

공시일	2023-12-21
기준일	2023-12-20

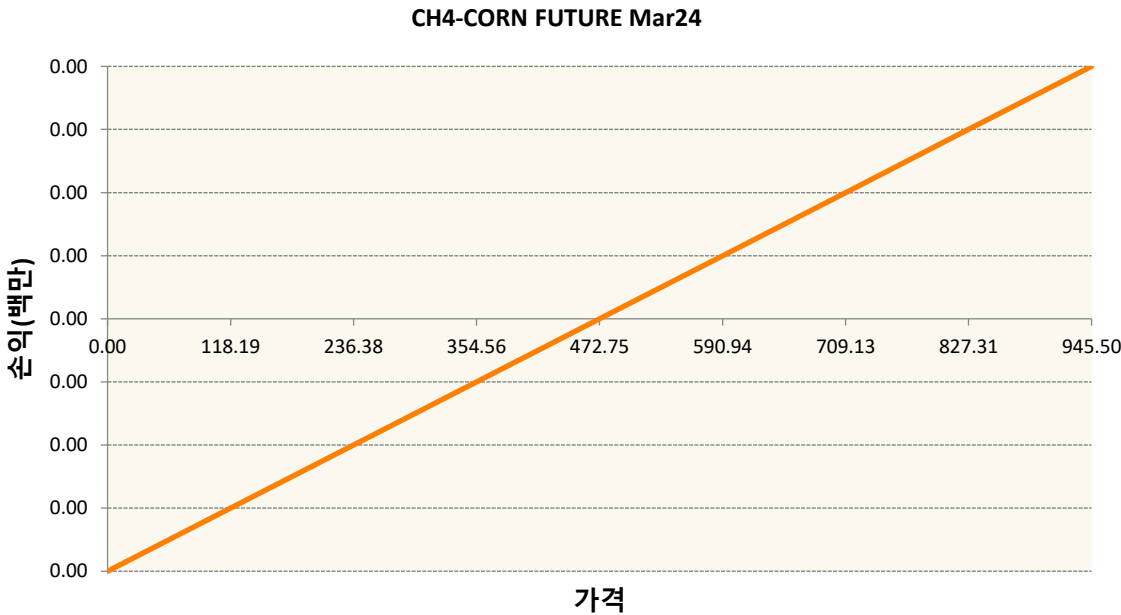
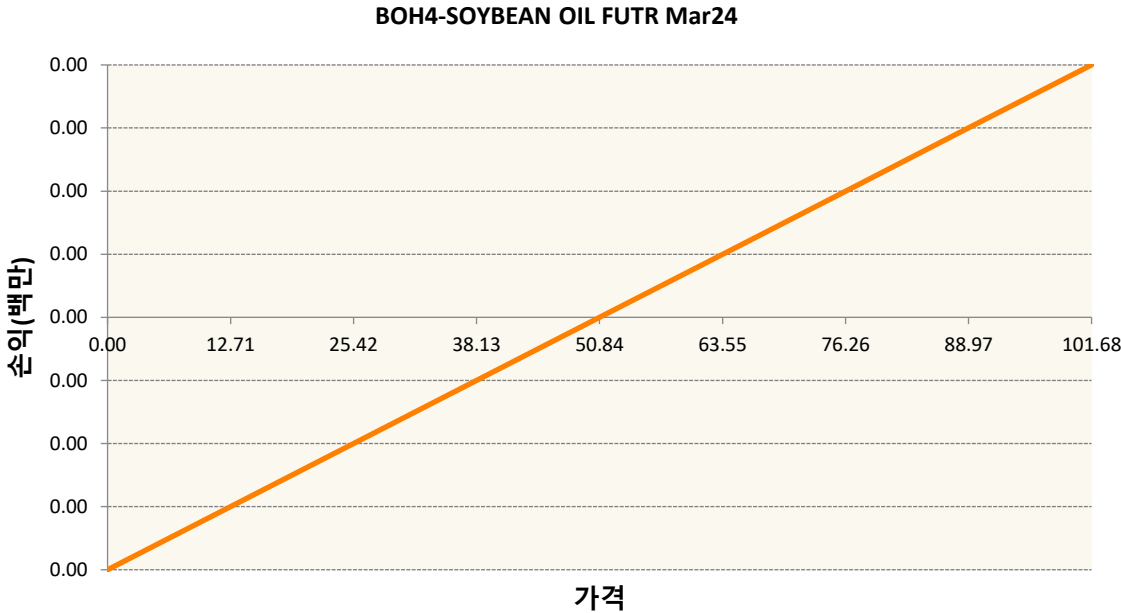
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

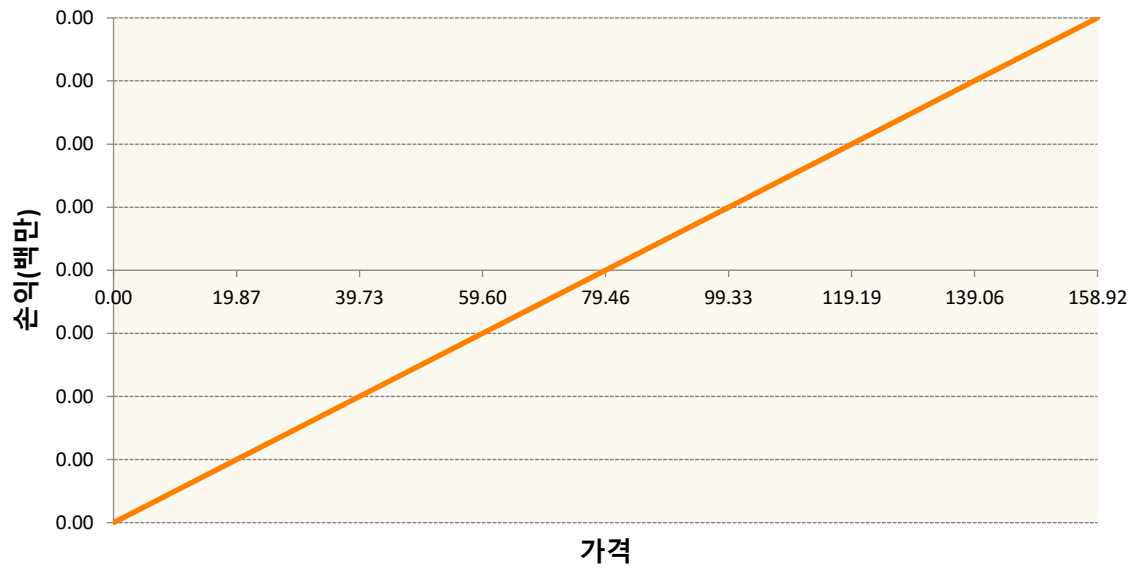
(단위:USD 백만)

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	4,768	0	4,768	
누계	통화	선물	0	480	-480	장내

