

공시일	2023-07-05
기준일	2023-07-04

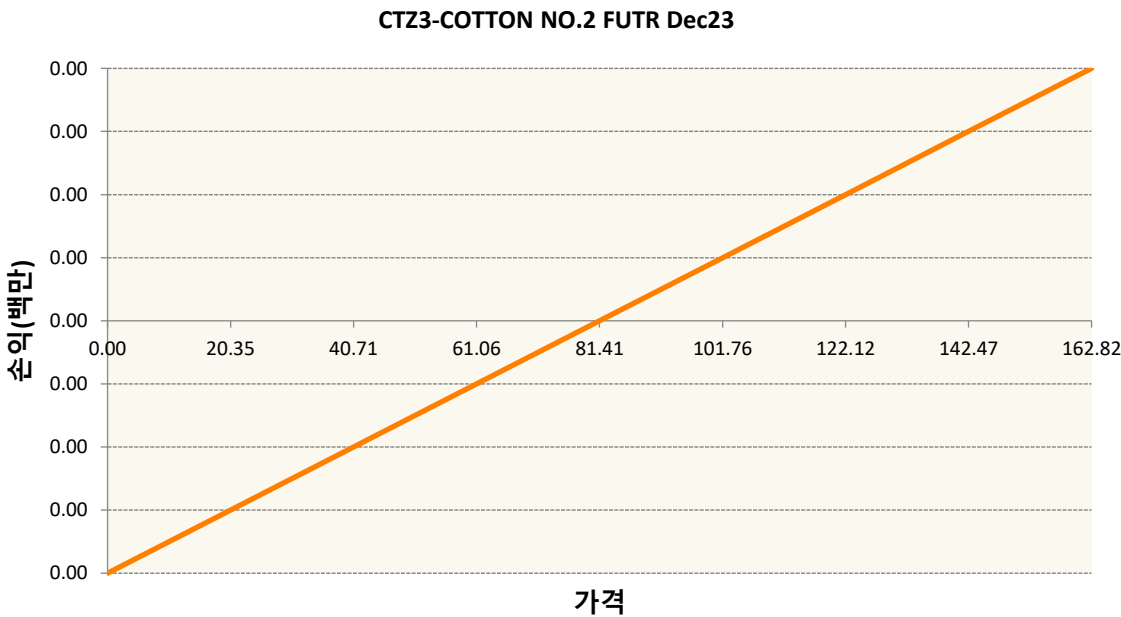
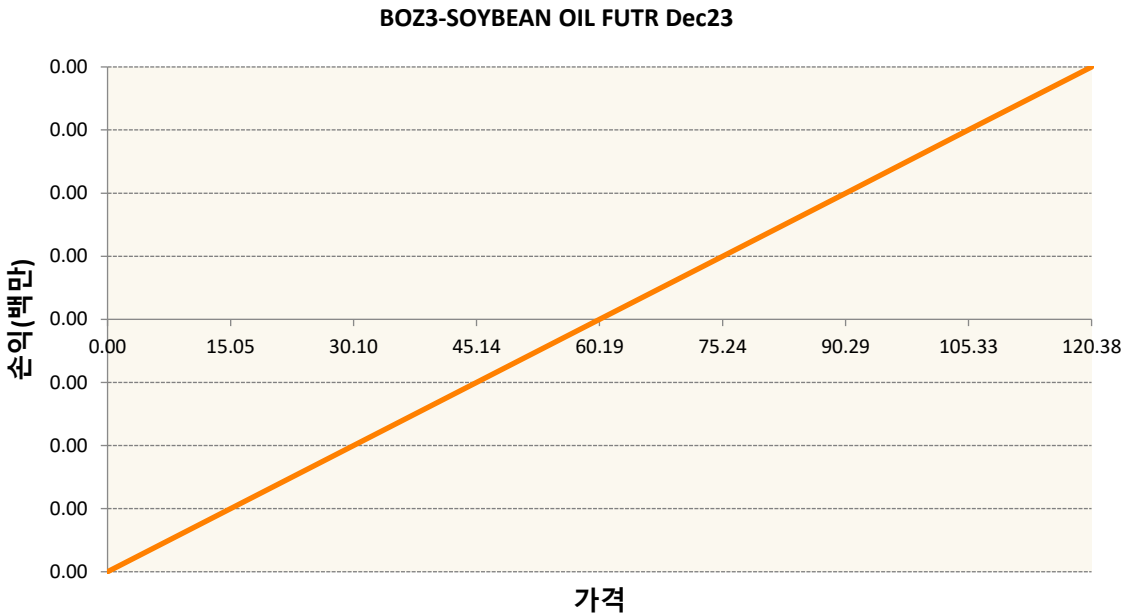
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

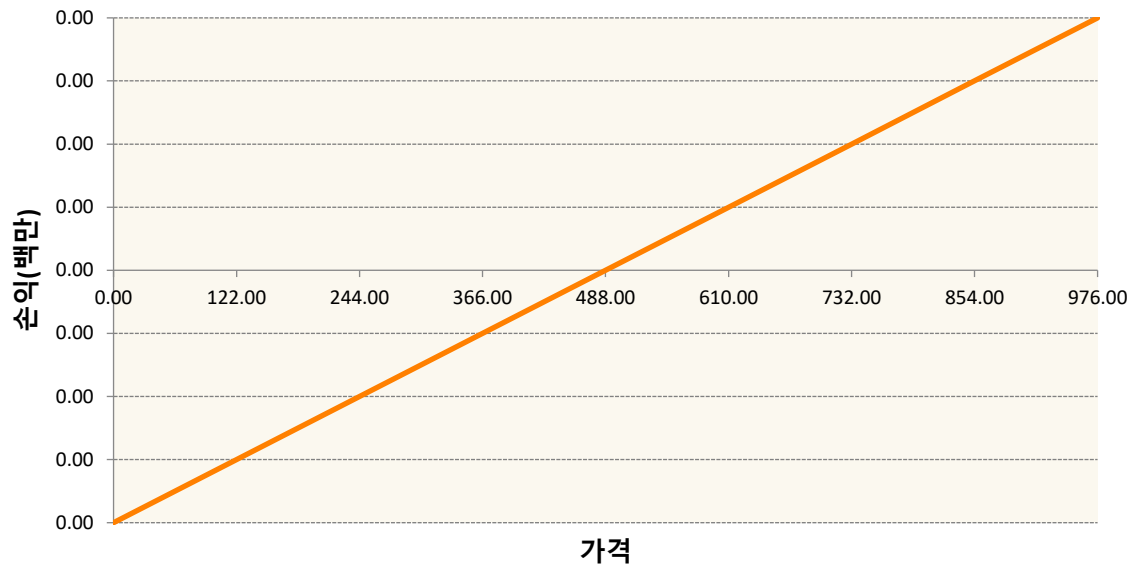
(단위:USD 백만)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,182	455	4,727	

