

공시일	2023-06-30
기준일	2023-06-29

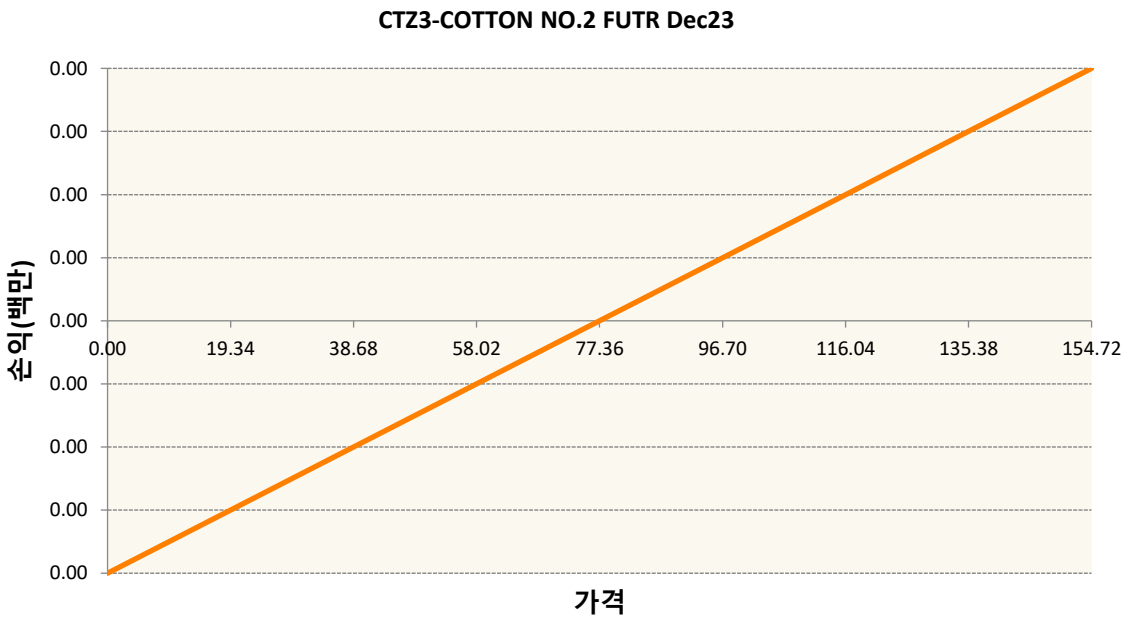
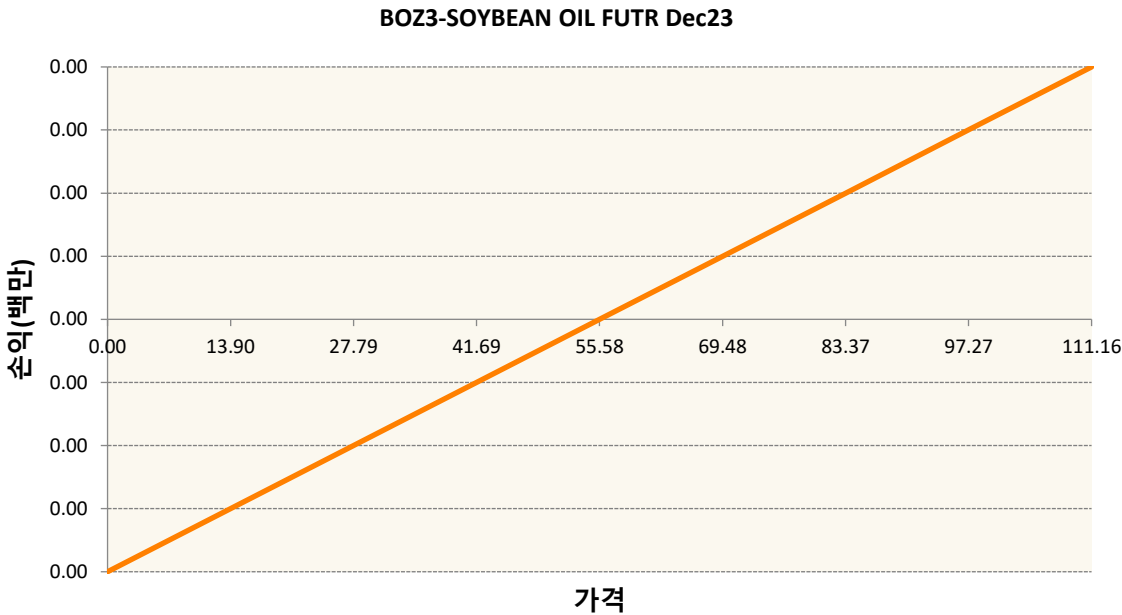
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

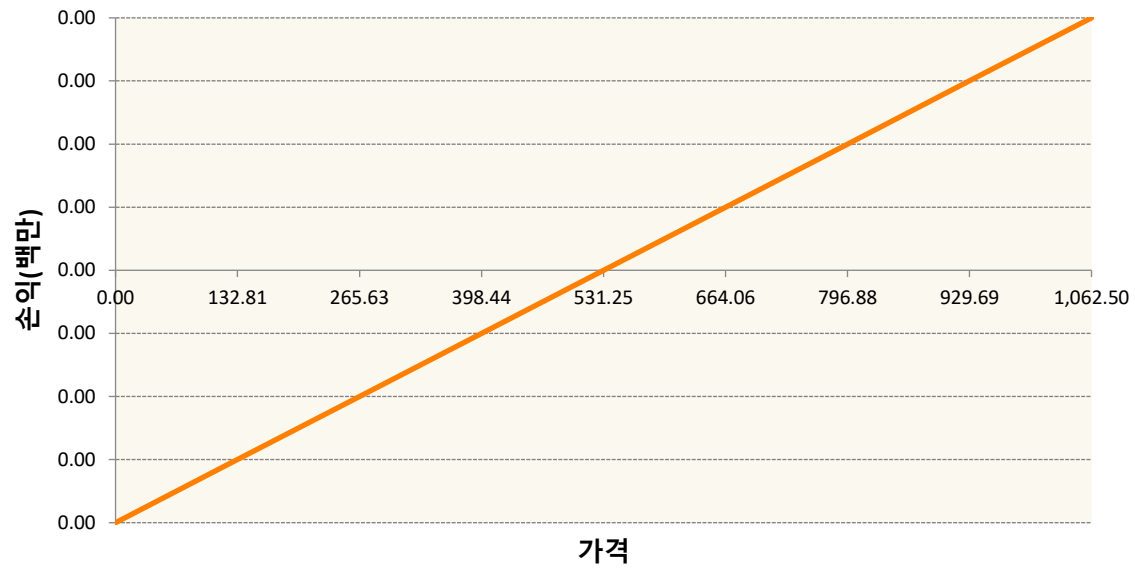
(단위:USD 백만)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,107	461	4,647	

