

공시일	2024-01-15
기준일	2024-01-12

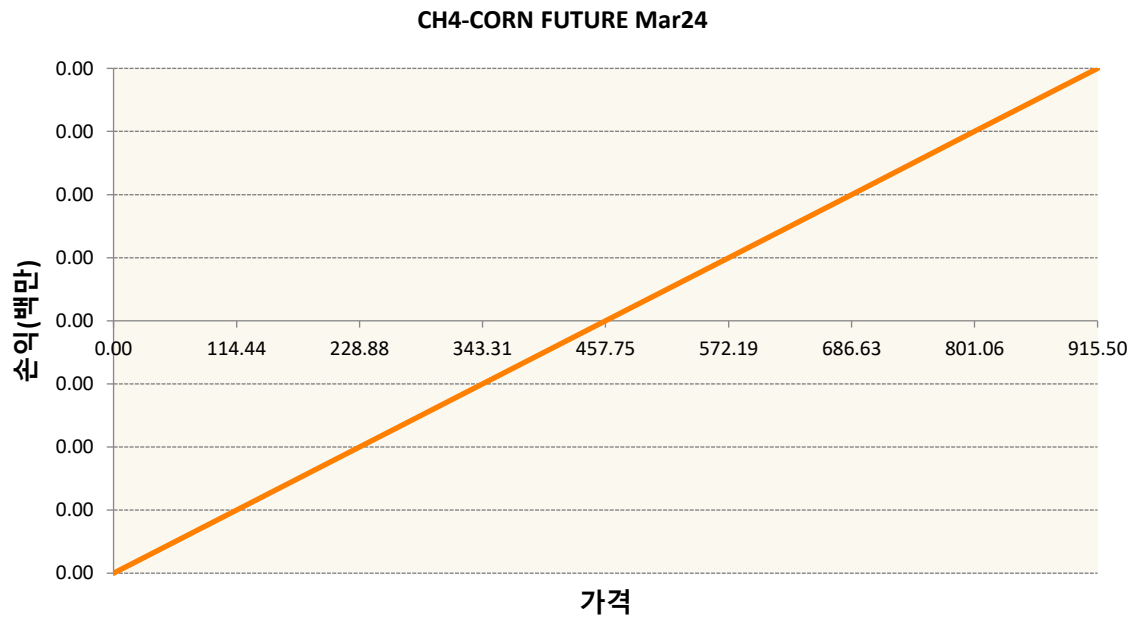
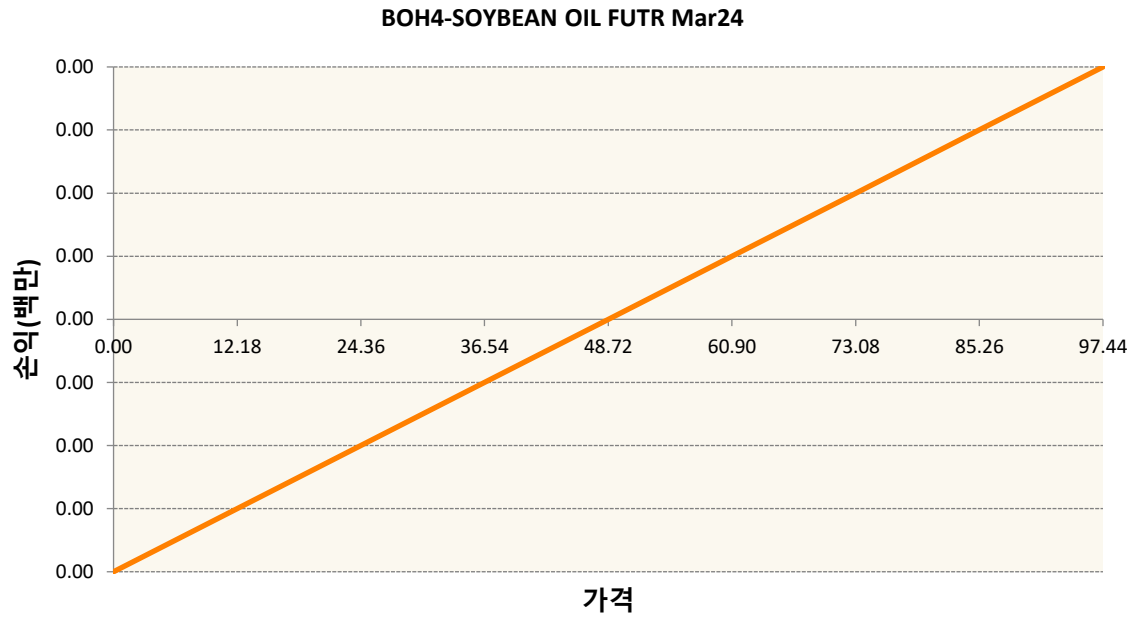
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

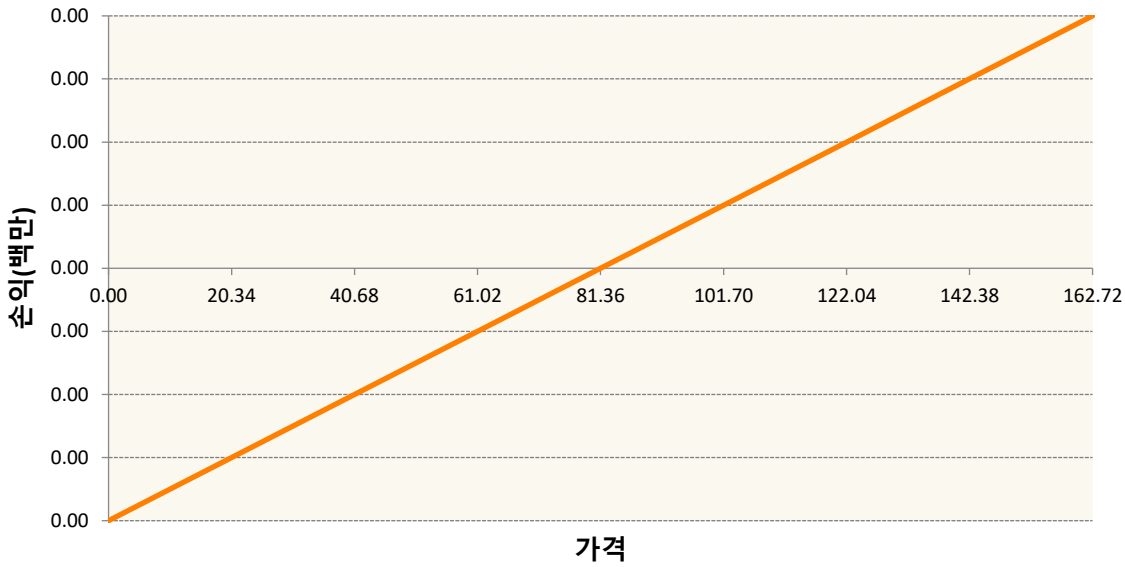
(단위:USD 백만)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	407	-407	장내
누계	유가증권	선물	4,554	0	4,554	
누계	통화	선물	0	446	-446	장내

