

공시일	2023-12-29
기준일	2023-12-28

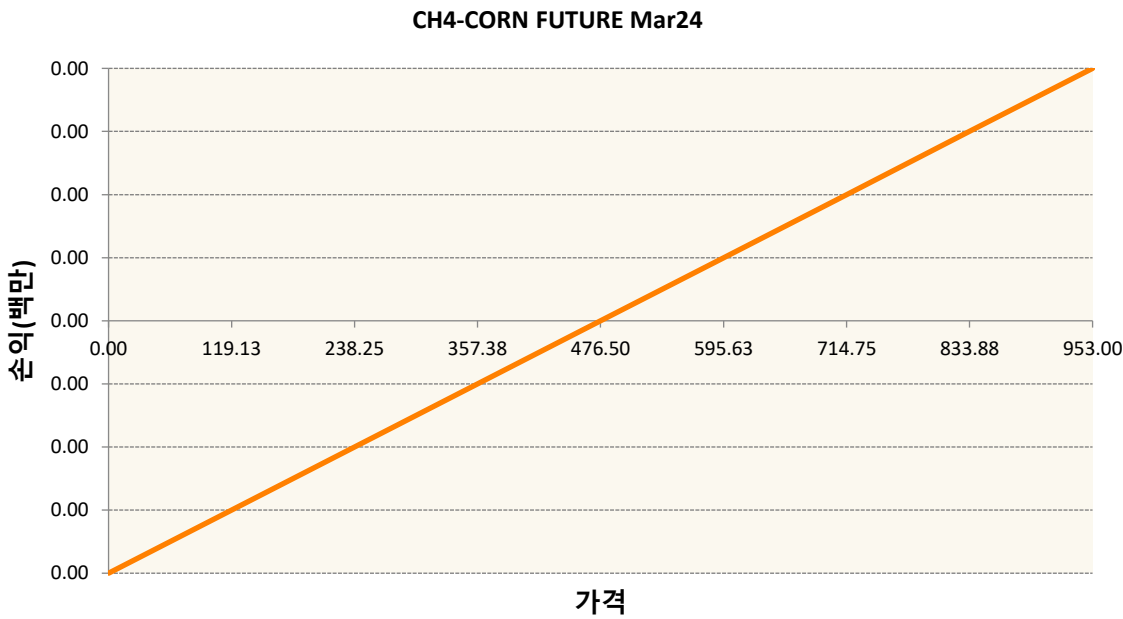
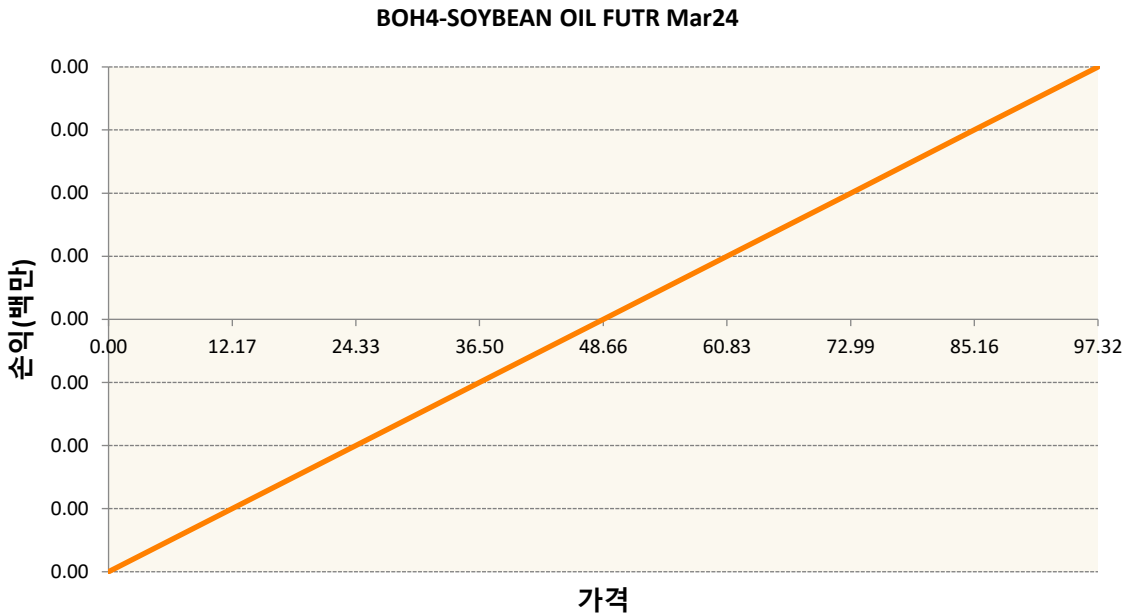
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

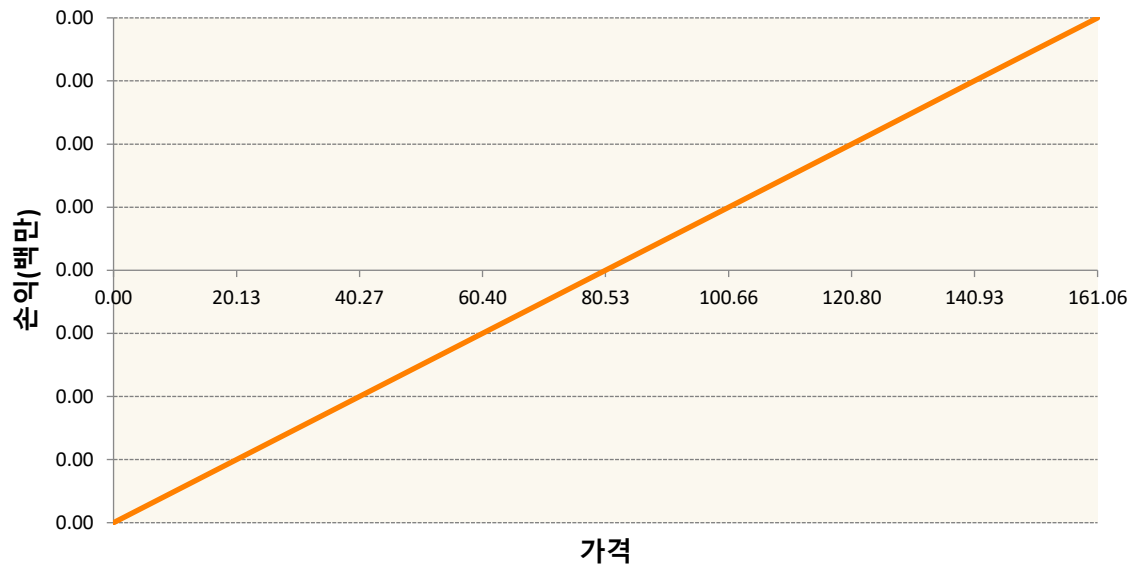
(단위:USD 백만)

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	4,718	0	4,718	
누계	통화	선물	0	476	-476	장내