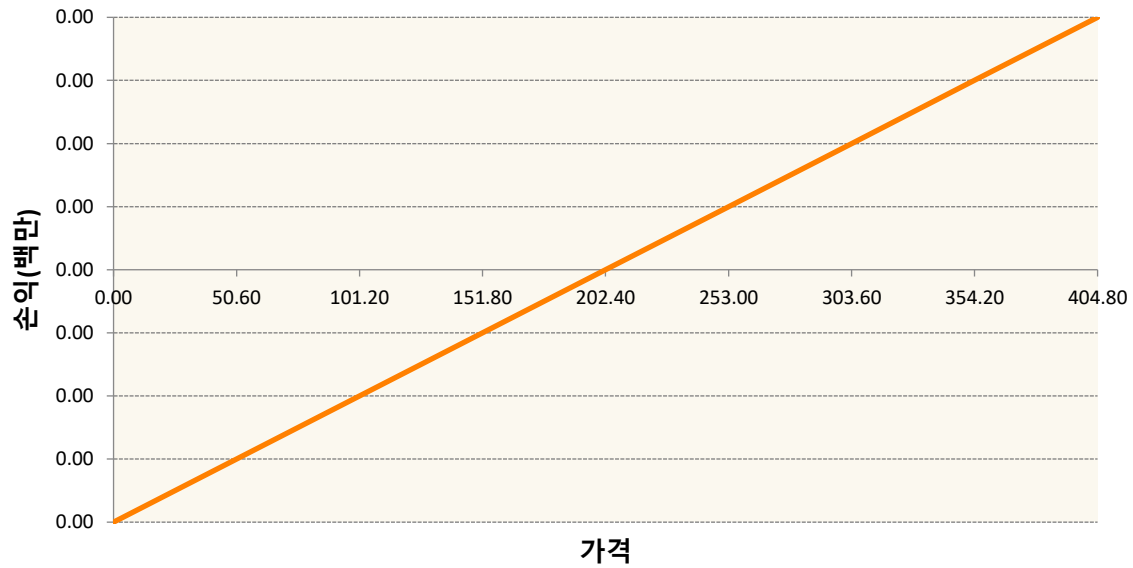
2. 만기시점의 손익구조



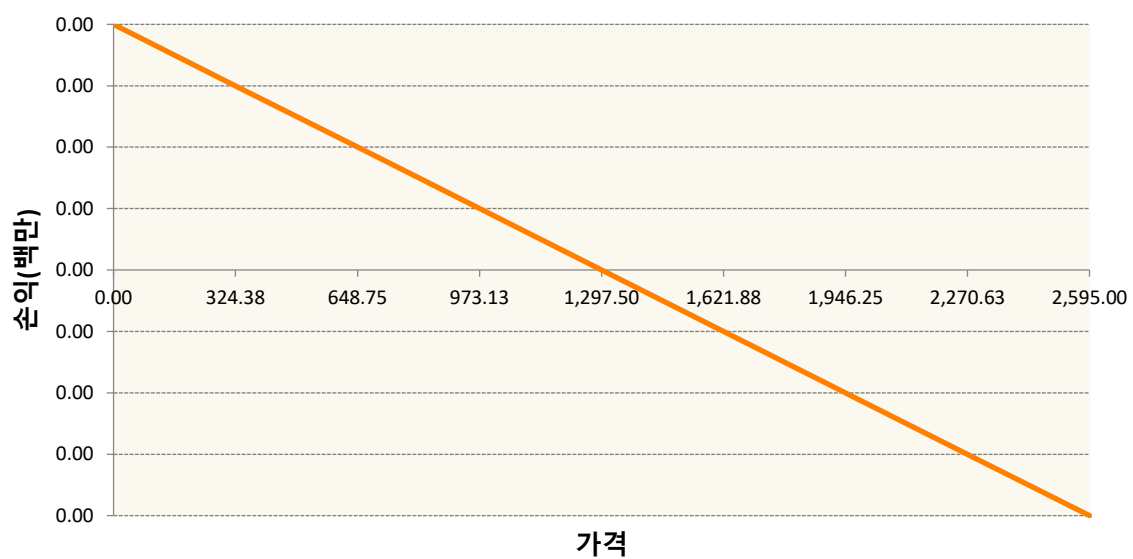
CTH4-COTTON NO.2 FUTR Mar24



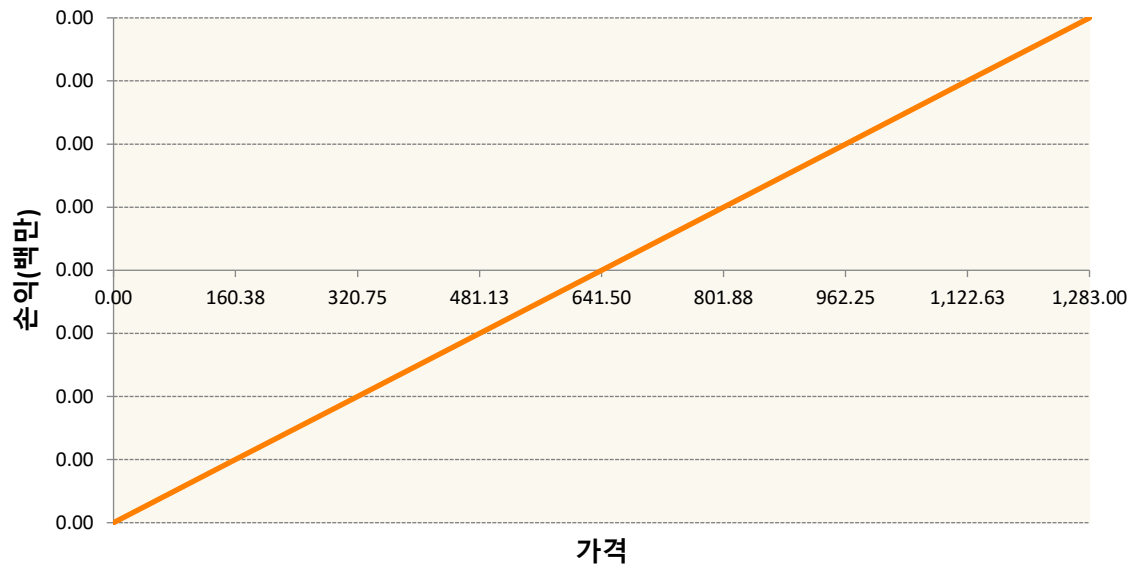
KCH4-COFFEE 'C' FUTURE Mar24



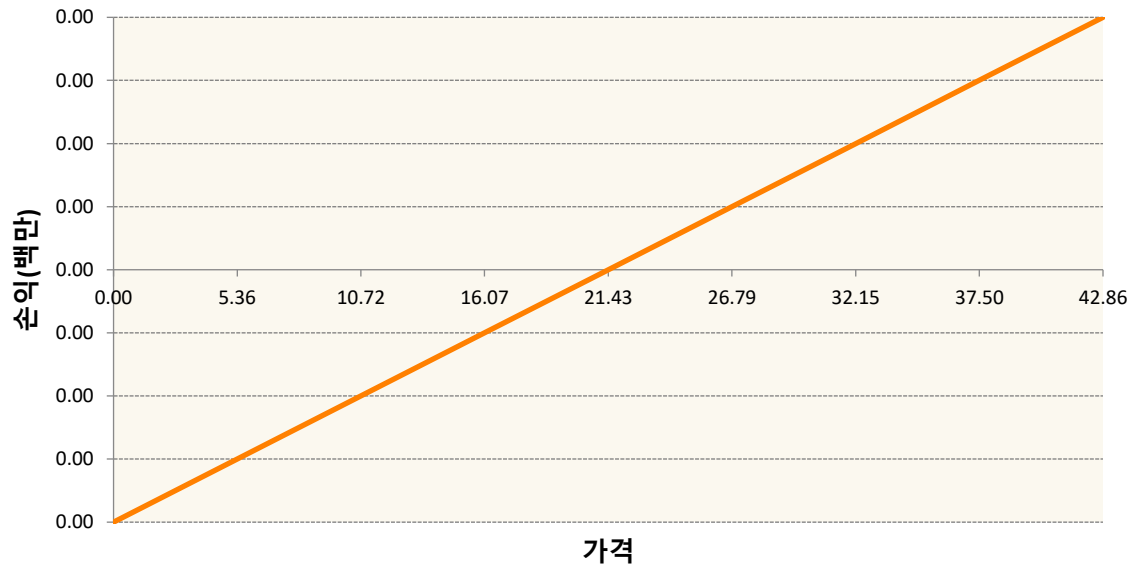
KR4175V10001-2024-01 달러선물



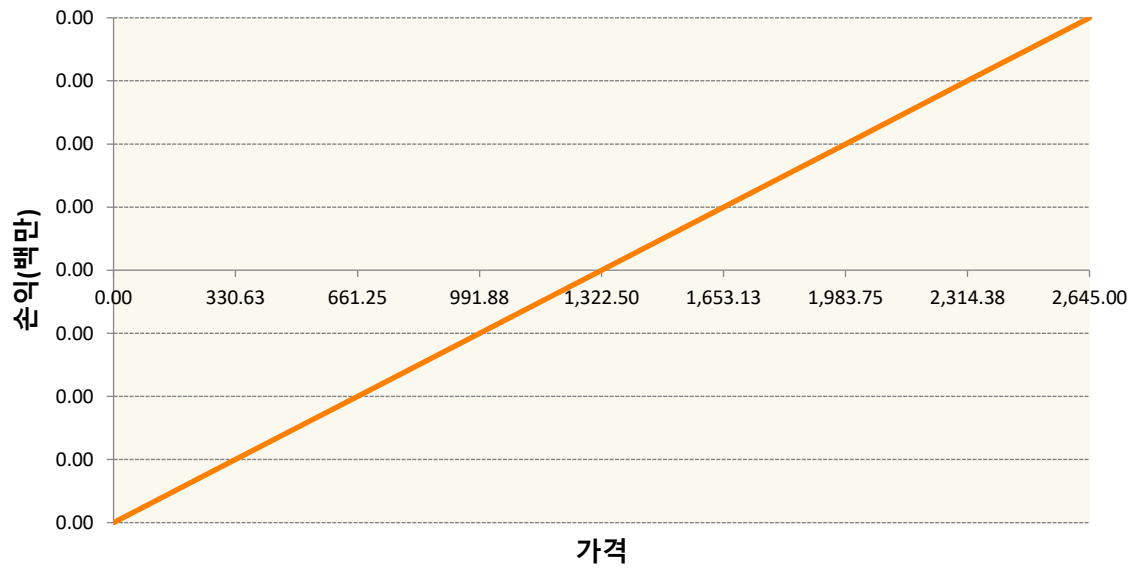
KWH4-KC HRW WHEAT FUT Mar24



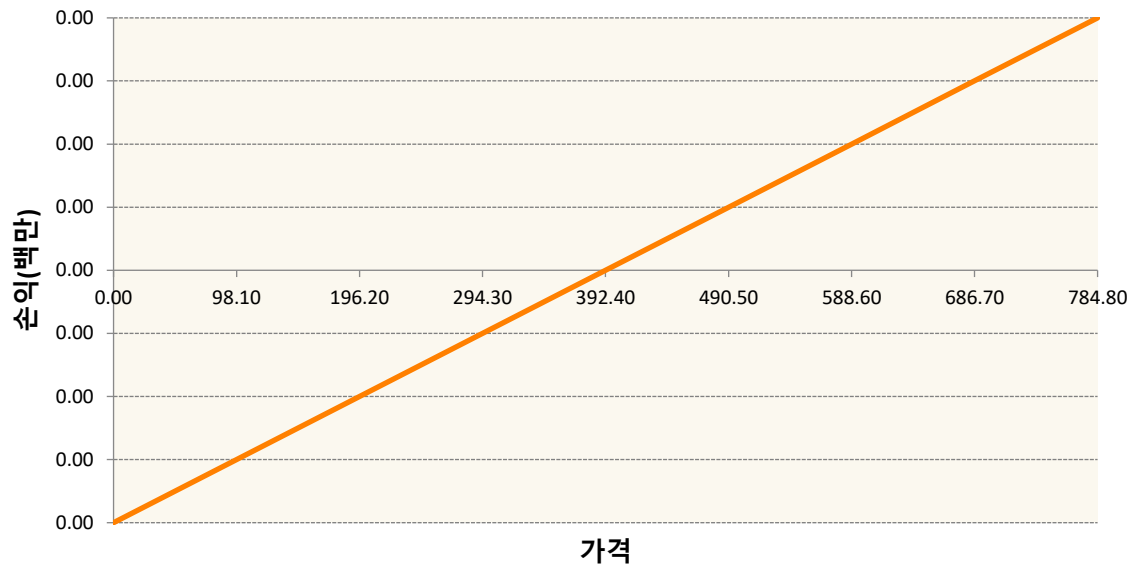
SBH4-Sugar #11 (WORLD) Mar24



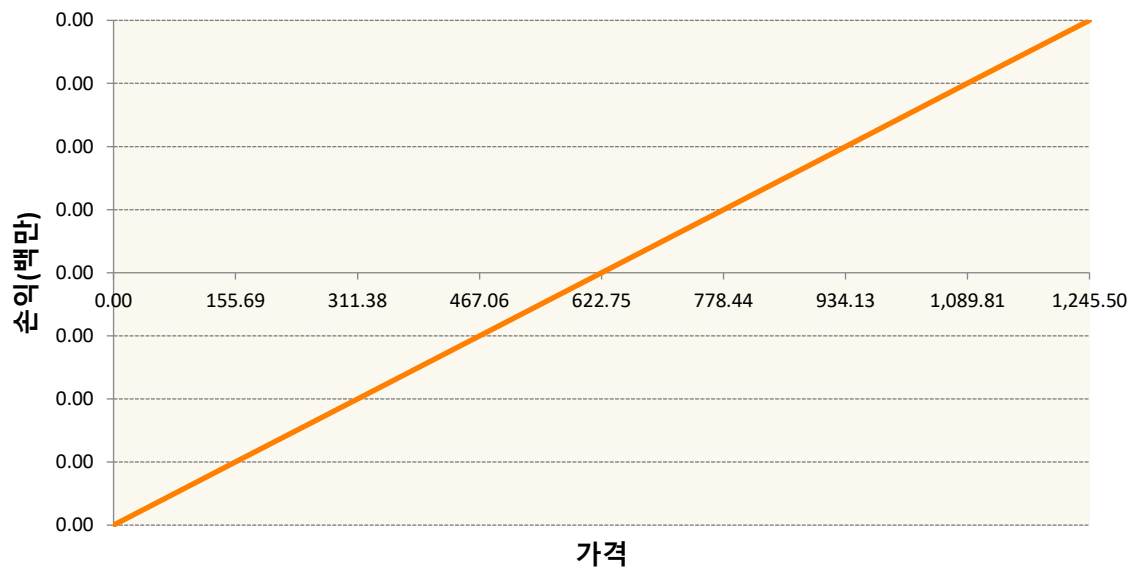
SH4-SOYBEAN FUTURE Mar24



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	2023-12-21
기준일	2023-12-20

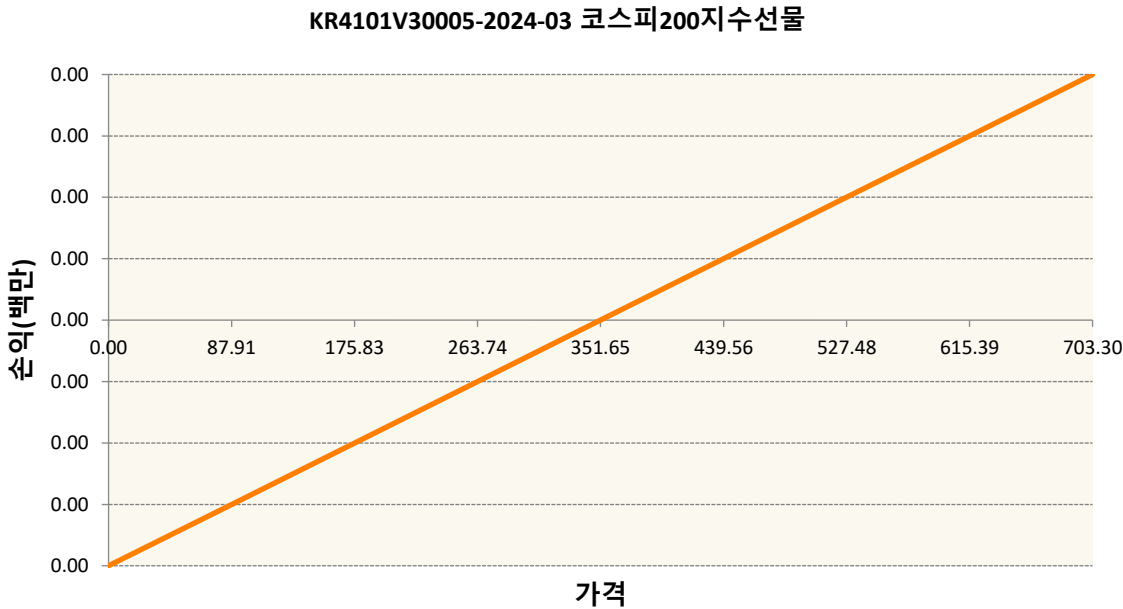
스마트인덱스모

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	1,582	0	1,582	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101V30005		2024-03 코스피200지수선물					126
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-126	-126	-126	-126	-126	-126	-126
-5.33%	-84	-84	-84	-84	-84	-84	-84
-2.67%	-42	-42	-42	-42	-42	-42	-42
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	42	42	42	42	42	42	42
5.33%	84	84	84	84	84	84	84
8.00%	126	126	126	126	126	126	126

공시일	2023-12-21
기준일	2023-12-20

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

307

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

271

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2023-12-21
기준일	2023-12-20

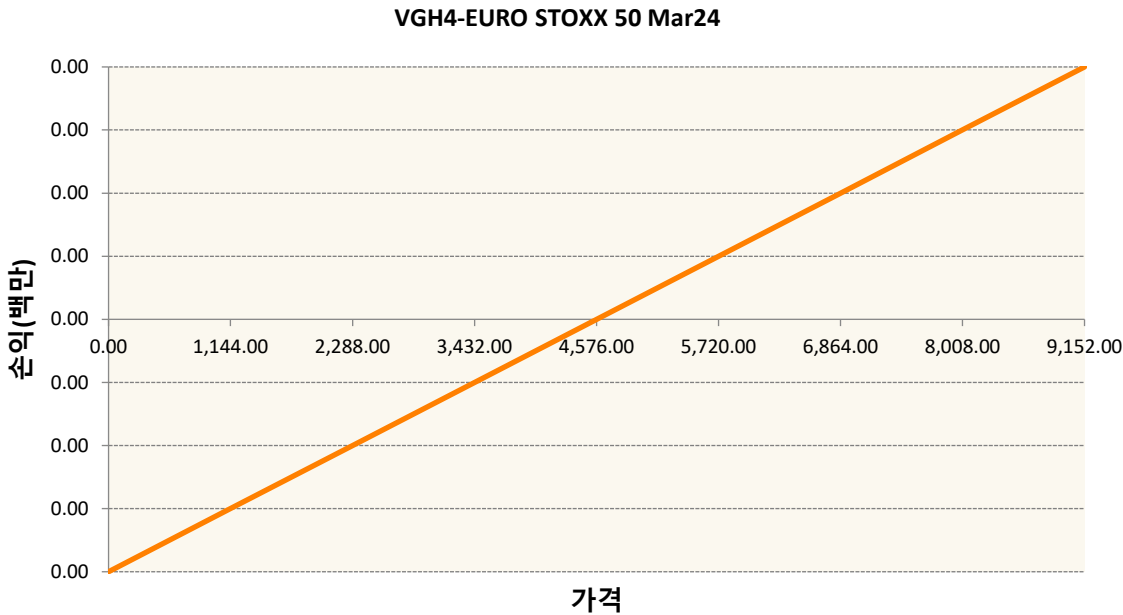
유로인덱스모(주식-파생형)

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	977	0	977	
누계	통화	선도	427	0	427	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
FXW213D9M	EUR/KRW	22-12-23E	17
FXW213DCL	EUR/KRW	22-03-24E	17
VGH4	EURO STOXX 50	Mar24	78

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	85

공시일	2023-12-21
기준일	2023-12-20

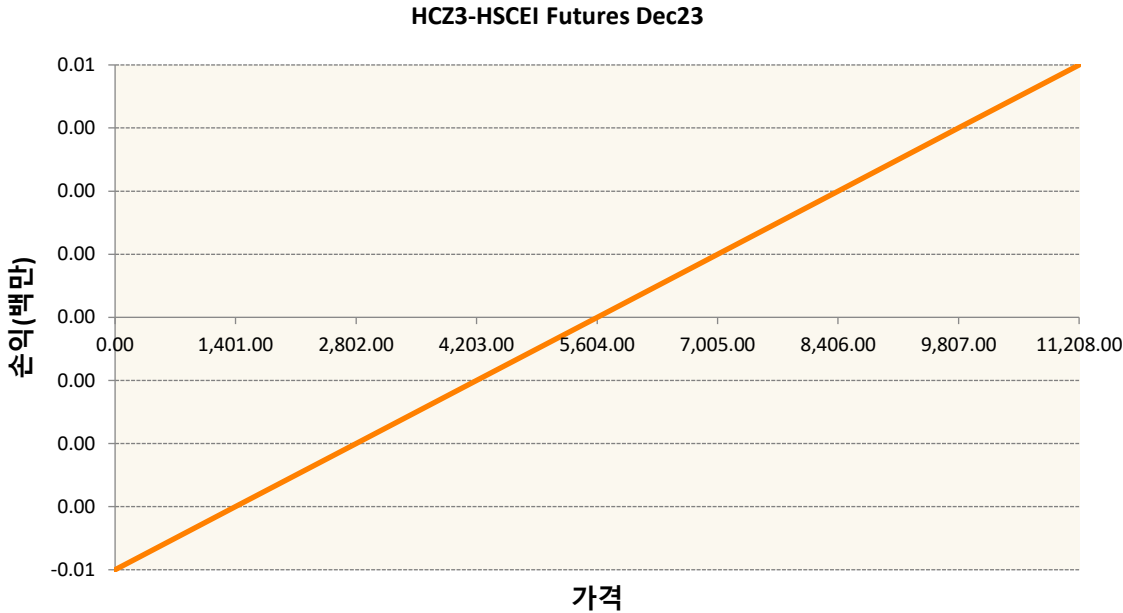
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,116	0	1,116	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCZ3	HSCEI Futures Dec23	89
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

130

공시일	2023-12-21
기준일	2023-12-20

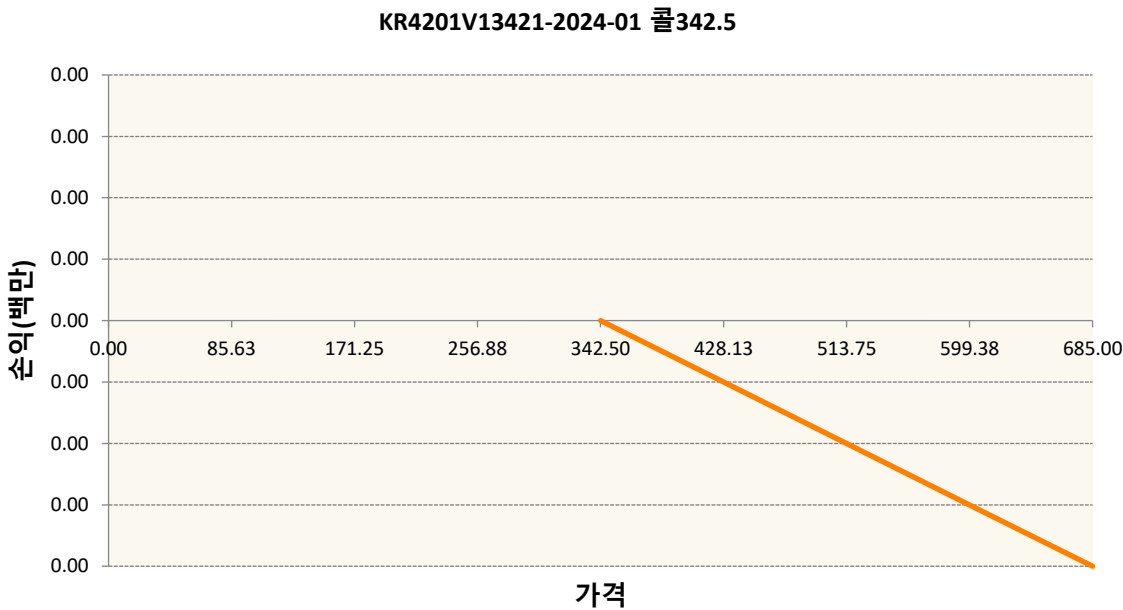
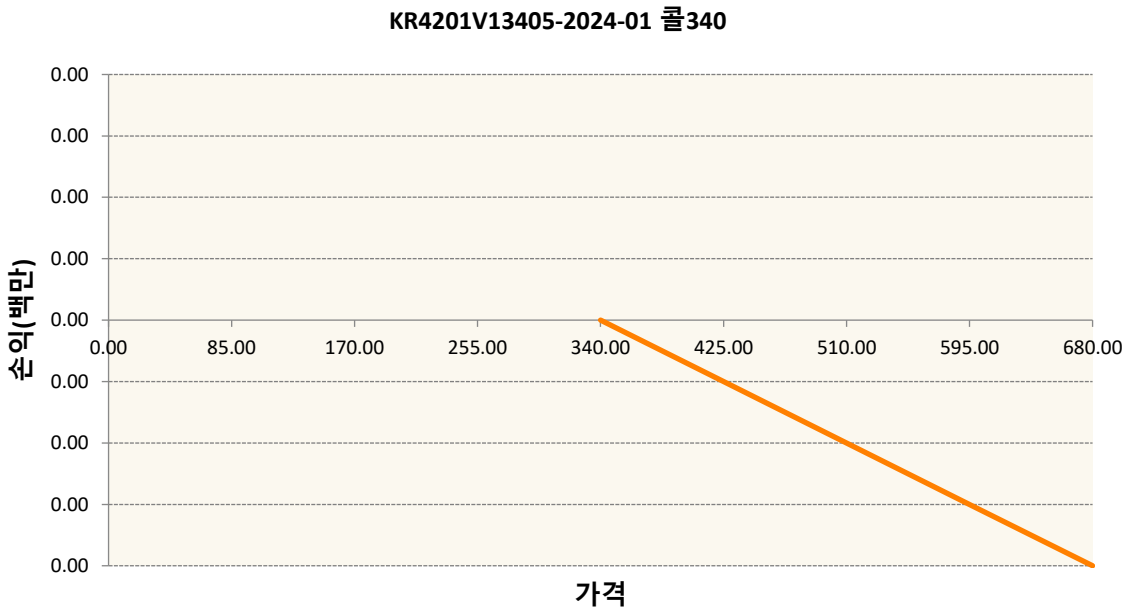
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

