

공시일	2023-12-27
기준일	2023-12-26

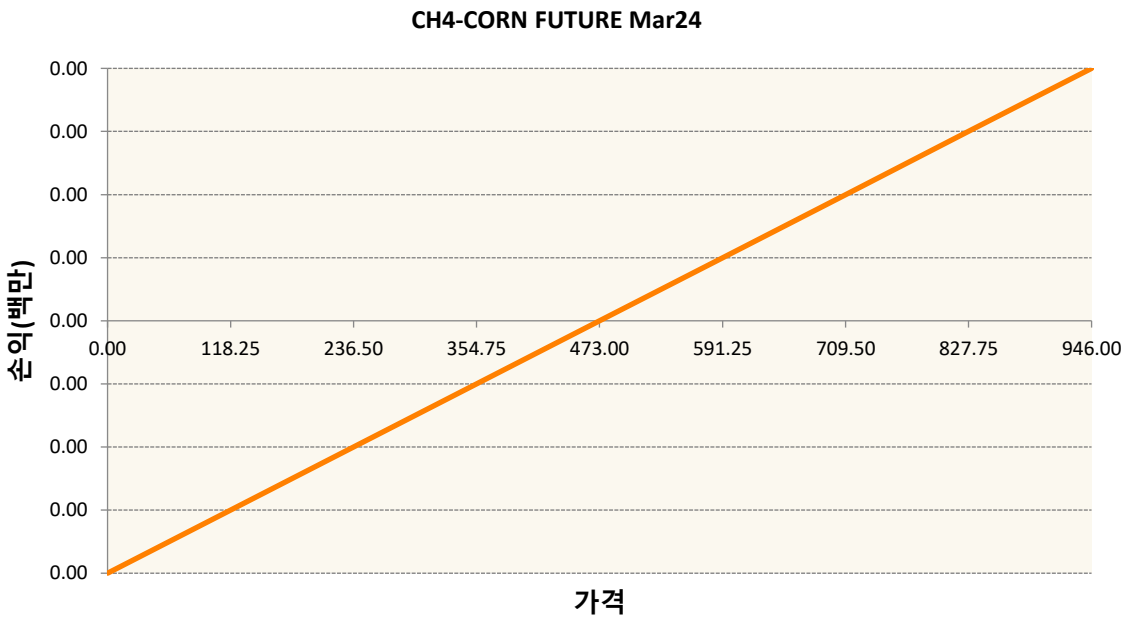
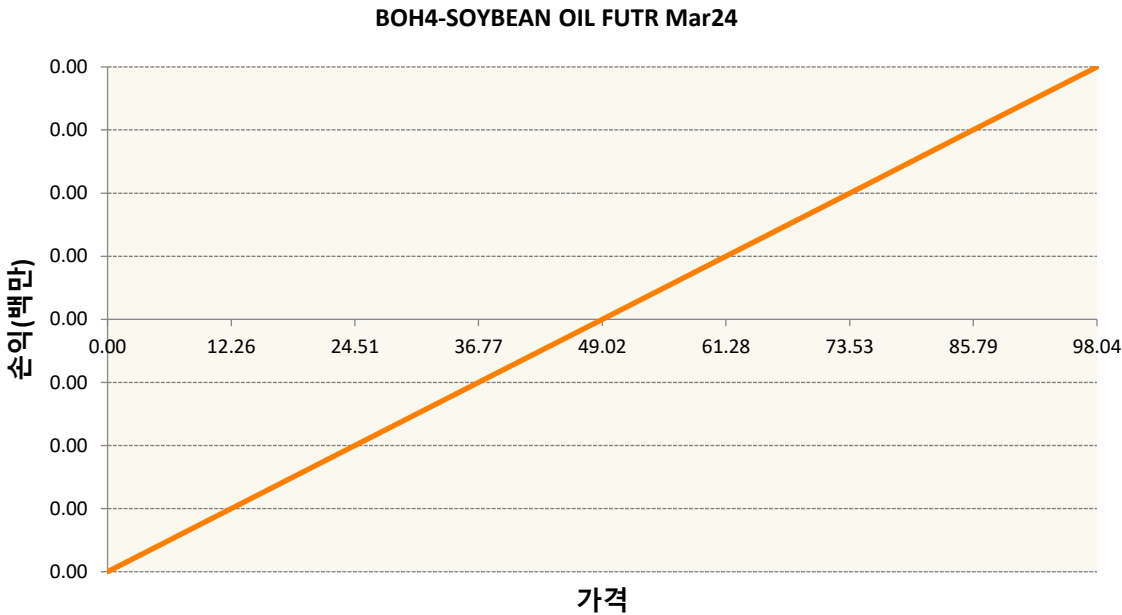
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

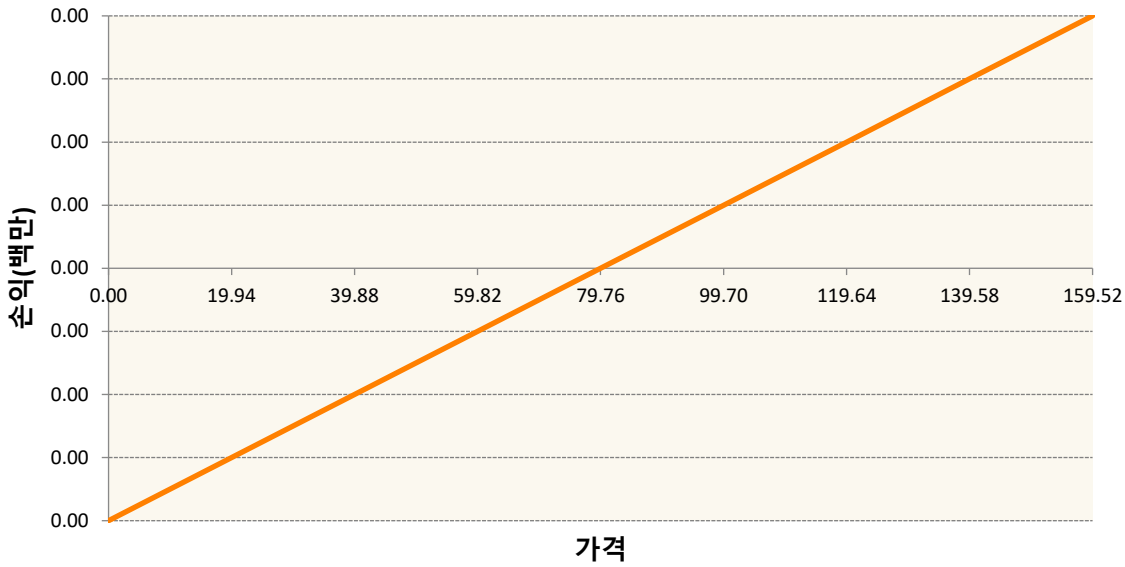
(단위:USD 백만)

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	4,676	0	4,676	
누계	통화	선물	0	478	-478	장내