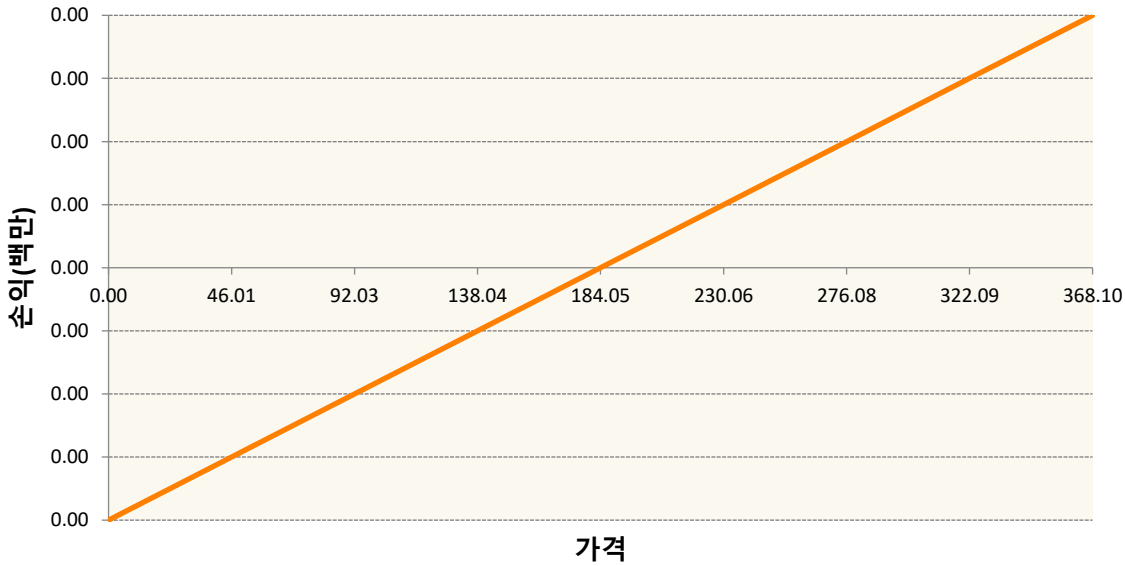
2. 만기시점의 손익구조



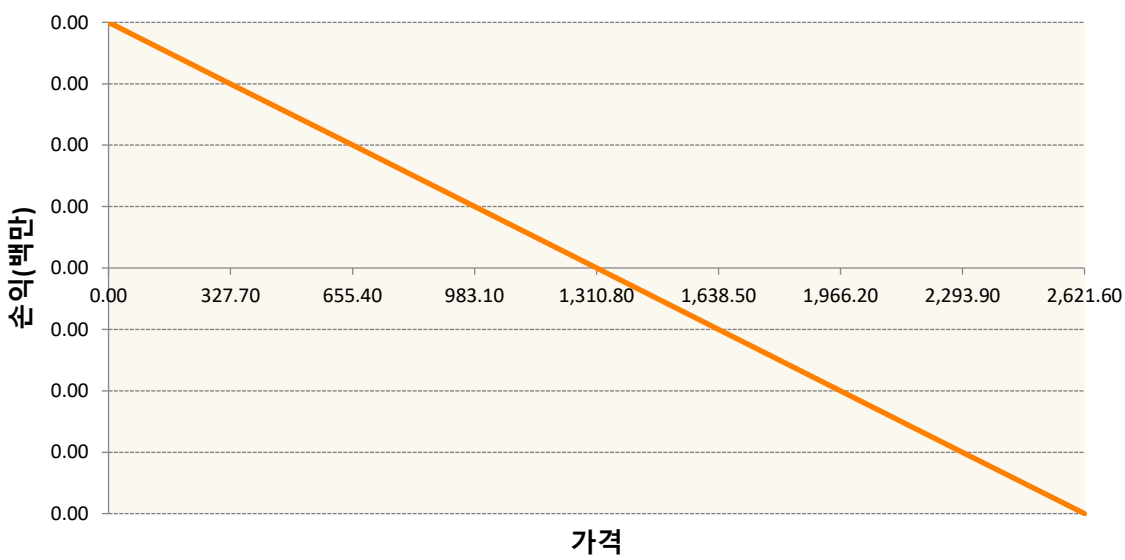
CTH4-COTTON NO.2 FUTR Mar24



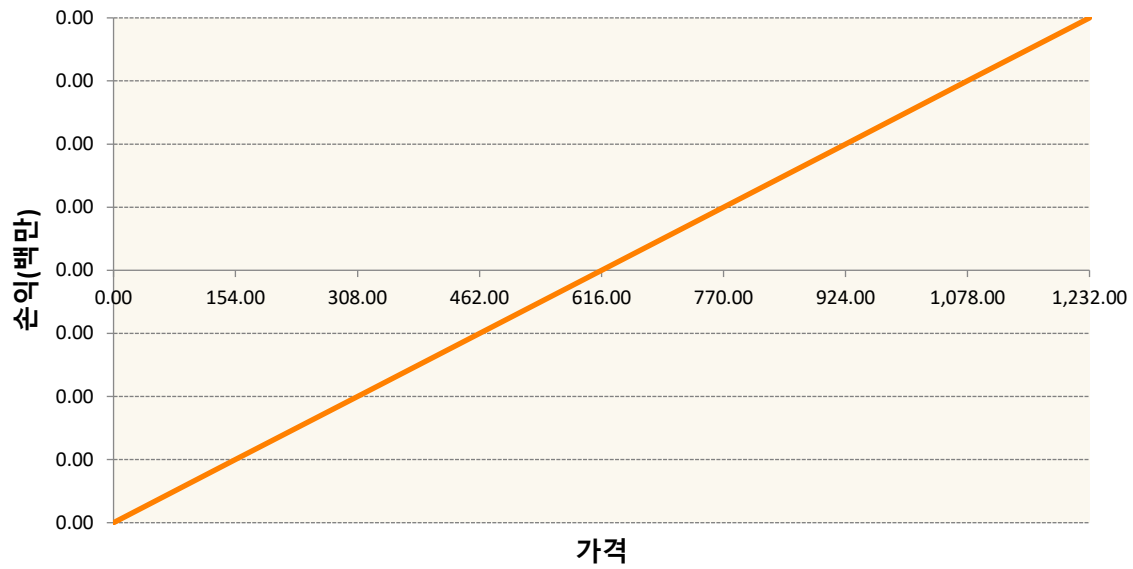
KCH4-COFFEE 'C' FUTURE Mar24



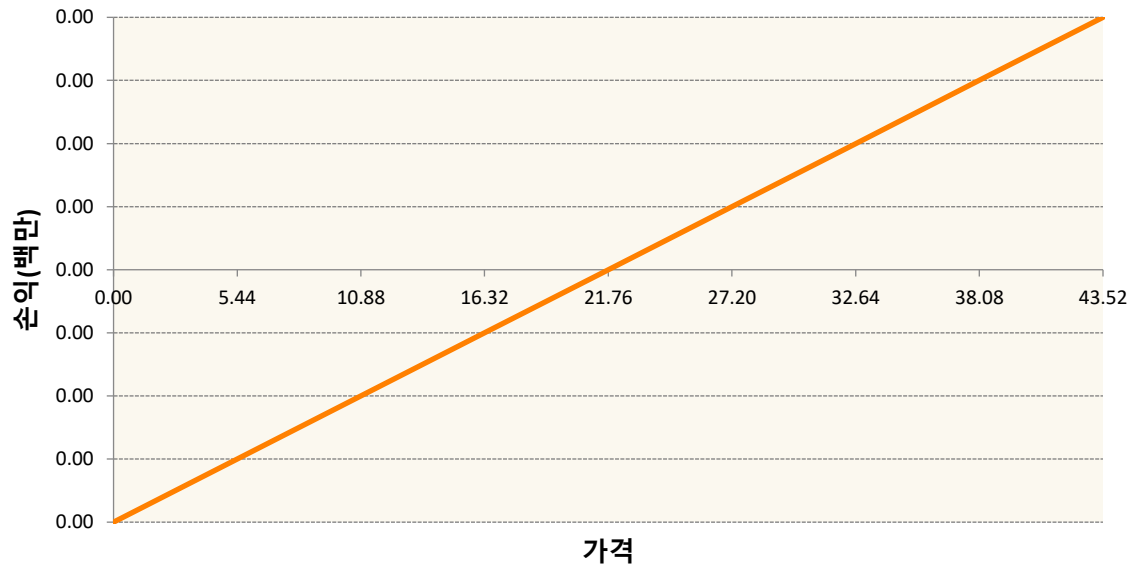
KR4175V20000-2024-02 달러선물



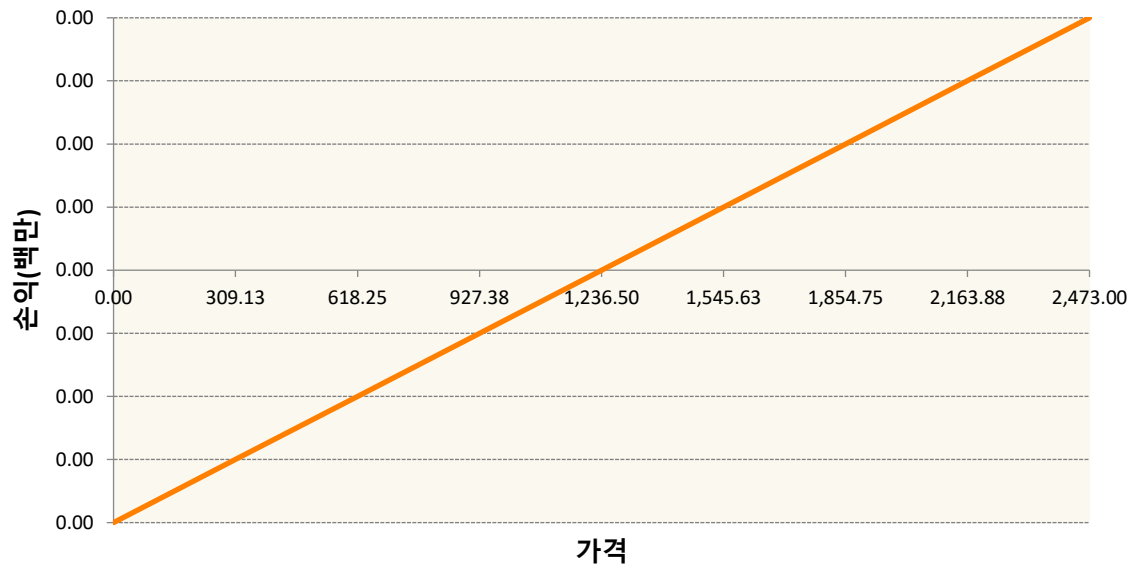
KWH4-KC HRW WHEAT FUT Mar24



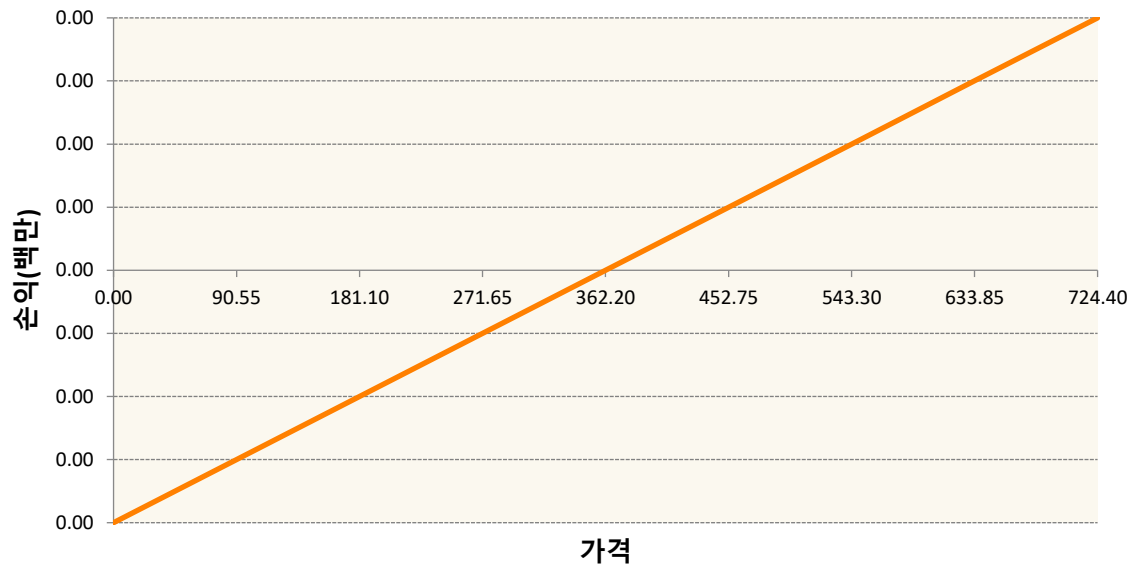
SBH4-Sugar #11 (WORLD) Mar24



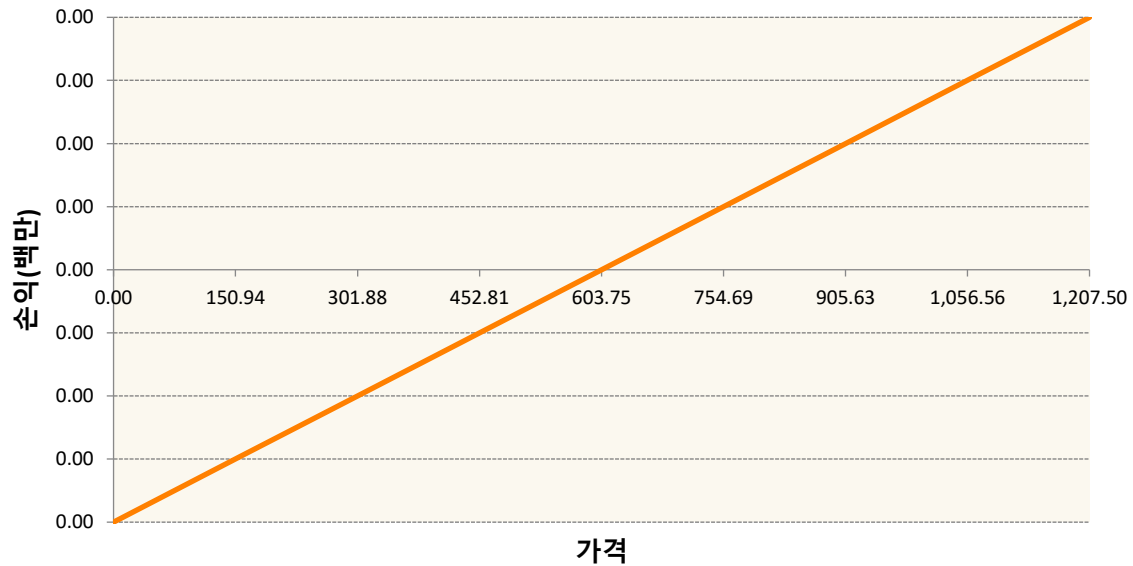
SH4-SOYBEAN FUTURE Mar24



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	2024-01-15
기준일	2024-01-12

스마트인덱스모

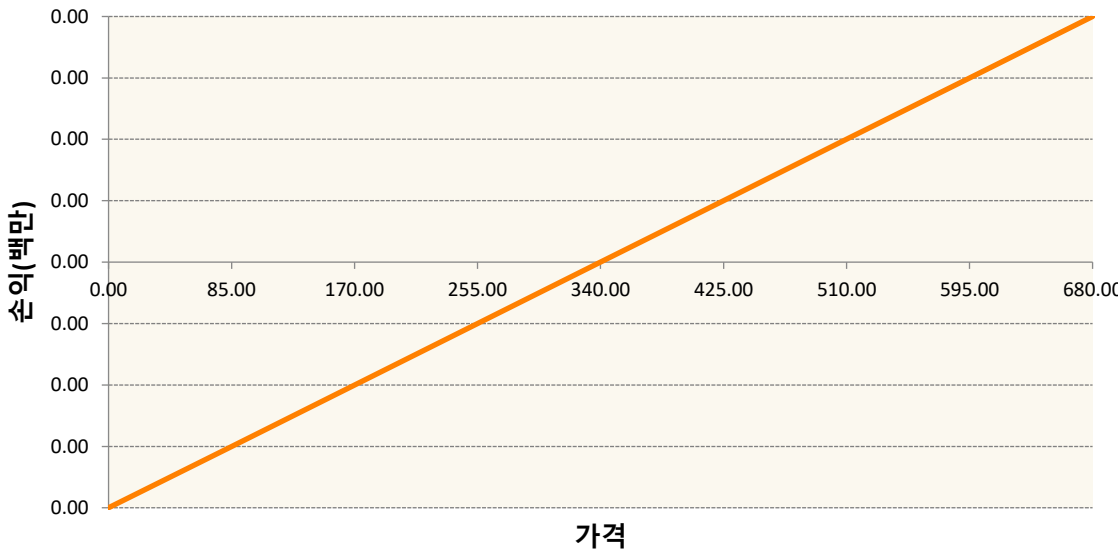
1. 계약금액

(단위:백만원)

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

2. 만기시점의 손익구조

KR4101V30005-2024-03 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101V30005		2024-03 코스피200지수선물					108
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-108	-108	-108	-108	-108	-108	-108
-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%	108	108	108	108	108	108	108

공시일	2024-01-15
기준일	2024-01-12

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	295
-----------------------------	-----

* 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	2024-01-15
기준일	2024-01-12

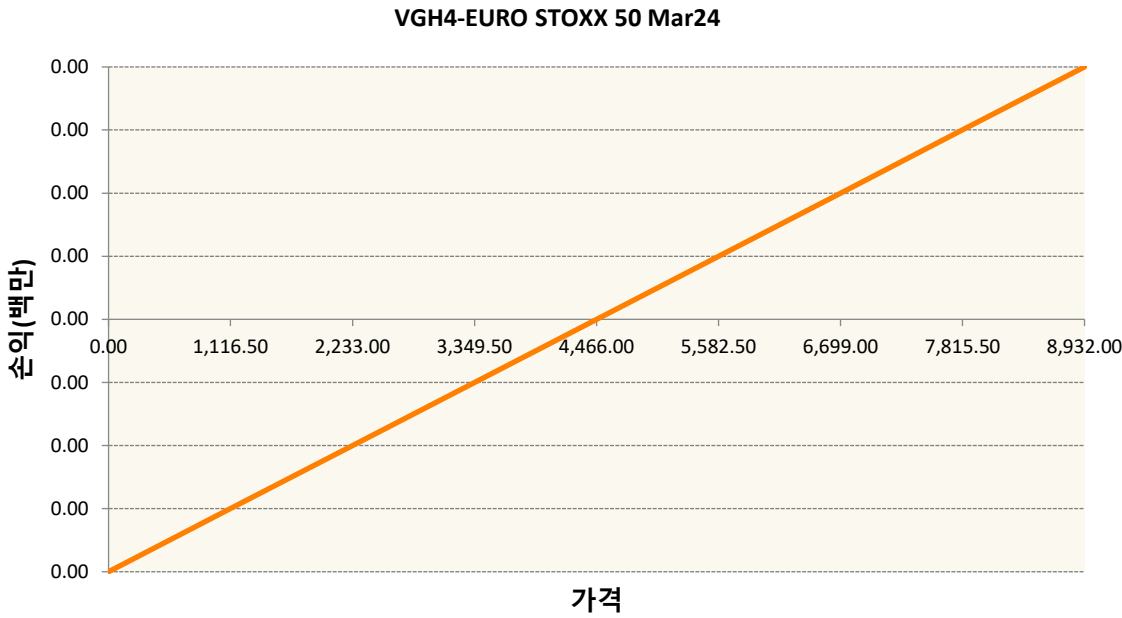
유로인덱스모(주식-파생형)

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	953	0	953	
누계	통화	선도	216	0	216	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213DCL	EUR/KRW 22-03-24E	17
VGH4	EURO STOXX 50 Mar24	76

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

(단위:백만원)

71

공시일	2024-01-15
기준일	2024-01-12

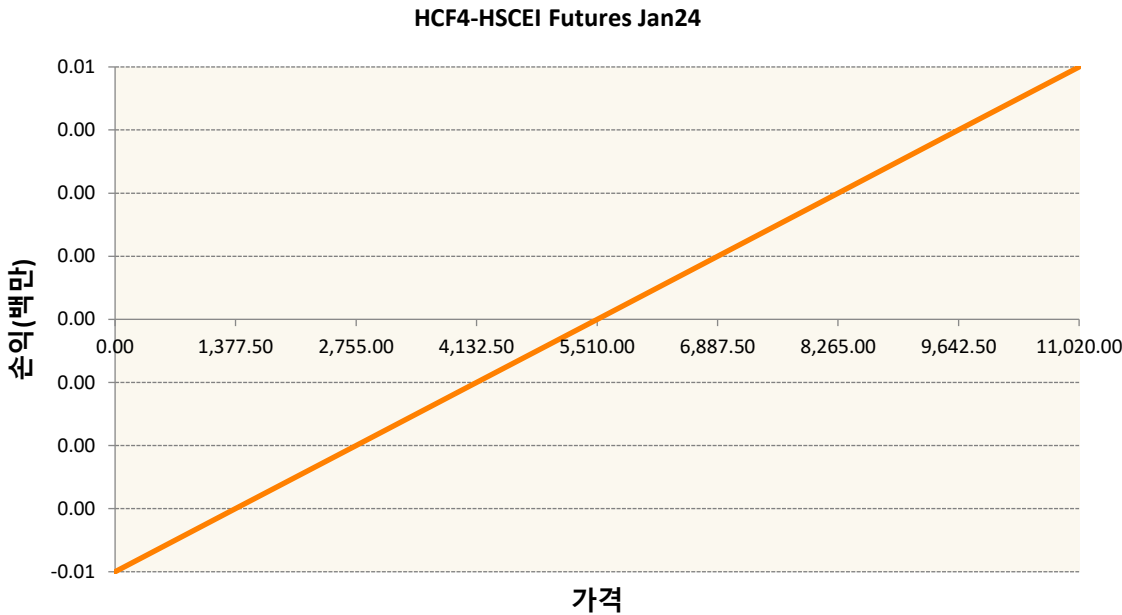
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,004	0	1,004	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCF4	HSCEI Futures Jan24	80
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

