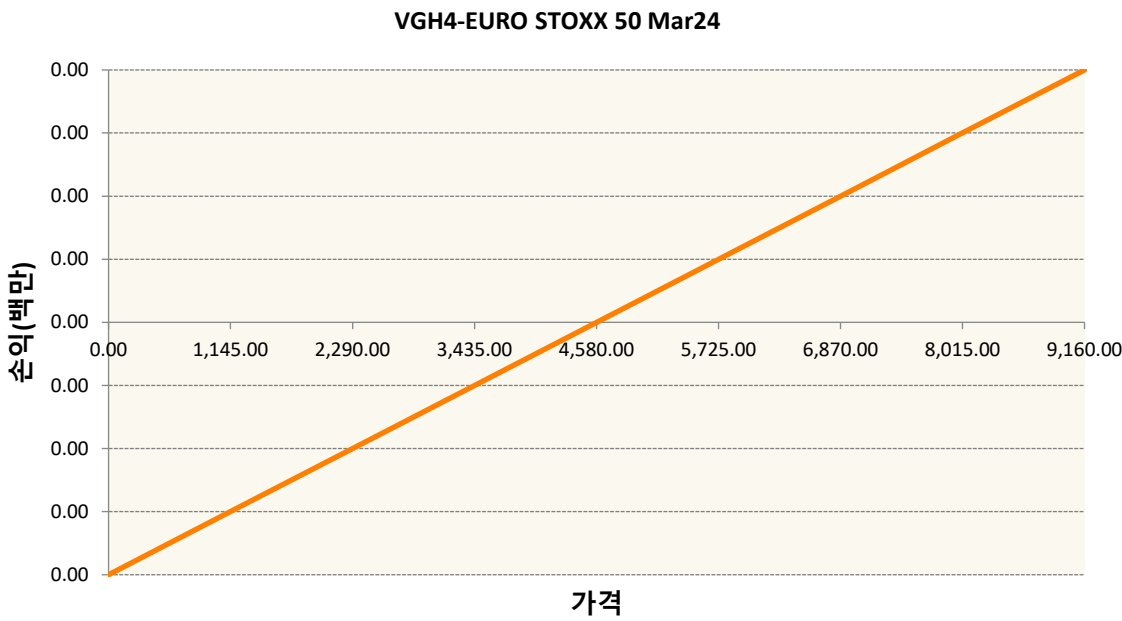
유로인덱스모(주식-파생형)

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	978	0	978	
누계	통화	선도	214	0	214	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213D9M EUR/KRW 22-12-23E	17
VGH4 EURO STOXX 50 Mar24	78

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

(단위:백만원)

73

공시일	2023-12-18
기준일	2023-12-15

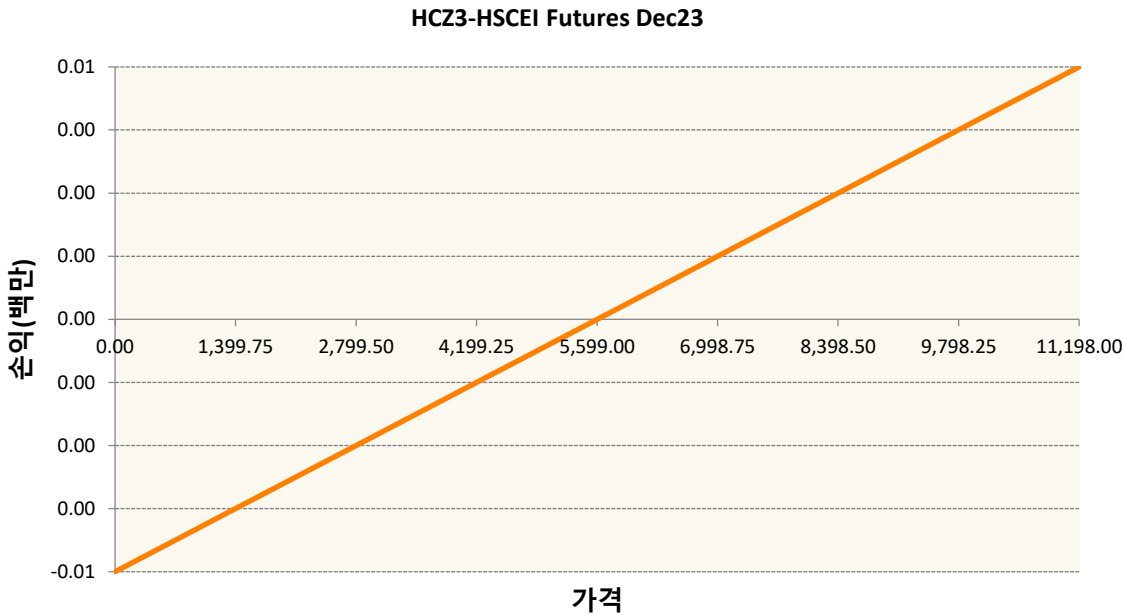
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,069	0	1,069	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	2023-12-18
기준일	2023-12-15

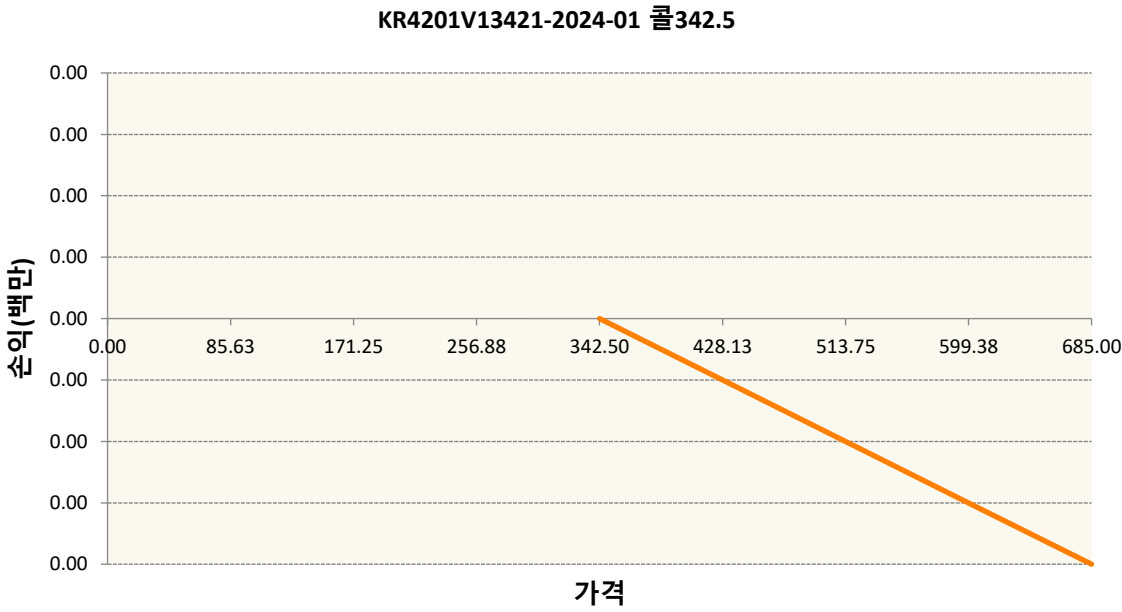
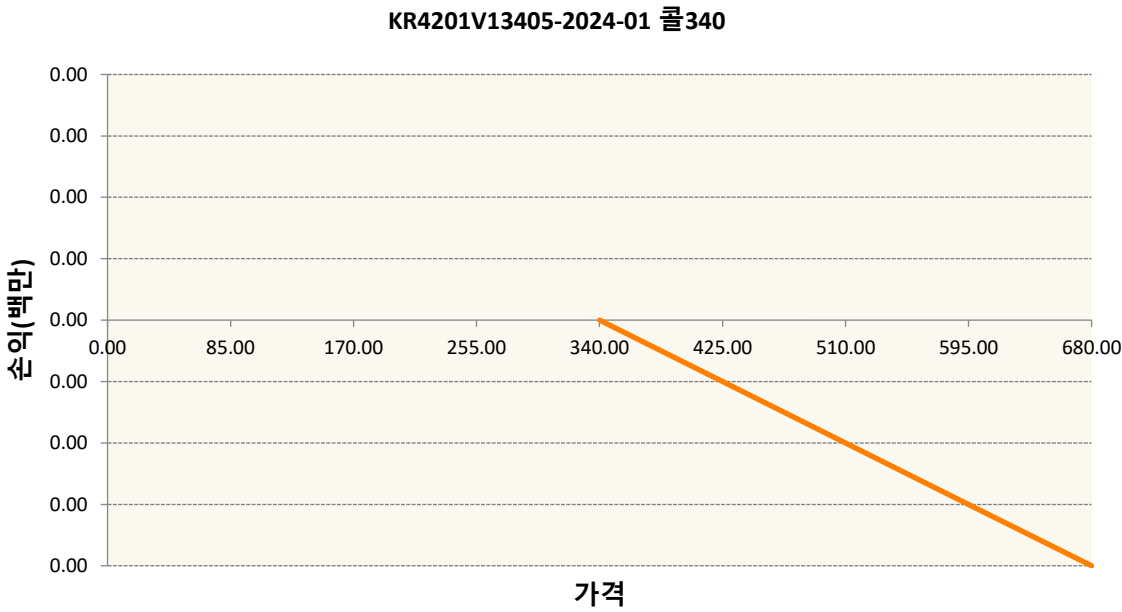
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	17,260	-17,260	장내
누계	유가증권	옵션	0	51,198	-51,198	장내

2. 만기시점의 손익구조



KR4301V13403-2024-01 풋340



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201V13405			2024-01 콜340				1,033
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	507	492	475	456	435	412	388
-5.33%	445	420	392	364	335	305	274
-2.67%	318	283	249	215	180	145	110
0%	105	70	35	0	-35	-71	-106
2.67%	-190	-218	-247	-278	-309	-341	-373
5.33%	-547	-565	-585	-608	-632	-658	-685
8.00%	-940	-950	-962	-977	-994	-1,013	-1,033
KR4201V13421			2024-01 콜342.5				1,717
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	778	757	732	702	670	634	596
-5.33%	694	655	612	567	519	470	420
-2.67%	509	453	396	338	280	221	162
0%	184	123	62	0	-62	-123	-185
2.67%	-285	-338	-392	-448	-505	-562	-620
5.33%	-872	-909	-949	-992	-1,038	-1,086	-1,136
8.00%	-1,534	-1,554	-1,579	-1,609	-1,642	-1,678	-1,717
KR4301V13403			2024-01 풋340				507
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-496	-496	-497	-499	-501	-504	-507
-5.33%	-274	-278	-282	-288	-294	-301	-308
-2.67%	-85	-95	-105	-114	-125	-135	-145
0%	30	20	10	0	-10	-21	-31

2.67%	73	69	63	57	50	43	35
5.33%	82	81	79	77	74	70	66
8.00%	83	83	83	82	81	80	78

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	3,212

공시일	2023-12-18
기준일	2023-12-15

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	1,920	0	1,920	

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	2023-12-18
기준일	2023-12-15

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	4,485	0	4,485	

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	2023-12-18
기준일	2023-12-15

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	17,328	0	17,328	
누계	통화	선도	0	16,887	-16,887	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213D9R KRW/USD 29-12-23E	503
FXW213DAT KRW/USD 31-01-24E	185
FXW213DBV KRW/USD 29-02-24E	637
FXW213DCB KRW/USD 31-01-24E	26
IE00BD8RGM75	

