

공시일	2023-07-12
기준일	2023-07-11

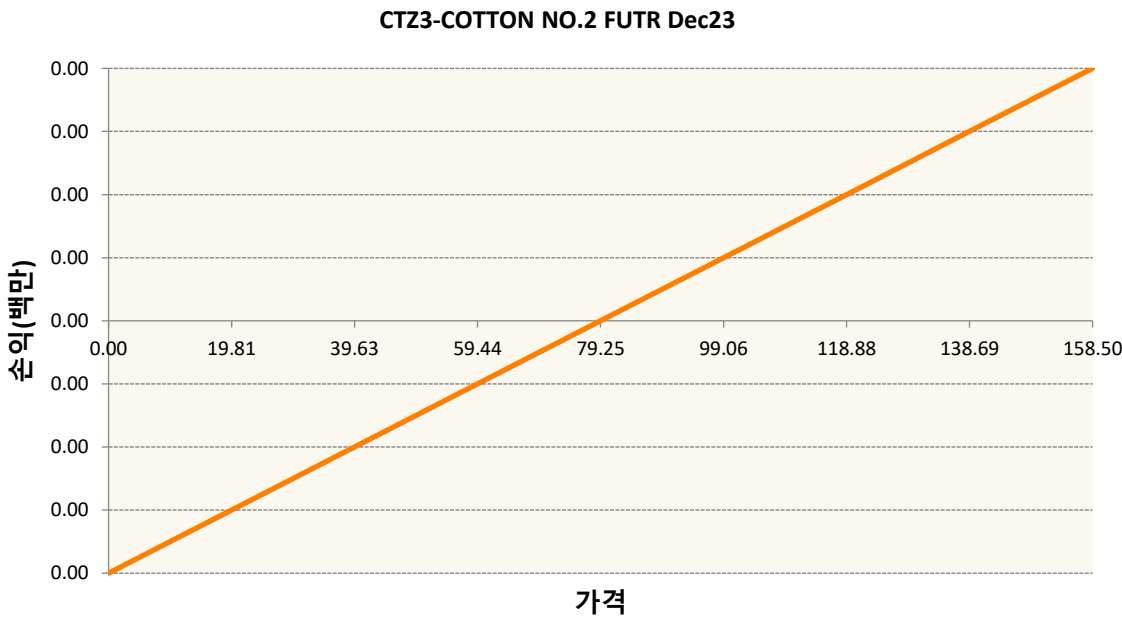
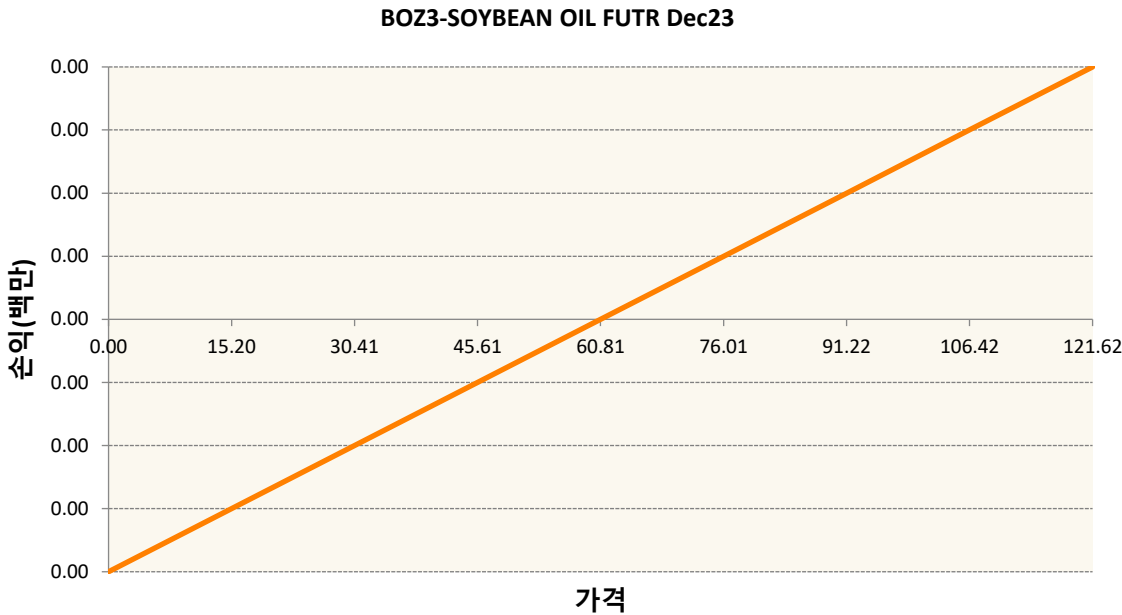
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