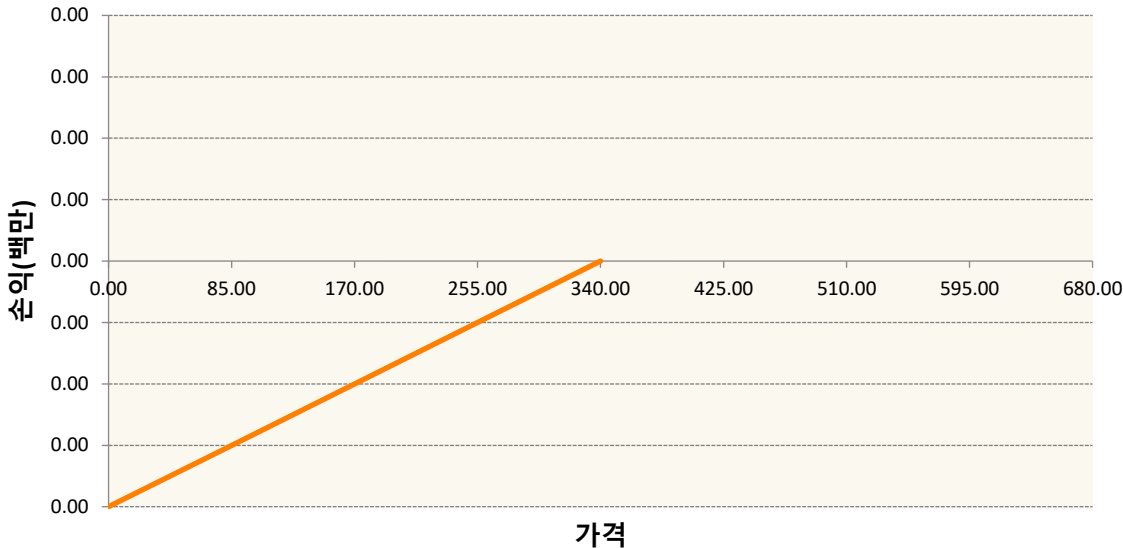
(단위:백만원)

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

2. 만기시점의 손익구조



KR4301V13403-2024-01 풋340



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201V13405		2024-01 콜340					1,137
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	632	615	595	574	552	528	504
-5.33%	541	513	484	455	426	396	366
-2.67%	361	329	297	265	232	200	168
0%	84	57	29	0	-29	-59	-89
2.67%	-271	-288	-307	-328	-351	-375	-400
5.33%	-671	-679	-690	-703	-718	-735	-753
8.00%	-1,091	-1,094	-1,099	-1,105	-1,114	-1,125	-1,137
KR4201V13421		2024-01 콜342.5					1,903
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	978	952	923	891	856	819	780
-5.33%	852	808	762	715	666	617	567
-2.67%	587	532	477	421	366	310	255
0%	154	104	52	0	-53	-106	-160
2.67%	-423	-458	-496	-536	-579	-624	-670
5.33%	-1,093	-1,112	-1,134	-1,160	-1,190	-1,222	-1,257
8.00%	-1,808	-1,815	-1,826	-1,840	-1,858	-1,879	-1,903
KR4301V13403		2024-01 풋340					426
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-406	-408	-411	-414	-417	-422	-426
-5.33%	-194	-201	-208	-216	-224	-233	-241
-2.67%	-44	-54	-64	-75	-85	-95	-105
0%	20	14	7	0	-8	-15	-24

2.67%	34	32	30	27	24	20	15
5.33%	35	35	35	34	33	32	30
8.00%	36	36	35	35	35	35	34

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)						(단위:백만원)
						3,495

공시일	2023-12-21
기준일	2023-12-20

H2O글로벌본드(USD)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	20	-20	
누계	유가증권	수익증권	1,941	0	1,941	

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	2023-12-21
기준일	2023-12-20

H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	33	-33	
누계	유가증권	수익증권	4,548	0	4,548	

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	2023-12-21
기준일	2023-12-20

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	17,698	0	17,698	
누계	통화	선도	0	16,918	-16,918	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213D9R KRW/USD 29-12-23E	504
FXW213DAT KRW/USD 31-01-24E	185
FXW213DBV KRW/USD 29-02-24E	638
FXW213DCB KRW/USD 31-01-24E	26
IE00BD8RGM75	

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

707

공시일	2023-12-21
기준일	2023-12-20

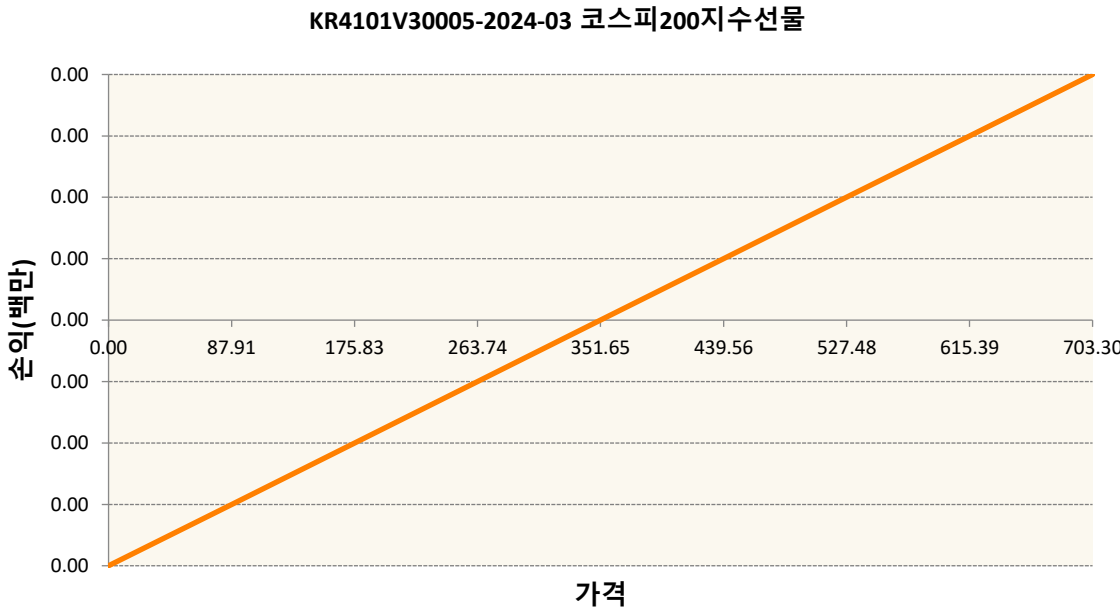
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

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	615	0	615	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101V30005			2024-03 코스피200지수선물				49
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-49	-49	-49	-49	-49	-49	-49
-5.33%	-33	-33	-33	-33	-33	-33	-33
-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%	33	33	33	33	33	33	33
8.00%	49	49	49	49	49	49	49

공시일	2023-12-21
기준일	2023-12-20

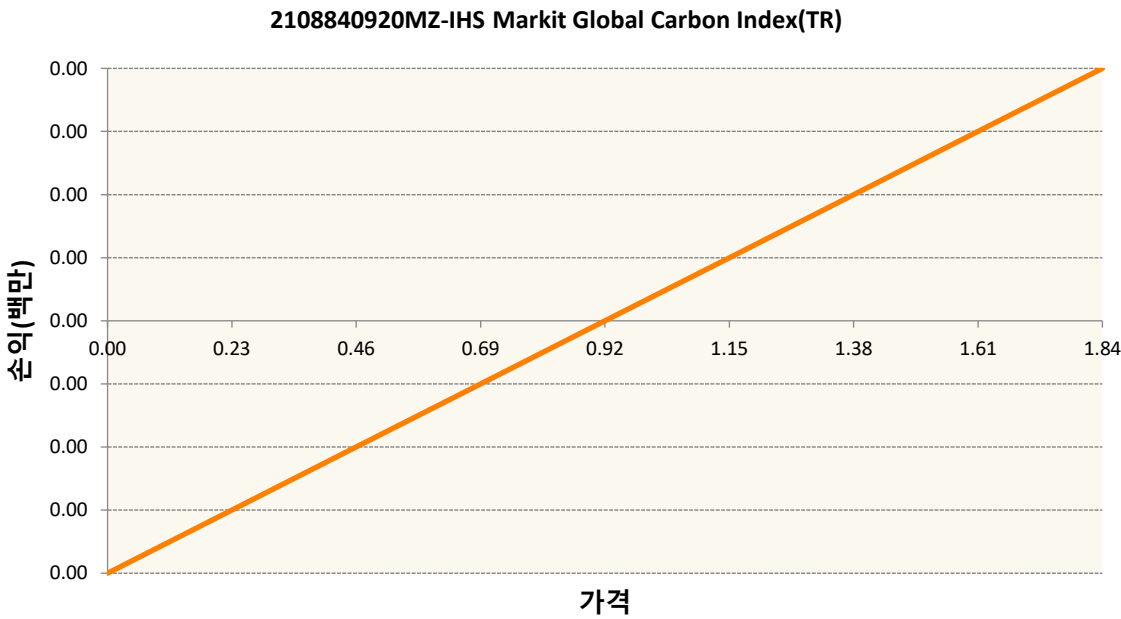
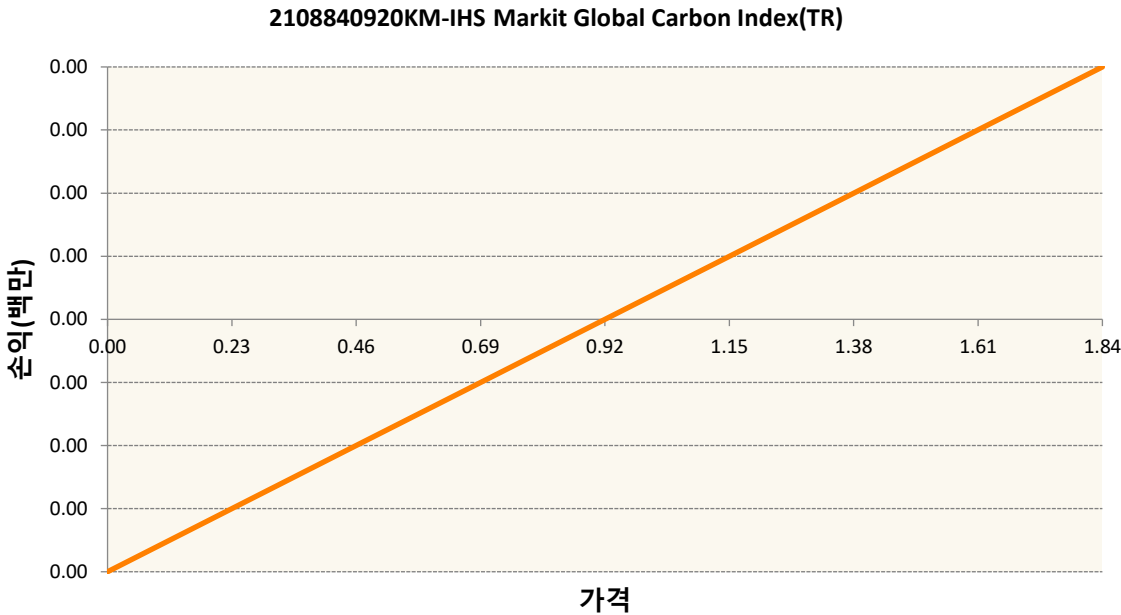
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

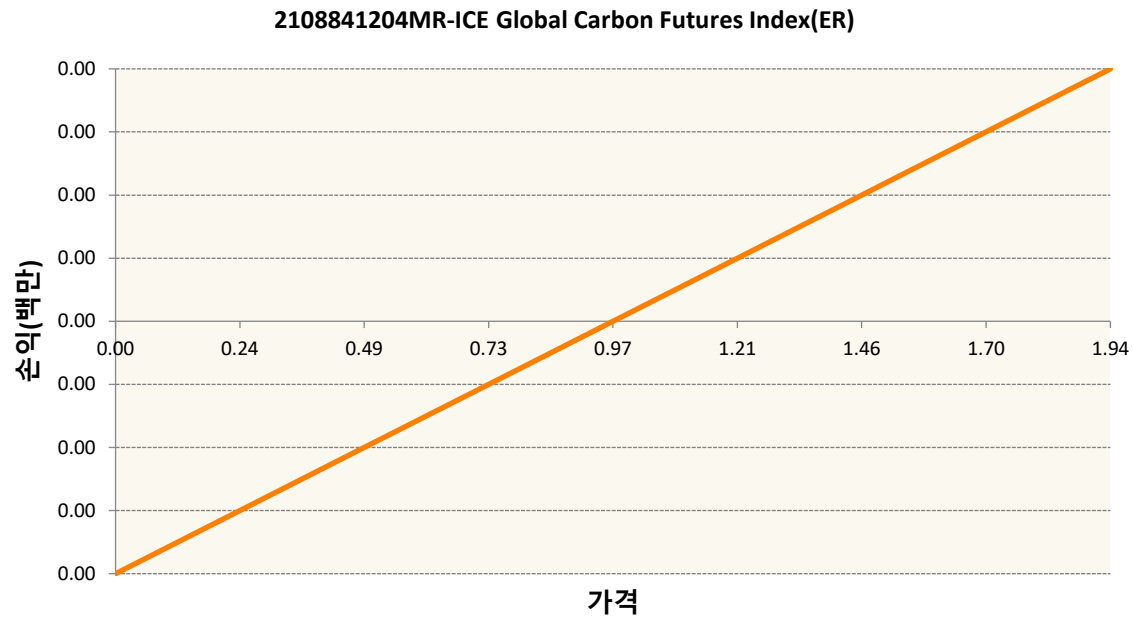
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	18,649	0	18,649	

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108840920IIHS Markit Global Carbon Index(TR)		935
2108840920IIHS Markit Global Carbon Index(TR)		187
2108841204IIICE Global Carbon Futures Index(ER)		374