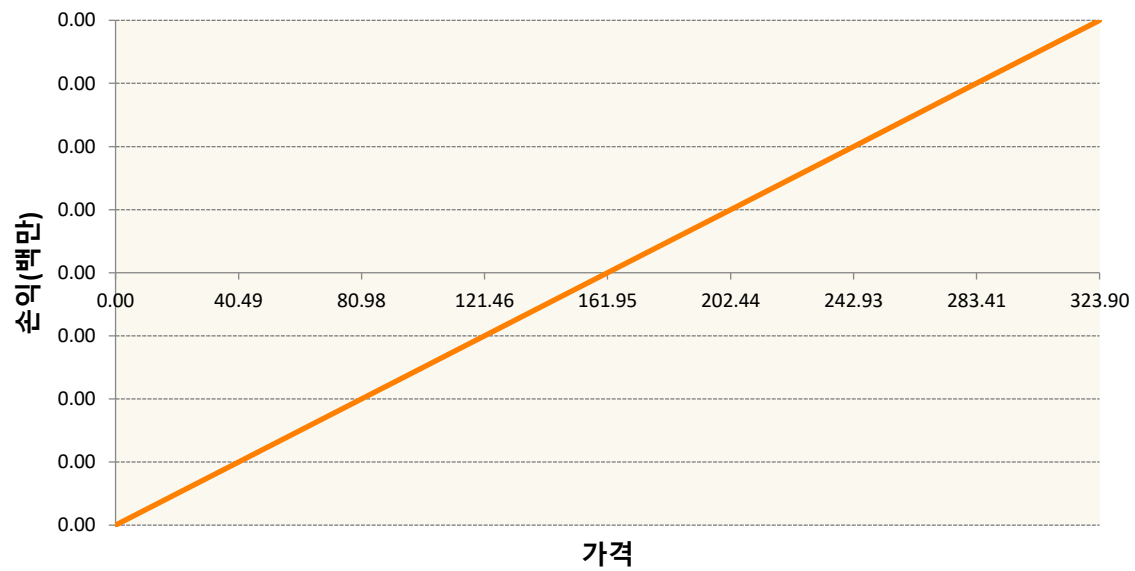
2. 만기시점의 손익구조



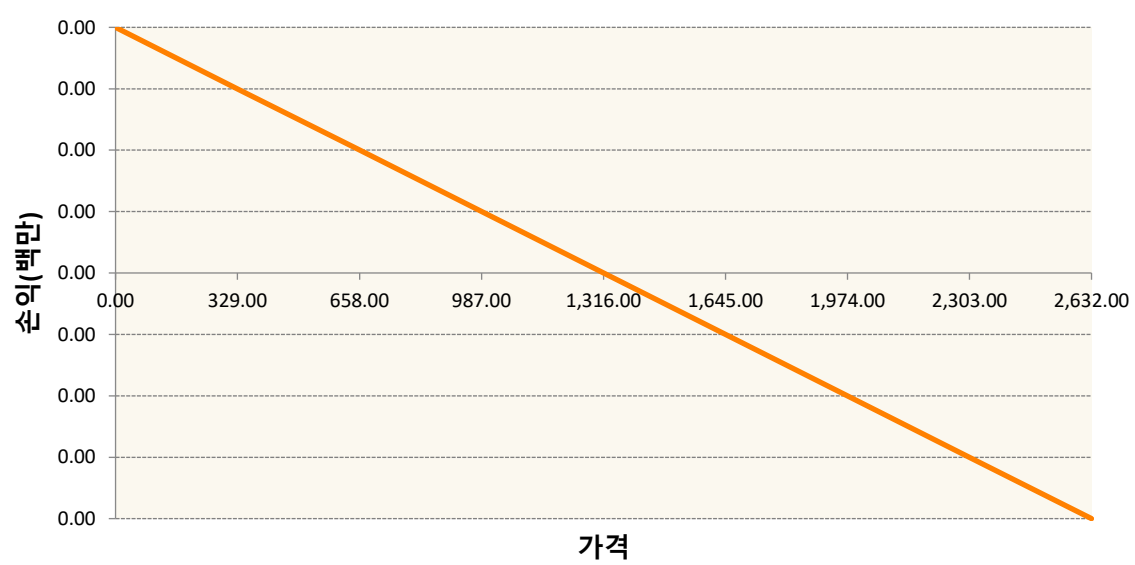
CU3-CORN FUTURE Sep23



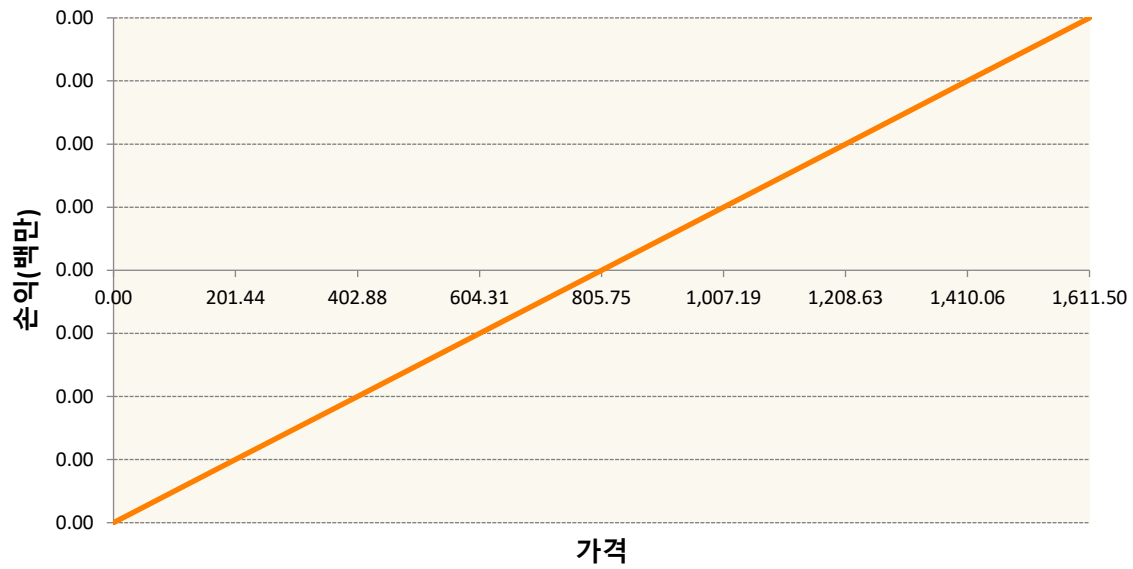
KCU3-COFFEE 'C' FUTURE Sep23



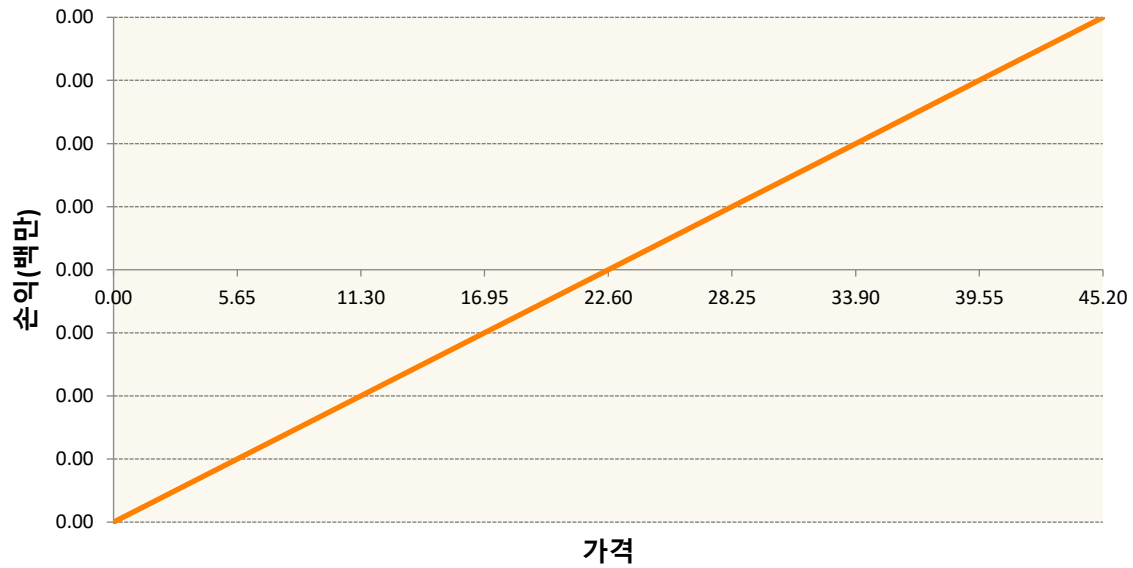
KR4175T70009-2023-07 달러선물



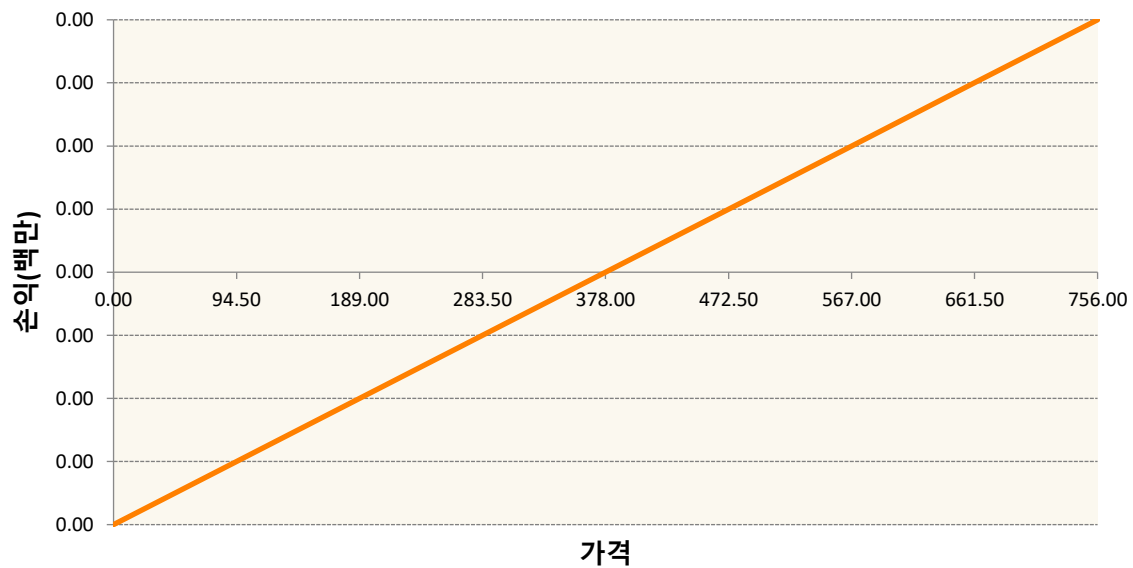
KWU3-KC HRW WHEAT FUT Sep23

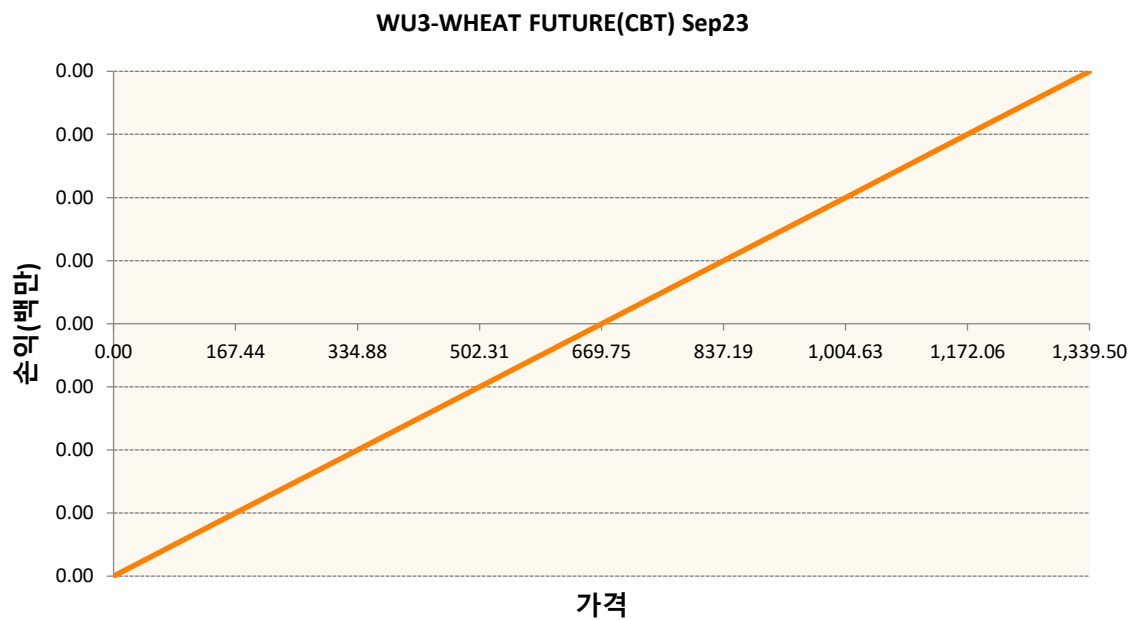
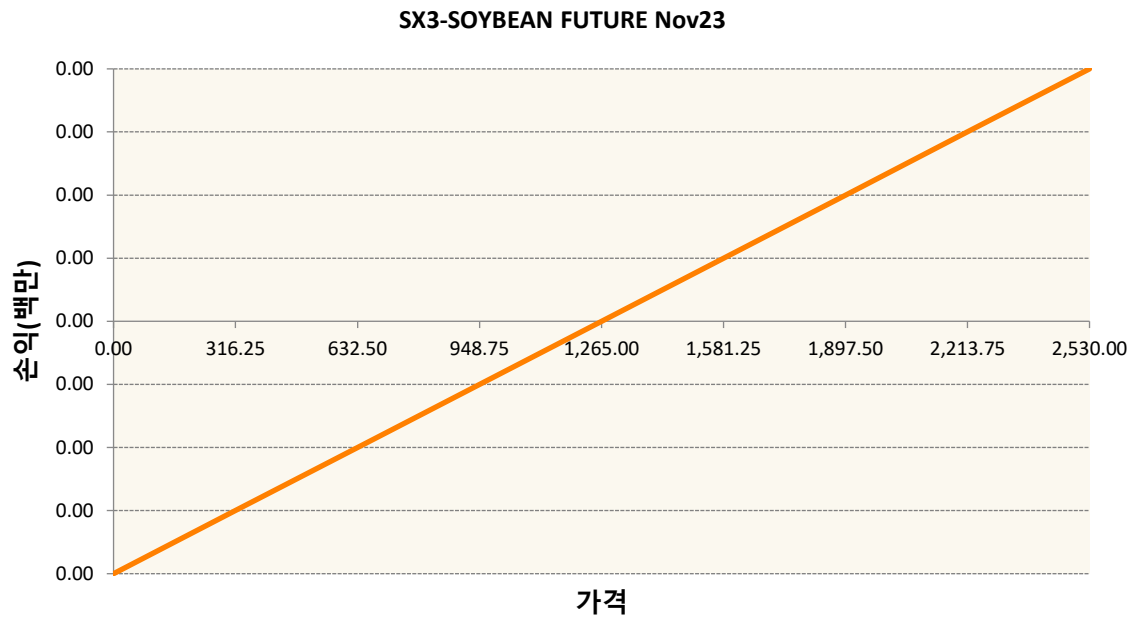


