

공시일	2023-12-22
기준일	2023-12-21

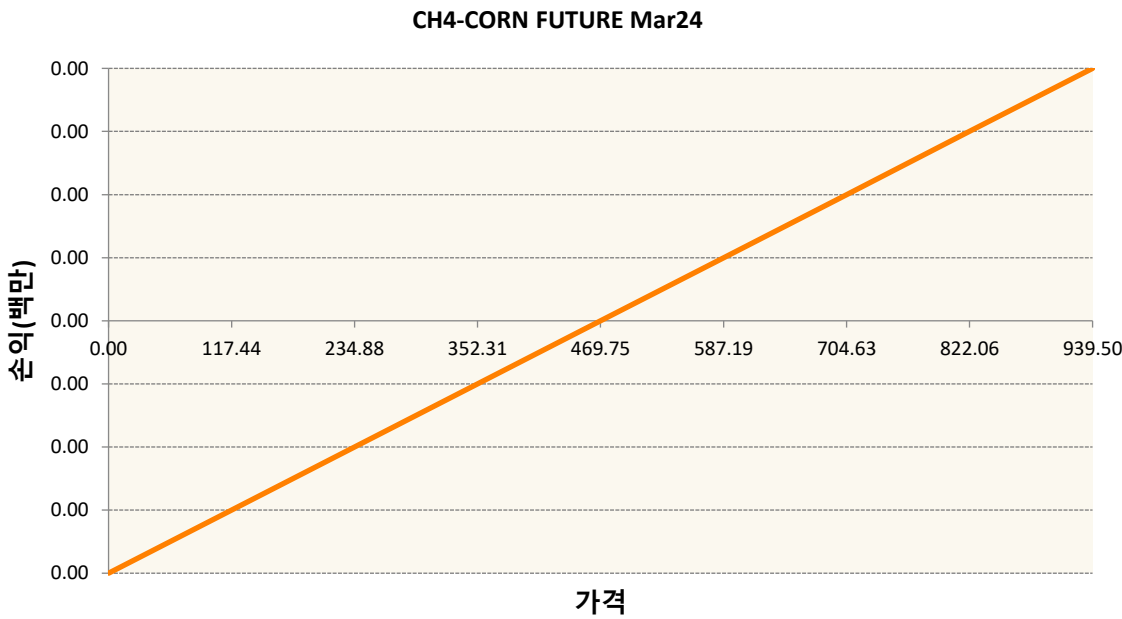
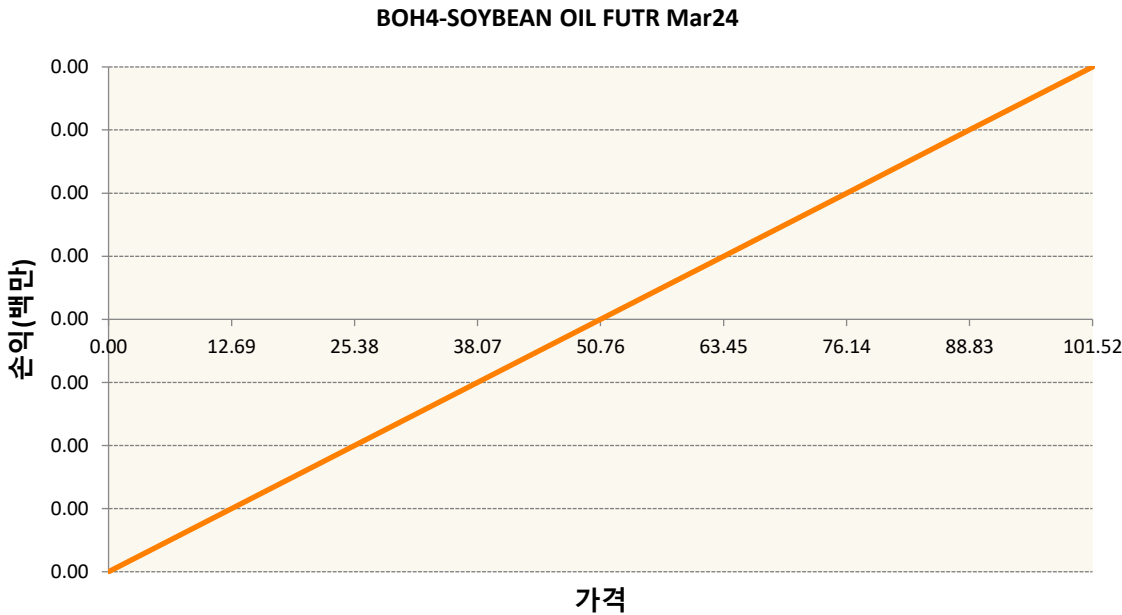
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

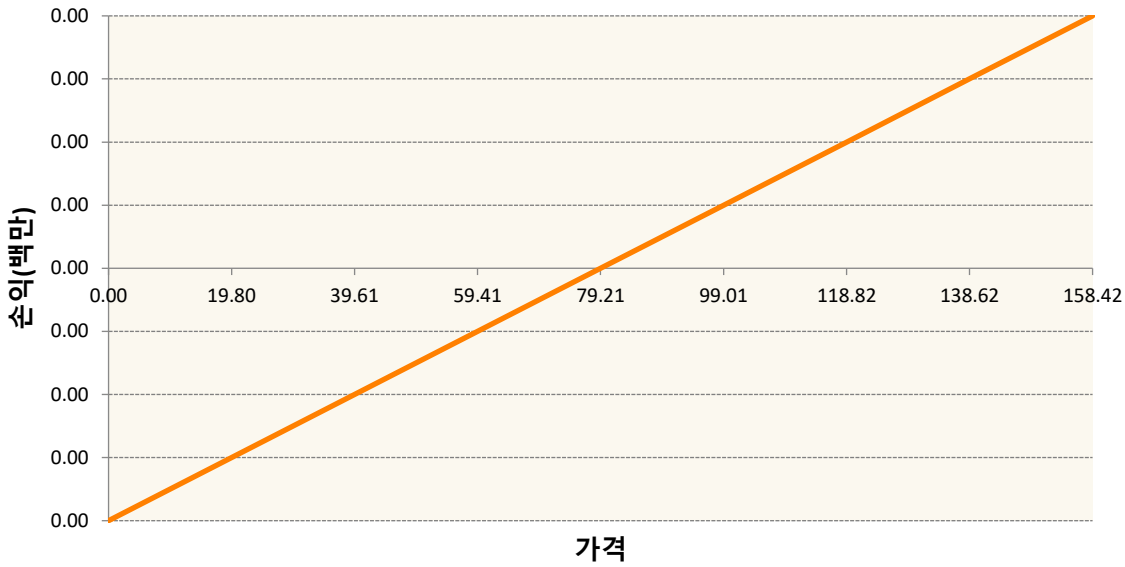
(단위:USD 백만)

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	4,685	0	4,685	
누계	통화	선물	0	482	-482	장내