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

709

공시일	2023-12-18
기준일	2023-12-15

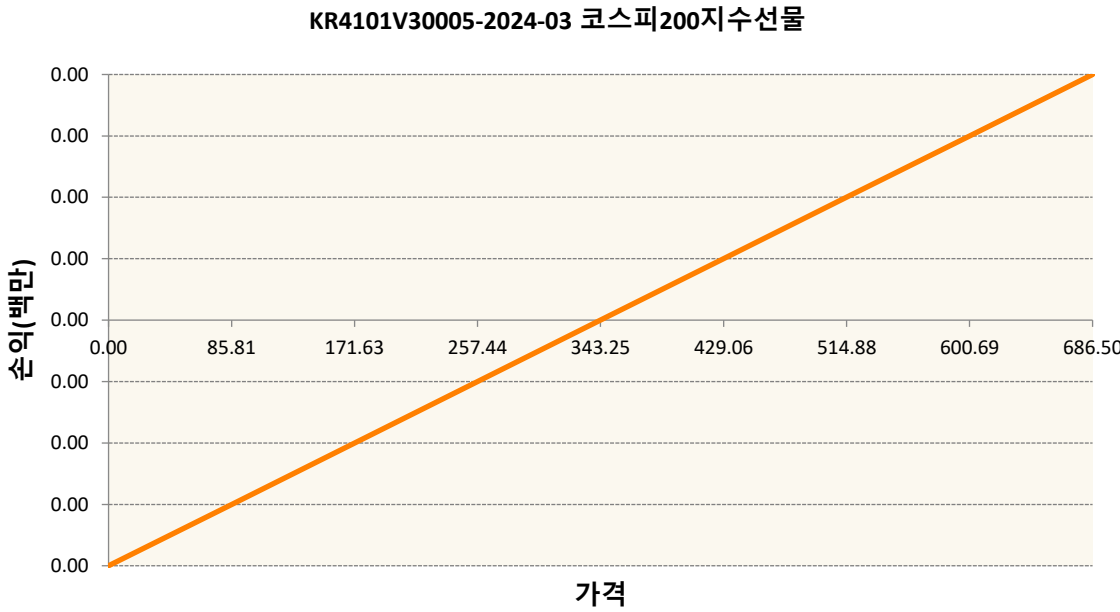
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

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	601	0	601	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101V30005			2024-03 코스피200지수선물				48
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-48	-48	-48	-48	-48	-48	-48
-5.33%	-32	-32	-32	-32	-32	-32	-32
-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%	32	32	32	32	32	32	32
8.00%	48	48	48	48	48	48	48

공시일	2023-12-18
기준일	2023-12-15

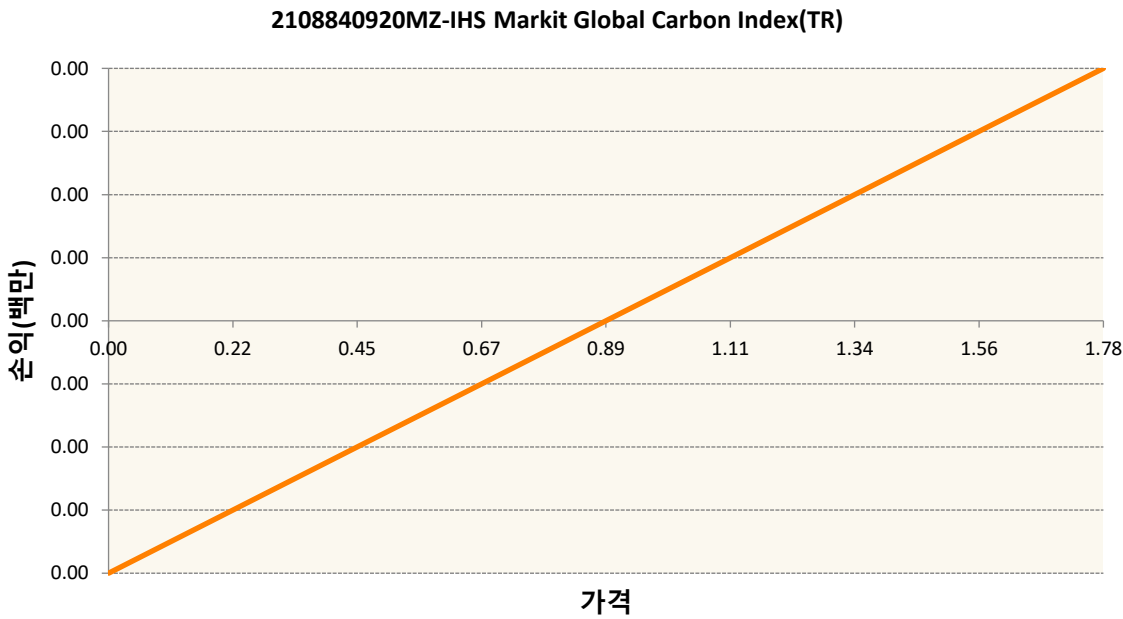
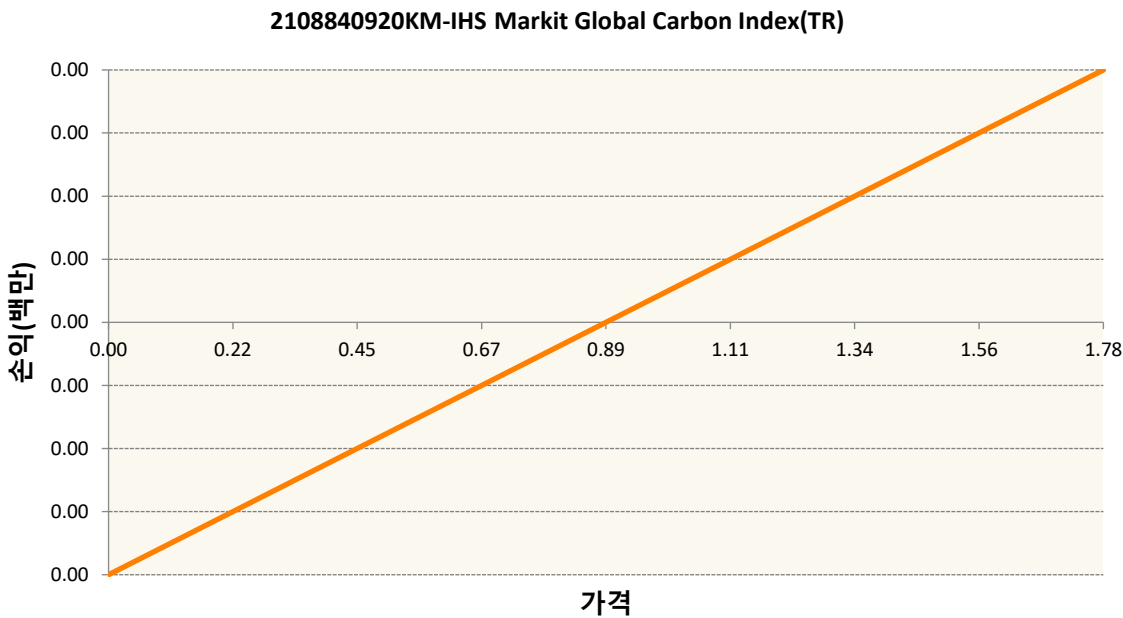
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

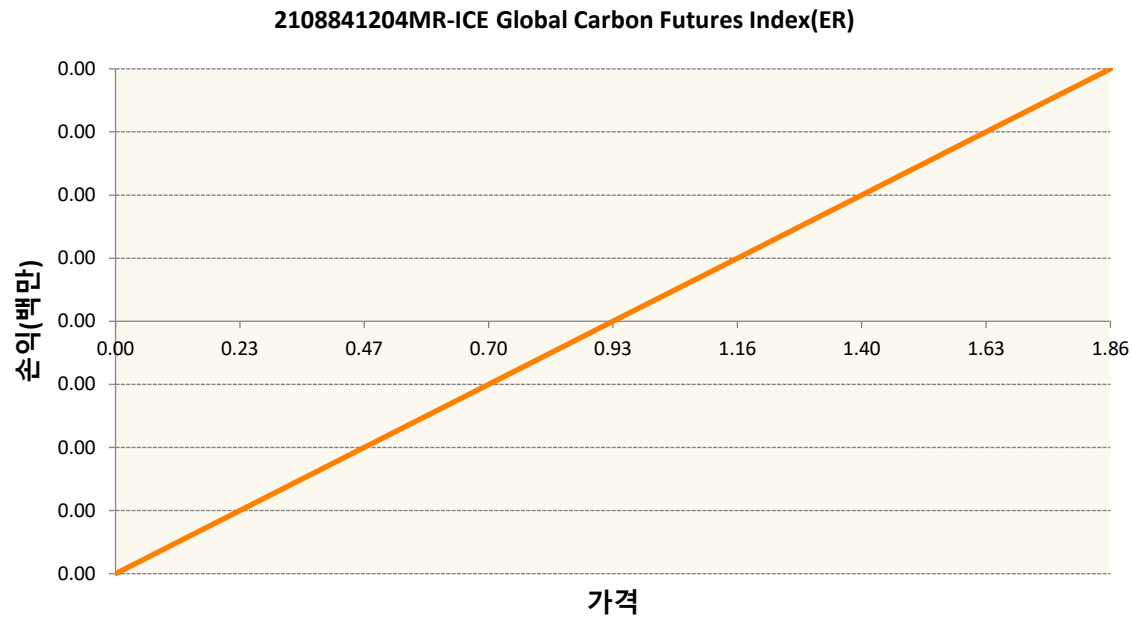
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	18,000	0	18,000	

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108840920IIHS Markit Global Carbon Index(TR)		898
2108840920IIHS Markit Global Carbon Index(TR)		180
2108841204IIICE Global Carbon Futures Index(ER)		359

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

공시일	2023-12-18
기준일	2023-12-15

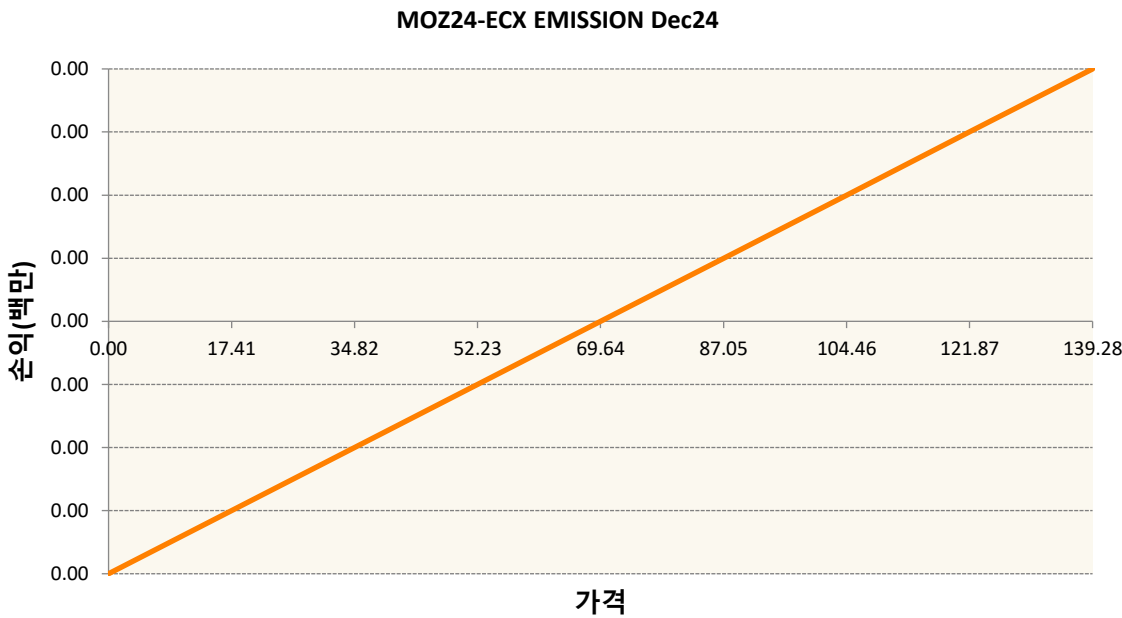
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	7,544	0	7,544	
누계	지수	스왑	479	0	479	장외
누계	통화	선도	0	1,436	-1,436	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213DBV KRW/EUR 28-12-23E	115
MOZ24 ECX EMISSION Dec24	604
SWICEUACN ICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX	8

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

(단위:백만원)

1,169

공시일	2023-12-18
기준일	2023-12-15

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)	25
SWCSI00000 신한CSI Index 230622 (메리츠)	25
SWCSI00000 신한CSI Index 230922 (키움)	16
SWCSI00000 신한CSI Index 231013 (NH)	18

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

(단위:백만원)

121

공시일	2023-12-18
기준일	2023-12-15

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

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

(단위:백만원)