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)		(단위:백만원)
		1,891

공시일	2023-12-21
기준일	2023-12-20

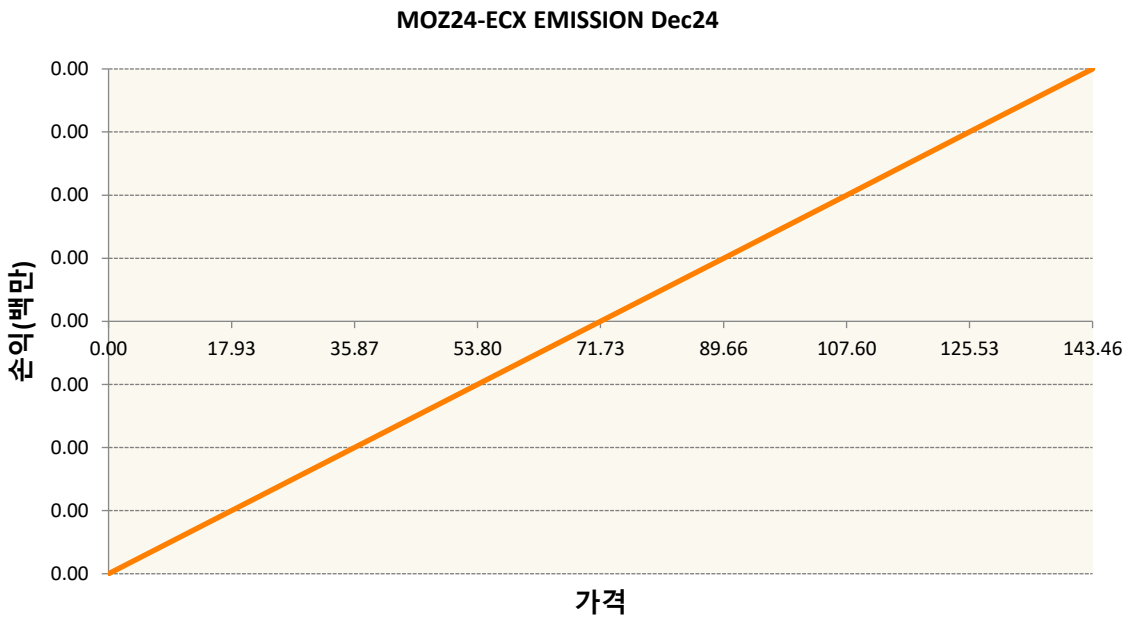
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	8,795	0	8,795	
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	704
SWICEUACN ICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX	7

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

(단위:백만원)

1,345

공시일	2023-12-21
기준일	2023-12-20

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)	26
SWCSI00000 신한CSI Index 230622 (메리츠)	26
SWCSI00000 신한CSI Index 230922 (키움)	17
SWCSI00000 신한CSI Index 231013 (NH)	18

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

(단위:백만원)

123

공시일	2023-12-21
기준일	2023-12-20

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	2023-12-21
기준일	2023-12-20

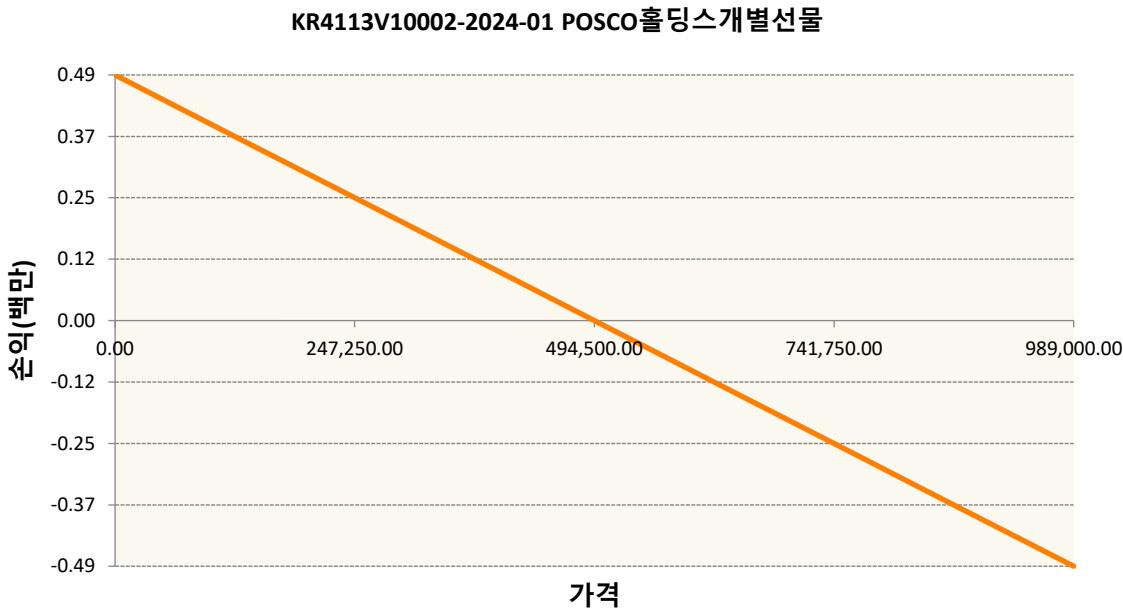
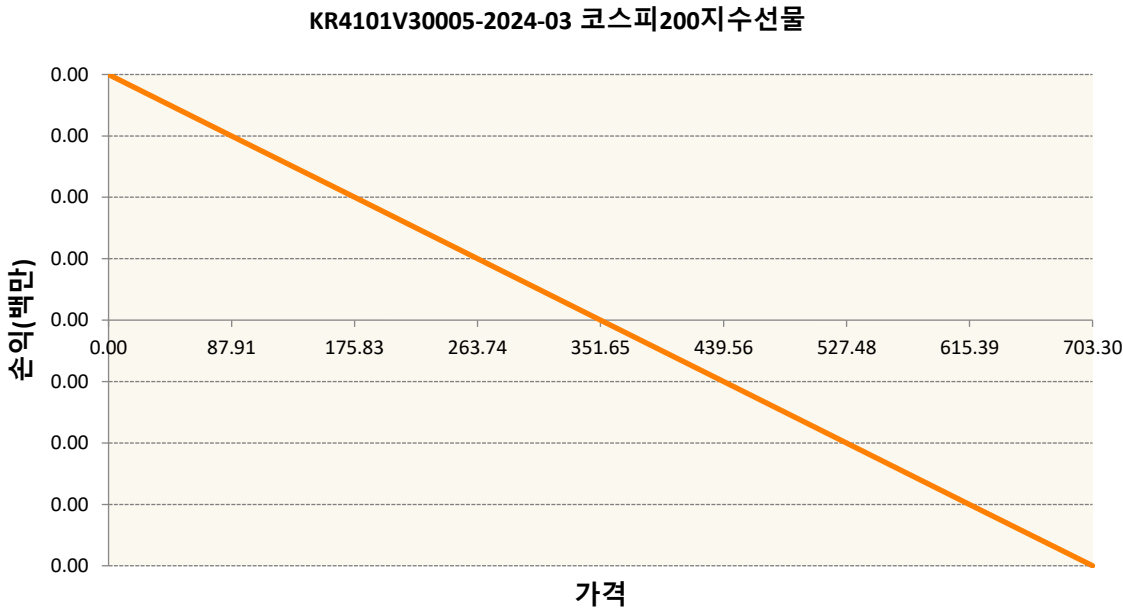
에쿼티알파일반사모혼합자산

1. 계약금액

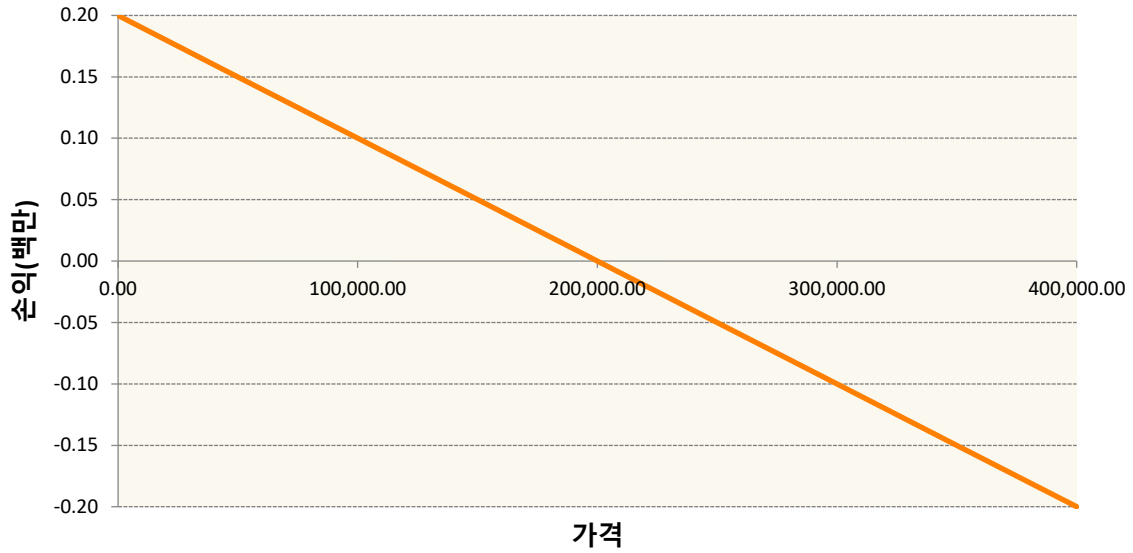
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	41	276	-236	장내
누계	유가증권	선물	96	3,080	-2,985	장내