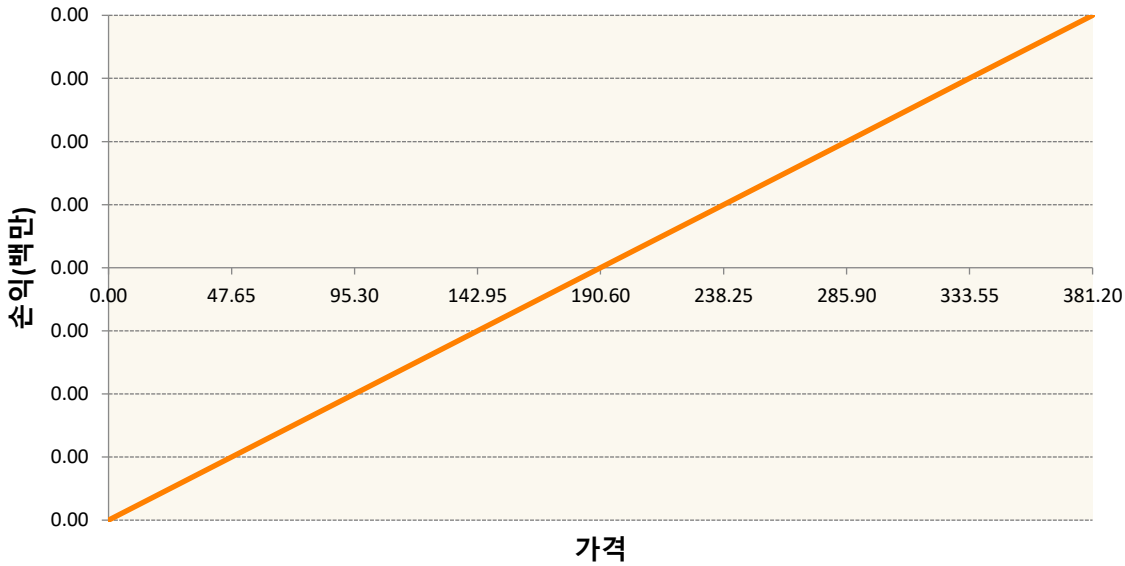
2. 만기시점의 손익구조



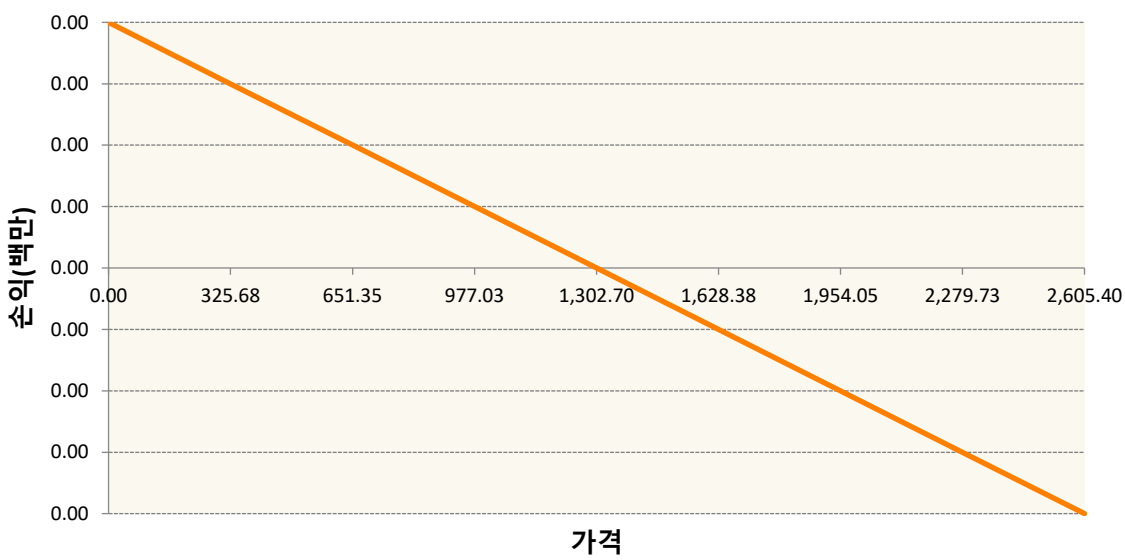
CTH4-COTTON NO.2 FUTR Mar24



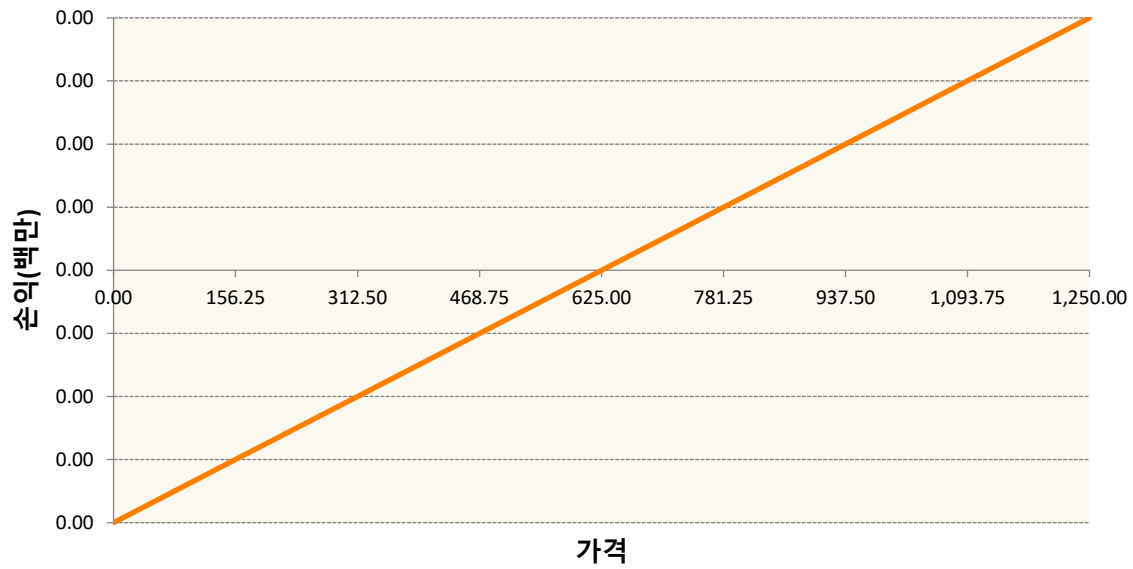
KCH4-COFFEE 'C' FUTURE Mar24



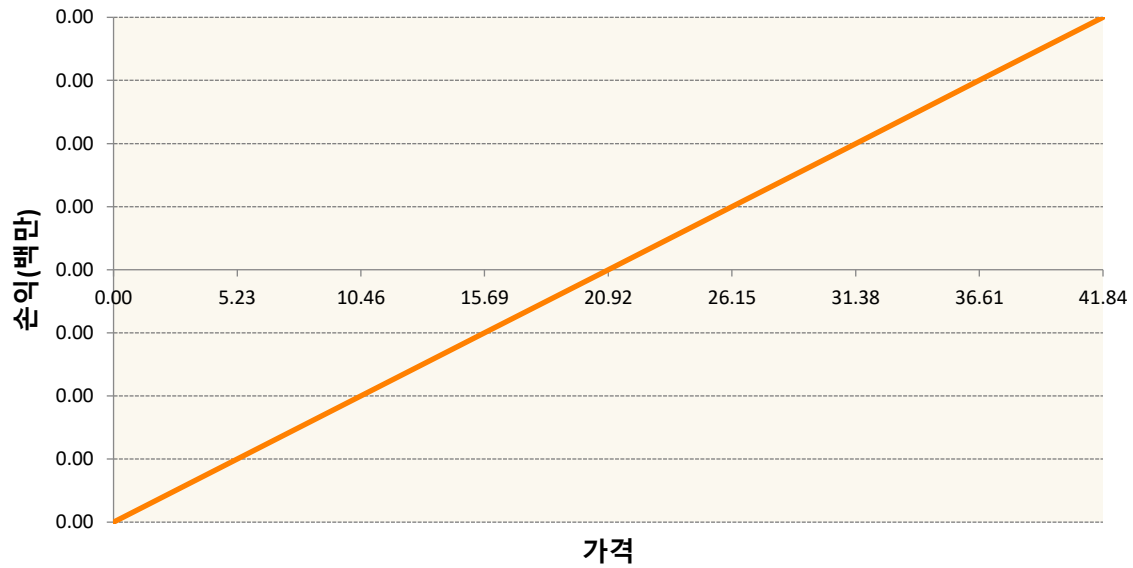
KR4175V10001-2024-01 달러선물



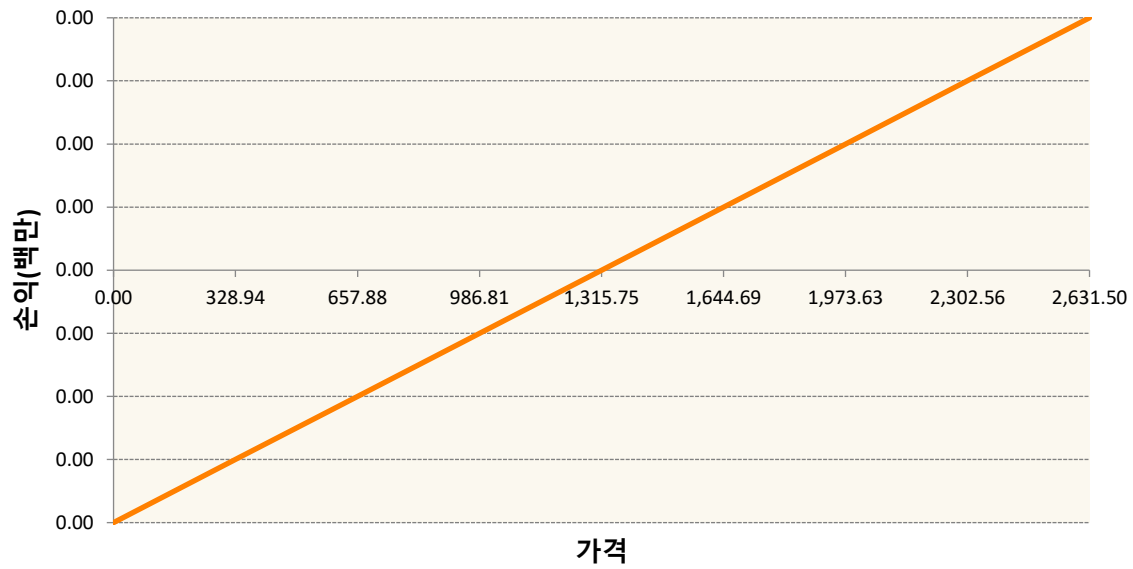
KWH4-KC HRW WHEAT FUT Mar24



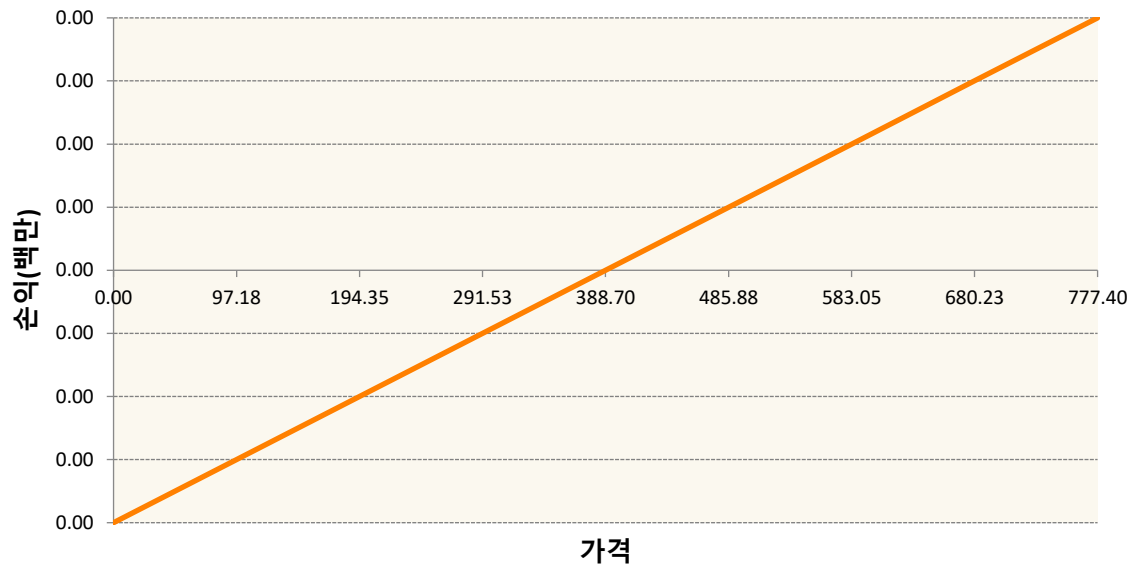
SBH4-Sugar #11 (WORLD) Mar24



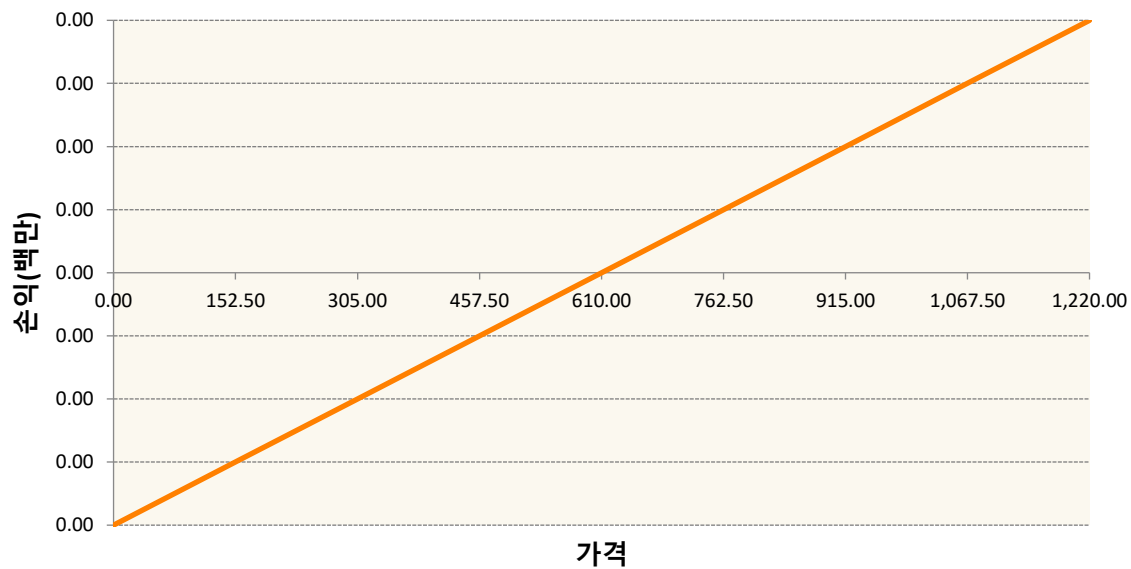
SH4-SOYBEAN FUTURE Mar24



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	2023-12-22
기준일	2023-12-21

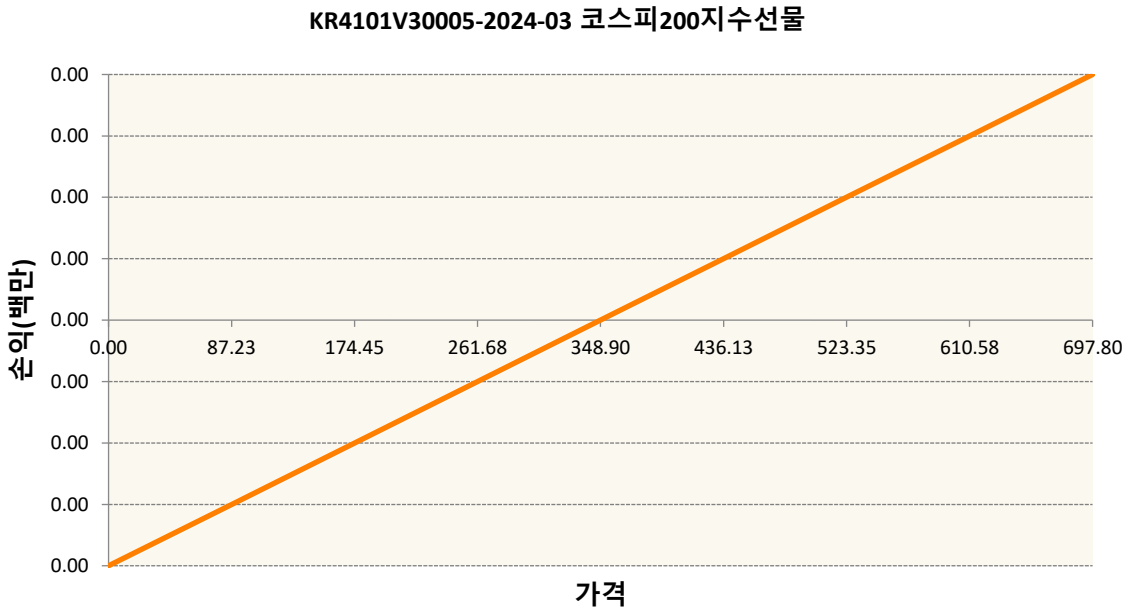
스마트인덱스모

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	1,570	0	1,570	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	2023-12-22
기준일	2023-12-21

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	303
-----------------------------	-----

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

266

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2023-12-22
기준일	2023-12-21

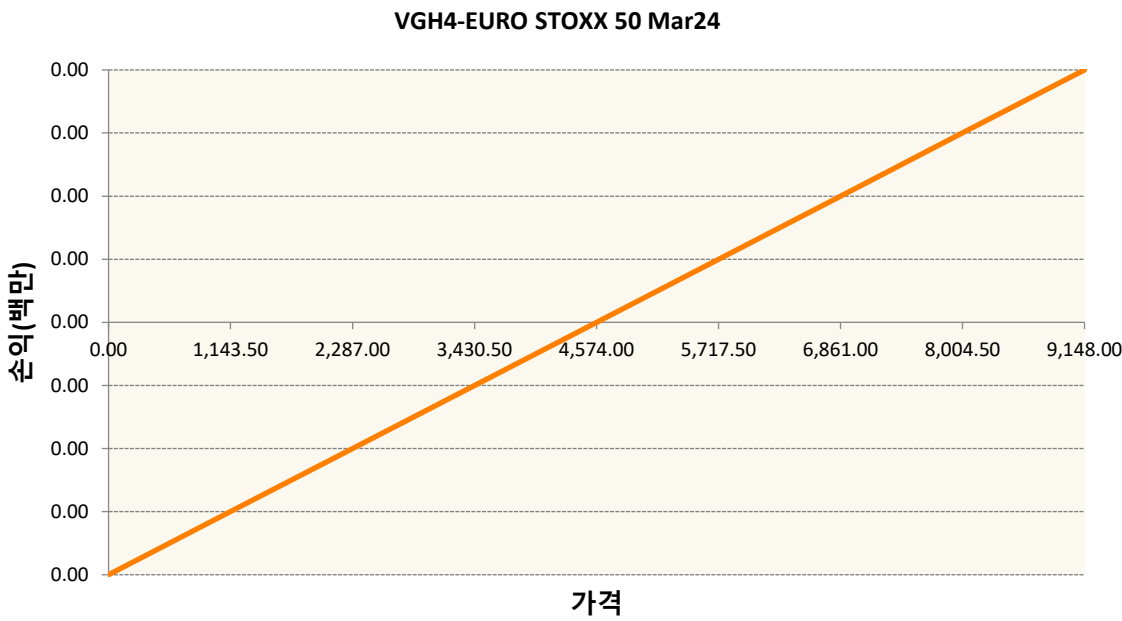
유로인덱스모(주식-파생형)

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	428	0	428	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)

84

공시일	2023-12-22
기준일	2023-12-21

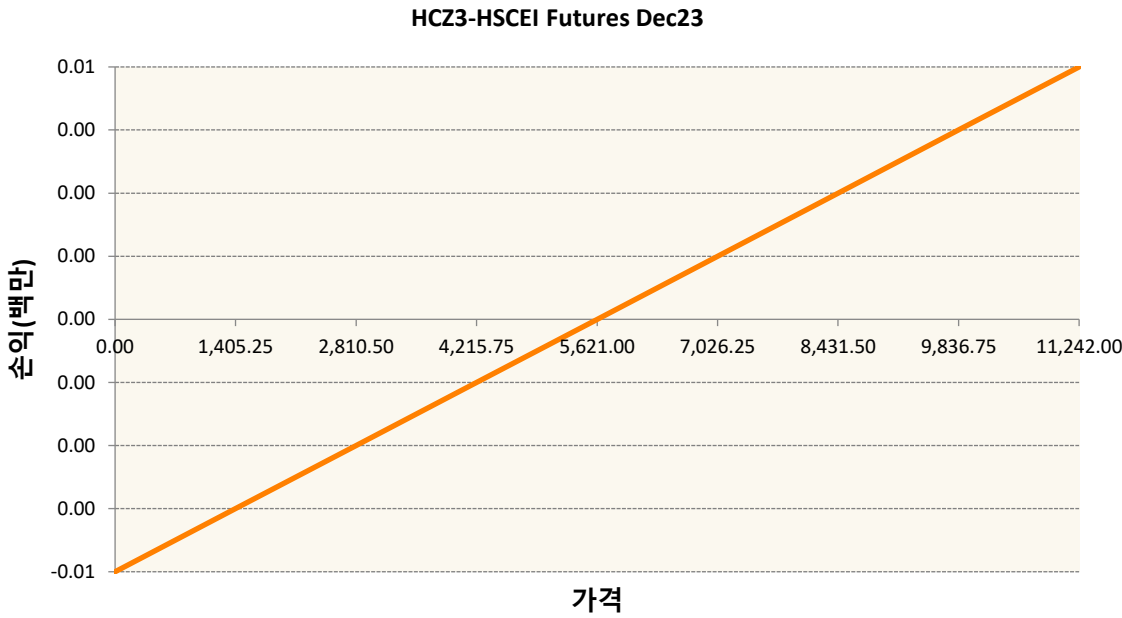
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,119	0	1,119	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCZ3	HSCEI Futures Dec23	90
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

130

공시일	2023-12-22
기준일	2023-12-21

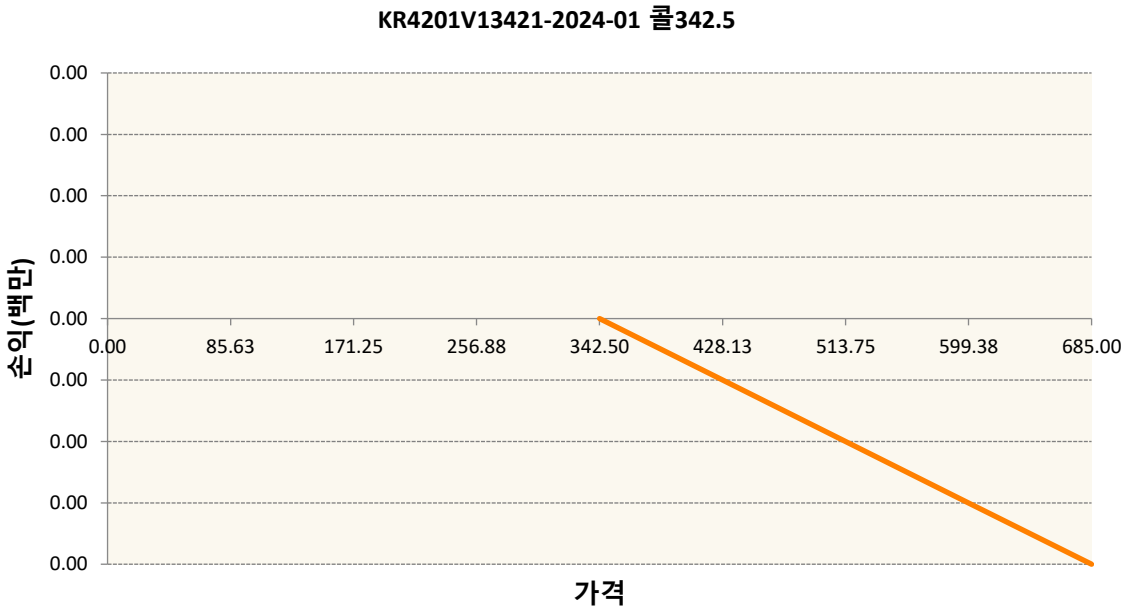
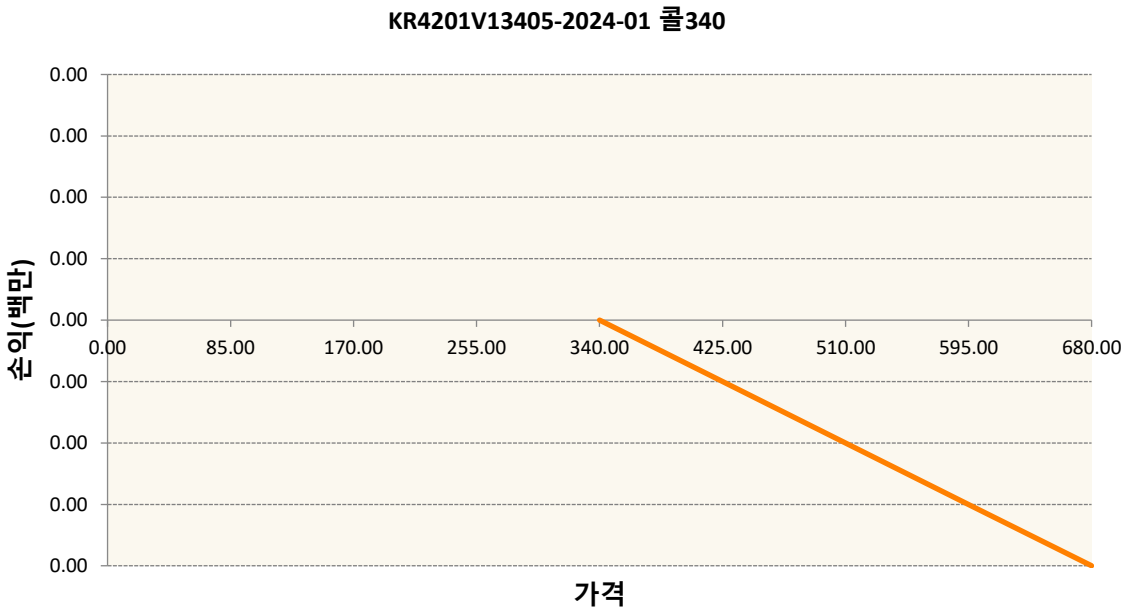
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