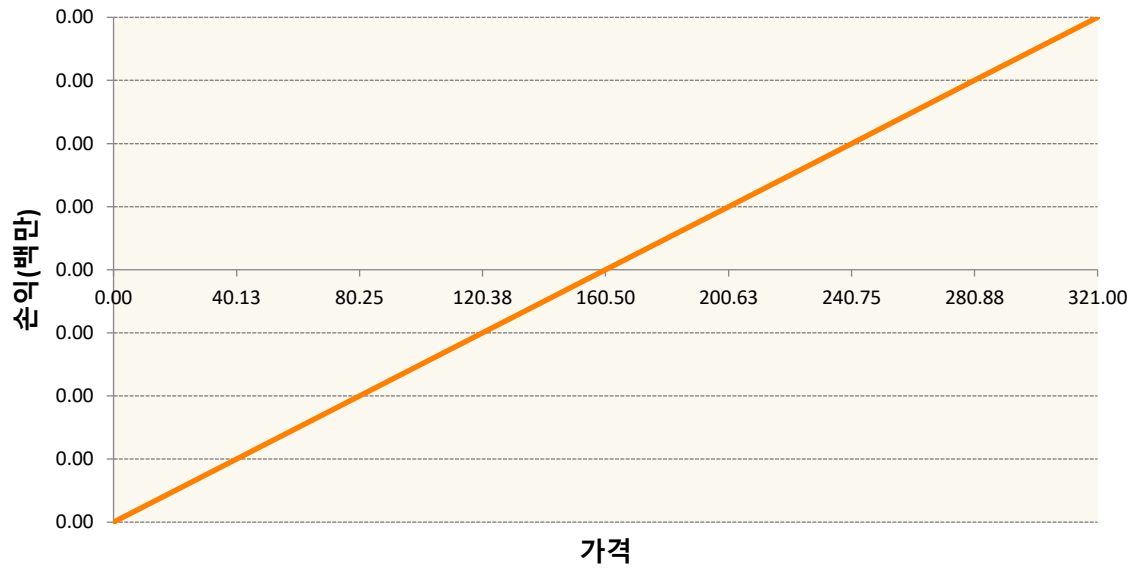
2. 만기시점의 손익구조



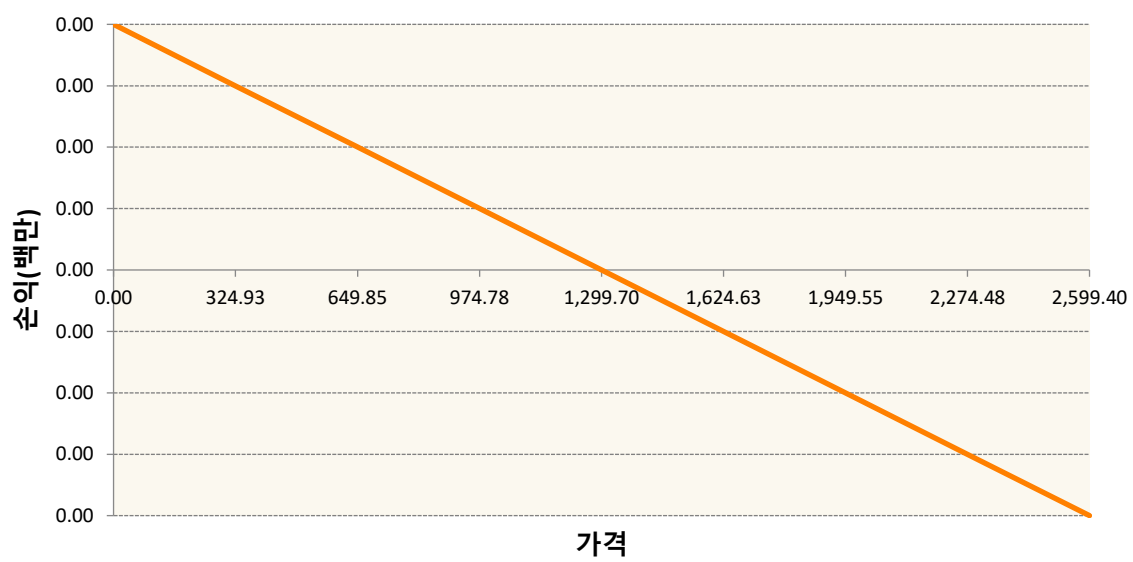
CU3-CORN FUTURE Sep23



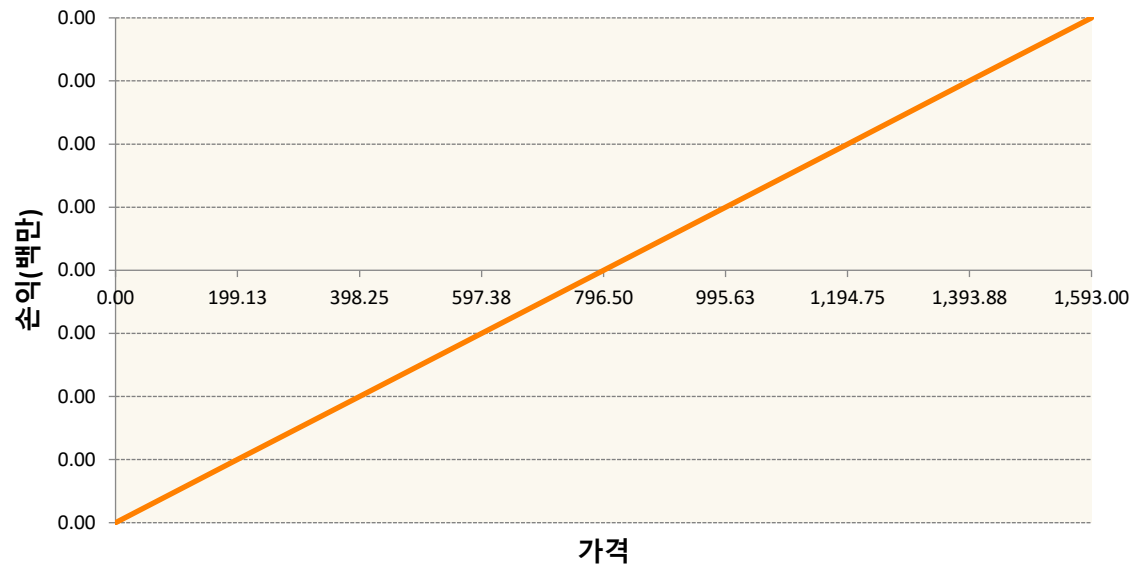
KCU3-COFFEE 'C' FUTURE Sep23



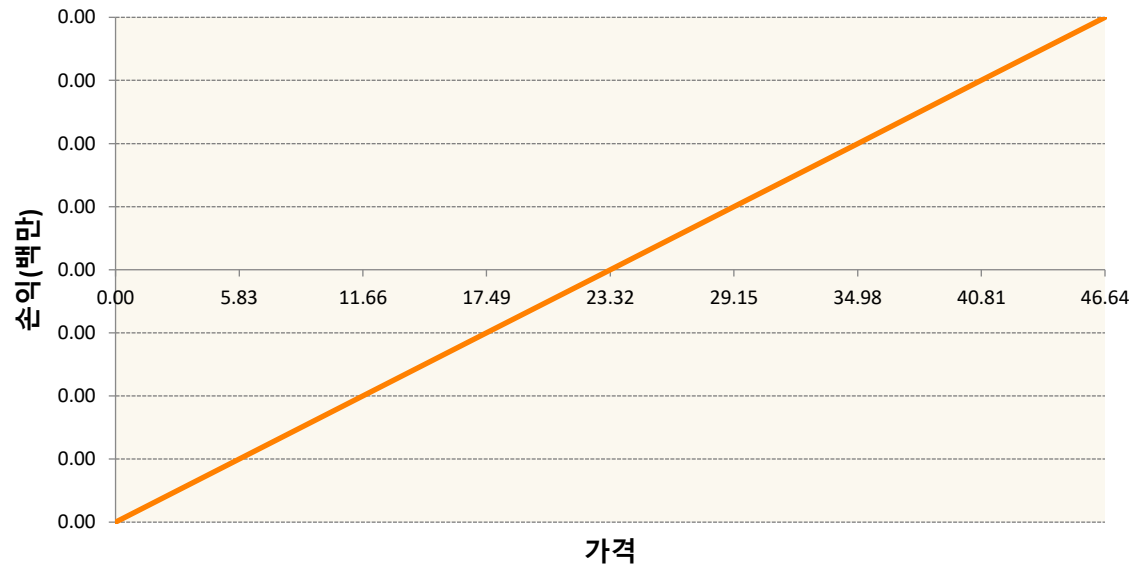
KR4175T70009-2023-07 달러선물



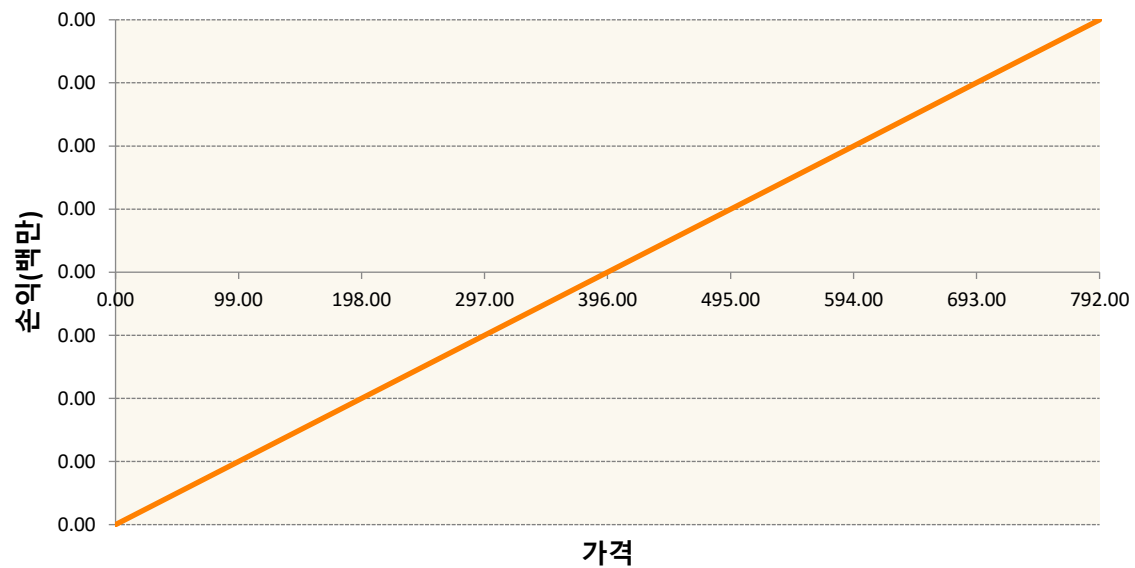
KWU3-KC HRW WHEAT FUT Sep23

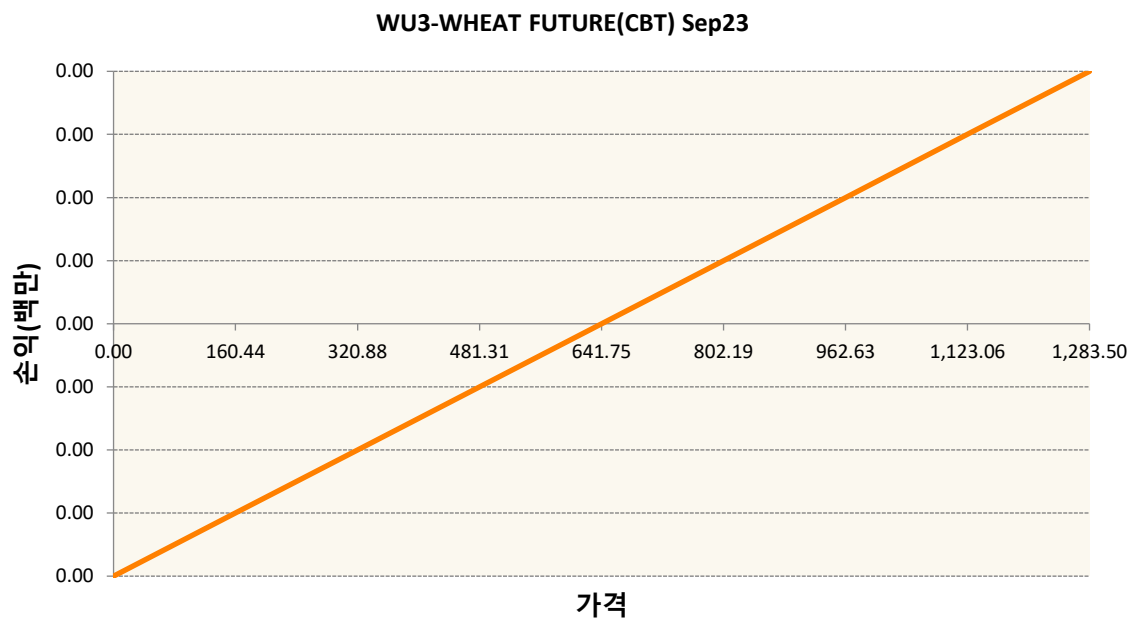
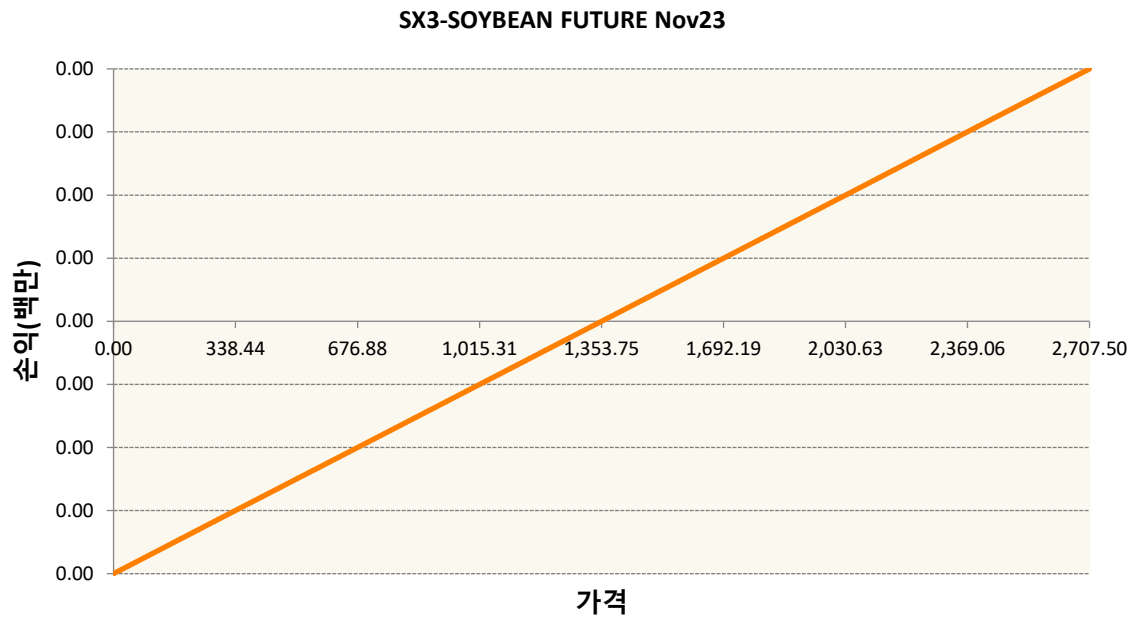