117

공시일	2024-01-15
기준일	2024-01-12

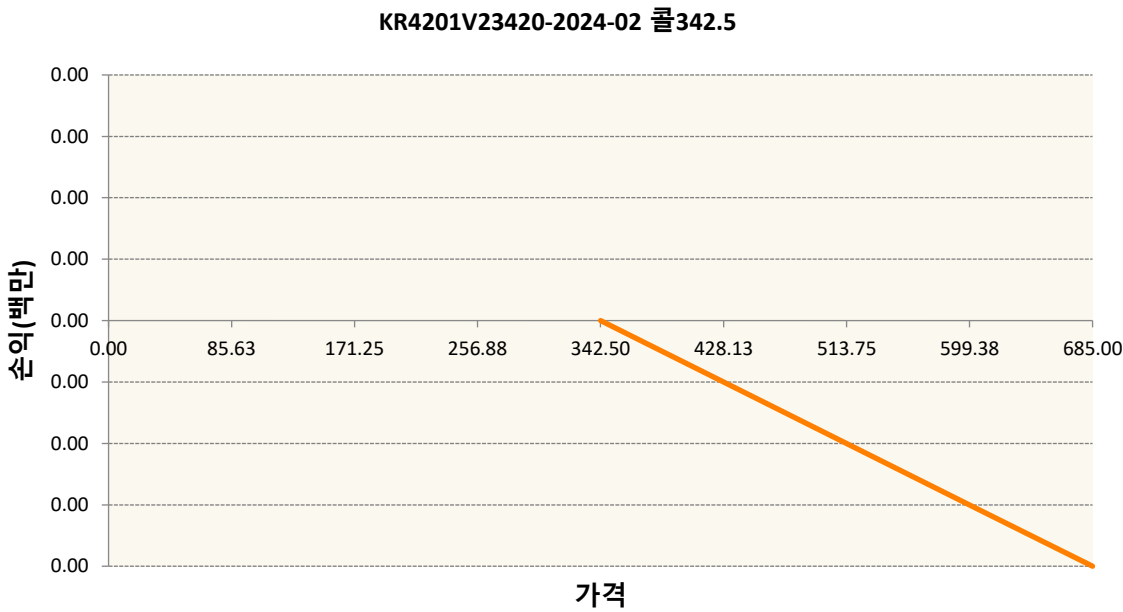
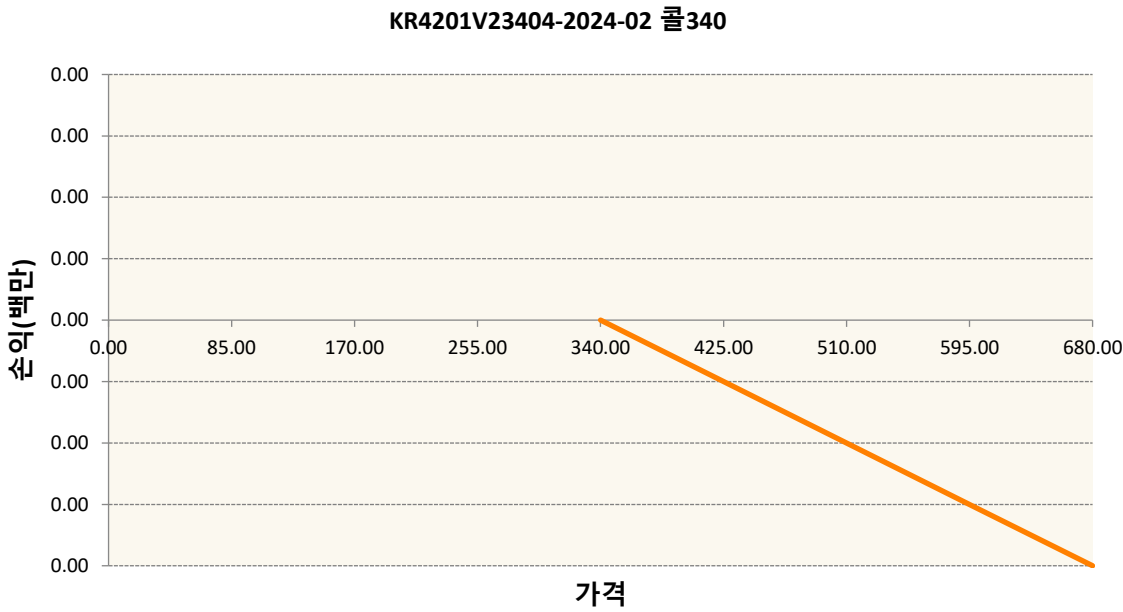
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

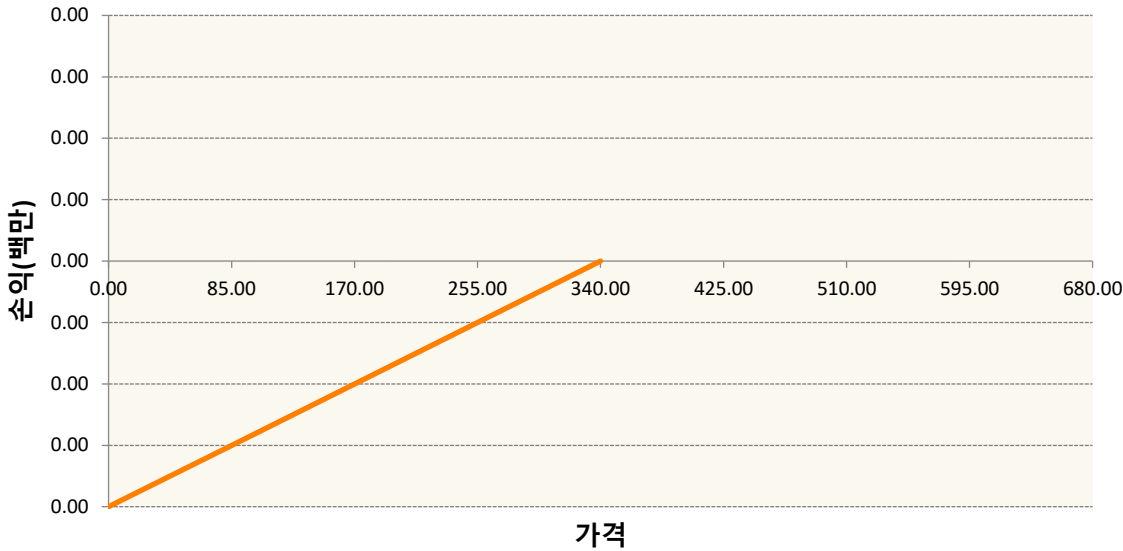
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	8,108	29,748	-21,640	장내
누계	유가증권	옵션	0	51,213	-51,213	장내

2. 만기시점의 손익구조



KR4301V23402-2024-02 풋340



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201V23404		2024-02 콜340					2,082
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	887	862	832	796	756	711	663
-5.33%	799	752	700	643	584	522	457
-2.67%	603	532	460	385	310	234	157
0%	249	166	83	0	-83	-166	-249
2.67%	-282	-360	-440	-520	-601	-682	-764
5.33%	-971	-1,032	-1,096	-1,164	-1,233	-1,305	-1,379
8.00%	-1,775	-1,814	-1,858	-1,908	-1,962	-2,020	-2,082
KR4201V23420		2024-02 콜342.5					332
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	130	127	123	117	111	105	97
-5.33%	119	112	104	96	87	77	67
-2.67%	92	81	70	58	46	34	21
0%	41	27	14	0	-14	-27	-41
2.67%	-39	-53	-66	-80	-94	-108	-122
5.33%	-147	-158	-169	-181	-194	-206	-219
8.00%	-275	-283	-291	-300	-310	-321	-332
KR4301V23402		2024-02 풋340					683
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-667	-668	-669	-672	-674	-678	-683
-5.33%	-394	-398	-403	-409	-417	-425	-434
-2.67%	-144	-155	-166	-179	-191	-205	-218
0%	48	32	16	0	-16	-32	-48

2.67%	158	144	130	116	101	86	71
5.33%	202	195	187	177	167	157	145
8.00%	214	211	208	204	198	192	185

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)						(단위:백만원)
						2,992

공시일	2024-01-15
기준일	2024-01-12

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	1,953	0	1,953	

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	2024-01-15
기준일	2024-01-12

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	4,528	0	4,528	

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	2024-01-15
기준일	2024-01-12

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	17,670	0	17,670	
누계	통화	선도	0	17,502	-17,502	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213DAT KRW/USD 31-01-24E	188
FXW213DBV KRW/USD 29-02-24E	645
FXW213DCB KRW/USD 31-01-24E	26
FXW213DCS KRW/USD 31-01-24E	32
FXW213DCT KRW/USD 29-03-24E	510
IE00BD8RGM75	

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

717

공시일	2024-01-15
기준일	2024-01-12

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

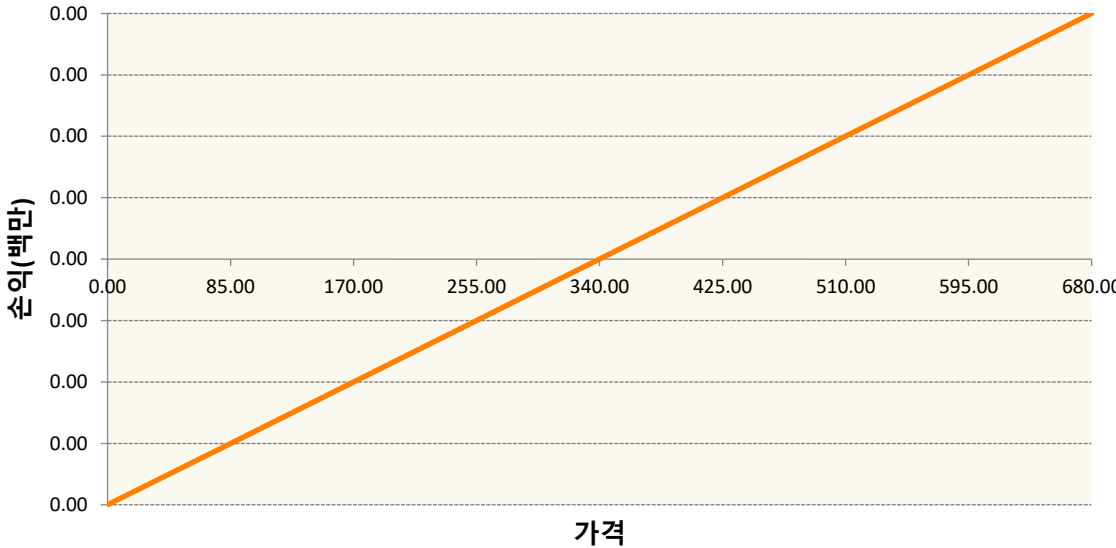
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	425	0	425	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101V30005-2024-03 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101V30005			2024-03 코스피200지수선물				34
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-34	-34	-34	-34	-34	-34	-34
-5.33%	-23	-23	-23	-23	-23	-23	-23
-2.67%	-11	-11	-11	-11	-11	-11	-11
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	11	11	11	11	11	11	11
5.33%	23	23	23	23	23	23	23
8.00%	34	34	34	34	34	34	34

공시일	2024-01-15
기준일	2024-01-12

SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

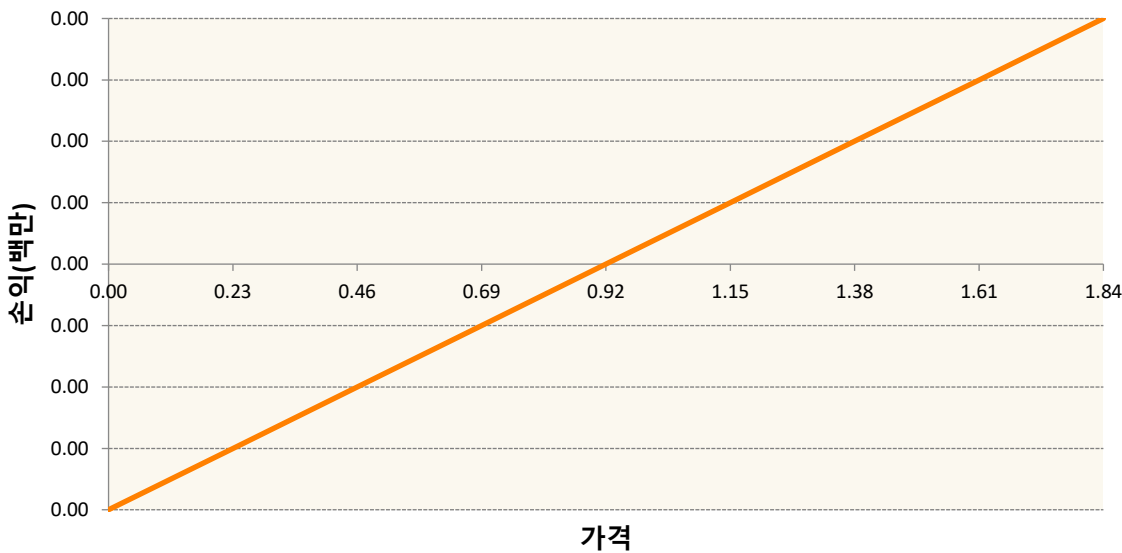
1. 계약금액

(단위:백만원)

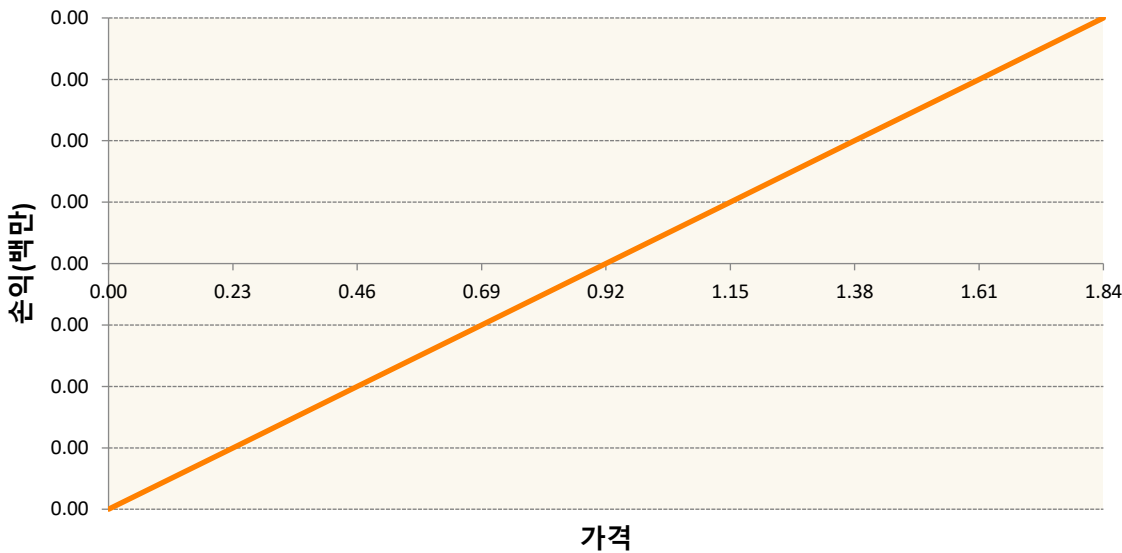
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	18,281	0	18,281	