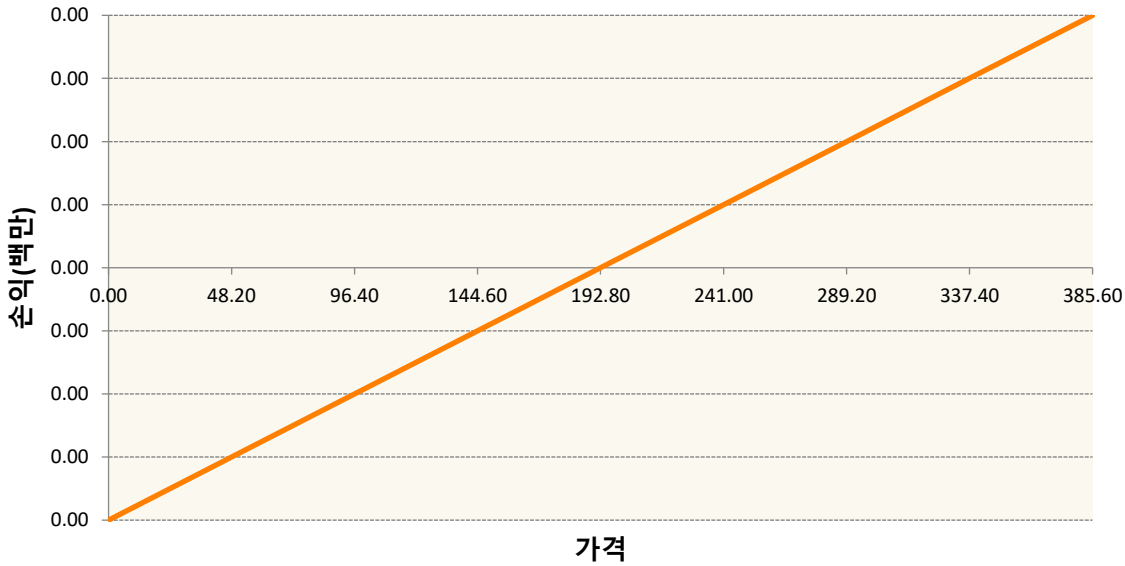
2. 만기시점의 손익구조



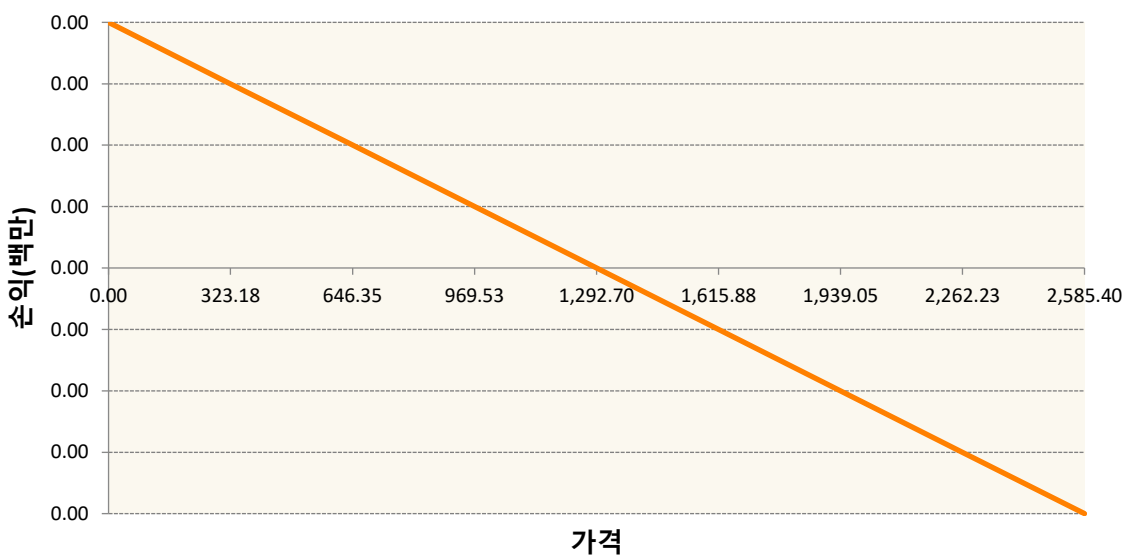
CTH4-COTTON NO.2 FUTR Mar24



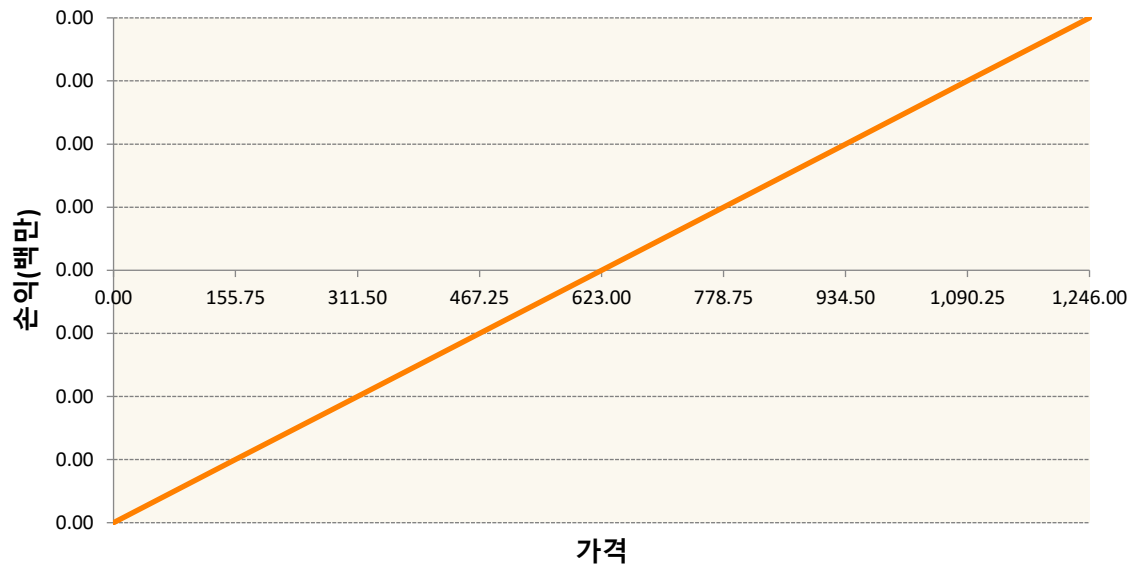
KCH4-COFFEE 'C' FUTURE Mar24



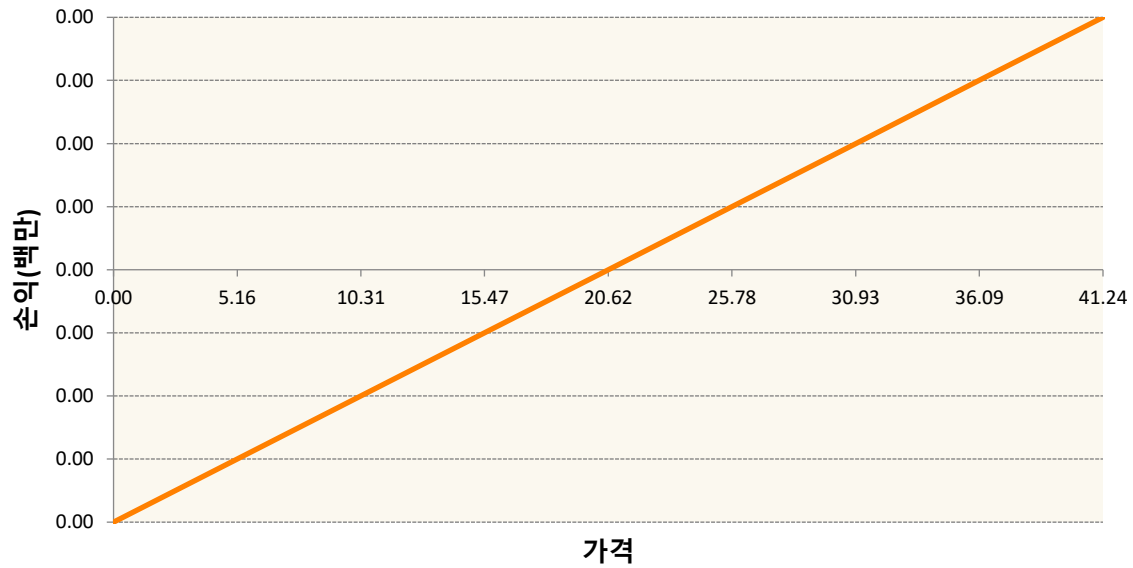
KR4175V10001-2024-01 달러선물



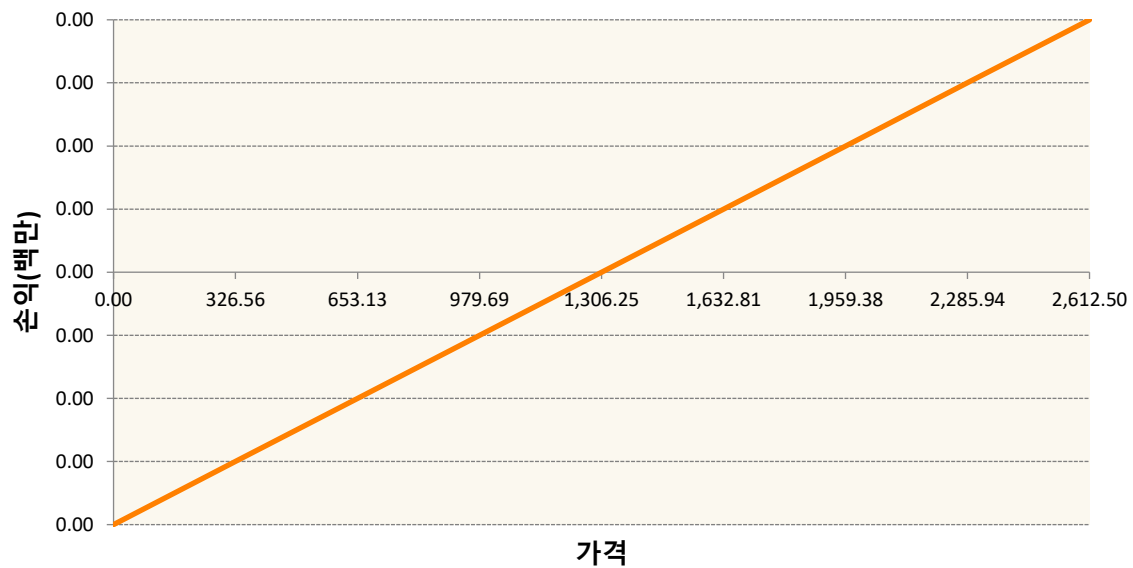
KWH4-KC HRW WHEAT FUT Mar24



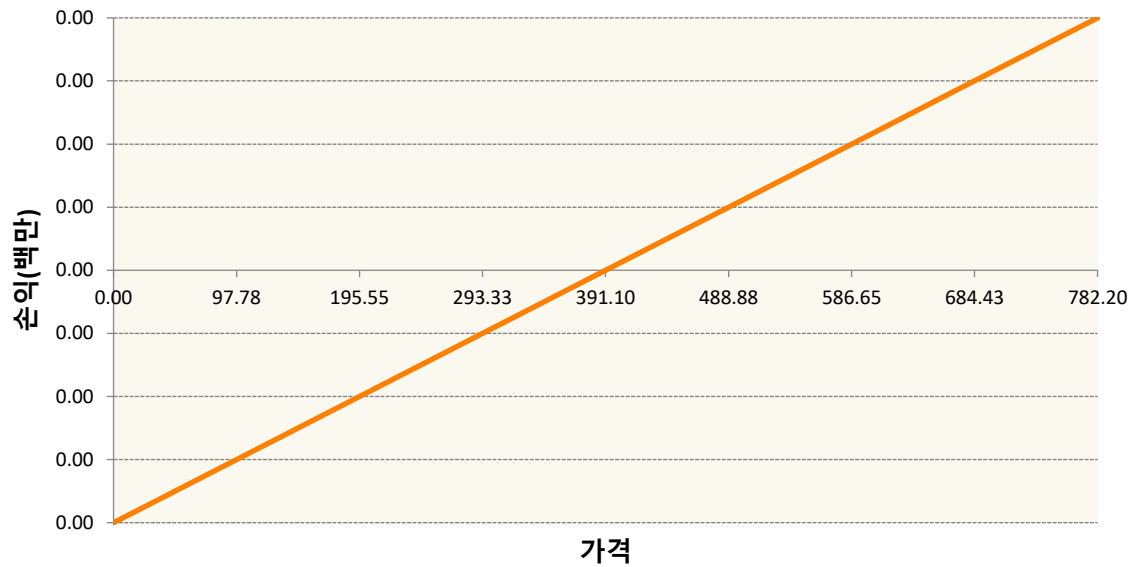
SBH4-Sugar #11 (WORLD) Mar24



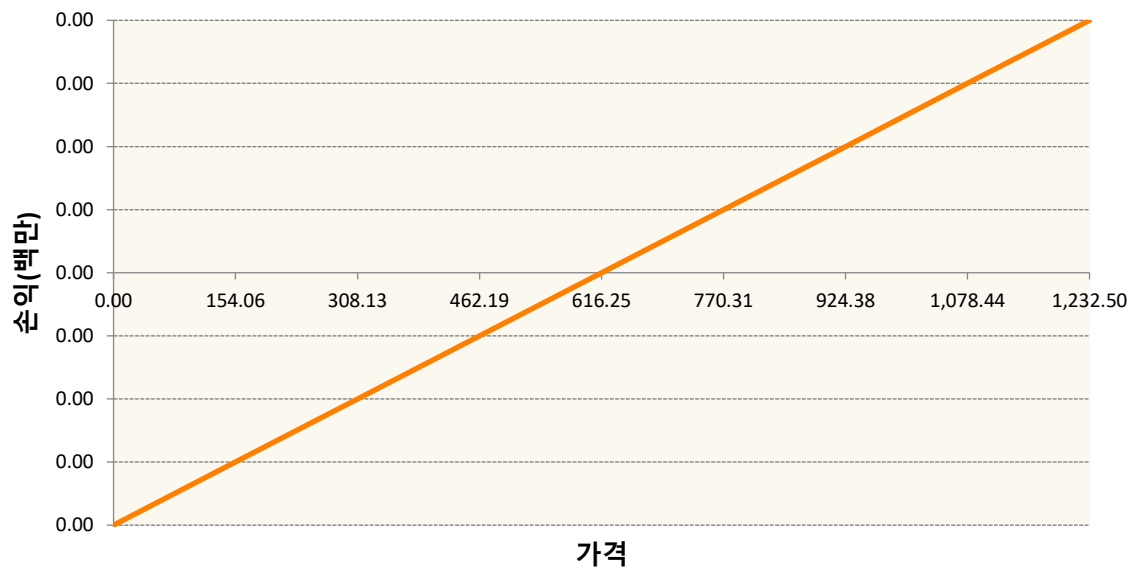
SH4-SOYBEAN FUTURE Mar24



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	2023-12-27
기준일	2023-12-26

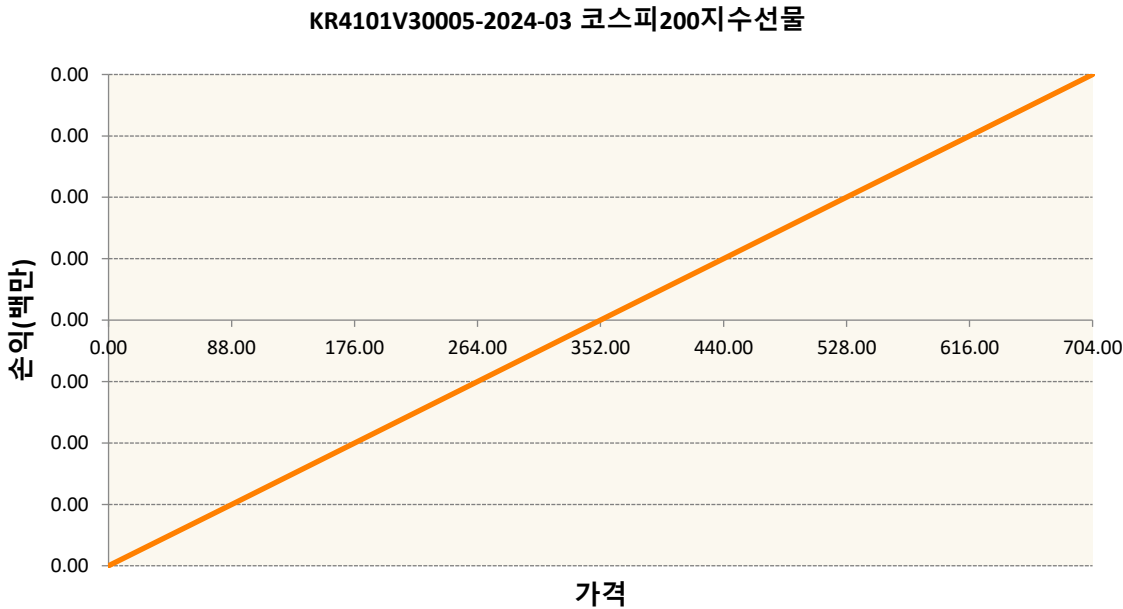
스마트인덱스모

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	1,584	0	1,584	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	2023-12-27
기준일	2023-12-26

SOL차이나강소기업CSI500상장

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	3,779	0	3,779	장외
누계	지수	스왑	3,779	0	3,779	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 신한CSI500미래231226

301

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

263

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2023-12-27
기준일	2023-12-26

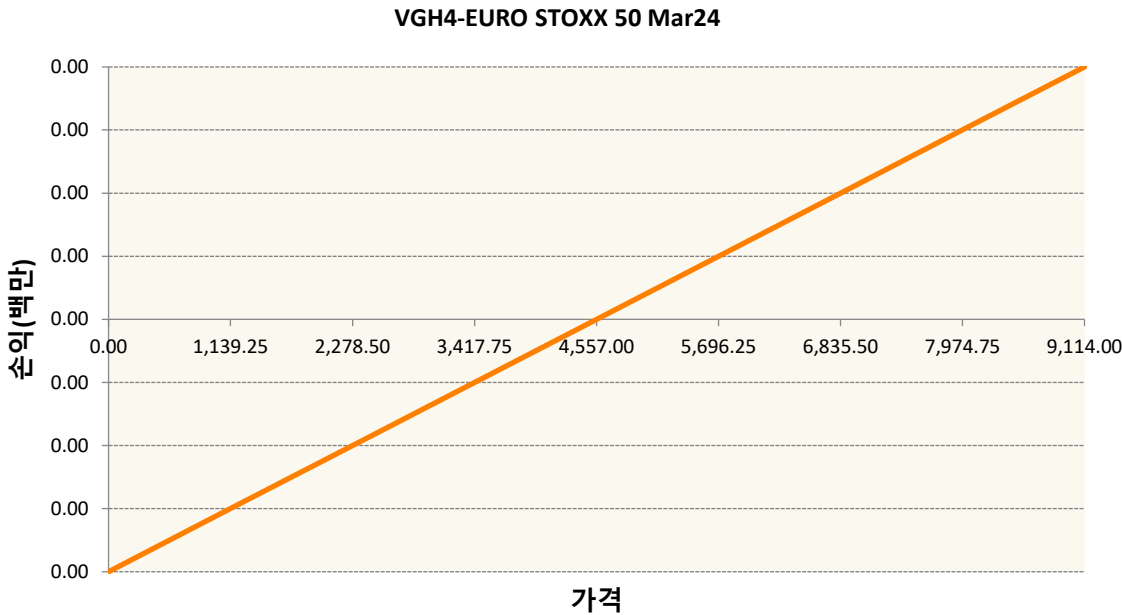
유로인덱스모(주식-파생형)

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	973	0	973	
누계	통화	선도	214	0	214	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213DCL	EUR/KRW 22-03-24E	17
VGH4	EURO STOXX 50 Mar24	78

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

(단위:백만원)

72

공시일	2023-12-27
기준일	2023-12-26

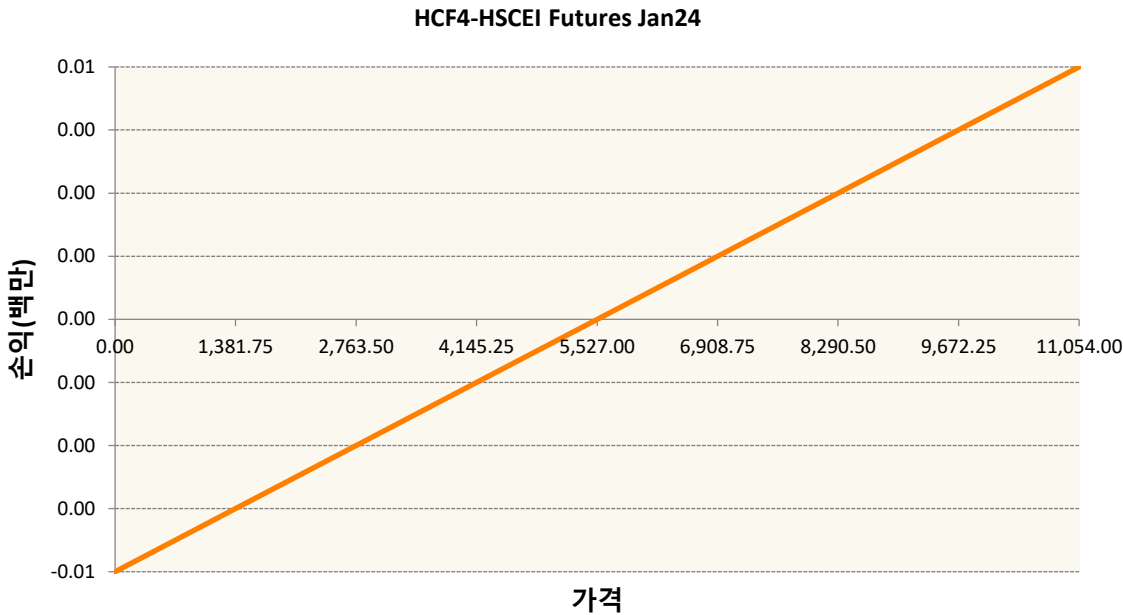
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,099	0	1,099	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCF4	HSCEI Futures Jan24	88
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