10

공시일	2023-12-18
기준일	2023-12-15

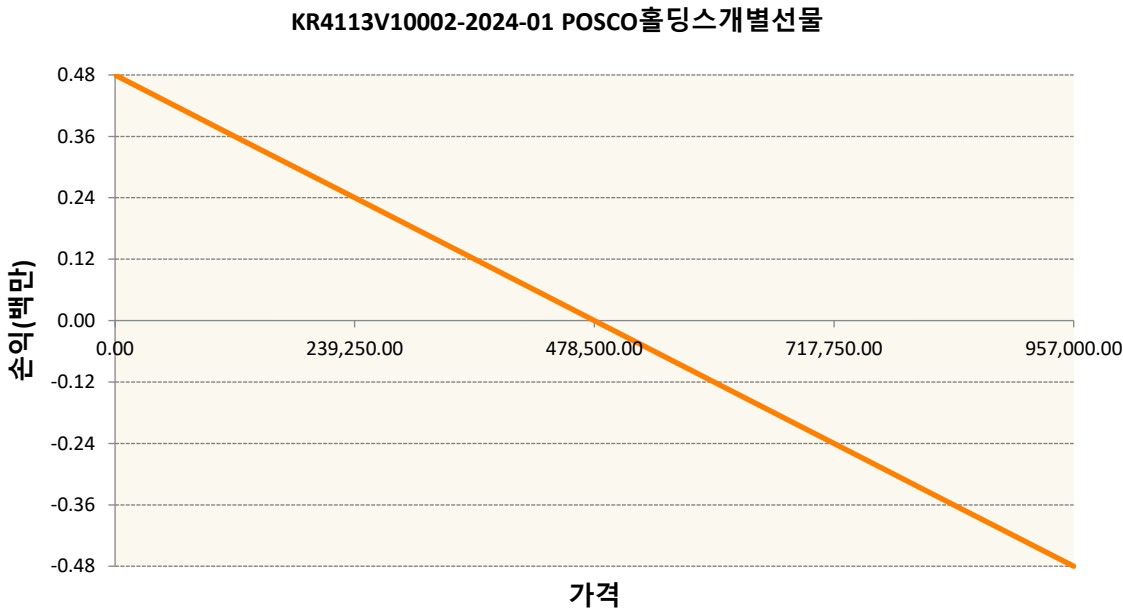
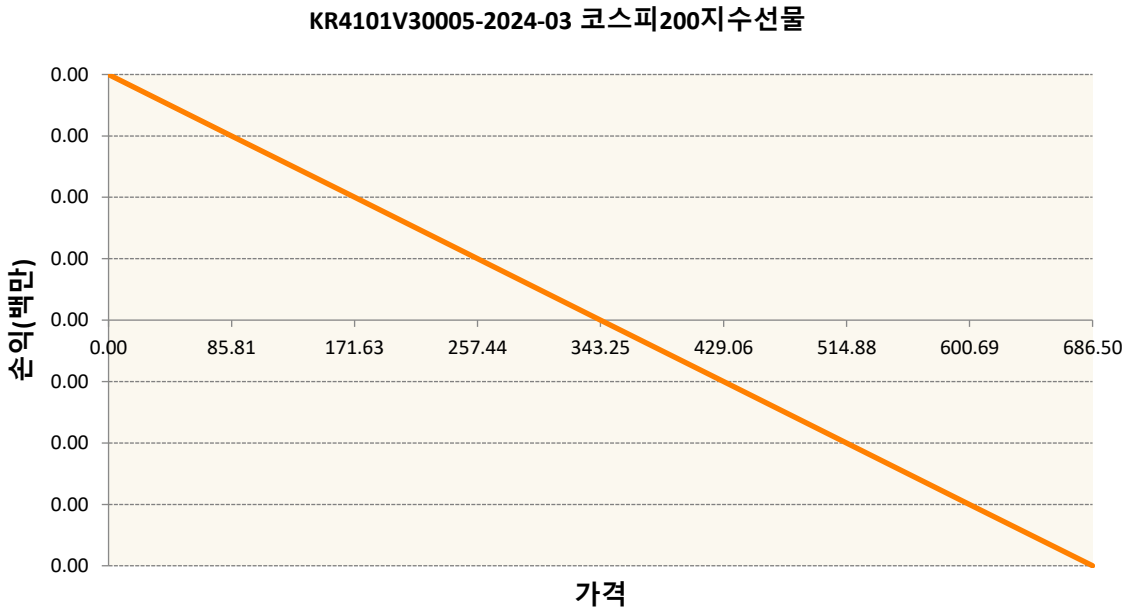
에퀴티알파일반사모혼합자산

1. 계약금액

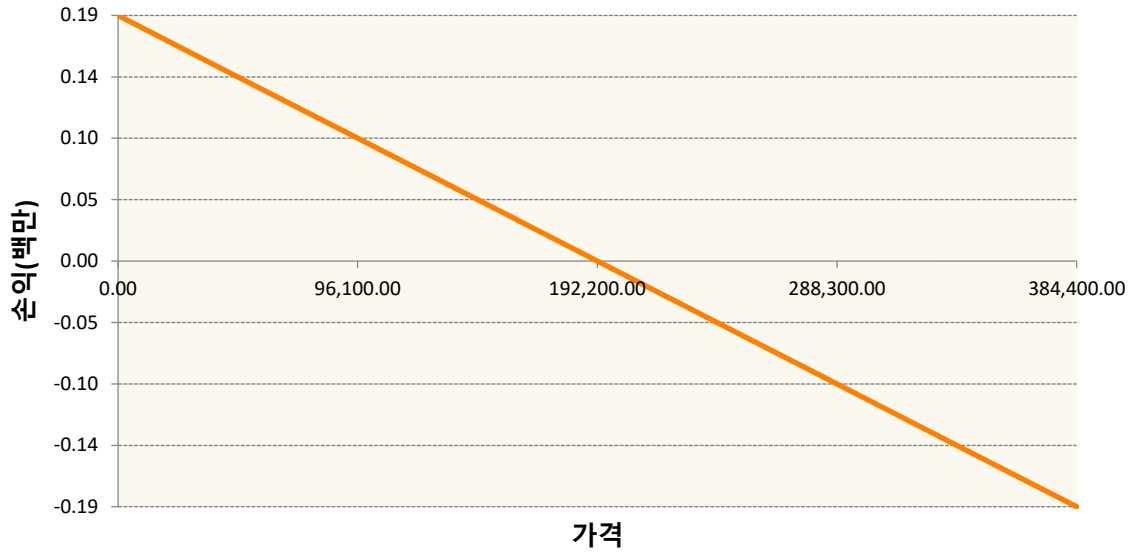
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	5	87	-82	장내
누계	유가증권	선물	5	2,533	-2,528	장내