SBV3-Sugar #11 (WORLD) Oct23



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	2023-07-05
기준일	2023-07-04

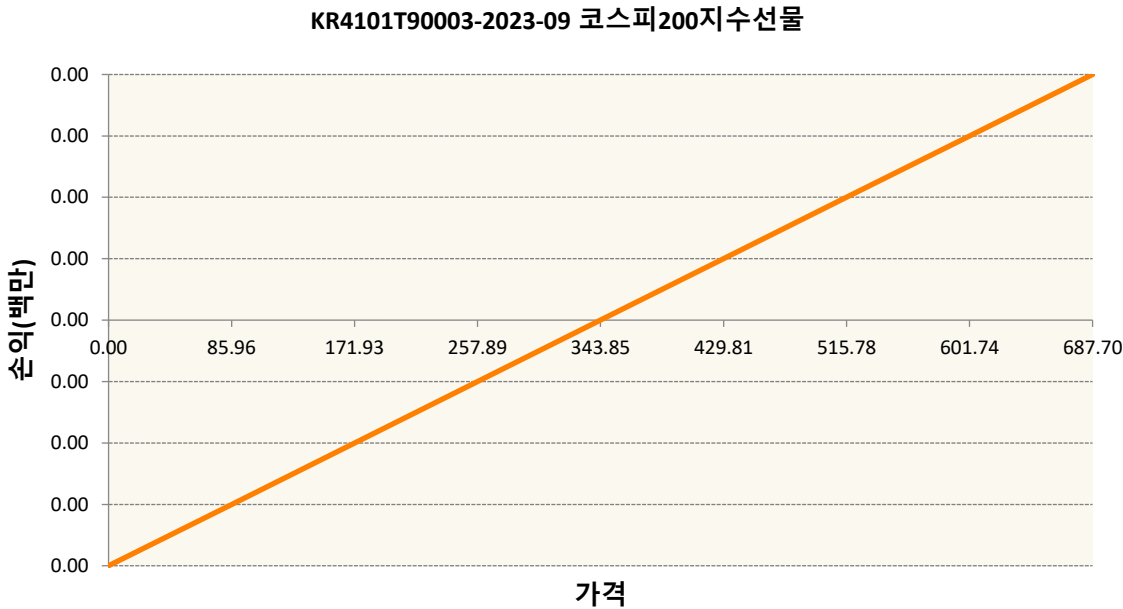
스마트인덱스모

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	430	0	430	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%	-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	2023-07-05
기준일	2023-07-04

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	338
-----------------------------	-----

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

545

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2023-07-05
기준일	2023-07-04

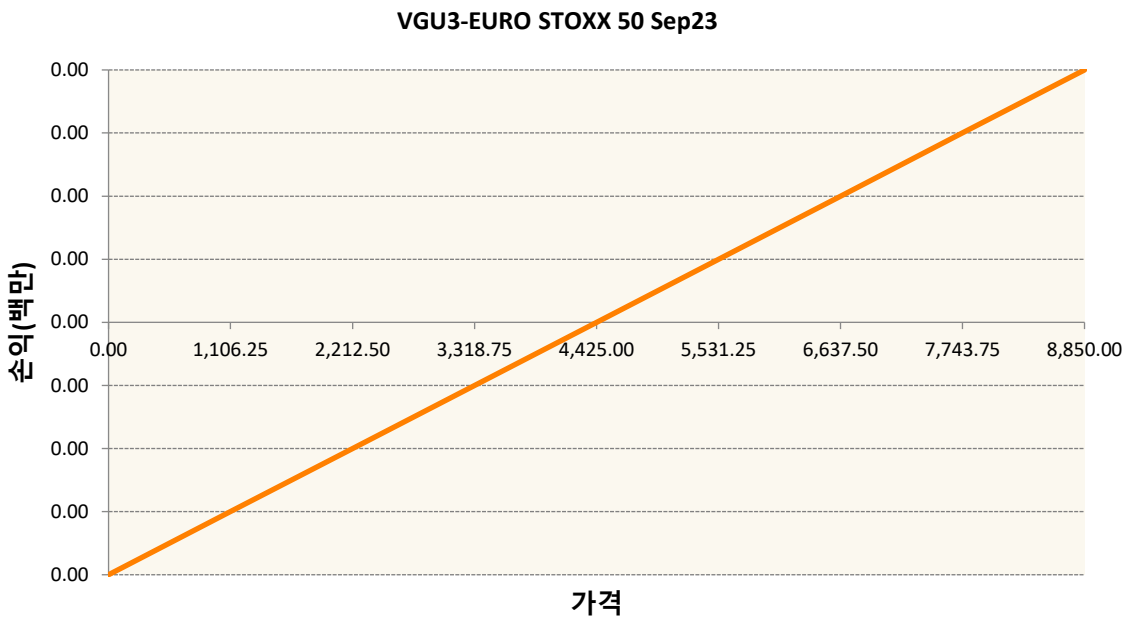
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	427	0	427	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGU3	EURO STOXX 50 Sep23	34
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

55

공시일	2023-07-05
기준일	2023-07-04

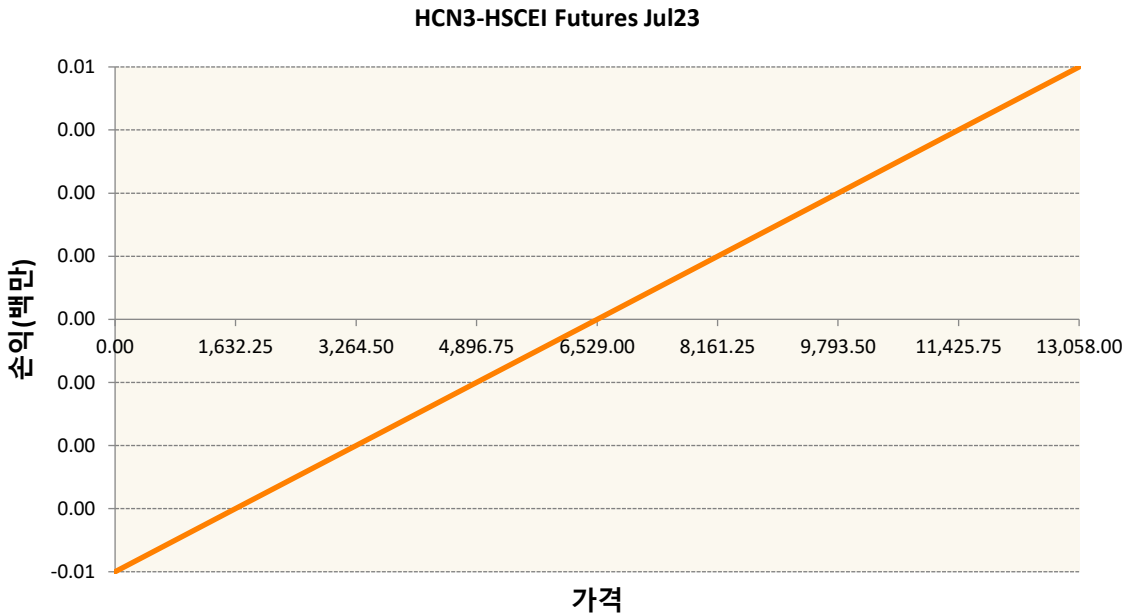
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,090	0	1,090	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCN3	HSCEI Futures Jul23	87
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

140

공시일	2023-07-05
기준일	2023-07-04

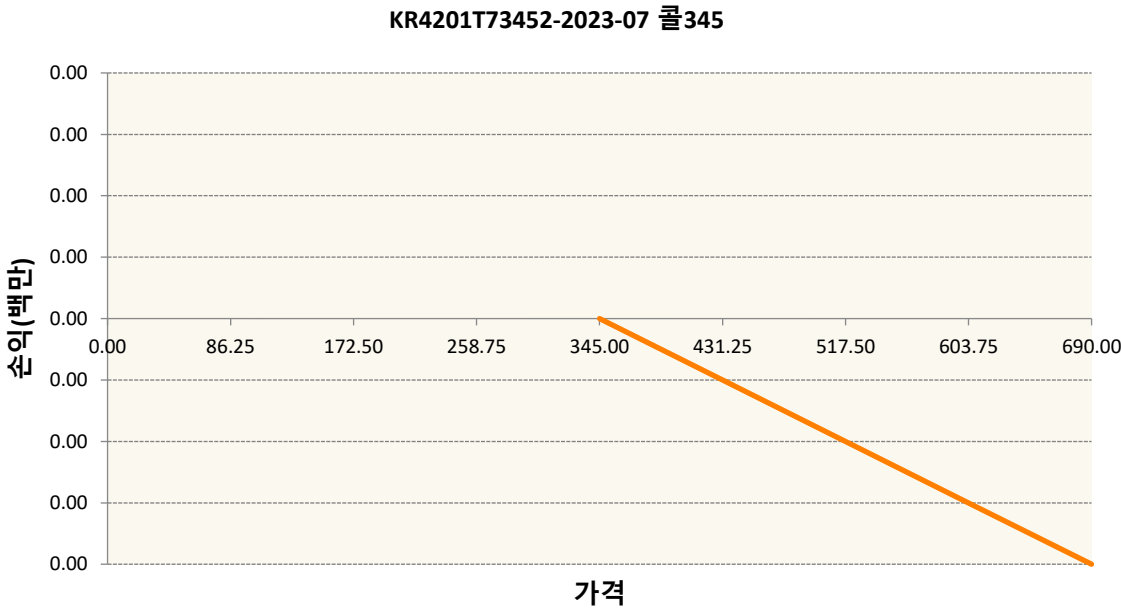
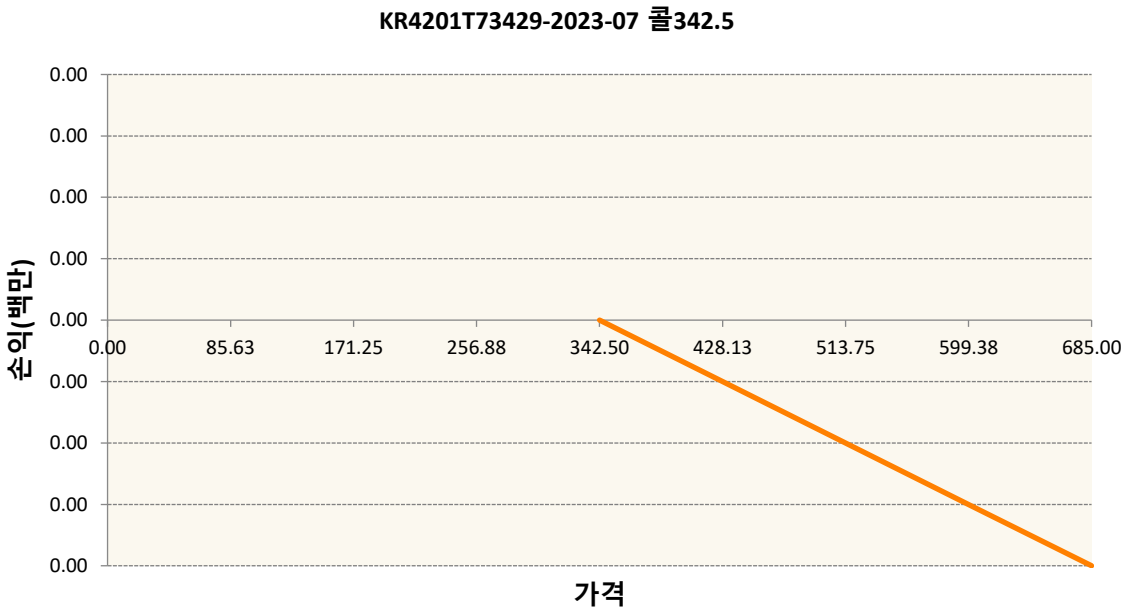
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