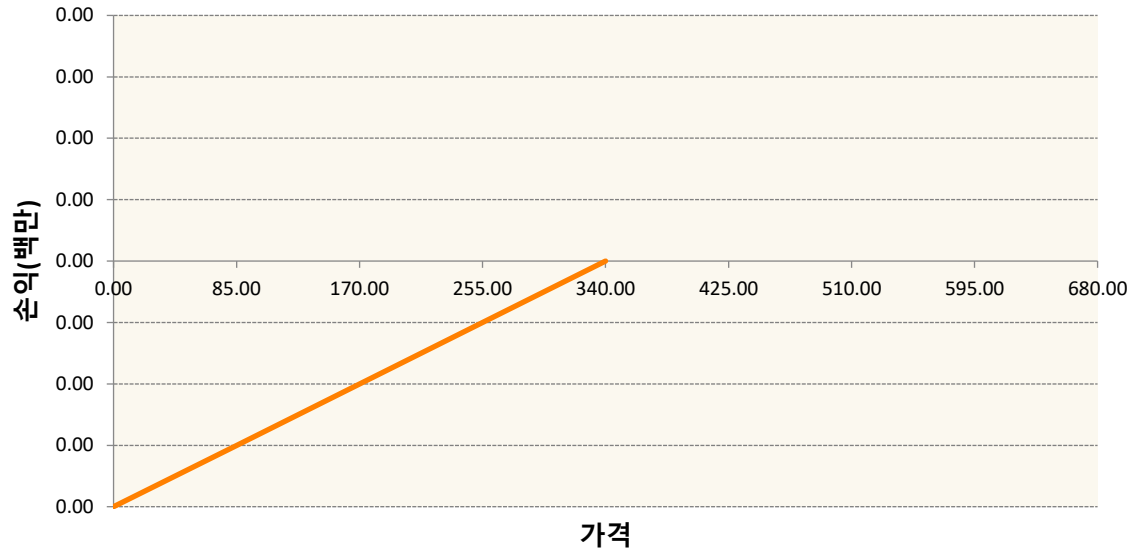
(단위:백만원)

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				1,121
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	592	577	560	541	520	499	476
-5.33%	513	487	460	433	405	376	347
-2.67%	349	317	286	254	223	191	159
0%	85	57	29	0	-29	-59	-89
2.67%	-261	-279	-299	-321	-343	-368	-393
5.33%	-656	-665	-676	-690	-705	-722	-741
8.00%	-1,074	-1,077	-1,082	-1,089	-1,098	-1,109	-1,121
KR4201V13421			2024-01 콜342.5				1,873
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	910	888	863	834	802	768	732
-5.33%	803	762	720	675	629	583	535
-2.67%	563	510	456	402	348	294	240
0%	155	104	52	0	-53	-106	-159
2.67%	-405	-441	-480	-522	-565	-610	-656
5.33%	-1,066	-1,085	-1,108	-1,135	-1,165	-1,199	-1,234
8.00%	-1,775	-1,783	-1,794	-1,809	-1,827	-1,849	-1,873
KR4301V13403			2024-01 풋340				446
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-429	-431	-433	-435	-438	-442	-446
-5.33%	-213	-219	-226	-233	-241	-249	-257
-2.67%	-52	-63	-73	-83	-93	-104	-114
0%	22	15	8	0	-8	-17	-25

2.67%	40	38	36	32	28	24	19
5.33%	43	42	42	41	40	38	36
8.00%	43	43	43	43	42	42	41

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

(단위:백만원)

3,483

공시일	2023-12-22
기준일	2023-12-21

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	1,960	0	1,960	

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	2023-12-22
기준일	2023-12-21

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	4,591	0	4,591	

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	2023-12-22
기준일	2023-12-21

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	17,866	0	17,866	
누계	통화	선도	0	16,999	-16,999	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213D9R KRW/USD 29-12-23E	506
FXW213DAT KRW/USD 31-01-24E	186
FXW213DBV KRW/USD 29-02-24E	641
FXW213DCB KRW/USD 31-01-24E	26
IE00BD8RGM75	

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

711

공시일	2023-12-22
기준일	2023-12-21

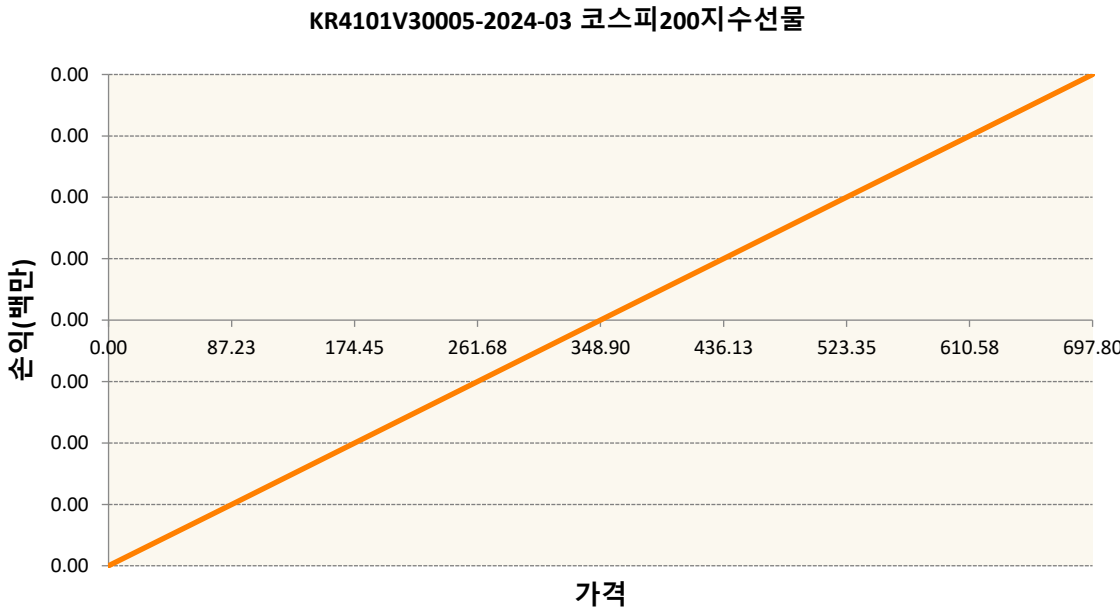
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

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	611	0	611	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	2023-12-22
기준일	2023-12-21

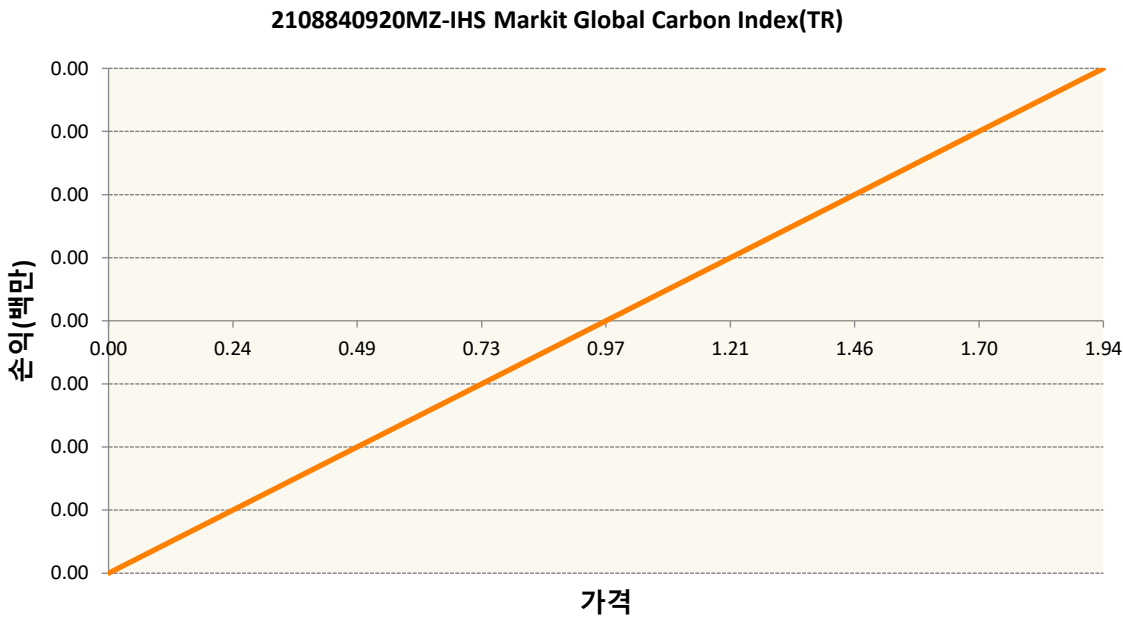
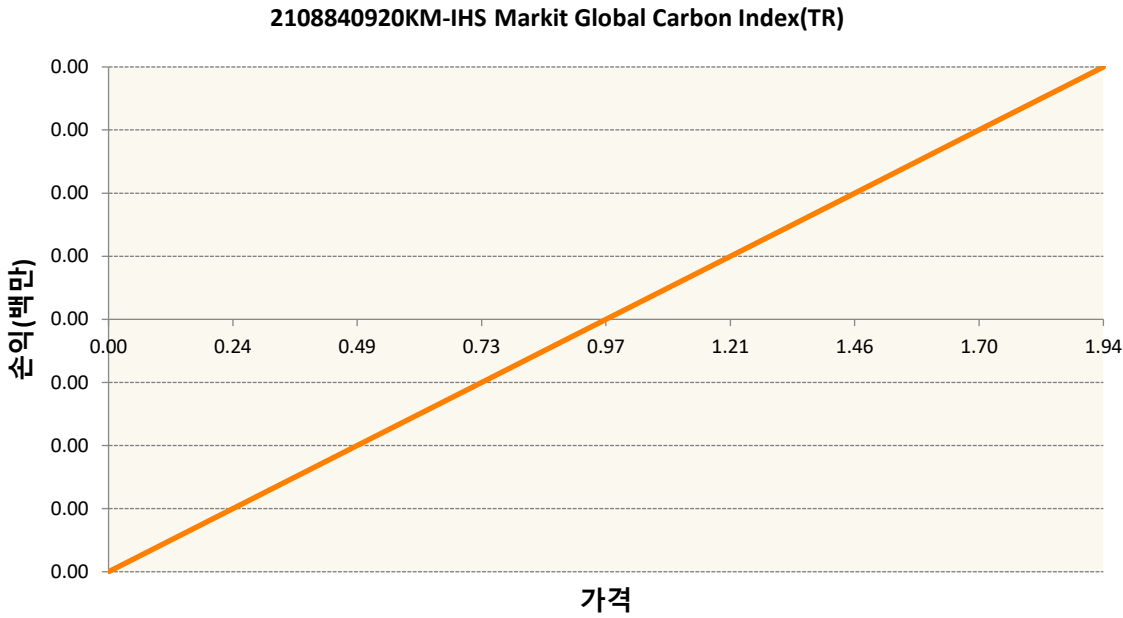
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

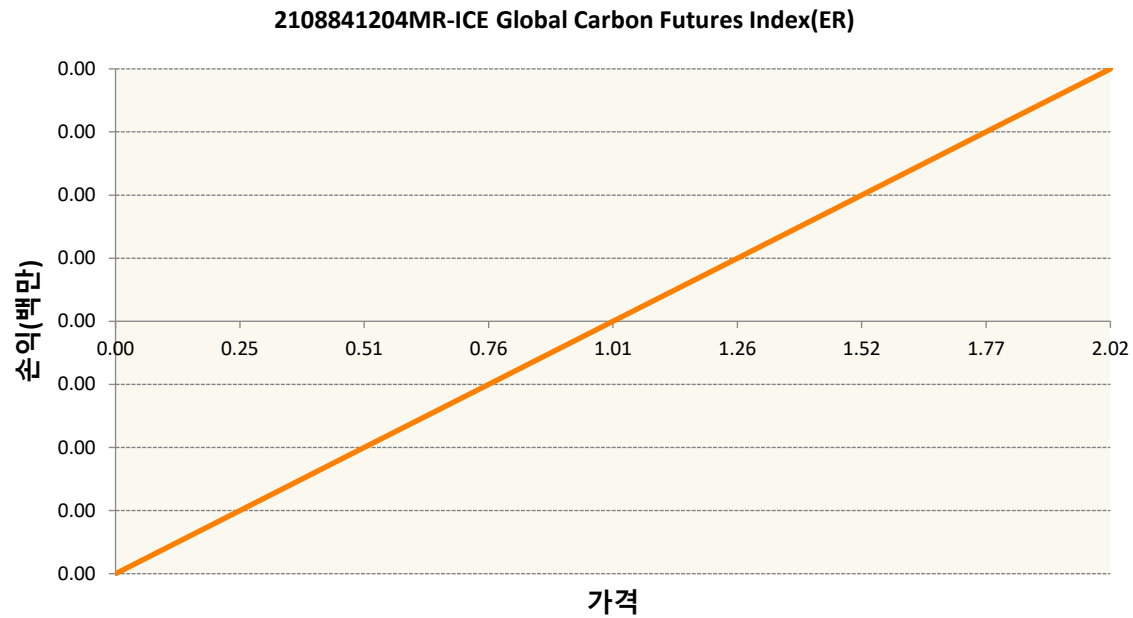
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	19,601	0	19,601	

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108840920IIHS Markit Global Carbon Index(TR)		978
2108840920IIHS Markit Global Carbon Index(TR)		196
2108841204IIICE Global Carbon Futures Index(ER)		391