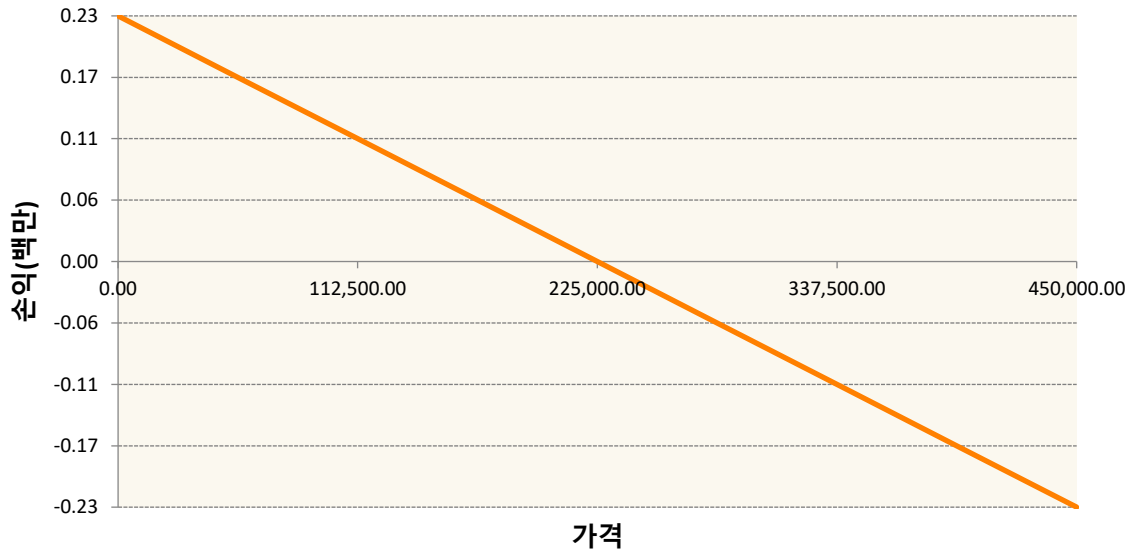
2. 만기시점의 손익구조



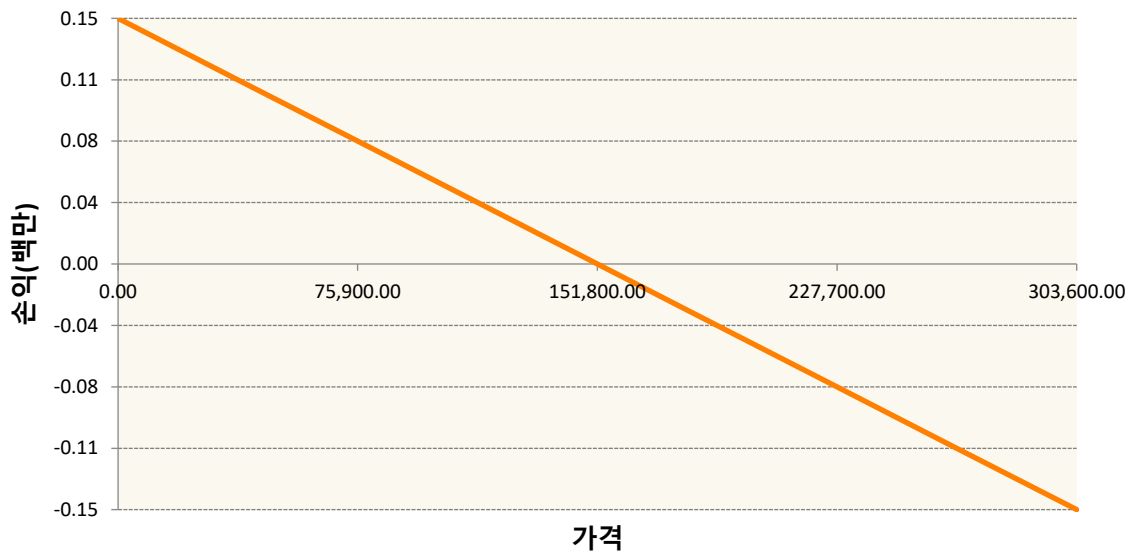
KR4116V10005-2024-01 현대차개별선물



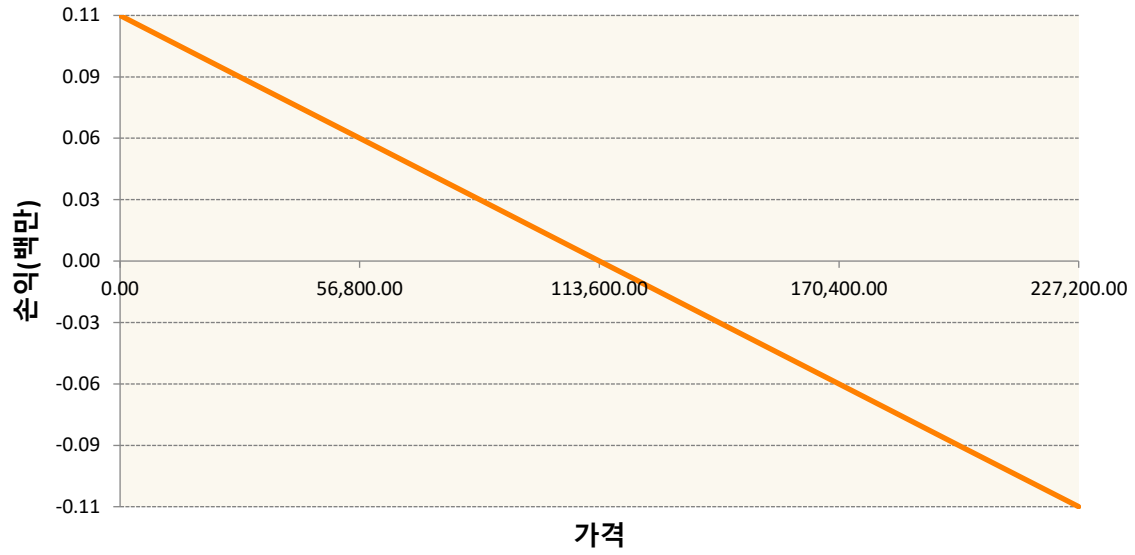
KR4120V10007-2024-01 현대모비스개별선물



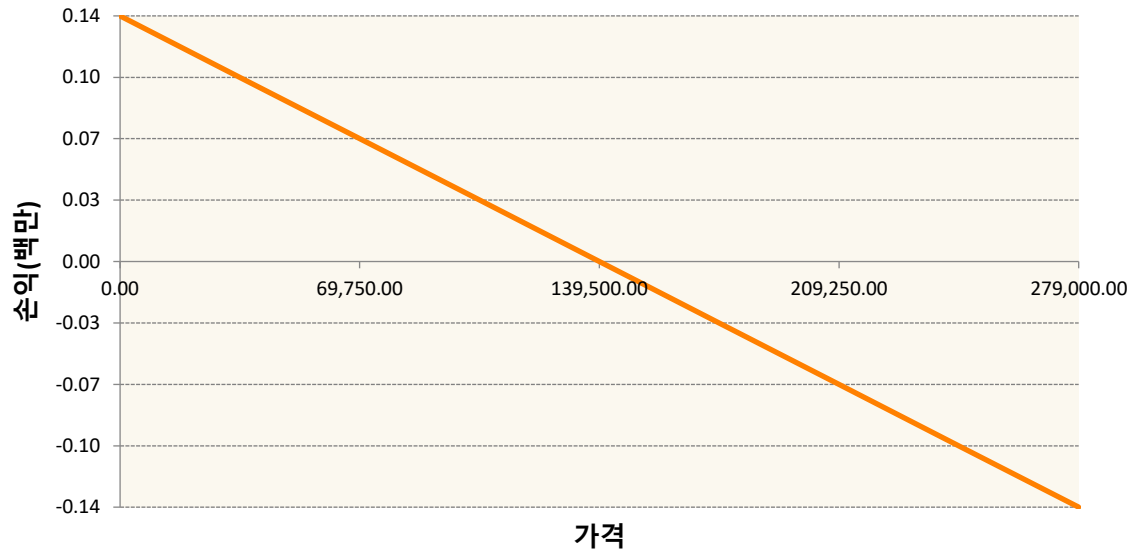
KR4123V10001-2024-01 삼성전기개별선물



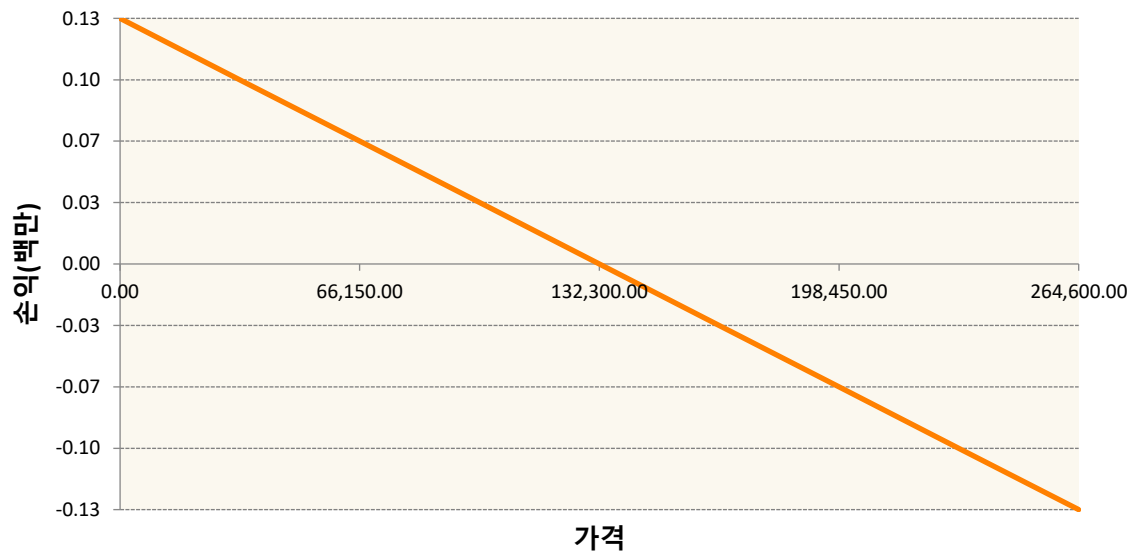
KR4139V10007-2024-01 HD한국조선해양개별선물



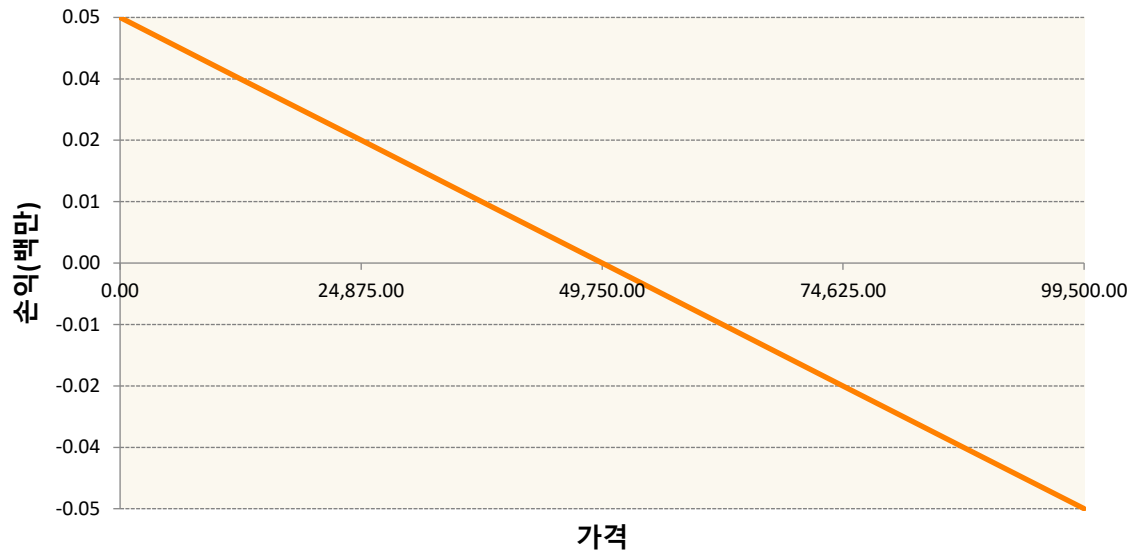
KR4150V10004-2024-01 SK하이닉스개별선물



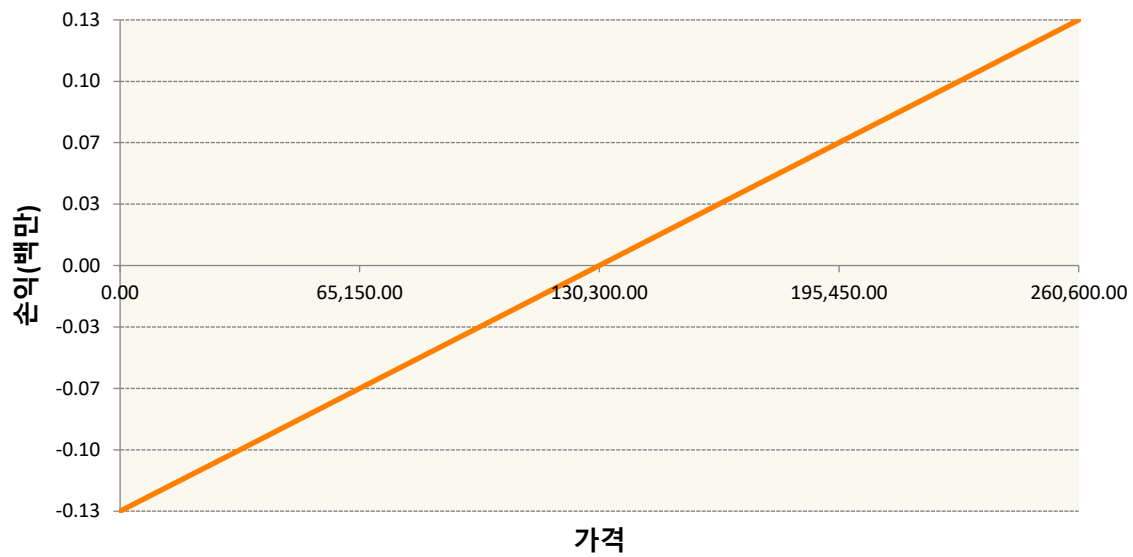
KR41C6V10003-2024-01 아모레퍼시픽개별선물



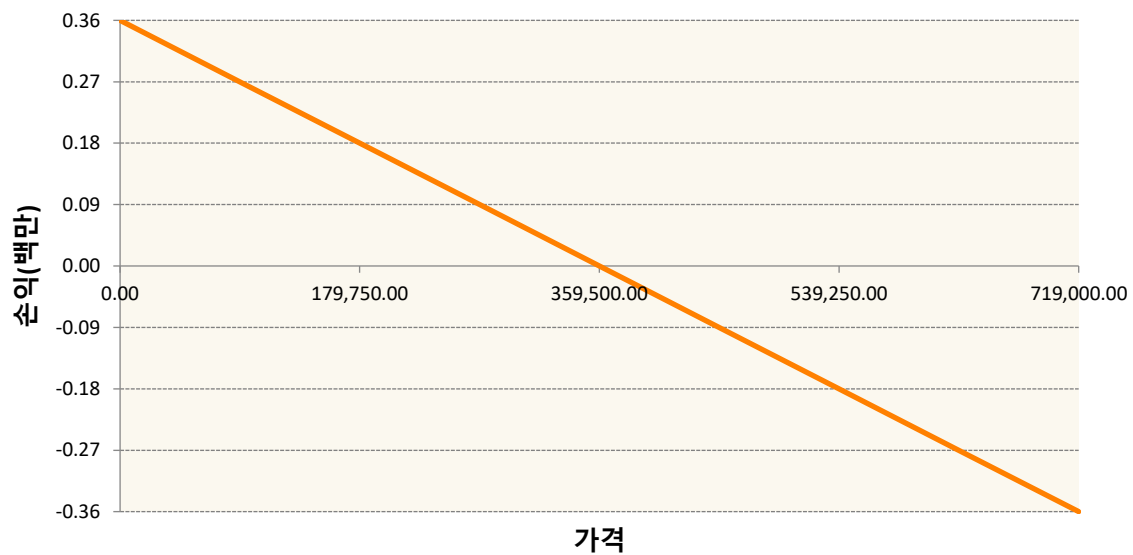
KR41CNV10006-2024-01 포스코DX개별선물



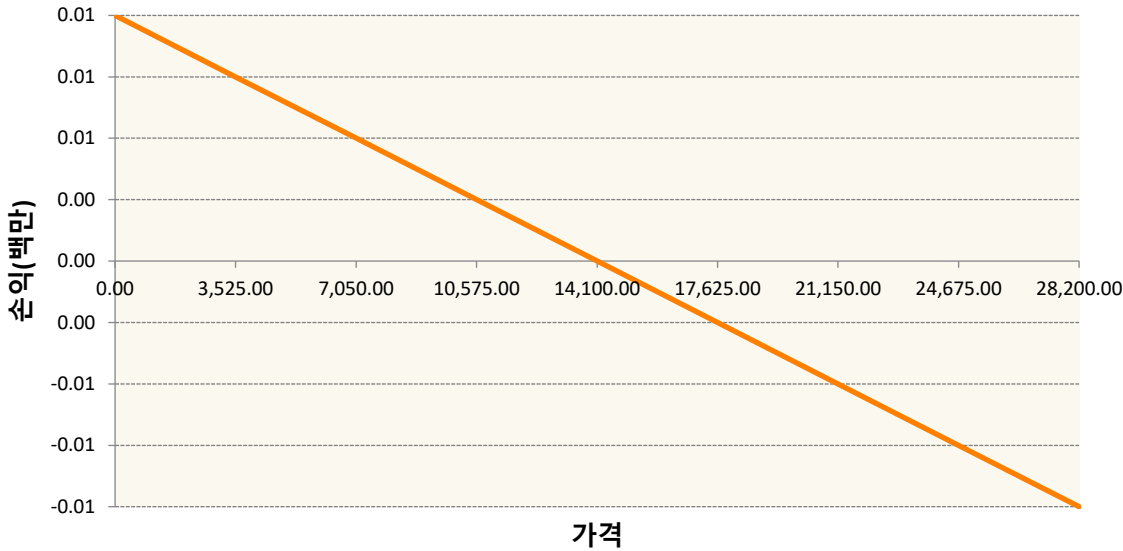
KR41DBV10009-2024-01 LIG넥스원개별선물



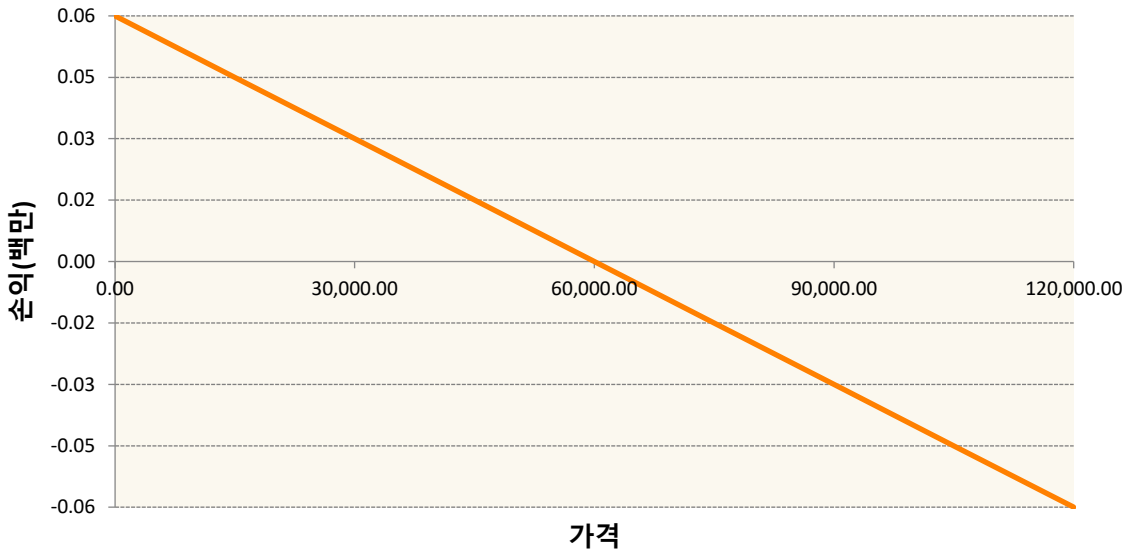
KR41E8V10007-2024-01 포스코퓨처엠개별선물



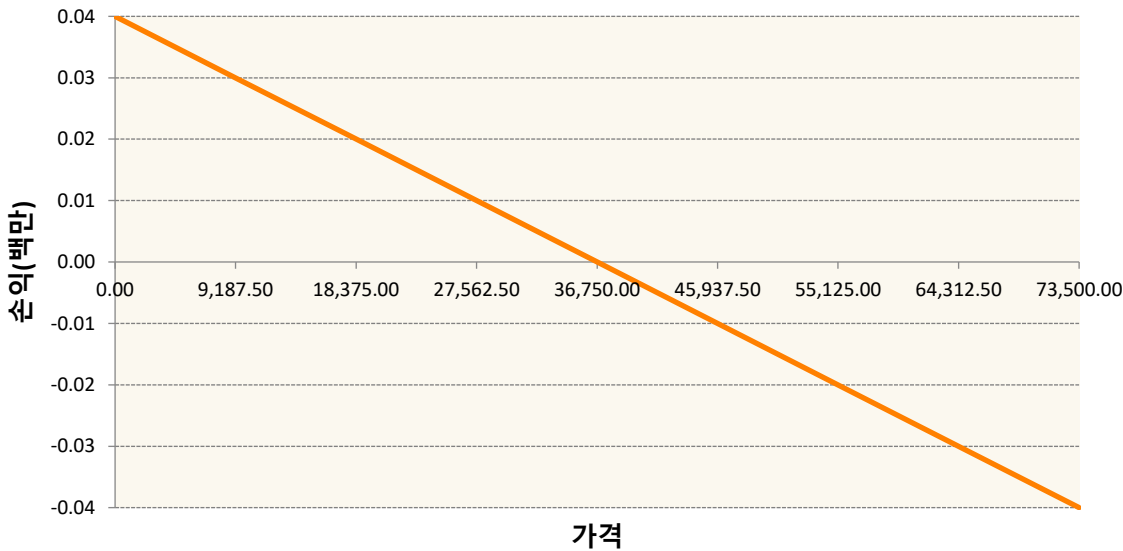
KR41ECV10005-2024-01 HDC현대산업개발개별선물



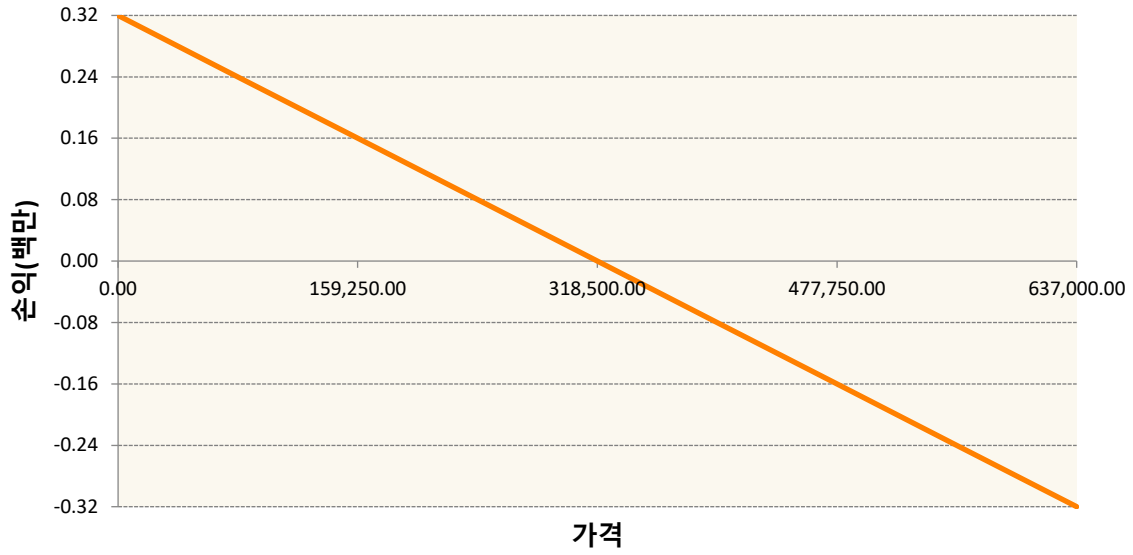
KR41EKV10008-2024-01 DB하이텍개별선물



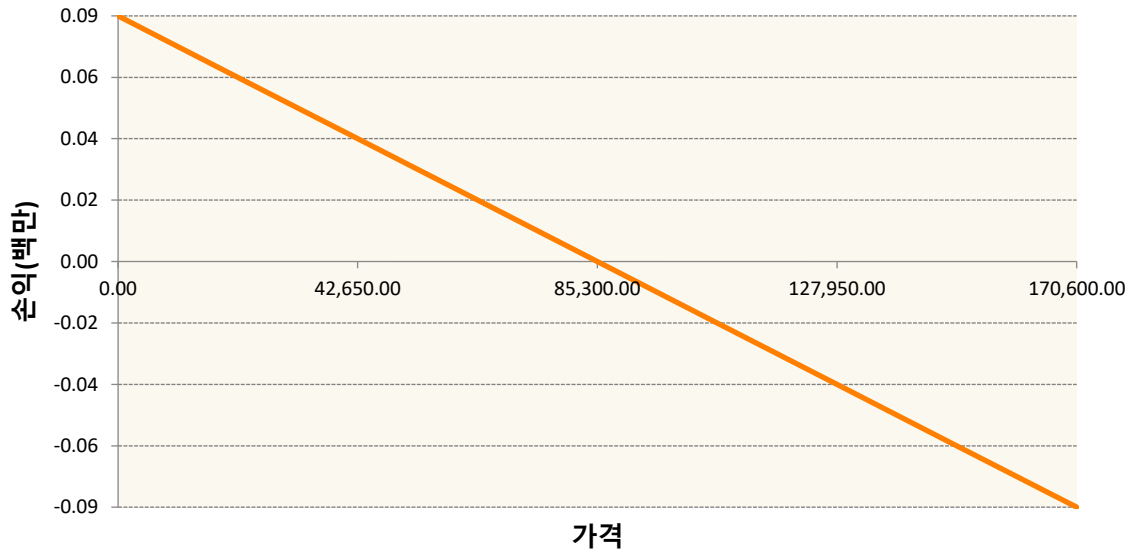
KR41ERV10003-2024-01 DL이앤씨개별선물



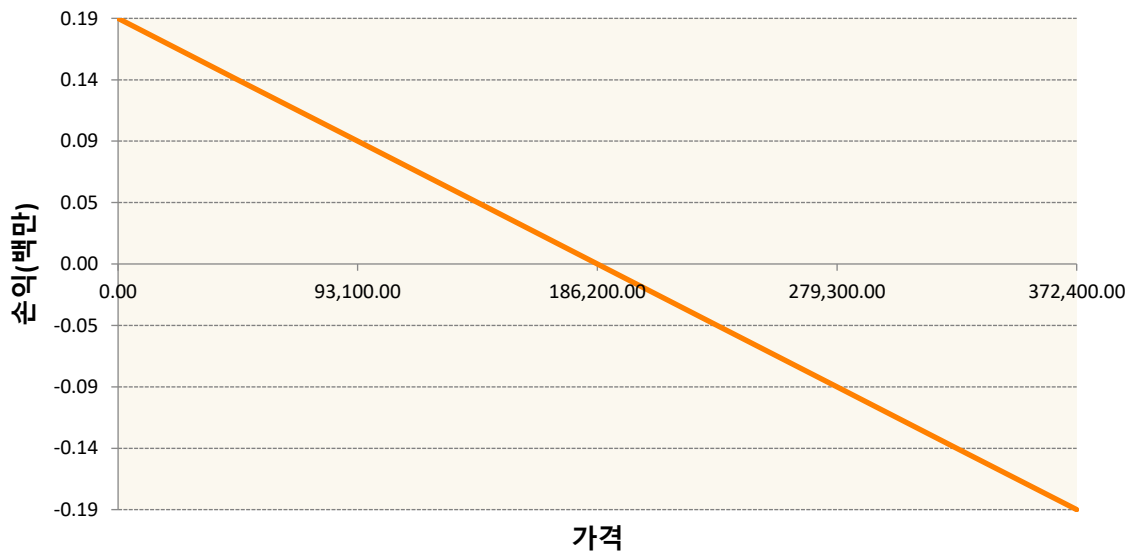
KR41EYV10009-2024-01 에코프로비엠개별선물



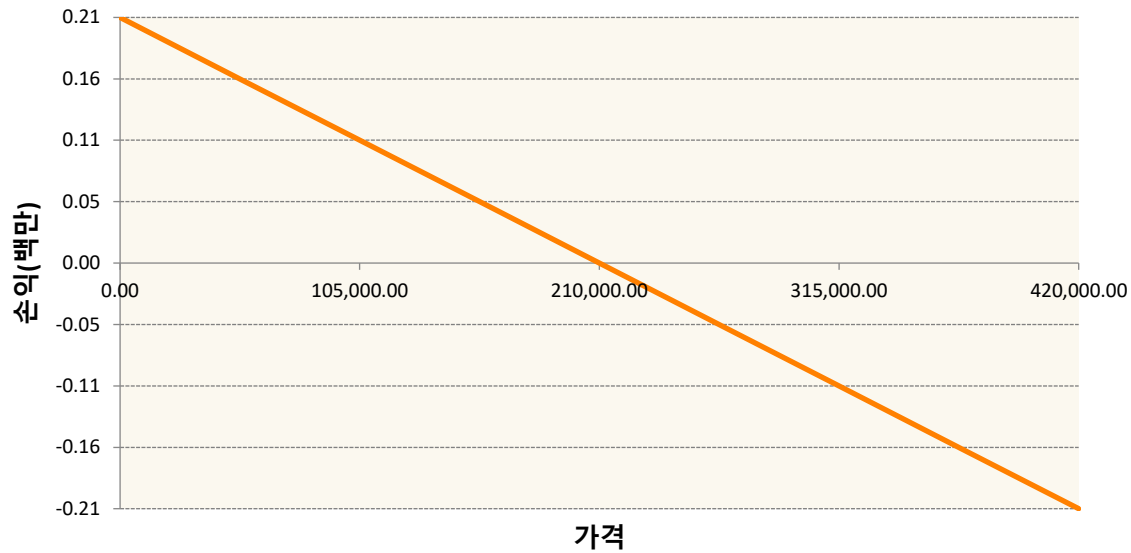
KR41FBV10004-2024-01 SK아이이테크놀로지개별선물



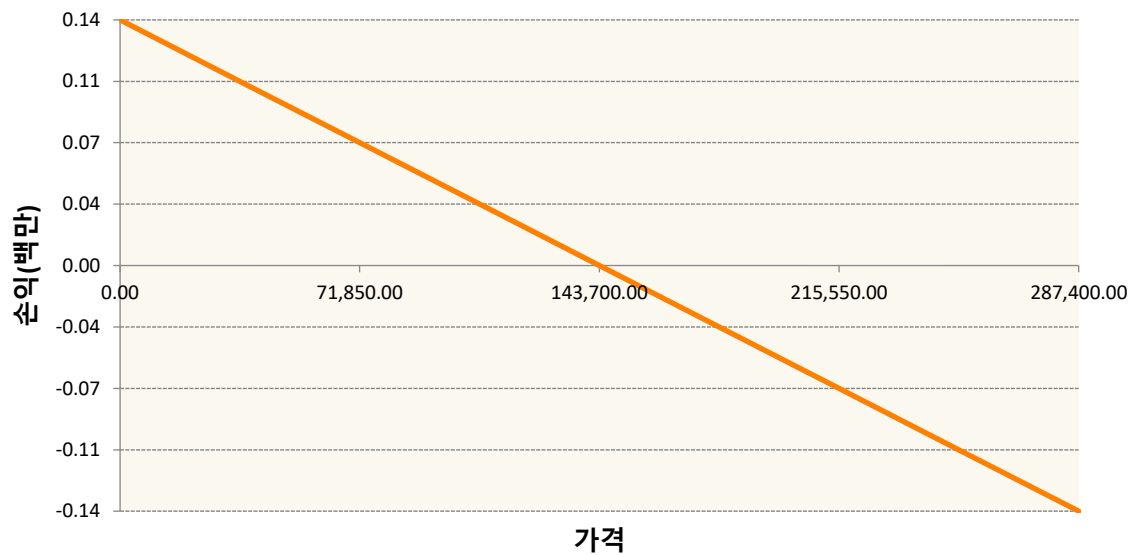