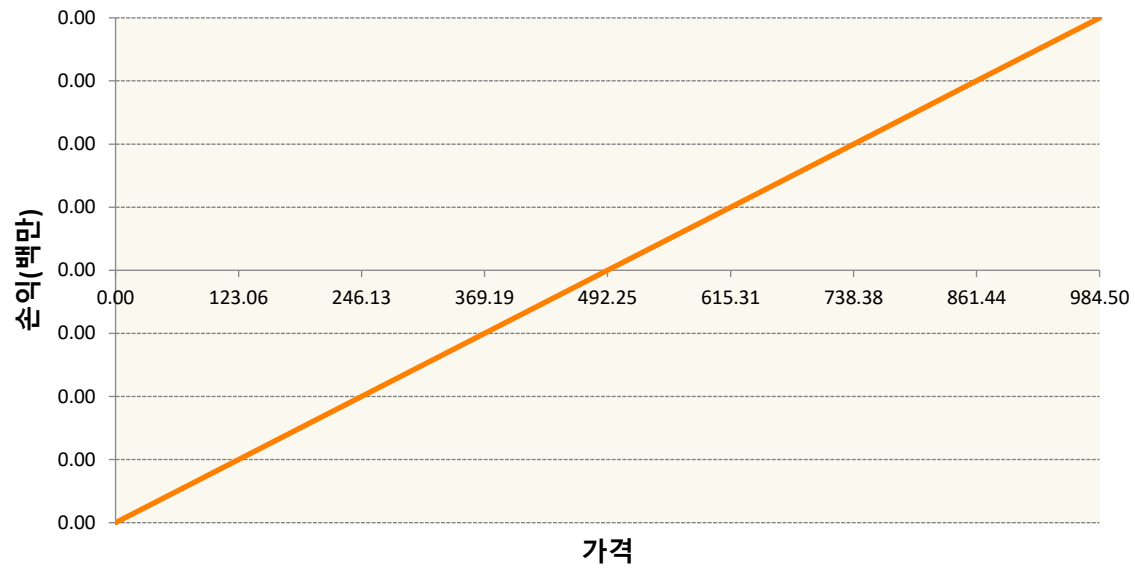
(단위:USD 백만)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,180	453	4,727	