SBV3-Sugar #11 (WORLD) Oct23



SMZ3-SOYBEAN MEAL FUTR Dec23





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

공시일	2023-06-30
기준일	2023-06-29

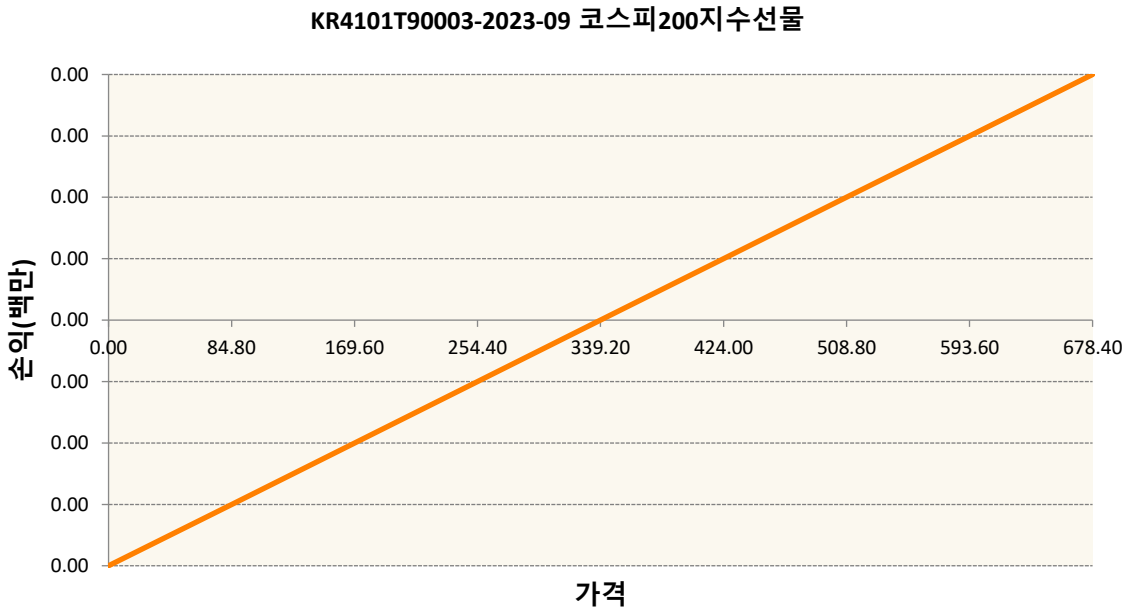
스마트인덱스모

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	424	0	424	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101T90003			2023-09 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%	-22	-22	-22	-22	-22	-22	-22
-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%	22	22	22	22	22	22	22
8.00%	34	34	34	34	34	34	34

공시일	2023-06-30
기준일	2023-06-29

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	4,215	0	4,215	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 신한CSI500미래230314

333

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

537

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2023-06-30
기준일	2023-06-29

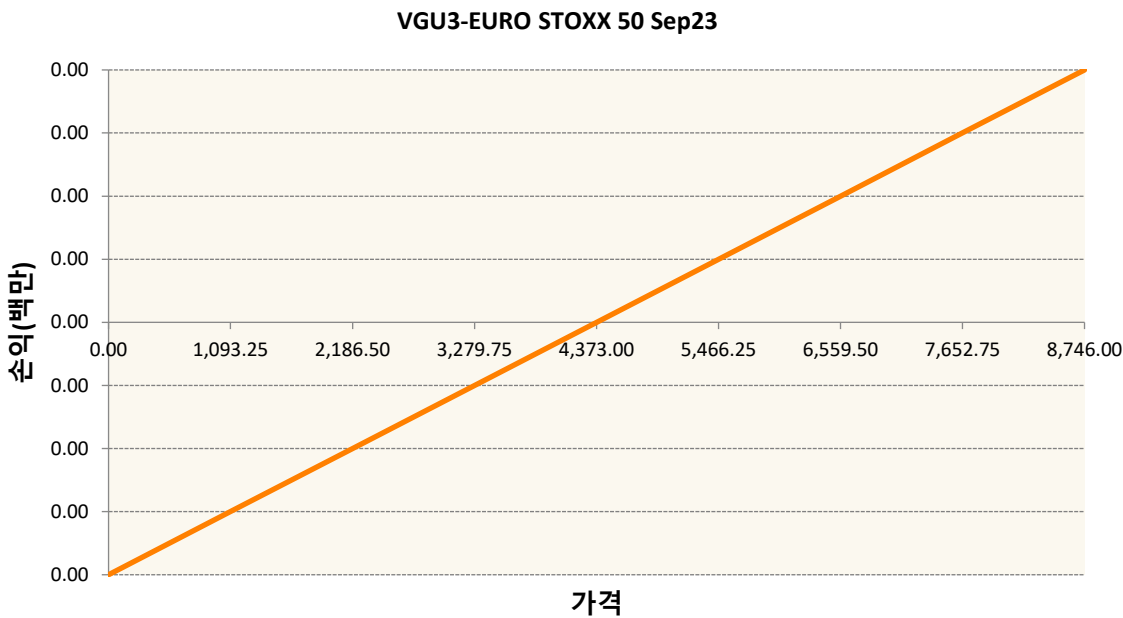
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	422	0	422	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGU3 EURO STOXX 50 Sep23

34

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

(단위:백만원)

54

공시일	2023-06-30
기준일	2023-06-29

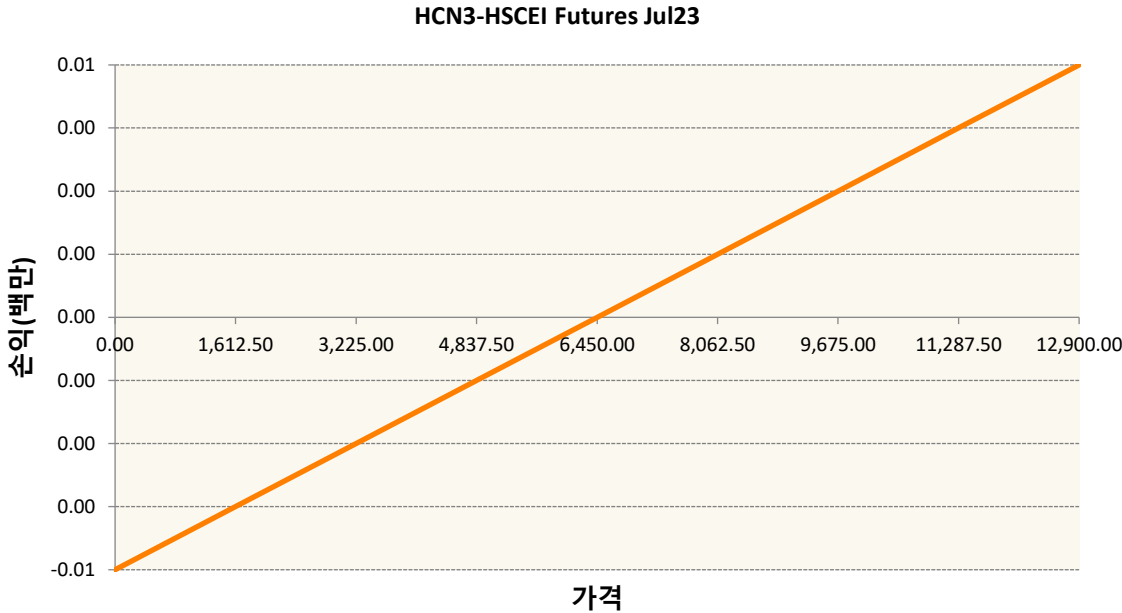
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,077	0	1,077	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCN3	HSCEI Futures Jul23	86
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

139

공시일	2023-06-30
기준일	2023-06-29

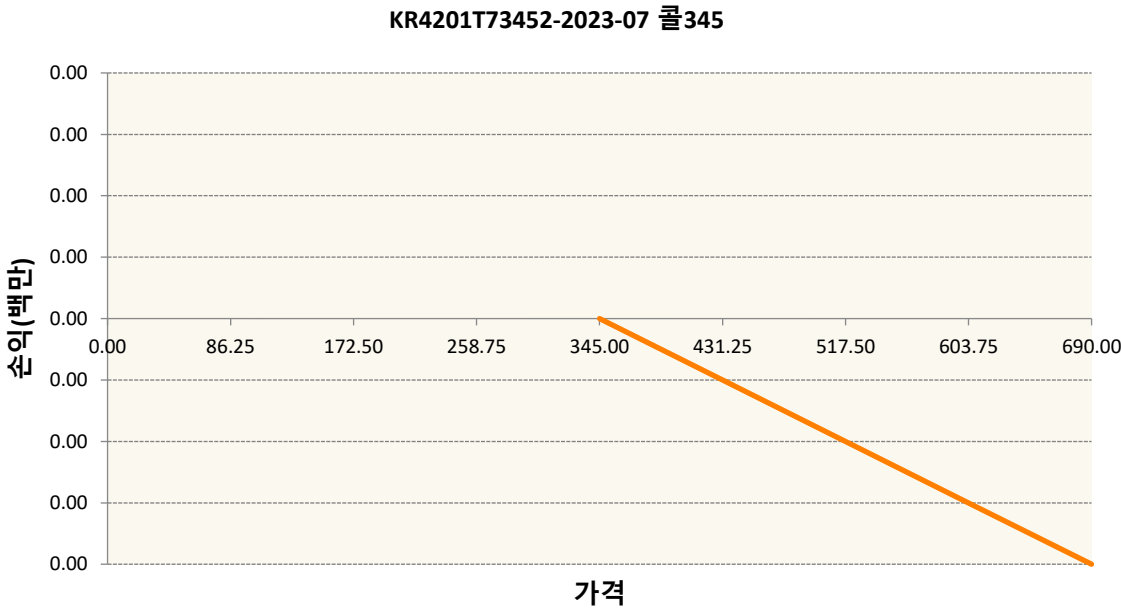
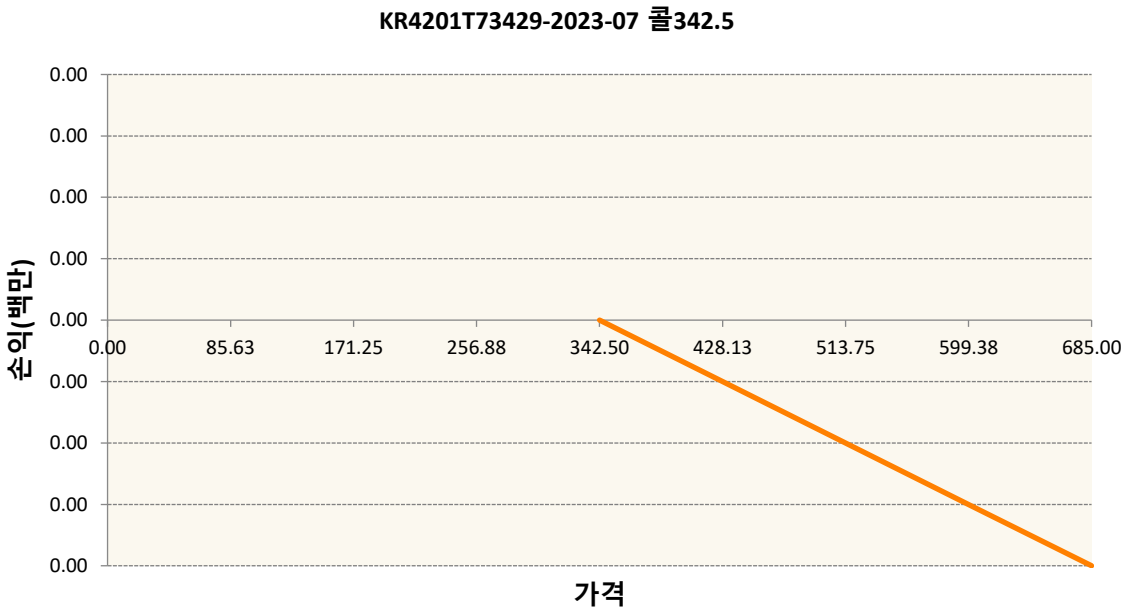
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