KR41FMV10001-2024-01 엘앤에프개별선물



KR41G4V10004-2024-01 한솔케미칼개별선물



KR41GCV10000-2024-01 이오테크닉스개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101V300 2024-03 코스피200지수선물	178
KR4113V100 2024-01 POSCO홀딩스개별선물	1
KR4116V100 2024-01 현대차개별선물	1
KR4120V100 2024-01 현대모비스개별선물	3
KR4123V100 2024-01 삼성전기개별선물	1
KR4139V100 2024-01 HD한국조선해양개별선물	2
KR4150V100 2024-01 SK하이닉스개별선물	2
KR41C6V100 2024-01 아모레퍼시픽개별선물	1
KR41CNV100 2024-01 포스코DX개별선물	2
KR41DBV100 2024-01 LIG넥스원개별선물	0.42
KR41E8V100 2024-01 포스코퓨처엠개별선물	2
KR41ECV100 2024-01 HDC현대산업개발개별선물	1

KR41EKV100 2024-01 DB하이텍개별선물	0.29
KR41ERV100 2024-01 DL이앤씨개별선물	1
KR41EYV100 2024-01 에코프로비엠개별선물	1
KR41FBV100 2024-01 SK아이이테크놀로지개별선물	1
KR41FMV100 2024-01 엘앤에프개별선물	2
KR41G4V100 2024-01 한솔케미칼개별선물	1
KR41GCV100 2024-01 이오테크닉스개별선물	1

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

(단위:백만원)

228

공시일	2023-12-18
기준일	2023-12-15

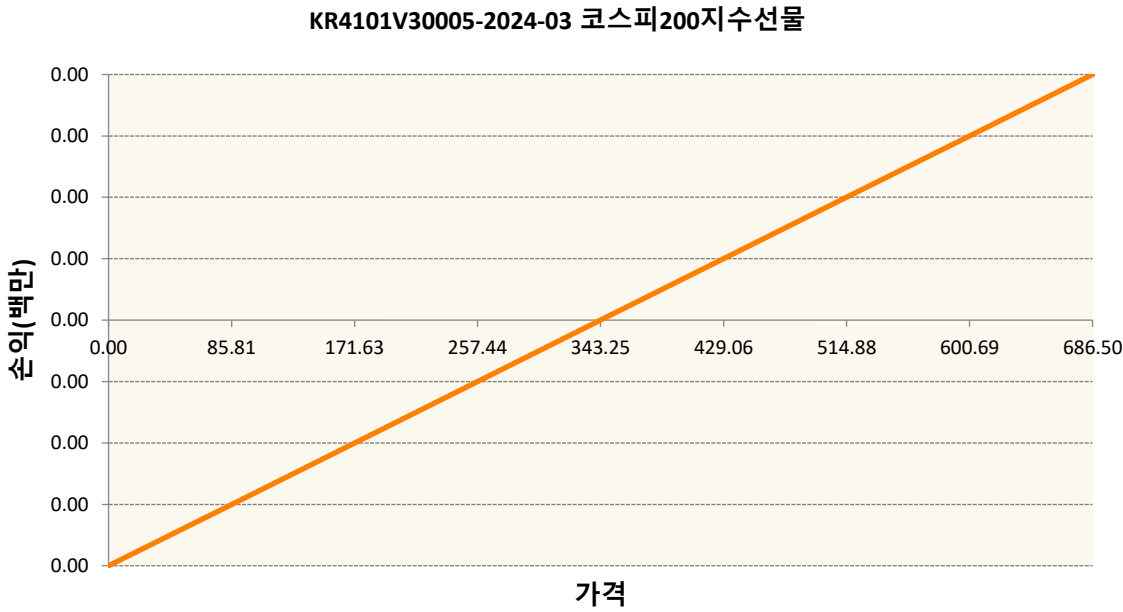
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	858	-858	장내
누계	유가증권	선물	3,089	0	3,089	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101V30005		2024-03 코스피200지수선물					248
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-248	-248	-248	-248	-248	-248	-248