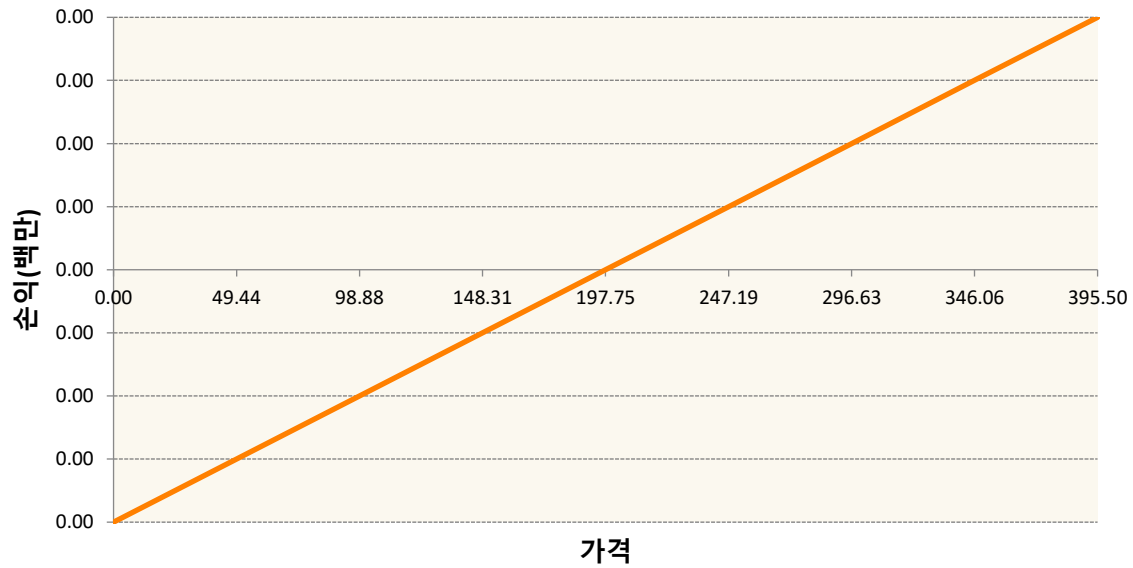
2. 만기시점의 손익구조



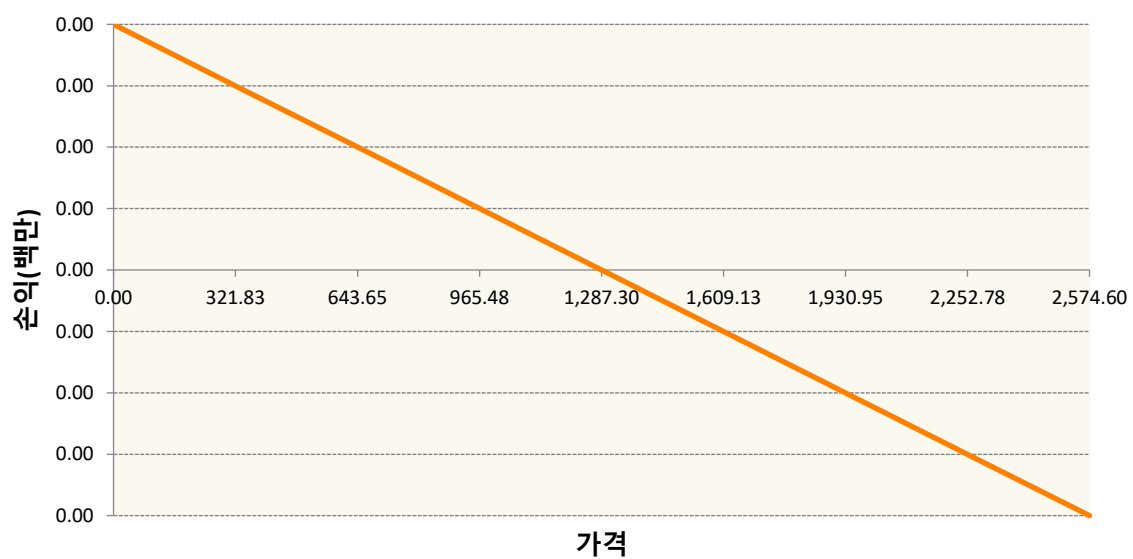
CTH4-COTTON NO.2 FUTR Mar24



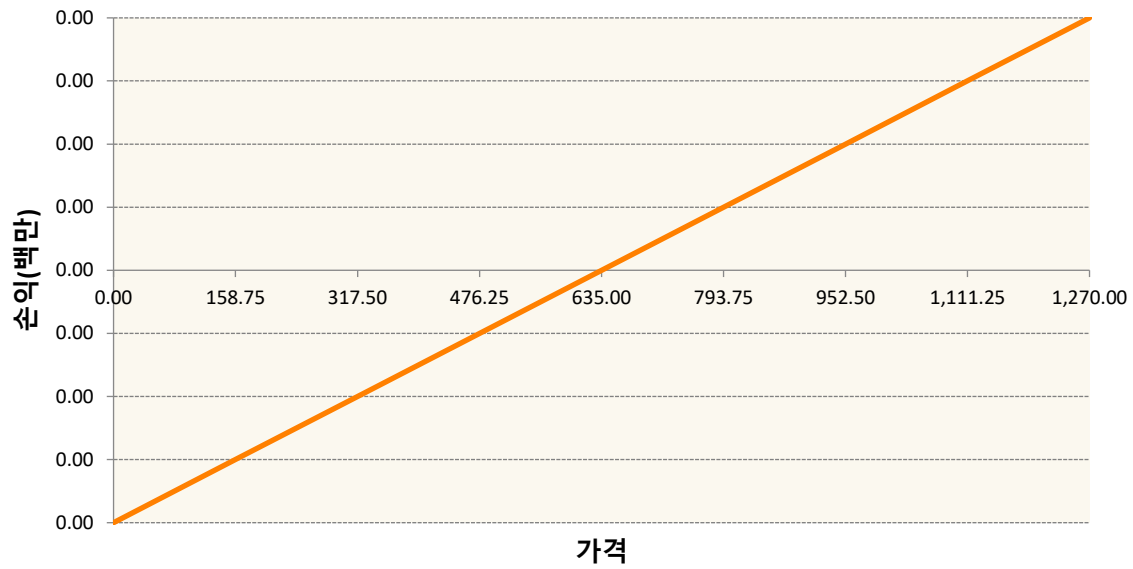
KCH4-COFFEE 'C' FUTURE Mar24



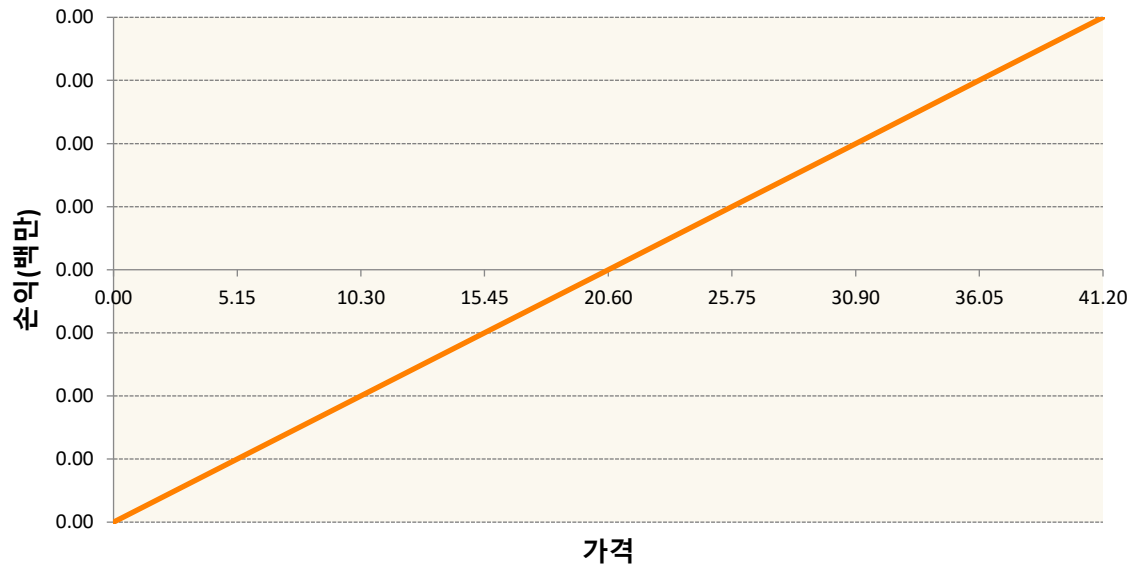
KR4175V10001-2024-01 달러선물



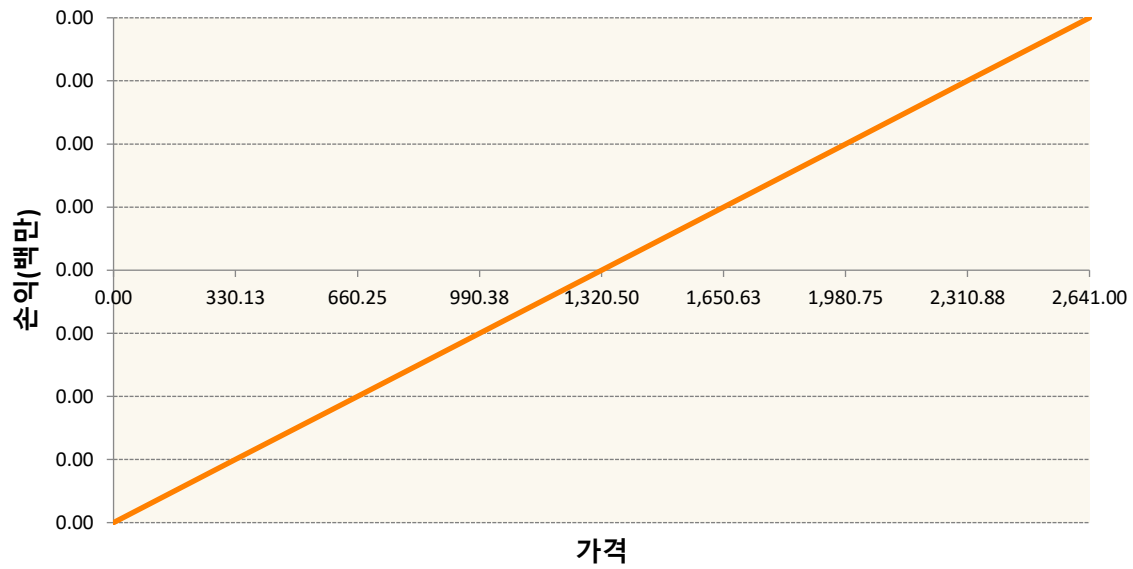
KWH4-KC HRW WHEAT FUT Mar24



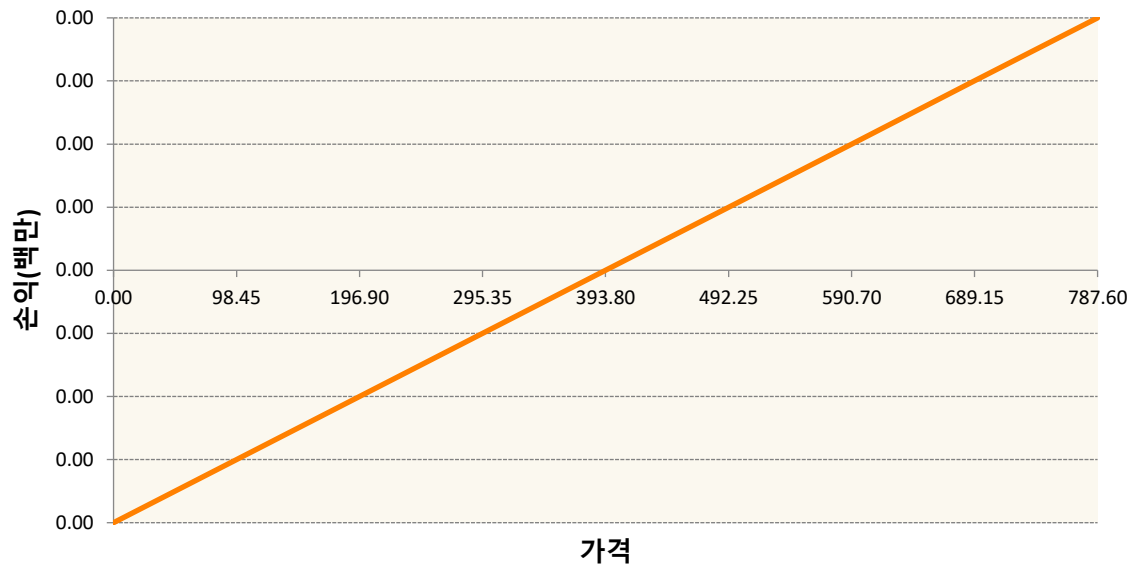
SBH4-Sugar #11 (WORLD) Mar24



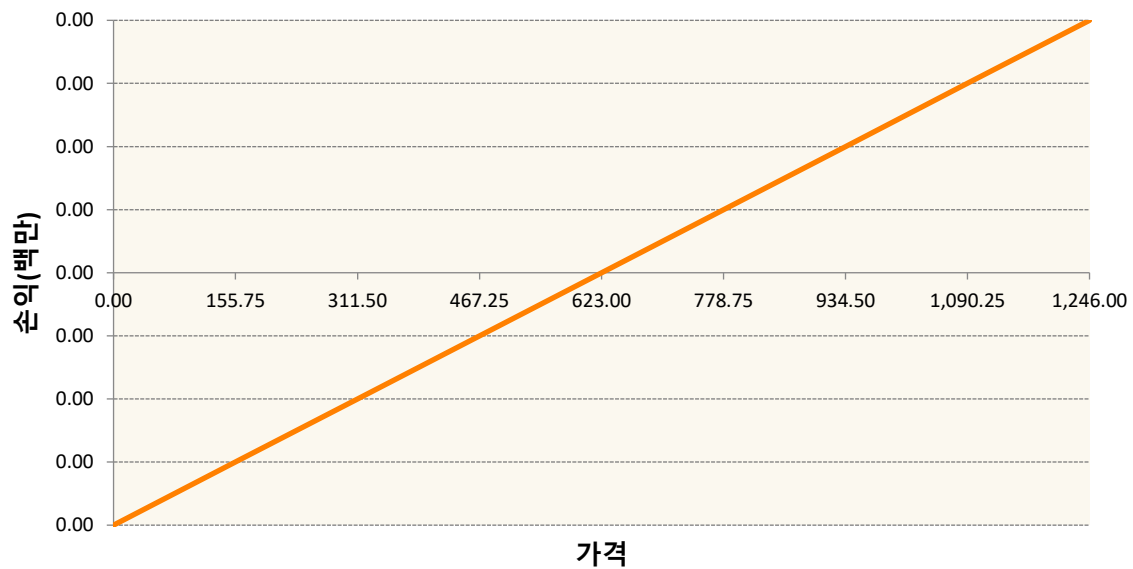
SH4-SOYBEAN FUTURE Mar24



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	2023-12-29
기준일	2023-12-28

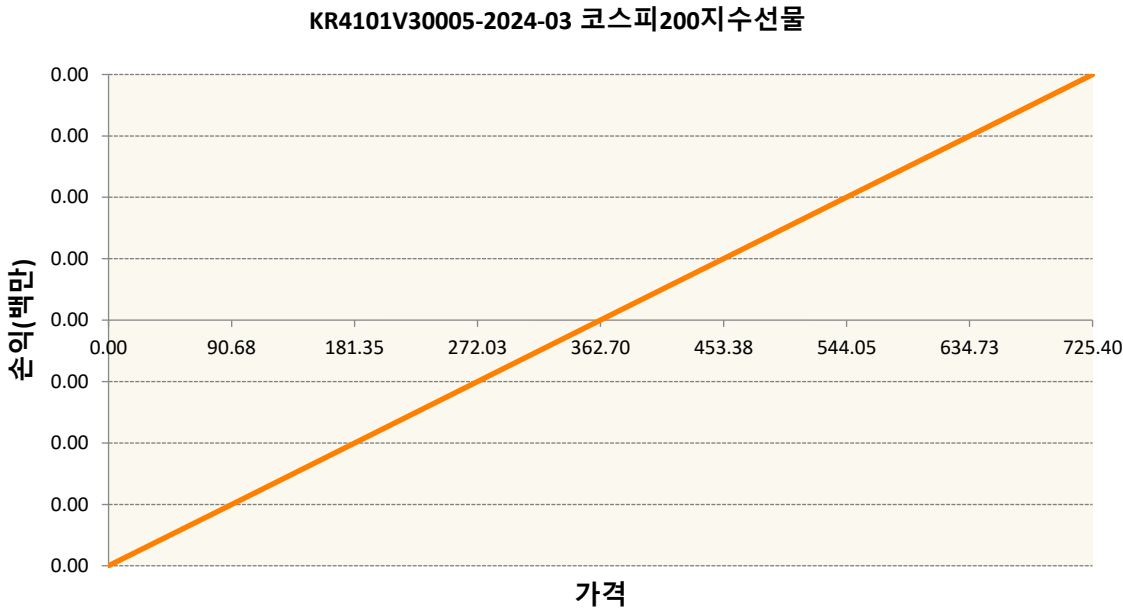
스마트인덱스모

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	181	-181	장내
누계	유가증권	선물	1,360	0	1,360	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101V30005		2024-03 코스피200지수선물					107
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-107	-107	-107	-107	-107	-107	-107
-5.33%	-72	-72	-72	-72	-72	-72	-72
-2.67%	-36	-36	-36	-36	-36	-36	-36
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	36	36	36	36	36	36	36
5.33%	72	72	72	72	72	72	72
8.00%	107	107	107	107	107	107	107

공시일	2023-12-29
기준일	2023-12-28

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	3,779	0	3,779	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 신한CSI500미래231226	299
-----------------------------	-----

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

261

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2023-12-29
기준일	2023-12-28

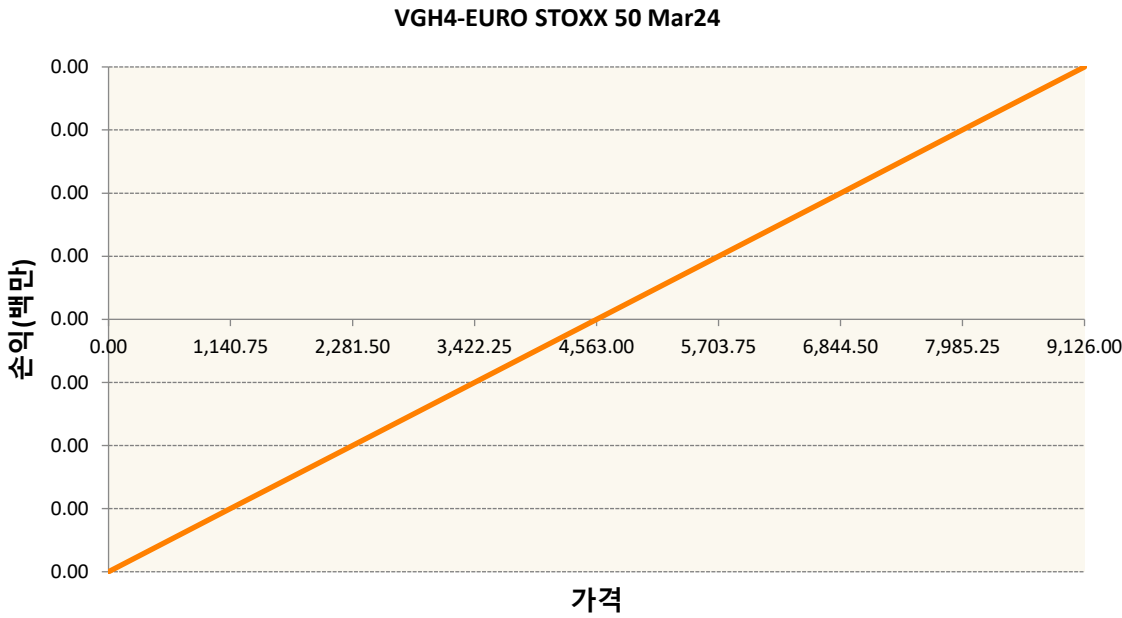
유로인덱스모(주식-파생형)

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	974	0	974	
누계	통화	선도	215	0	215	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	2023-12-29
기준일	2023-12-28

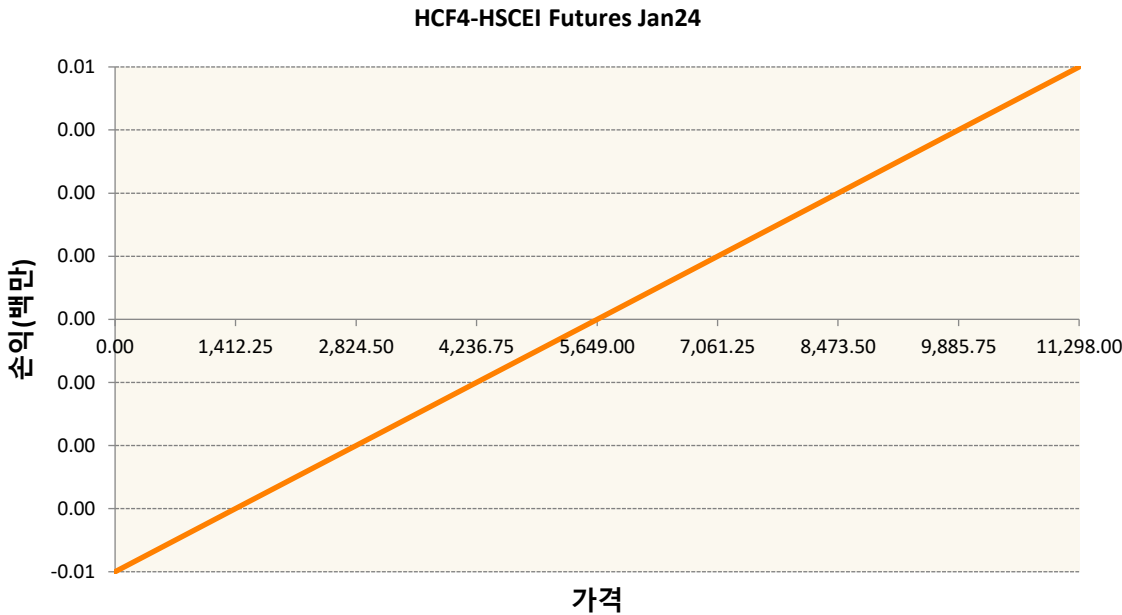
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,123	0	1,123	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCF4	HSCEI Futures Jan24	90
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