128

공시일	2023-12-27
기준일	2023-12-26

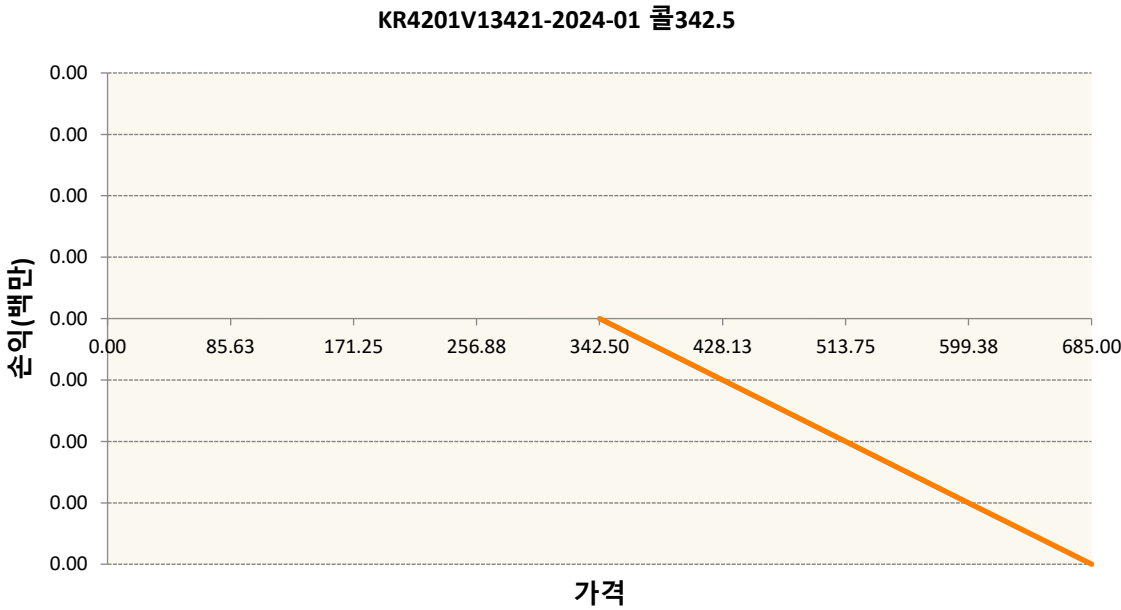
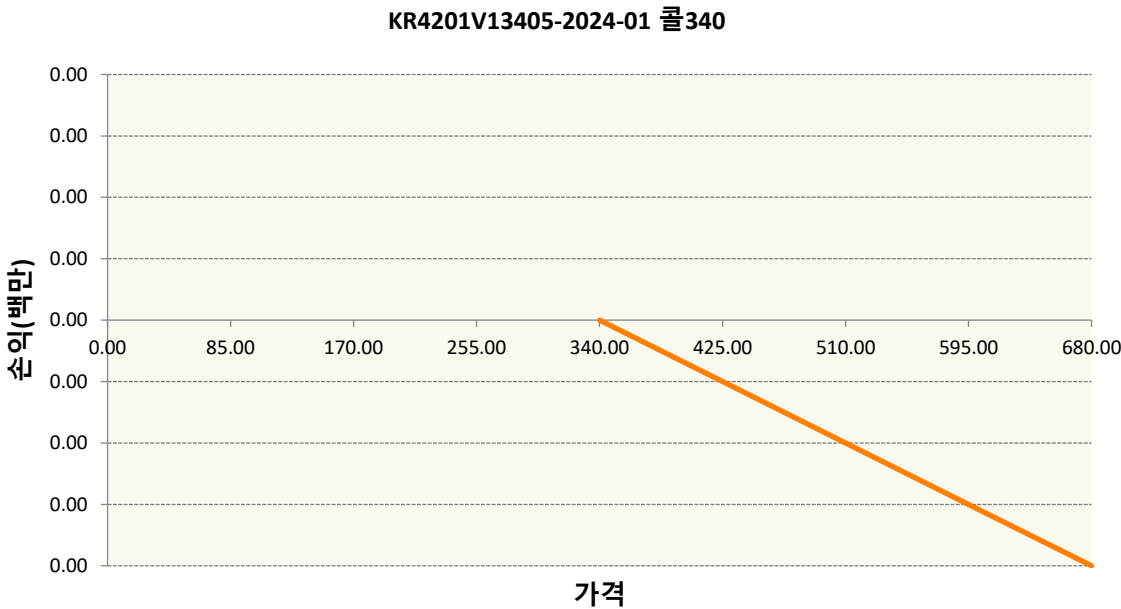
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

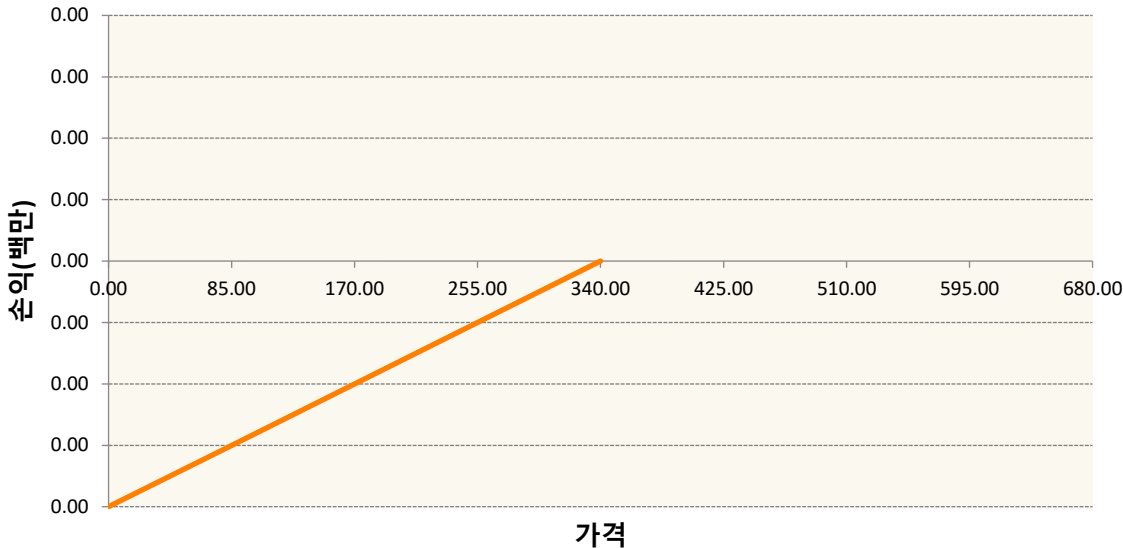
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	830	0	830	장내
누계	유가증권	옵션	0	50,344	-50,344	장내

2. 만기시점의 손익구조



KR4301V13403-2024-01 풋340



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201V13405		2024-01 콜340					1,139
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	597	585	571	555	538	520	501
-5.33%	521	498	475	451	426	401	376
-2.67%	349	322	294	267	240	213	186
0%	67	45	23	0	-24	-48	-73
2.67%	-296	-308	-321	-336	-353	-370	-389
5.33%	-699	-703	-709	-717	-726	-737	-750
8.00%	-1,115	-1,116	-1,118	-1,122	-1,126	-1,132	-1,139
KR4201V13421		2024-01 콜342.5					1,913
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	912	895	875	851	826	798	768
-5.33%	812	777	739	701	661	621	579
-2.67%	564	517	470	423	376	329	281
0%	126	85	43	0	-44	-88	-133
2.67%	-468	-492	-519	-550	-582	-616	-652
5.33%	-1,148	-1,158	-1,171	-1,188	-1,208	-1,230	-1,255
8.00%	-1,861	-1,864	-1,869	-1,876	-1,886	-1,898	-1,913
KR4301V13403		2024-01 풋340					423
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-405	-407	-409	-412	-415	-419	-423
-5.33%	-191	-198	-205	-213	-221	-229	-237
-2.67%	-42	-52	-62	-72	-82	-92	-101
0%	18	13	7	0	-7	-14	-22

2.67%	30	29	27	25	22	18	14
5.33%	31	31	31	30	30	28	27
8.00%	31	31	31	31	31	31	30

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	3,597

공시일	2023-12-27
기준일	2023-12-26

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	1,945	0	1,945	

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	2023-12-27
기준일	2023-12-26

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	4,511	0	4,511	

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	2023-12-27
기준일	2023-12-26

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	17,602	0	17,602	
누계	통화	선도	0	17,249	-17,249	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
FXW213D9R KRW/USD 29-12-23E		502
FXW213DAT KRW/USD 31-01-24E		185
FXW213DBV KRW/USD 29-02-24E		636
FXW213DCB KRW/USD 31-01-24E		26
FXW213DCS KRW/USD 31-01-24E		31
IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	715

공시일	2023-12-27
기준일	2023-12-26

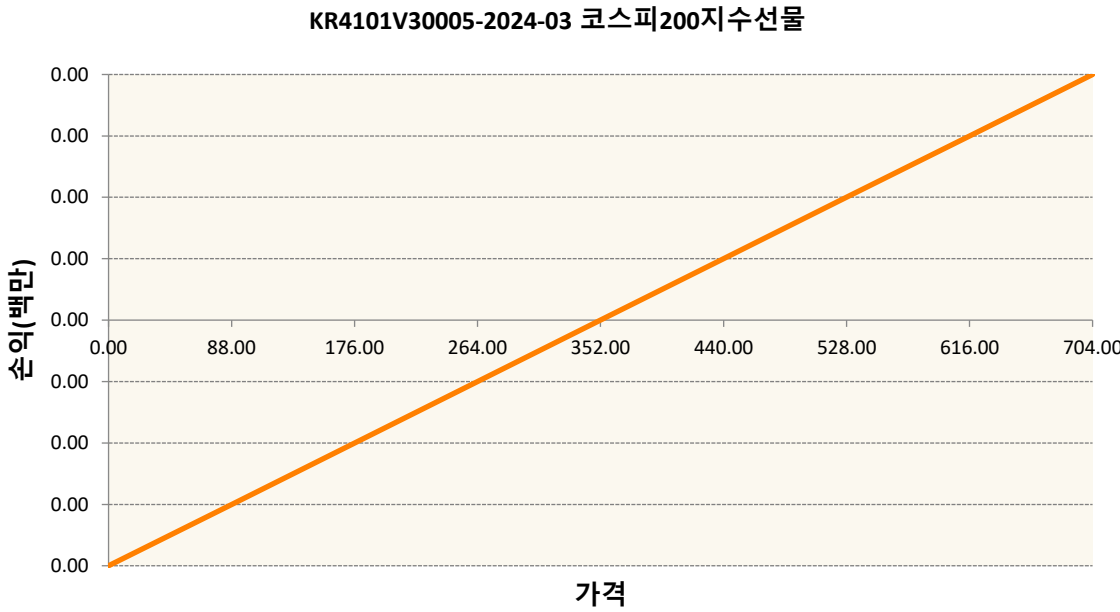
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	88	-88	장내
누계	유가증권	선물	528	0	528	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101V30005			2024-03 코스피200지수선물				42
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-42	-42	-42	-42	-42	-42	-42
-5.33%	-28	-28	-28	-28	-28	-28	-28
-2.67%	-14	-14	-14	-14	-14	-14	-14
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	14	14	14	14	14	14	14
5.33%	28	28	28	28	28	28	28
8.00%	42	42	42	42	42	42	42

공시일	2023-12-27
기준일	2023-12-26

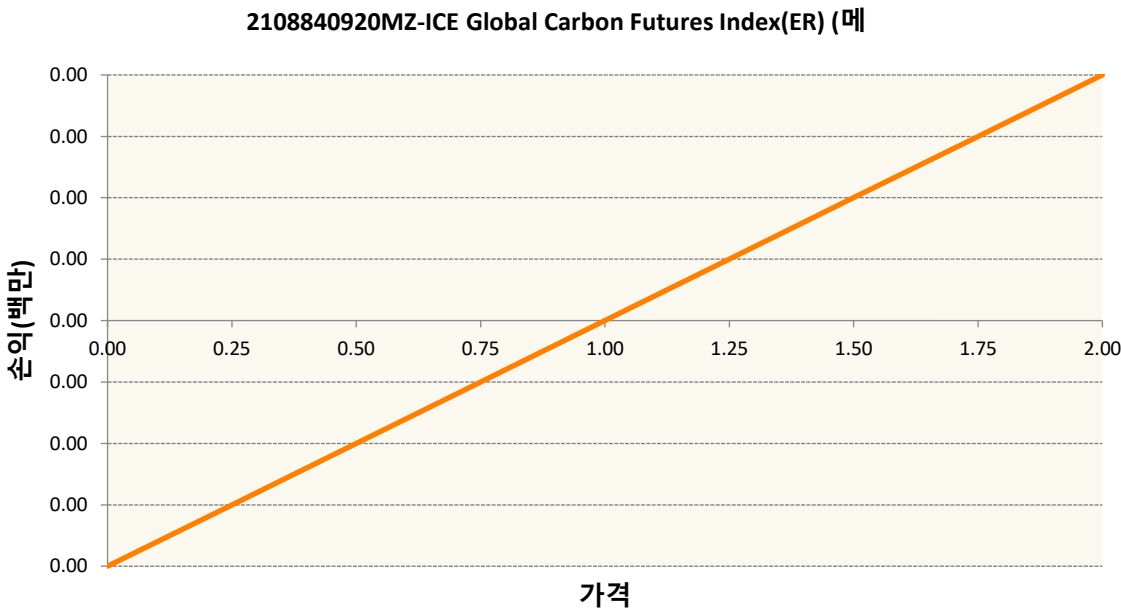
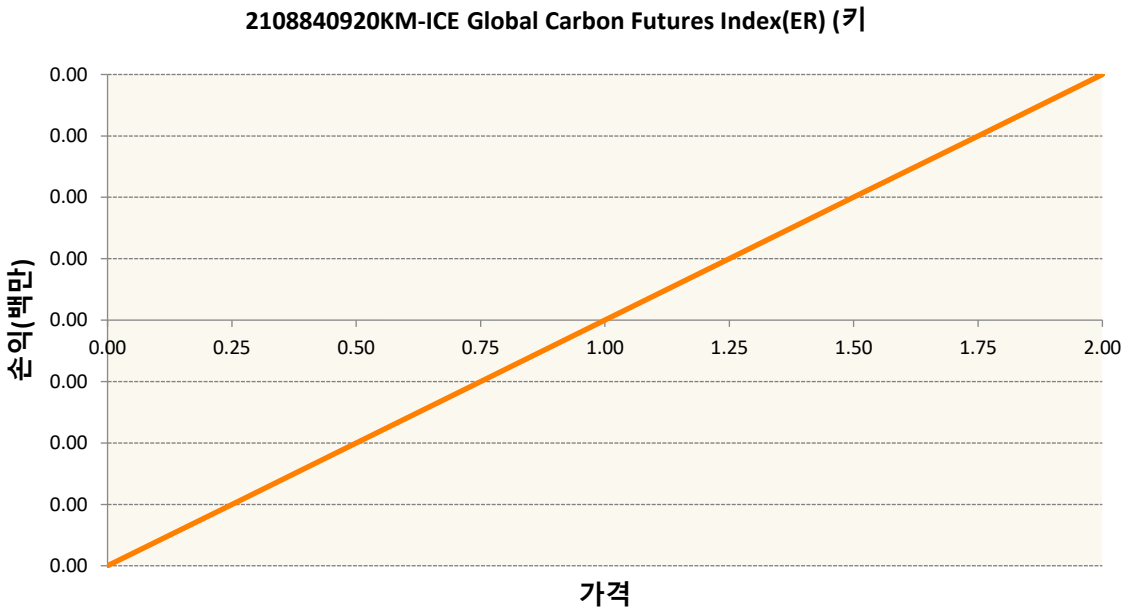
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