-5.33%	-165	-165	-165	-165	-165	-165	-165
-2.67%	-83	-83	-83	-83	-83	-83	-83
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	83	83	83	83	83	83	83
5.33%	165	165	165	165	165	165	165
8.00%	248	248	248	248	248	248	248

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

(단위:백만원)

230

공시일	2023-12-18
기준일	2023-12-15

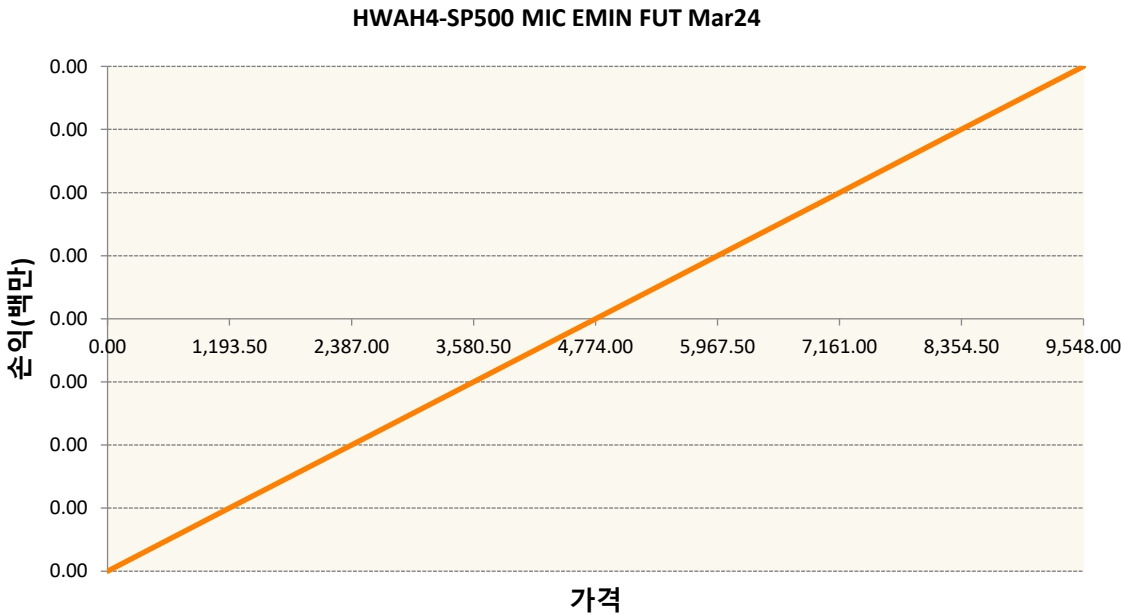
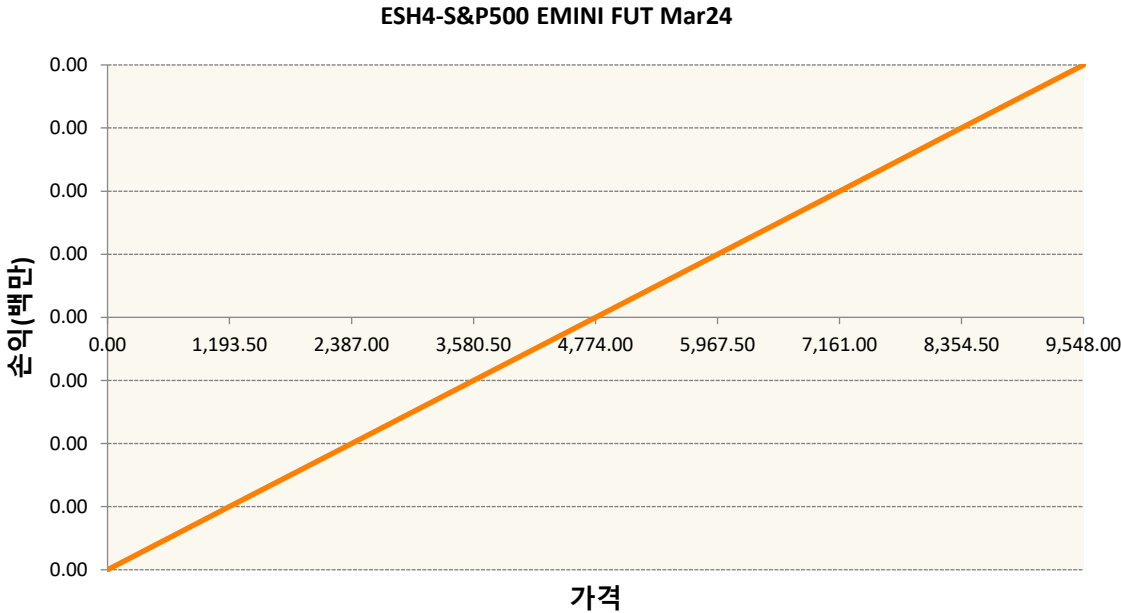
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

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	315	0	315	
누계	유가증권	선물	1,823	0	1,823	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESH4	S&P500 EMINI FUT Mar24	25
HWAH4	SP500 MIC EMIN FUT Mar24	146

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	145

공시일	2023-12-18
기준일	2023-12-15

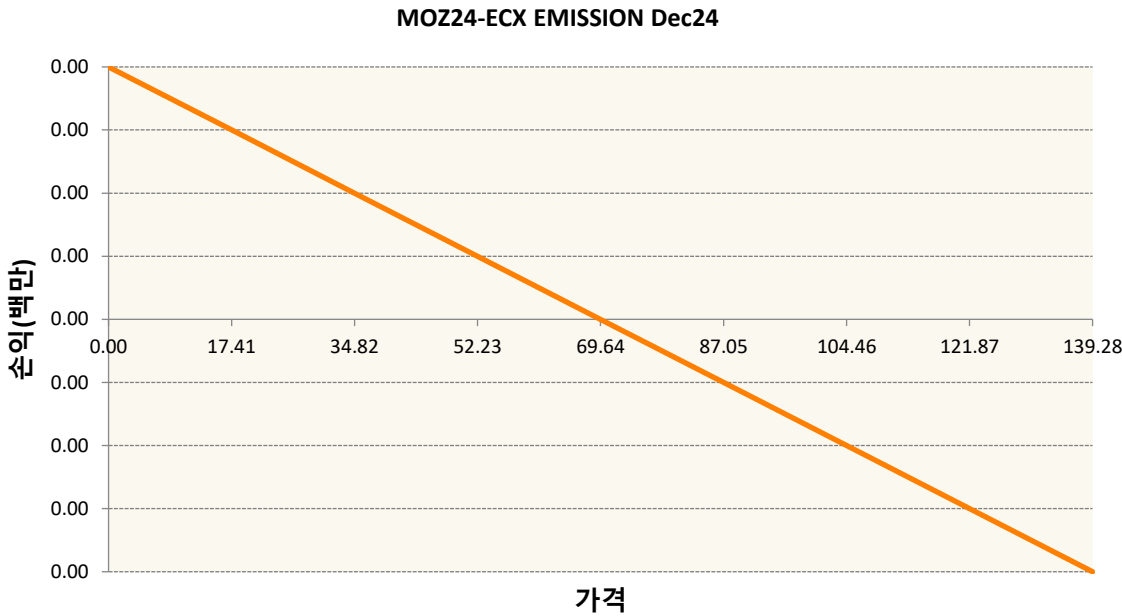
SOL유럽탄소배출권선물인버스ICE특별자산상

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	7,592	-7,592	
누계	지수	스왑	479	0	479	장외
누계	통화	선도	0	1,725	-1,725	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213DBV KRW/EUR 28-12-23E	7
FXW213DBV KRW/EUR 28-12-23E	131
MOZ24 ECX EMISSION Dec24	607
SWICEUACN ICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX	8