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,991

공시일	2023-12-22
기준일	2023-12-21

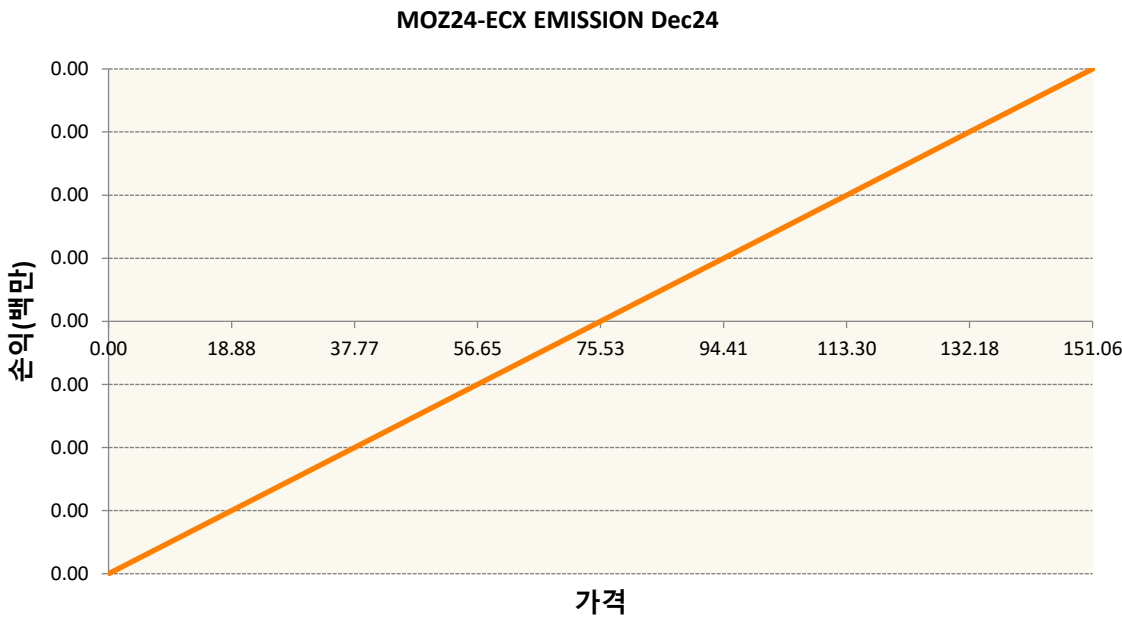
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	9,263	0	9,263	
누계	지수	스왑	479	0	479	장외
누계	통화	선도	0	1,441	-1,441	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213DBV KRW/EUR 28-12-23E	115
MOZ24 ECX EMISSION Dec24	741
SWICEUACN ICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX	5

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

(단위:백만원)

1,418

공시일	2023-12-22
기준일	2023-12-21

신한SOL차이나태양광CSI증권상장

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	1,011	-1,011	장외
누계	지수	스왑	4,370	0	4,370	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI00000 신한CSI Index 230622 (미래)	1
SWCSI00000 신한CSI Index 230622 (메리츠)	1
SWCSI00000 신한CSI Index 230922 (키움)	0.36
SWCSI00000 신한CSI Index 231013 (NH)	0.37

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

(단위:백만원)

3

공시일	2023-12-22
기준일	2023-12-21

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)	5
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 230116(메리츠)	8
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 230116(미래)	6
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 230427(키움)	2

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) (단위:백만원)
22

공시일	2023-12-22
기준일	2023-12-21

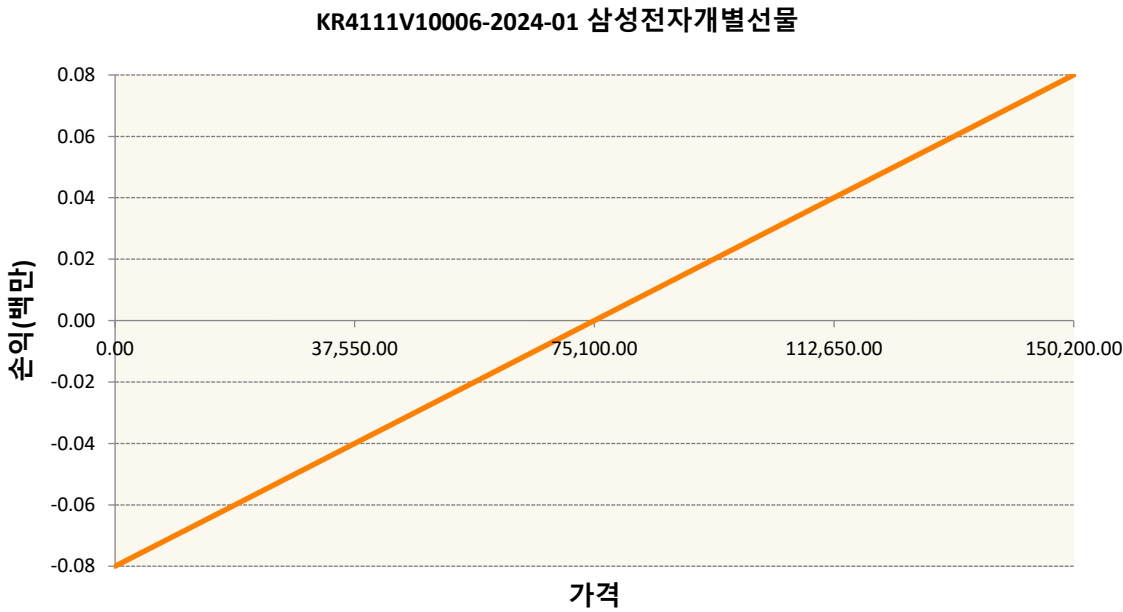
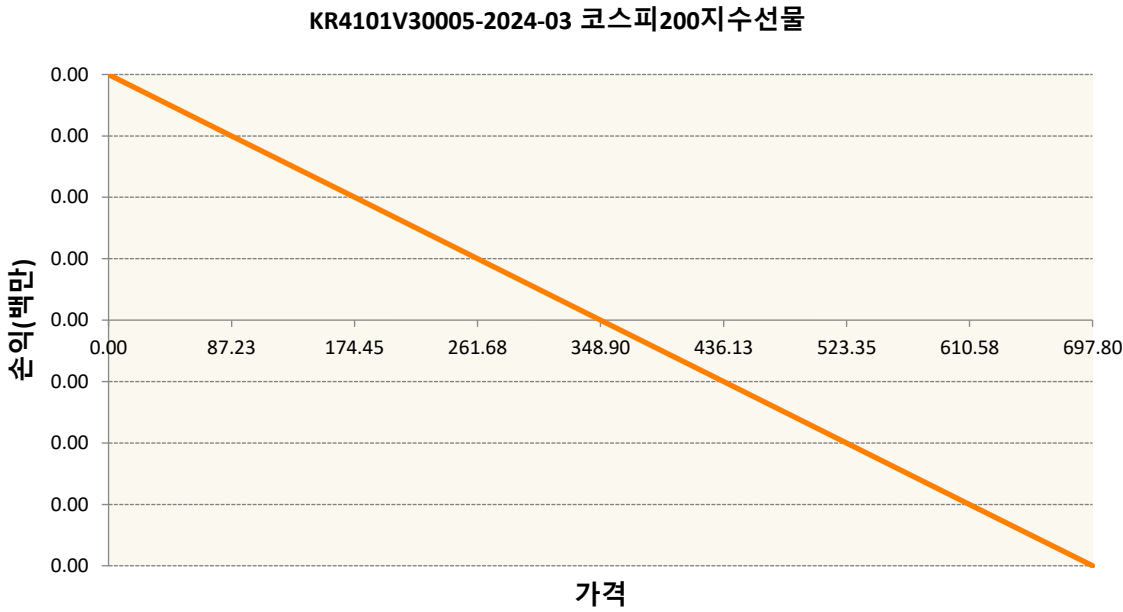
에퀴티알파일반사모혼합자산

1. 계약금액

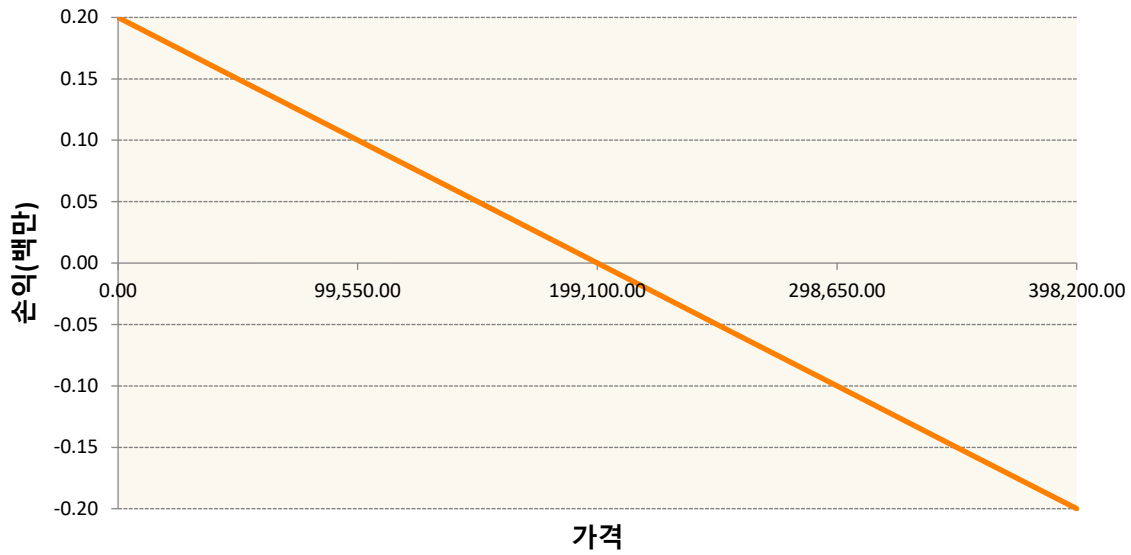
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	90	125	-34	장내
누계	유가증권	선물	184	3,124	-2,941	장내