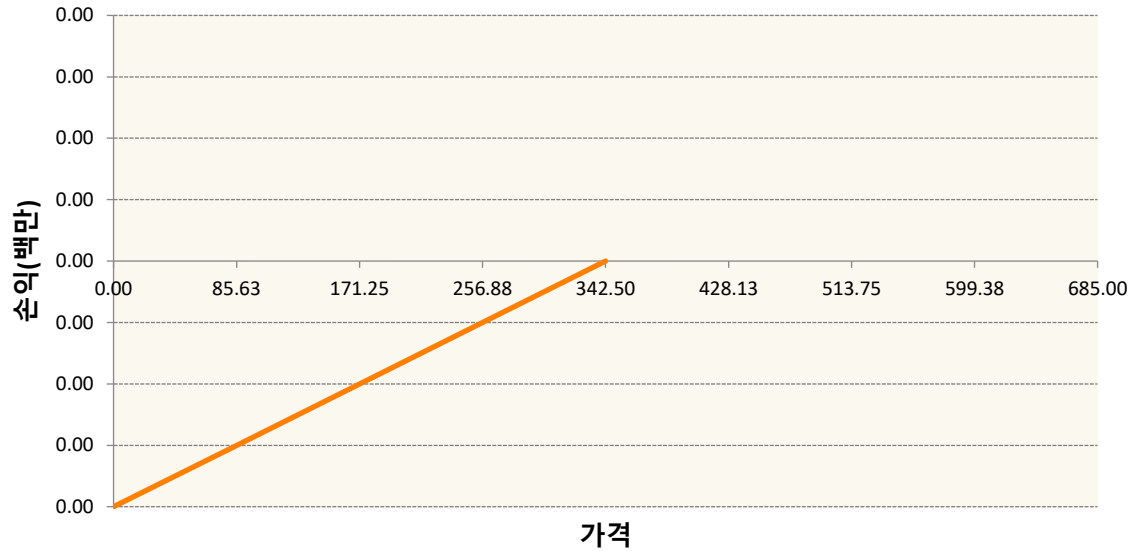
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	54,840	-54,840	장내

2. 만기시점의 손익구조



KR4301T73427-2023-07 풋342.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201T73429		2023-07 콜342.5						2,202
		기초자산의 변동성						
가격		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	402	401	399	396	391	384	375	
-5.33%	396	389	379	367	350	331	309	
-2.67%	349	324	295	262	227	189	149	
0%	156	105	53	0	-54	-108	-162	
2.67%	-321	-378	-435	-492	-549	-607	-664	
5.33%	-1,100	-1,136	-1,176	-1,218	-1,262	-1,309	-1,357	
8.00%	-2,062	-2,076	-2,094	-2,116	-2,141	-2,170	-2,202	
KR4201T73452		2023-07 콜345						281
		기초자산의 변동성						
가격		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	46	46	45	45	45	44	43	
-5.33%	45	45	43	42	40	38	35	
-2.67%	41	38	34	30	26	21	16	
0%	20	14	7	0	-7	-15	-22	
2.67%	-34	-42	-51	-59	-67	-76	-84	
5.33%	-130	-136	-143	-150	-157	-164	-172	
8.00%	-255	-258	-262	-266	-271	-276	-281	
KR4301T73427		2023-07 풋342.5						651
		기초자산의 변동성						
가격		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-645	-645	-645	-646	-647	-649	-651	
-5.33%	-400	-401	-403	-406	-410	-415	-420	
-2.67%	-164	-170	-177	-185	-193	-202	-211	
0%	37	25	12	0	-13	-25	-38	

2.67%	171	157	144	130	117	103	90
5.33%	233	225	215	206	195	184	173
8.00%	253	250	245	240	234	227	220

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

(단위:백만원)

3,141

공시일	2023-06-30
기준일	2023-06-29

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	6,558	0	6,558	

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	2023-06-30
기준일	2023-06-29

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	4,878	0	4,878	

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	2023-06-30
기준일	2023-06-29

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	19,002	0	19,002	
누계	통화	선도	264	18,809	-18,545	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213D4S(KRW/USD 31-07-23E	262
FXW213D5S(KRW/USD 31-08-23E	689
FXW213D6S(KRW/USD 27-09-23E	553
FXW213D6V(USD/KRW 31-07-23E	21
IE00BD8RGM75	

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

3,322

공시일	2023-06-30
기준일	2023-06-29

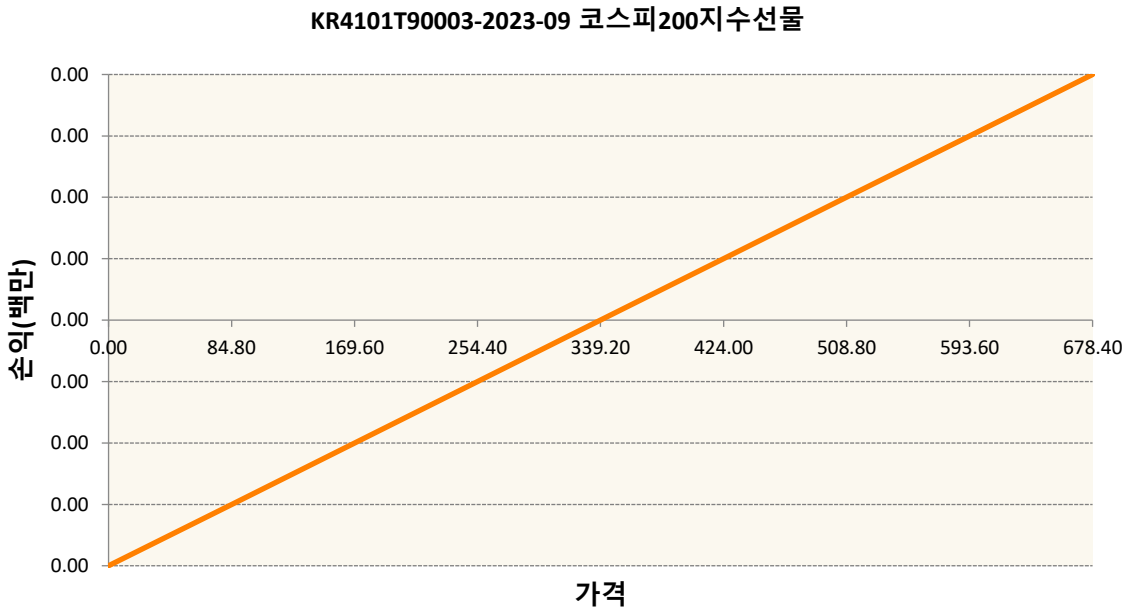
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

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	594	0	594	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101T90003			2023-09 코스피200지수선물				47
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-47	-47	-47	-47	-47	-47	-47
-5.33%	-31	-31	-31	-31	-31	-31	-31
-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%	31	31	31	31	31	31	31
8.00%	47	47	47	47	47	47	47

공시일	2023-06-30
기준일	2023-06-29

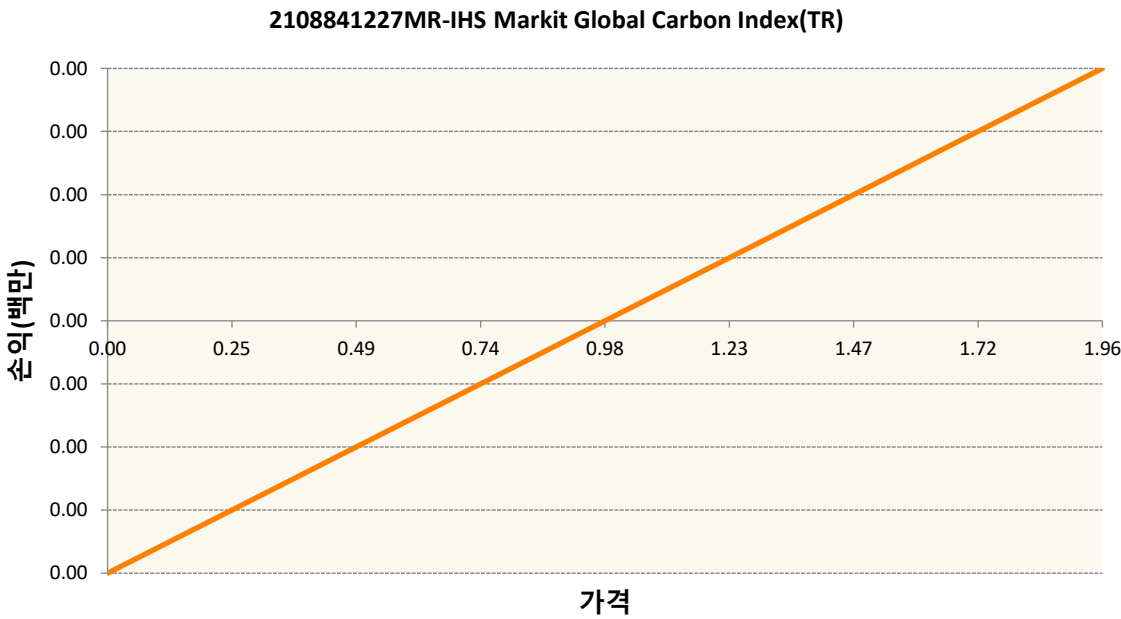
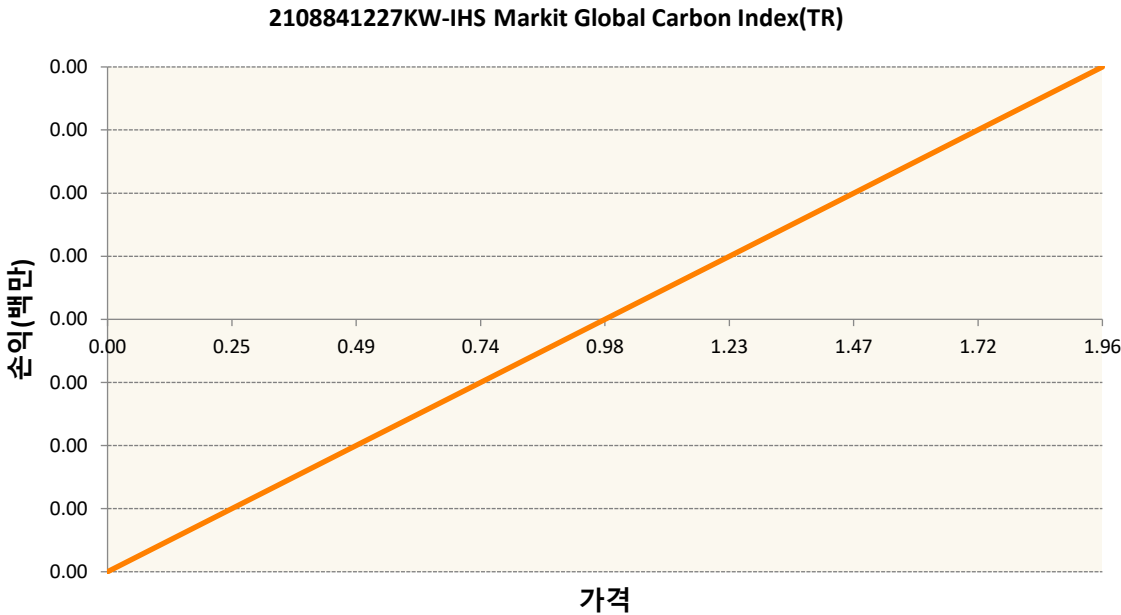
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