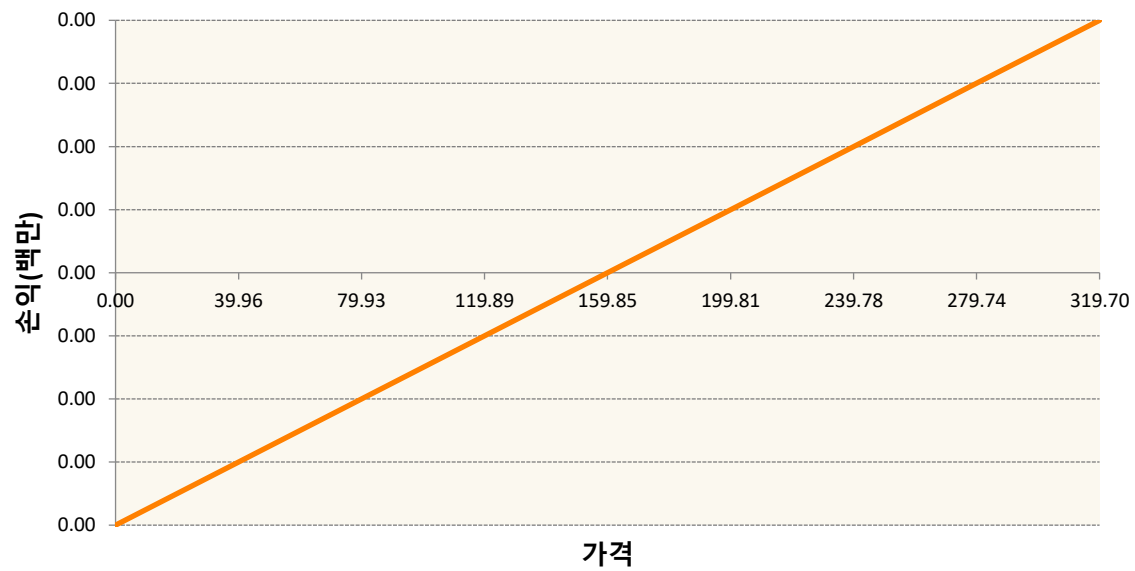
2. 만기시점의 손익구조



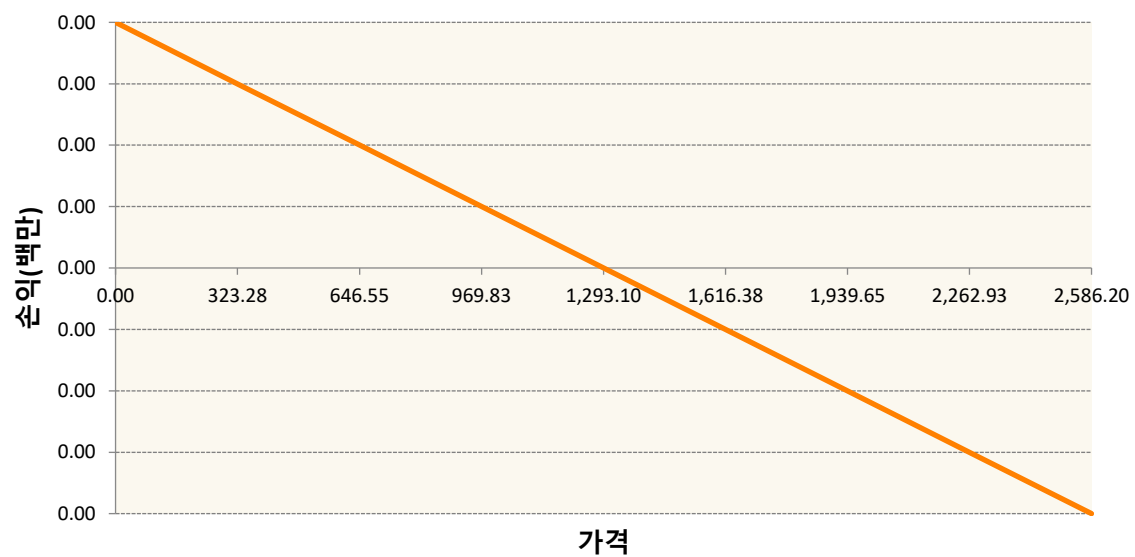
CU3-CORN FUTURE Sep23