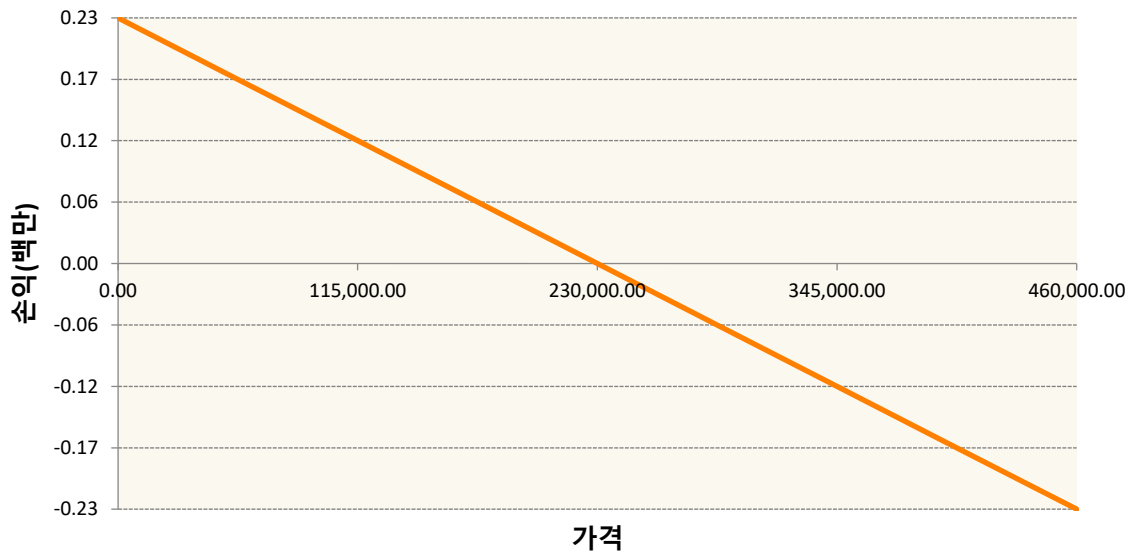
2. 만기시점의 손익구조



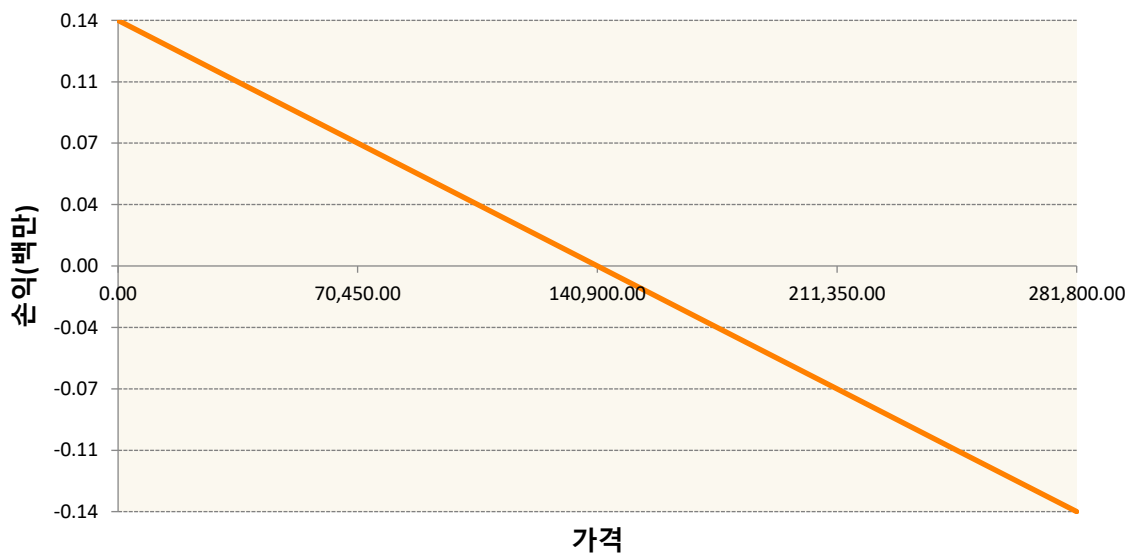
KR4116V10005-2024-01 현대차개별선물



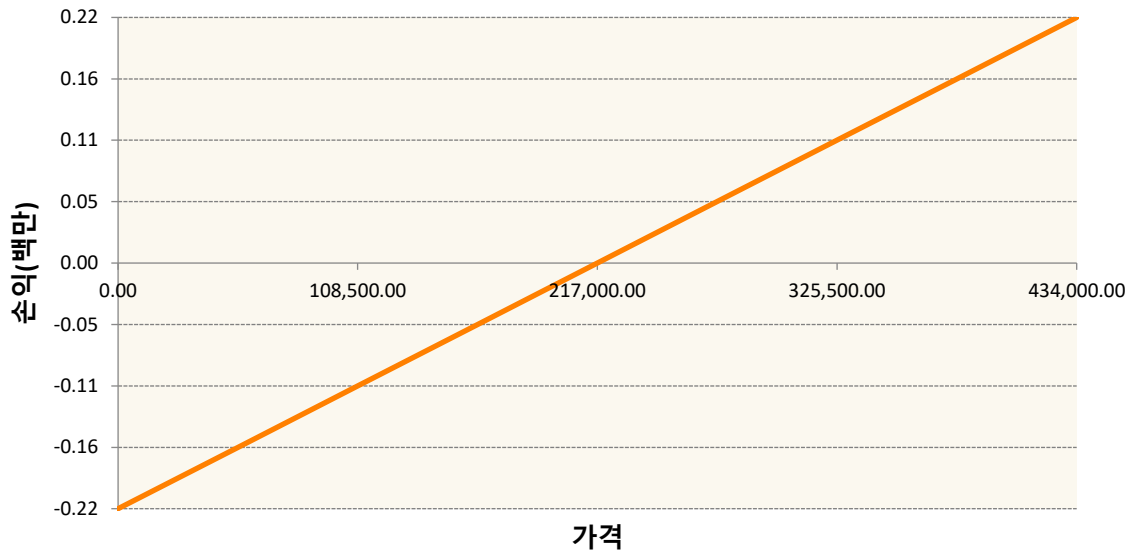
KR4120V10007-2024-01 현대모비스개별선물



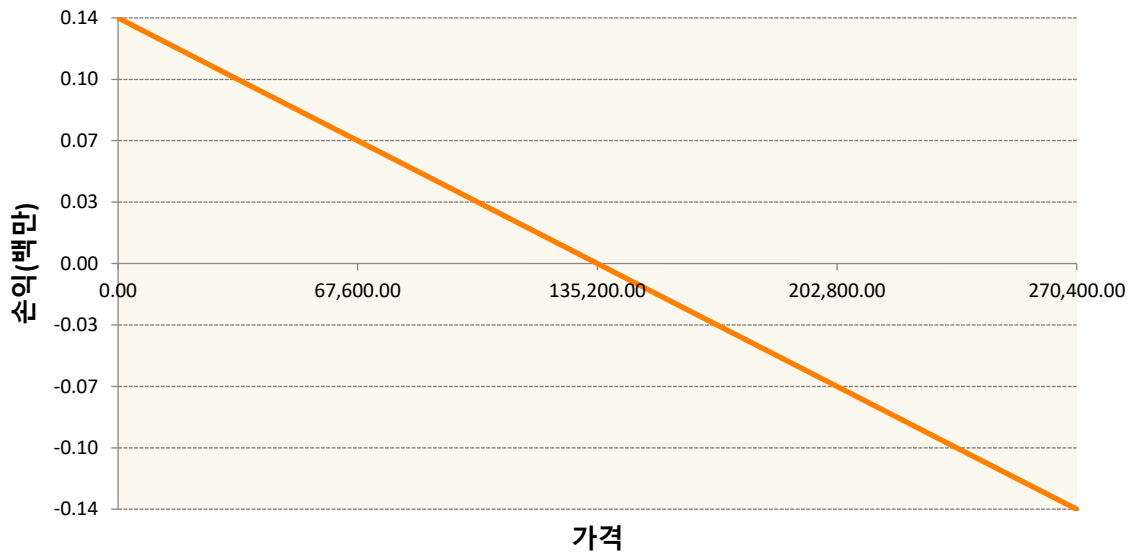
KR4150V10004-2024-01 SK하이닉스개별선물



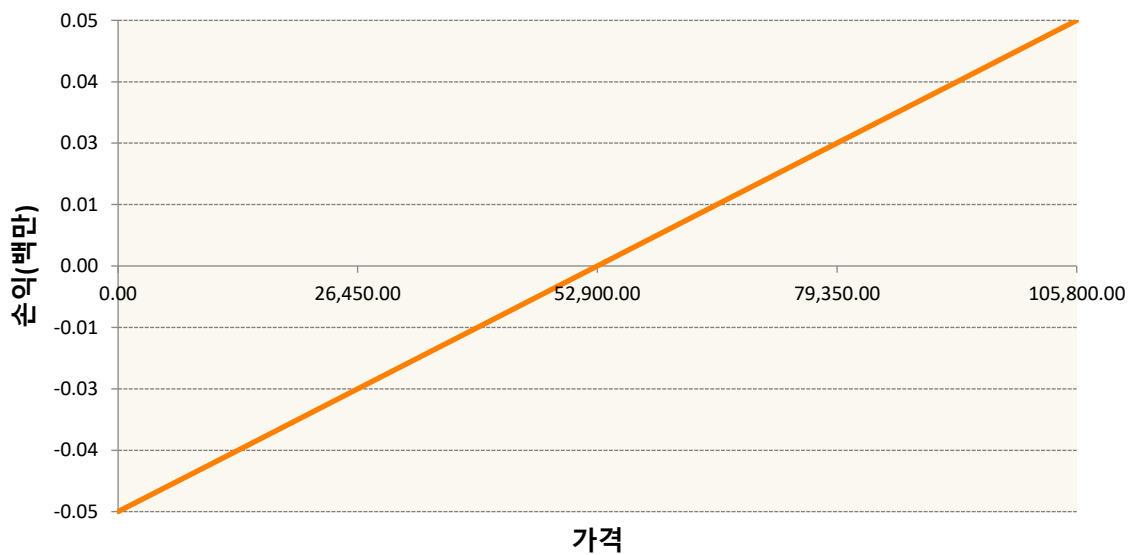
KR4156V10001-2024-01 NAVER개별선물



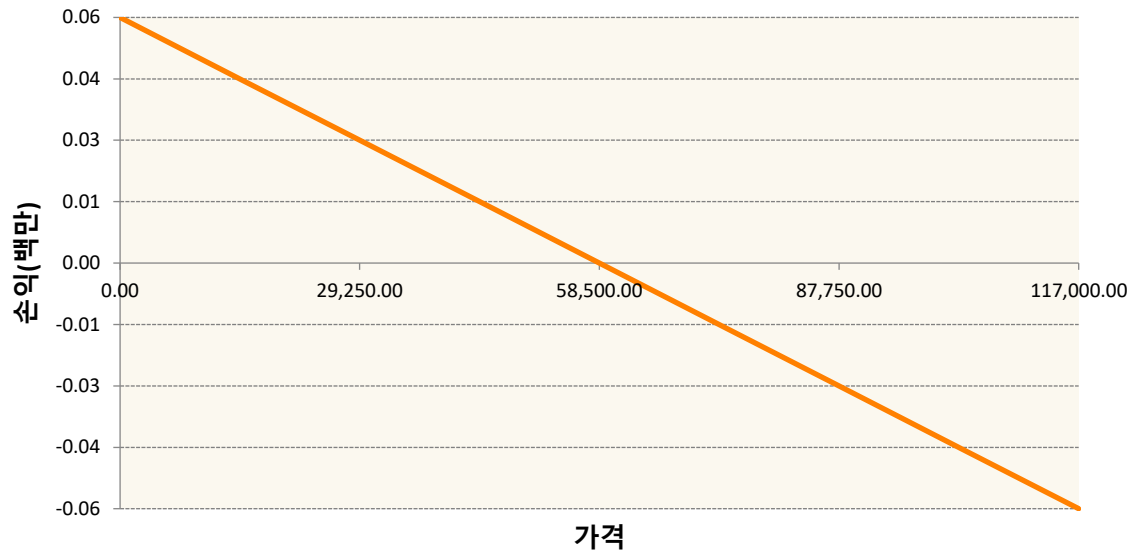
KR41C6V10003-2024-01 아모레퍼시픽개별선물



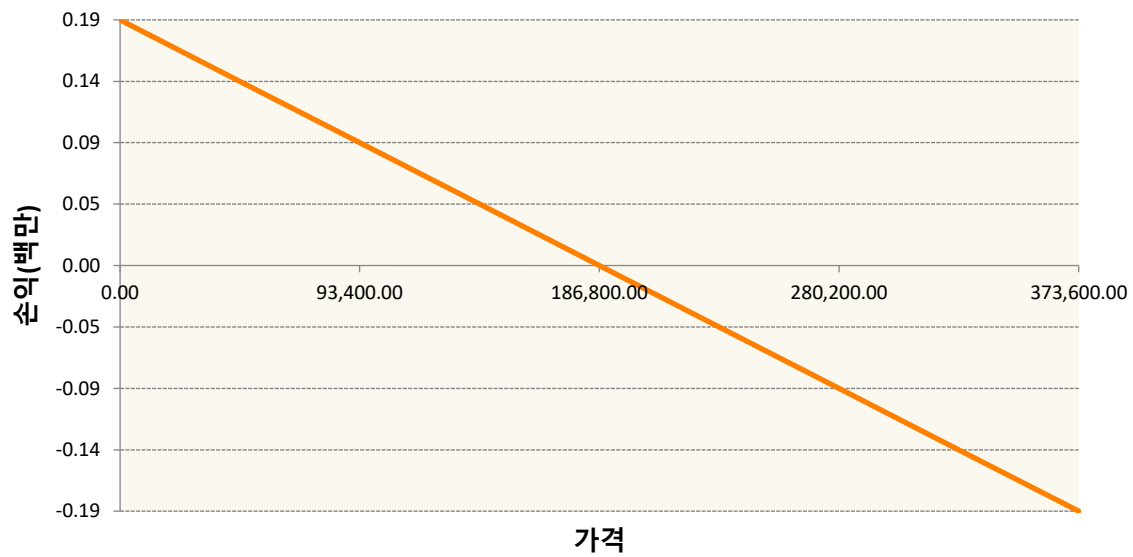
KR41CFV10002-2024-01 카카오개별선물



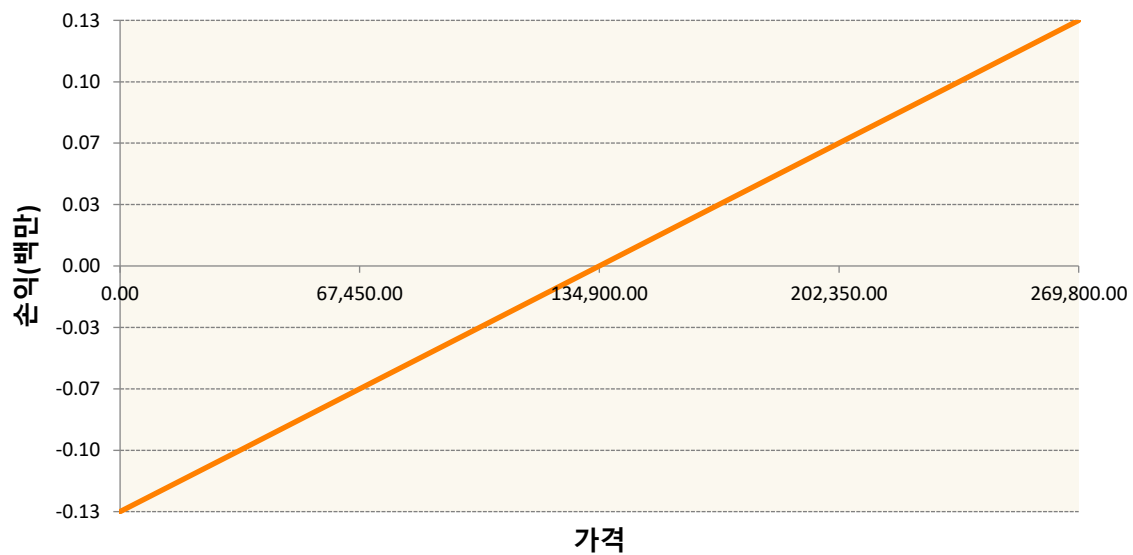
KR41CNV10006-2024-01 포스코DX개별선물



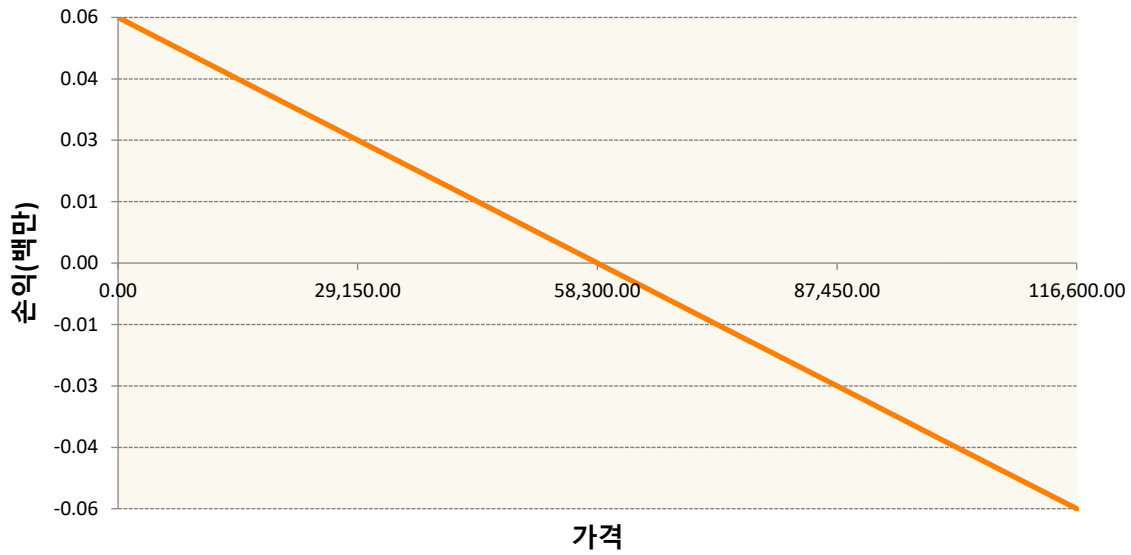
KR41CPV10001-2024-01 셀트리온개별선물



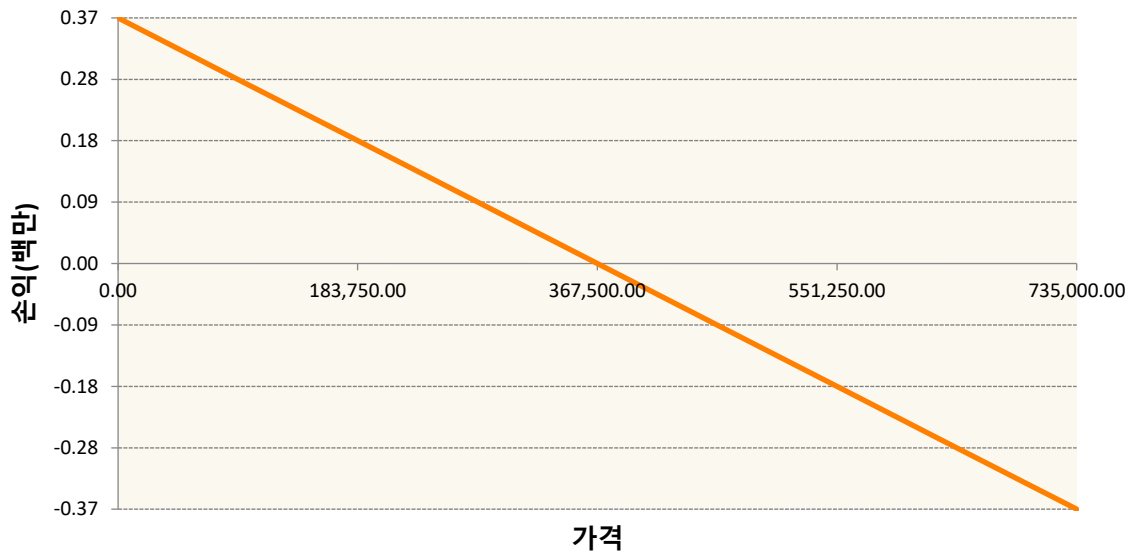
KR41DBV10009-2024-01 LIG넥스원개별선물



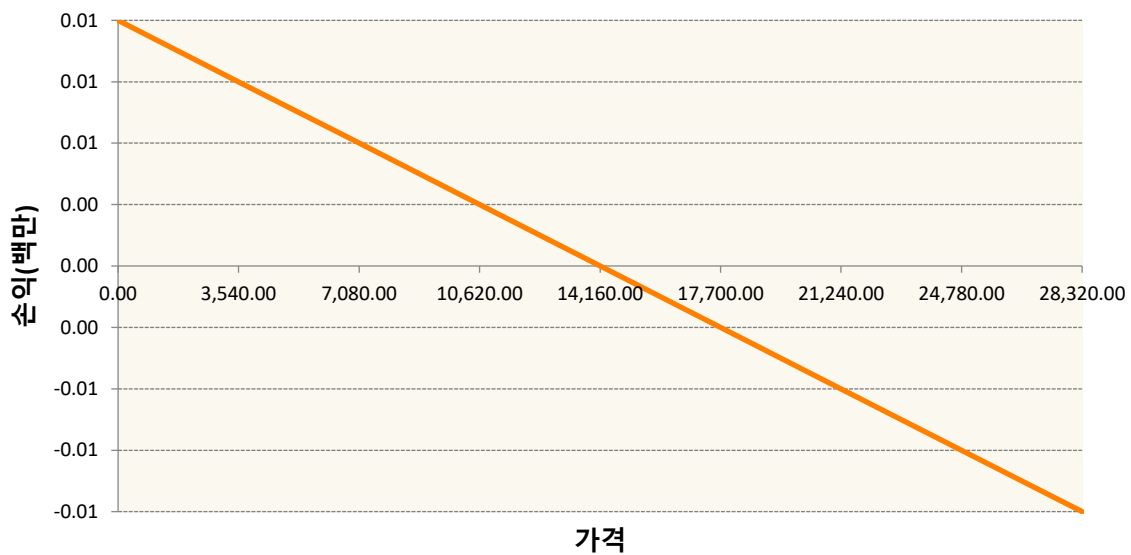
KR41E5V10003-2024-01 넷마블개별선물



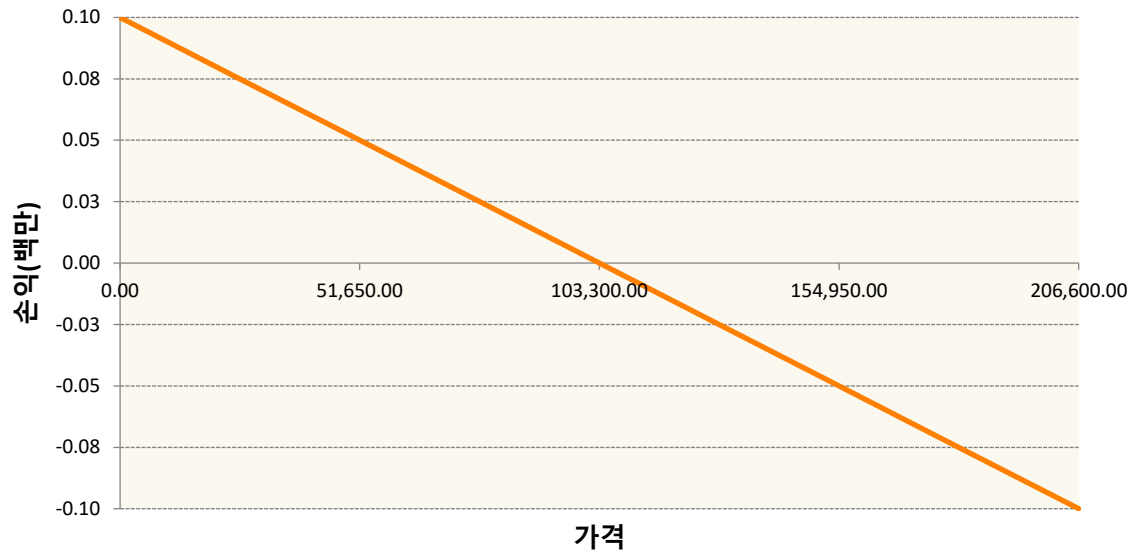
KR41E8V10007-2024-01 포스코퓨처엠개별선물



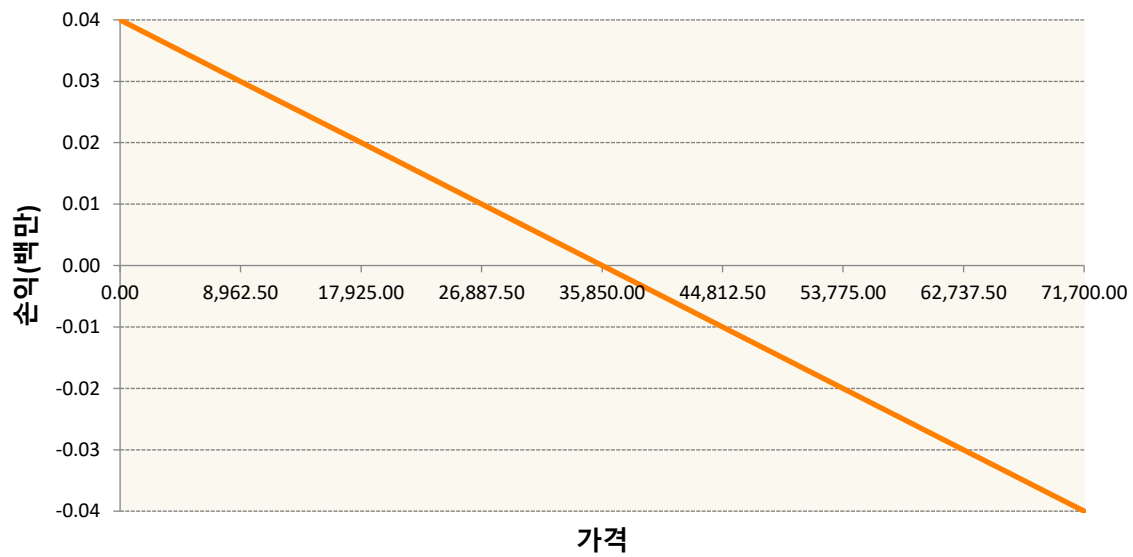
KR41ECV10005-2024-01 HDC현대산업개발개별선물



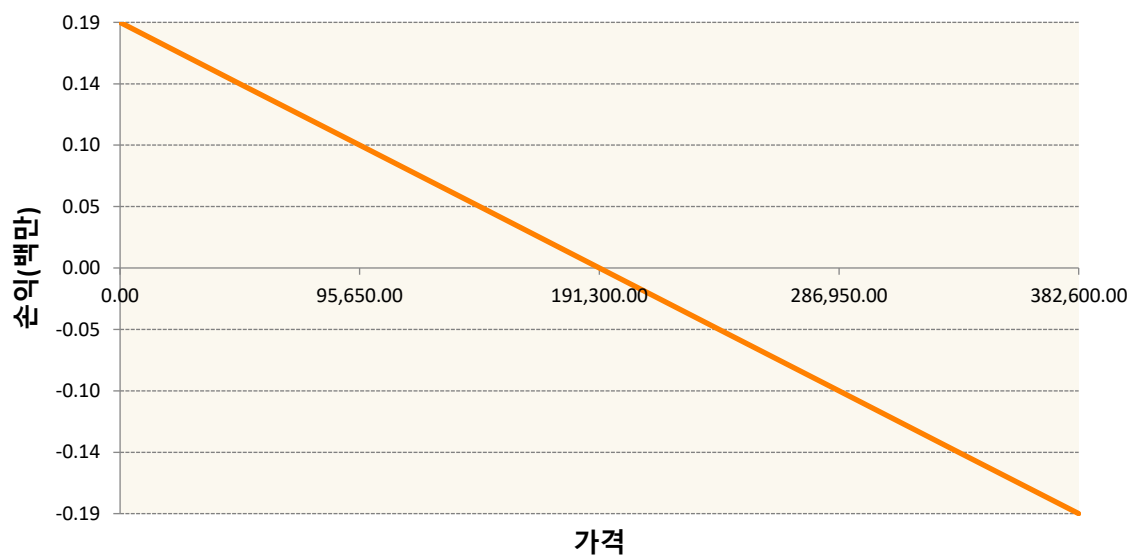
KR41EFV10008-2024-01 JYP Ent.개별선물



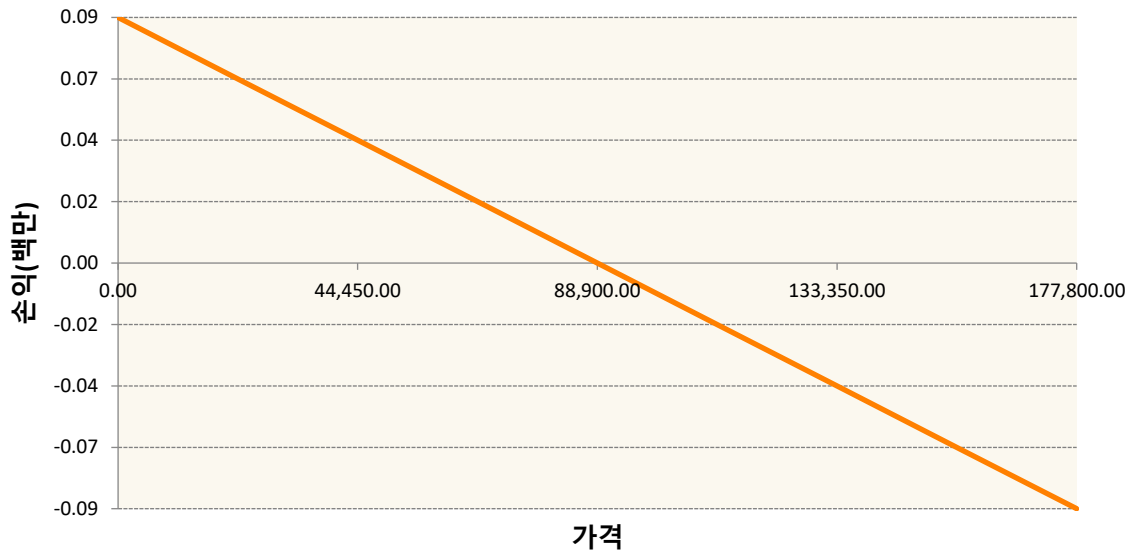
KR41ERV10003-2024-01 DL이앤씨개별선물