130

공시일	2023-12-29
기준일	2023-12-28

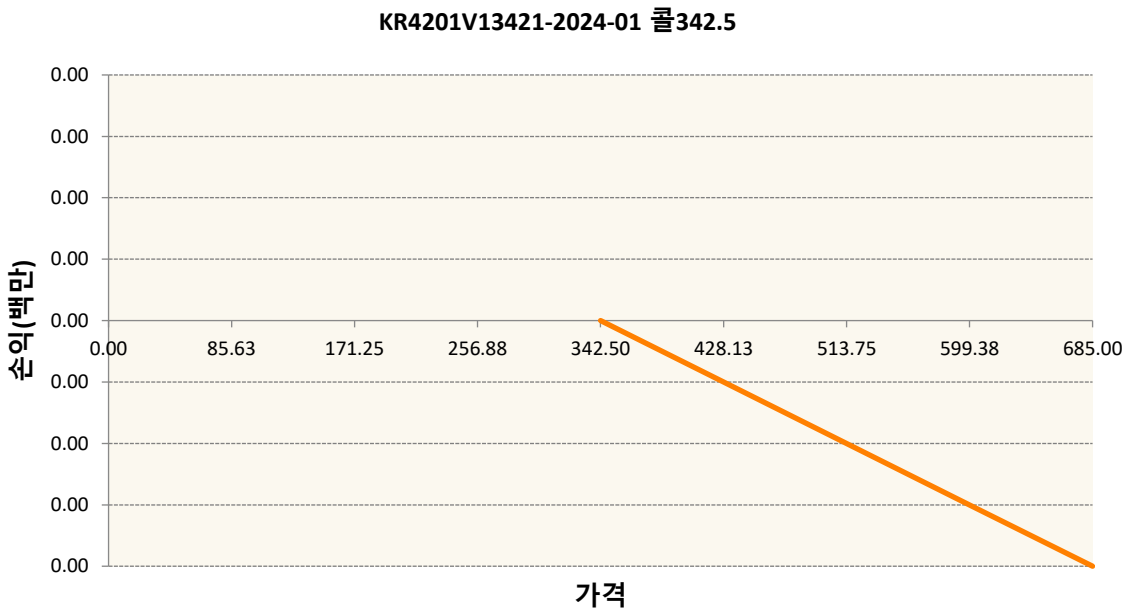
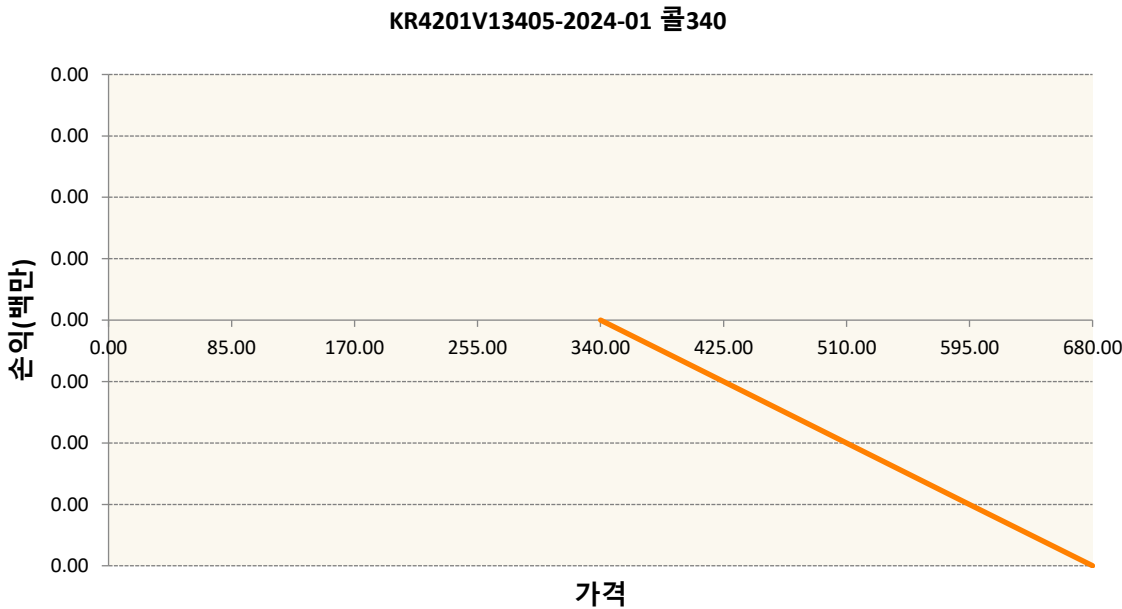
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	650	0	650	장내
누계	유가증권	옵션	0	49,660	-49,660	장내

2. 만기시점의 손익구조



KR4301V13403-2024-01 풋340



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201V13405		2024-01 콜340						1,216
		기초자산의 변동성						
가격		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	805	786	766	745	723	701	678	
-5.33%	660	634	608	582	556	530	504	
-2.67%	398	376	353	330	306	282	257	
0%	42	29	16	0	-17	-35	-54	
2.67%	-362	-367	-373	-381	-391	-402	-414	
5.33%	-783	-784	-786	-789	-793	-799	-806	
8.00%	-1,206	-1,207	-1,207	-1,208	-1,210	-1,212	-1,216	
KR4201V13421		2024-01 콜342.5						2,047
		기초자산의 변동성						
가격		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,255	1,226	1,196	1,163	1,129	1,093	1,057	
-5.33%	1,053	1,010	966	922	879	834	790	
-2.67%	657	616	574	531	488	445	401	
0%	84	59	31	0	-33	-67	-103	
2.67%	-590	-600	-614	-631	-651	-673	-698	
5.33%	-1,303	-1,306	-1,311	-1,318	-1,328	-1,340	-1,354	
8.00%	-2,026	-2,027	-2,028	-2,030	-2,034	-2,040	-2,047	
KR4301V13403		2024-01 풋340						335
		기초자산의 변동성						
가격		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-263	-274	-285	-297	-309	-322	-335	
-5.33%	-106	-121	-135	-150	-165	-179	-194	
-2.67%	-15	-27	-40	-53	-67	-80	-94	
0%	23	17	9	0	-9	-20	-30	

2.67%	35	32	29	24	19	13	6
5.33%	37	37	35	34	31	28	24
8.00%	38	38	37	37	36	34	32

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

(단위:백만원)

3,731

공시일	2023-12-29
기준일	2023-12-28

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	1,935	0	1,935	

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	2023-12-29
기준일	2023-12-28

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	4,488	0	4,488	

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	2023-12-29
기준일	2023-12-28

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	17,514	0	17,514	
누계	통화	선도	0	23,409	-23,409	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
FXW213D9R\KRW/USD 29-12-23E		500
FXW213DAT\KRW/USD 31-01-24E		184
FXW213DBV\KRW/USD 29-02-24E		633
FXW213DCB\KRW/USD 31-01-24E		26
FXW213DCS\KRW/USD 31-01-24E		31
FXW213DCT\KRW/USD 29-03-24E		500
IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	969

공시일	2023-12-29
기준일	2023-12-28

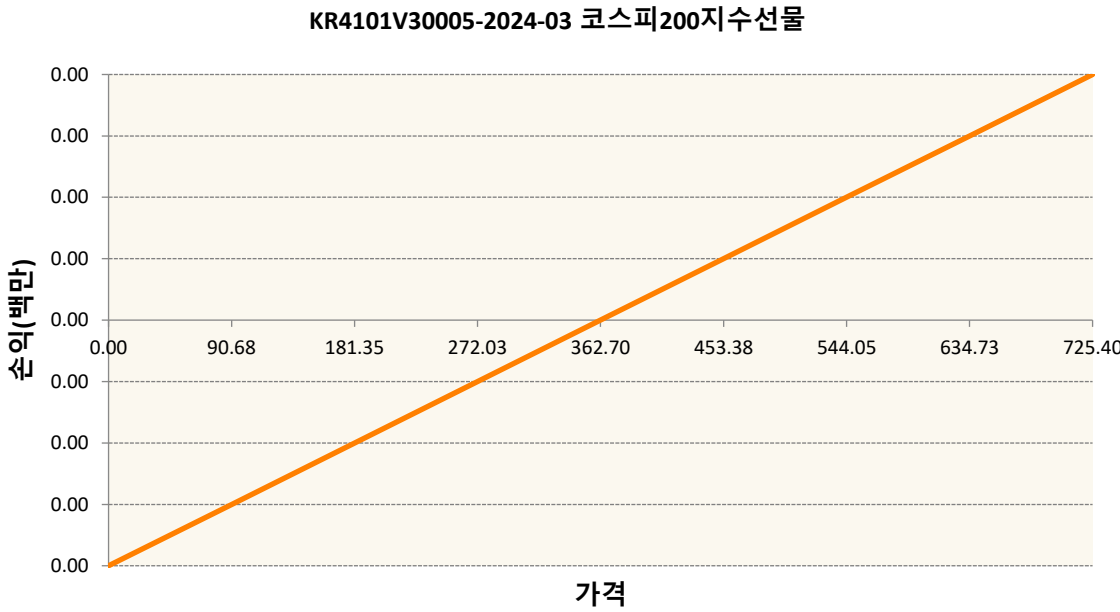
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

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	544	0	544	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101V30005			2024-03 코스피200지수선물				43
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-43	-43	-43	-43	-43	-43	-43
-5.33%	-29	-29	-29	-29	-29	-29	-29
-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%	29	29	29	29	29	29	29
8.00%	43	43	43	43	43	43	43

공시일	2023-12-29
기준일	2023-12-28

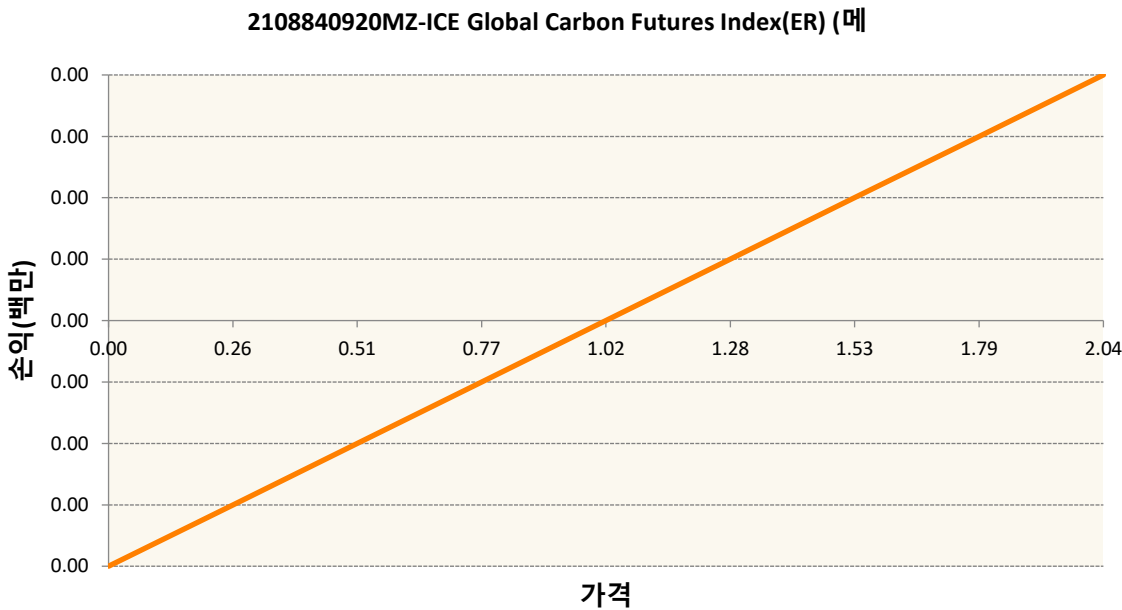
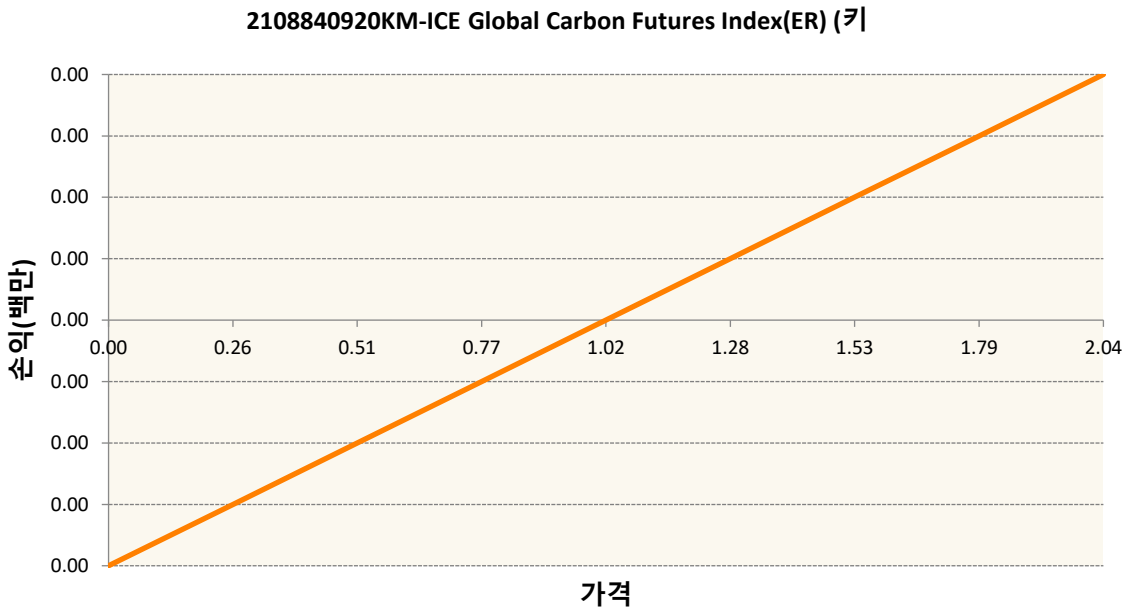
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