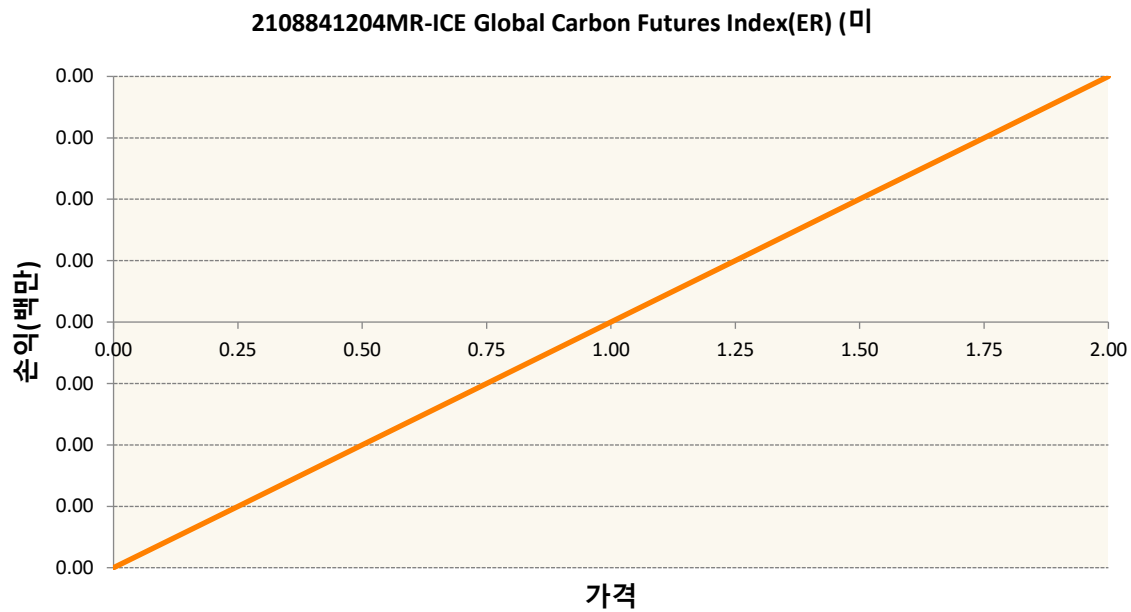
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	19,870	19,849	21	
누계	유가증권	선물	19,870	0	19,870	

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108840920ICE Global Carbon Futures Index(ER) (키		995
2108840920ICE Global Carbon Futures Index(ER) (메		199
2108841204ICE Global Carbon Futures Index(ER) (미		398

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	2,014

공시일	2023-12-27
기준일	2023-12-26

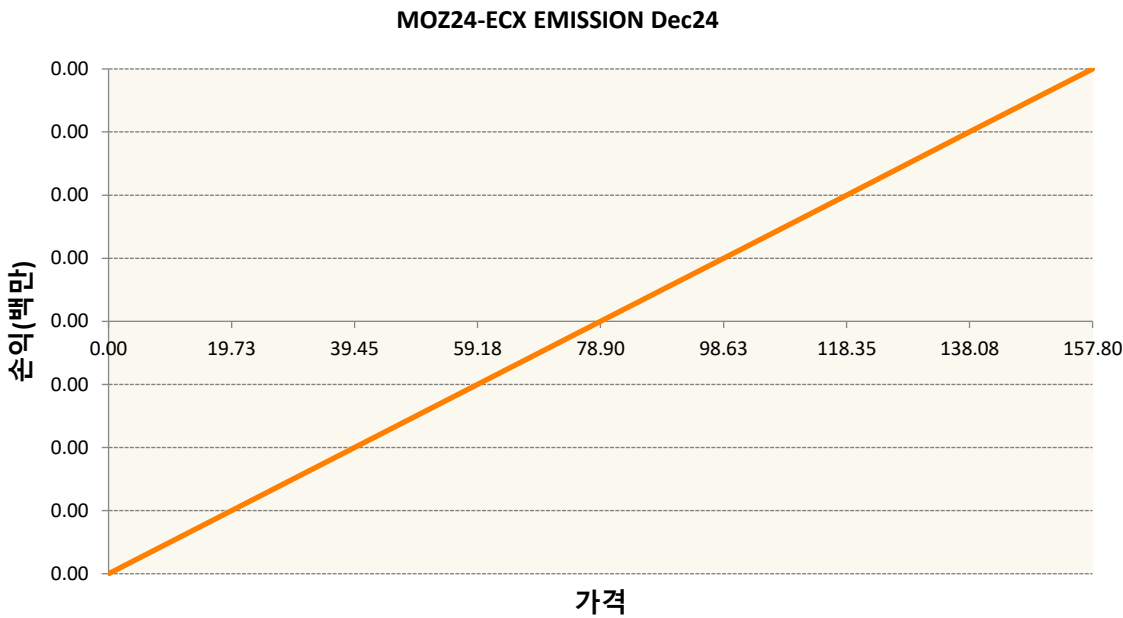
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	55	-55	장외
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	9,682	0	9,682	
누계	지수	스왑	424	0	424	장외
누계	통화	선도	0	3,840	-3,840	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213DBV KRW/EUR 28-12-23E	115
FXW213DCS KRW/EUR 31-01-24E	15
FXW213DCS KRW/EUR 31-01-24E	62
FXW213DCS KRW/EUR 31-01-24E	115
MOZ24 ECX EMISSION Dec24	775
SWICEUACN ICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX	0.44

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

(단위:백만원)

공시일	2023-12-27
기준일	2023-12-26

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	4,370	0	4,370	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI00000 신한CSI Index 230622 (미래)	4
SWCSI00000 신한CSI Index 230622 (메리츠)	4
SWCSI00000 신한CSI Index 230922 (키움)	3
SWCSI00000 신한CSI Index 231013 (NH)	3

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

(단위:백만원)

19

공시일	2023-12-27
기준일	2023-12-26

SOL차이나육성산업엑티브상장지

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	6,244	0	6,244	장외
누계	지수	스왑	6,244	0	6,244	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(미래)	3
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(NH)	2
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(메리츠)	3
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(키움)	1

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

(단위:백만원)

10

공시일	2023-12-27
기준일	2023-12-26

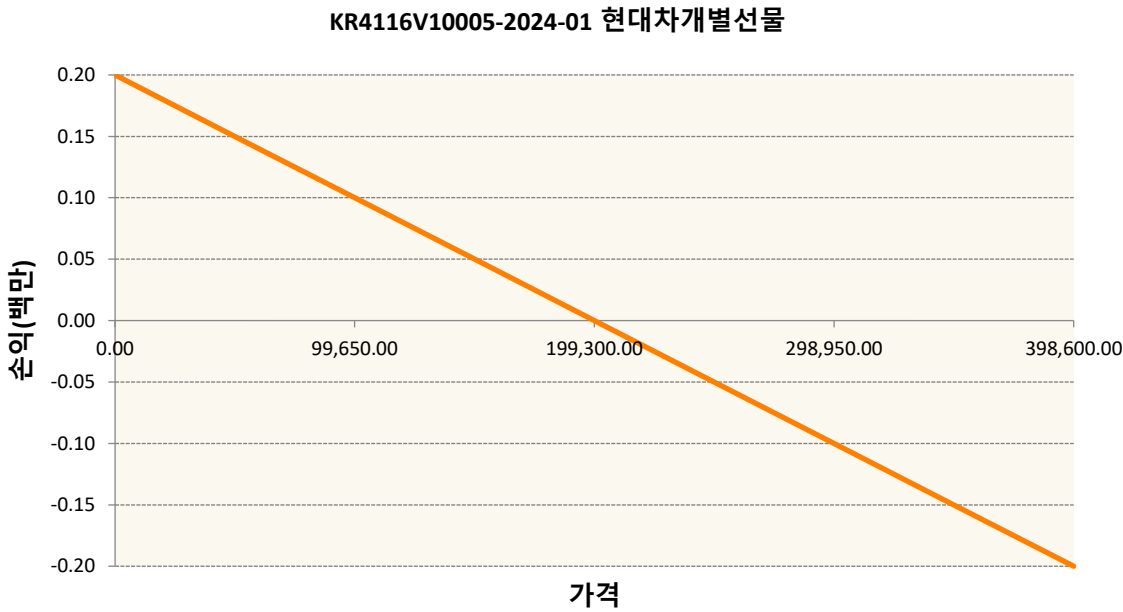
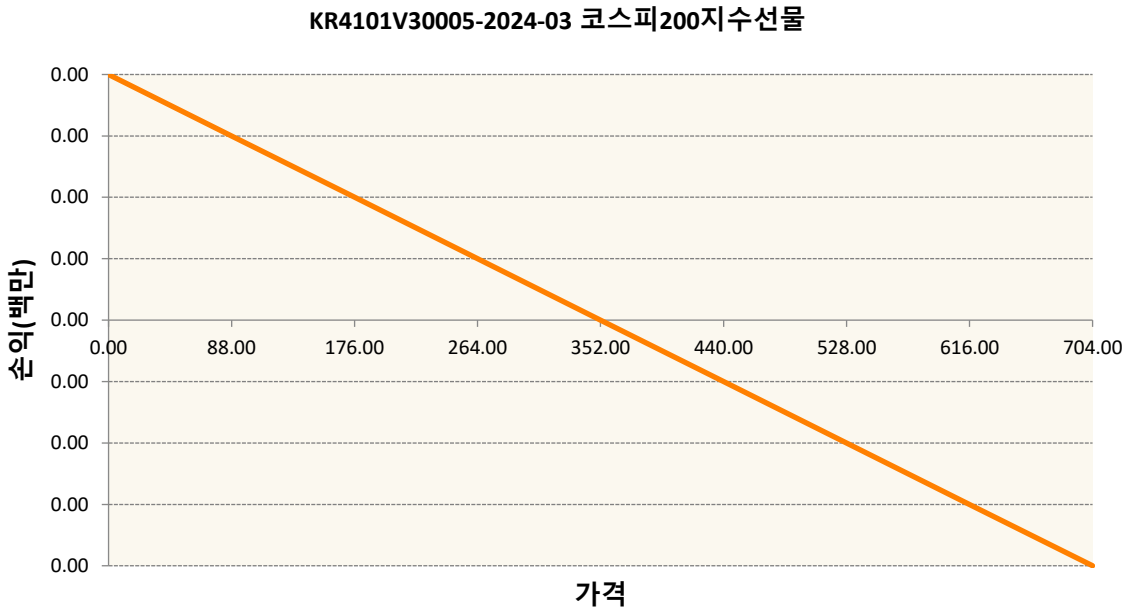
에퀴티알파일반사모혼합자산

1. 계약금액

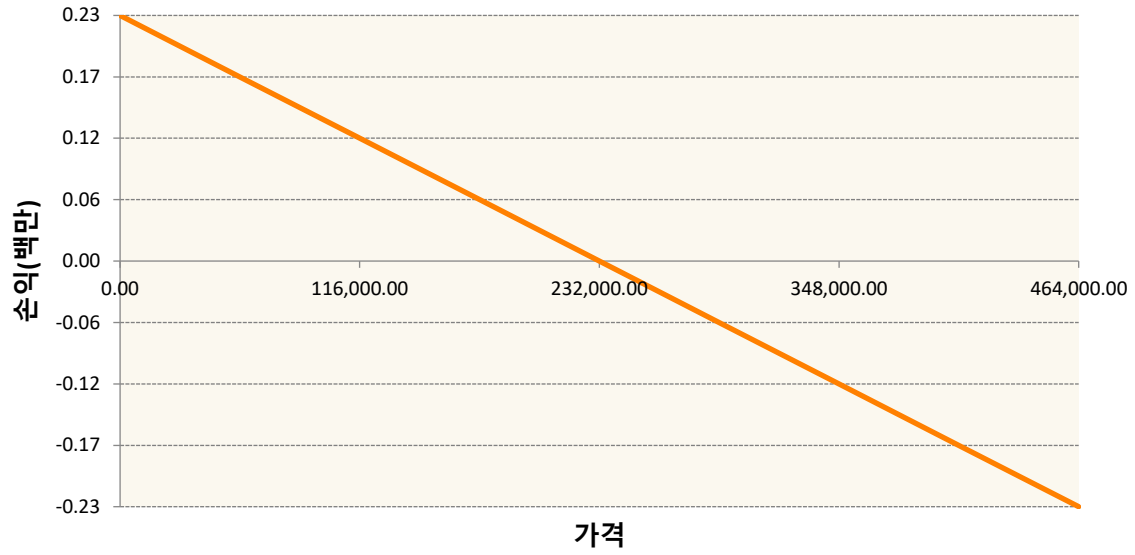
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	1,477	94	1,383	장내
누계	유가증권	선물	52	1,522	-1,470	장내