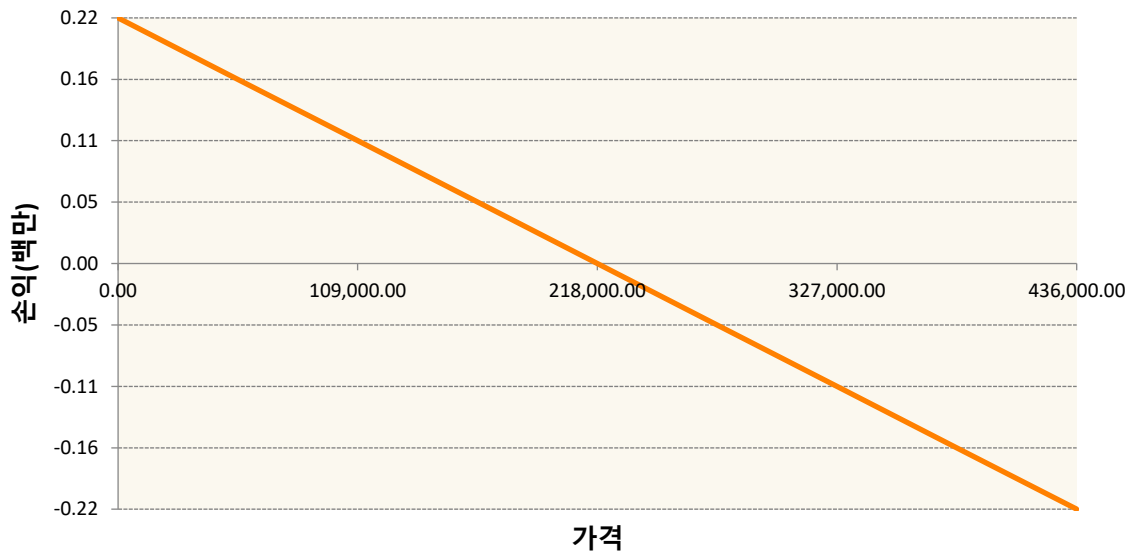
KR41FMV10001-2024-01 엘앤에프개별선물



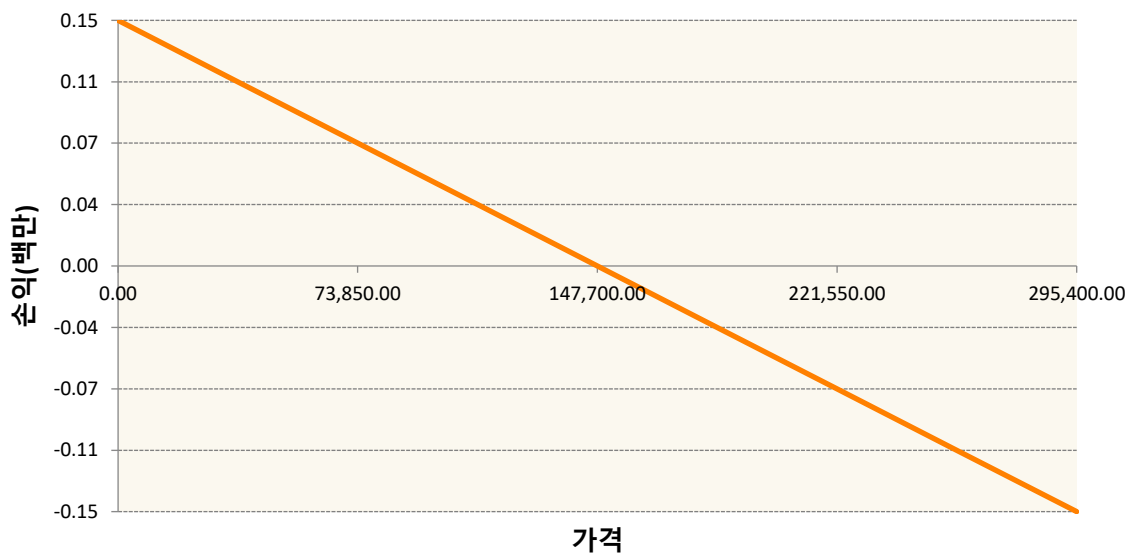
KR41FPV10004-2024-01 알테오젠개별선물



KR41G4V10004-2024-01 한솔케미칼개별선물



KR41GCV10000-2024-01 이오테크닉스개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
KR4101V300 2024-03 코스피200지수선물		195
KR4111V100 2024-01 삼성전자개별선물		2
KR4116V100 2024-01 현대차개별선물		2
KR4120V100 2024-01 현대모비스개별선물		3
KR4150V100 2024-01 SK하이닉스개별선물		9
KR4156V100 2024-01 NAVER개별선물		5
KR41C6V100 2024-01 아모레퍼시픽개별선물		2
KR41CFV100 2024-01 카카오개별선물		4
KR41CNV100 2024-01 포스코DX개별선물		11
KR41CPV100 2024-01 셀트리온개별선물		5
KR41DBV100 2024-01 LIG넥스원개별선물		3
KR41E5V100 2024-01 넷마블개별선물		2
KR41E8V100 2024-01 포스코퓨처엠개별선물		5
KR41ECV100 2024-01 HDC현대산업개발개별선물		2
KR41EFV100 2024-01 JYP Ent.개별선물		2
KR41ERV100 2024-01 DL이앤씨개별선물		1
KR41FMV100 2024-01 엘앤에프개별선물		6
KR41FPV100 2024-01 알테오젠개별선물		1
KR41G4V100 2024-01 한솔케미칼개별선물		1
KR41GCV100 2024-01 이오테크닉스개별선물		2

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)		(단위:백만원)
		372

공시일	2023-12-22
기준일	2023-12-21

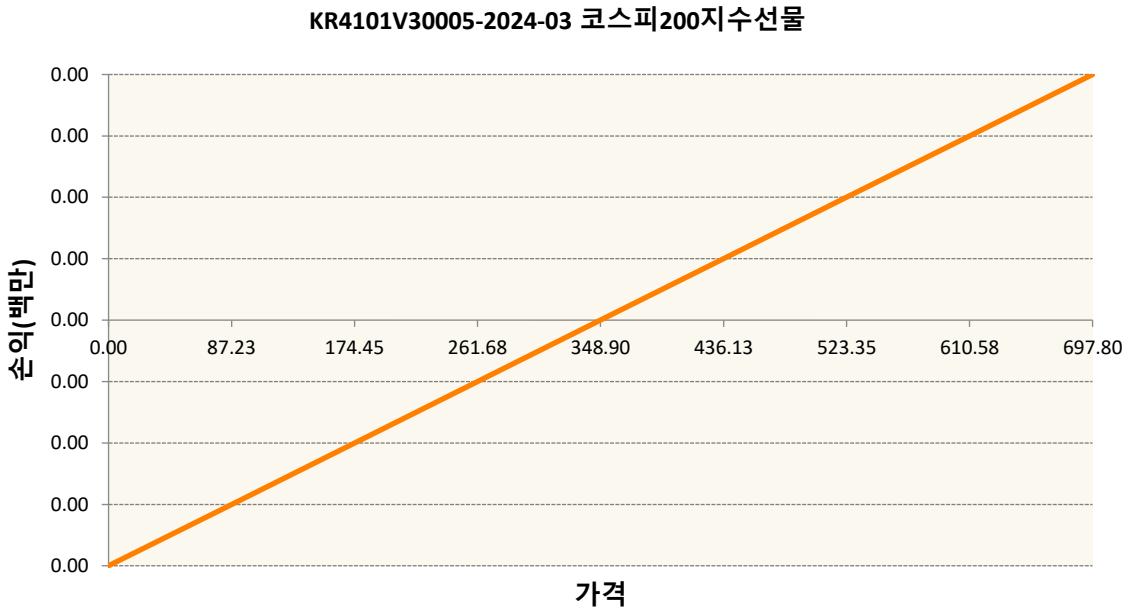
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