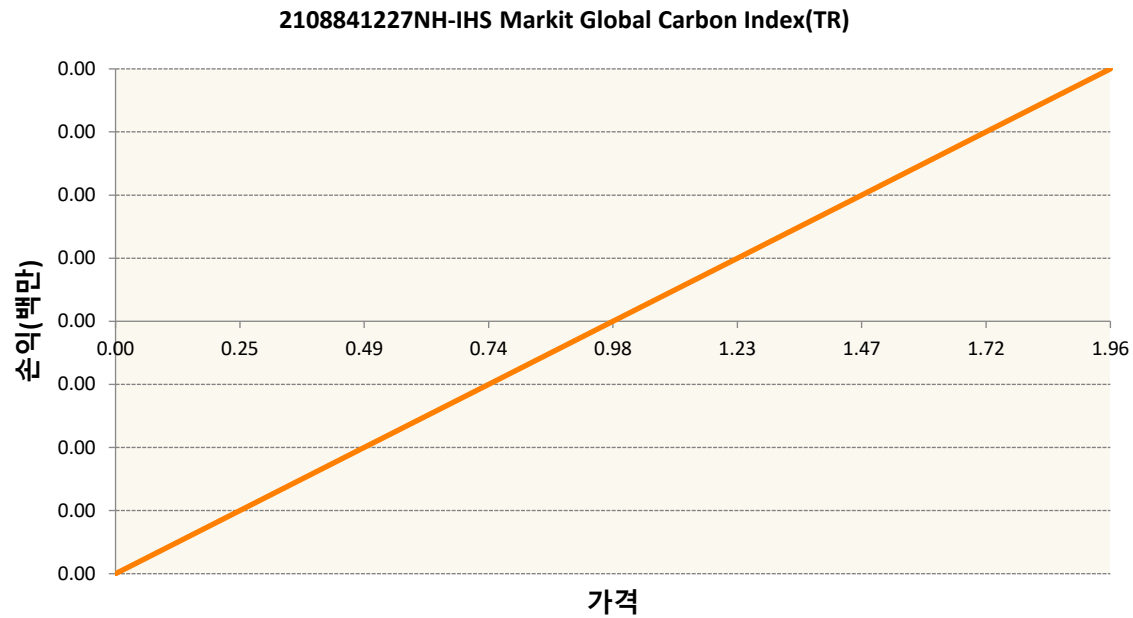
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	25,747	0	25,747	

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108841227IHS Markit Global Carbon Index(TR)		1,759
2108841227IHS Markit Global Carbon Index(TR)		207
2108841227IHS Markit Global Carbon Index(TR)		103

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)		(단위:백만원)
		3,337

공시일	2023-06-30
기준일	2023-06-29

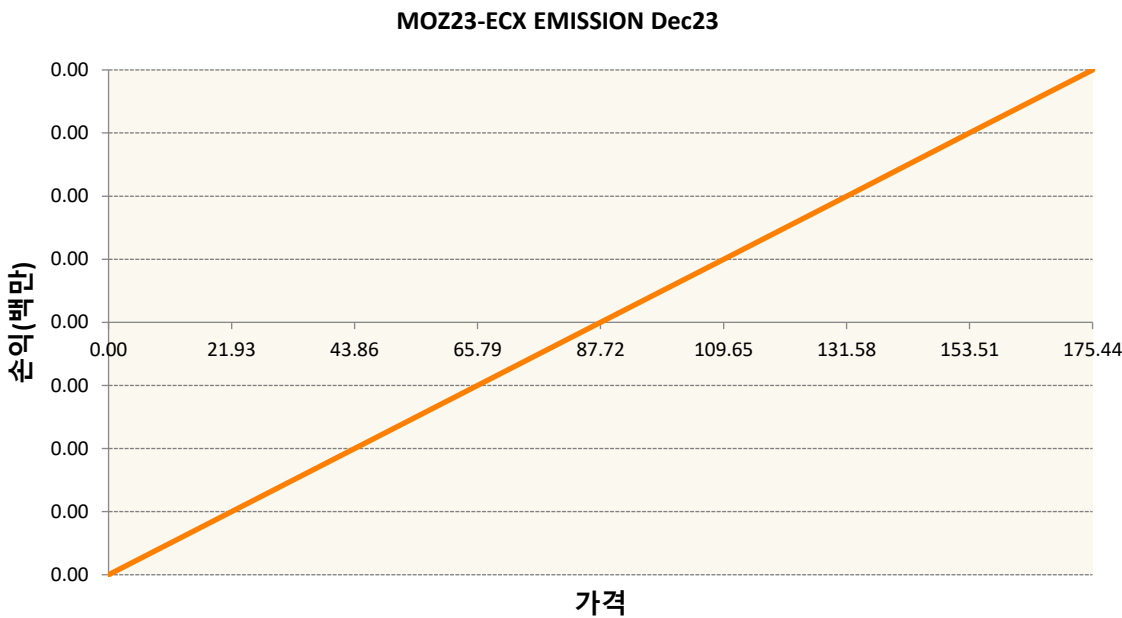
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	8,880	0	8,880	
누계	통화	선도	574	5,349	-4,775	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213D5S(KRW/EUR 30-06-23E	40
FXW213D5S(KRW/EUR 30-06-23E	46
FXW213D5S(KRW/EUR 30-06-23E	69
FXW213D6D KRW/EUR 30-06-23E	42
FXW213D6F(KRW/EUR 30-06-23E	47
FXW213D6S(EUR/KRW 30-06-23E	46
FXW213D6V(KRW/EUR 31-07-23E	23
FXW213D6V(KRW/EUR 31-07-23E	34
FXW213D6V(KRW/EUR 31-07-23E	57
FXW213D6V(KRW/EUR 31-07-23E	69
MOZ23 ECX EMISSION Dec23	710

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

(단위:백만원)

1,522

공시일	2023-06-30
기준일	2023-06-29

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	7,901	0	7,901	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI00000 신한CSI Index 230622 (NH)	4
SWCSI00000 신한CSI Index 230622 (키움)	4
SWCSI00000 신한CSI Index 230622 (미래)	4
SWCSI00000 신한CSI Index 230622 (메리츠)	4

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

(단위:백만원)

26

공시일	2023-06-30
기준일	2023-06-29

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	7,540	0	7,540	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 230116(NH)	2
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 230116(메리츠)	2
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 230116(미래)	2
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 230427(키움)	0.49

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

(단위:백만원)

10

공시일	2023-06-30
기준일	2023-06-29

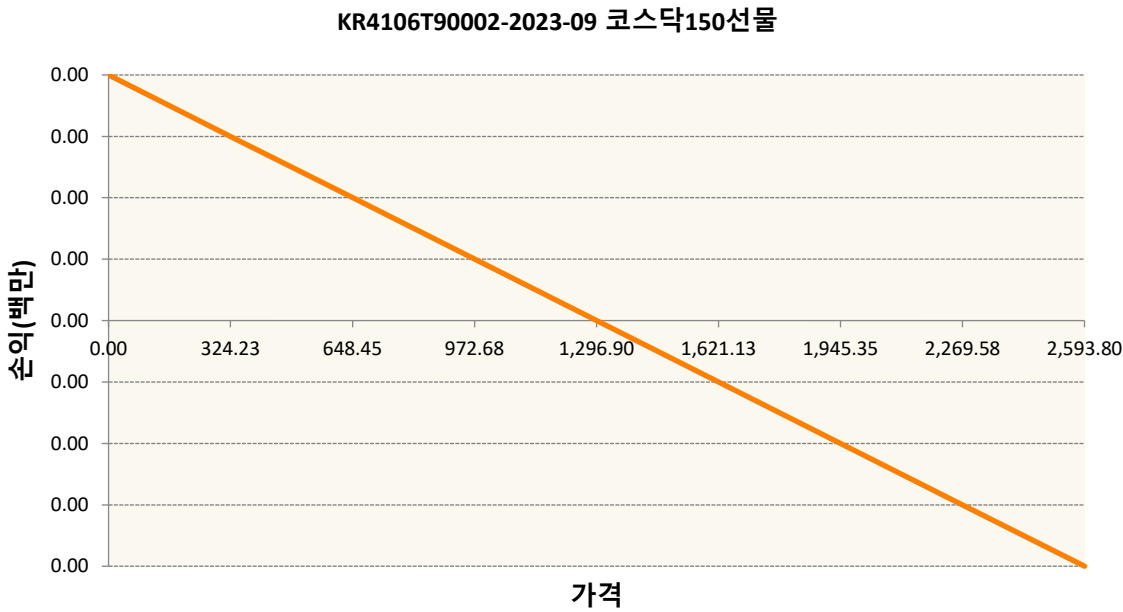
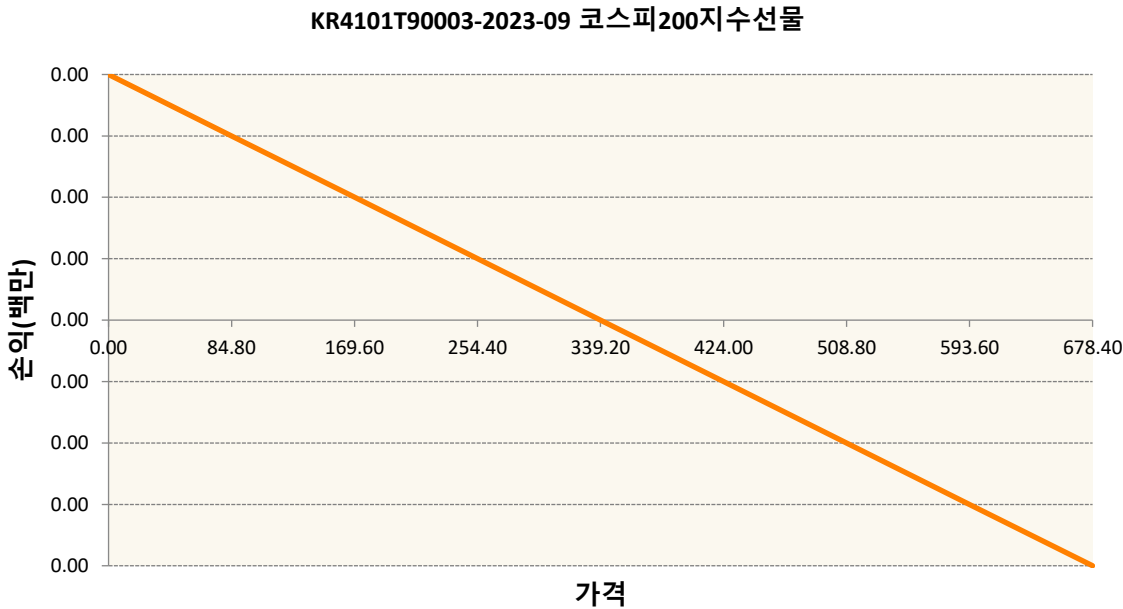
에쿼티알파일반사모혼합자산