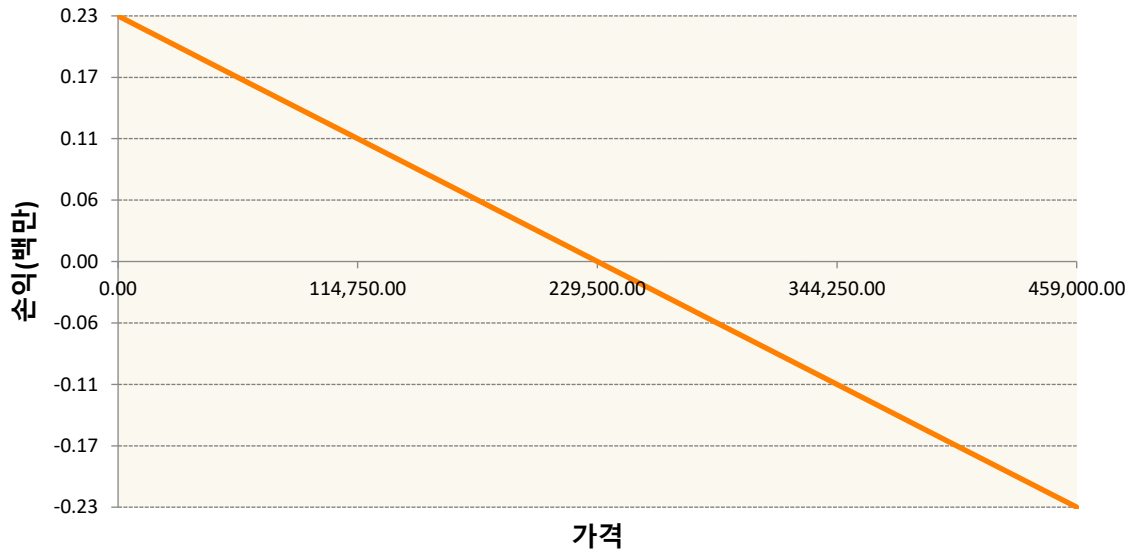
2. 만기시점의 손익구조



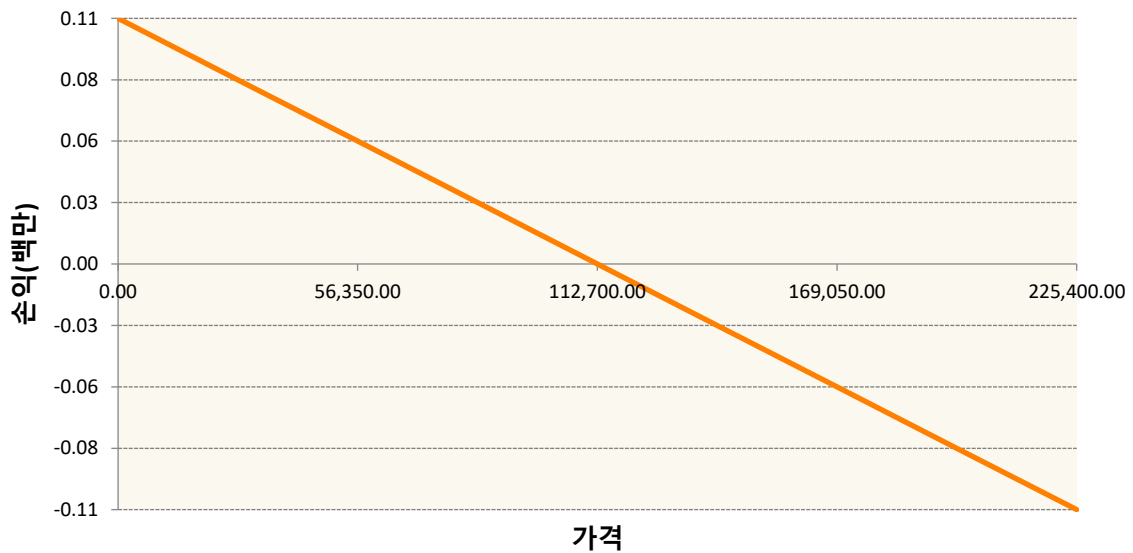
KR4116V10005-2024-01 현대차개별선물



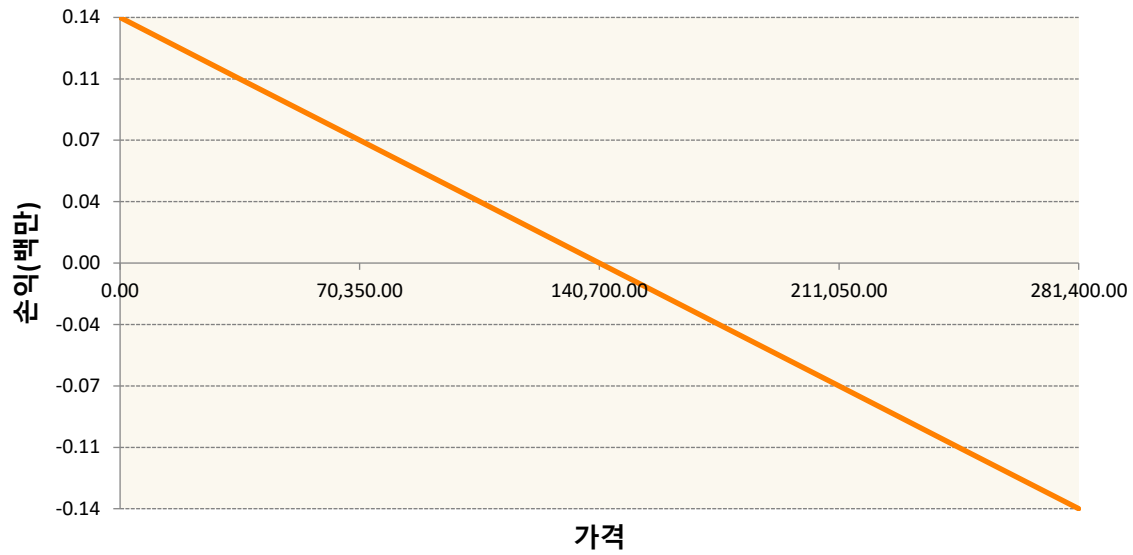
KR4120V10007-2024-01 현대모비스개별선물



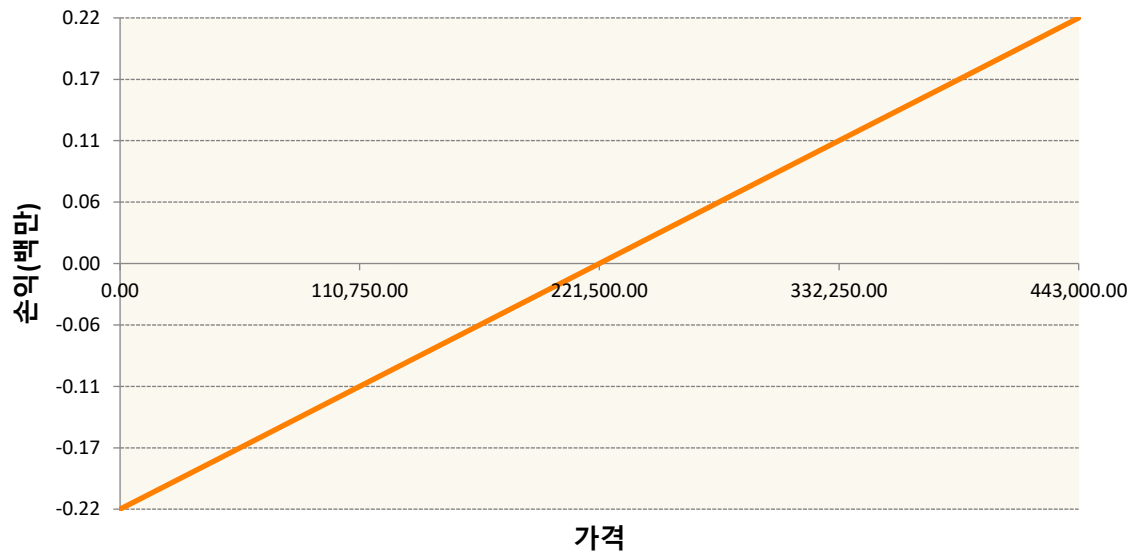
KR4139V10007-2024-01 HD한국조선해양개별선물



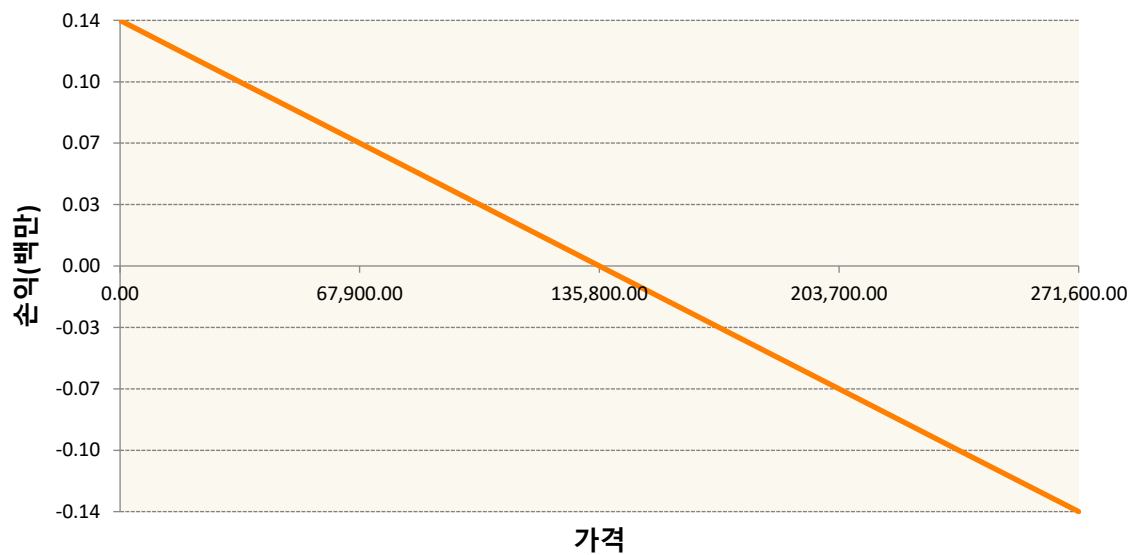
KR4150V10004-2024-01 SK하이닉스개별선물



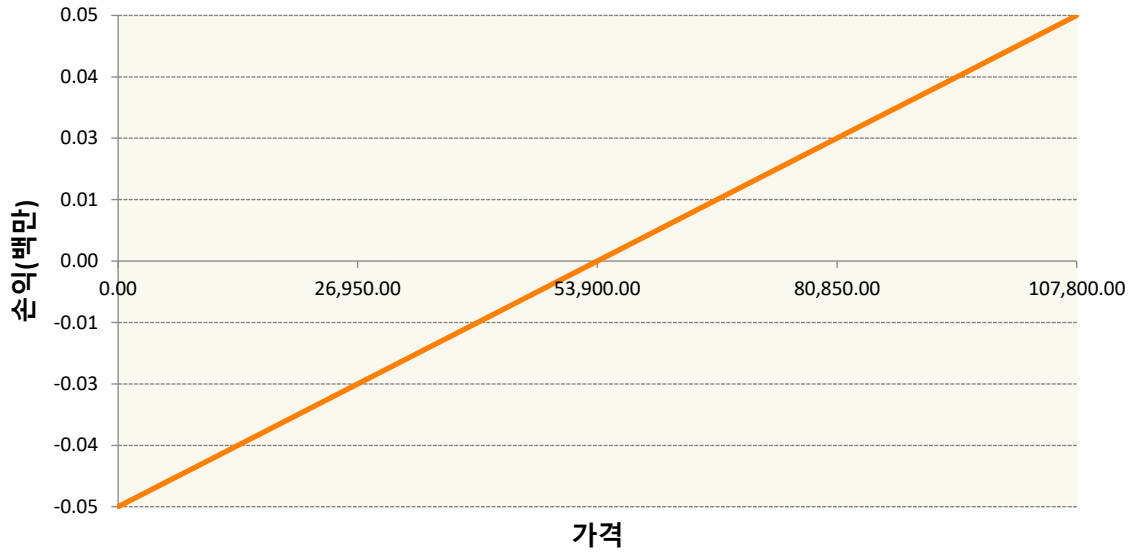
KR4156V10001-2024-01 NAVER개별선물



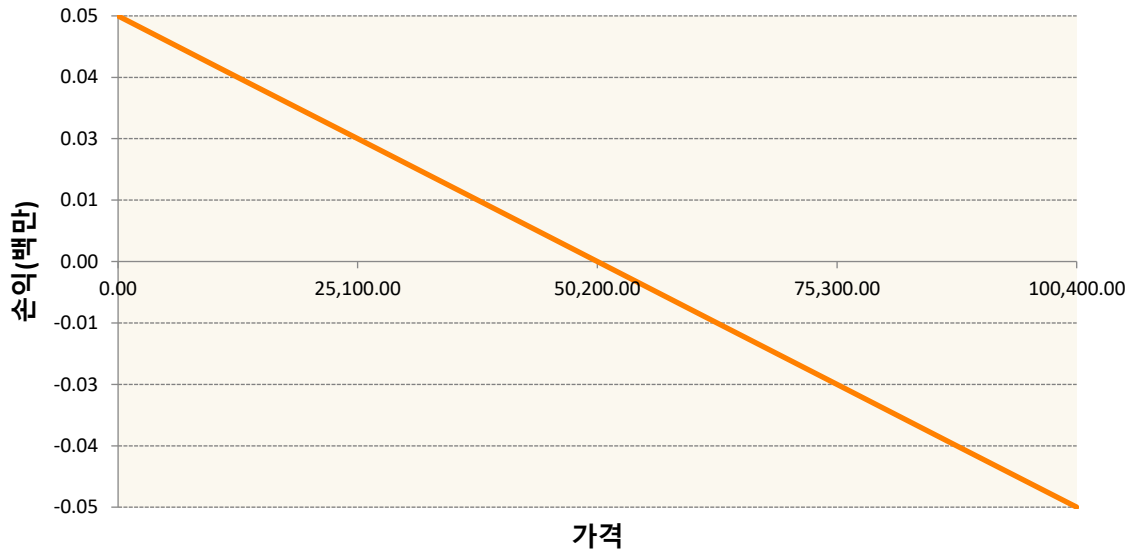
KR41C6V10003-2024-01 아모레퍼시픽개별선물



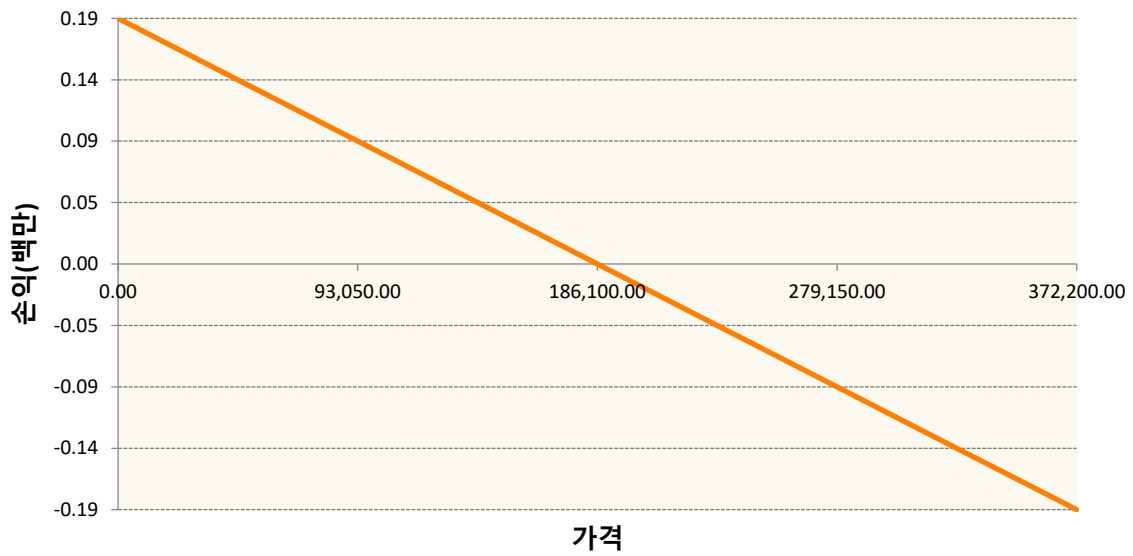
KR41CFV10002-2024-01 카카오개별선물



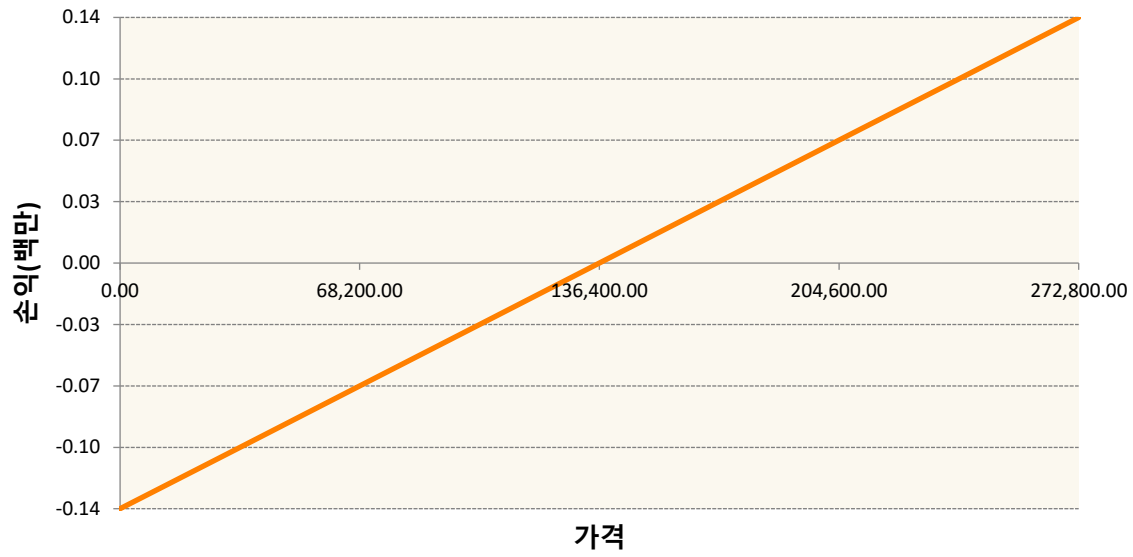
KR41CNV10006-2024-01 포스코DX개별선물



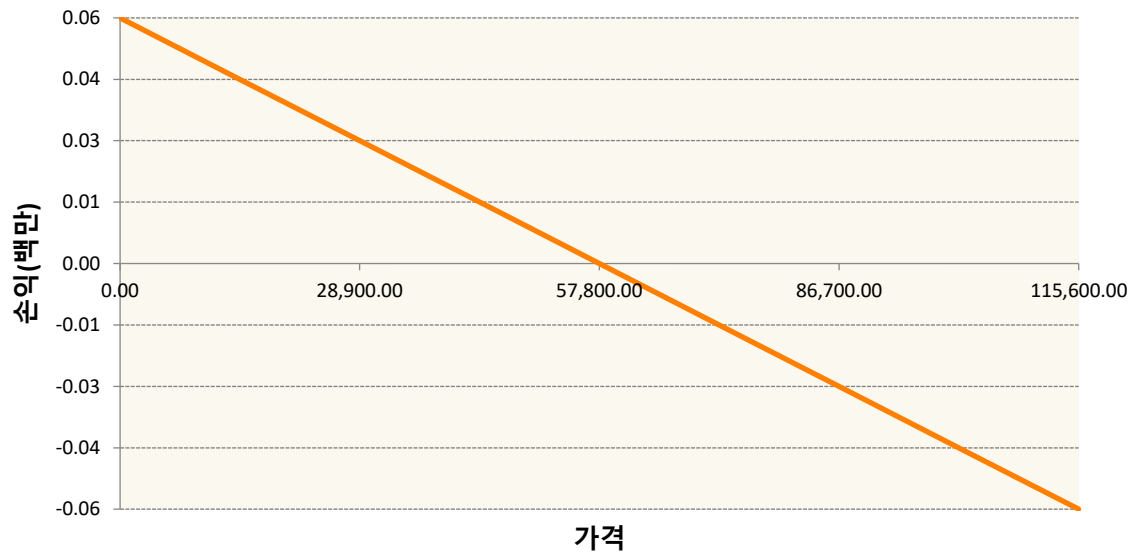
KR41CPV10001-2024-01 셀트리온개별선물



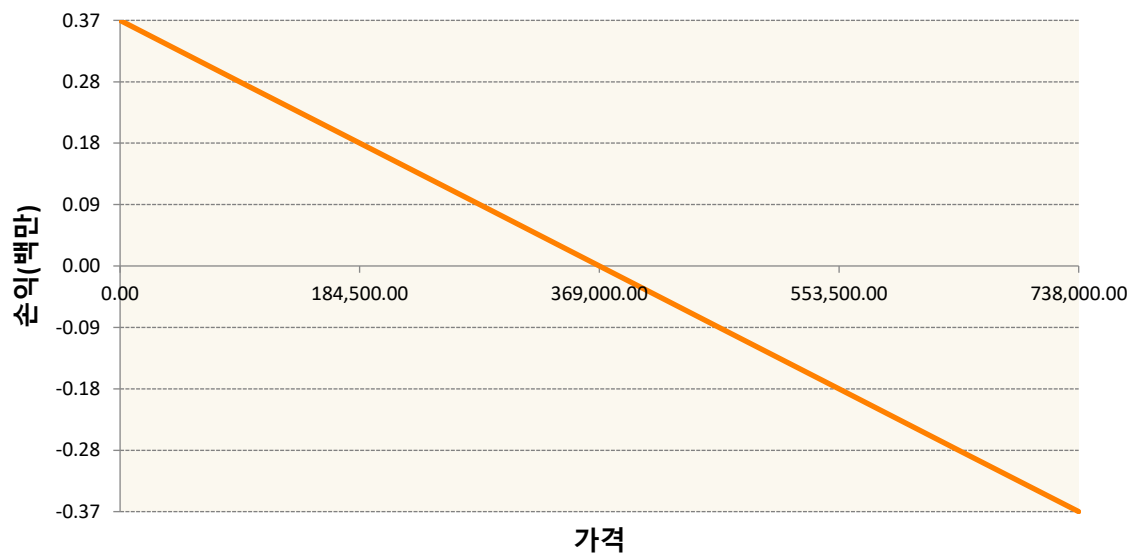
KR41DBV10009-2024-01 LIG넥스원개별선물



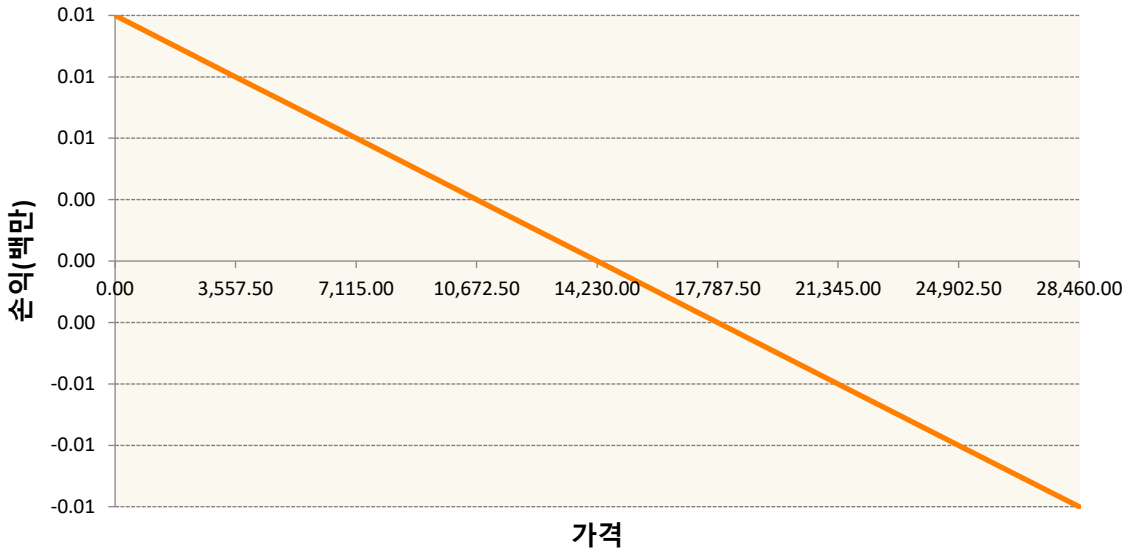
KR41E5V10003-2024-01 넷마블개별선물



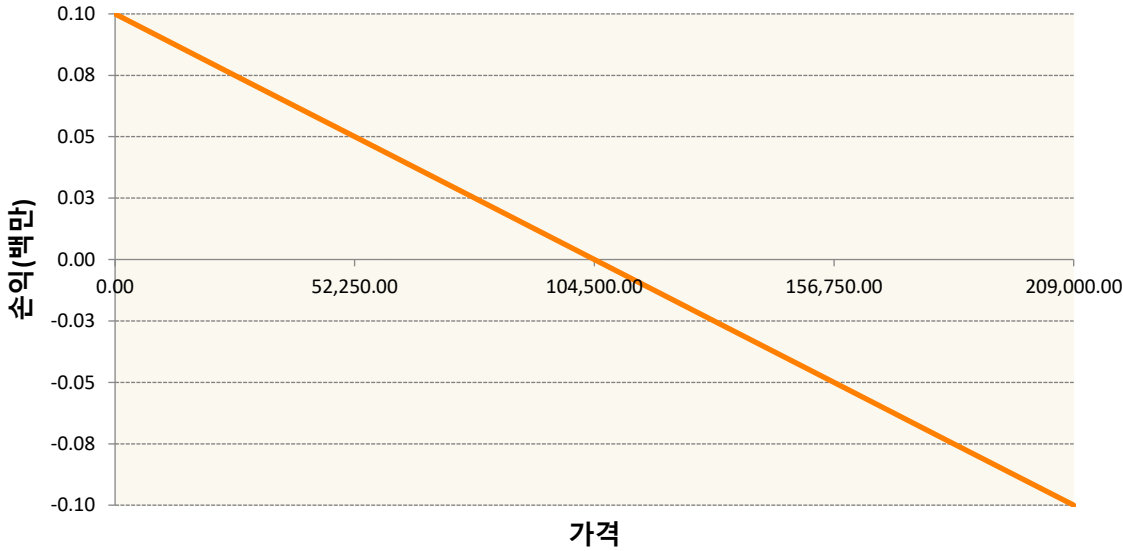
KR41E8V10007-2024-01 포스코퓨처엠개별선물



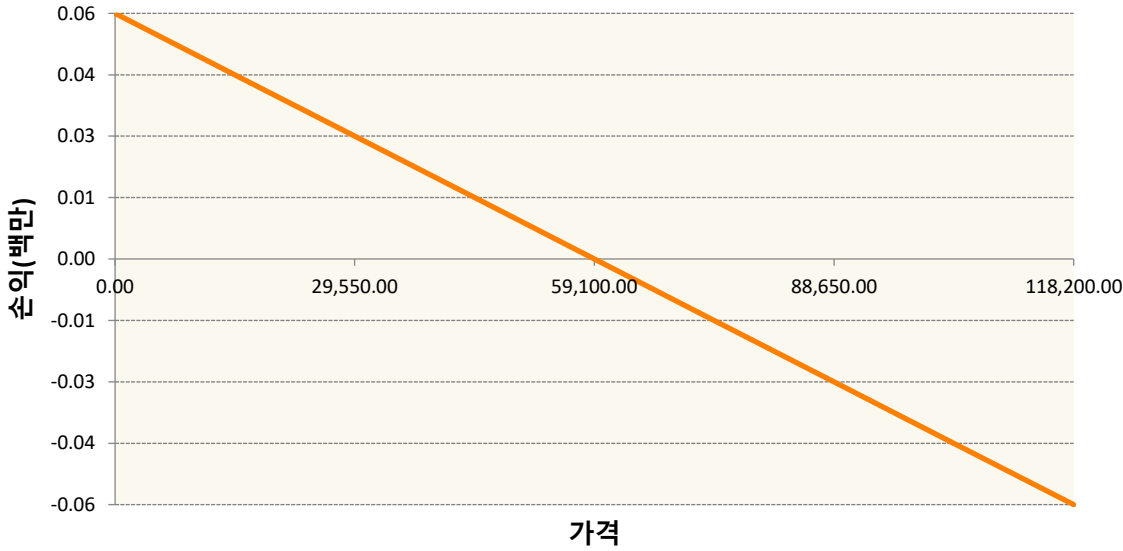
KR41ECV10005-2024-01 HDC현대산업개발개별선물



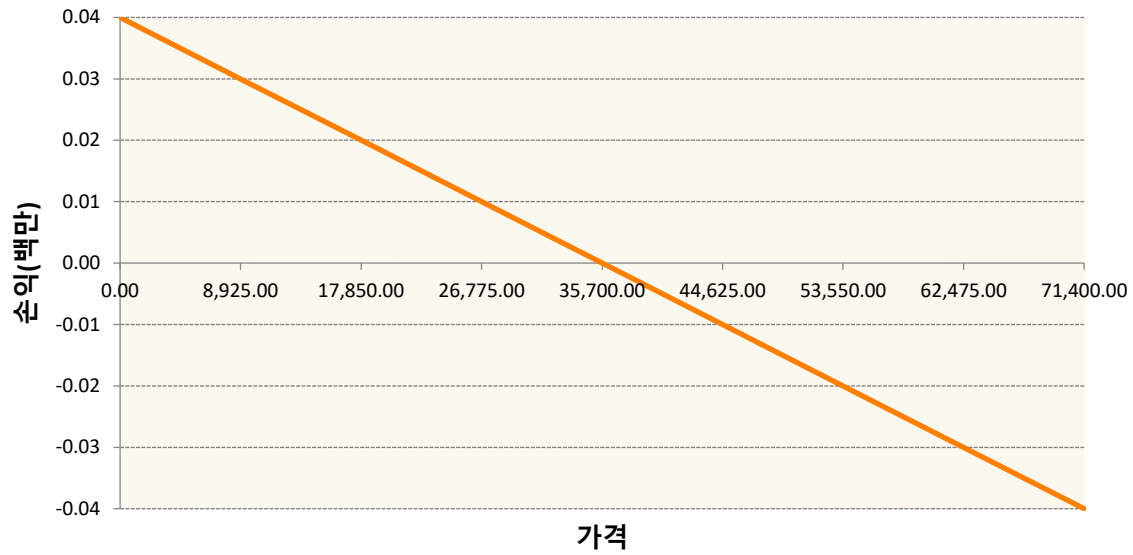