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

(단위:백만원)

1,191

공시일	2023-12-18
기준일	2023-12-15

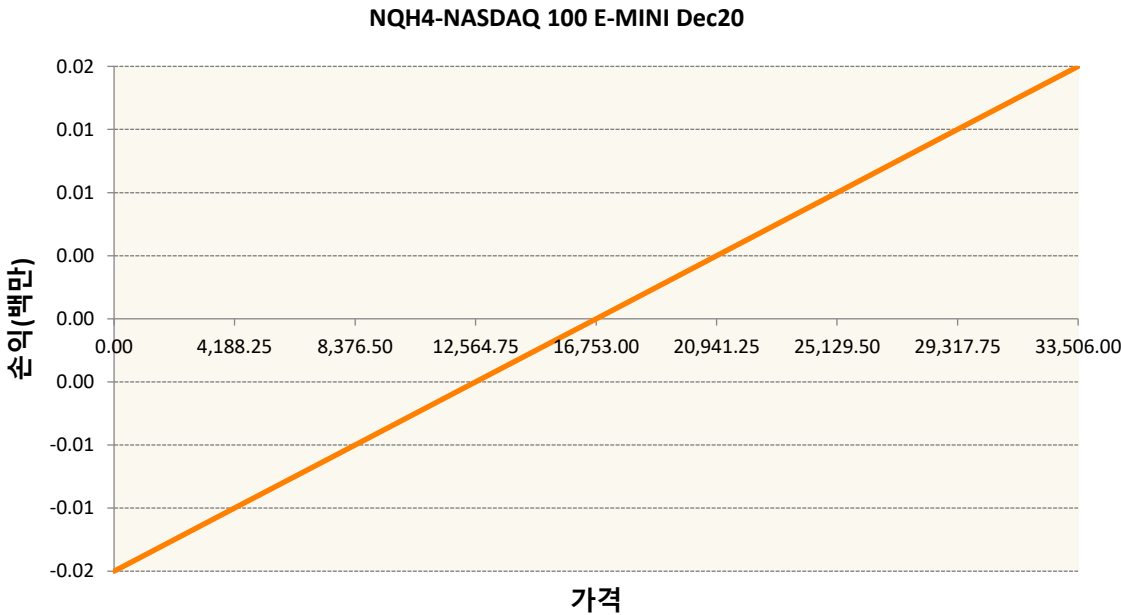
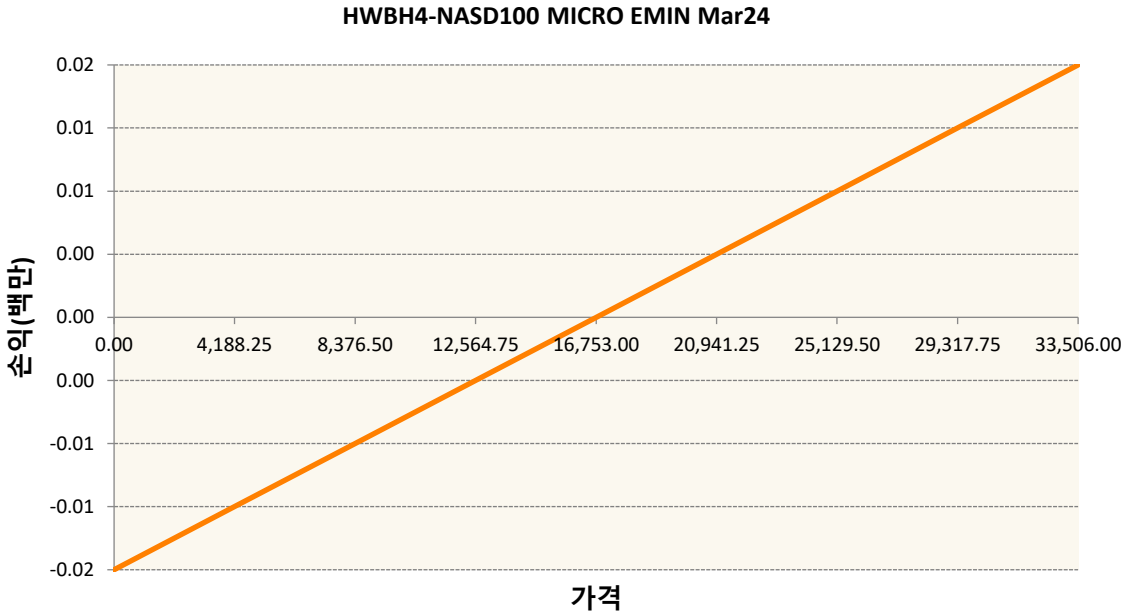
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

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	442	0	442	
누계	유가증권	선물	1,764	0	1,764	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HWBH4	NASD100 MICRO EMIN Mar24	141
NQH4	NASDAQ 100 E-MINI Dec20	35

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	160

공시일	2023-12-18
기준일	2023-12-15

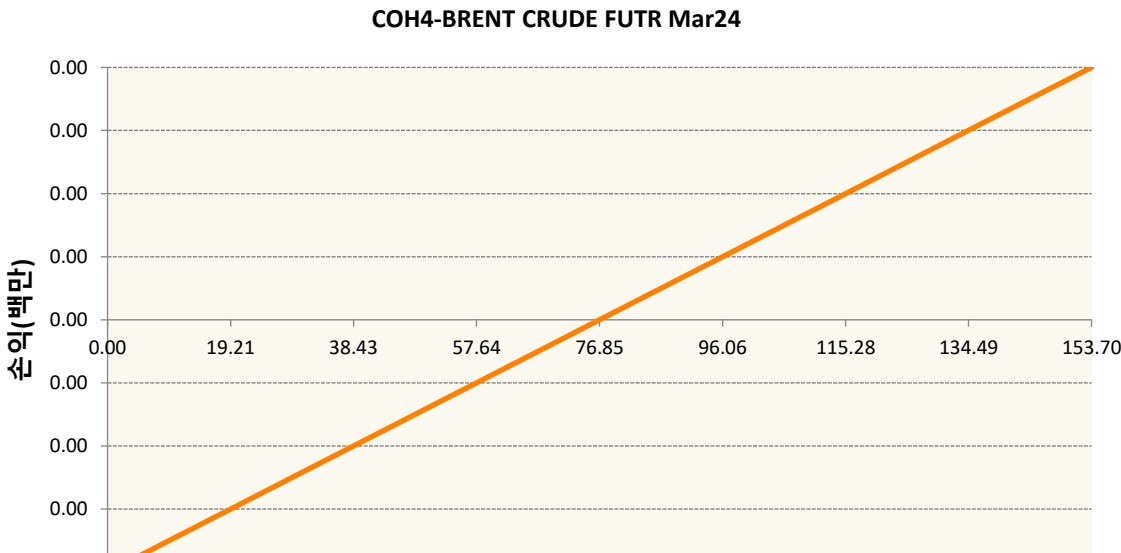
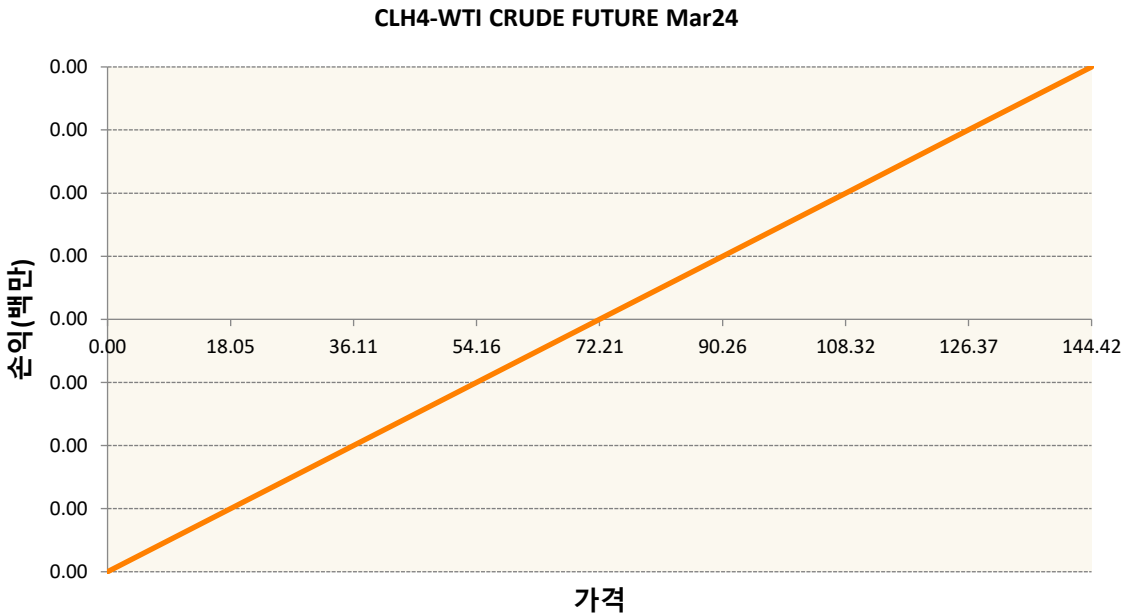
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