1. 계약금액

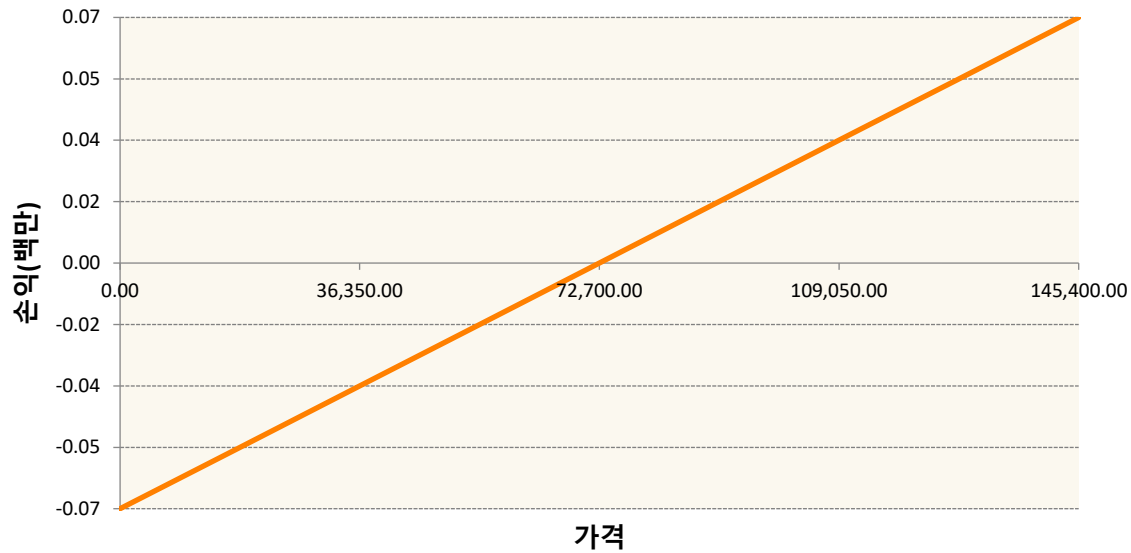
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	391	3,128	-2,737	장내
누계	유가증권	스왑	0	0	0	장외

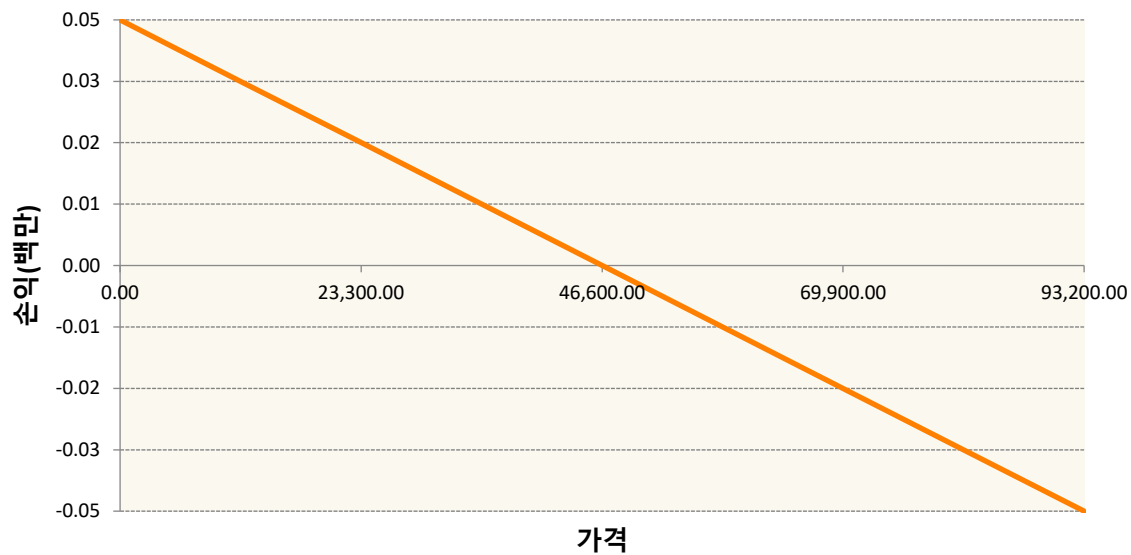
2. 만기시점의 손익구조



KR4111T70004-2023-07 삼성전자개별선물



KR41F7T70006-2023-07 카카오페이개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101T900 2023-09 코스피200지수선물	136
KR4106T900 2023-09 코스닥150선물	109
KR4111T700 2023-07 삼성전자개별선물	31
KR41F7T700 2023-07 카카오페이개별선물	6
KRS0004099 SWAP_MICRON TECH_0308	0.15
KRS0004212 SWAP_SPDR S&P BIOTECH_0413	1
KRS0004404 SWAP_PRSH ST FTRS ETF_0629	0.2

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

(단위:백만원)

456

공시일	2023-06-30
기준일	2023-06-29

코리아인덱스(주식-파생형)(종)

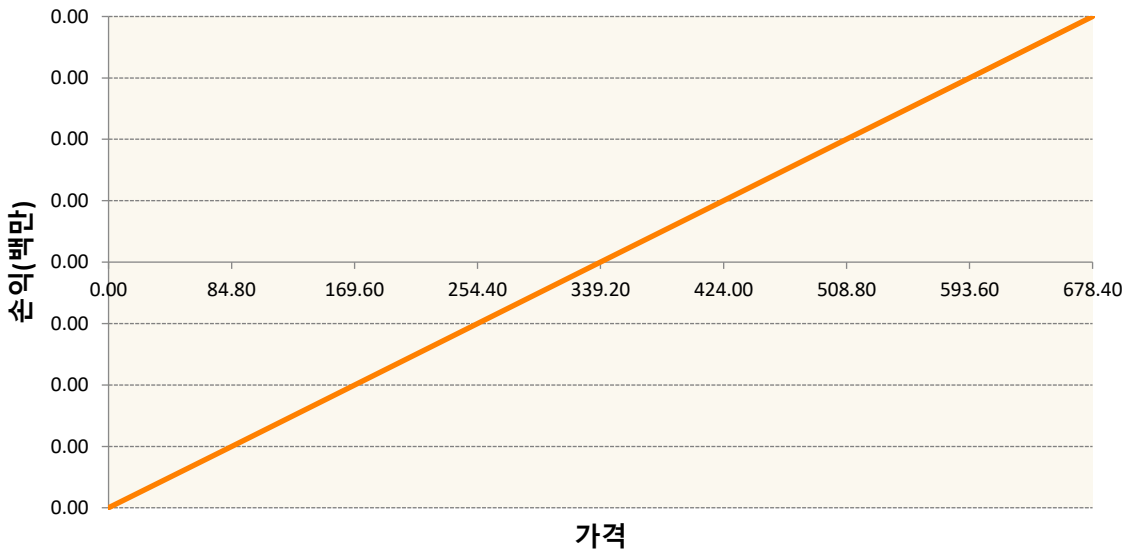
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	254	0	254	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101T90003-2023-09 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101T90003			2023-09 코스피200지수선물				20
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-20	-20	-20	-20	-20	-20	-20
-5.33%	-13	-13	-13	-13	-13	-13	-13
-2.67%	-7	-7	-7	-7	-7	-7	-7
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	7	7	7	7	7	7	7
5.33%	13	13	13	13	13	13	13
8.00%	20	20	20	20	20	20	20

공시일	2023-06-30
기준일	2023-06-29

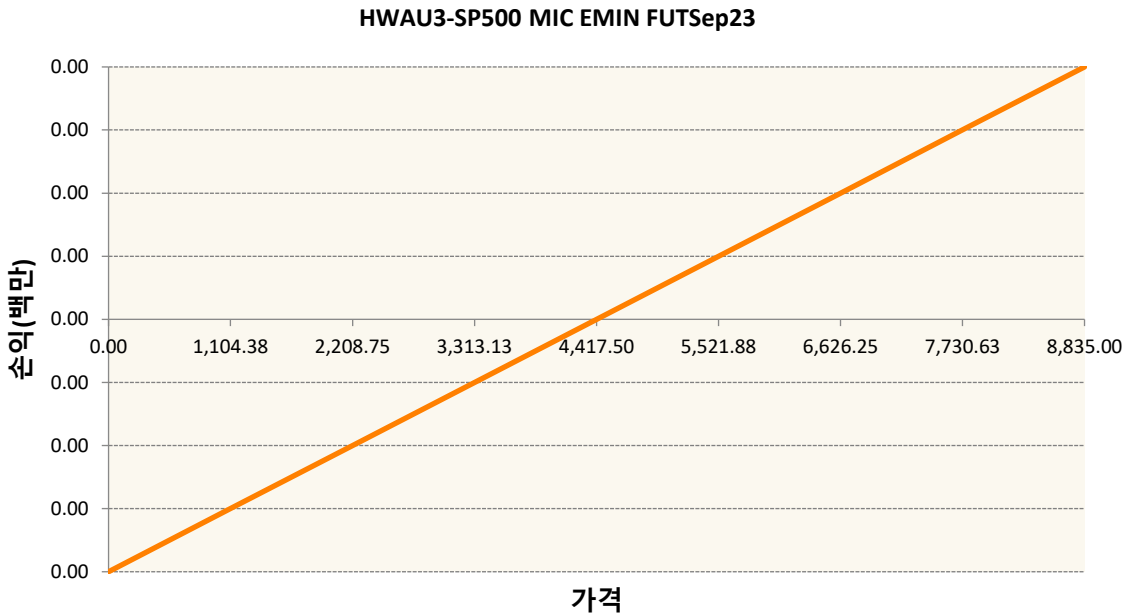
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	848	0	848	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HWAU3	SP500 MIC EMIN FUTSep23	68
-------	-------------------------	----

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

(단위:백만원)