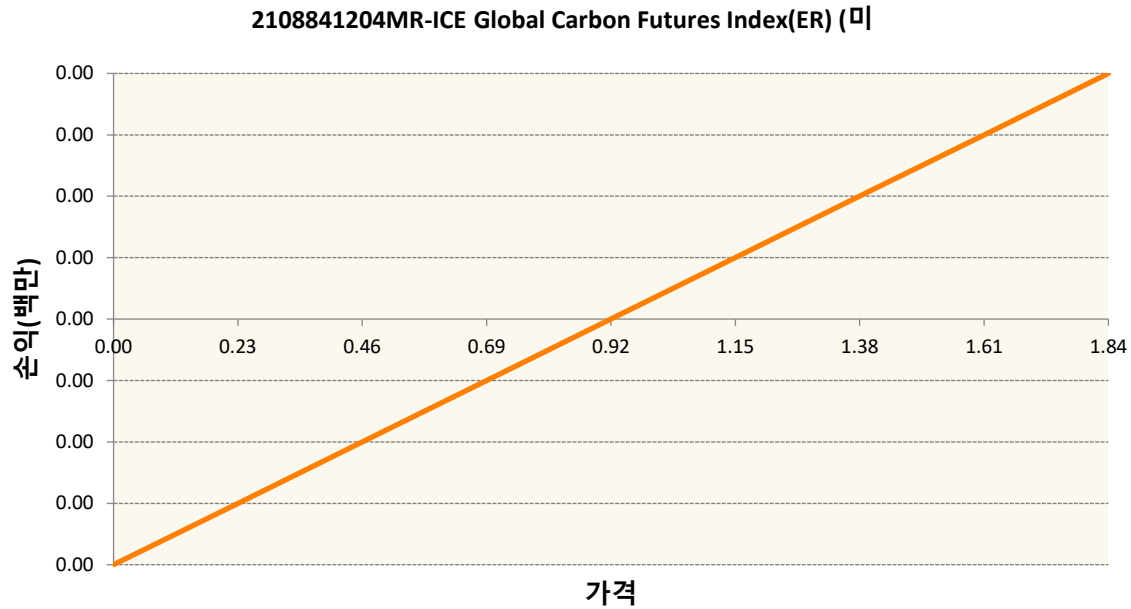
2. 만기시점의 손익구조

2108840920KM-ICE Global Carbon Futures Index(ER) (키



2108840920MZ-ICE Global Carbon Futures Index(ER) (메





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108840920ICE Global Carbon Futures Index(ER) (키		913
2108840920ICE Global Carbon Futures Index(ER) (메		183
2108841204ICE Global Carbon Futures Index(ER) (미		365

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,871

공시일	2024-01-15
기준일	2024-01-12

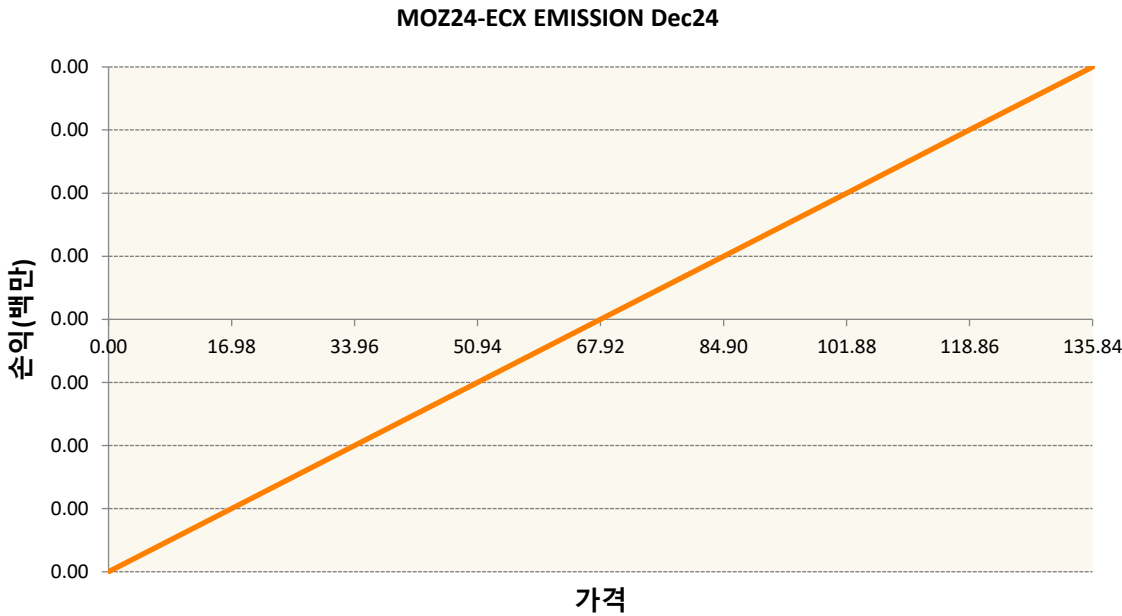
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	8,304	0	8,304	
누계	지수	스왑	424	0	424	장외
누계	통화	선도	0	2,425	-2,425	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213DCS₩ KRW/EUR 31-01-24E	15
FXW213DCS₩ KRW/EUR 31-01-24E	63
FXW213DCS₩ KRW/EUR 31-01-24E	116
MOZ24 ECX EMISSION Dec24	664
SWICEUACN ICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX	4

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

(단위:백만원)

1,334

공시일	2024-01-15
기준일	2024-01-12

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)	11
SWCSI00000 신한CSI Index 230622 (메리츠)	11
SWCSI00000 신한CSI Index 230922 (키움)	7
SWCSI00000 신한CSI Index 231013 (NH)	7

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

(단위:백만원)

51

공시일	2024-01-15
기준일	2024-01-12

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)	10
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(NH)	8
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(메리츠)	12
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(키움)	2

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

(단위:백만원)

34

공시일	2024-01-15
기준일	2024-01-12

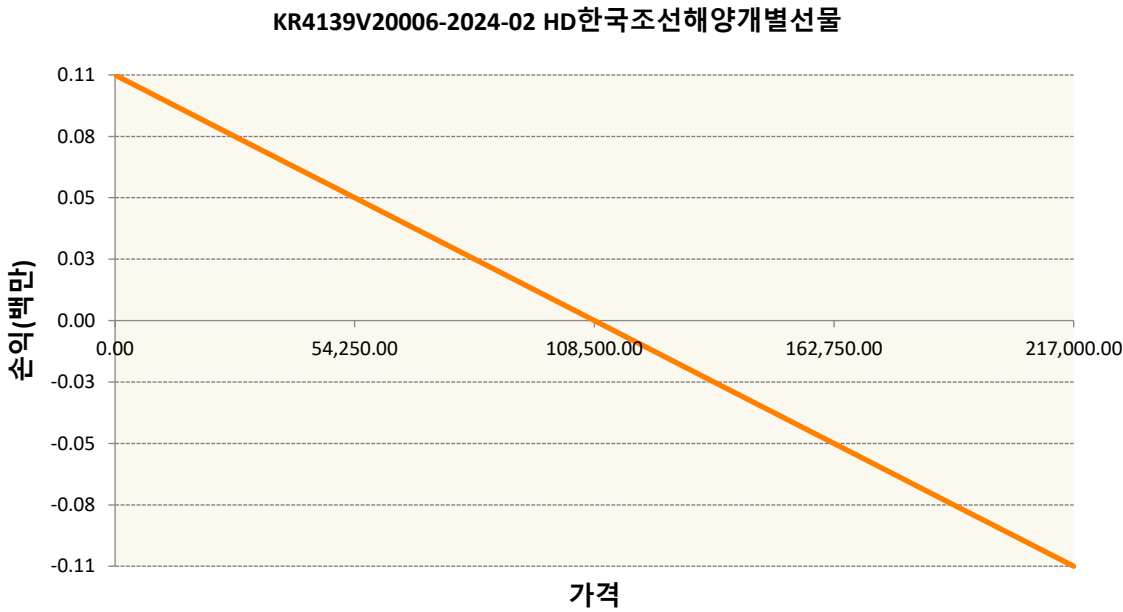
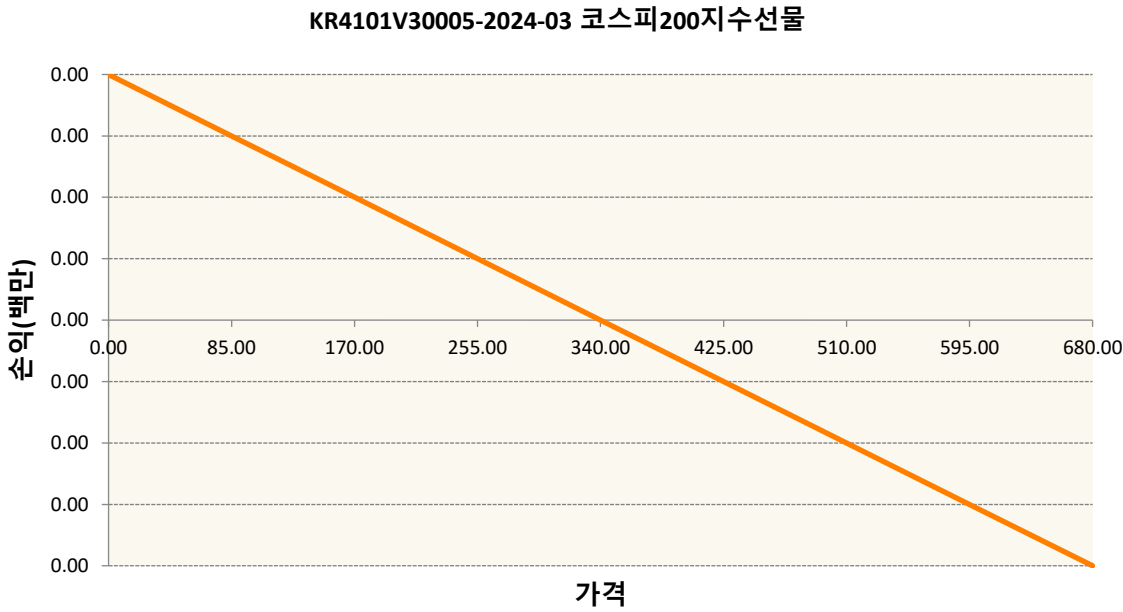
에퀴티알파일반사모혼합자산

1. 계약금액

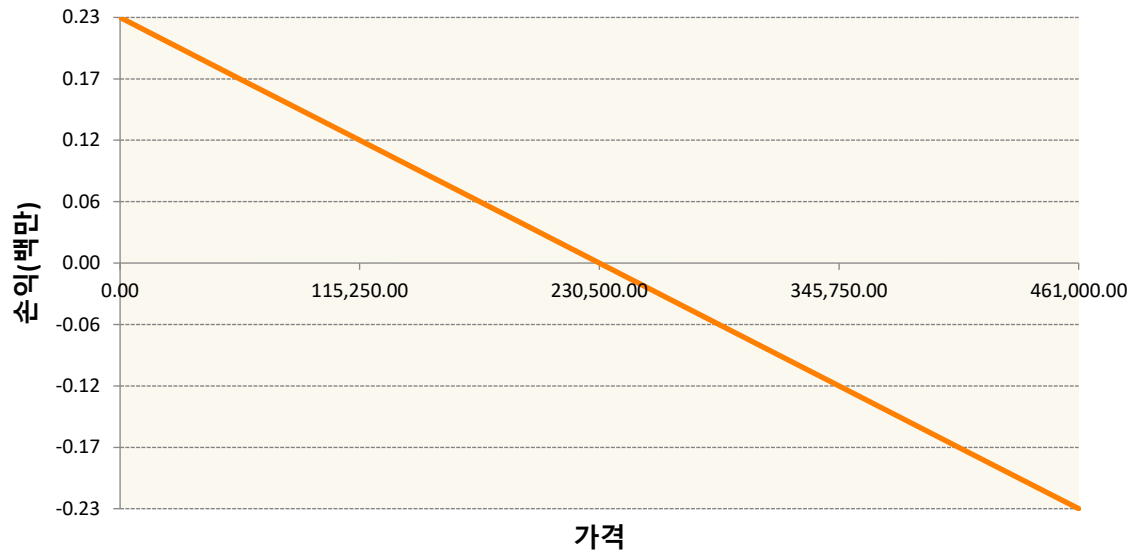
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	67	-67	장내
누계	유가증권	선물	0	1,105	-1,105	장내