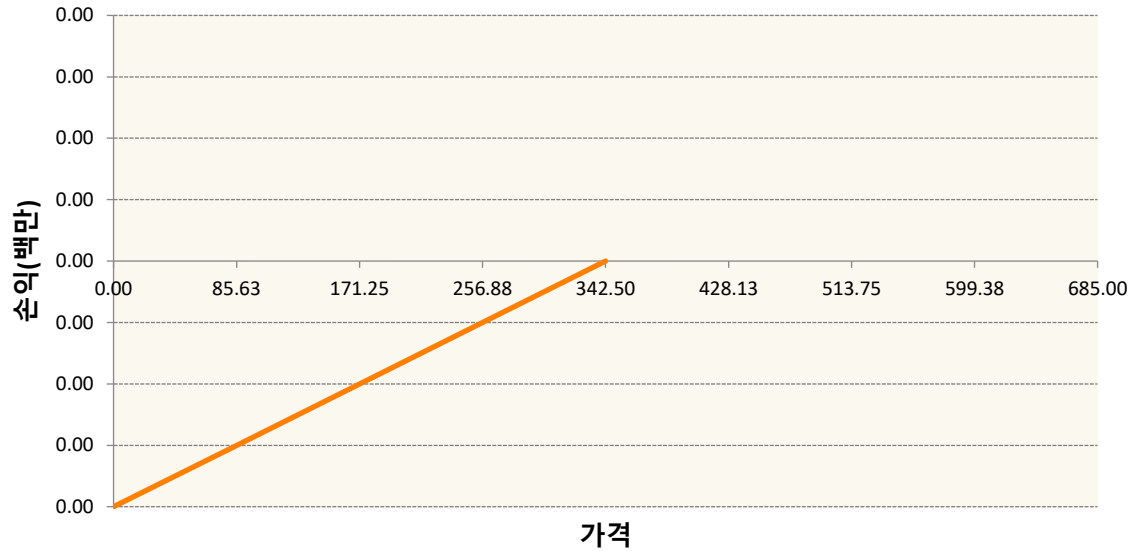
(단위:백만원)

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				2,619
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	502	502	501	500	497	493	488
-5.33%	498	493	485	475	463	448	431
-2.67%	438	412	384	354	322	288	253
0%	136	91	45	0	-45	-91	-136
2.67%	-566	-597	-631	-666	-703	-741	-780
5.33%	-1,539	-1,548	-1,560	-1,575	-1,593	-1,613	-1,636
8.00%	-2,589	-2,591	-2,593	-2,596	-2,602	-2,609	-2,619
KR4201T73452			2023-07 콜345				337
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	56	56	56	56	55	55	54
-5.33%	56	55	54	53	52	50	48
-2.67%	50	47	44	40	36	31	27
0%	19	13	6	0	-6	-13	-19
2.67%	-62	-68	-74	-80	-86	-92	-98
5.33%	-187	-189	-192	-195	-199	-203	-207
8.00%	-329	-330	-330	-331	-333	-334	-337
KR4301T73427			2023-07 풋342.5				636
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-633	-633	-633	-633	-634	-635	-636
-5.33%	-383	-384	-386	-389	-391	-395	-399
-2.67%	-147	-153	-160	-167	-174	-182	-191
0%	32	21	11	0	-11	-21	-32

2.67%	117	109	101	93	84	75	66
5.33%	137	135	133	129	125	120	115
8.00%	140	140	139	138	137	135	133

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

(단위:백만원)

3,995

공시일	2023-07-05
기준일	2023-07-04

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	6,509	0	6,509	

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	2023-07-05
기준일	2023-07-04

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	4,737	0	4,737	

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	2023-07-05
기준일	2023-07-04

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	18,860	0	18,860	
누계	통화	선도	260	18,577	-18,317	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213D4S(KRW/USD 31-07-23E	259
FXW213D5S(KRW/USD 31-08-23E	681
FXW213D6S(KRW/USD 27-09-23E	547
FXW213D6V(USD/KRW 31-07-23E	21
IE00BD8RGM75	

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

3,293

공시일	2023-07-05
기준일	2023-07-04

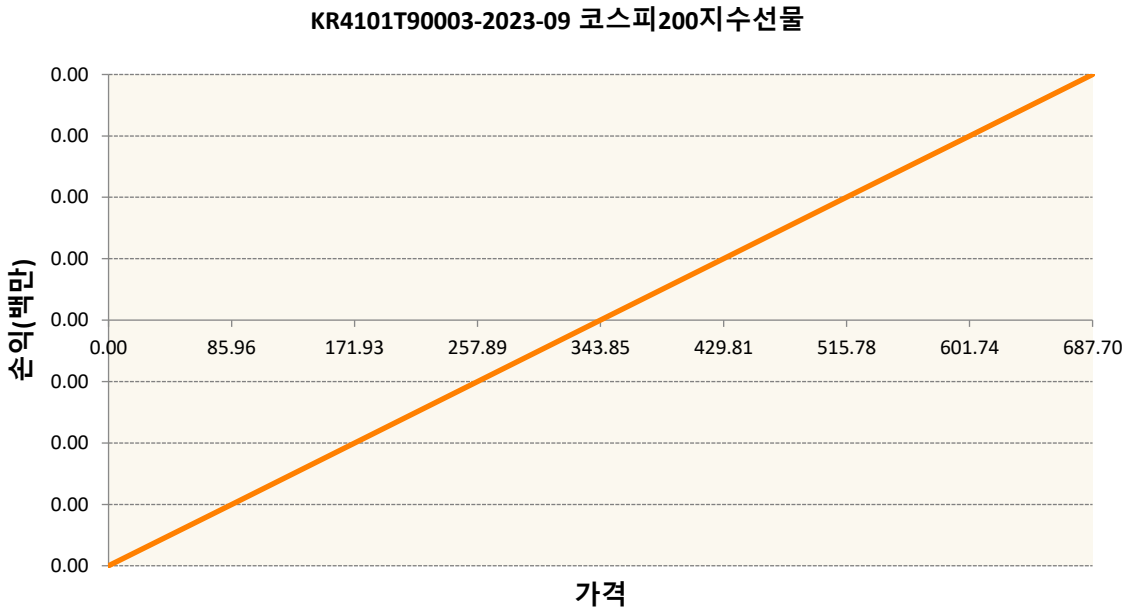
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

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	688	0	688	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101T90003			2023-09 코스피200지수선물				55
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-55	-55	-55	-55	-55	-55	-55
-5.33%	-36	-36	-36	-36	-36	-36	-36
-2.67%	-18	-18	-18	-18	-18	-18	-18
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	18	18	18	18	18	18	18
5.33%	36	36	36	36	36	36	36
8.00%	55	55	55	55	55	55	55

공시일	2023-07-05
기준일	2023-07-04

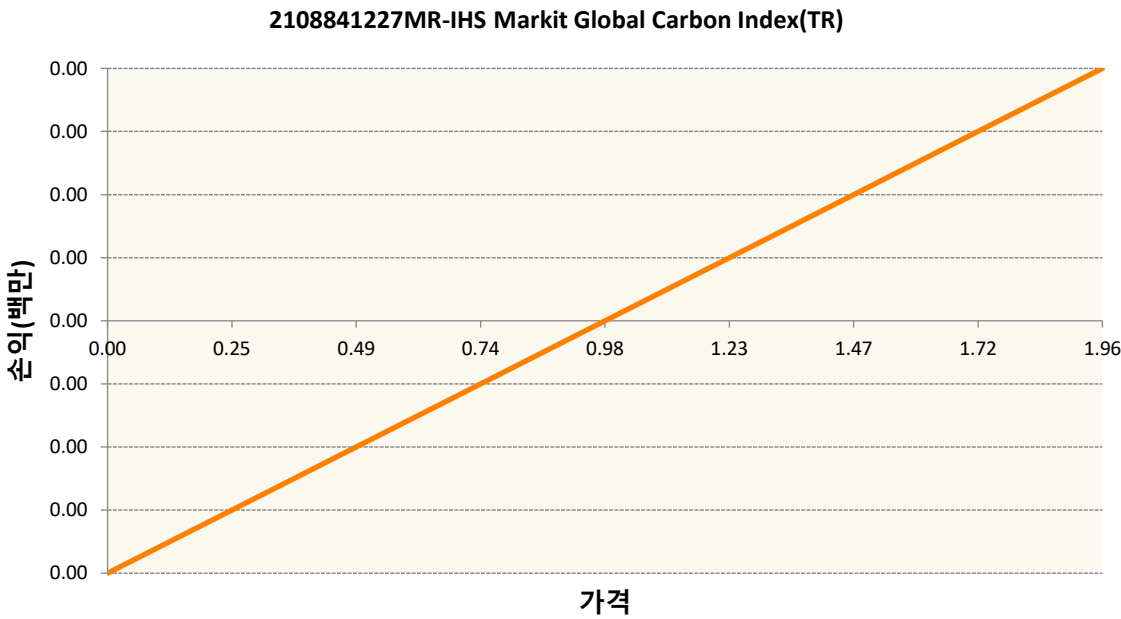
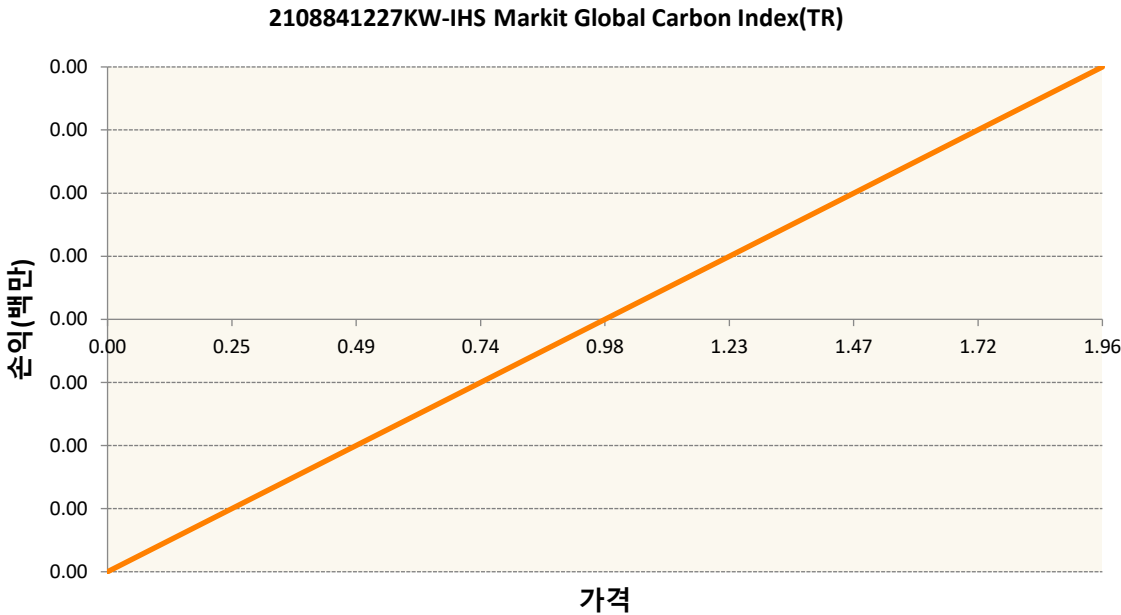
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