109

공시일	2023-06-30
기준일	2023-06-29

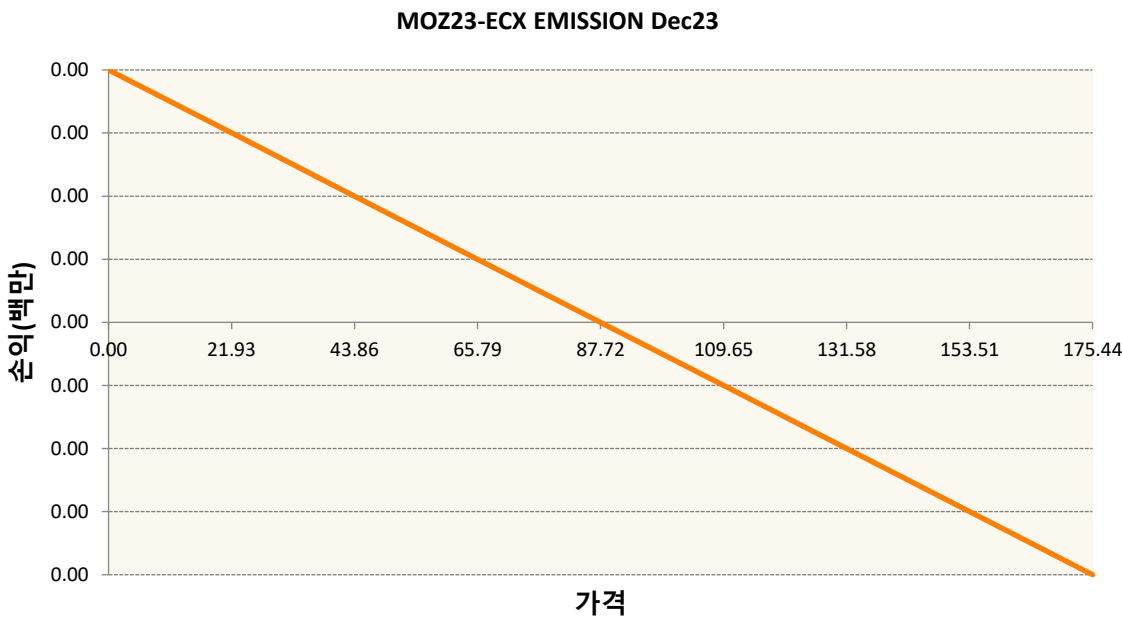
SOL유럽탄소배출권선물인버스ICE특별자산상

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	0	8,677	-8,677	
누계	통화	선도	0	4,434	-4,434	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213D6E(KRW/EUR 30-06-23E	184
FXW213D6V KRW/EUR 31-07-23E	45
FXW213D6V KRW/EUR 31-07-23E	126
MOZ23 ECX EMISSION Dec23	694

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

(단위:백만원)

1,401

공시일	2023-06-30
기준일	2023-06-29

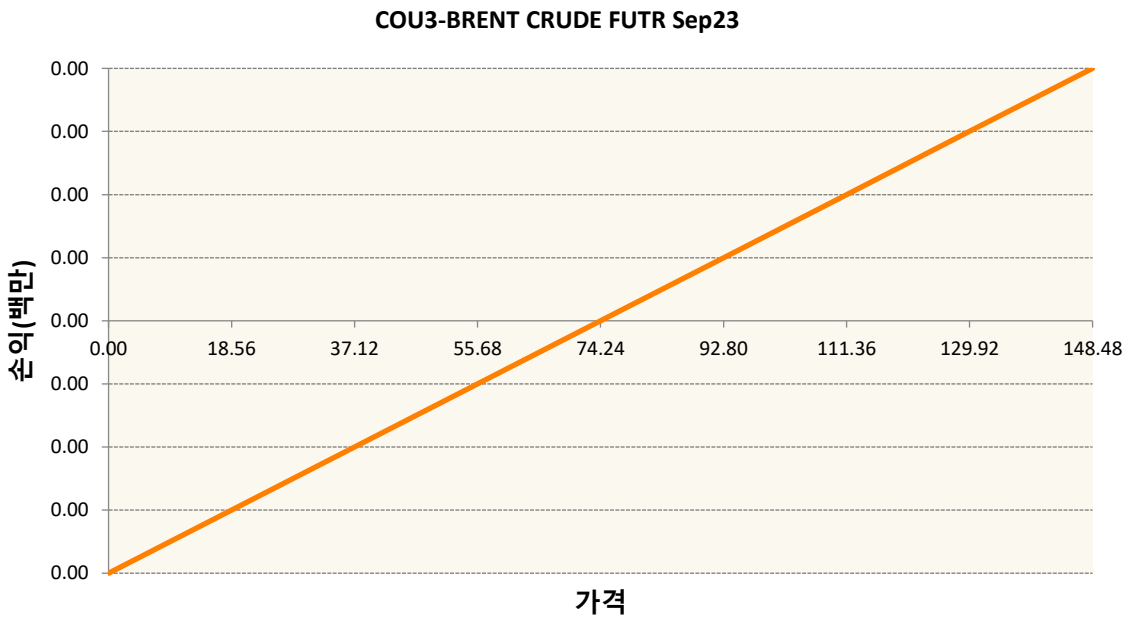
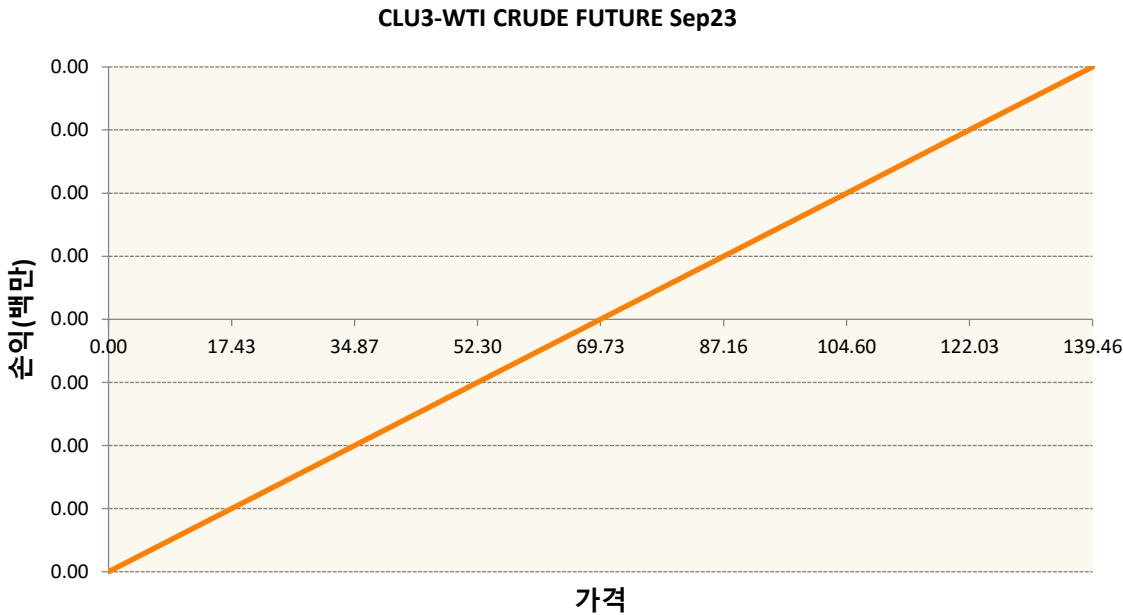
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

1. 계약금액

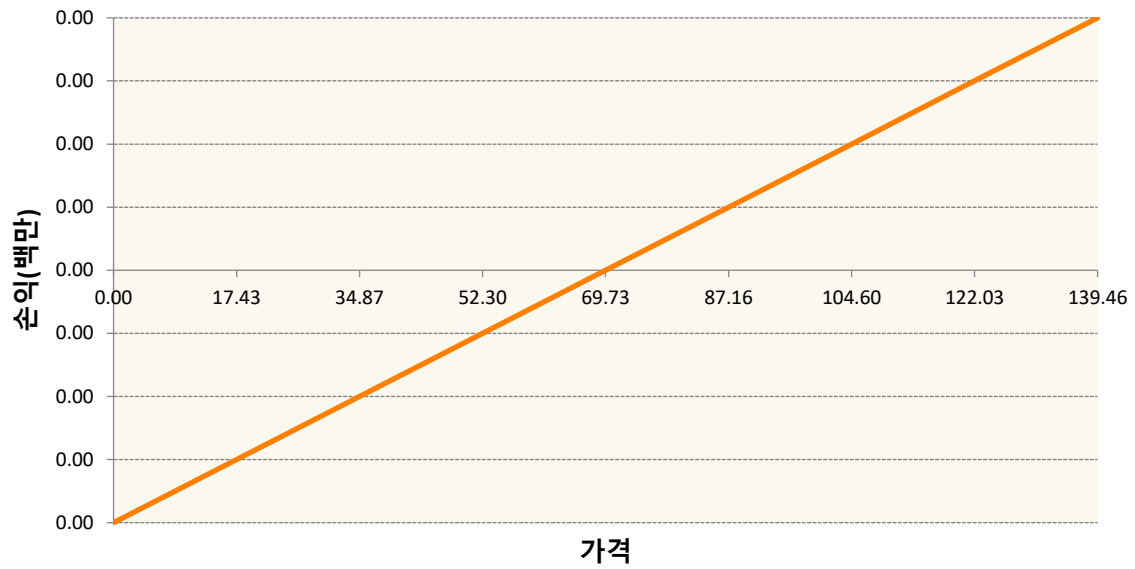
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,266	197	1,069	