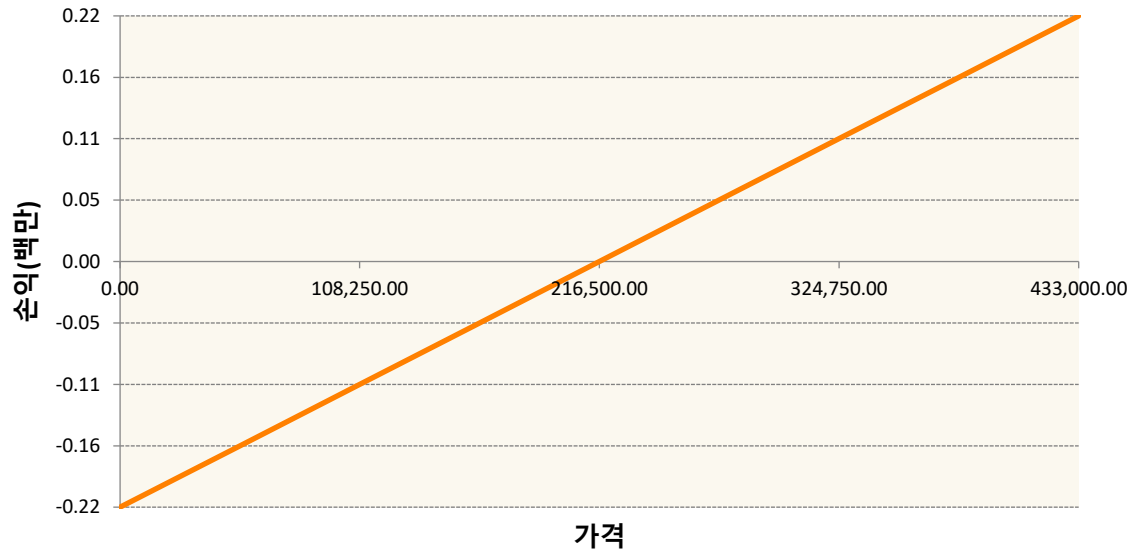
2. 만기시점의 손익구조



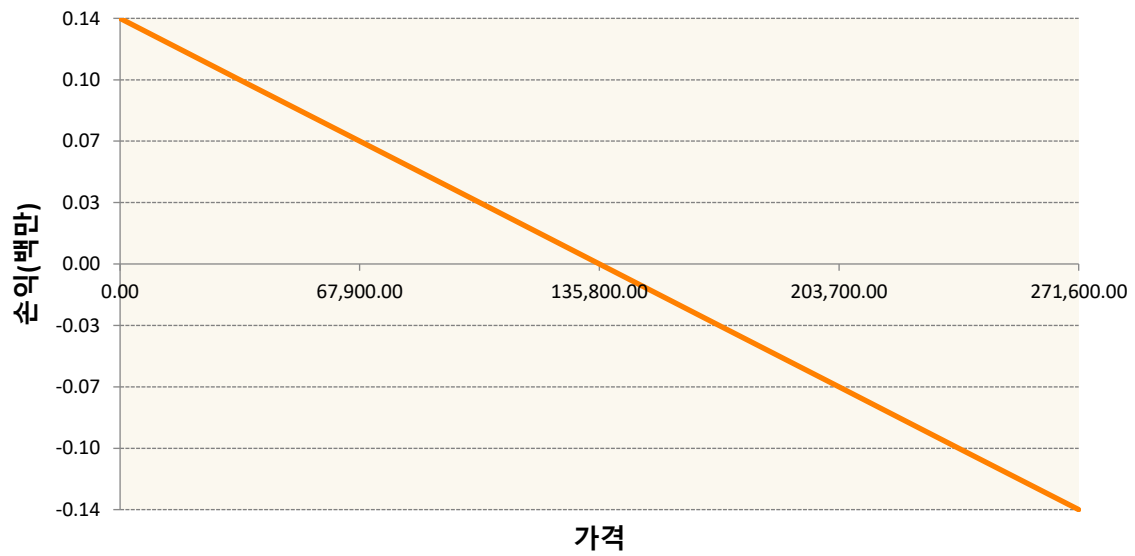
KR4120V10007-2024-01 현대모비스개별선물



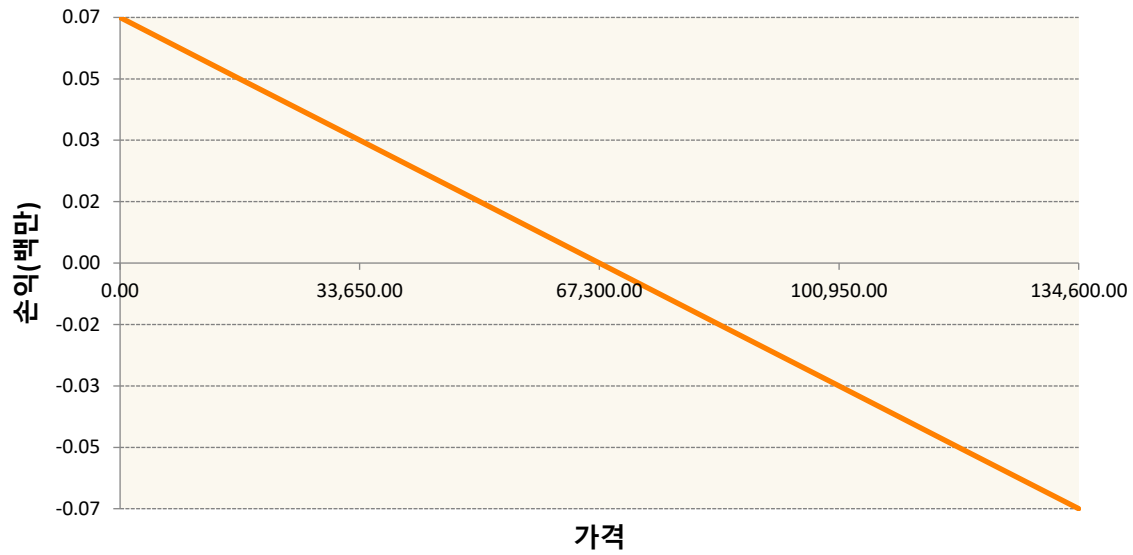
KR4156V10001-2024-01 NAVER개별선물



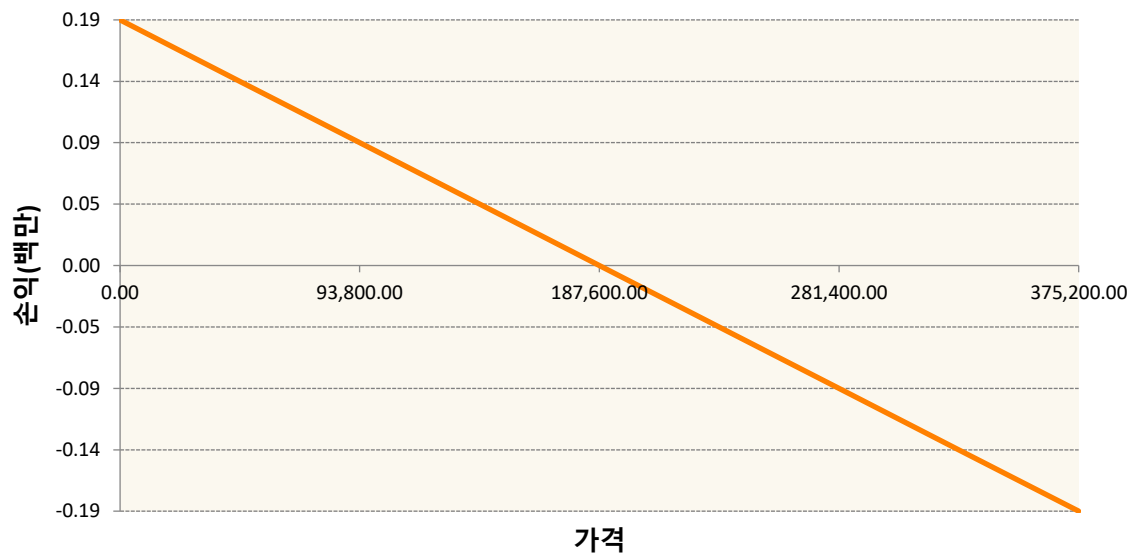
KR41C6V10003-2024-01 아모레퍼시픽개별선물



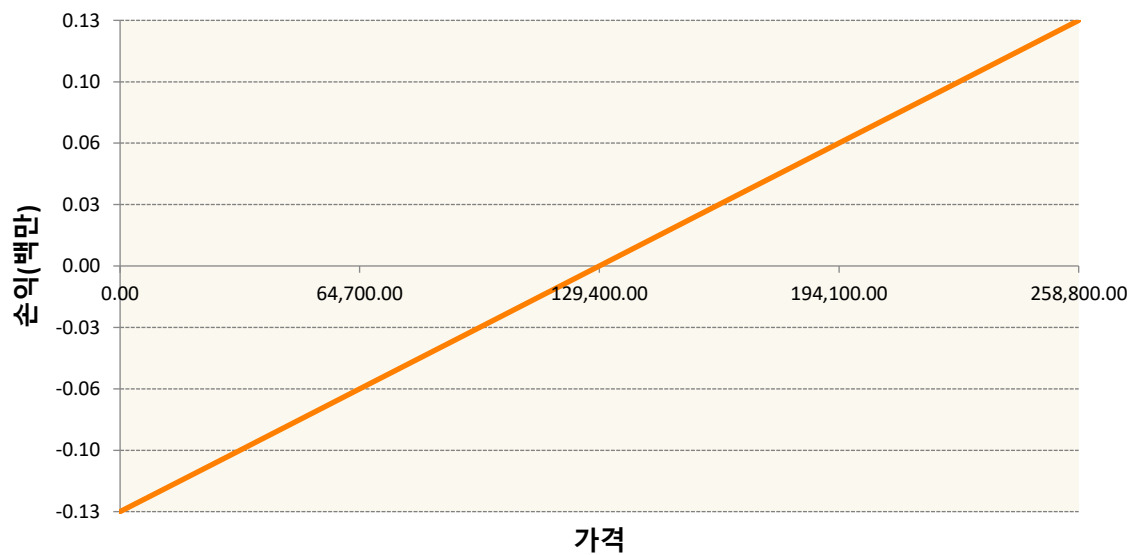
KR41CNV10006-2024-01 포스코DX개별선물



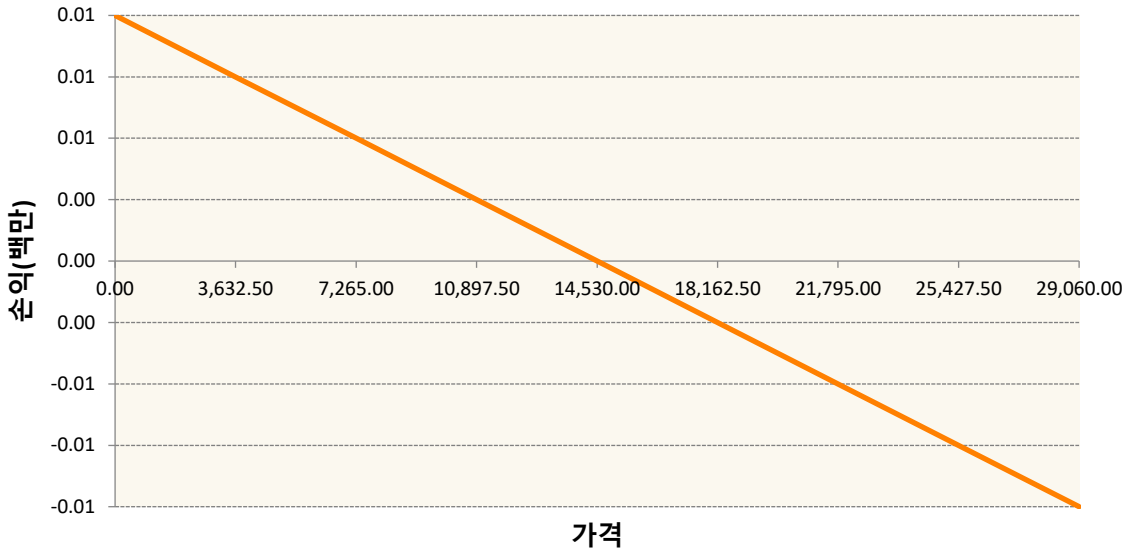
KR41CPV10001-2024-01 셀트리온개별선물



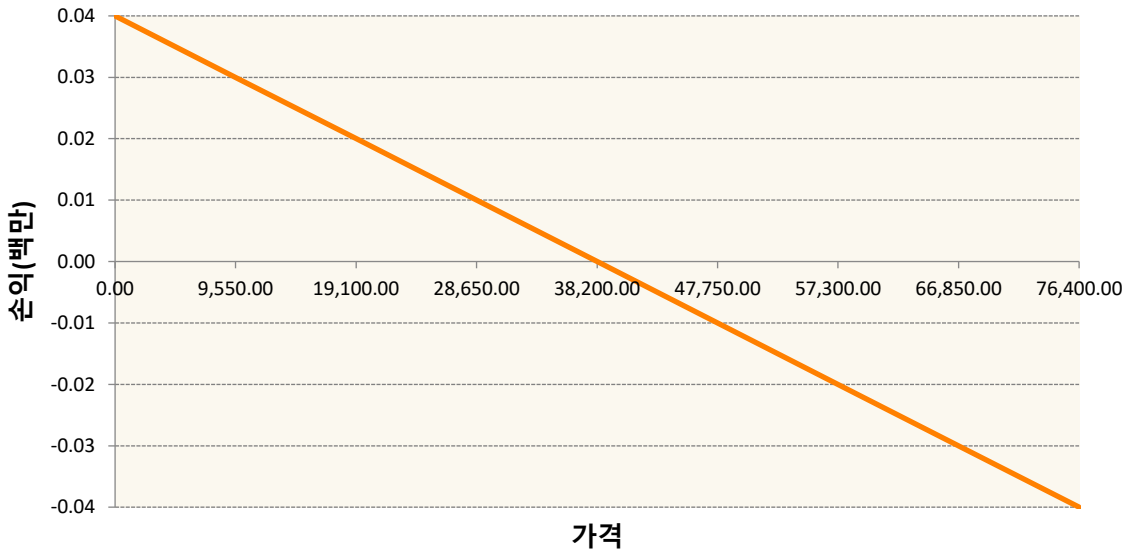
KR41DBV10009-2024-01 LIG넥스원개별선물



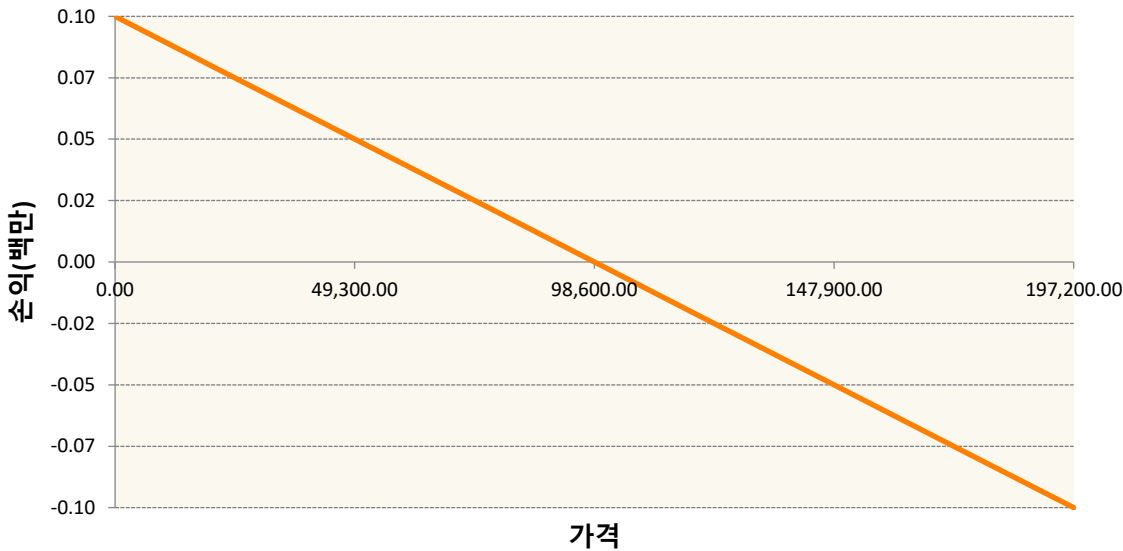
KR41ECV10005-2024-01 HDC현대산업개발개별선물



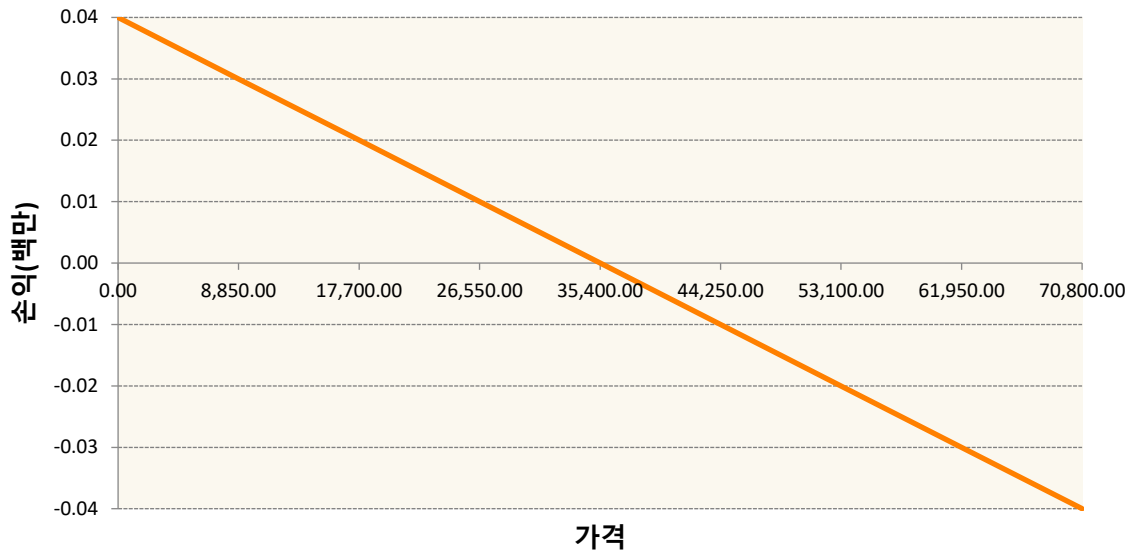
KR41EEV10001-2024-01 한올바이오파마개별선물



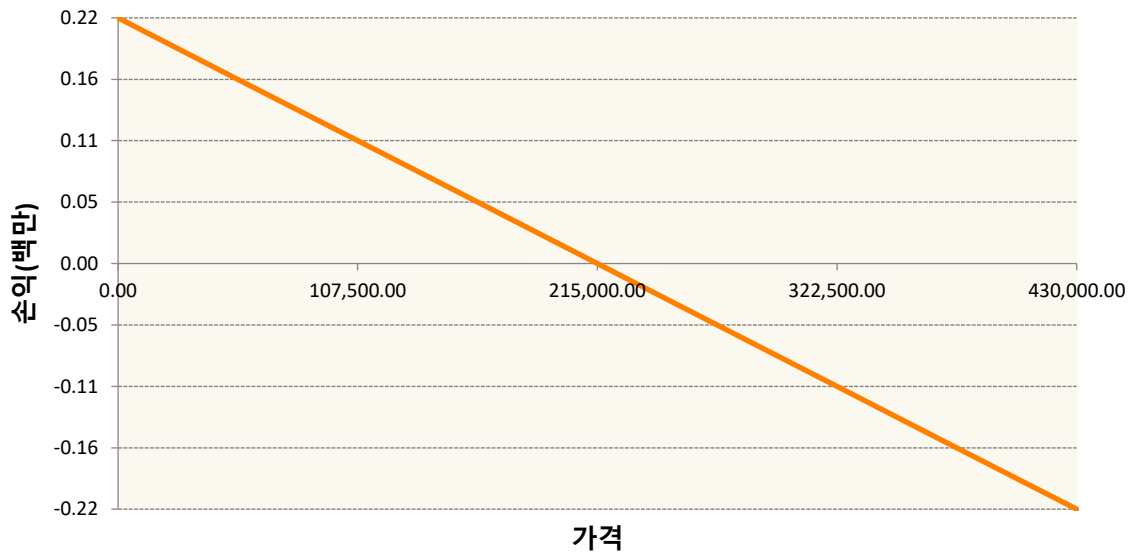
KR41EFV10008-2024-01 JYP Ent.개별선물



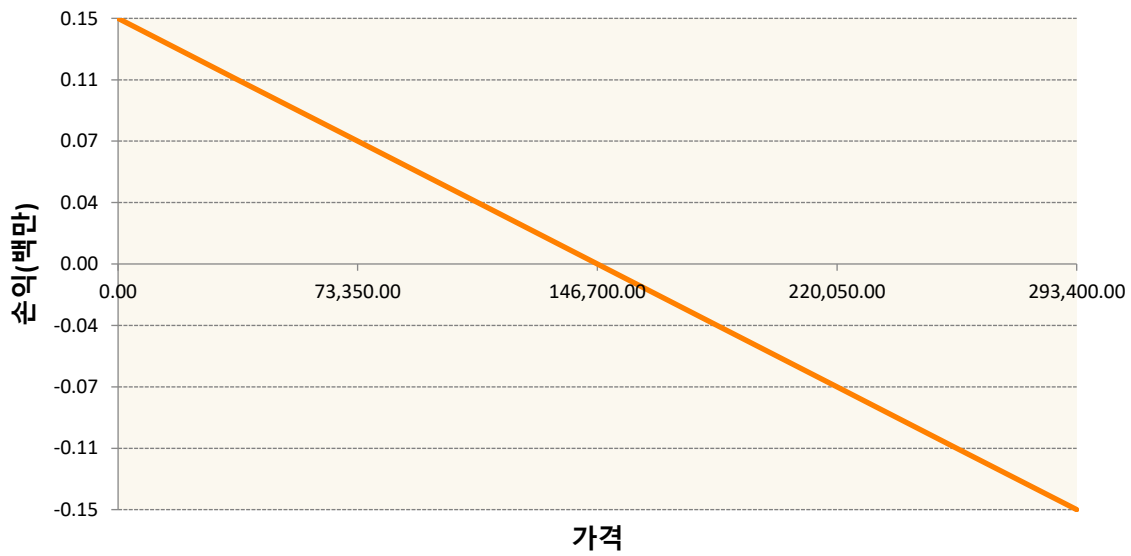
KR41ERV10003-2024-01 DL이앤씨개별선물



KR41G4V10004-2024-01 한솔케미칼개별선물



KR41GCV10000-2024-01 이오테크닉스개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