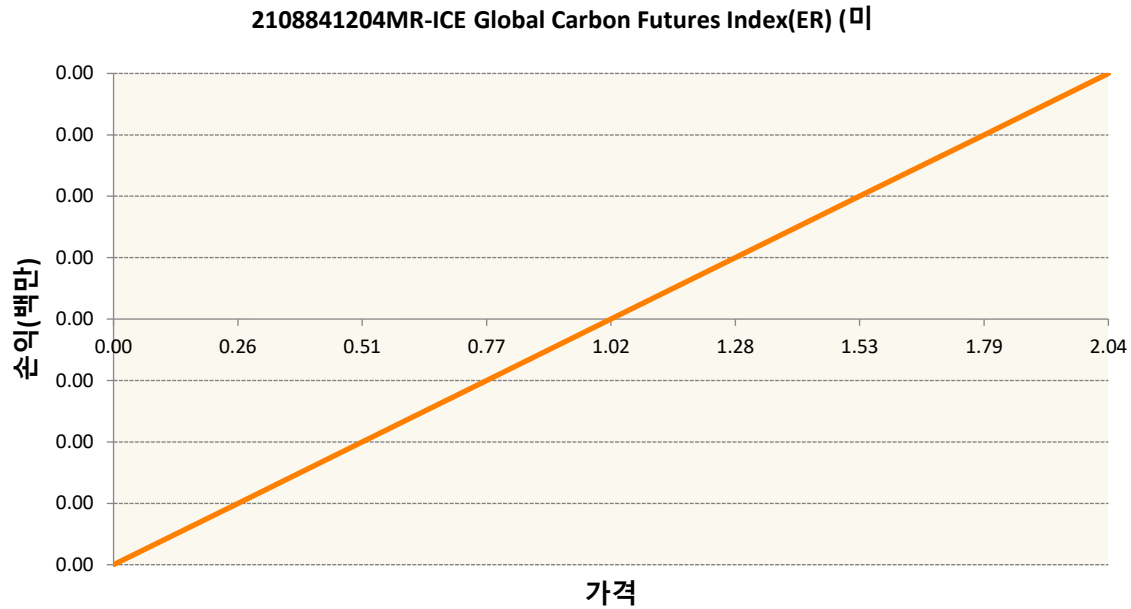
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	20,268	0	20,268	

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108840920ICE Global Carbon Futures Index(ER) (키		1,015
2108840920ICE Global Carbon Futures Index(ER) (메		203
2108841204ICE Global Carbon Futures Index(ER) (미		406

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)		(단위:백만원)
		2,054

공시일	2023-12-29
기준일	2023-12-28

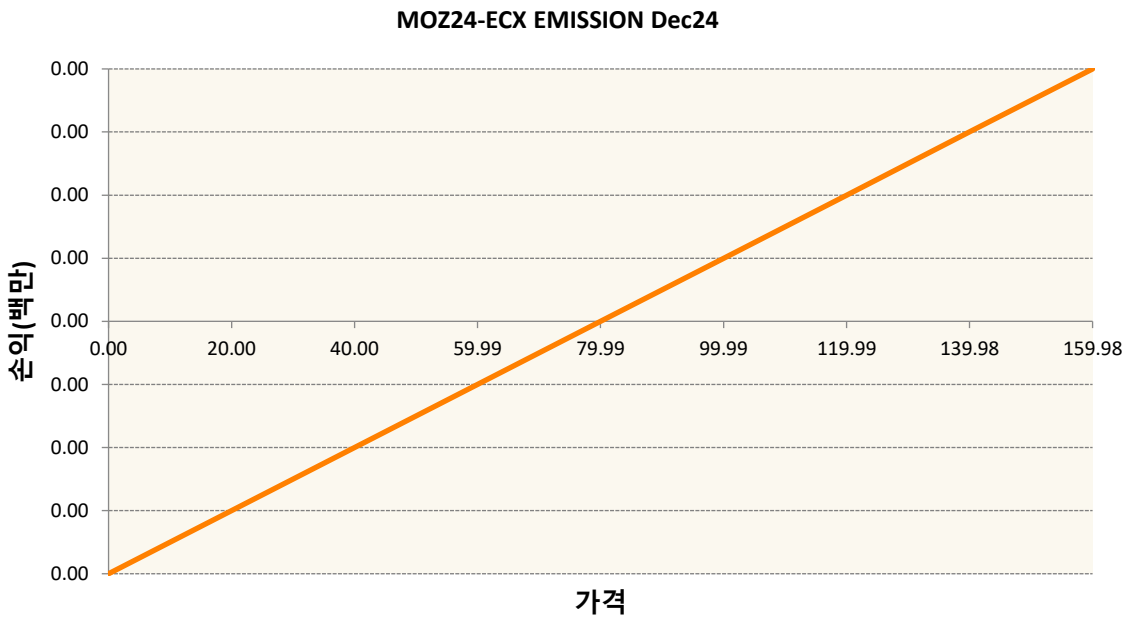
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	9,818	0	9,818	
누계	지수	스왑	424	0	424	장외
누계	통화	선도	0	2,407	-2,407	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213DCS₩ KRW/EUR 31-01-24E	15
FXW213DCS₩ KRW/EUR 31-01-24E	62
FXW213DCS₩ KRW/EUR 31-01-24E	116
MOZ24 ECX EMISSION Dec24	785
SWICEUACN ICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX	1

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

(단위:백만원)

1,543

공시일	2023-12-29
기준일	2023-12-28

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)	3
SWCSI00000 신한CSI Index 230622 (메리츠)	3
SWCSI00000 신한CSI Index 230922 (키움)	2
SWCSI00000 신한CSI Index 231013 (NH)	2

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

(단위:백만원)

15

공시일	2023-12-29
기준일	2023-12-28

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	6,244	0	6,244	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(미래)	4
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(NH)	4
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(메리츠)	5
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(키움)	1

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

(단위:백만원)

14

공시일	2023-12-29
기준일	2023-12-28

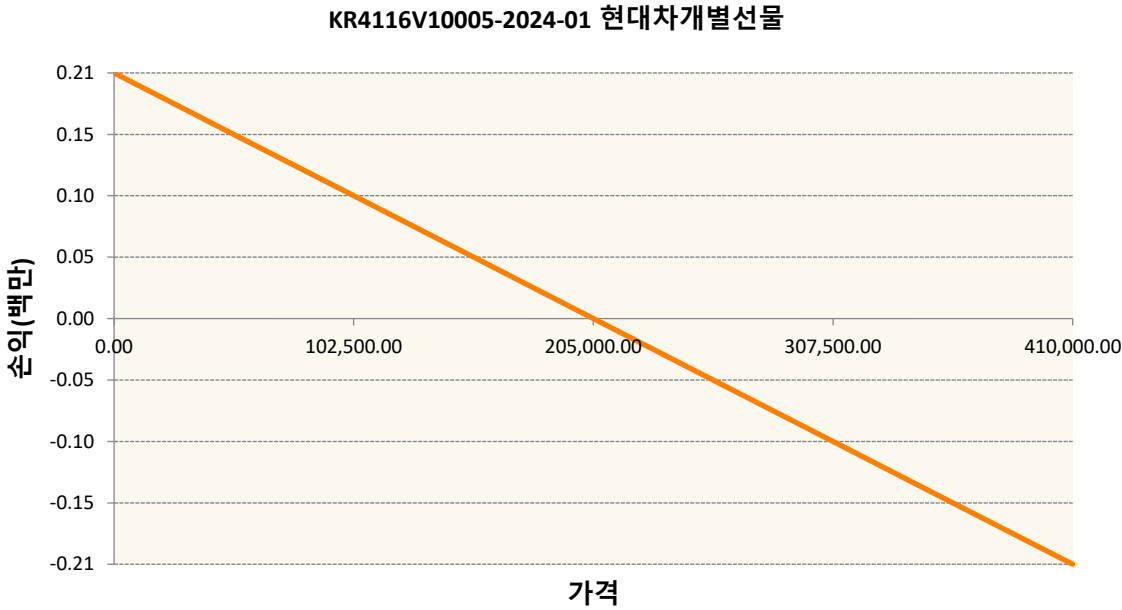
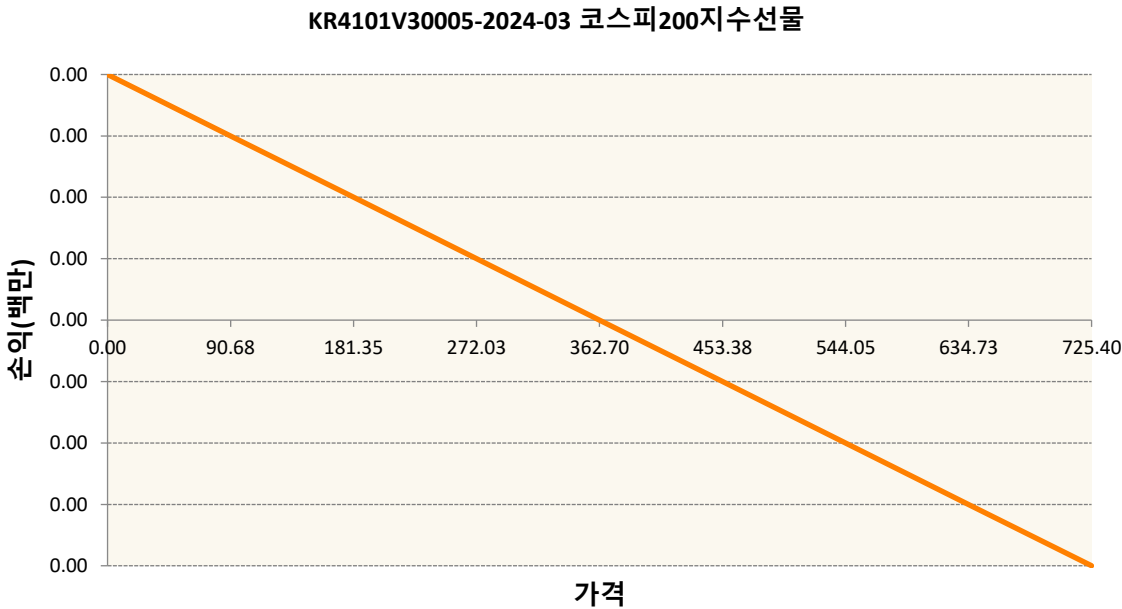
에쿼티알파일반사모혼합자산

1. 계약금액

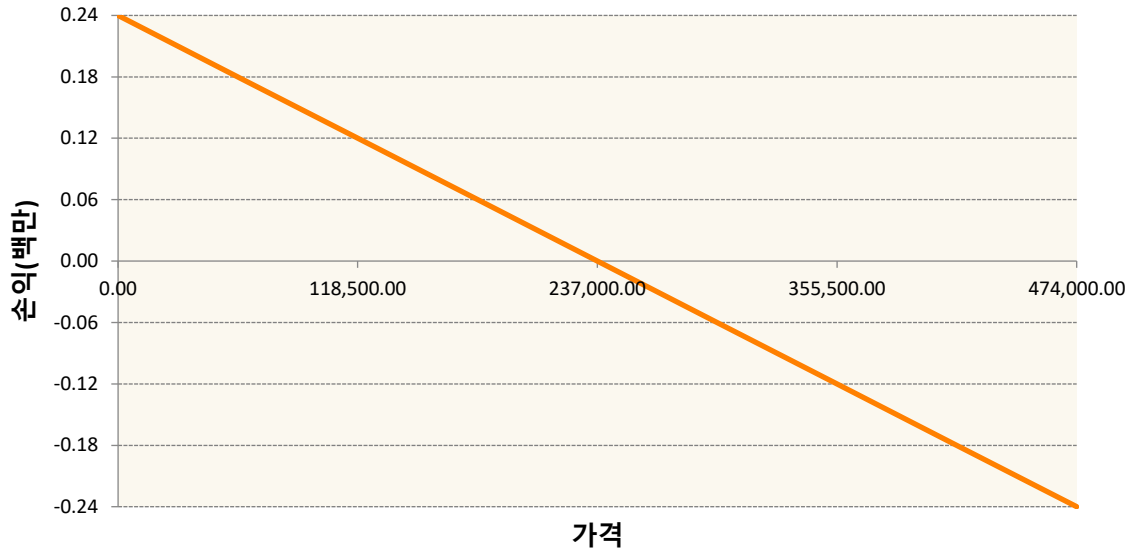
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	28	-28	장내
누계	유가증권	선물	20	1,615	-1,595	장내