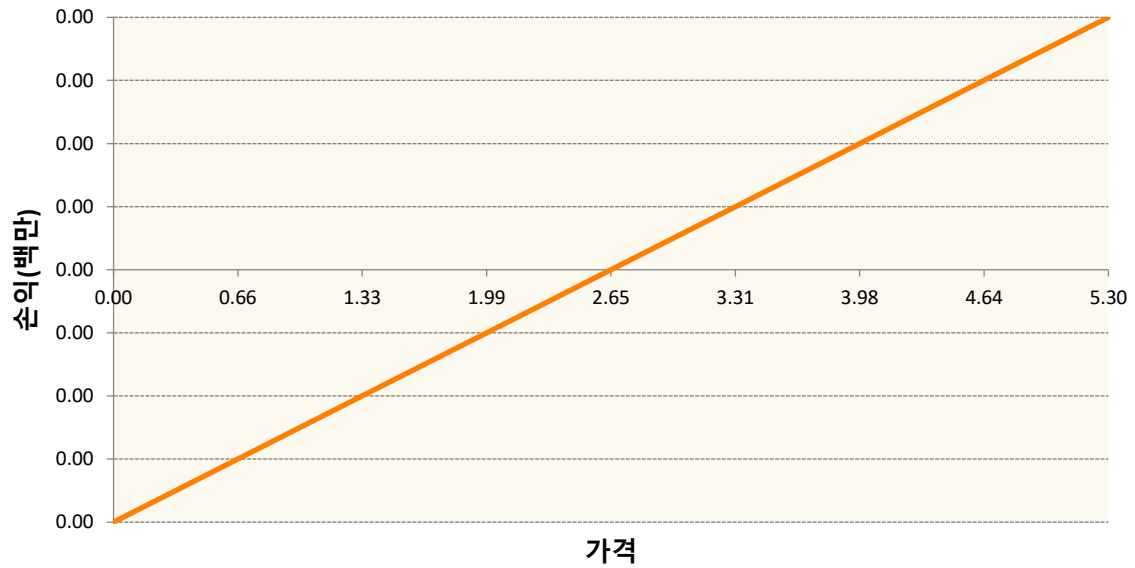
2. 만기시점의 손익구조



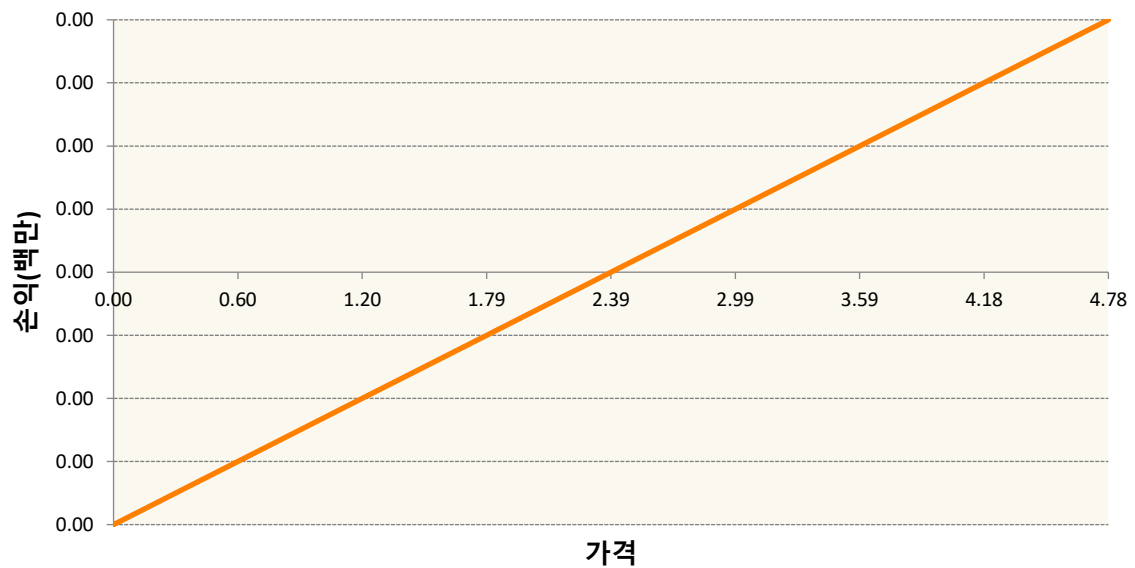
ECU3-E-mini Crude Oil Sep23



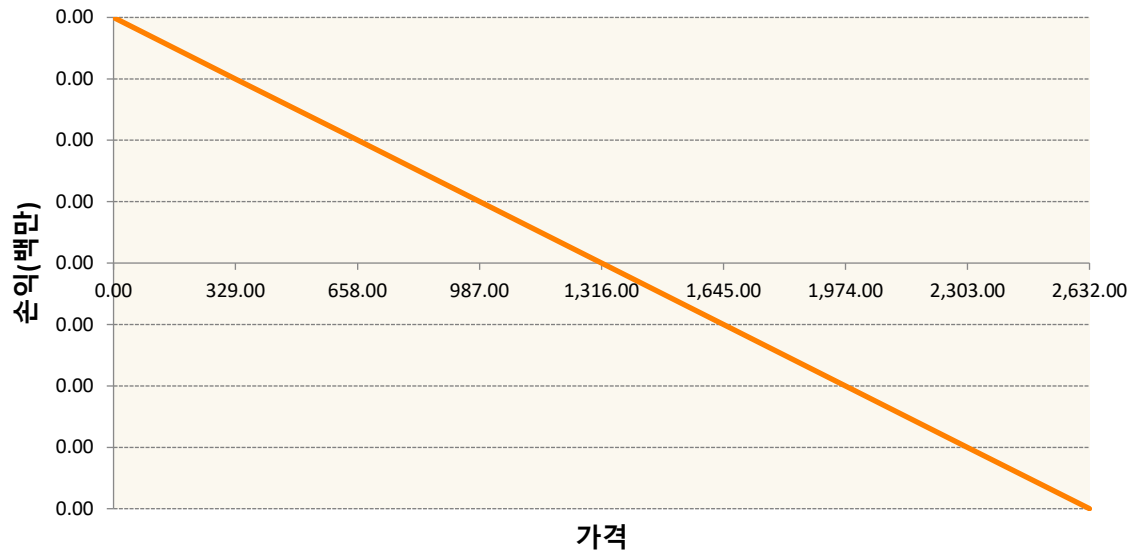
EOU3-E-MINI NATURAL GAS Sep23



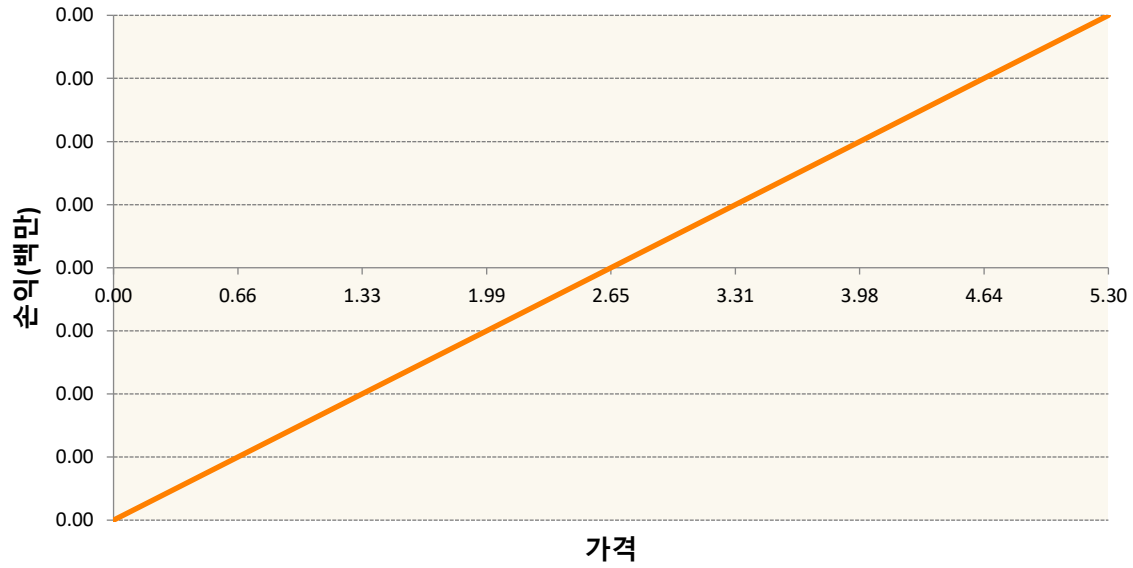
HOU3-NY Harb ULSD Fut Sep23



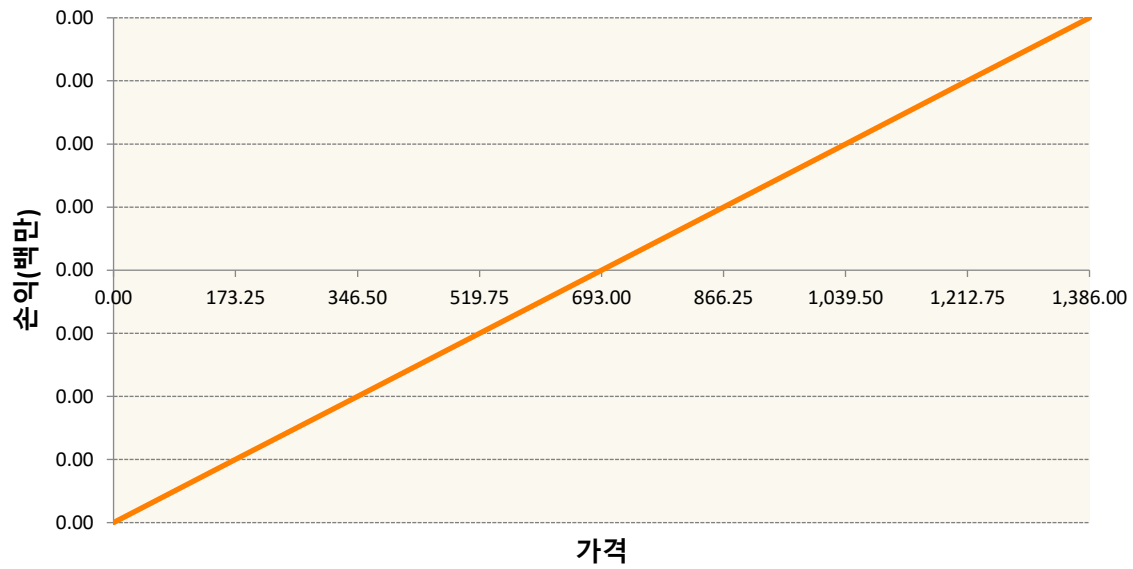
KR4175T70009-2023-07 달러선물

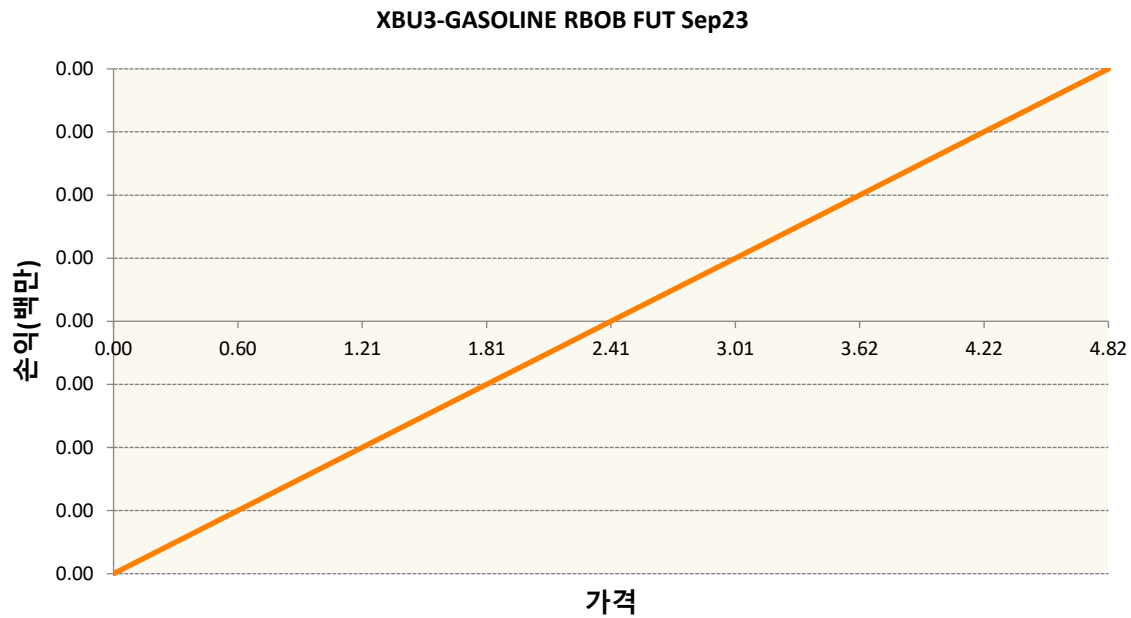


NGU23-NATURAL GAS FUTR Sep23



QSU3-Low Su Gasoil G Sep23





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
CLU3	WTI CRUDE FUTURE Sep23	22
COU3	BRENT CRUDE FUTR Sep23	24
ECU3	E-mini Crude Oil Sep23	4
EOU3	E-MINI NATURAL GAS Sep23	3
HOU3	NY Harb ULSD Fut Sep23	10
KR4175T700 2023-07 달러선물		16
NGU23	NATURAL GAS FUTR Sep23	22
QSU3	Low Su Gasoil G Sep23	7
XBU3	GASOLINE RBOB FUT Sep23	10

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	189