KR41EFV10008-2024-01 JYP Ent.개별선물



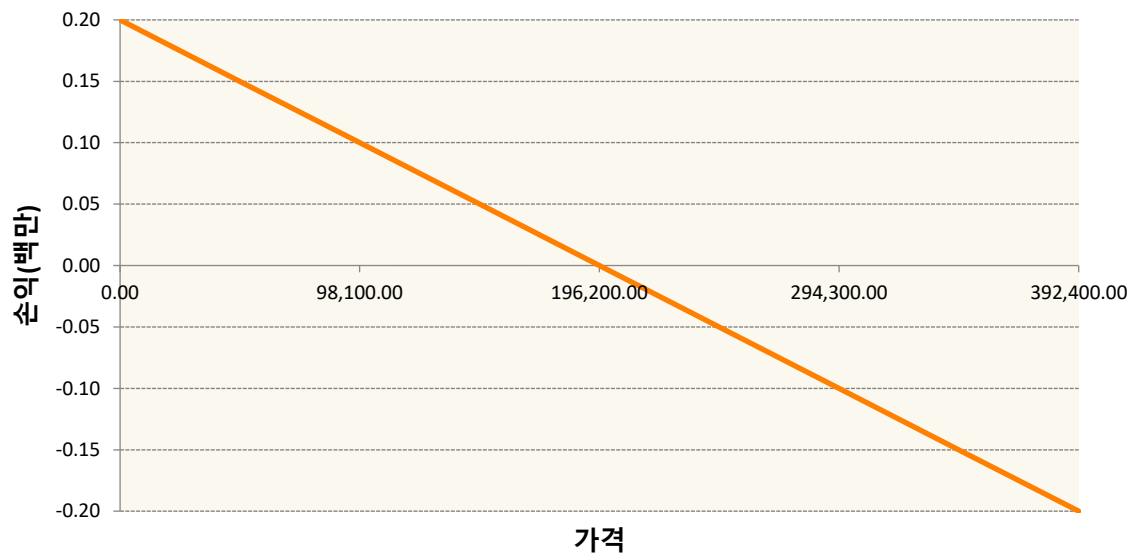
KR41EKV10008-2024-01 DB하이텍개별선물



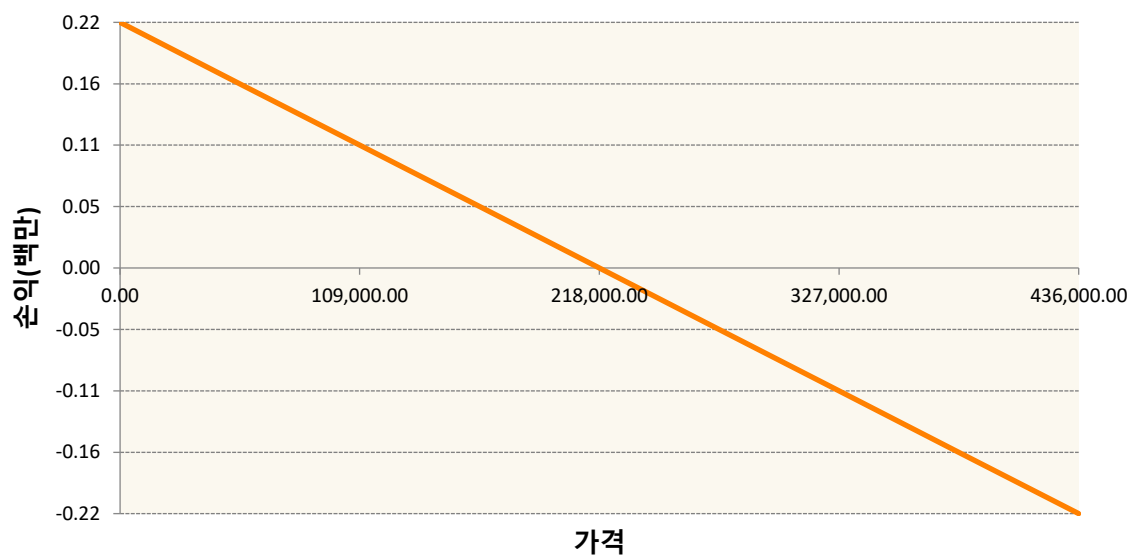
KR41ERV10003-2024-01 DL이앤씨개별선물



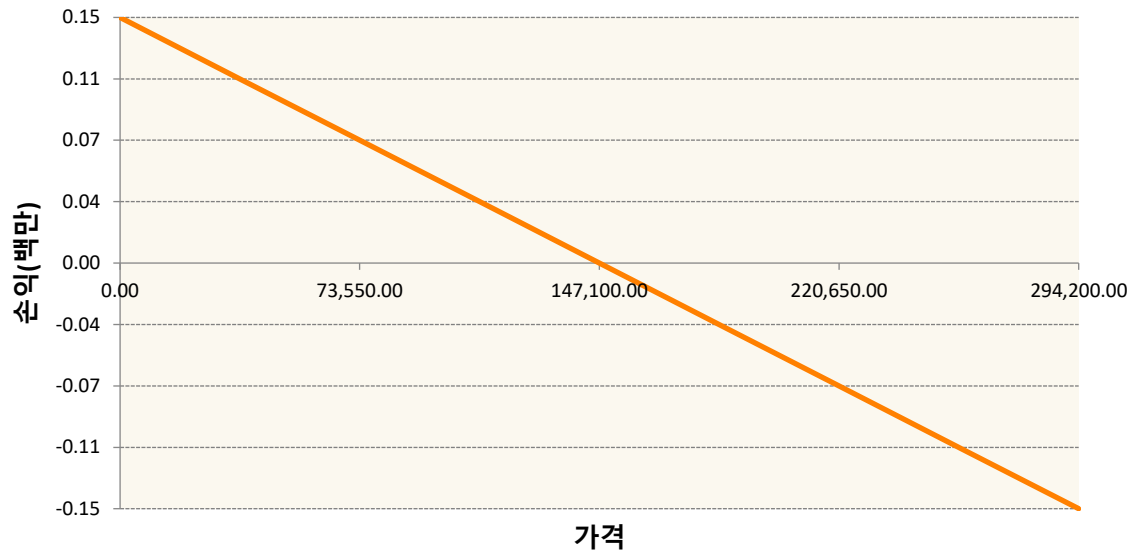
KR41FMV10001-2024-01 엘앤에프개별선물



KR41G4V10004-2024-01 한솔케미칼개별선물



KR41GCV10000-2024-01 이오테크닉스개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101V300 2024-03 코스피200지수선물	197
KR4113V100 2024-01 POSCO홀딩스개별선물	4
KR4116V100 2024-01 현대차개별선물	2
KR4120V100 2024-01 현대모비스개별선물	3
KR4139V100 2024-01 HD한국조선해양개별선물	2
KR4150V100 2024-01 SK하이닉스개별선물	9
KR4156V100 2024-01 NAVER개별선물	2
KR41C6V100 2024-01 아모레퍼시픽개별선물	2
KR41CFV100 2024-01 카카오개별선물	2
KR41CNV100 2024-01 포스코DX개별선물	5
KR41CPV100 2024-01 셀트리온개별선물	2
KR41DBV100 2024-01 LIG넥스원개별선물	3
KR41E5V100 2024-01 넷마블개별선물	1
KR41E8V100 2024-01 포스코퓨처엠개별선물	5
KR41ECV100 2024-01 HDC현대산업개발개별선물	2
KR41EFV100 2024-01 JYP Ent.개별선물	2
KR41EKV100 2024-01 DB하이텍개별선물	0.28
KR41ERV100 2024-01 DL이앤씨개별선물	1
KR41FMV100 2024-01 엘앤에프개별선물	6
KR41G4V100 2024-01 한솔케미칼개별선물	1
KR41GCV100 2024-01 이오테크닉스개별선물	2

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

(단위:백만원)