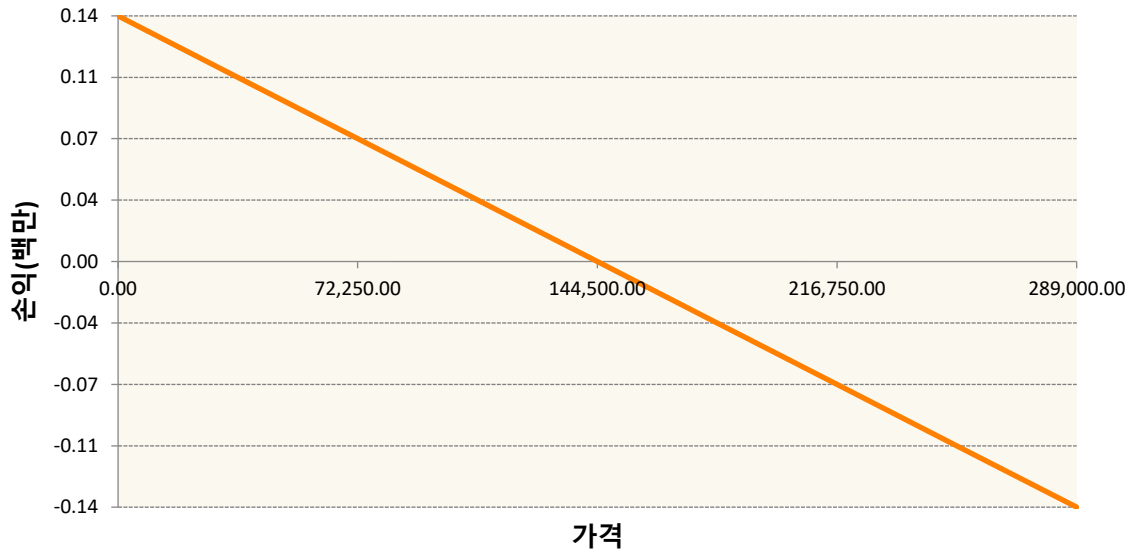
2. 만기시점의 손익구조



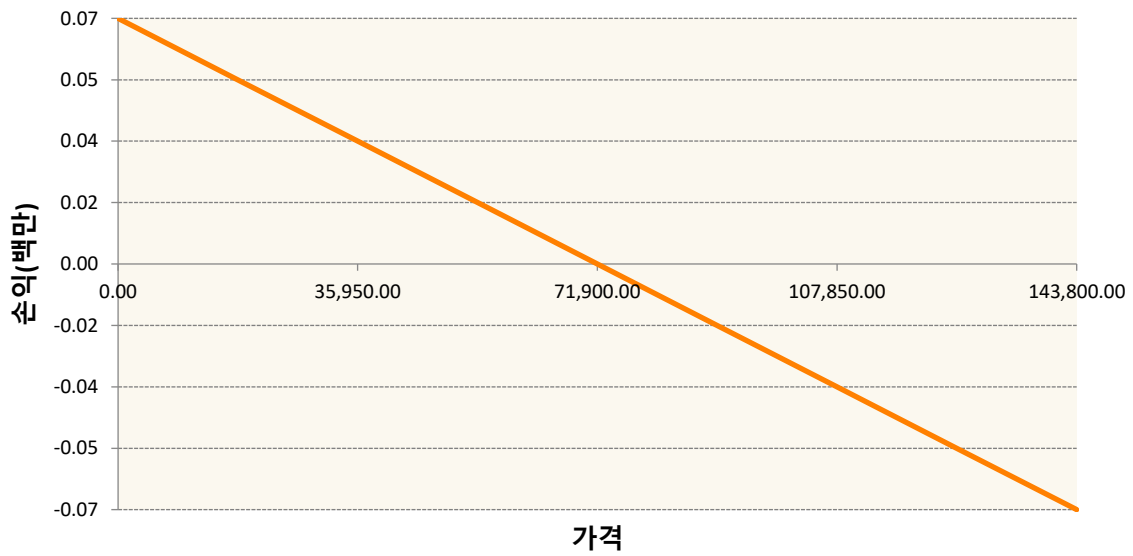
KR4120V10007-2024-01 현대모비스개별선물



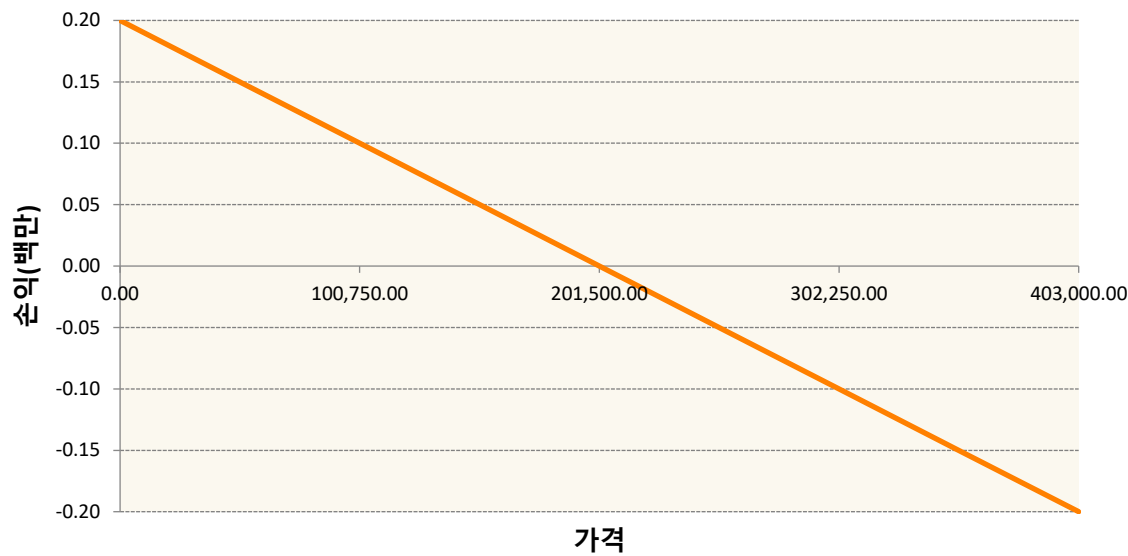
KR41C6V10003-2024-01 아모레퍼시픽개별선물



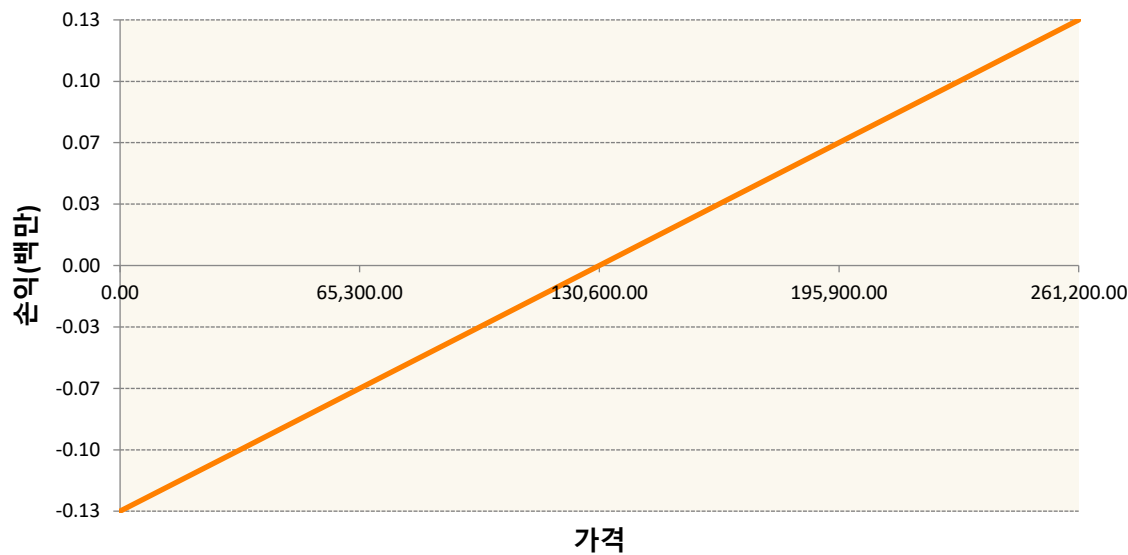
KR41CNV10006-2024-01 포스코DX개별선물



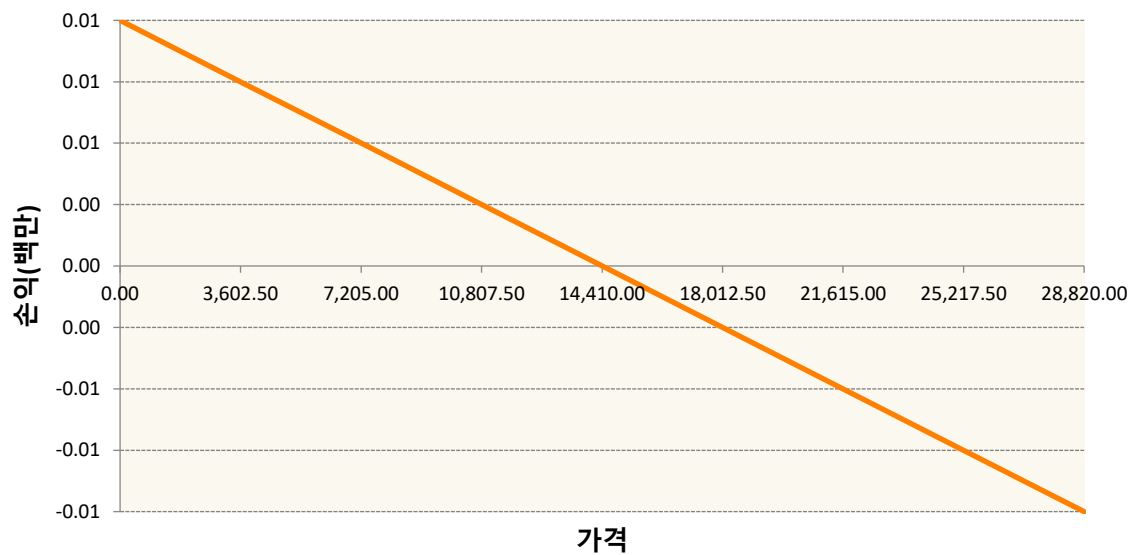
KR41CPV10001-2024-01 셀트리온개별선물



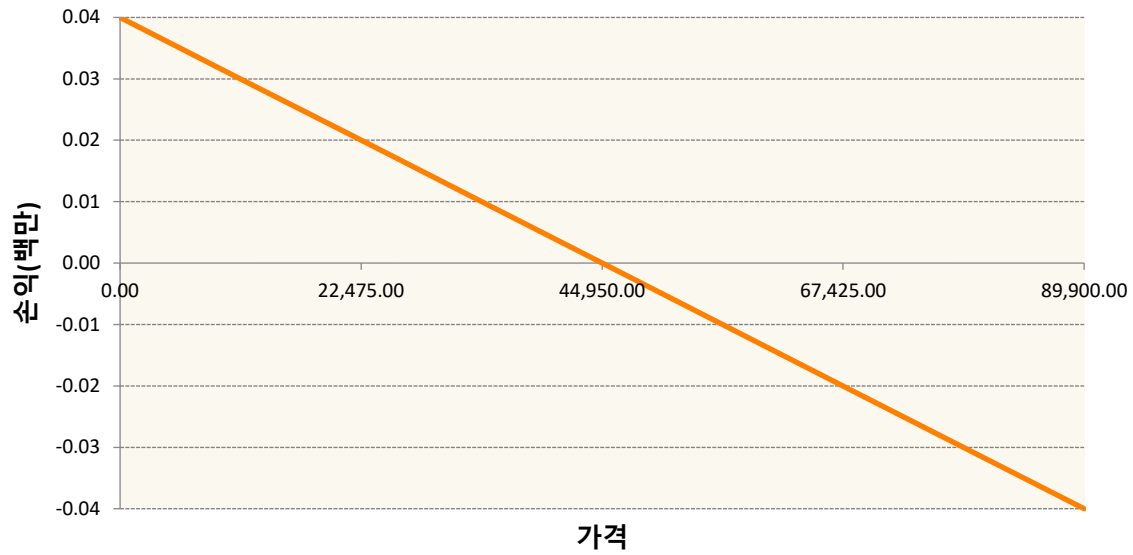
KR41DBV10009-2024-01 LIG넥스원개별선물



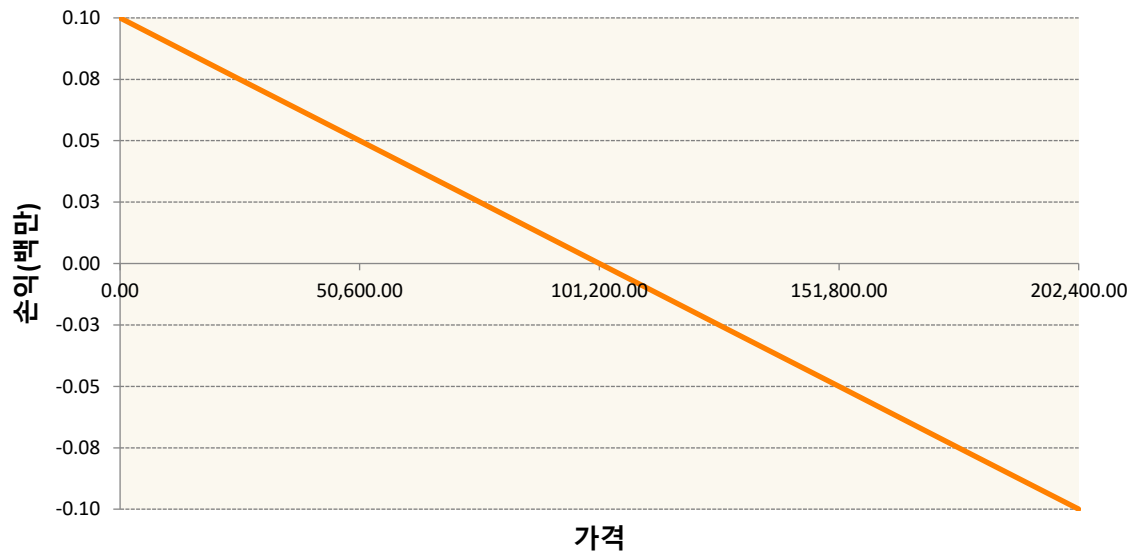
KR41ECV10005-2024-01 HDC현대산업개발개별선물



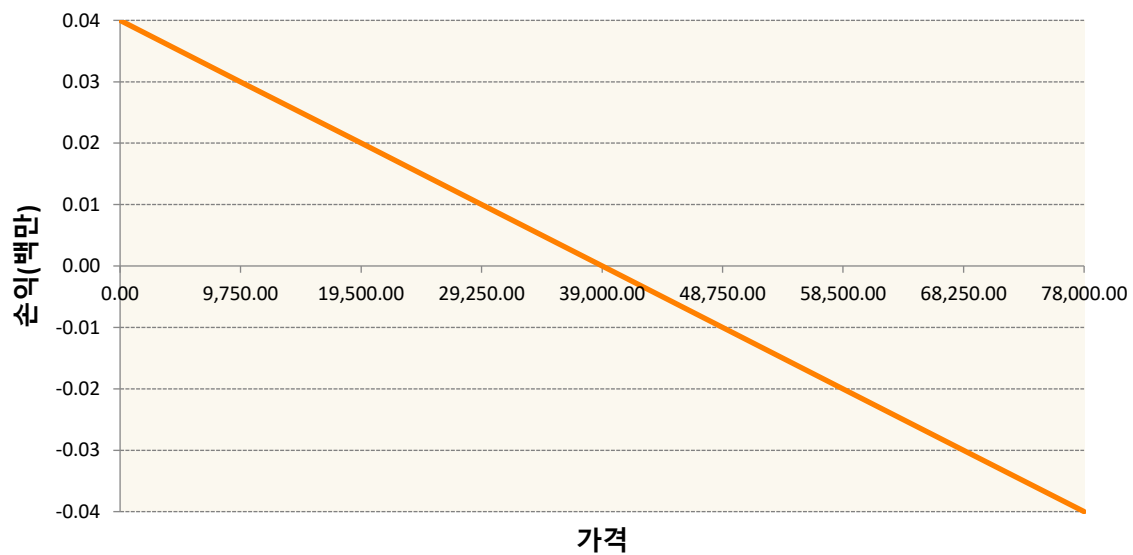
KR41EEV10001-2024-01 한울바이오파마개별선물



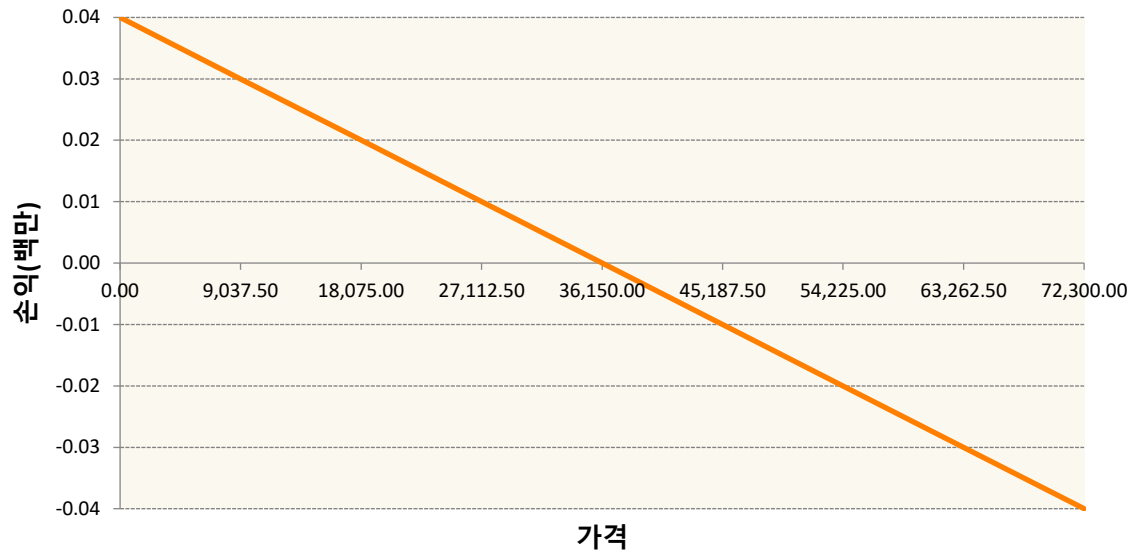
KR41EFV10008-2024-01 JYP Ent.개별선물



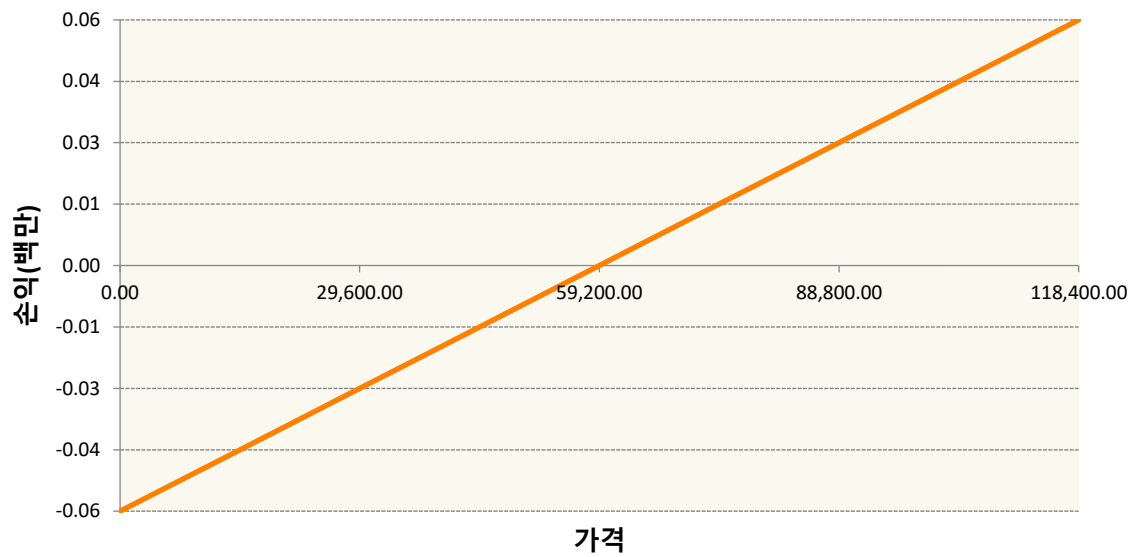
KR41ENV10002-2024-01 동진세미캠개별선물



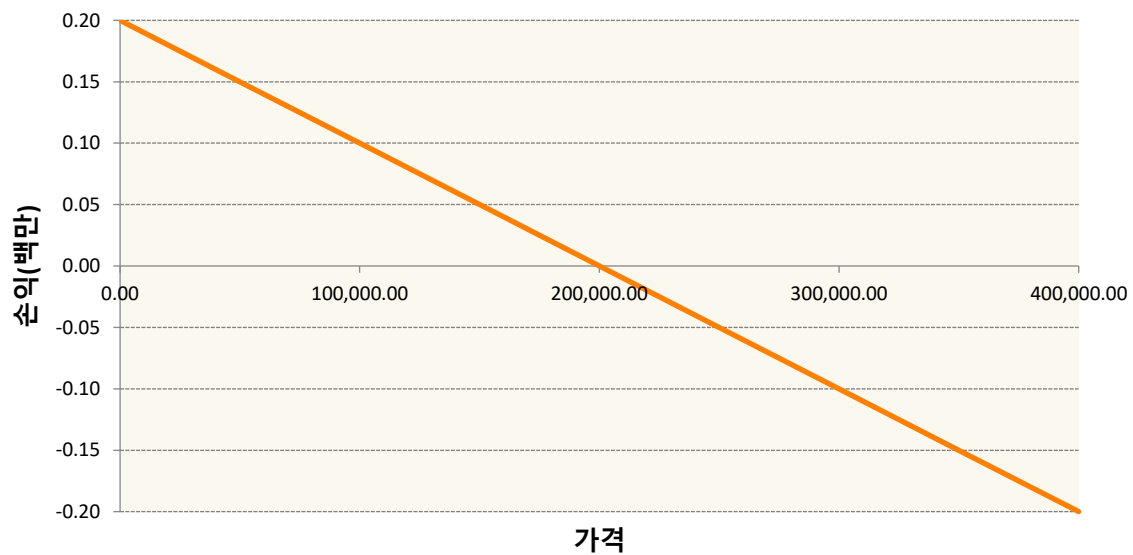
KR41ERV10003-2024-01 DL이앤씨개별선물



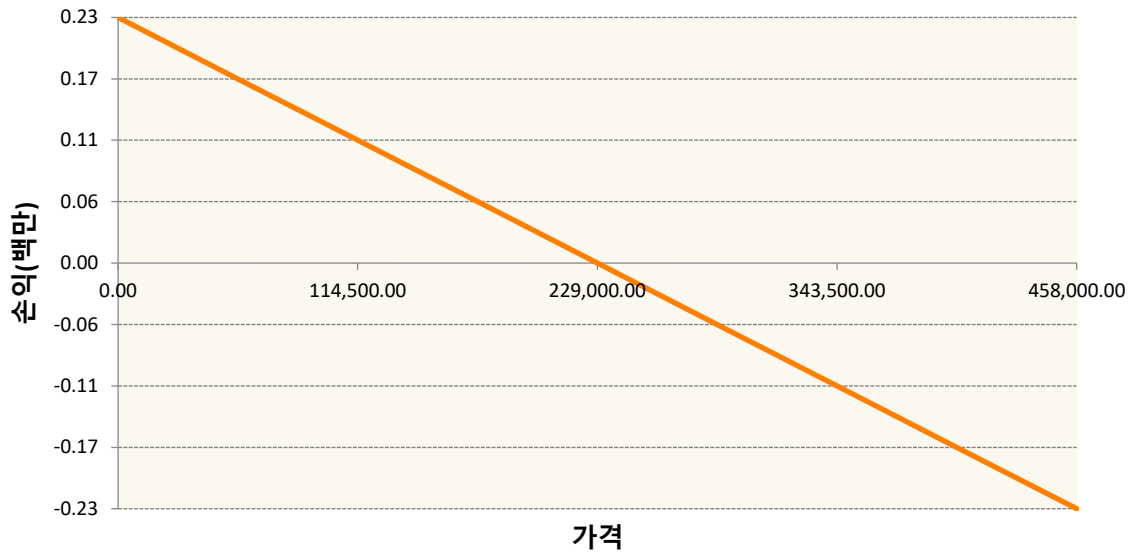
KR41FKV10005-2024-01 메리츠금융지주개별선물



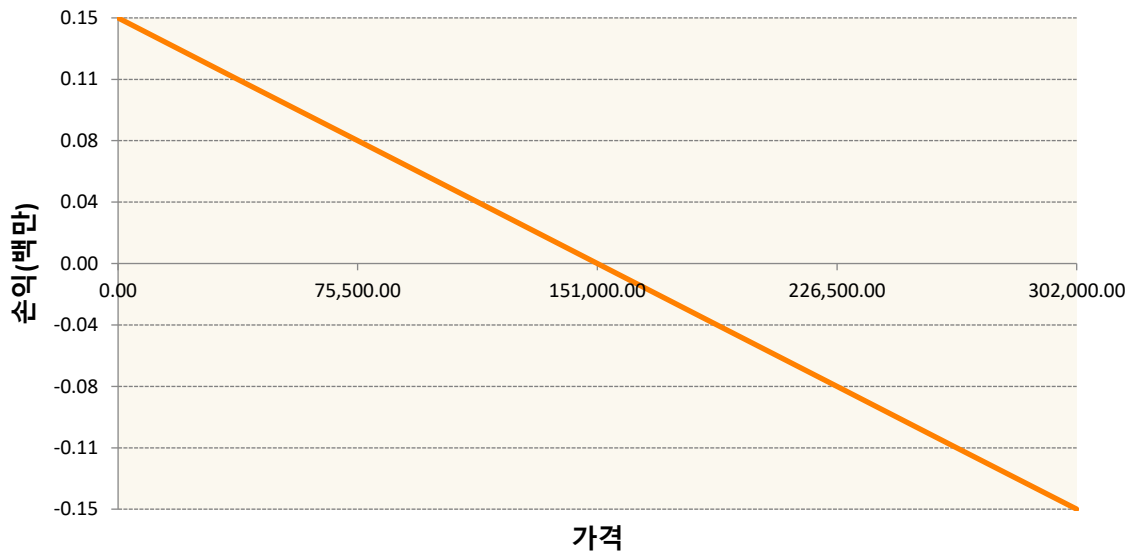
KR41FMV10001-2024-01 엘앤에프개별선물



KR41G4V10004-2024-01 한솔케미칼개별선물



KR41GCV10000-2024-01 이오테크닉스개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101V300 2024-03 코스피200지수선물	102
KR4116V100 2024-01 현대차개별선물	3