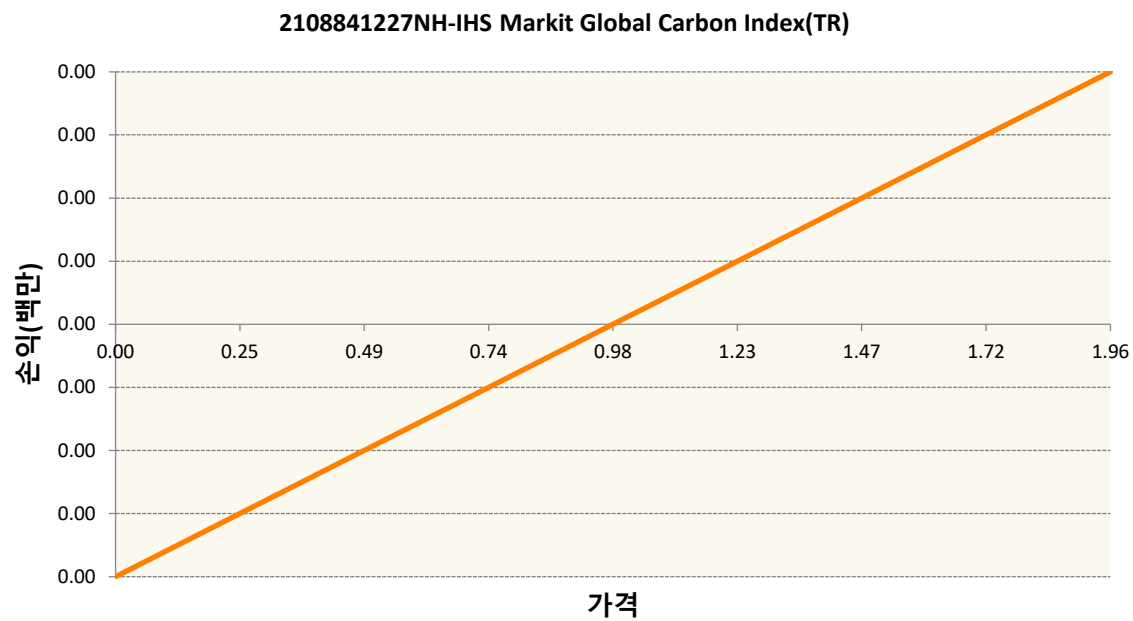
1. 계약금액

(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)		1,745
2108841227IHS Markit Global Carbon Index(TR)		205
2108841227IHS Markit Global Carbon Index(TR)		103

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)		(단위:백만원)
		3,306

공시일 2023-07-05

기준일 2023-07-04

SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

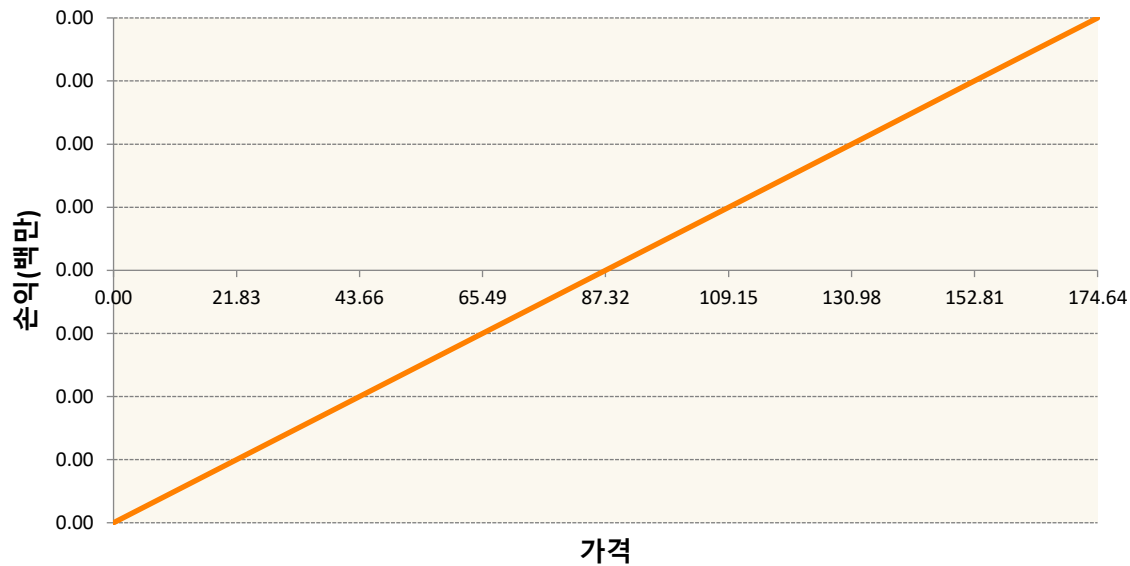
1. 계약금액

(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	8,830	0	8,830	
누계	통화	선도	0	2,292	-2,292	장외

2. 만기시점의 손익구조

MOZ23-ECX EMISSION Dec23



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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	68
FXW213D73 KRW/EUR 31-07-23E	2
MOZ23 ECX EMISSION Dec23	706

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

(단위:백만원)

1,283

공시일	2023-07-05
기준일	2023-07-04

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)

28

공시일	2023-07-05
기준일	2023-07-04

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)	3
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 230116(메리츠)	4
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 230116(미래)	3
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 230427(키움)	1

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

(단위:백만원)

19

공시일	2023-07-05
기준일	2023-07-04

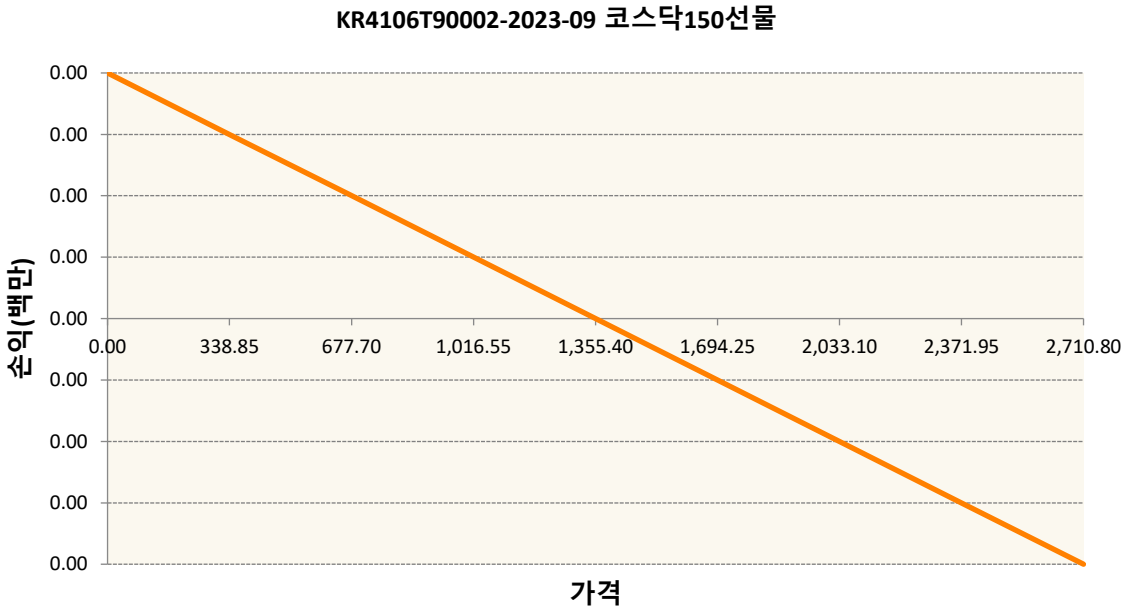
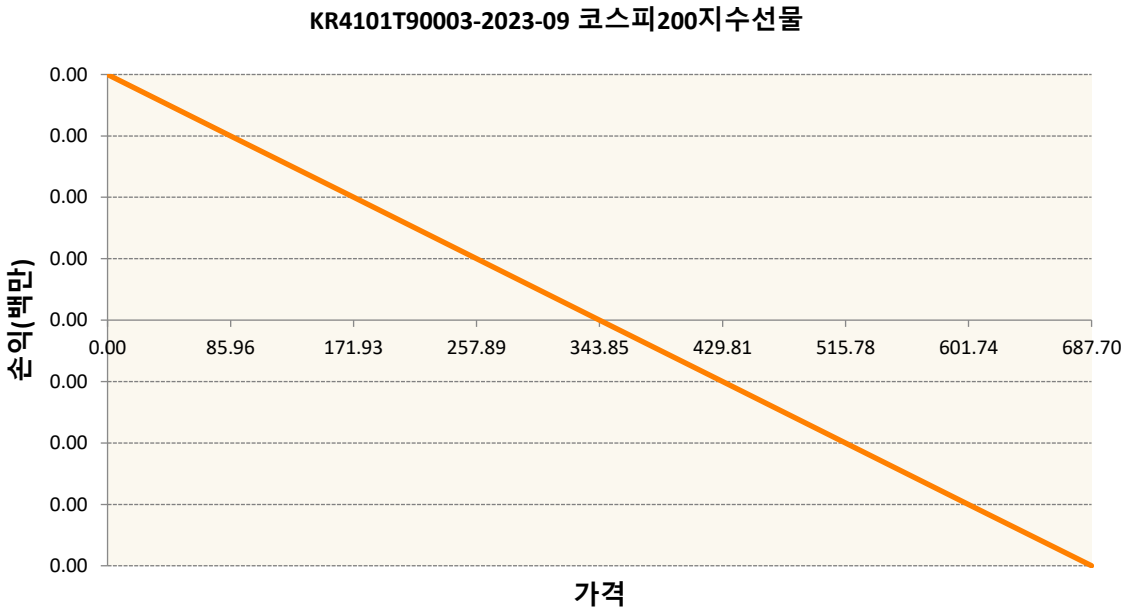
에쿼티알파일반사모혼합자산