KR4101V300 2024-03 코스피200지수선물		99
KR4116V100 2024-01 현대차개별선물		3
KR4120V100 2024-01 현대모비스개별선물		2
KR4156V100 2024-01 NAVER개별선물		3
KR41C6V100 2024-01 아모레퍼시픽개별선물		1
KR41CNV100 2024-01 포스코DX개별선물		9
KR41CPV100 2024-01 셀트리온개별선물		3
KR41DBV100 2024-01 LG넥스원개별선물		2
KR41ECV100 2024-01 HDC현대산업개발개별선물		1
KR41EEV100 2024-01 한올바이오파마개별선물		1
KR41EFV100 2024-01 JYP Ent.개별선물		2
KR41ERV100 2024-01 DL이앤씨개별선물		0.2
KR41G4V100 2024-01 한솔케미칼개별선물		1
KR41GCV100 2024-01 이오테크닉스개별선물		1

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	172

공시일	2023-12-27
기준일	2023-12-26

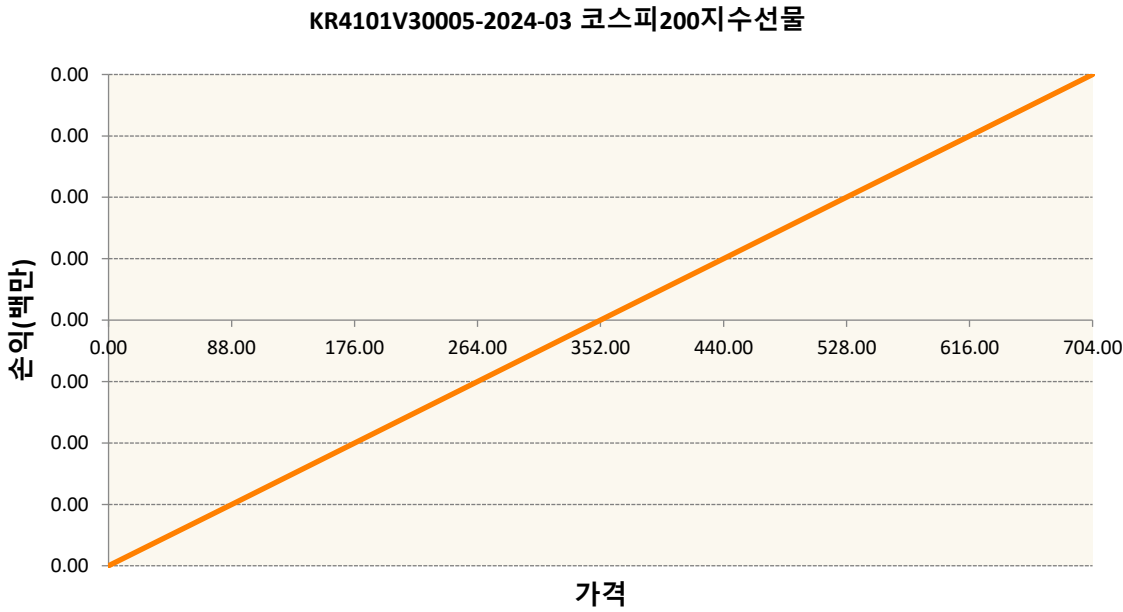
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

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	3,168	0	3,168	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	2023-12-27
기준일	2023-12-26

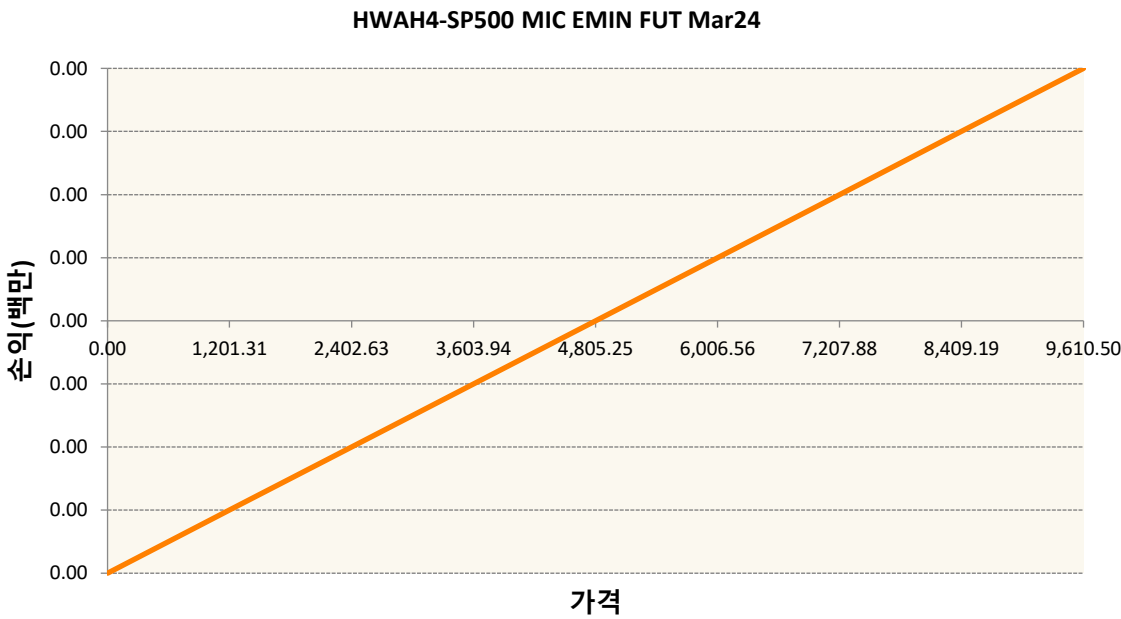
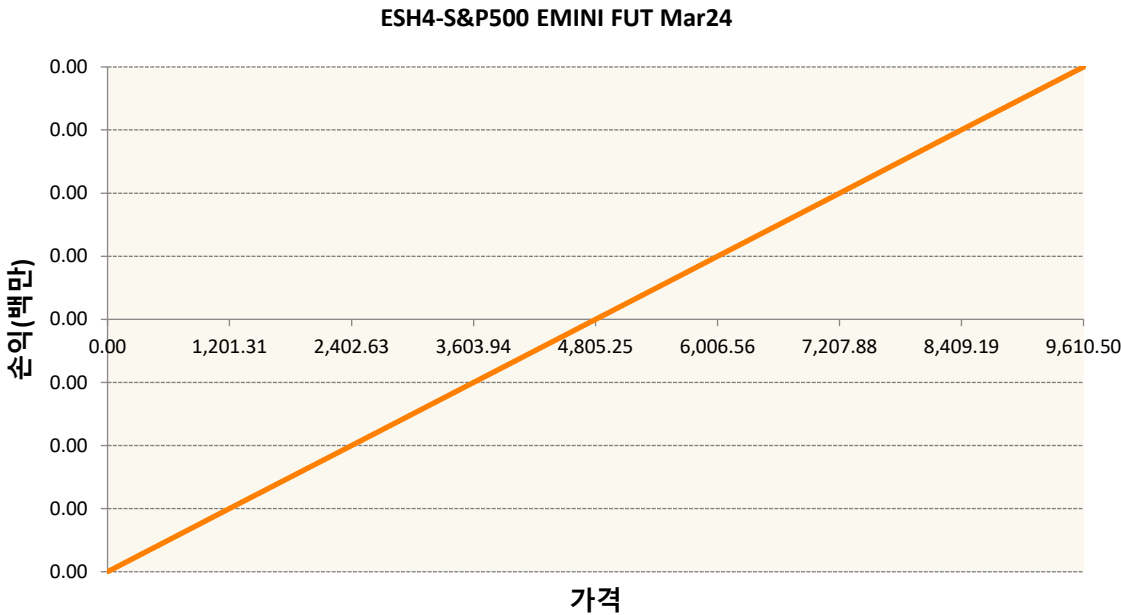
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