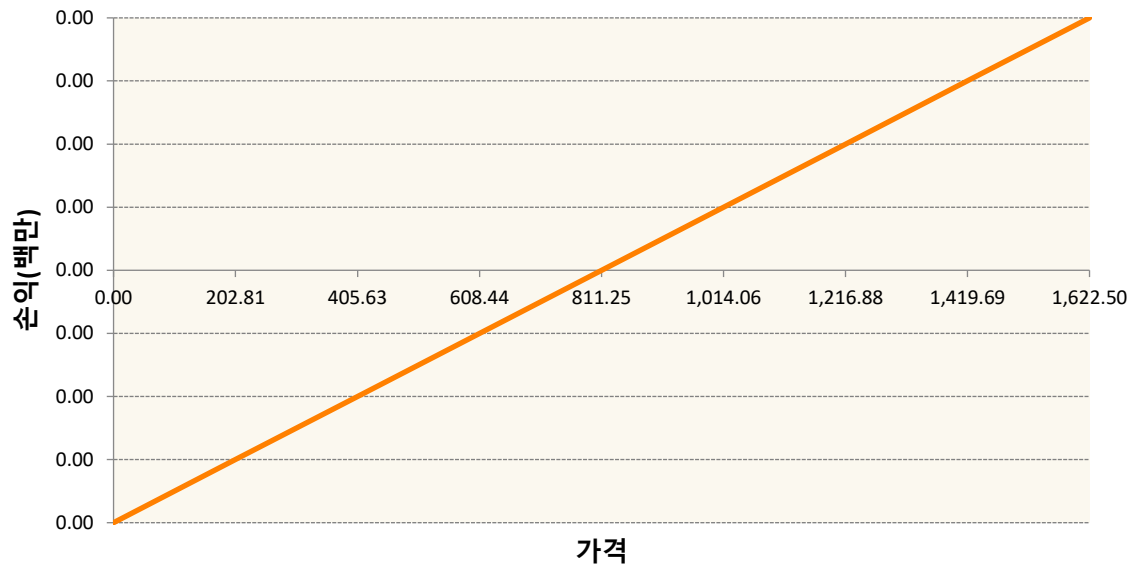
KCU3-COFFEE 'C' FUTURE Sep23



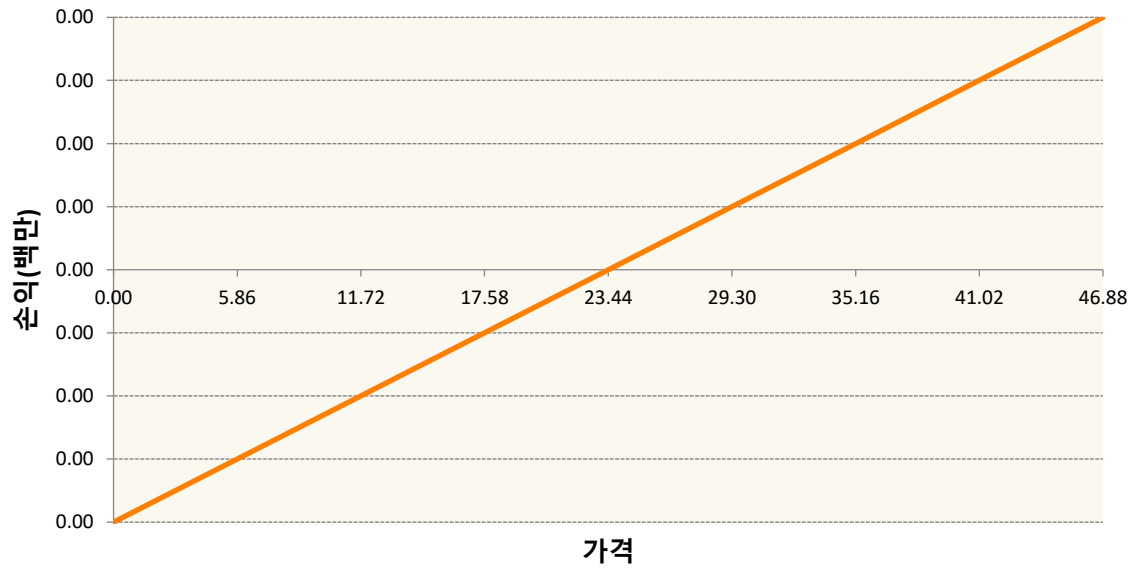
KR4175T70009-2023-07 달러선물