1. 계약금액

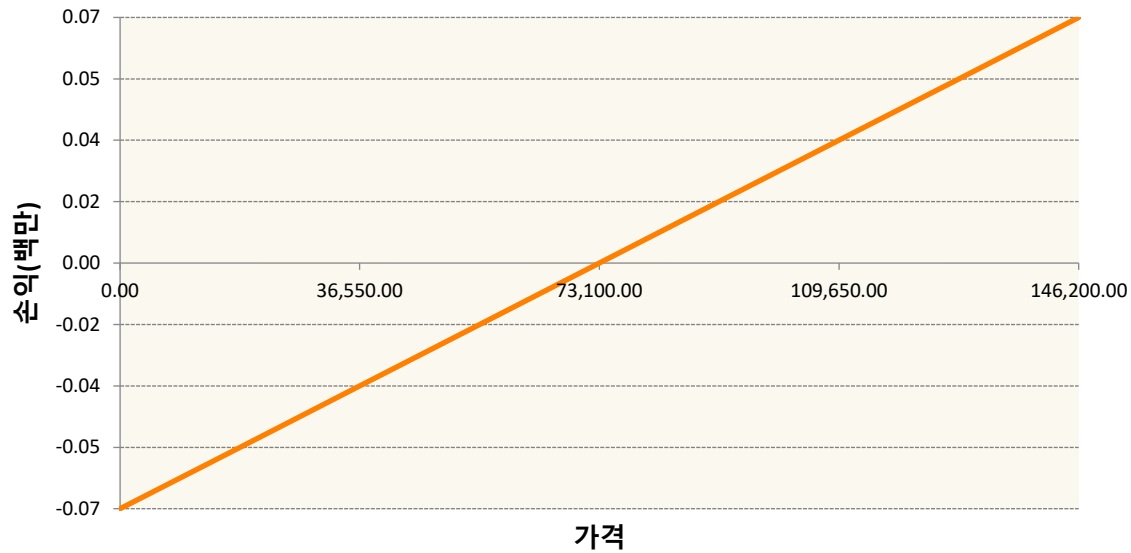
(단위:백만원)

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	393	3,185	-2,791	장내
누계	유가증권	스왑	0	0	0	장외

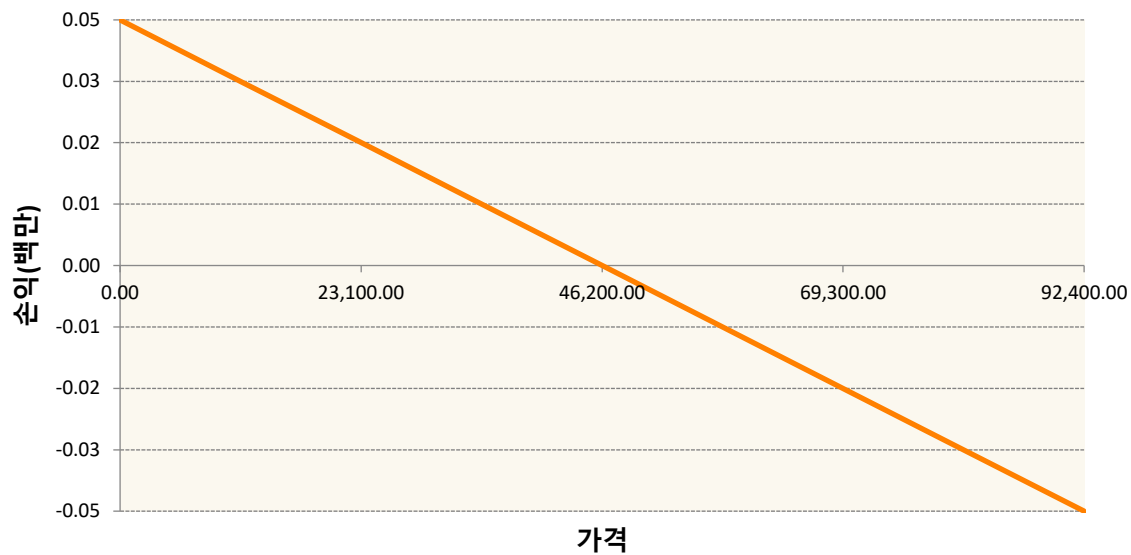
2. 만기시점의 손익구조



KR4111T70004-2023-07 삼성전자개별선물



KR41F7T70006-2023-07 카카오페이개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101T900 2023-09 코스피200지수선물	138
KR4106T900 2023-09 코스닥150선물	112
KR4111T700 2023-07 삼성전자개별선물	31
KR41F7T700 2023-07 카카오페이개별선물	6
KRS0004099 SWAP_MICRON TECH_0308	1
KRS0004212 SWAP_SPDR S&P BIOTECH_0413	1
KRS0004404 SWAP_PRSH ST FTRS ETF_0629	0.24

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

(단위:백만원)

464

공시일	2023-07-05
기준일	2023-07-04

코리아인덱스(주식-파생형)(종)

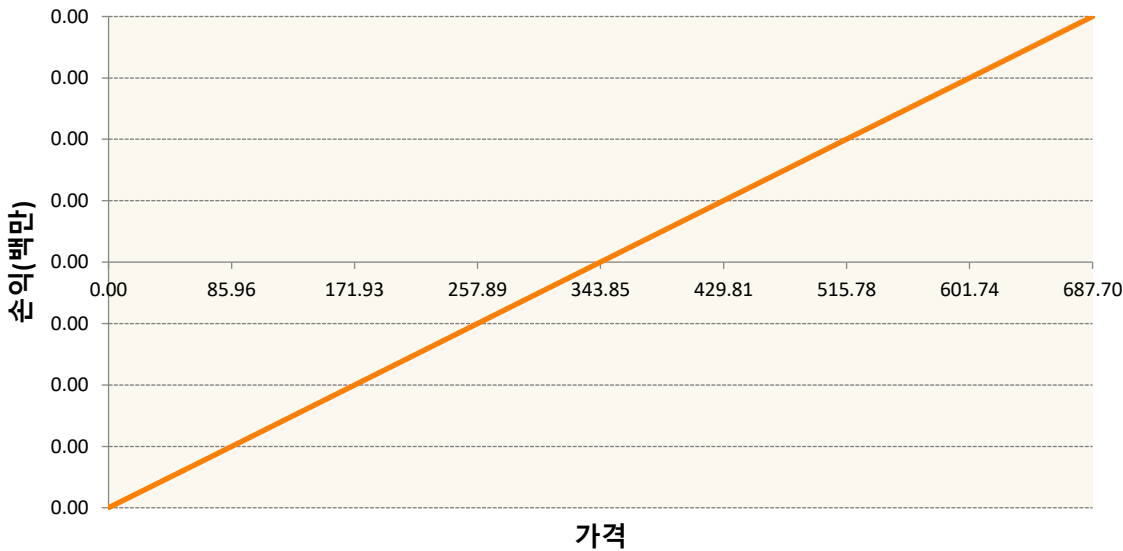
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,203	0	1,203	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101T90003-2023-09 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101T90003			2023-09 코스피200지수선물				96
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-96	-96	-96	-96	-96	-96	-96
-5.33%	-64	-64	-64	-64	-64	-64	-64
-2.67%	-32	-32	-32	-32	-32	-32	-32
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	32	32	32	32	32	32	32
5.33%	64	64	64	64	64	64	64
8.00%	96	96	96	96	96	96	96

공시일	2023-07-05
기준일	2023-07-04

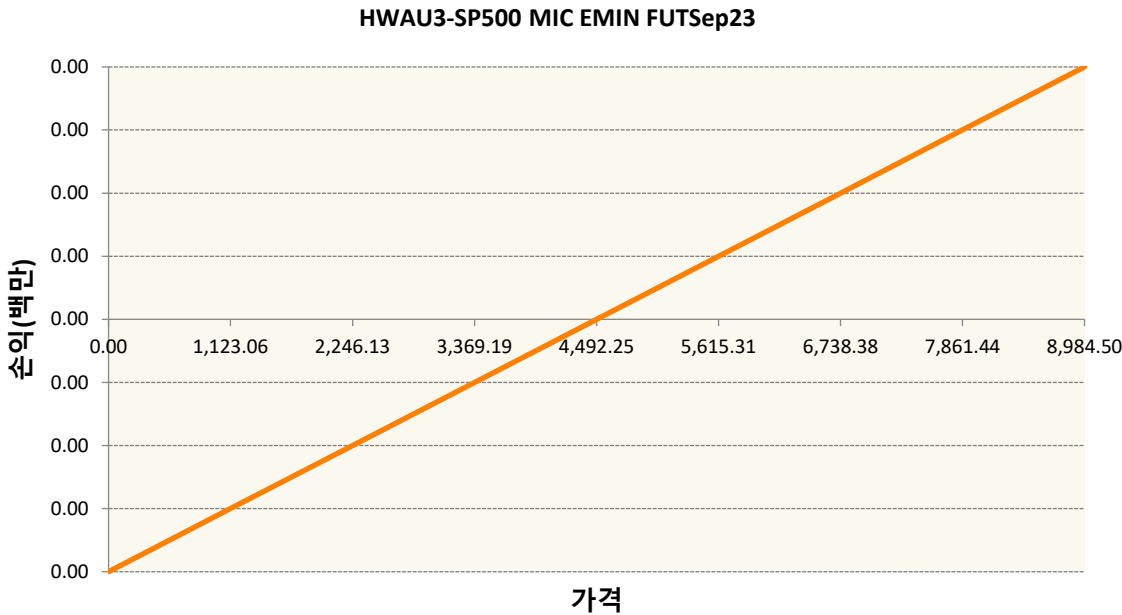
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

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	862	0	862	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HWAU3	SP500 MIC EMIN FUTSep23	69
-------	-------------------------	----

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

(단위:백만원)