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	317	0	317	
누계	유가증권	선물	2,241	0	2,241	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESH4	S&P500 EMINI FUT Mar24	25
HWAH4	SP500 MIC EMIN FUT Mar24	179

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	173

공시일	2023-12-27
기준일	2023-12-26

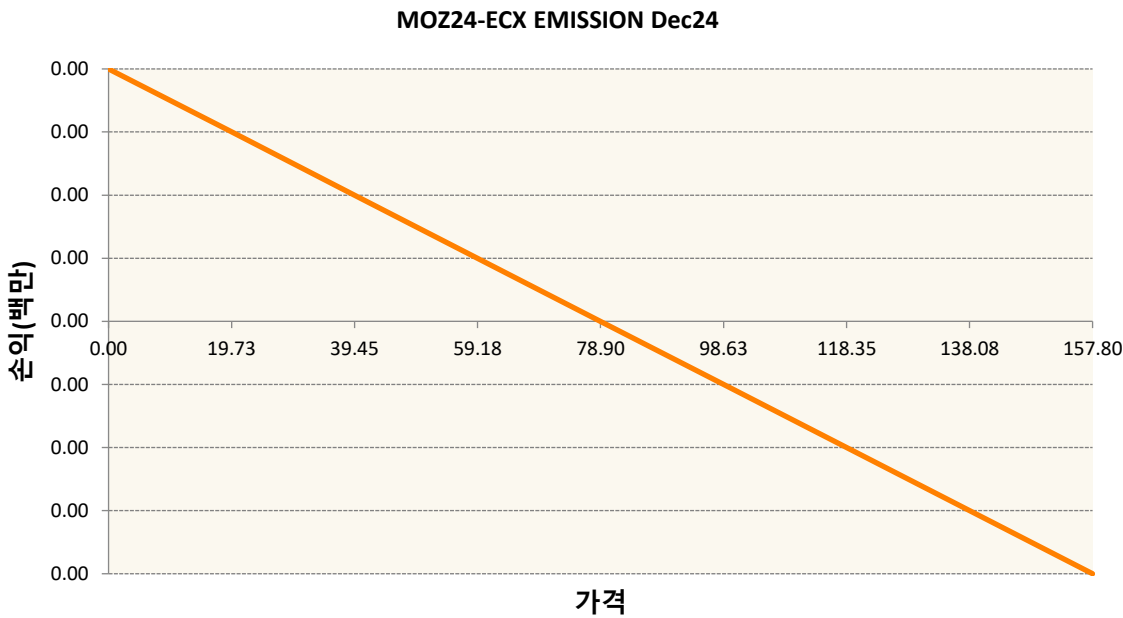
SOL유럽탄소배출권선물인버스ICE특별자산상

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	55	-55	장외
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	0	5,020	-5,020	
누계	지수	스왑	424	0	424	장외
누계	통화	선도	0	3,059	-3,059	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213DBV KRW/EUR 28-12-23E	7
FXW213DBV KRW/EUR 28-12-23E	131
FXW213DCS KRW/EUR 31-01-24E	106
MOZ24 ECX EMISSION Dec24	402
SWICEUACN ICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX	0.45

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

(단위:백만원)

888

공시일	2023-12-27
기준일	2023-12-26

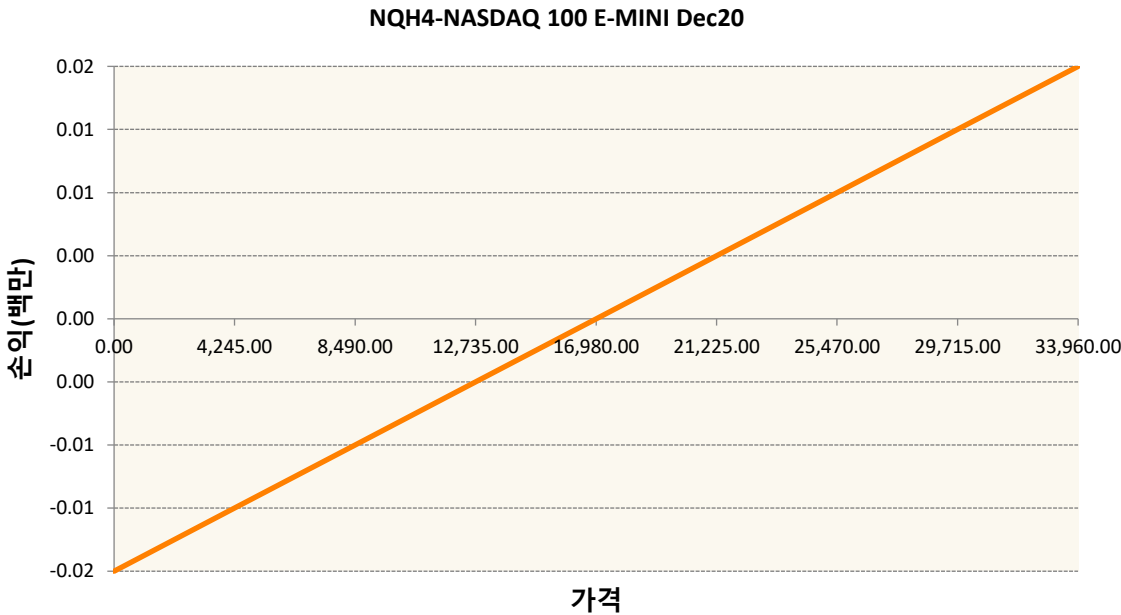
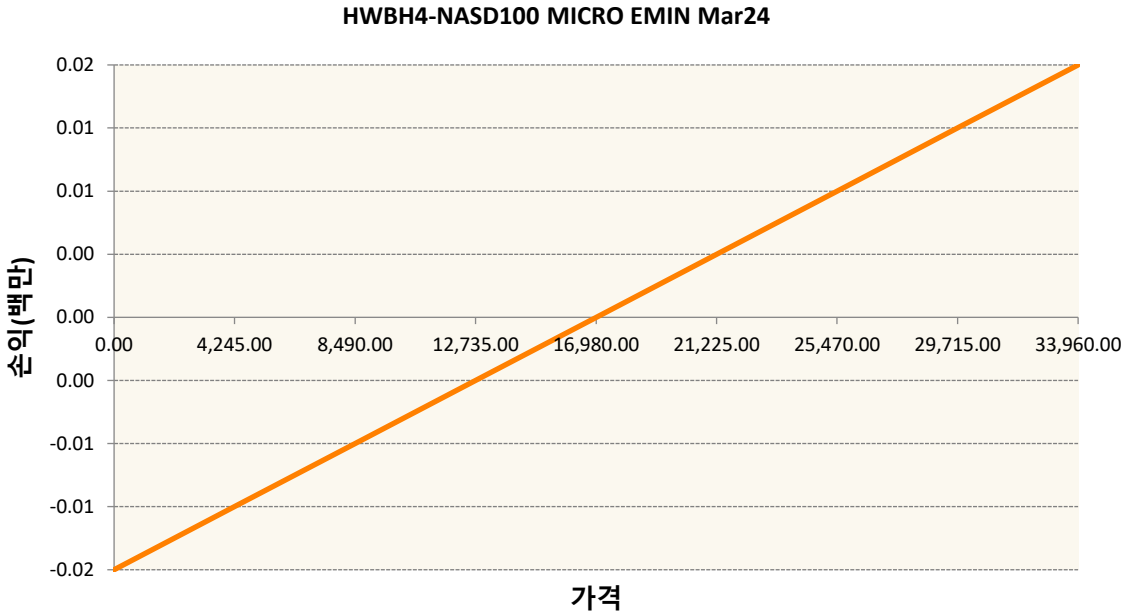
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

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	448	0	448	
누계	유가증권	선물	2,142	0	2,142	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
HWBH4	NASD100 MICRO EMIN Mar24		171
NQH4	NASDAQ 100 E-MINI Dec20		36

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)			(단위:백만원)
			185

공시일	2023-12-27
기준일	2023-12-26

SOL미국30년국채커버드콜(합성)

1. 계약금액

* 해당 펀드는 파생상품을 포함하지 않음

2. 만기시점의 손익구조

* 해당 펀드는 파생상품을 포함하지 않음

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

* 해당 펀드는 파생상품을 포함하지 않음

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

* 해당 펀드는 파생상품을 포함하지 않음

공시일	2023-12-27
기준일	2023-12-26

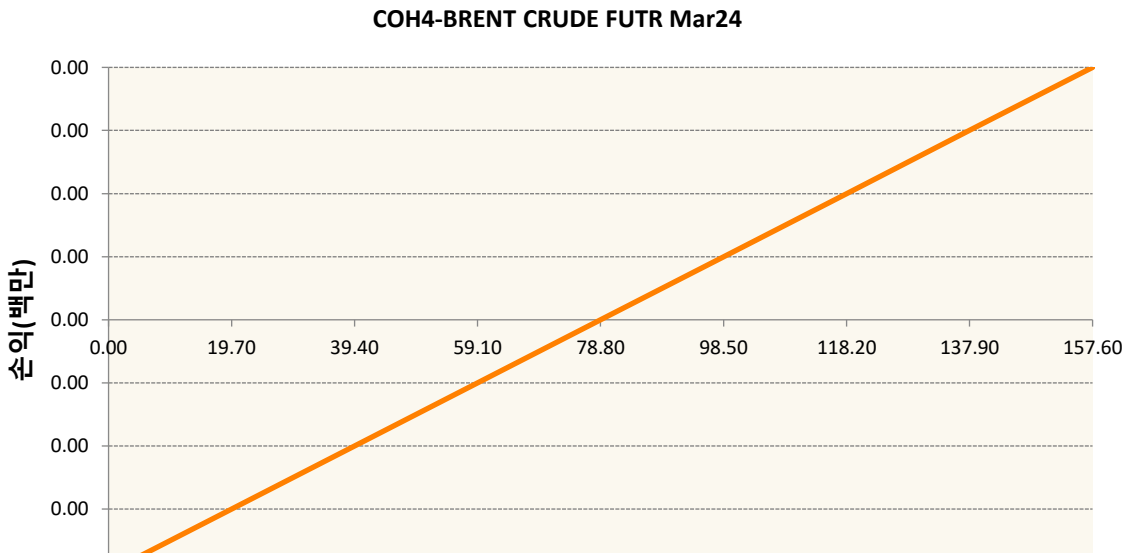
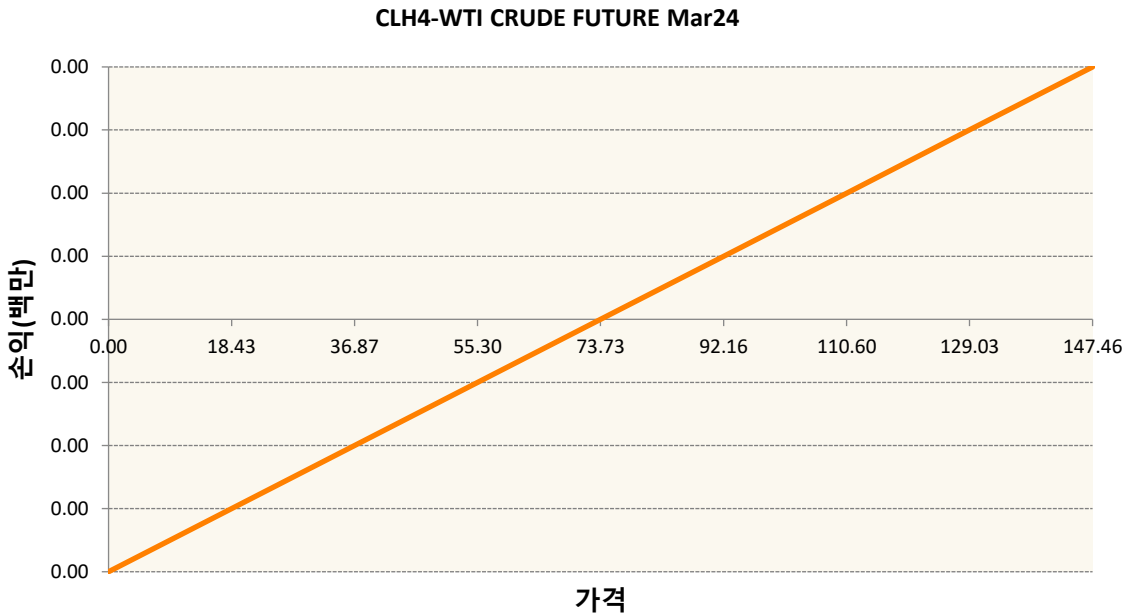
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