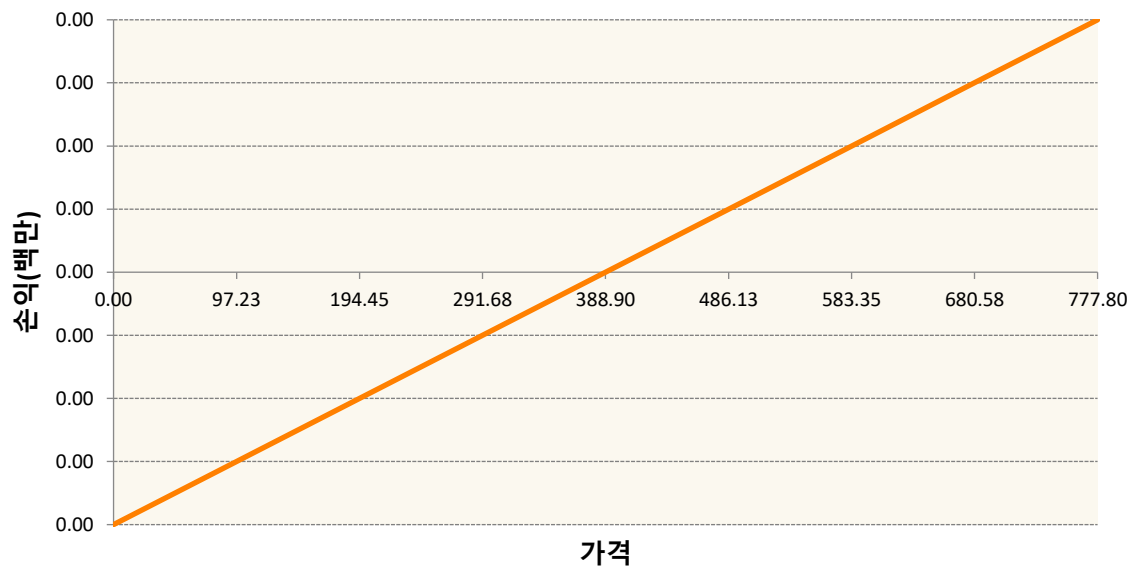
KWU3-KC HRW WHEAT FUT Sep23

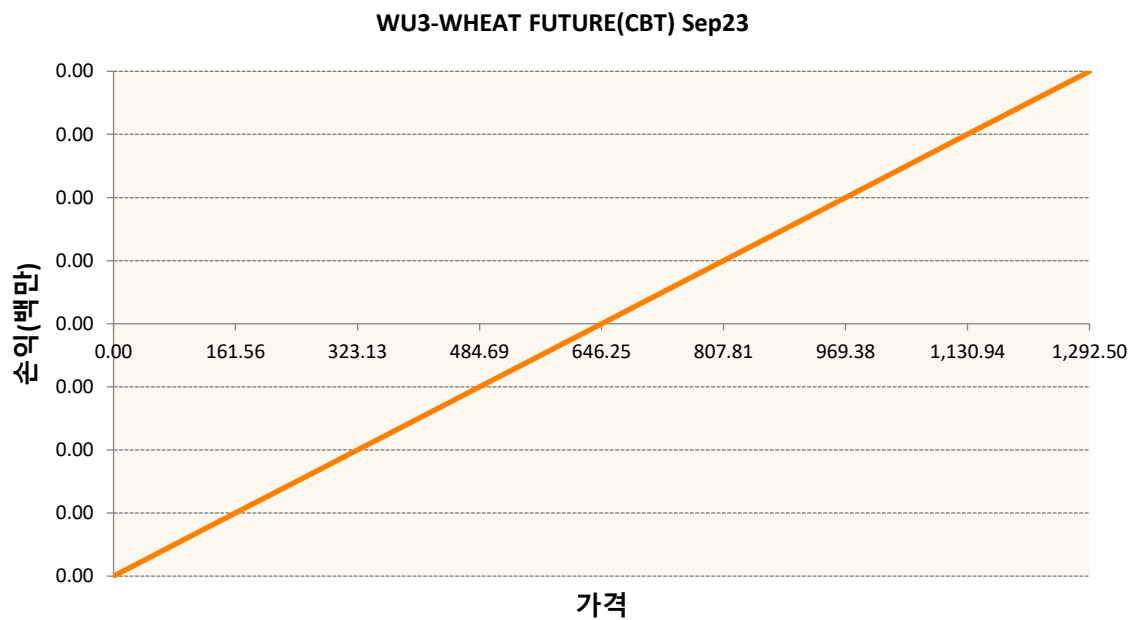
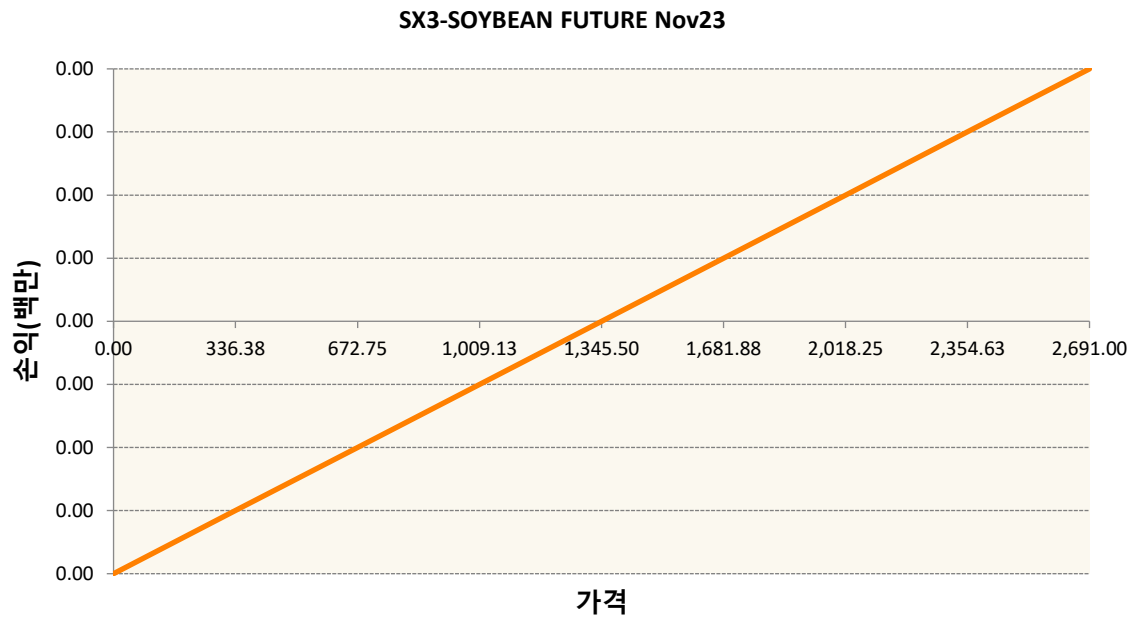