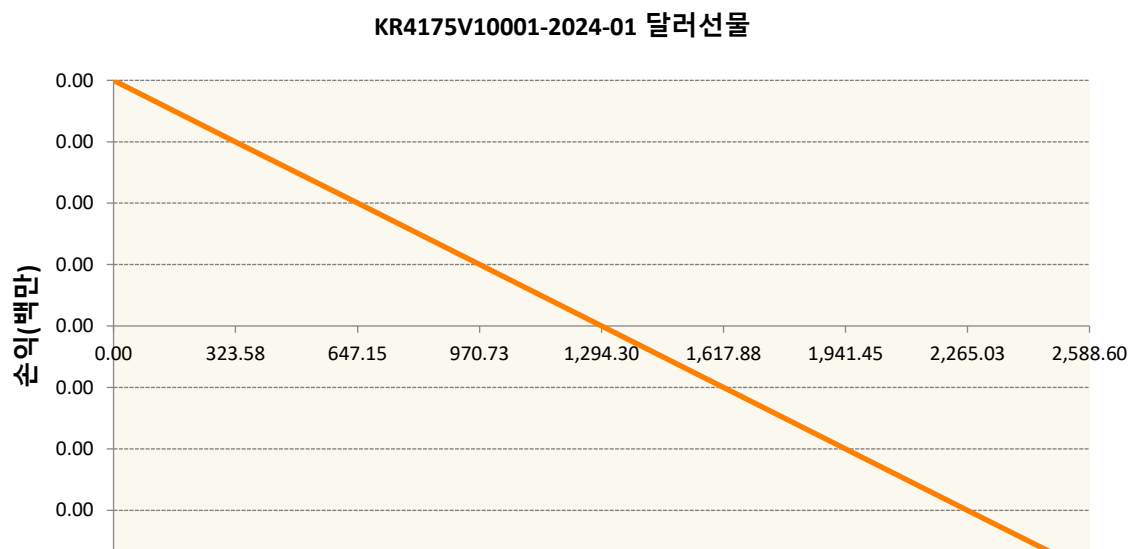
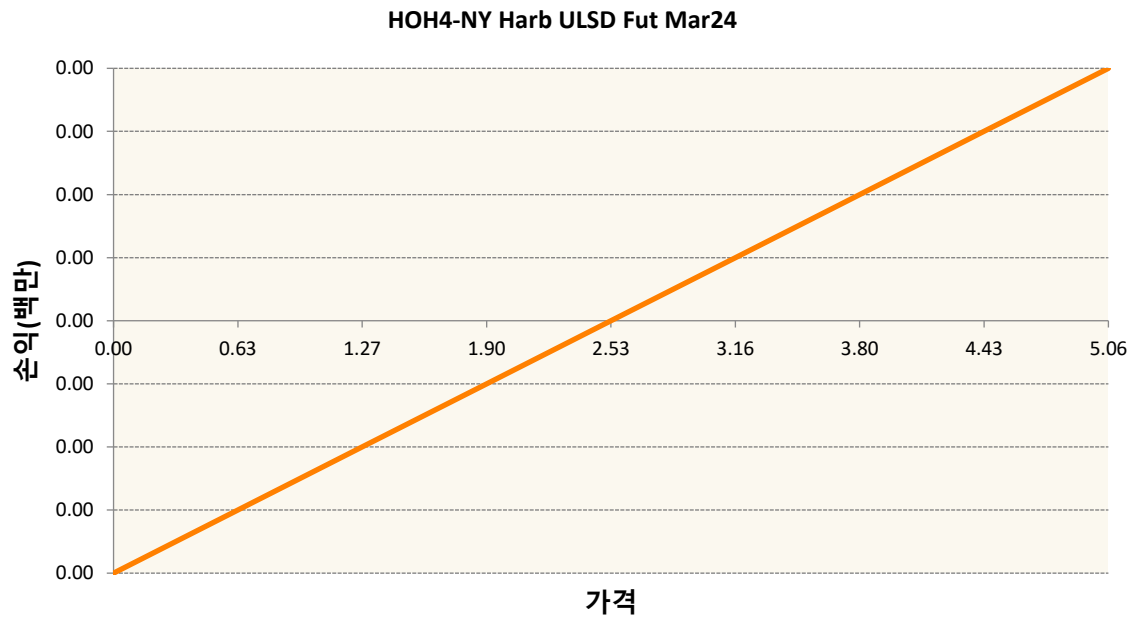
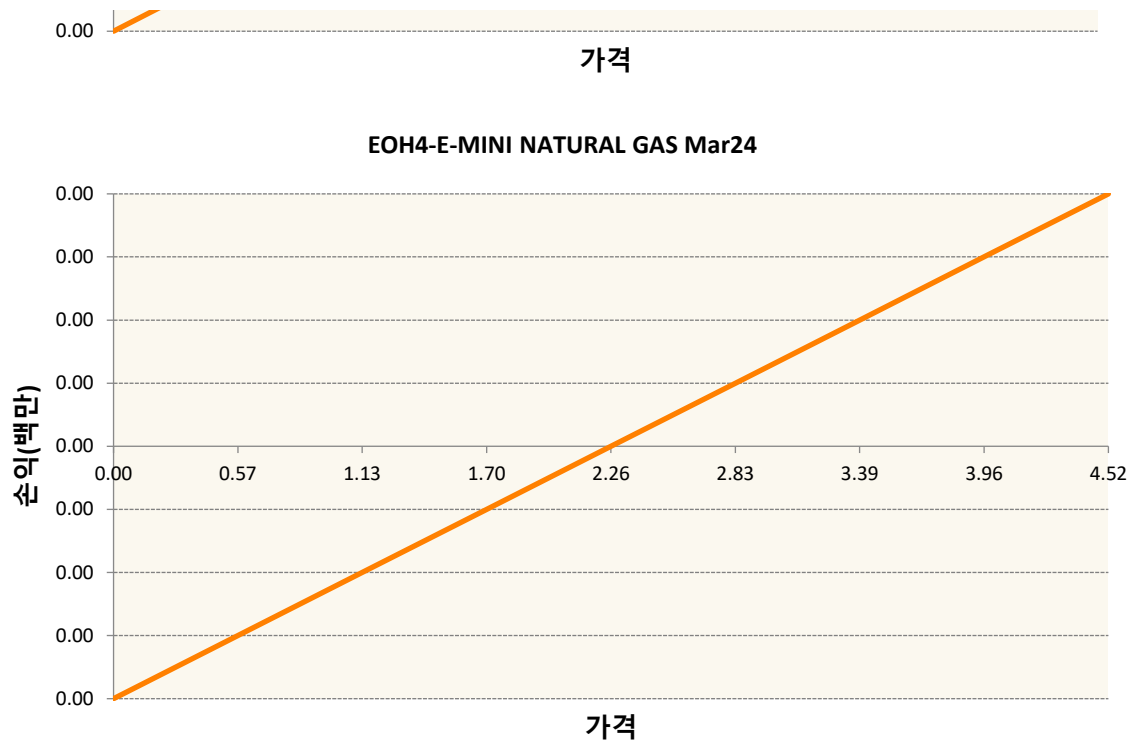
1. 계약금액

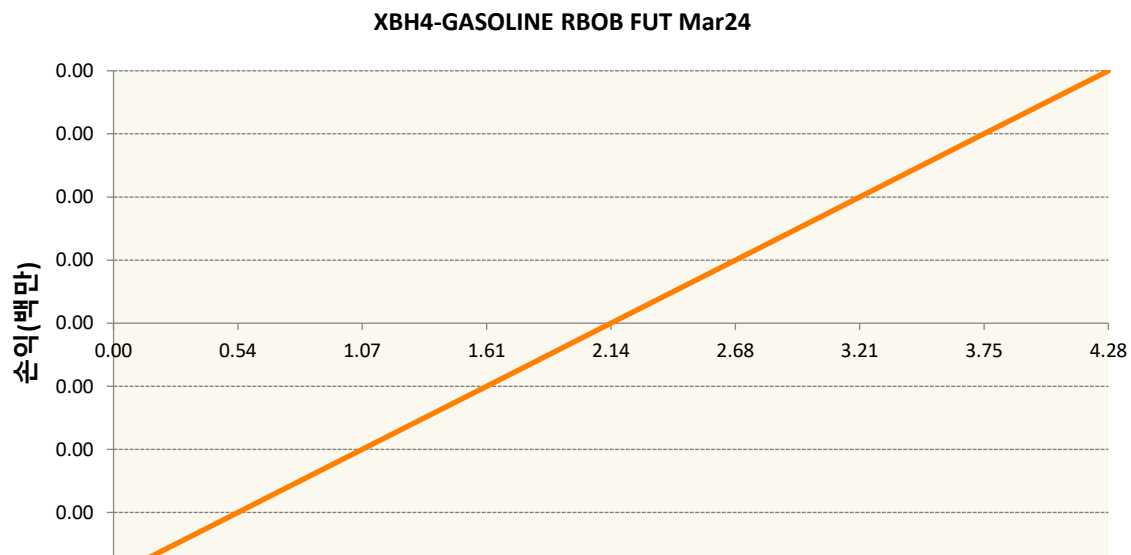
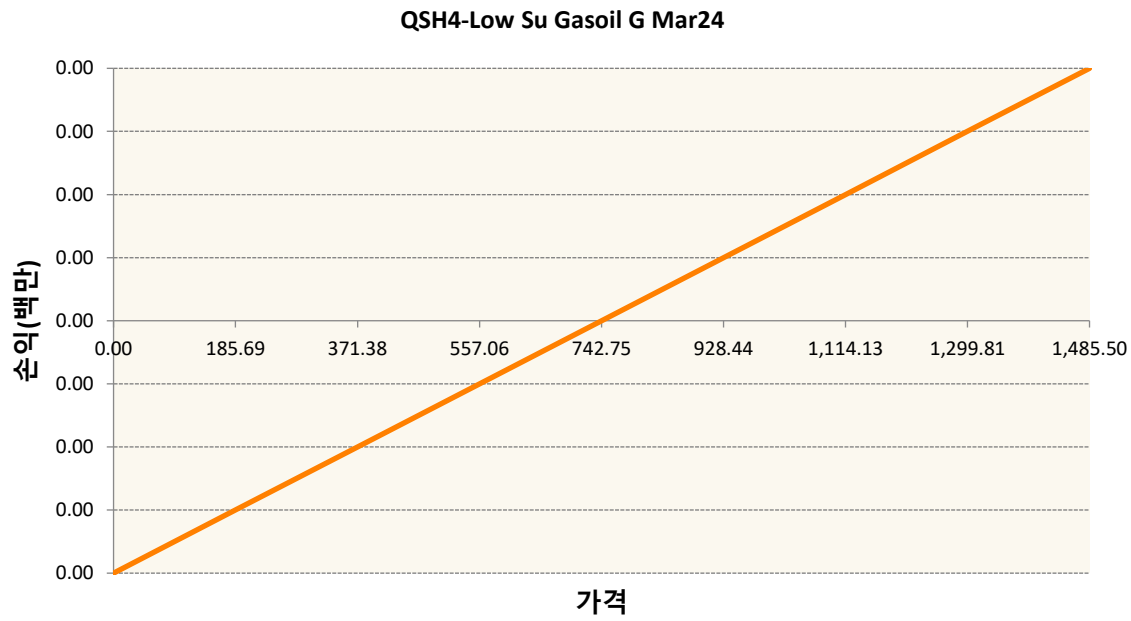
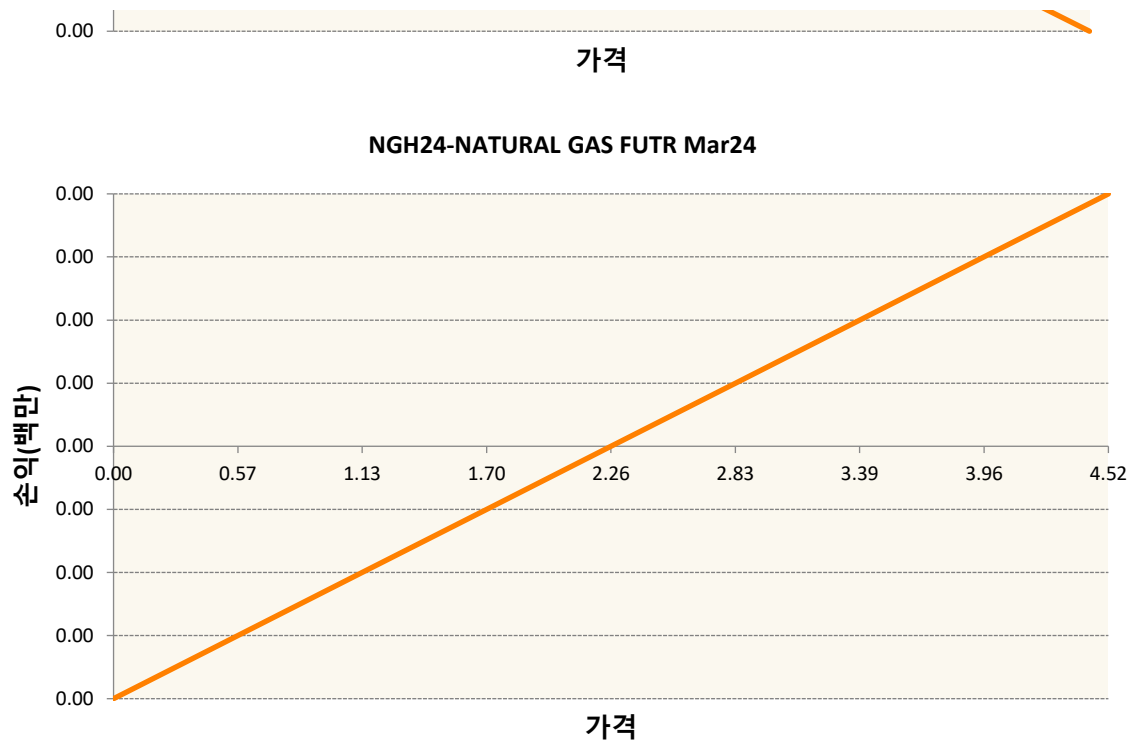
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	142	-142	장내
누계	선물	유가증권	285	0	285	
누계	유가증권	선물	852	0	852	
누계	통화	선물	0	220	-220	장내

2. 만기시점의 손익구조







0.00

가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

CLH4	WTI CRUDE FUTURE Mar24	23
COH4	BRENT CRUDE FUTR Mar24	24
EOH4	E-MINI NATURAL GAS Mar24	1
HOH4	NY Harb ULSD Fut Mar24	11
KR4175V100 2024-01	달러선물	18
NGH24	NATURAL GAS FUTR Mar24	14
QSH4	Low Su Gasoil G Mar24	8
XBH4	GASOLINE RBOB FUT Mar24	9

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

(단위:백만원)

221