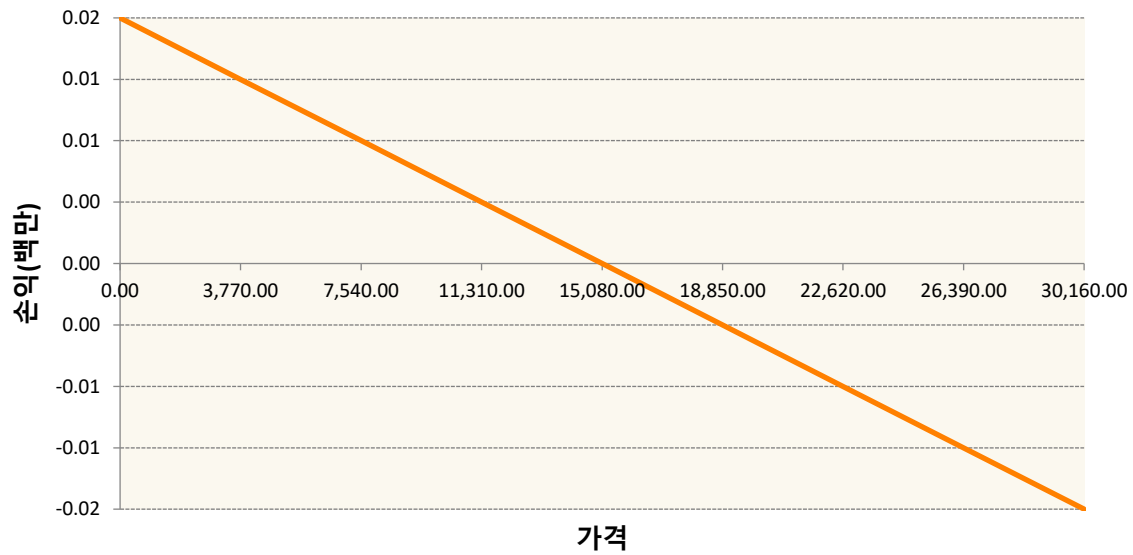
2. 만기시점의 손익구조



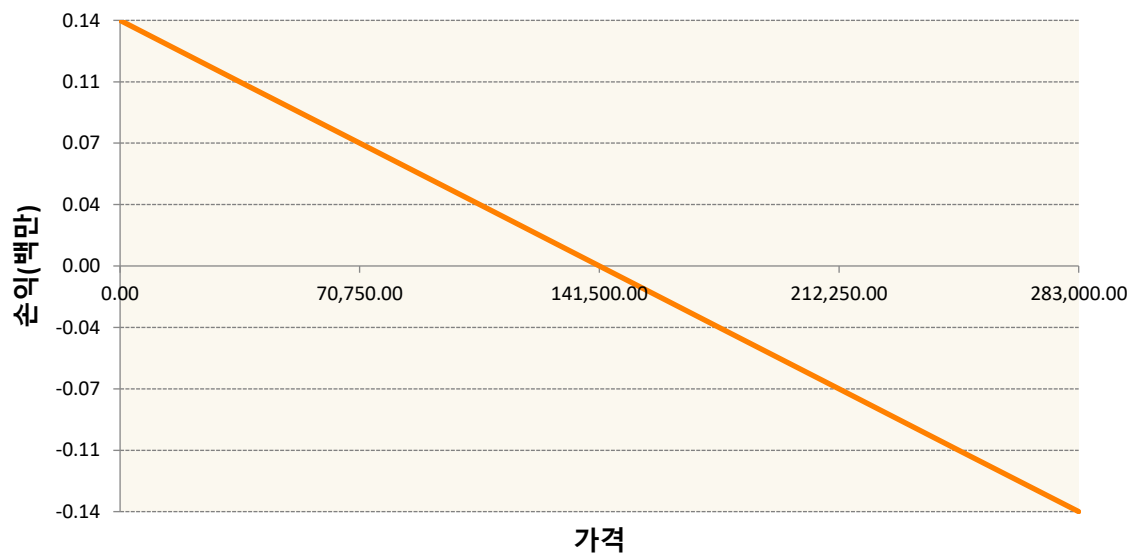
KR4156V20000-2024-02 NAVER개별선물



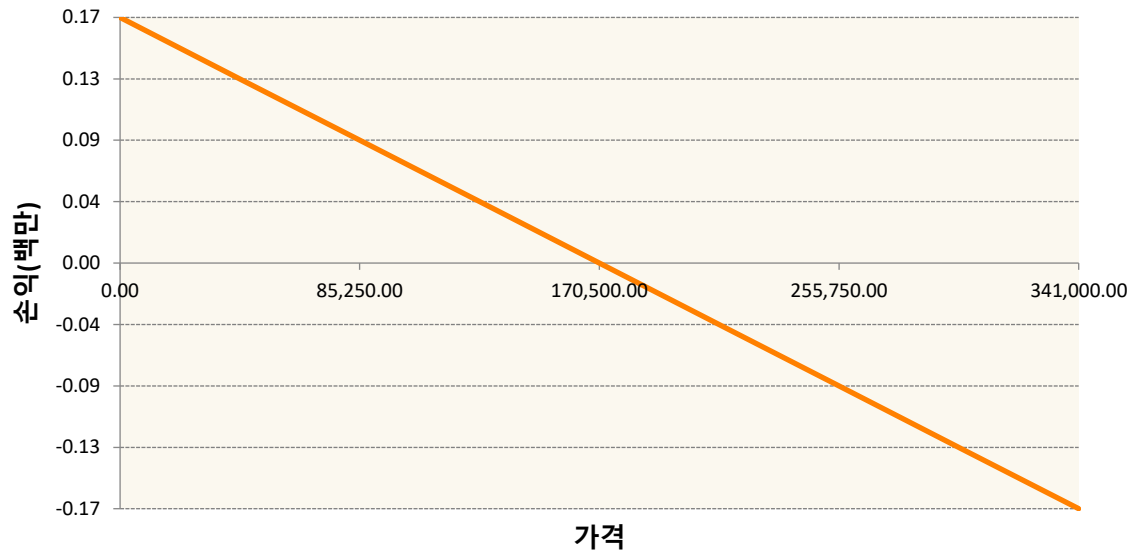
KR41B9V20007-2024-02 두산에너지빌리티개별선물



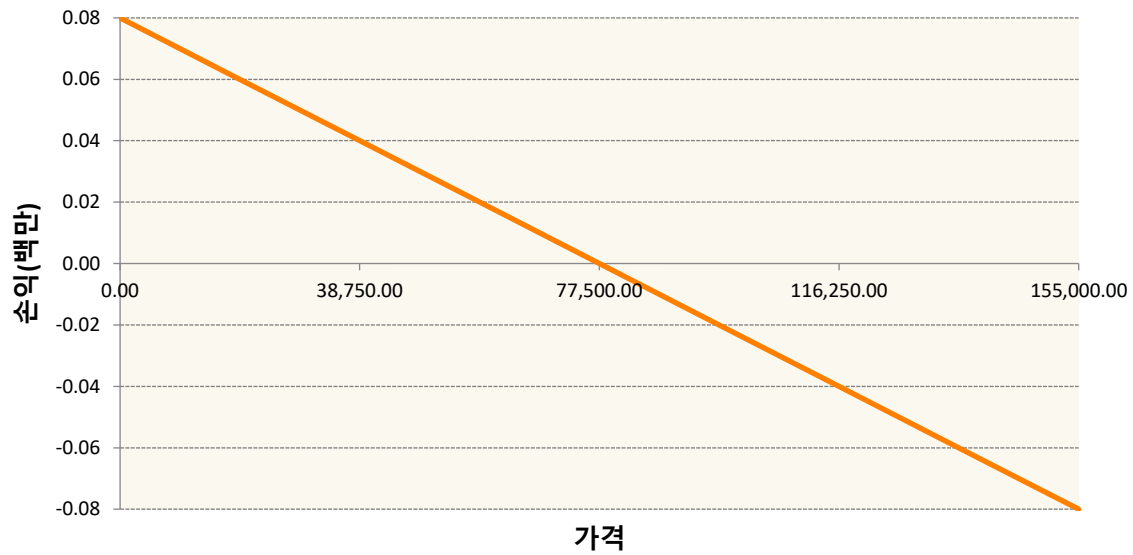
KR41BHV20009-2024-02 한화에어로스페이스개별선물



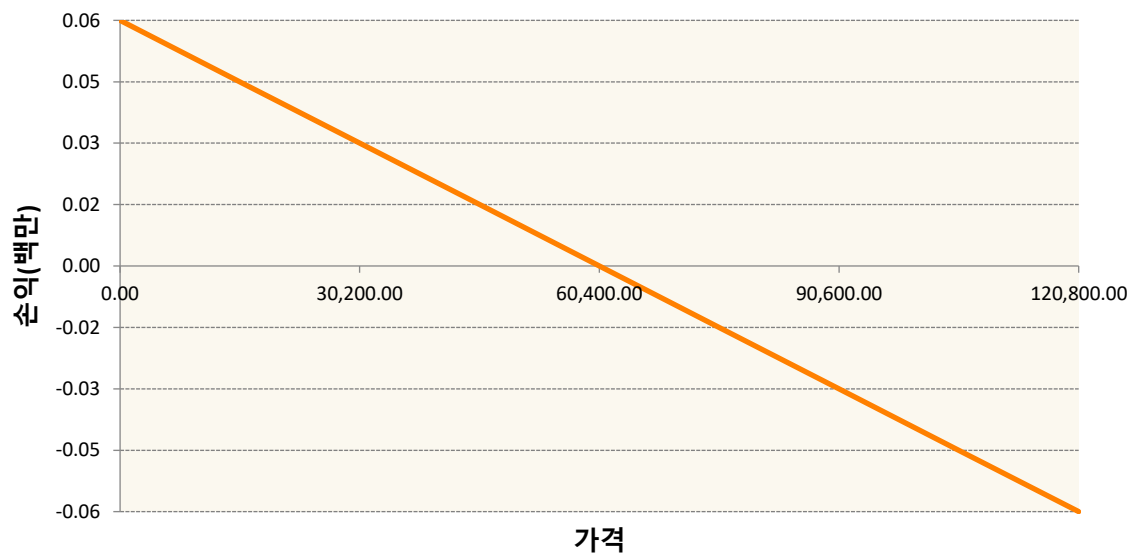
KR41C5V20004-2024-02 삼성에스디에스개별선물



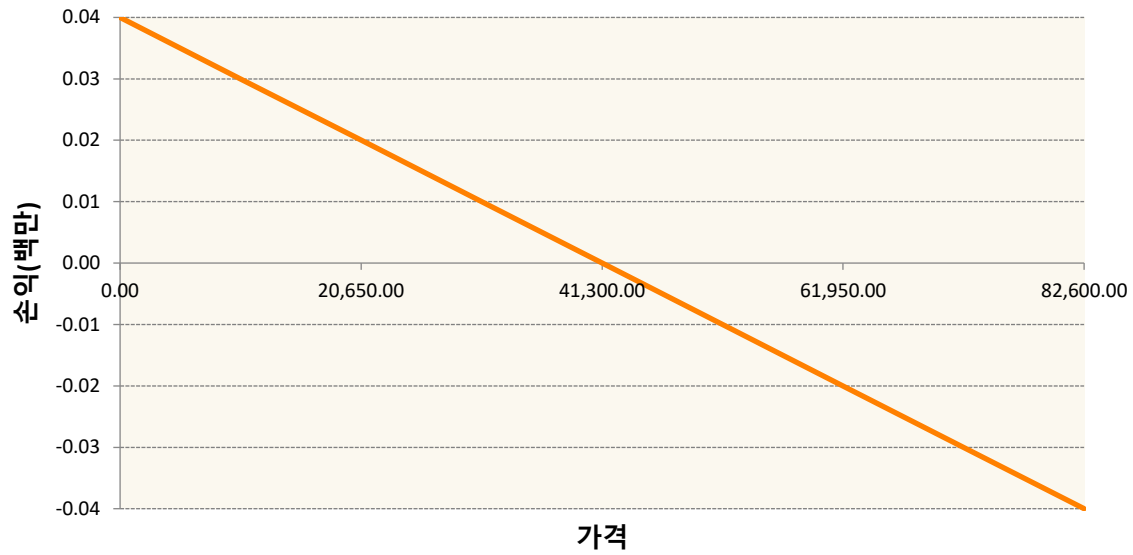
KR41CDV20006-2024-02 현대미포조선개별선물



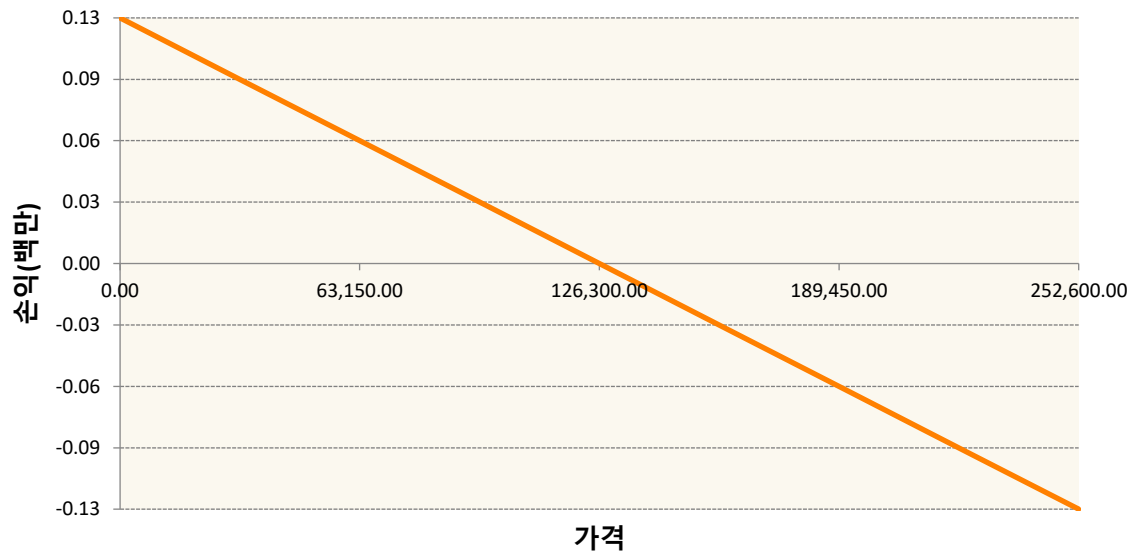
KR41CFV20001-2024-02 카카오개별선물



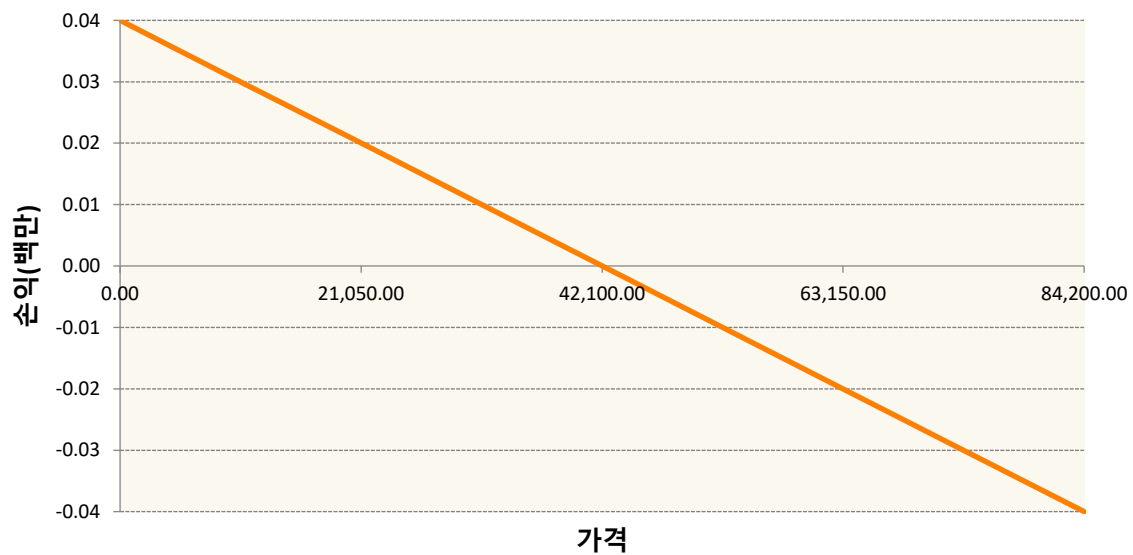
KR41CQV20008-2024-02 와이지엔터테인먼트개별선물



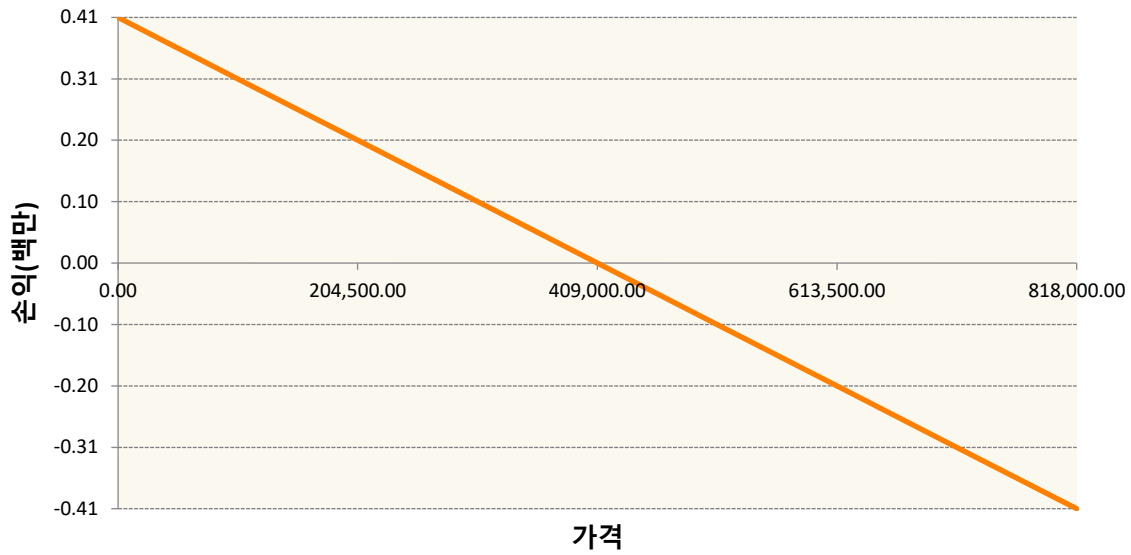
KR41DBV20008-2024-02 LIG넥스원개별선물



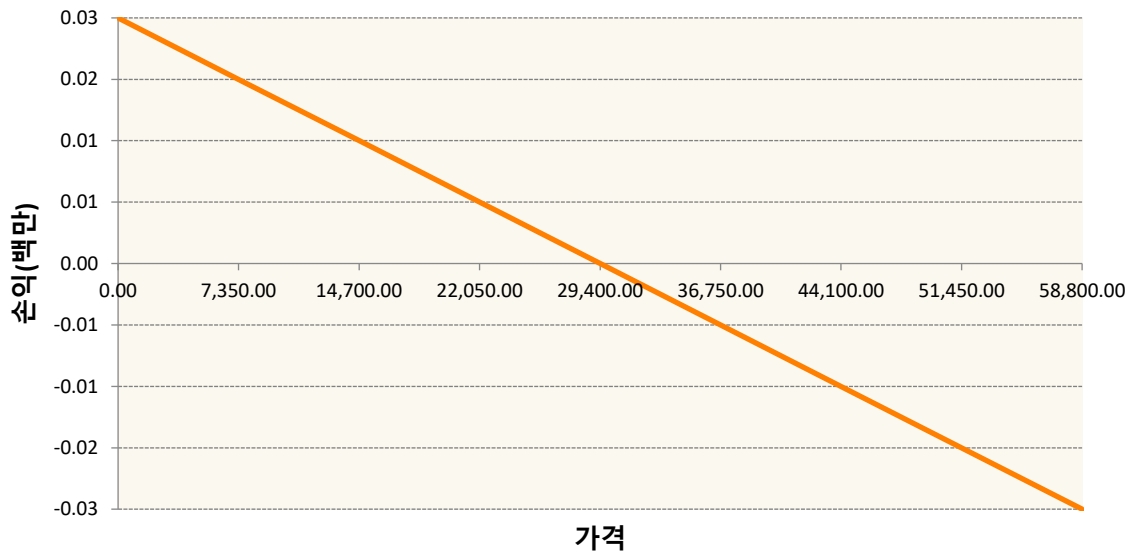
KR41ENV20001-2024-02 동진세미캠개별선물



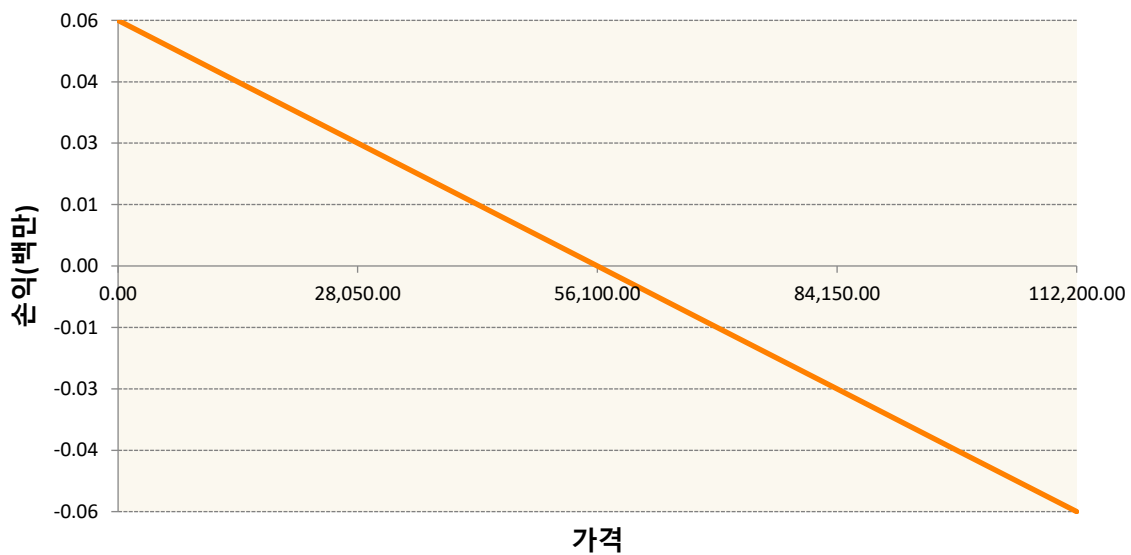
KR41F5V20001-2024-02 LG에너지솔루션개별선물



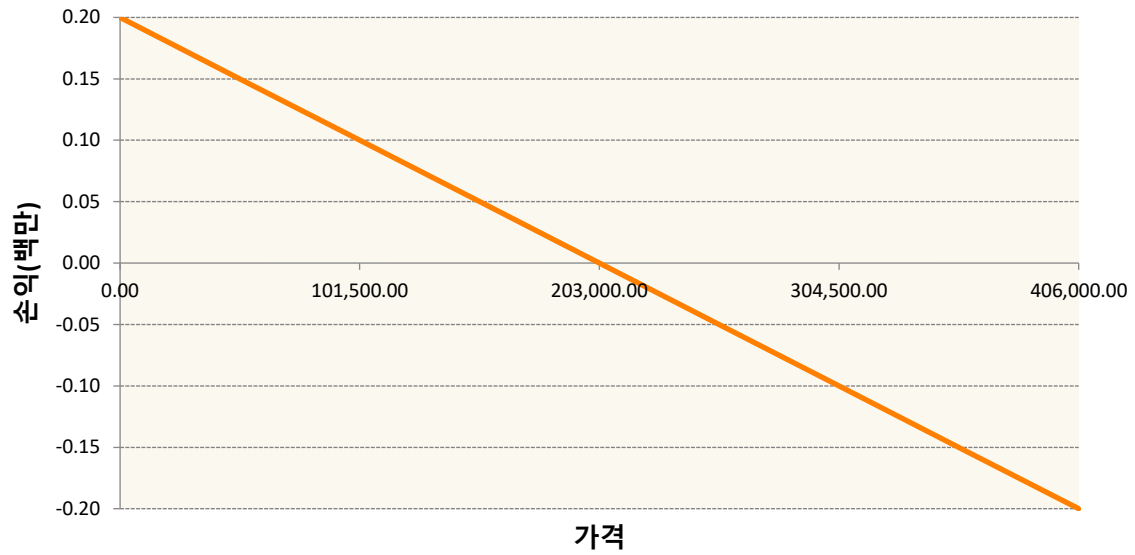
KR41F6V20009-2024-02 카카오뱅크개별선물



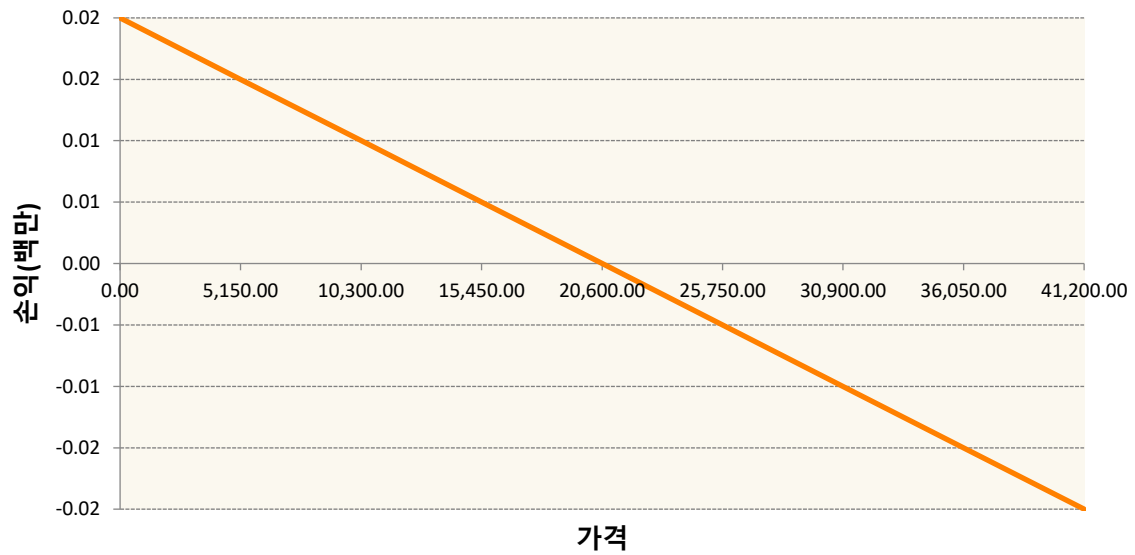
KR41F7V20007-2024-02 카카오페이개별선물



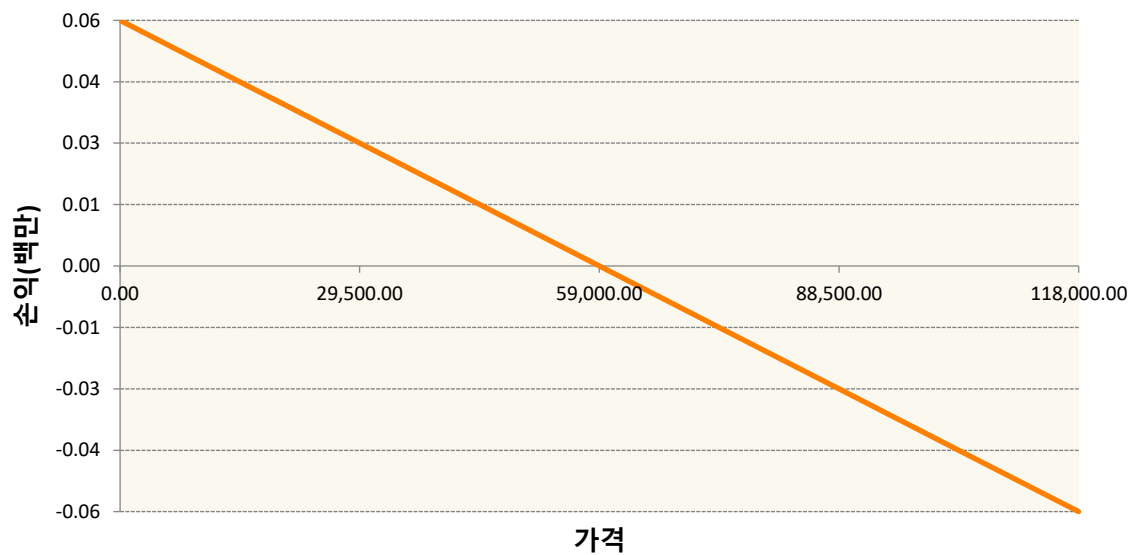
KR41F8V20005-2024-02 크래프톤개별선물



KR41FAV20005-2024-02 HMM개별선물



KR41FKV20004-2024-02 메리츠금융지주개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
KR4101V300 2024-03 코스피200지수선물	82
KR4139V200 2024-02 HD한국조선해양개별선물	0.35