SBV3-Sugar #11 (WORLD) Oct23



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	2023-07-12
기준일	2023-07-11

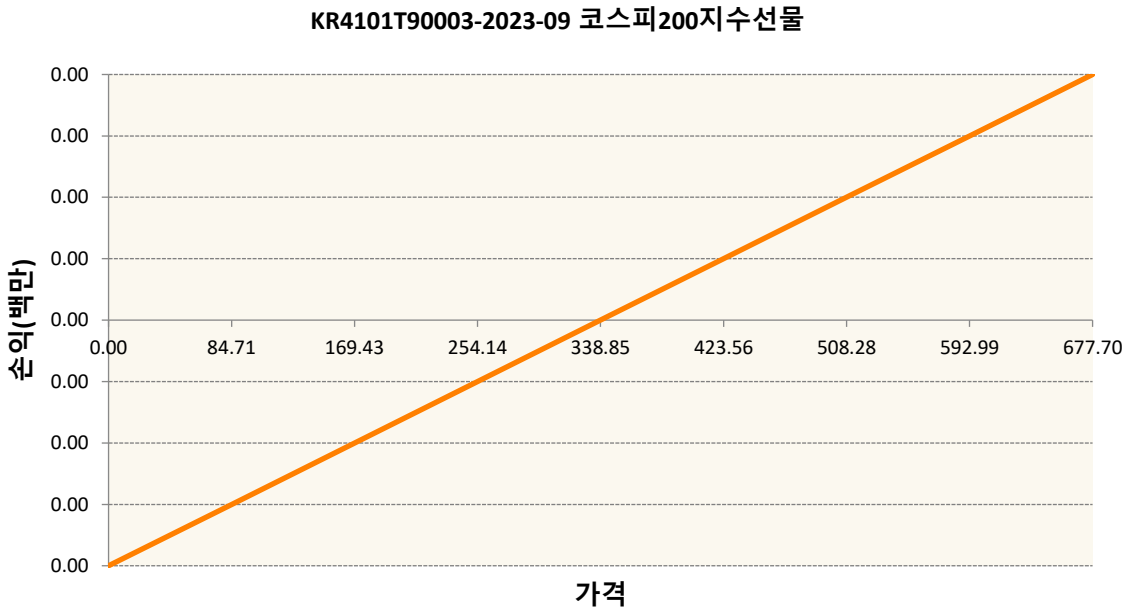
스마트인덱스모

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	85	0	85	장내
누계	유가증권	선물	508	0	508	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101T90003			2023-09 코스피200지수선물				40
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-40	-40	-40	-40	-40	-40	-40
-5.33%	-27	-27	-27	-27	-27	-27	-27
-2.67%	-13	-13	-13	-13	-13	-13	-13
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	13	13	13	13	13	13	13
5.33%	27	27	27	27	27	27	27
8.00%	40	40	40	40	40	40	40

공시일	2023-07-12
기준일	2023-07-11

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	336
-----------------------------	-----

* 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	2023-07-12
기준일	2023-07-11