111

공시일	2023-07-05
기준일	2023-07-04

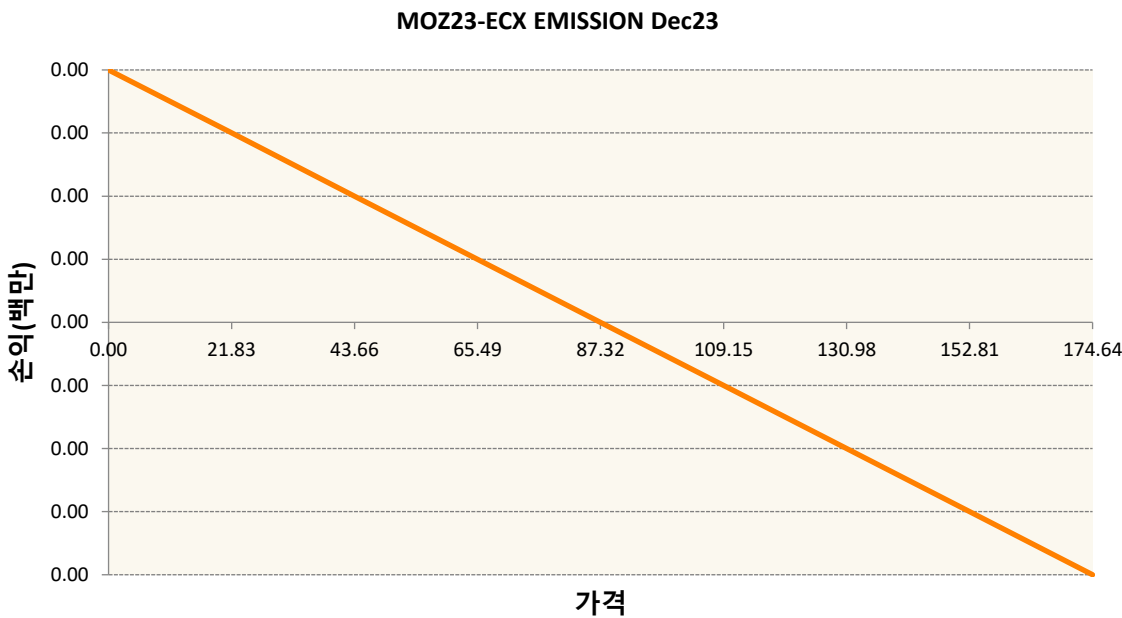
SOL유럽탄소배출권선물인버스ICE특별자산상

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	8,685	-8,685	
누계	통화	선도	22	2,114	-2,092	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213D6V\ KRW/EUR 31-07-23E	44
FXW213D6V\ KRW/EUR 31-07-23E	125
FXW213D73\ EUR/KRW 31-07-23E	2
MOZ23 ECX EMISSION Dec23	695

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

(단위:백만원)

1,255

공시일	2023-07-05
기준일	2023-07-04

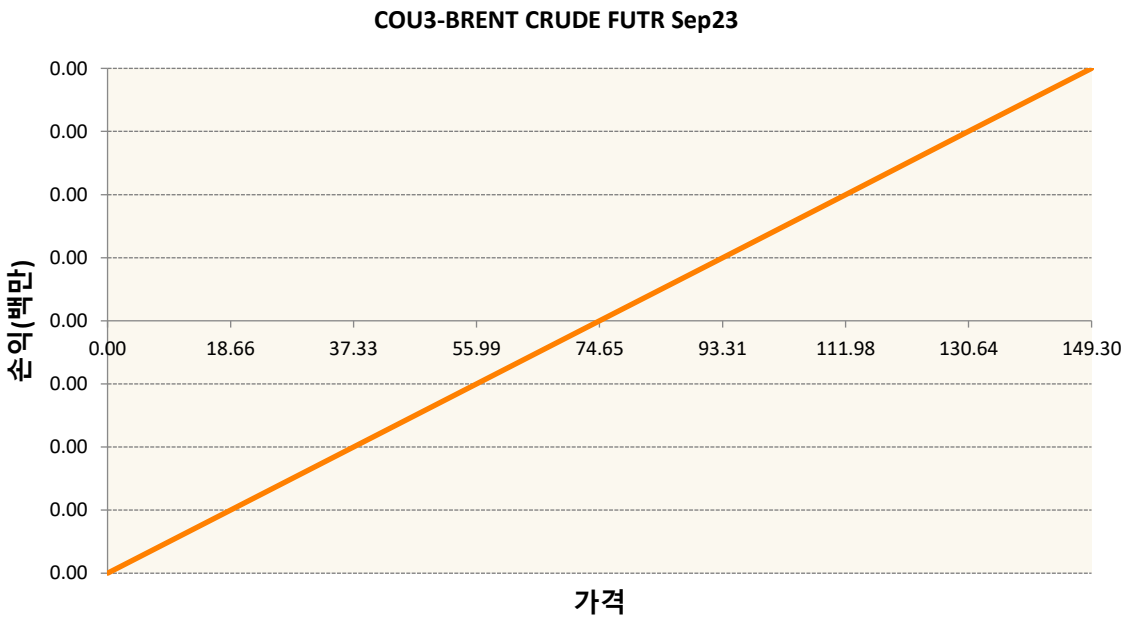
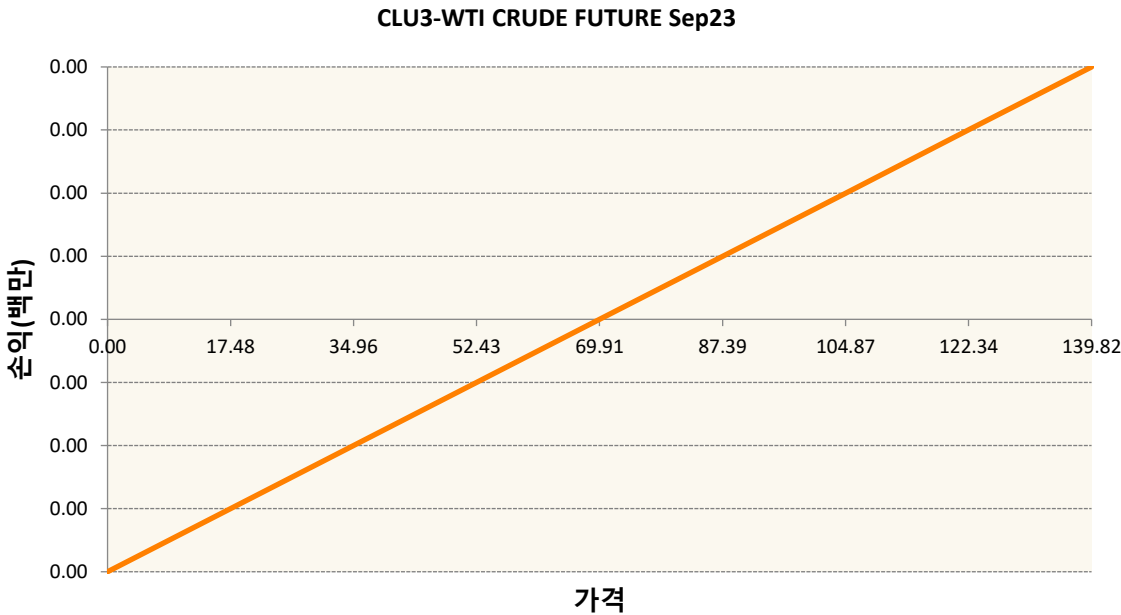
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

1. 계약금액

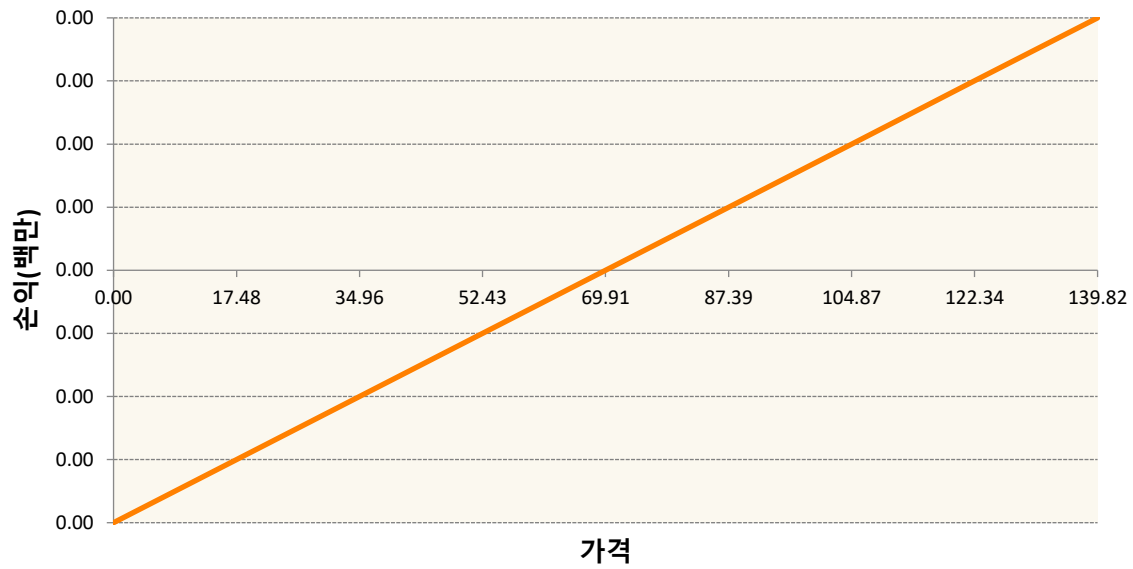
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,274	195	1,079	