KR4156V200 2024-02 NAVER개별선물	0.37
KR41B9V200 2024-02 두산에너지개별선물	0.36
KR41BHV200 2024-02 한화에어로스페이스개별선물	1
KR41C5V200 2024-02 삼성에스디에스개별선물	0.41
KR41CDV200 2024-02 현대미포조선개별선물	0.5
KR41CFV200 2024-02 카카오개별선물	0.34
KR41CQV200 2024-02 와이즈엔터테인먼트개별선물	0.36
KR41DBV200 2024-02 LIG넥스원개별선물	1
KR41ENV200 2024-02 동진세미캠개별선물	0.34
KR41F5V200 2024-02 LG에너지솔루션개별선물	0.33
KR41F6V200 2024-02 카카오뱅크개별선물	0.35
KR41F7V200 2024-02 카카오페이개별선물	0.36
KR41F8V200 2024-02 크래프톤개별선물	0.32
KR41FAV200 2024-02 HMM개별선물	0.36
KR41FKV200 2024-02 메리츠금융지주개별선물	0.33

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	89

공시일	2024-01-15
기준일	2024-01-12

코리아인덱스(주식-파생형)(종)

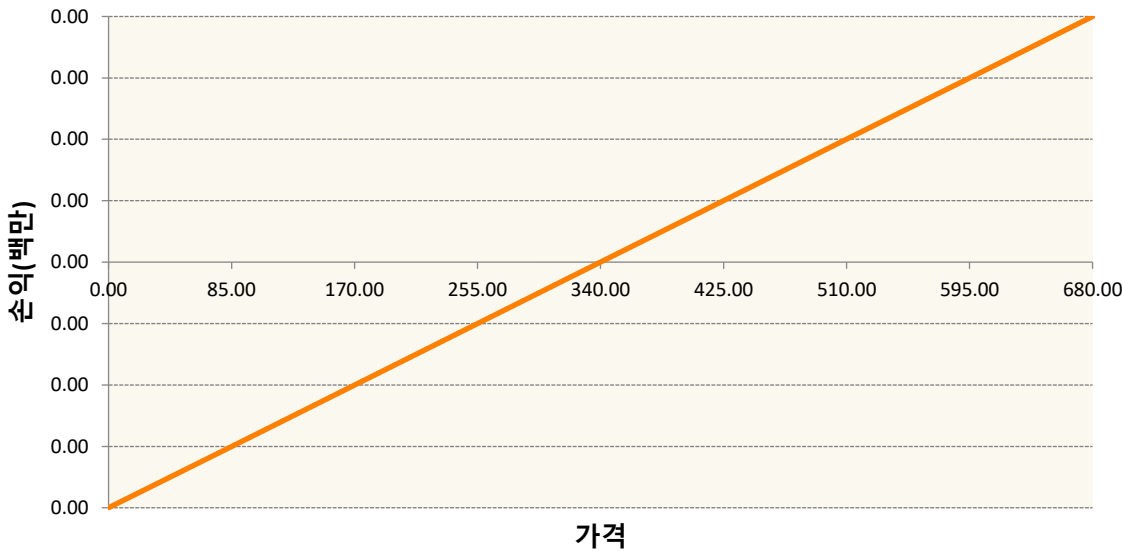
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,315	0	3,315	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101V30005-2024-03 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101V30005		2024-03 코스피200지수선물					264
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-264	-264	-264	-264	-264	-264	-264
-5.33%	-176	-176	-176	-176	-176	-176	-176
-2.67%	-88	-88	-88	-88	-88	-88	-88
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	88	88	88	88	88	88	88
5.33%	176	176	176	176	176	176	176
8.00%	264	264	264	264	264	264	264