KR4120V100 2024-01 현대모비스개별선물	2
KR41C6V100 2024-01 아모레퍼시픽개별선물	2
KR41CNV100 2024-01 포스코DX개별선물	9
KR41CPV100 2024-01 셀트리온개별선물	3
KR41DBV100 2024-01 LIG넥스원개별선물	2
KR41ECV100 2024-01 HDC현대산업개발개별선물	1
KR41EEV100 2024-01 한올바이오파마개별선물	1
KR41EFV100 2024-01 JYP Ent.개별선물	2
KR41ENV100 2024-01 동진세미캠개별선물	0.31
KR41ERV100 2024-01 DL이앤씨개별선물	0.2

KR41FKV100 2024-01 메리츠금융지주개별선물
KR41FMV100 2024-01 엘앤에프개별선물
KR41G4V100 2024-01 한솔케미칼개별선물
KR41GCV100 2024-01 이오테크닉스개별선물

0.05
0.32
1
1

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

(단위:백만원)

182

공시일	2023-12-29
기준일	2023-12-28

코리아인덱스(주식-파생형)(종)

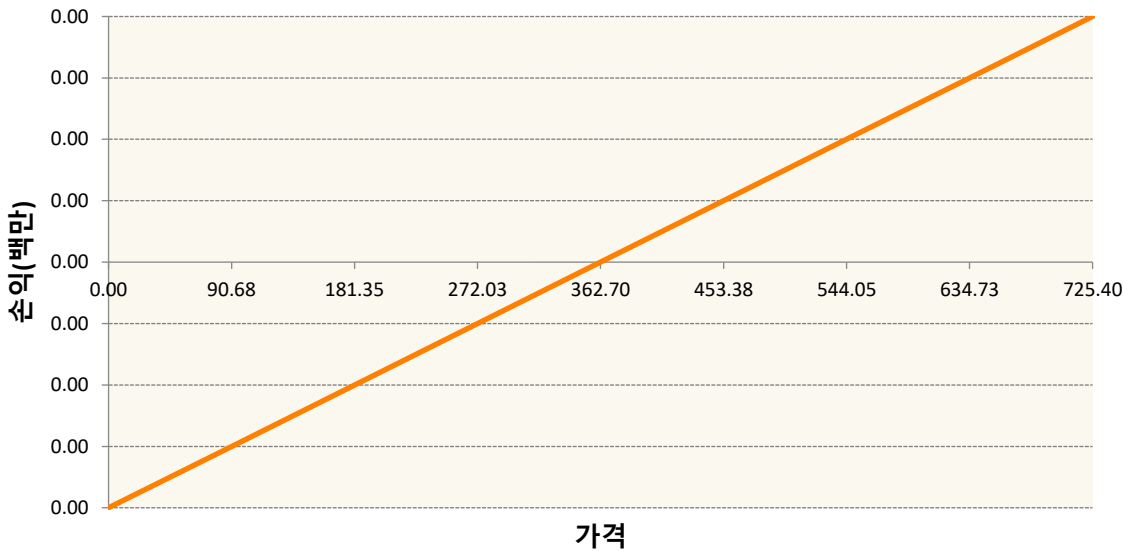
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,264	0	3,264	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101V30005-2024-03 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101V30005		2024-03 코스피200지수선물					258
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-258	-258	-258	-258	-258	-258	-258
-5.33%	-172	-172	-172	-172	-172	-172	-172
-2.67%	-86	-86	-86	-86	-86	-86	-86
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	86	86	86	86	86	86	86
5.33%	172	172	172	172	172	172	172
8.00%	258	258	258	258	258	258	258