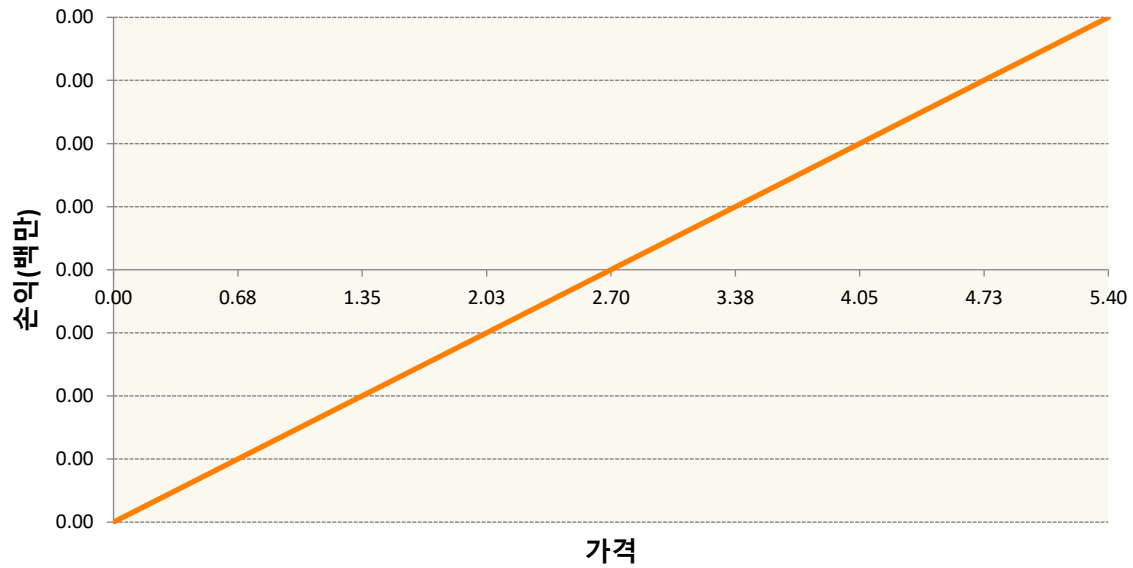
2. 만기시점의 손익구조



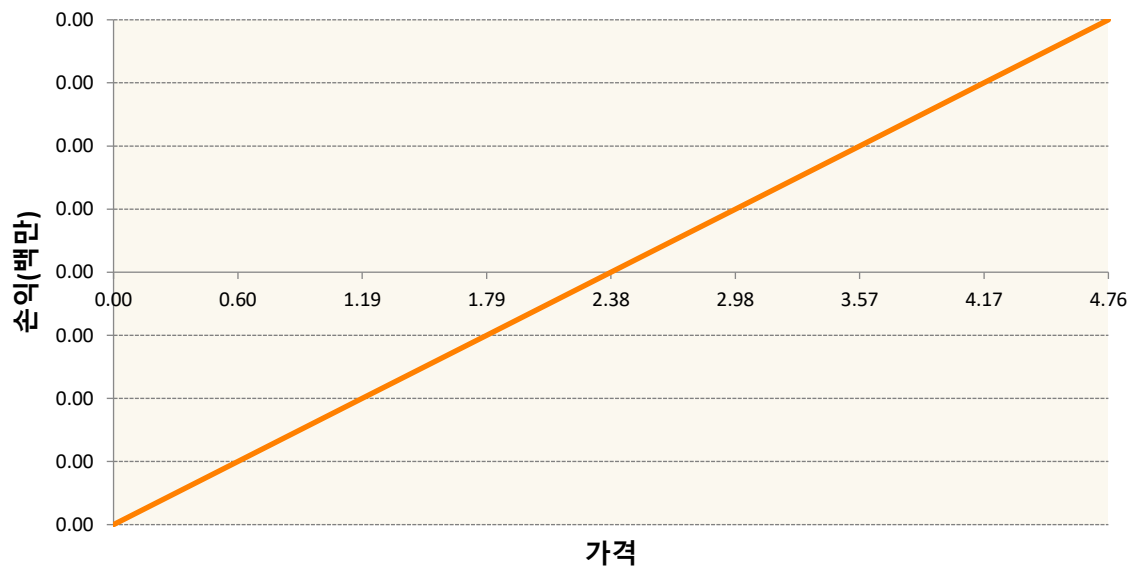
ECU3-E-mini Crude Oil Sep23



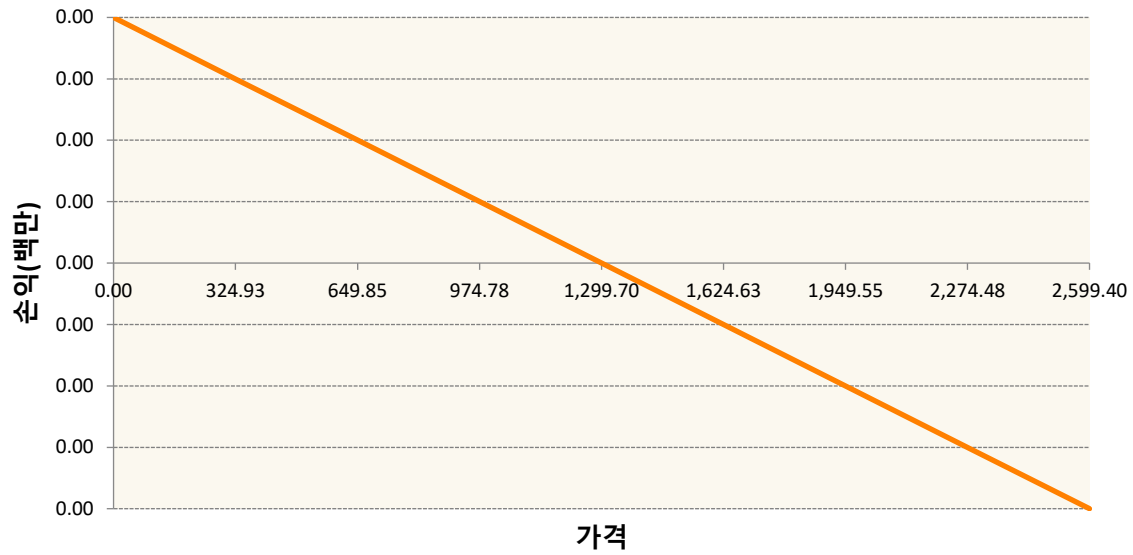
EOU3-E-MINI NATURAL GAS Sep23



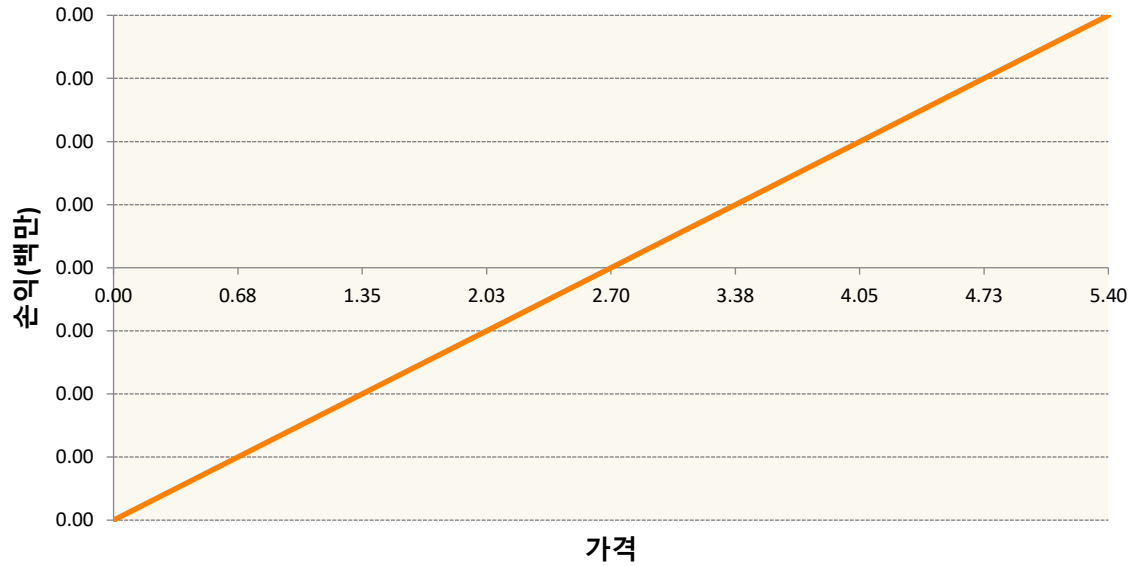
HOU3-NY Harb ULSD Fut Sep23



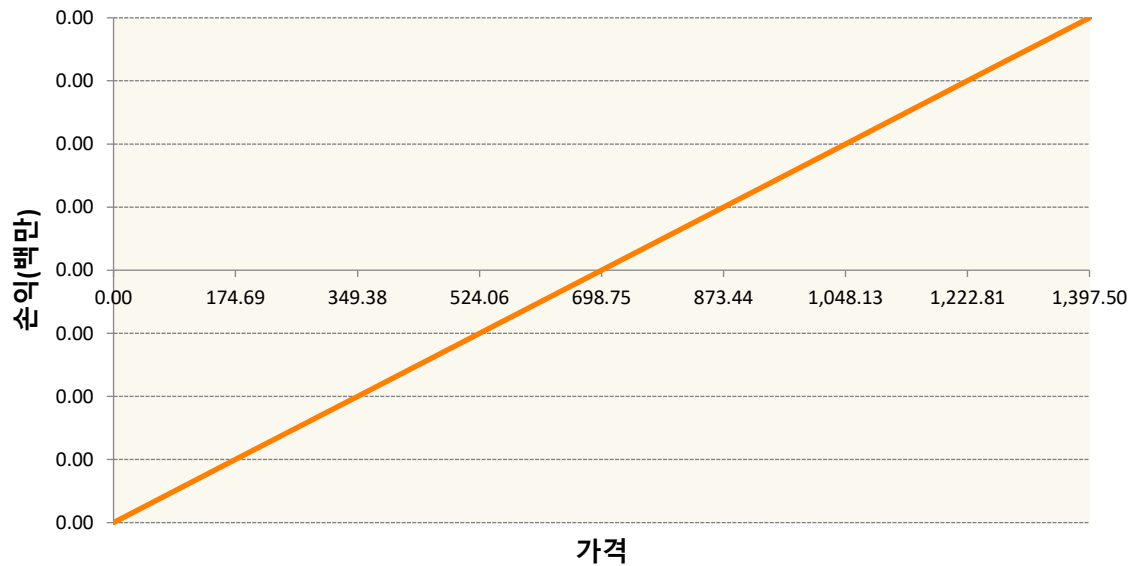
KR4175T70009-2023-07 달러선물

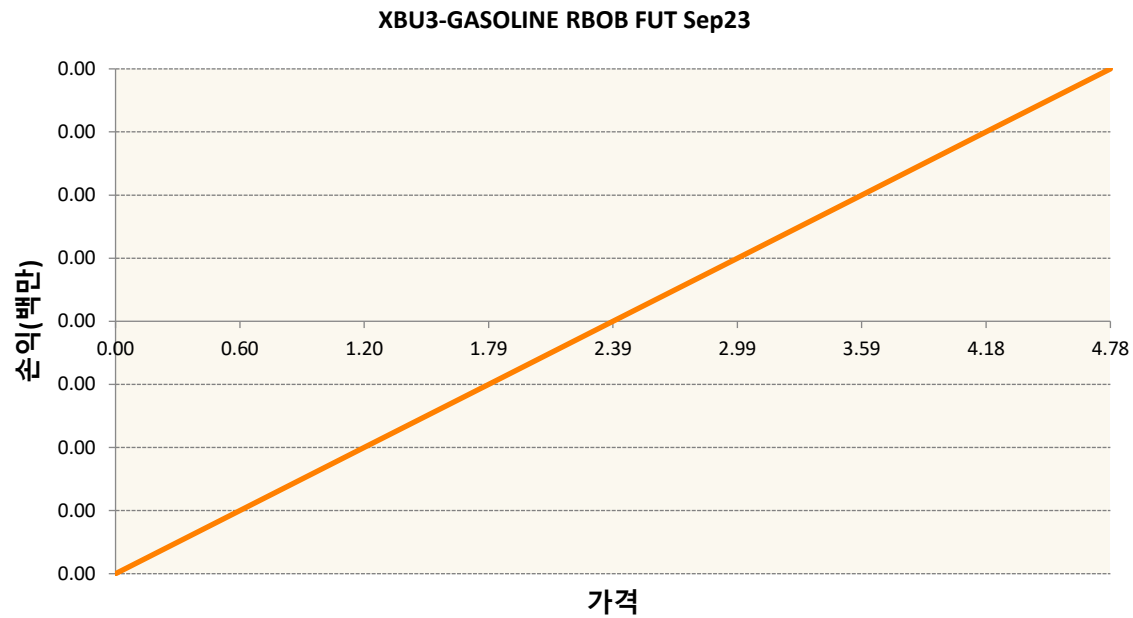


NGU23-NATURAL GAS FUTR Sep23



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