공시일	2024-01-15
기준일	2024-01-12

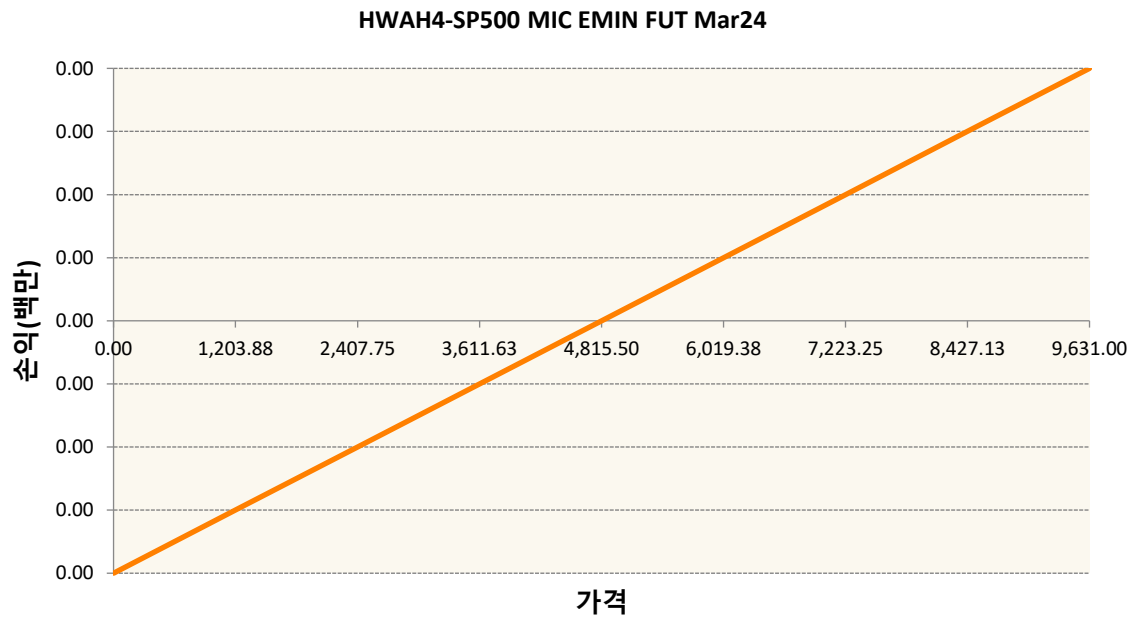
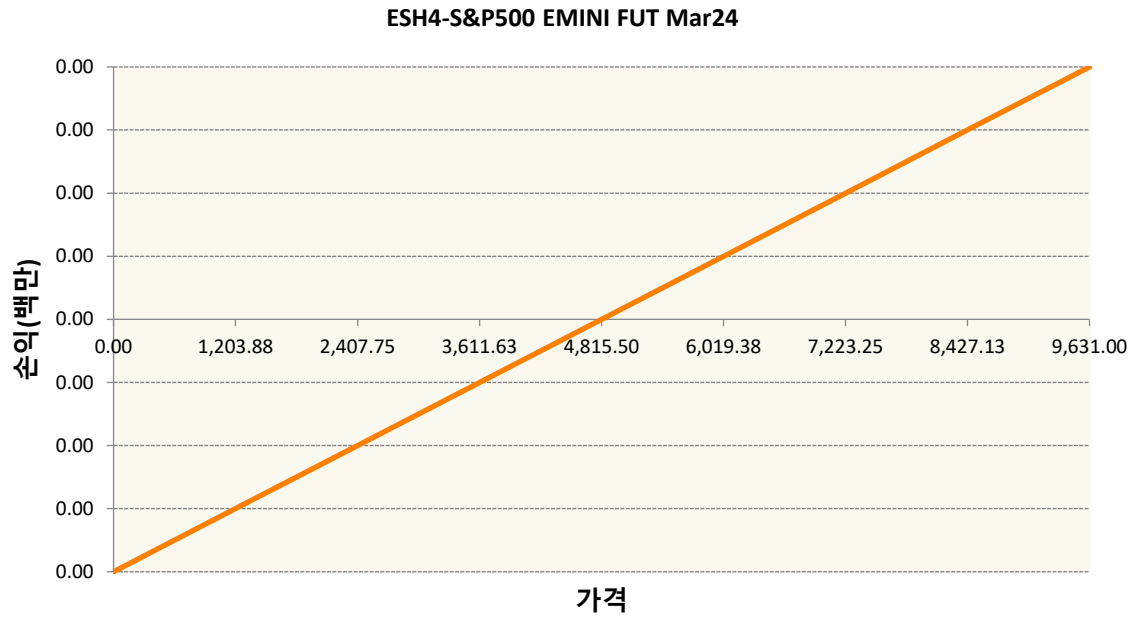
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

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	1,255	0	1,255	
누계	유가증권	선물	3,222	0	3,222	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESH4	S&P500 EMINI FUT Mar24	100
HWAH4	SP500 MIC EMIN FUT Mar24	258

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	298

공시일	2024-01-15
기준일	2024-01-12

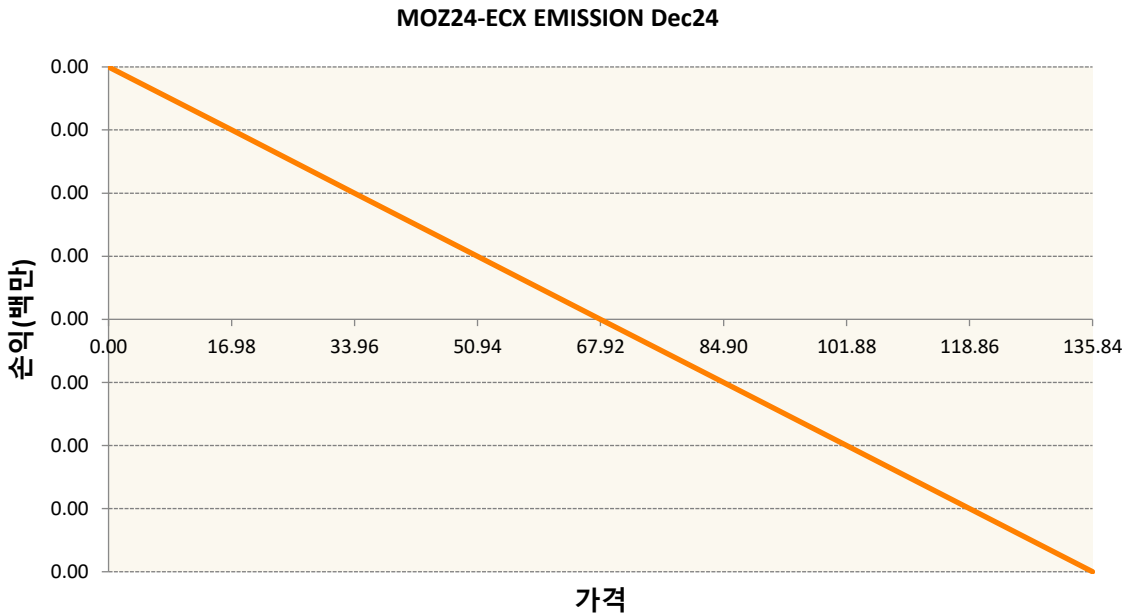
SOL유럽탄소배출권선물인버스ICE특별자산상

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	7,649	-7,649	
누계	지수	스왑	424	0	424	장외
누계	통화	선도	0	1,343	-1,343	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213DCS₩ KRW/EUR 31-01-24E	107
MOZ24 ECX EMISSION Dec24	612
SWICEUACN ICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX	4

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

(단위:백만원)

1,181

공시일	2024-01-15
기준일	2024-01-12

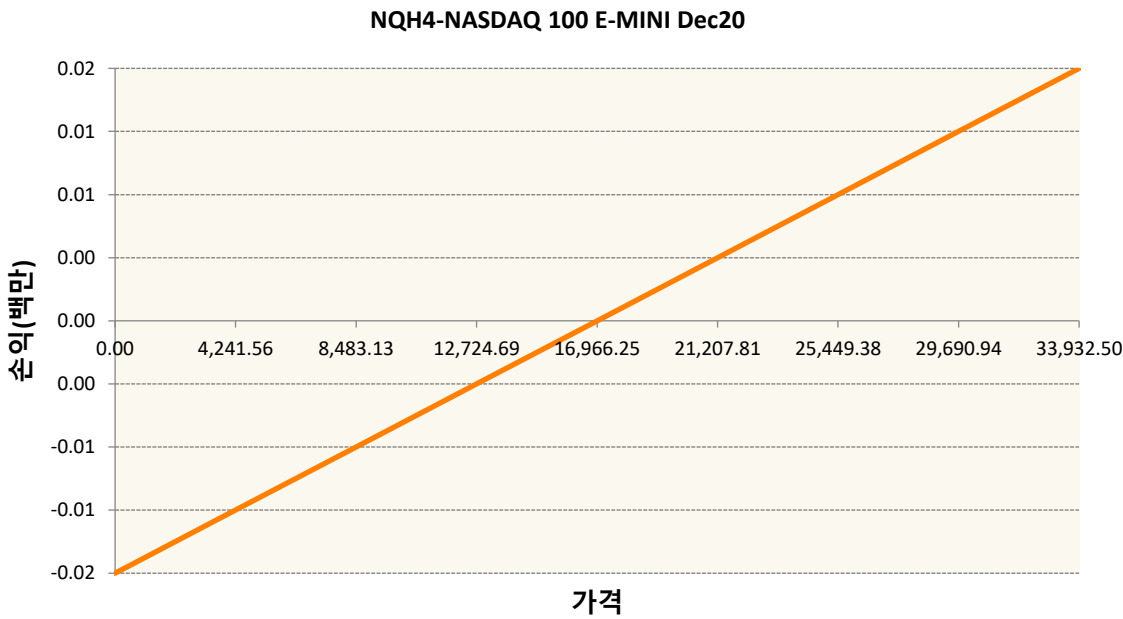
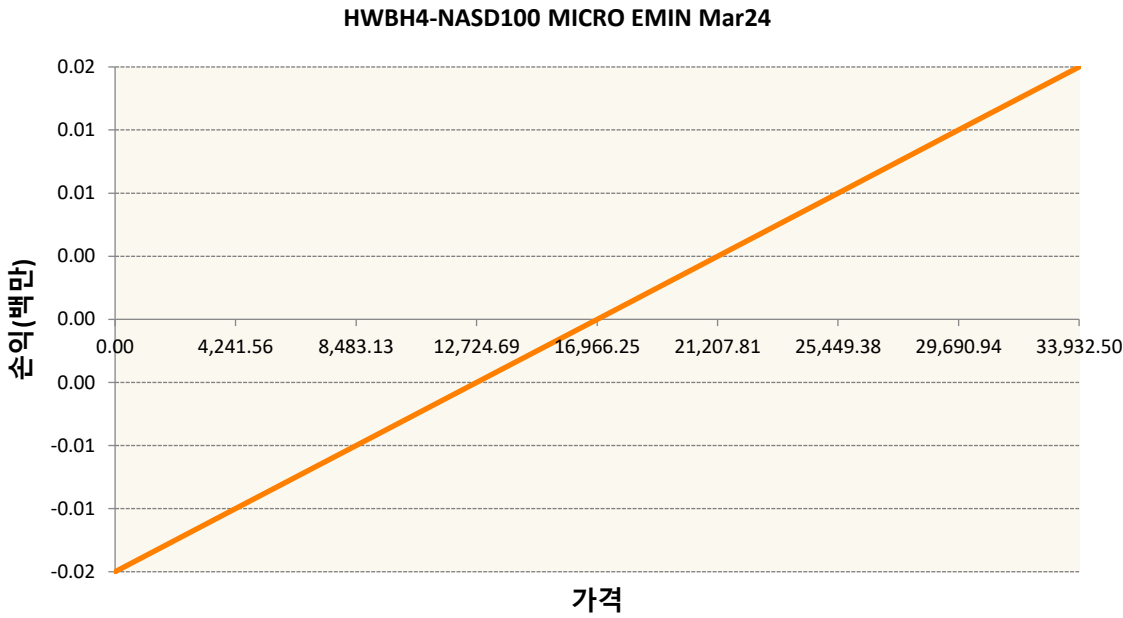
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

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	1,320	0	1,320	
누계	유가증권	선물	2,628	0	2,628	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
HWBH4	NASD100 MICRO EMIN Mar24		210
NQH4	NASDAQ 100 E-MINI Dec20		106

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)			(단위:백만원)
			291

공시일	2024-01-15
기준일	2024-01-12

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	19,592	0	19,592	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWKEDI0000 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	162
SWKEDI0000 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	162
SWKEDI0000 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	81
SWKEDI0000 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	243
SWKEDI0000 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	931

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

(단위:백만원)

1,091

공시일	2024-01-15
기준일	2024-01-12

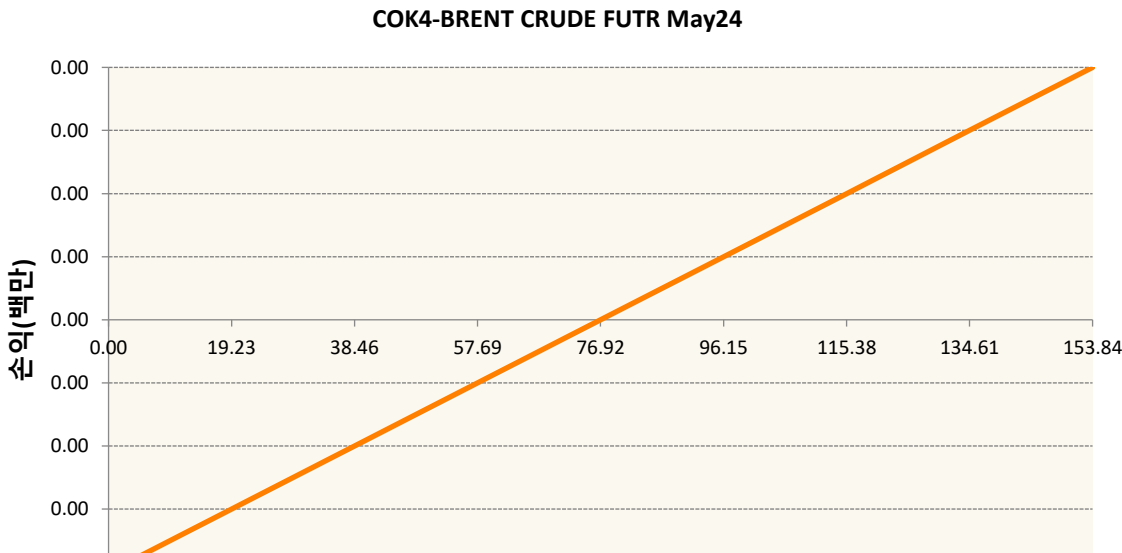
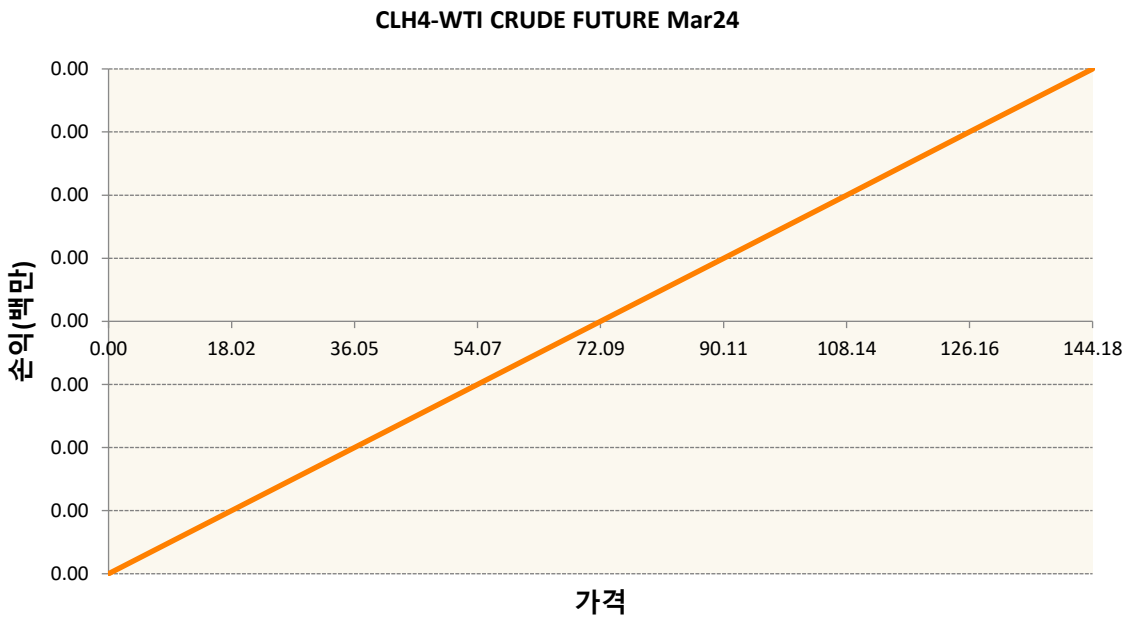
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