공시일	2023-12-29
기준일	2023-12-28

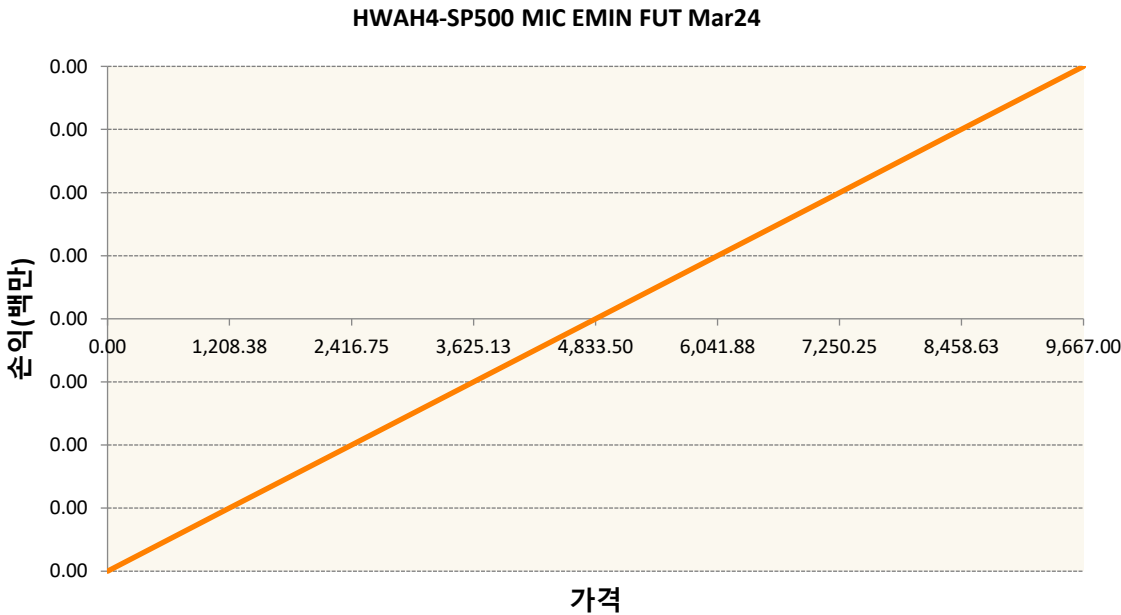
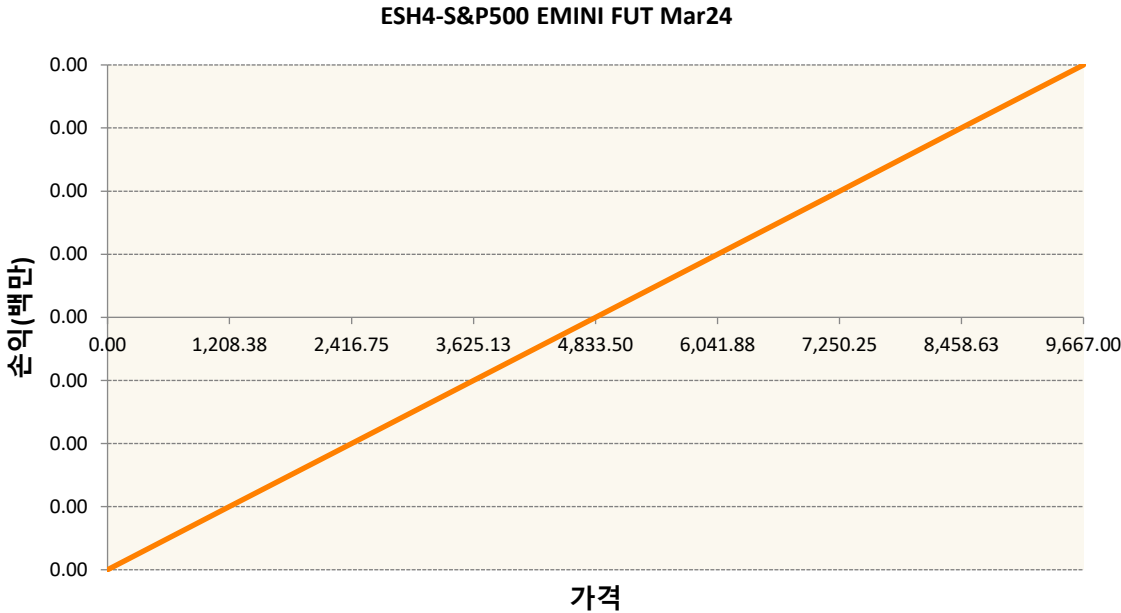
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

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	630	0	630	
누계	유가증권	선물	2,504	0	2,504	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESH4	S&P500 EMINI FUT Mar24	50
HWAH4	SP500 MIC EMIN FUT Mar24	200

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	211

공시일	2023-12-29
기준일	2023-12-28

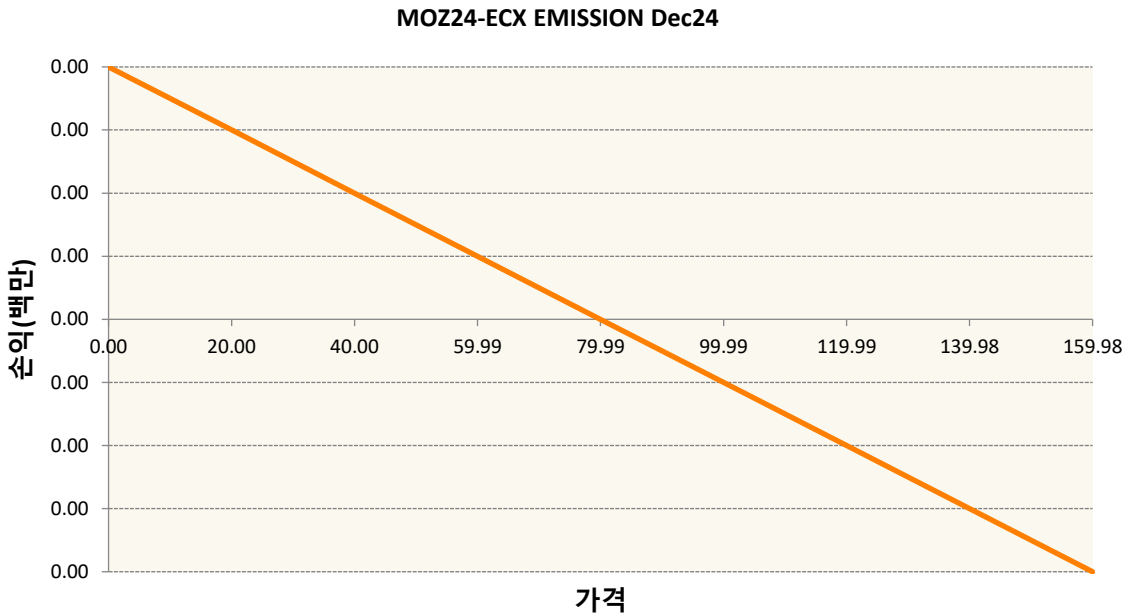
SOL유럽탄소배출권선물인버스ICE특별자산상

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	4,830	-4,830	
누계	지수	스왑	424	0	424	장외
누계	통화	선도	0	1,333	-1,333	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213DCS₩ KRW/EUR 31-01-24E	107
MOZ24 ECX EMISSION Dec24	386
SWICEUACN ICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX	1

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

(단위:백만원)

768

공시일	2023-12-29
기준일	2023-12-28

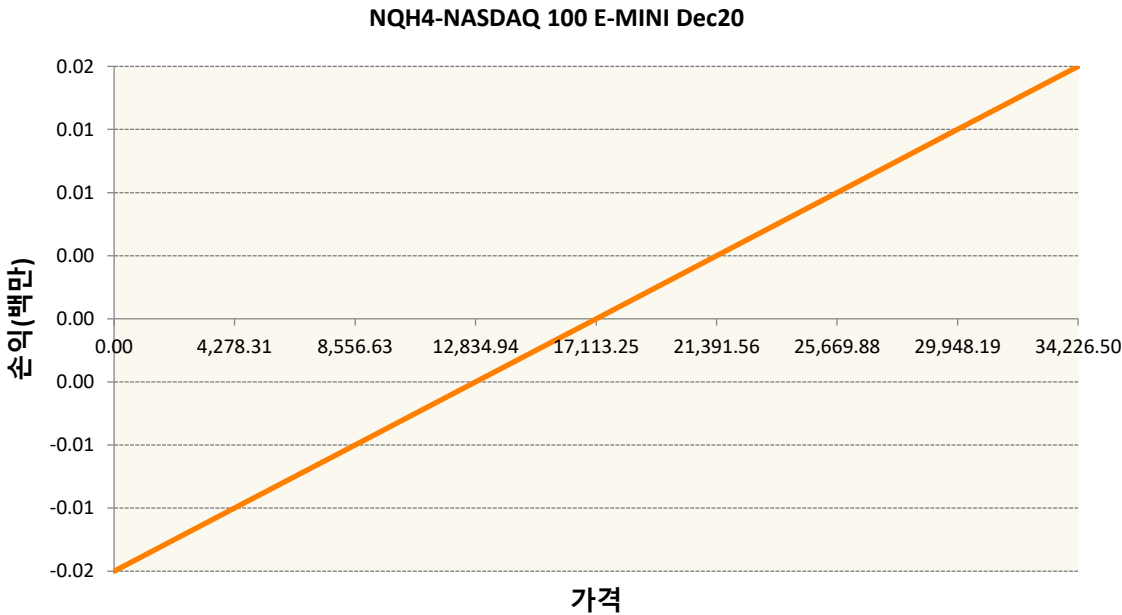
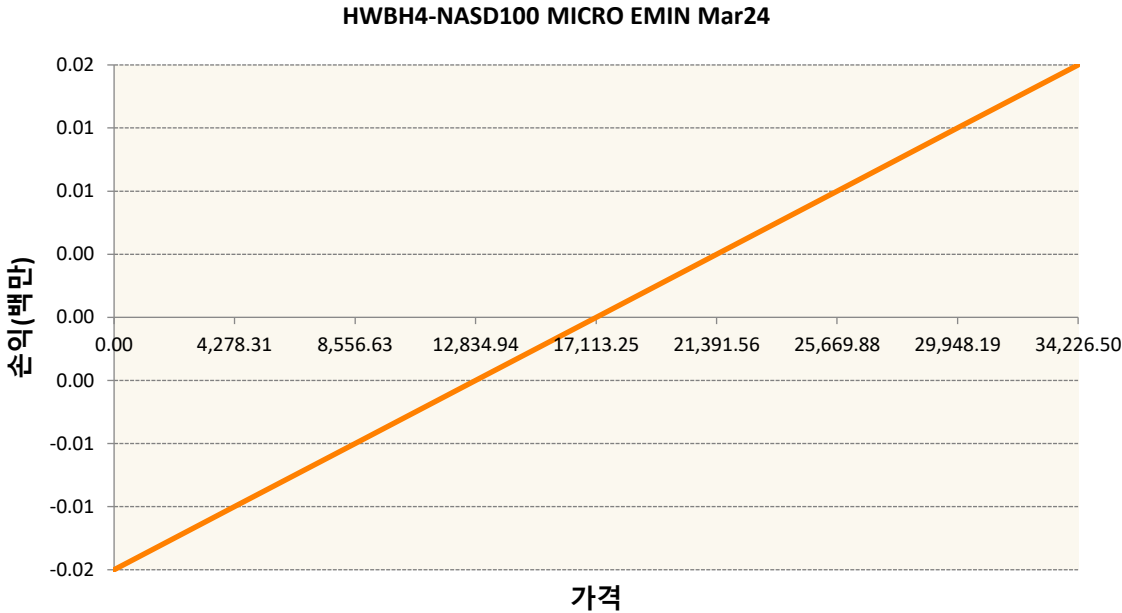
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

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	892	0	892	
누계	유가증권	선물	2,159	0	2,159	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
HWBH4	NASD100 MICRO EMIN Mar24		173
NQH4	NASDAQ 100 E-MINI Dec20		71

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)			(단위:백만원)
			225

공시일	2023-12-29
기준일	2023-12-28

SOL미국30년국채커버드콜(합성)

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	7,968	0	7,968	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWKEDI0000 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	80
SWKEDI0000 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	159
SWKEDI0000 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	159
SWKEDI0000 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	159
SWKEDI0000 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	80

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

(단위:백만원)

444

공시일	2023-12-29
기준일	2023-12-28

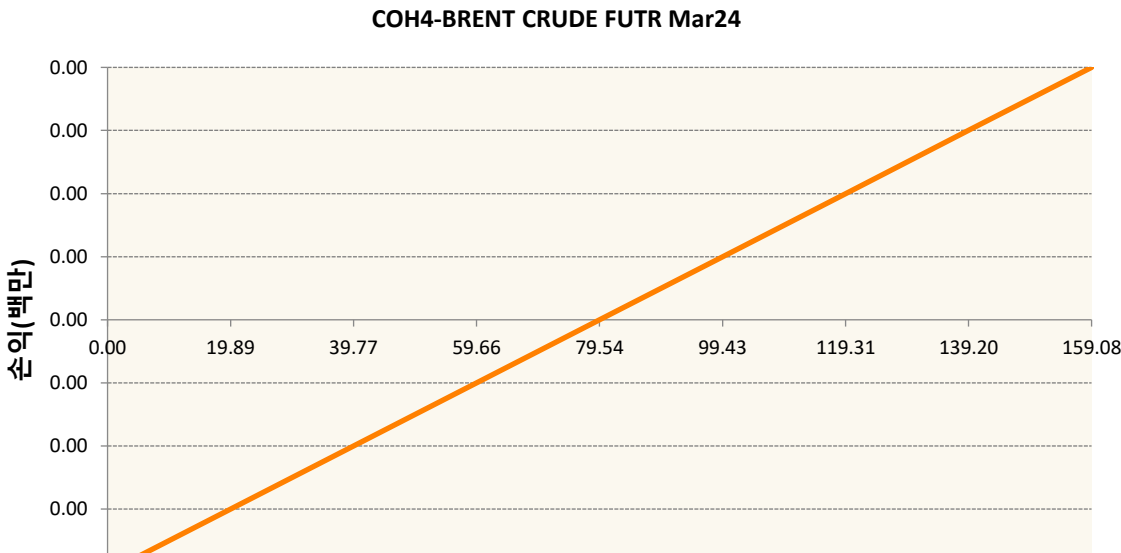
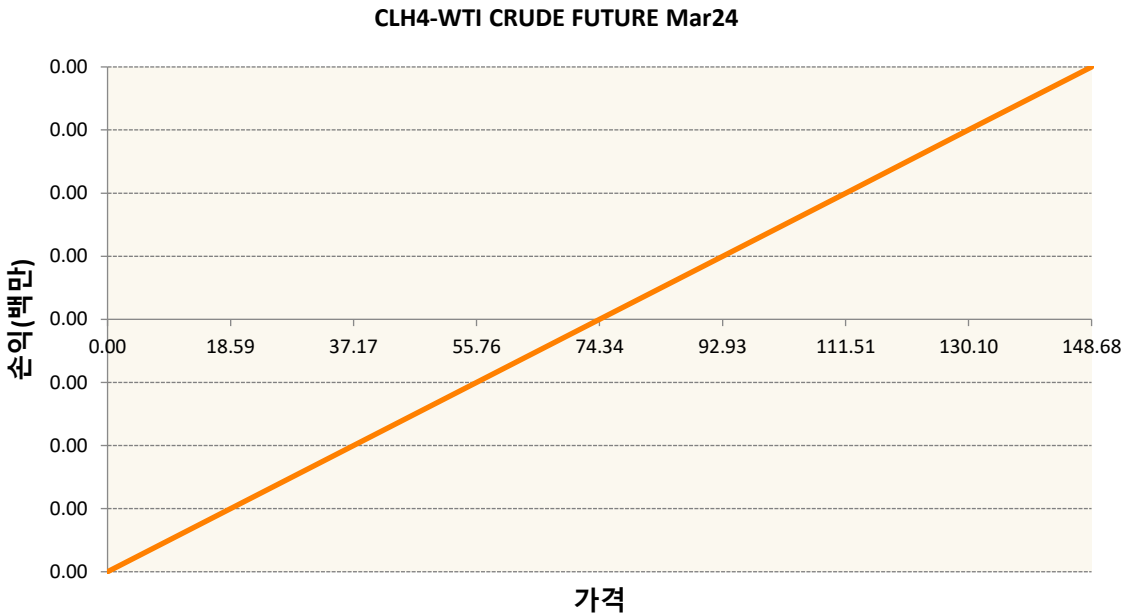
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