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	3,140	0	3,140	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101V30005			2024-03 코스피200지수선물				251
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-251	-251	-251	-251	-251	-251	-251
-5.33%	-167	-167	-167	-167	-167	-167	-167
-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%	167	167	167	167	167	167	167
8.00%	251	251	251	251	251	251	251

공시일	2023-12-22
기준일	2023-12-21

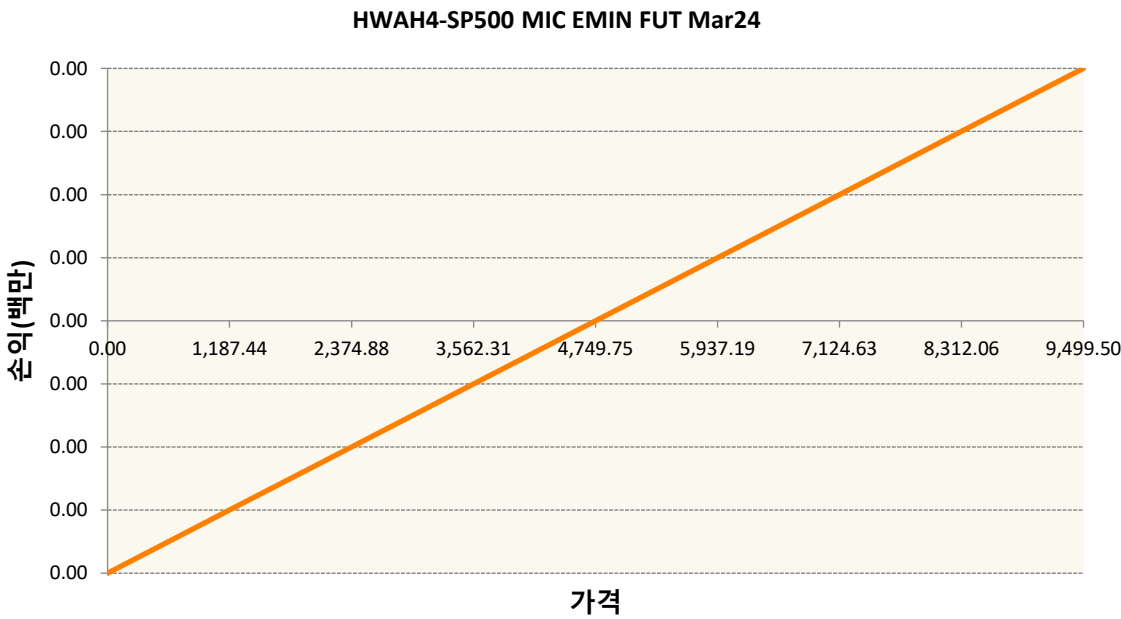
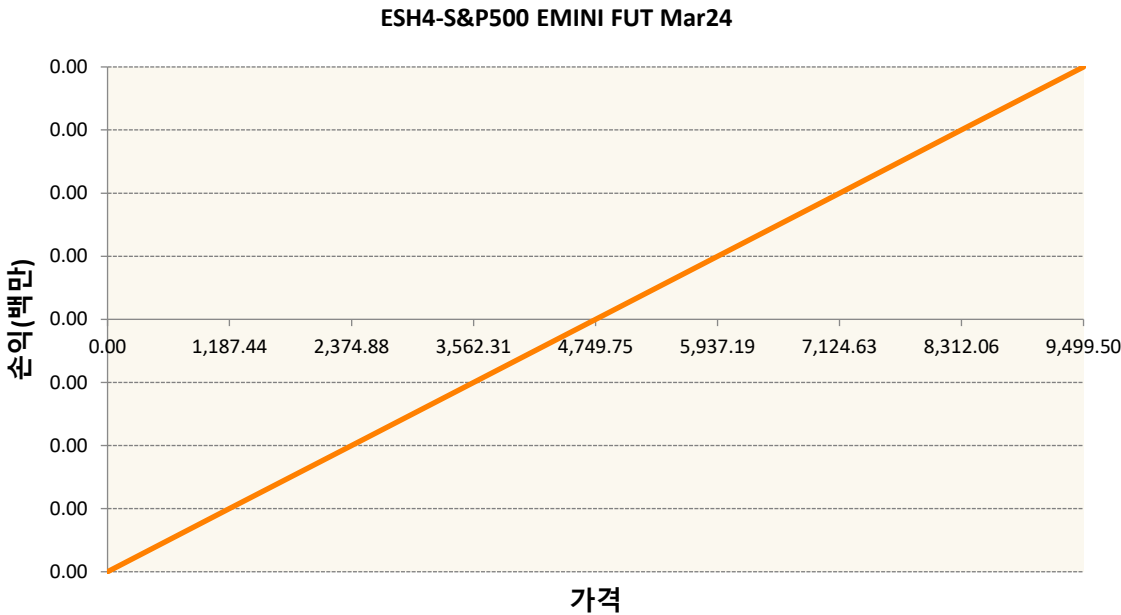
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

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	313	0	313	
누계	유가증권	선물	1,938	0	1,938	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESH4	S&P500 EMINI FUT Mar24	25
HWAH4	SP500 MIC EMIN FUT Mar24	155

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

공시일	2023-12-22
기준일	2023-12-21

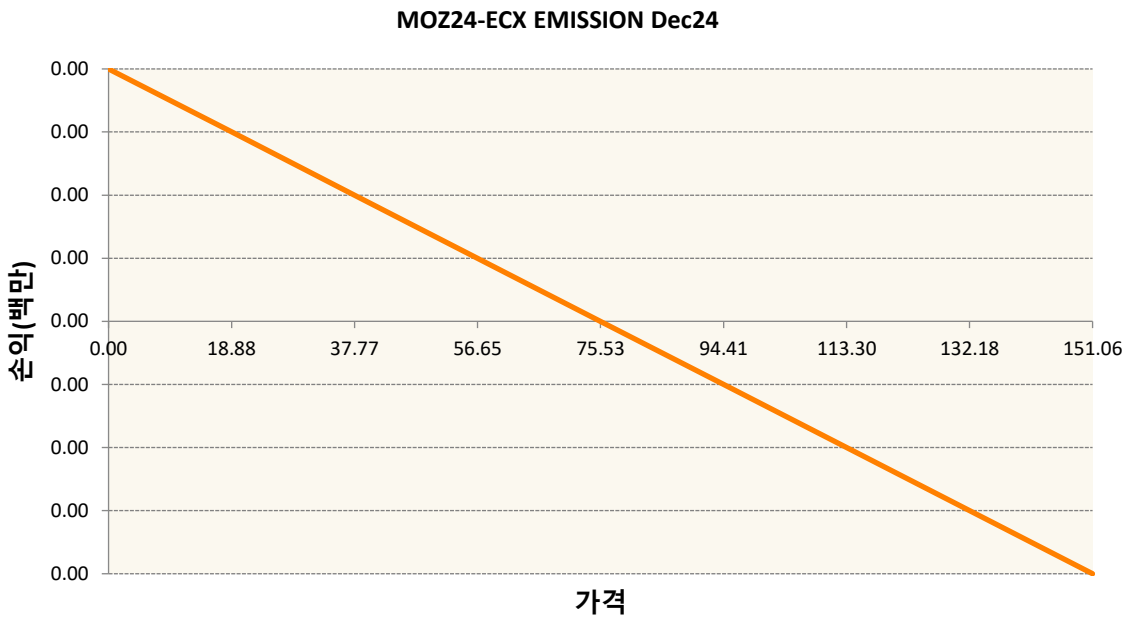
SOL유럽탄소배출권선물인버스ICE특별자산상

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	5,977	-5,977	
누계	지수	스왑	479	0	479	장외
누계	통화	선도	0	1,731	-1,731	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	478
SWICEUACN ICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX	5

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

(단위:백만원)

962

공시일	2023-12-22
기준일	2023-12-21

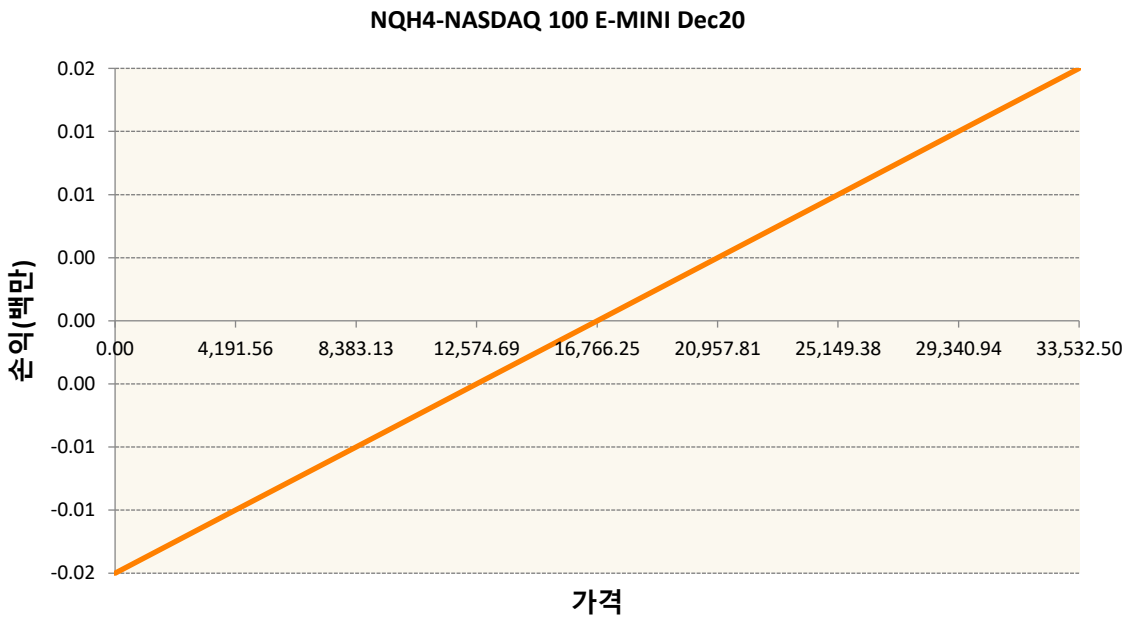
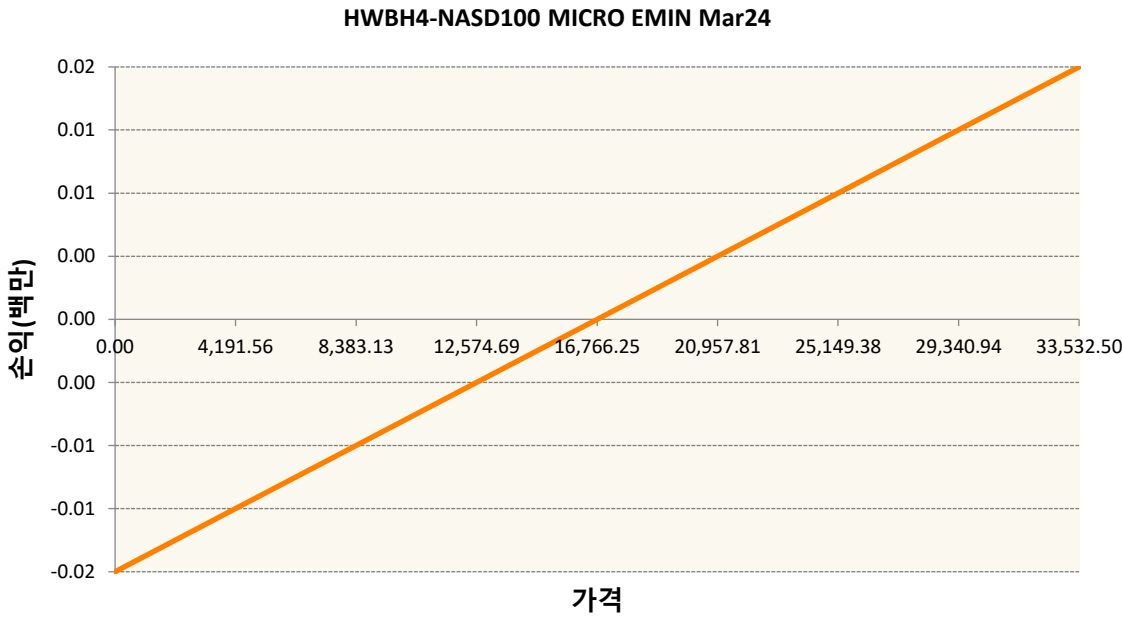
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

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	2,116	0	2,116	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
HWBH4	NASD100 MICRO EMIN Mar24		169
NQH4	NASDAQ 100 E-MINI Dec20		35

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)			(단위:백만원)
			183

공시일	2023-12-22
기준일	2023-12-21

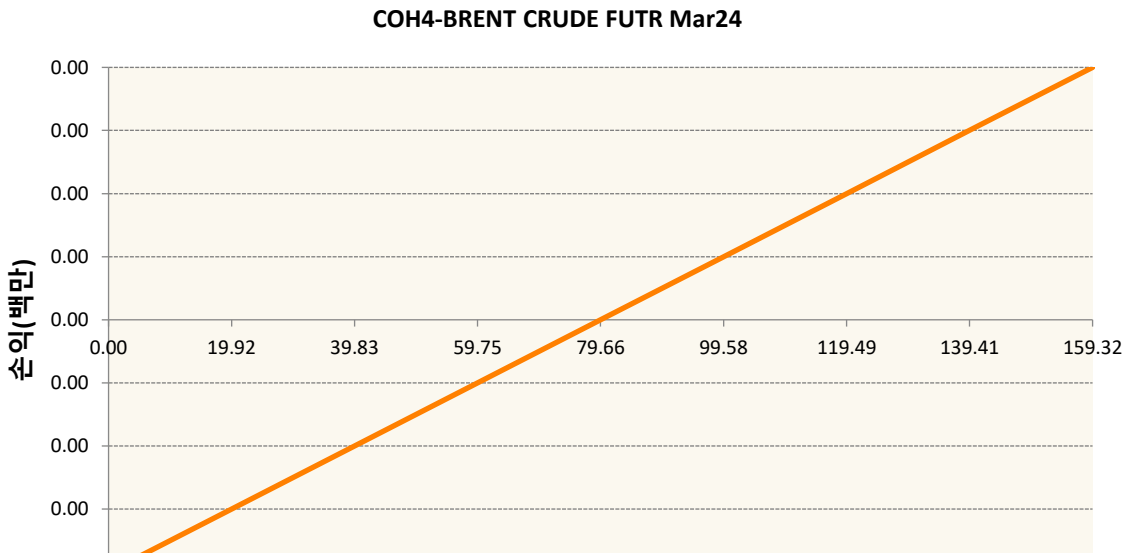
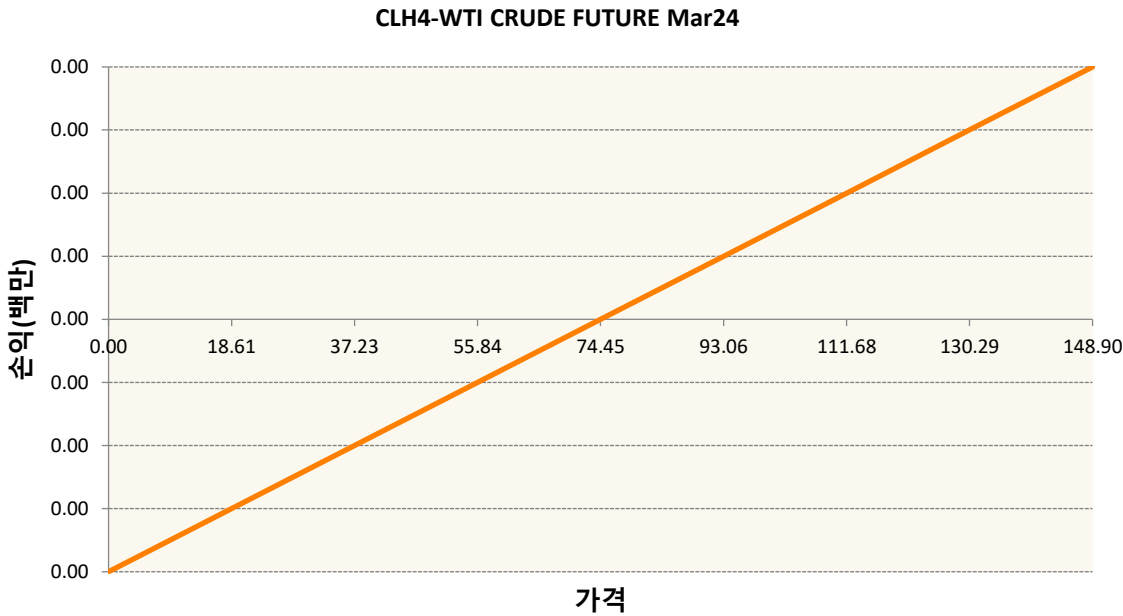
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