328

공시일	2023-12-21
기준일	2023-12-20

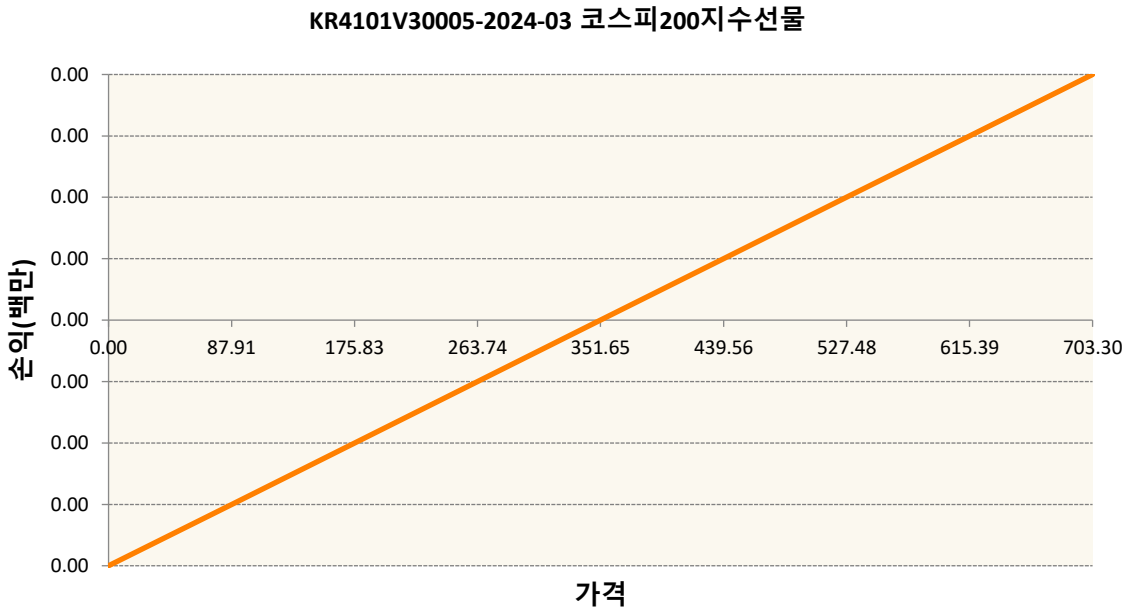
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

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	3,165	0	3,165	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101V30005		2024-03 코스피200지수선물					252
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-252	-252	-252	-252	-252	-252	-252
-5.33%	-168	-168	-168	-168	-168	-168	-168
-2.67%	-84	-84	-84	-84	-84	-84	-84
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	84	84	84	84	84	84	84
5.33%	168	168	168	168	168	168	168
8.00%	252	252	252	252	252	252	252

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

(단위:백만원)

233

공시일	2023-12-21
기준일	2023-12-20

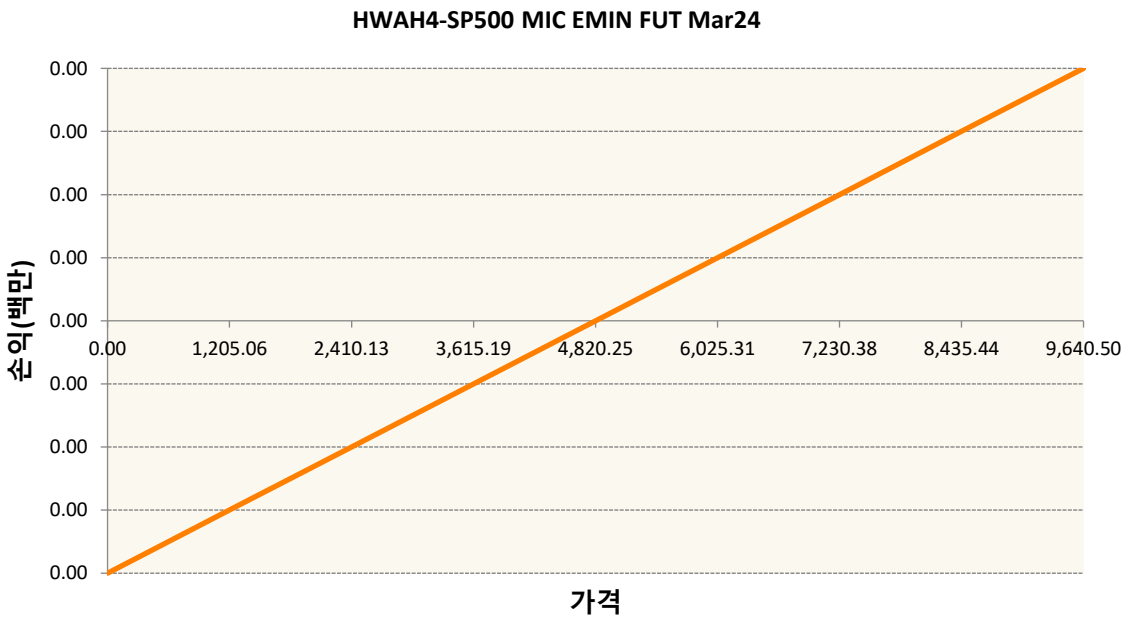
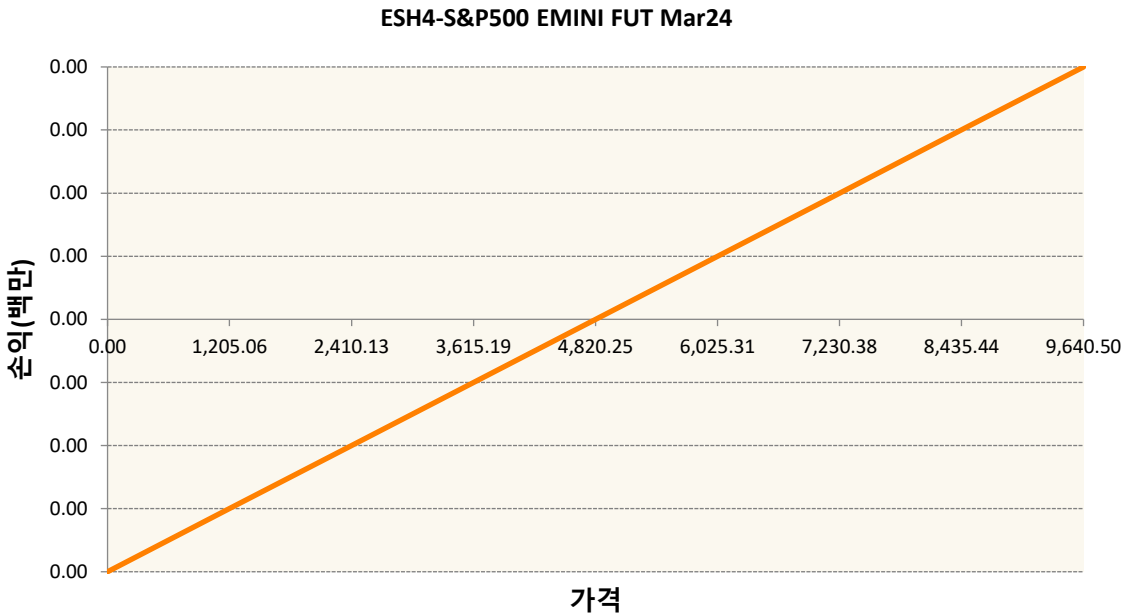
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

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	318	0	318	
누계	유가증권	선물	1,903	0	1,903	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESH4	S&P500 EMINI FUT Mar24	25
HWAH4	SP500 MIC EMIN FUT Mar24	152

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	150

공시일	2023-12-21
기준일	2023-12-20

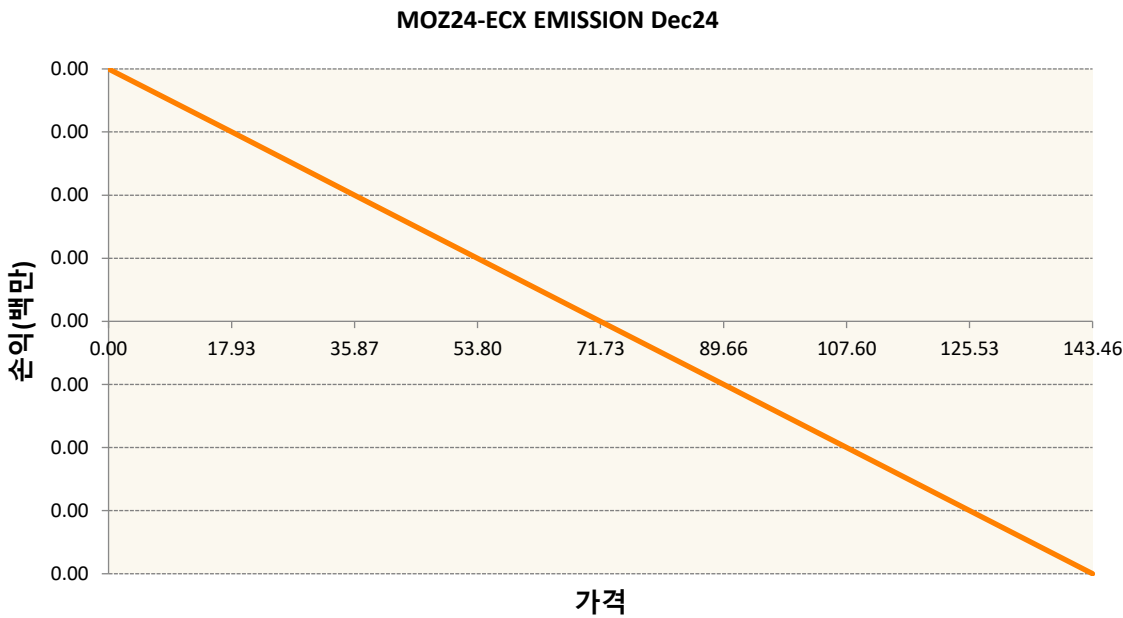
SOL유럽탄소배출권선물인버스ICE특별자산상

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	6,890	-6,890	
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	551
SWICEUACN ICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX	7

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

(단위:백만원)

1,089

공시일	2023-12-21
기준일	2023-12-20

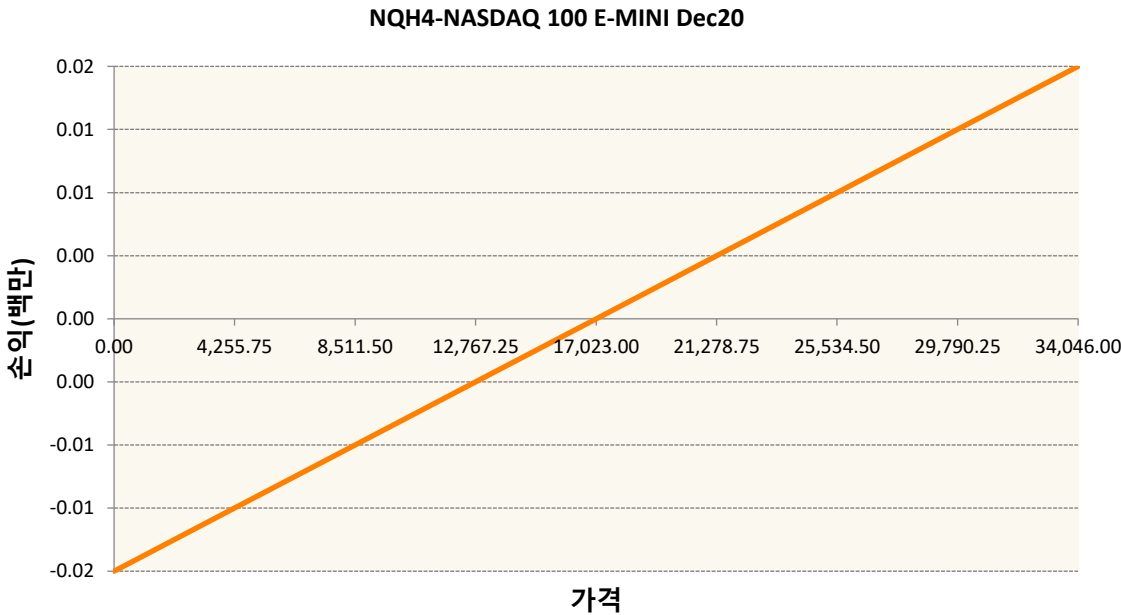
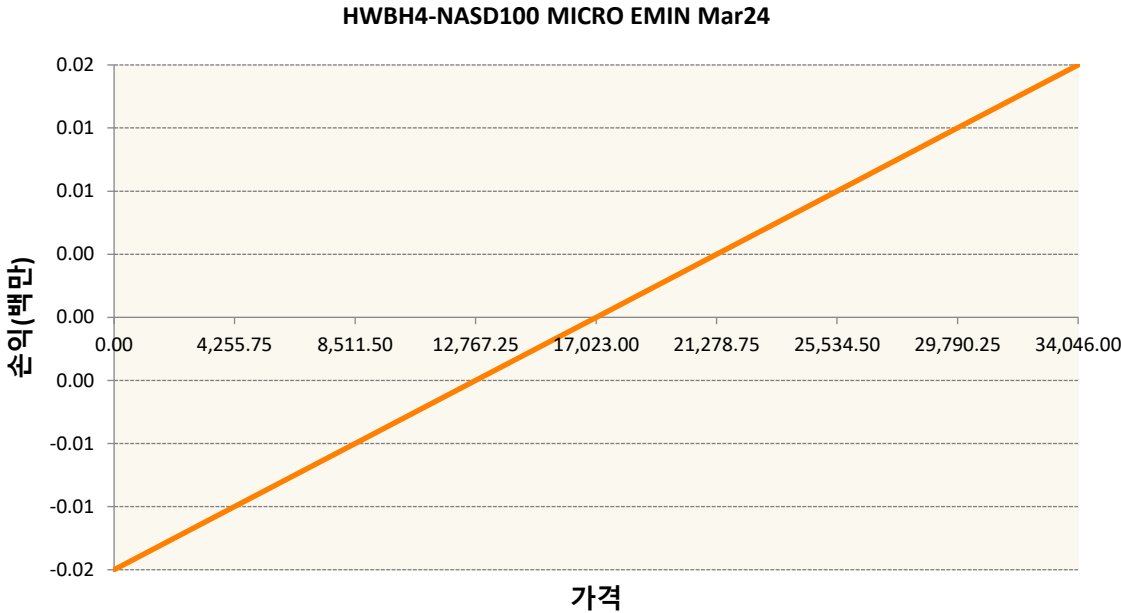
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

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	449	0	449	
누계	유가증권	선물	2,059	0	2,059	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
HWBH4	NASD100 MICRO EMIN Mar24		165
NQH4	NASDAQ 100 E-MINI Dec20		36