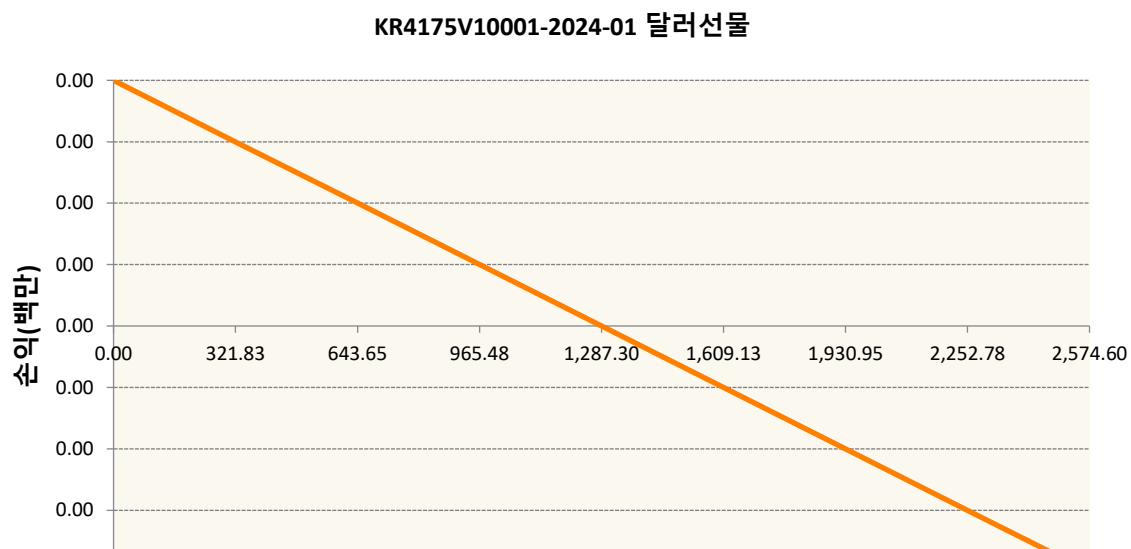
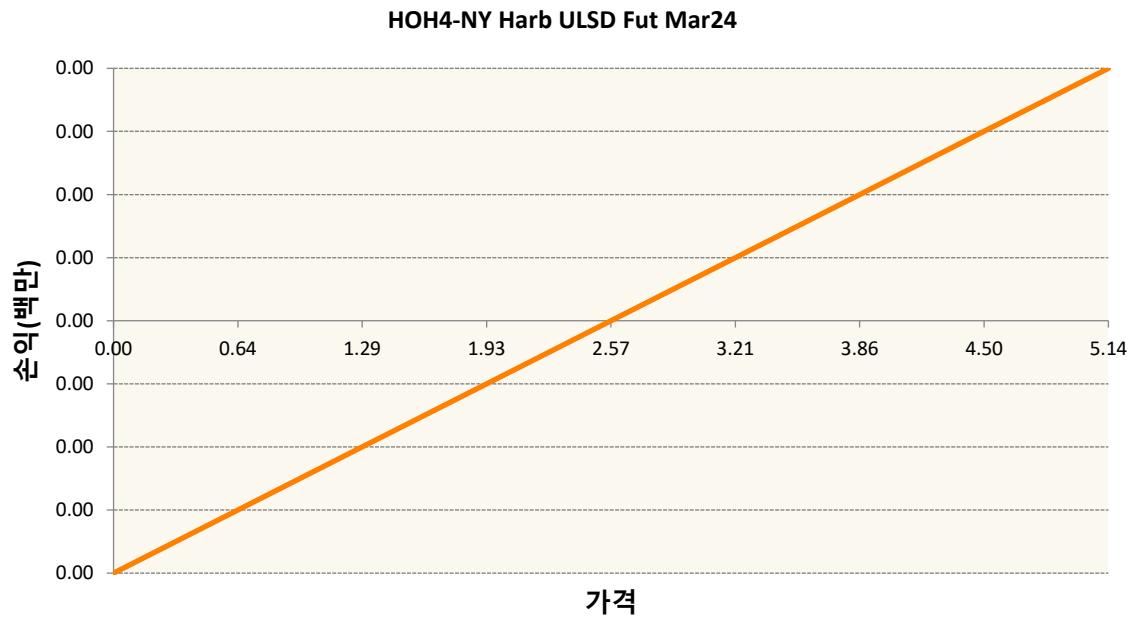
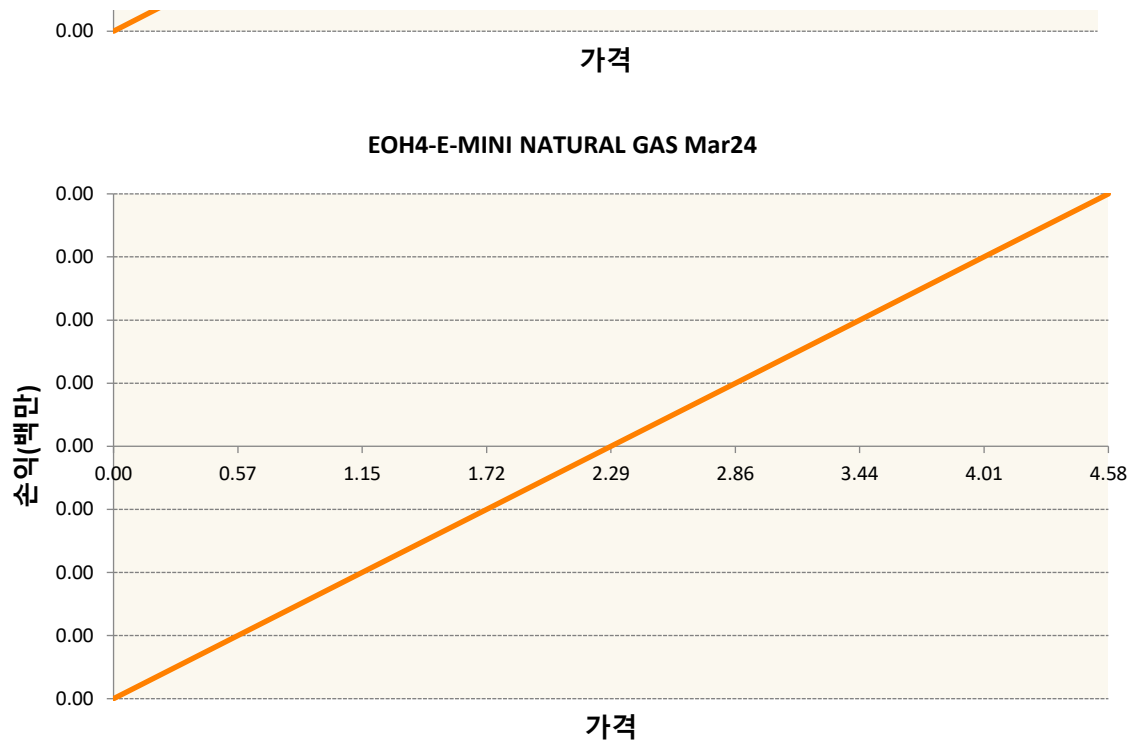
1. 계약금액

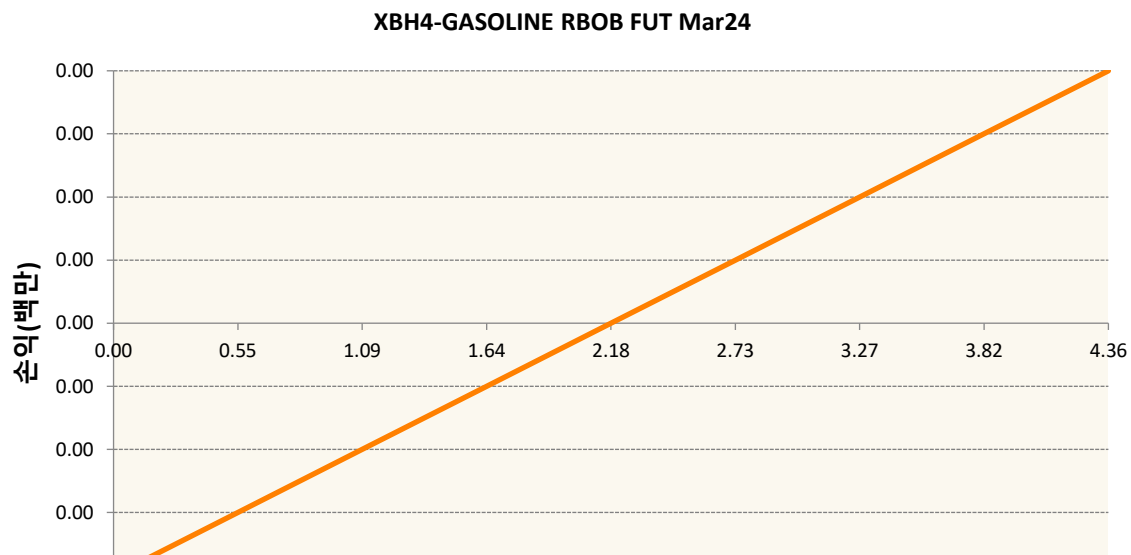
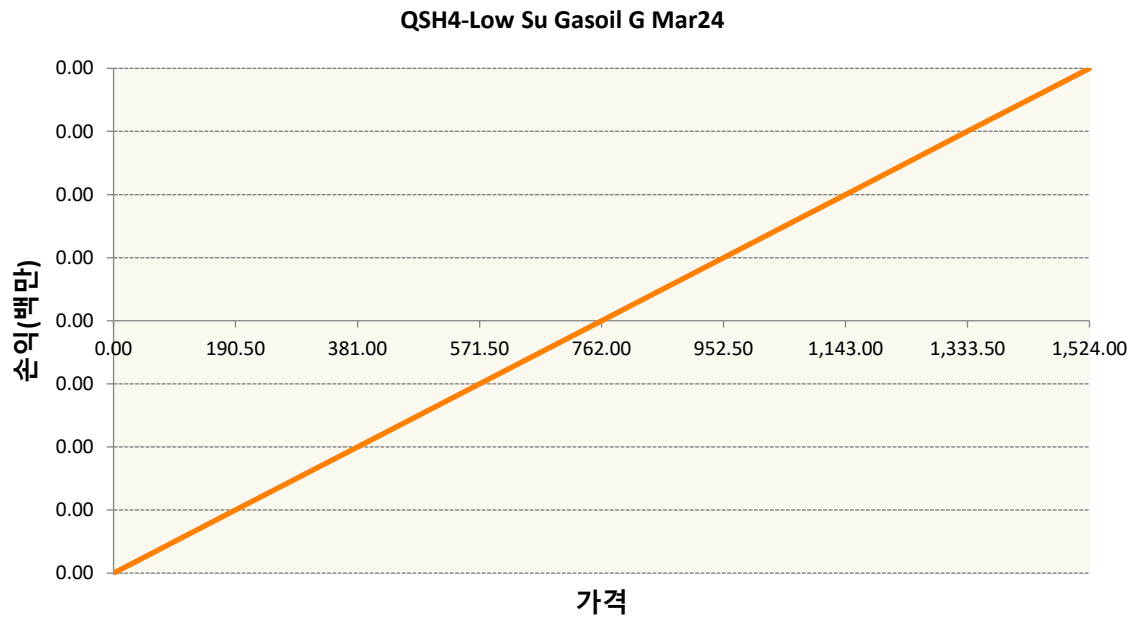
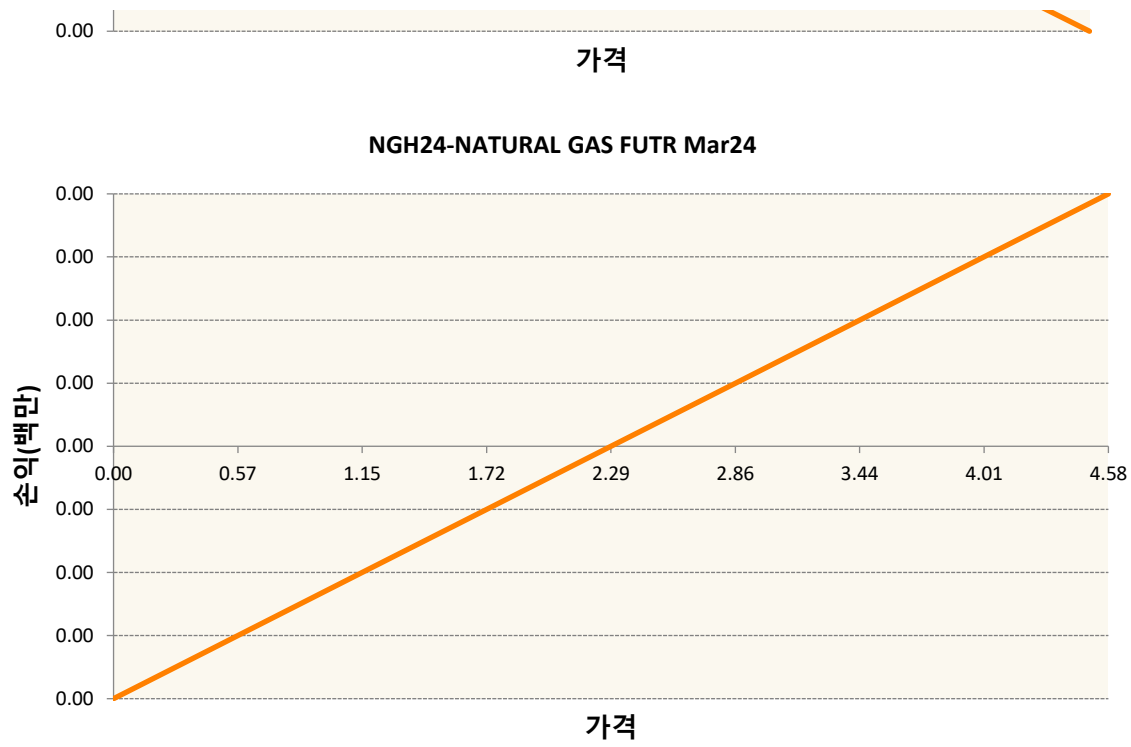
(단위:백만원)

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	293	0	293	
누계	유가증권	선물	879	0	879	
누계	통화	선물	0	180	-180	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	11
KR4175V100 2024-01	달러선물	14
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