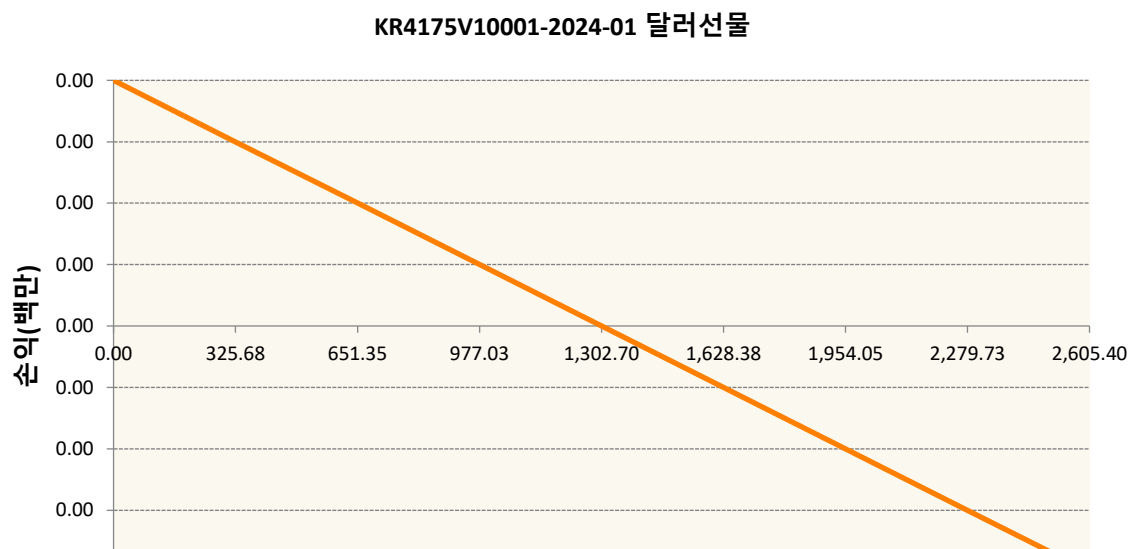
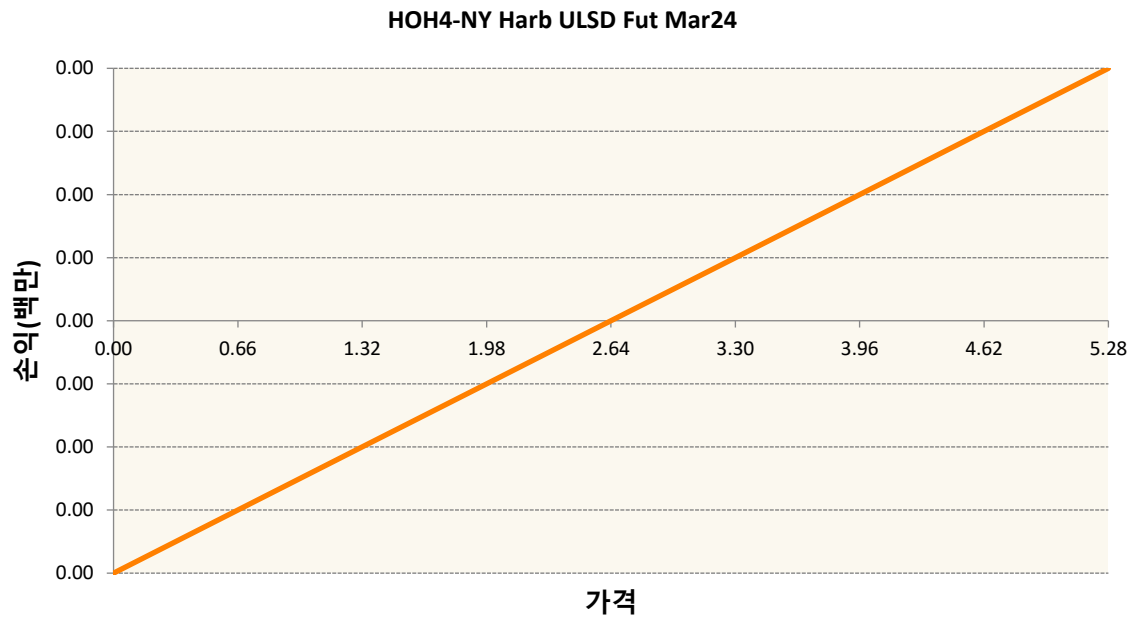
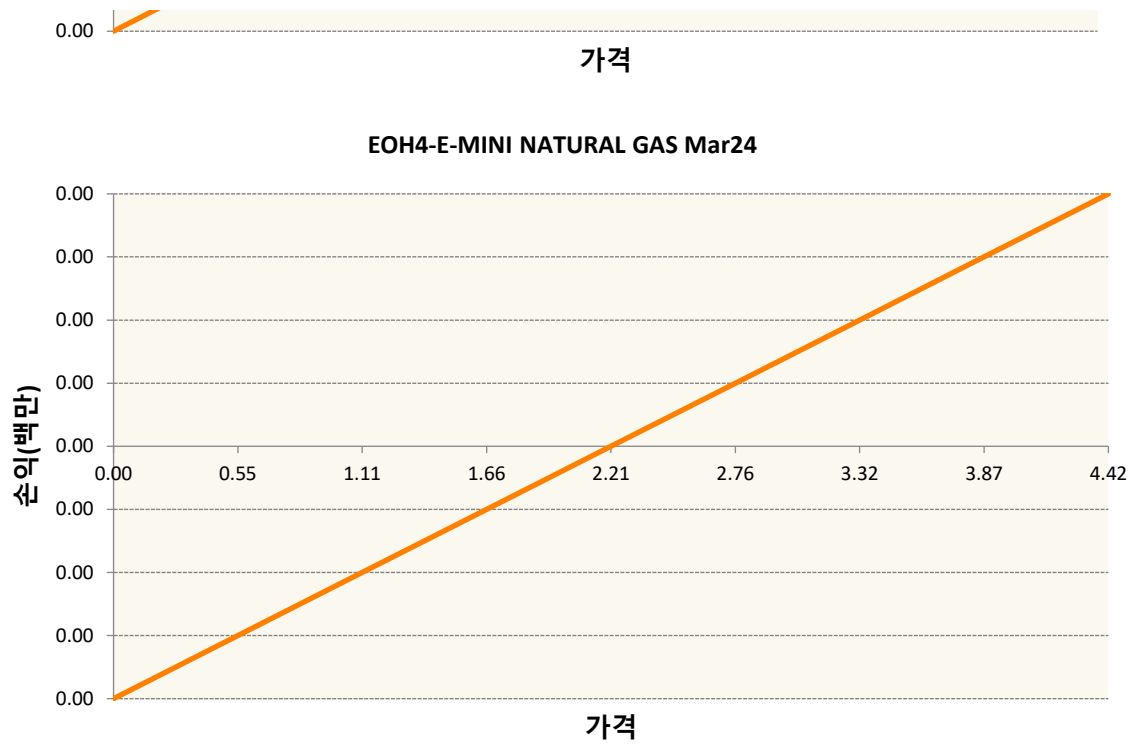
1. 계약금액

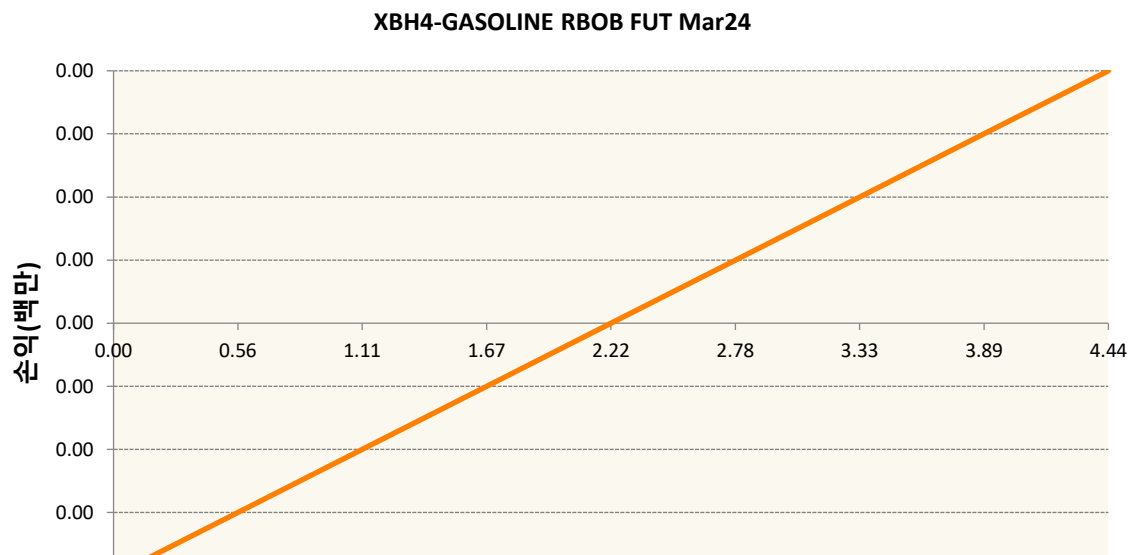
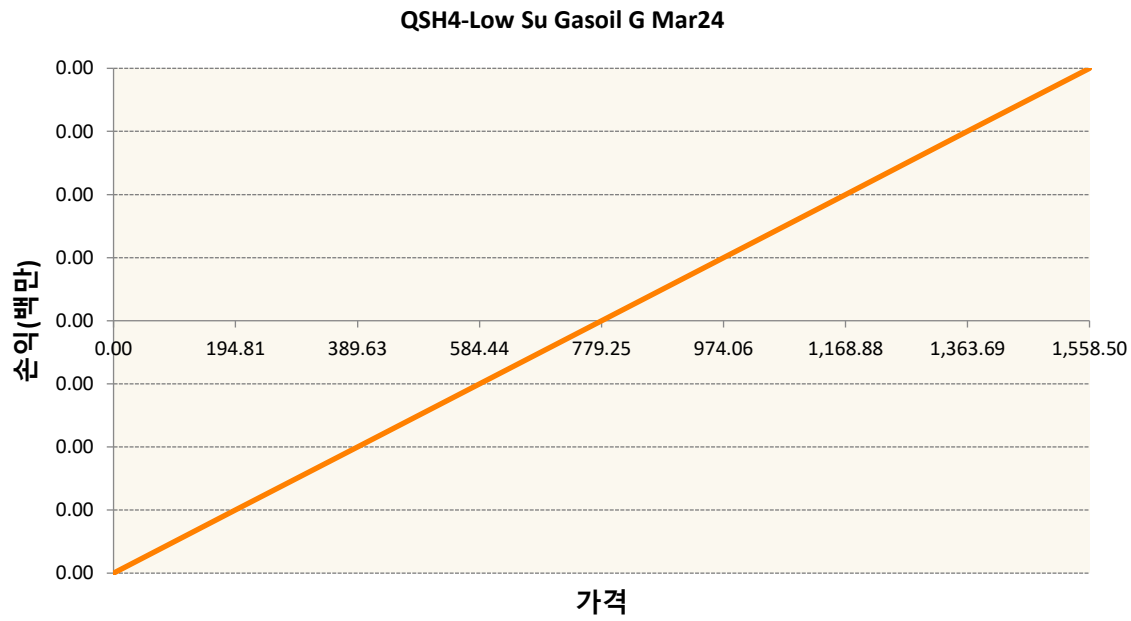
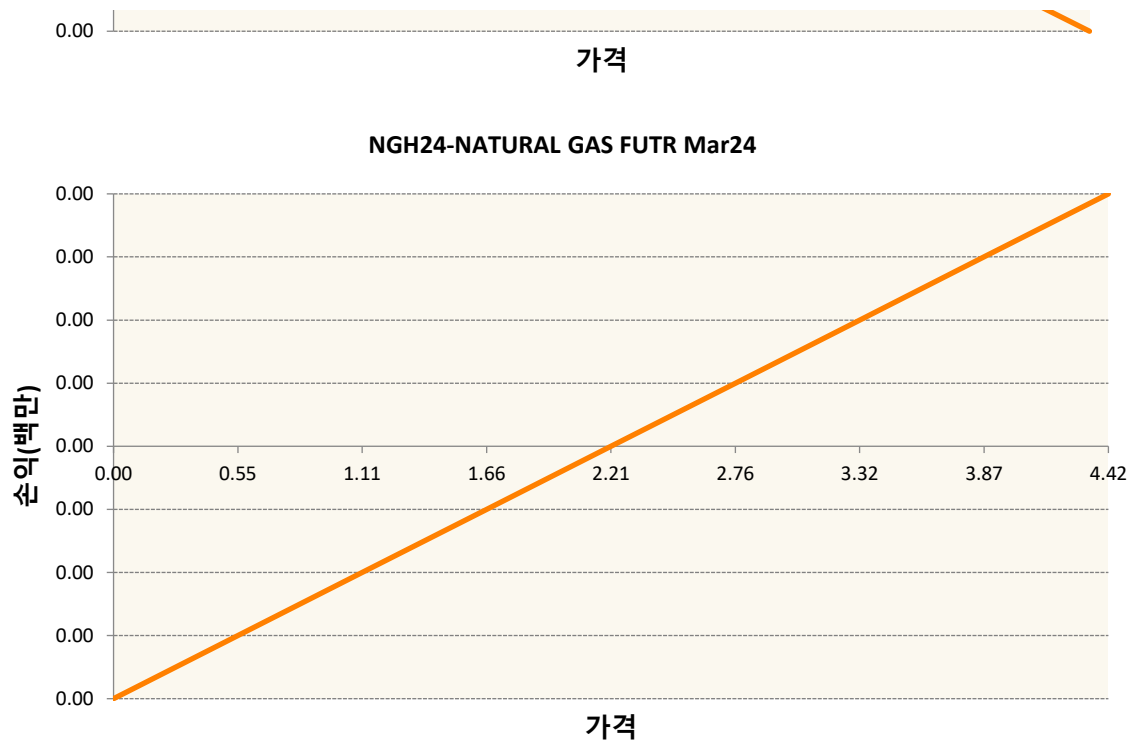
(단위:백만원)

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	65	0	65	장내
누계	선물	유가증권	293	0	293	
누계	유가증권	선물	881	0	881	
누계	통화	선물	0	182	-182	장내

2. 만기시점의 손익구조







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	15
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)

224