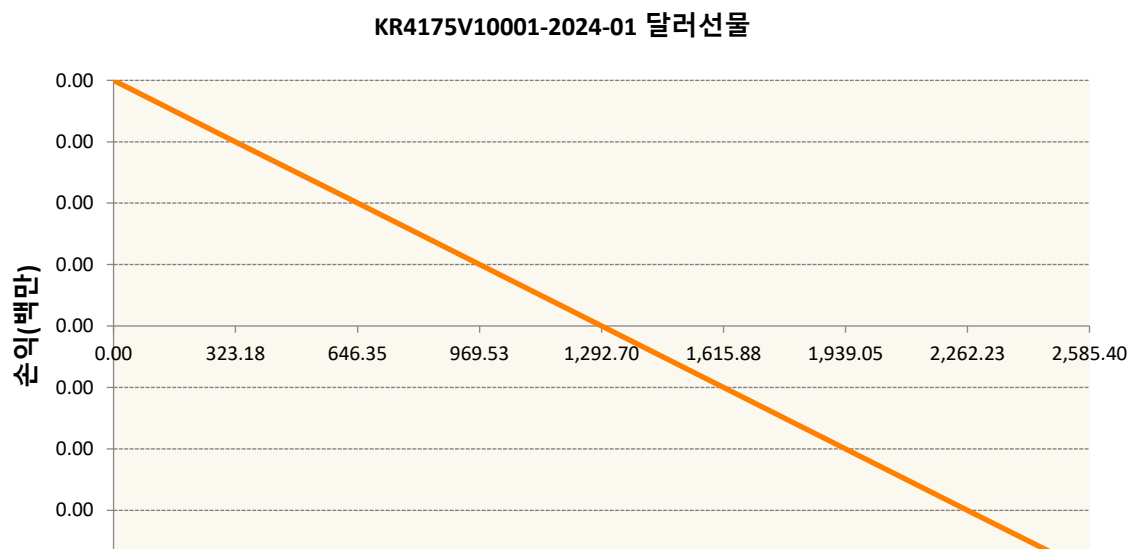
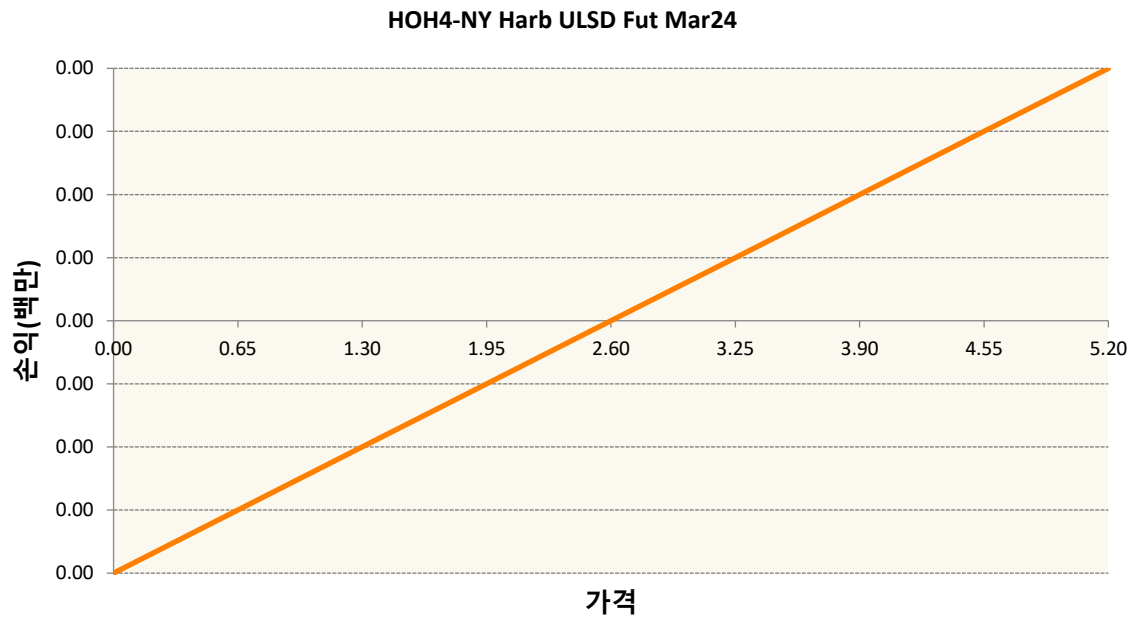
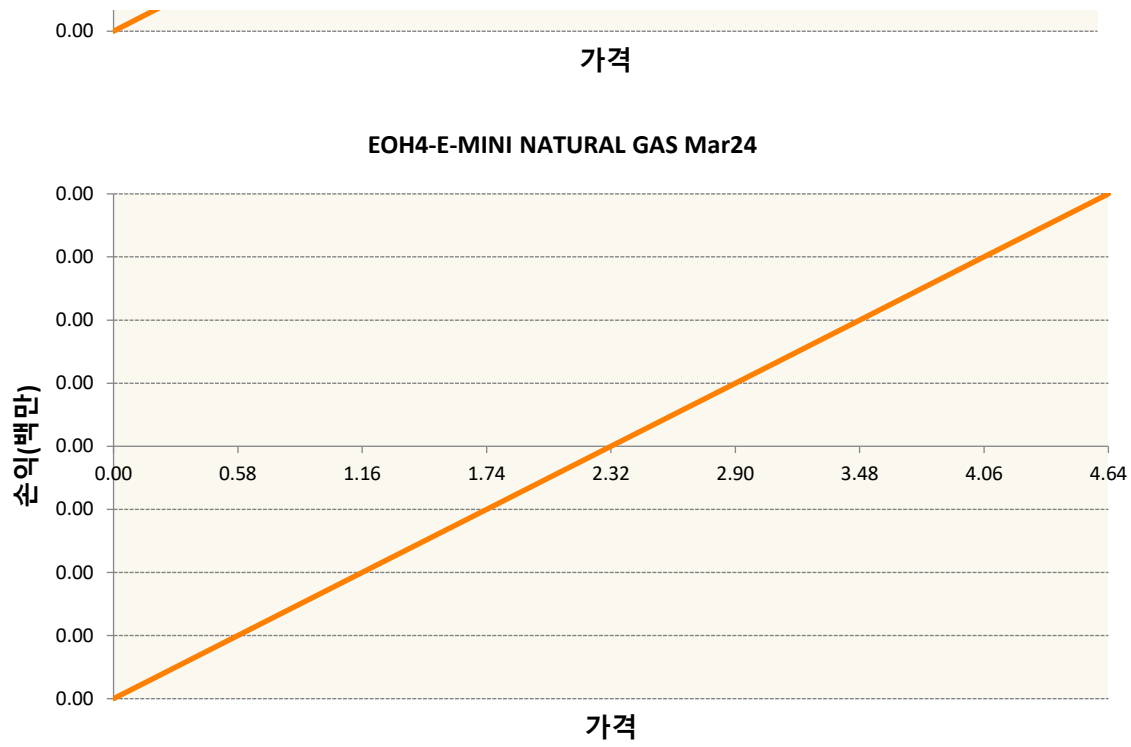
1. 계약금액

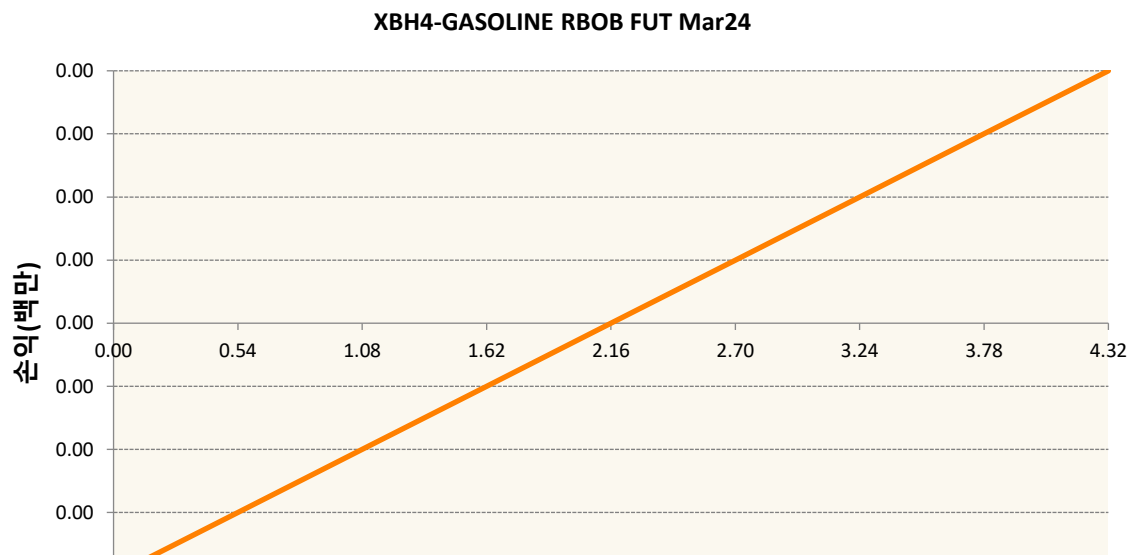
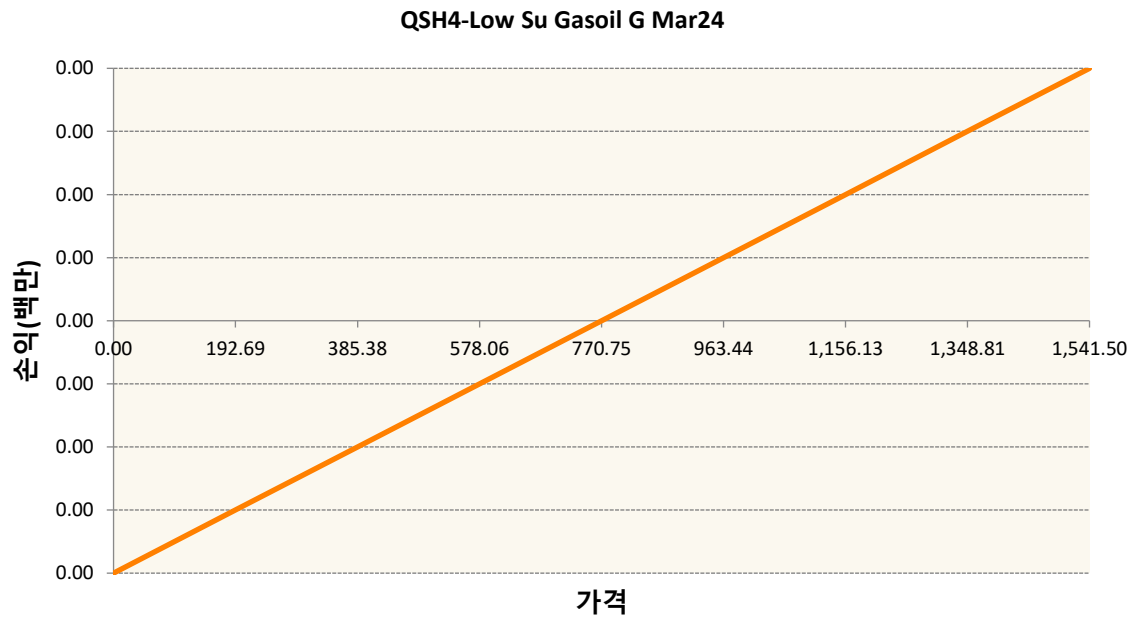
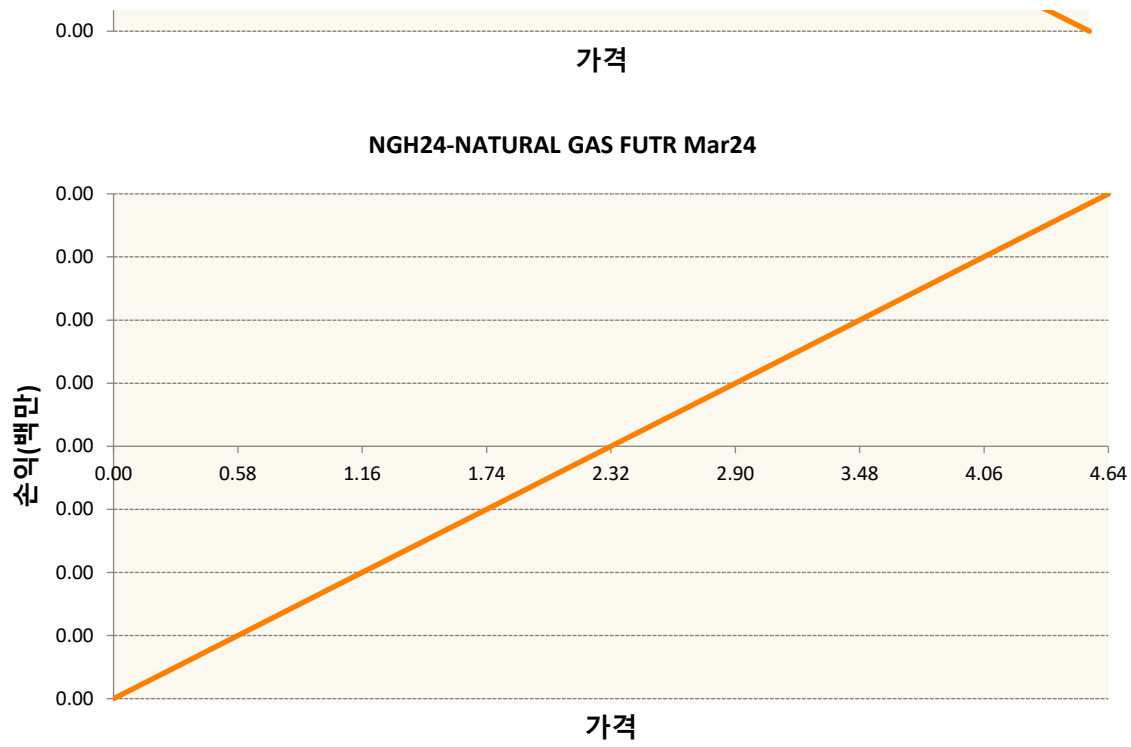
(단위:백만원)

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	0	0	장내
누계	선물	유가증권	291	0	291	
누계	유가증권	선물	880	0	880	
누계	통화	선물	0	181	-181	장내

2. 만기시점의 손익구조







0.00

가격

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	11
KR4175V100 2024-01	달러선물	14
NGH24	NATURAL GAS FUTR Mar24	15
QSH4	Low Su Gasoil G Mar24	8
XBH4	GASOLINE RBOB FUT Mar24	10

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

(단위:백만원)

224