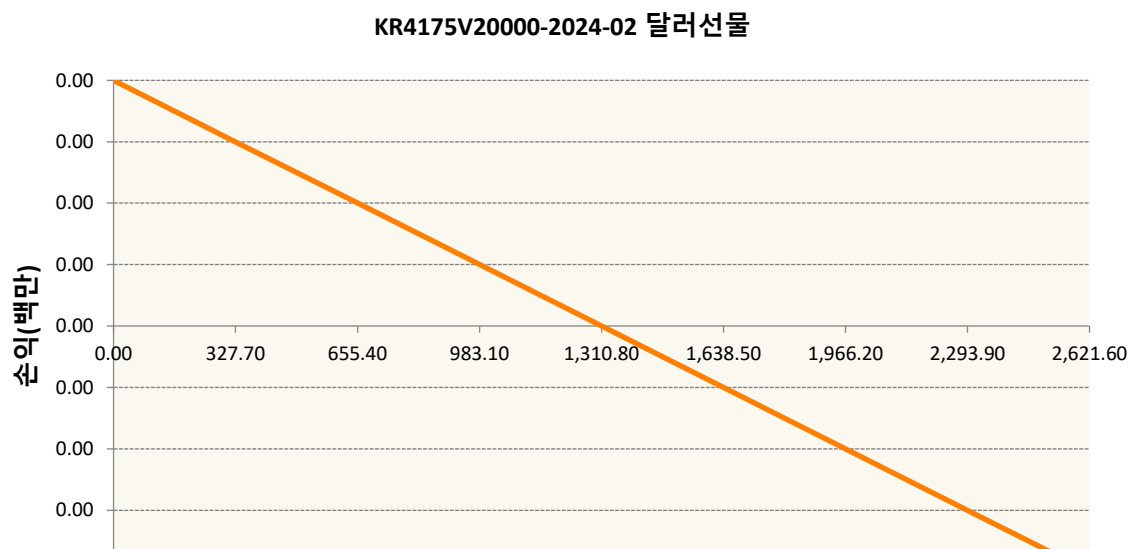
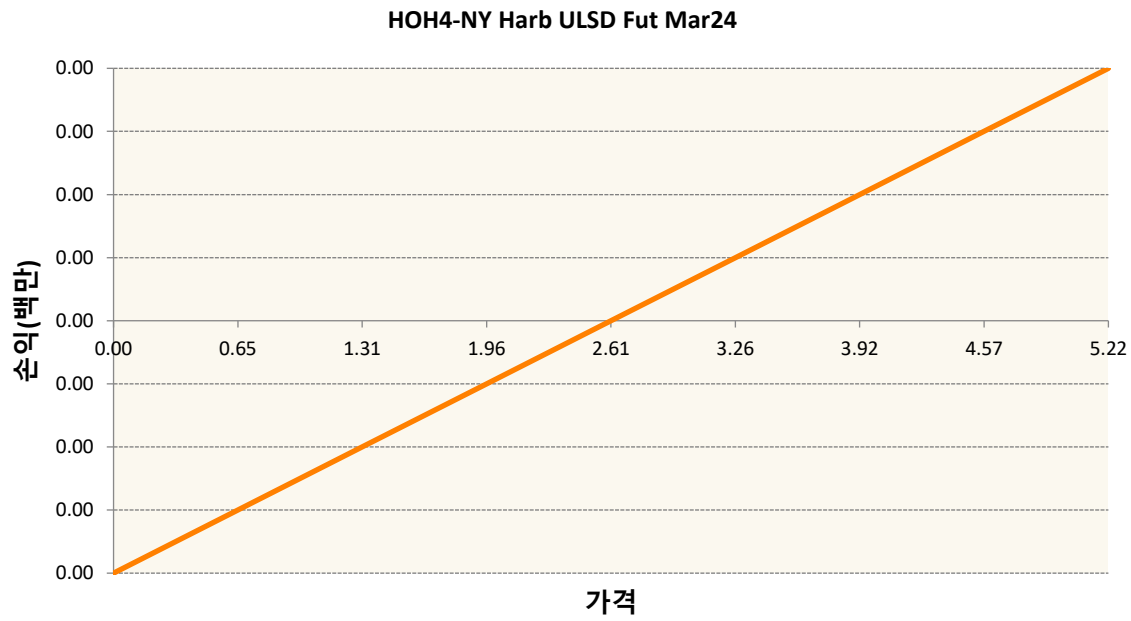
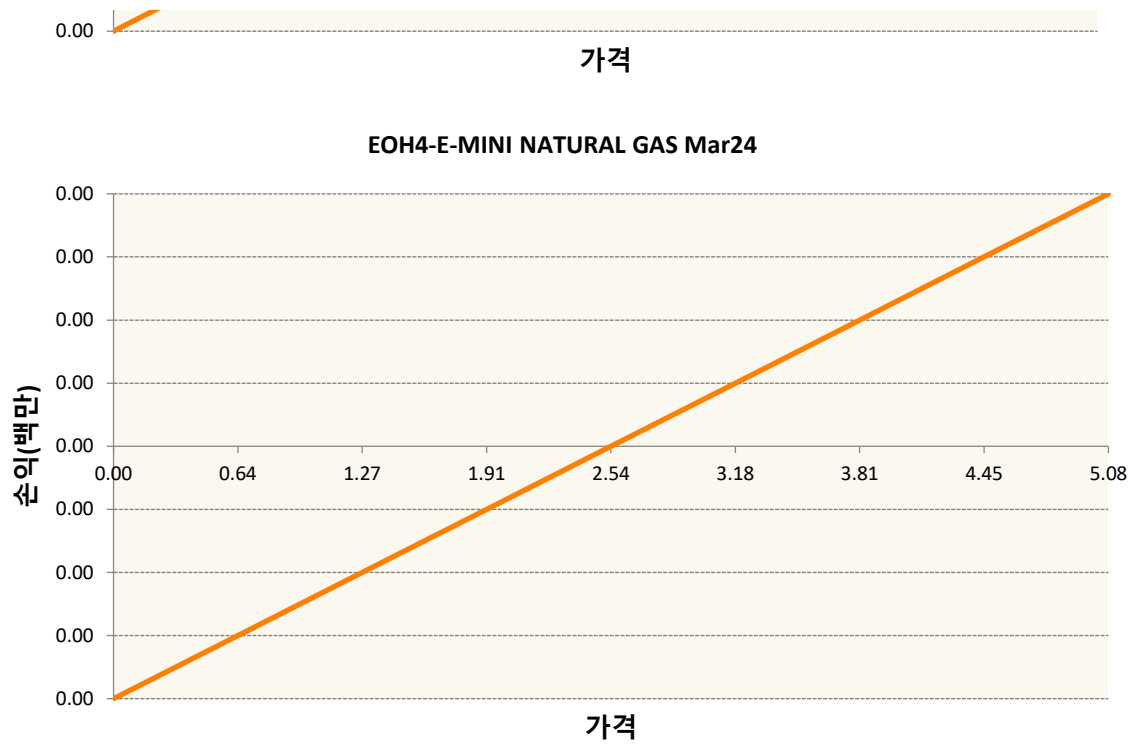
1. 계약금액

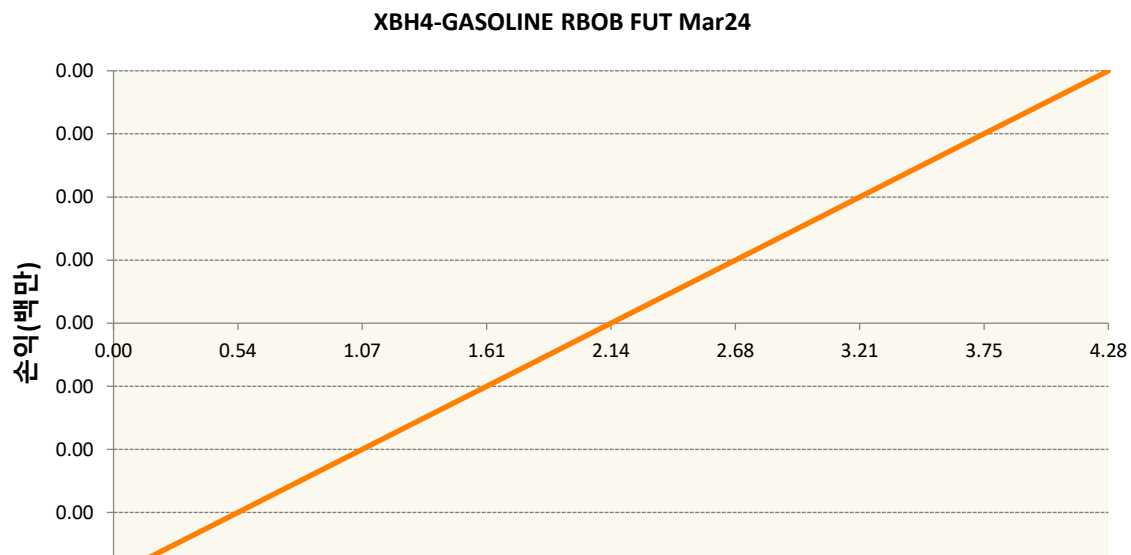
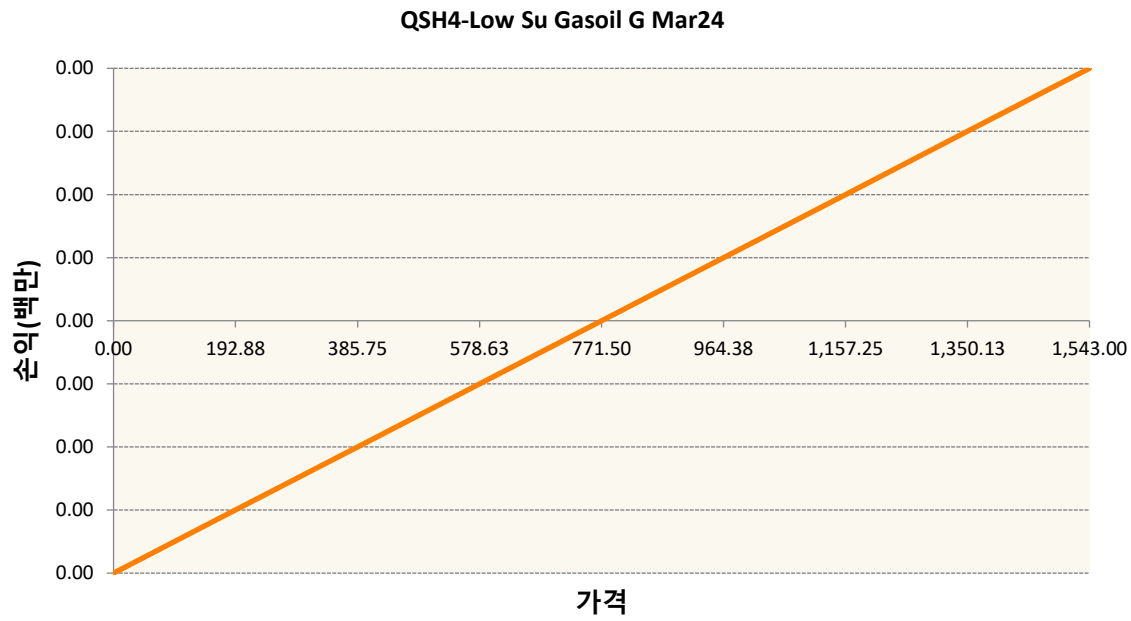
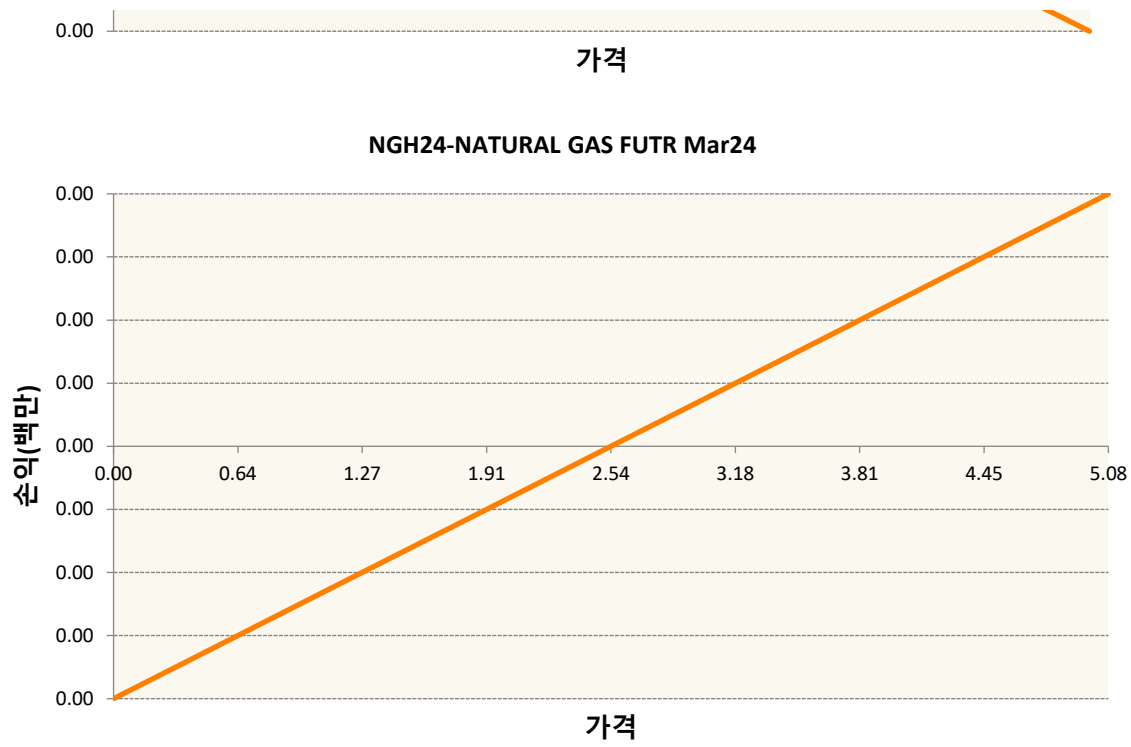
(단위:백만원)

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	284	0	284	
누계	유가증권	선물	909	0	909	
누계	통화	선물	0	197	-197	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
CLH4	WTI CRUDE FUTURE Mar24	23
COK4	BRENT CRUDE FUTR May24	24
EOH4	E-MINI NATURAL GAS Mar24	1
HOH4	NY Harb ULSD Fut Mar24	12
KR4175V200 2024-02 달러선물		16
NGH24	NATURAL GAS FUTR Mar24	19
QSH4	Low Su Gasoil G Mar24	8
XBH4	GASOLINE RBOB FUT Mar24	9

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	232