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

공시일	2023-12-21
기준일	2023-12-20

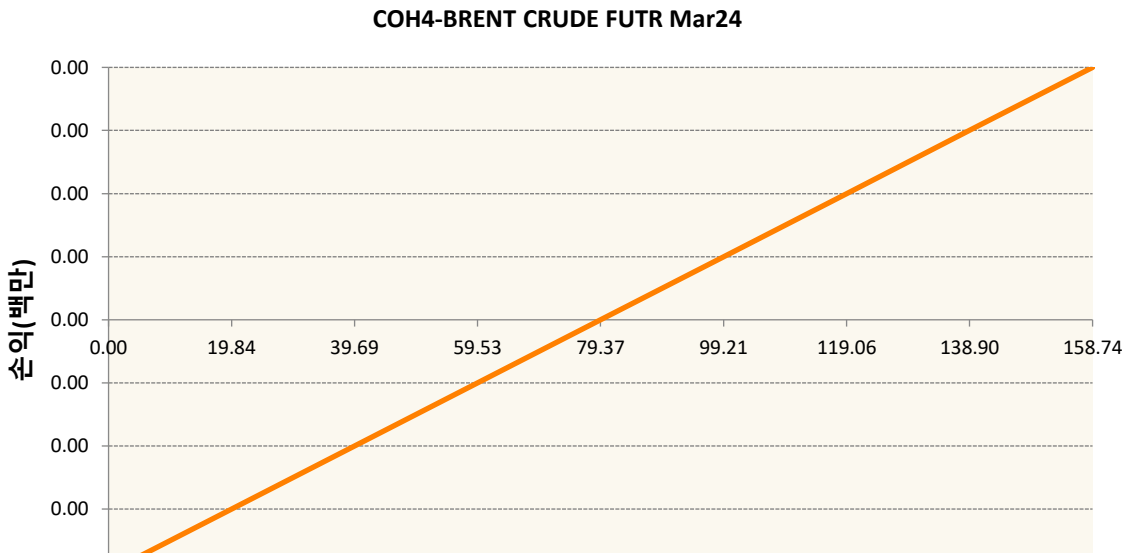
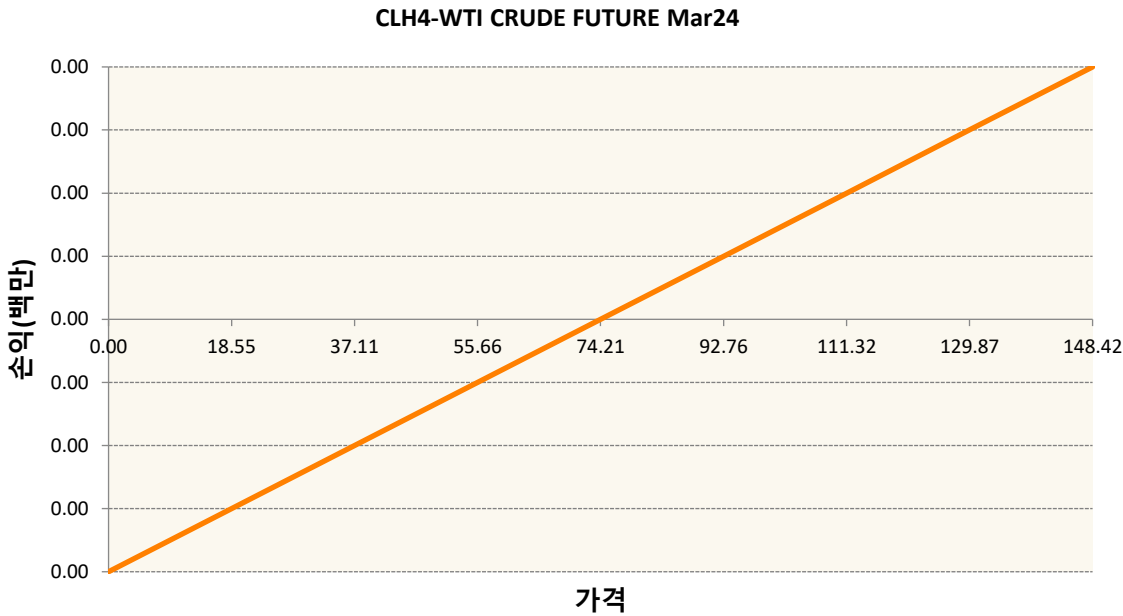
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

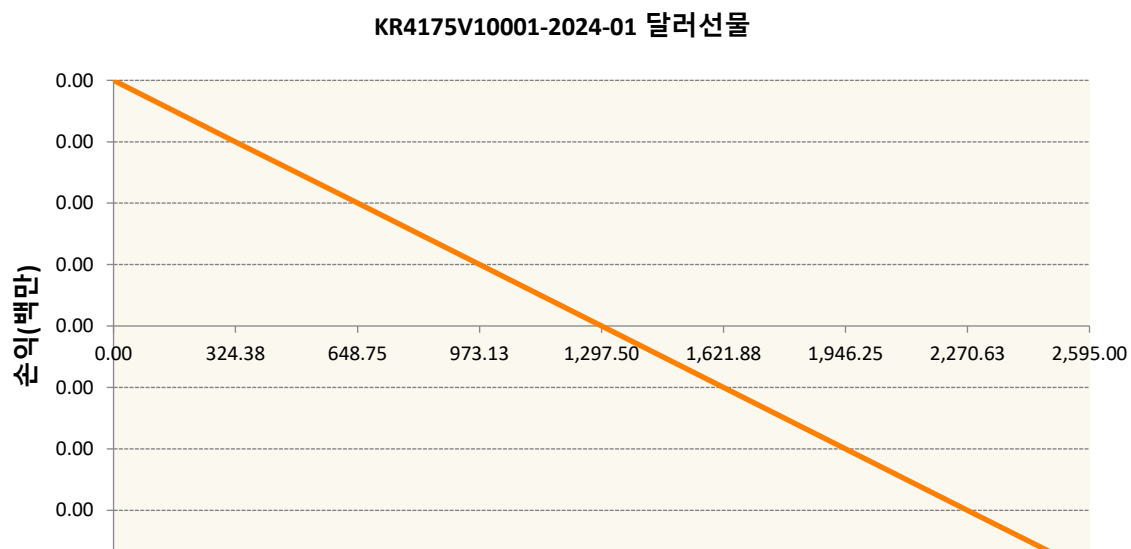
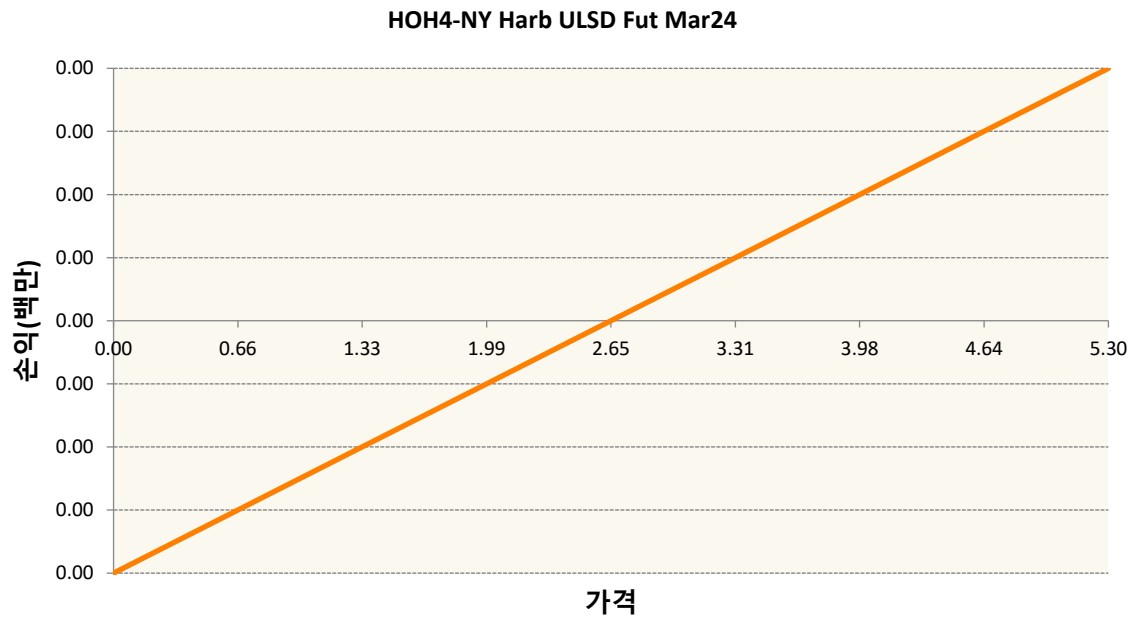
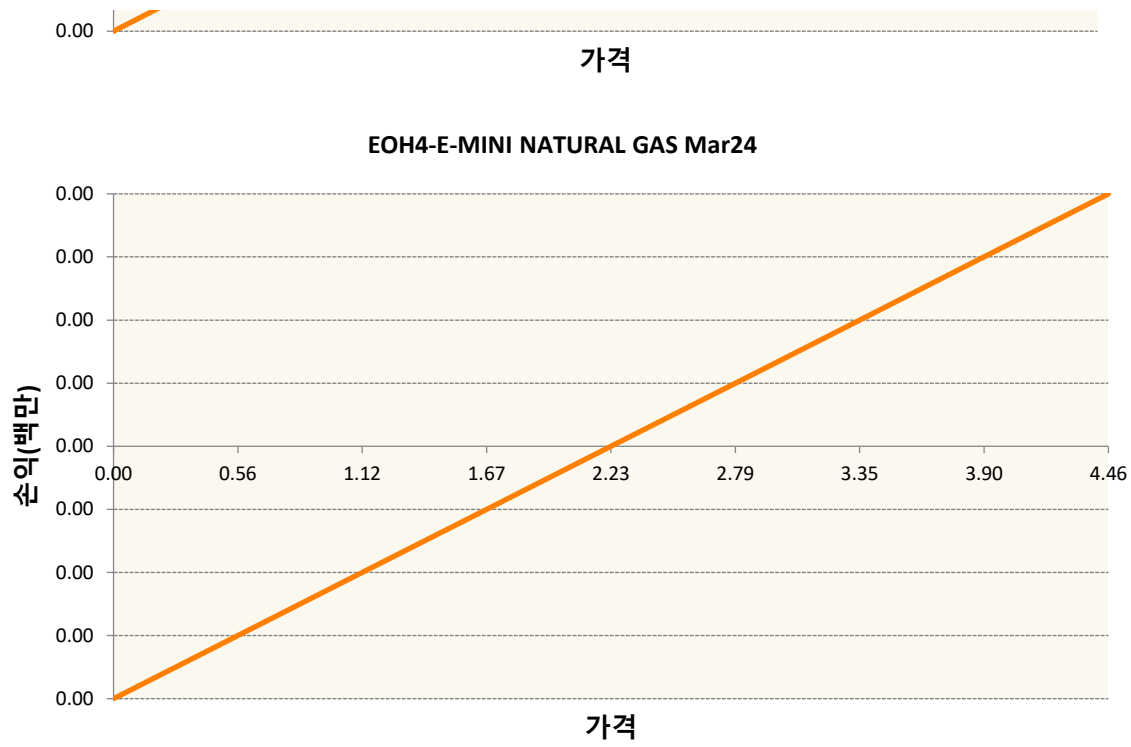
1. 계약금액

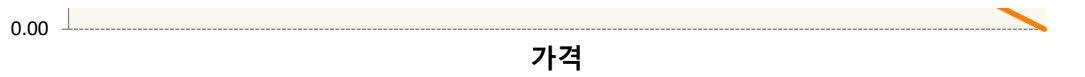
(단위:백만원)

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	26	-26	장내
누계	선물	유가증권	292	0	292	
누계	유가증권	선물	882	0	882	
누계	통화	선물	0	247	-247	장내

2. 만기시점의 손익구조

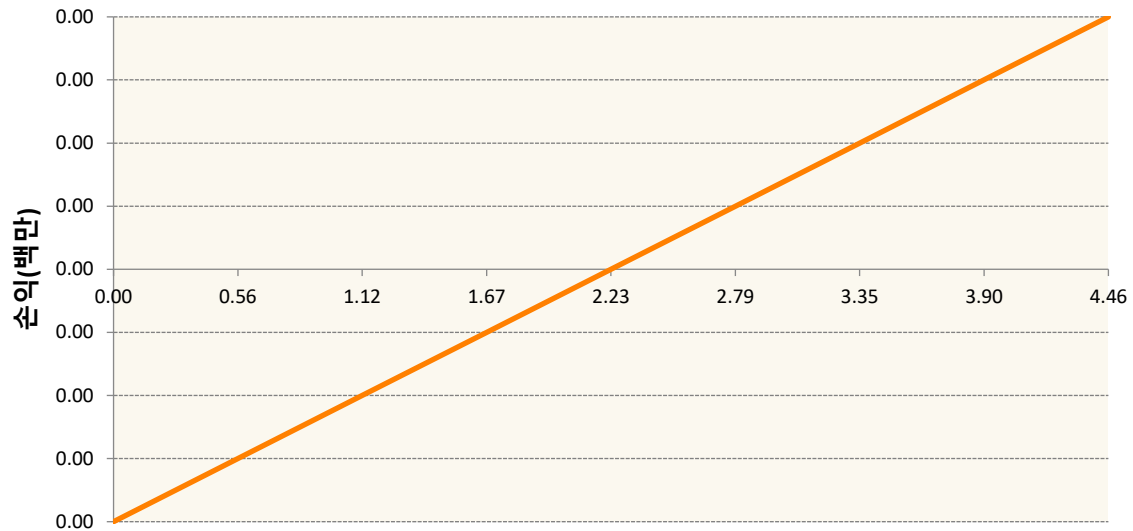






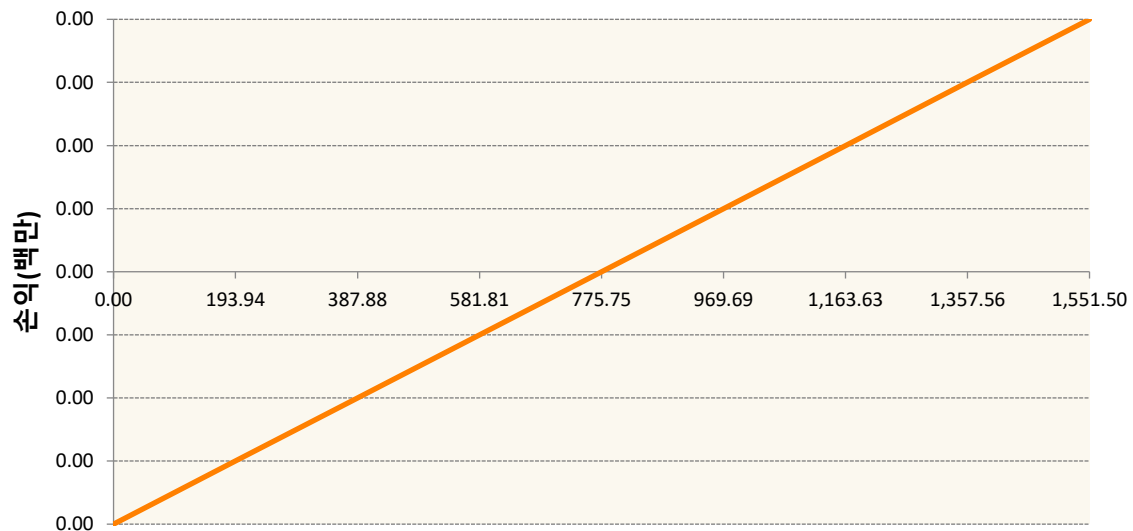
가격

NGH24-NATURAL GAS FUTR Mar24



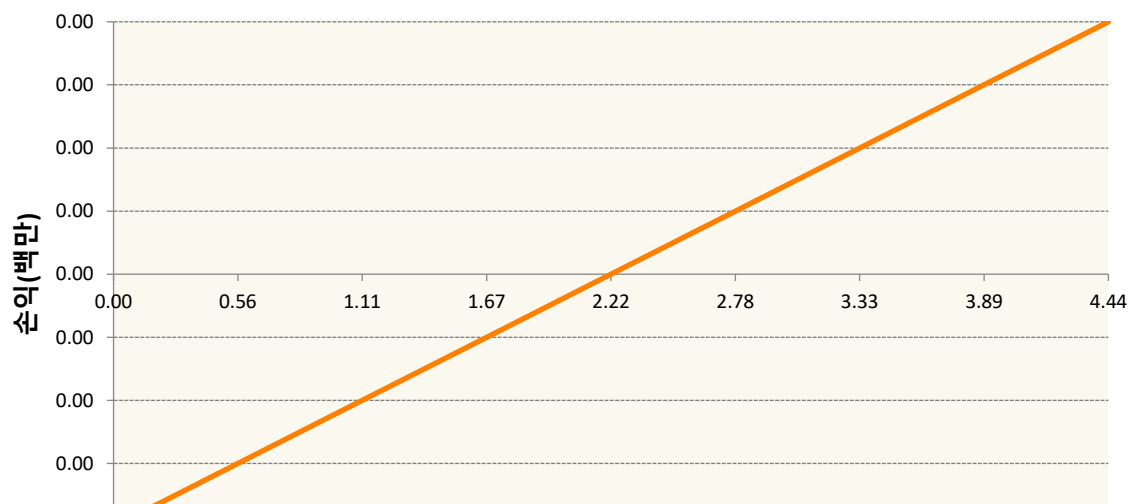
가격

QSH4-Low Su Gasoil G Mar24



가격

XBH4-GASOLINE RBOB FUT Mar24



손익(백만)

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
CLH4	WTI CRUDE FUTURE Mar24	23
COH4	BRENT CRUDE FUTR Mar24	25
EOH4	E-MINI NATURAL GAS Mar24	2
HOH4	NY Harb ULSD Fut Mar24	12
KR4175V100 2024-01 달러선물		20
NGH24	NATURAL GAS FUTR Mar24	14
QSH4	Low Su Gasoil G Mar24	8
XBH4	GASOLINE RBOB FUT Mar24	10

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	228