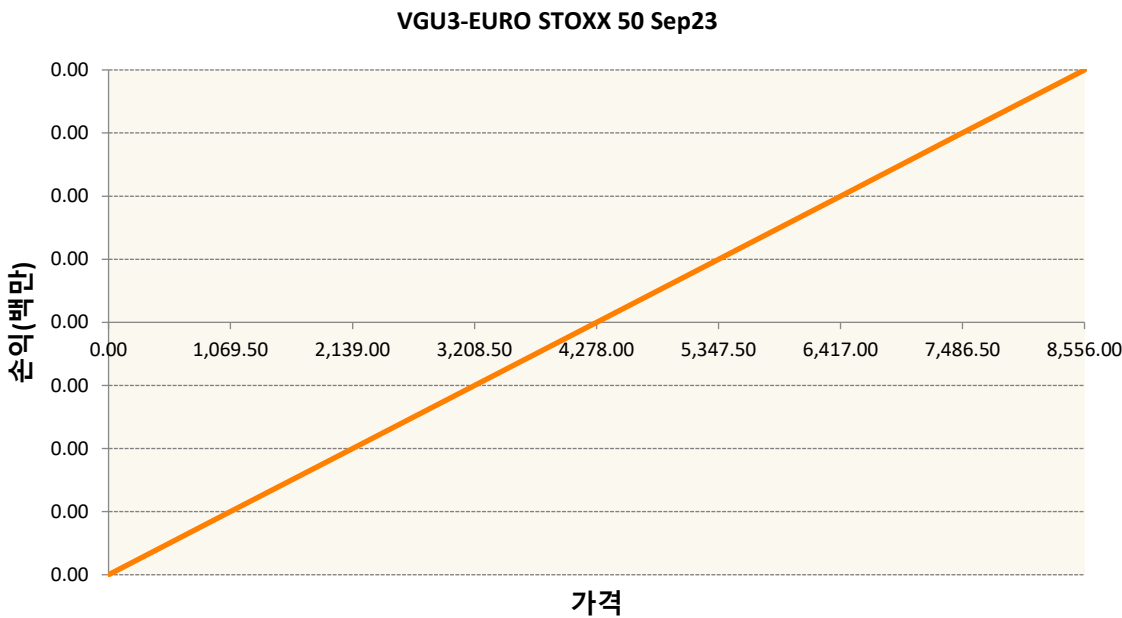
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	413	0	413	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGU3 EURO STOXX 50 Sep23

33

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

(단위:백만원)

53

공시일	2023-07-12
기준일	2023-07-11

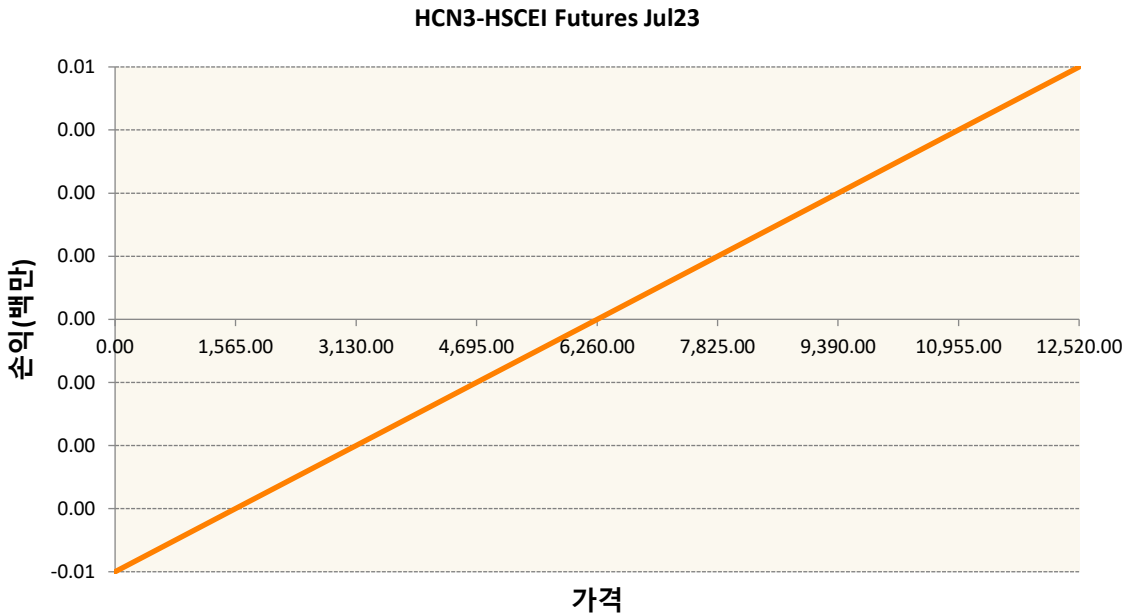
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,097	0	1,097	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCN3	HSCEI Futures Jul23	88
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

140

공시일	2023-07-12
기준일	2023-07-11

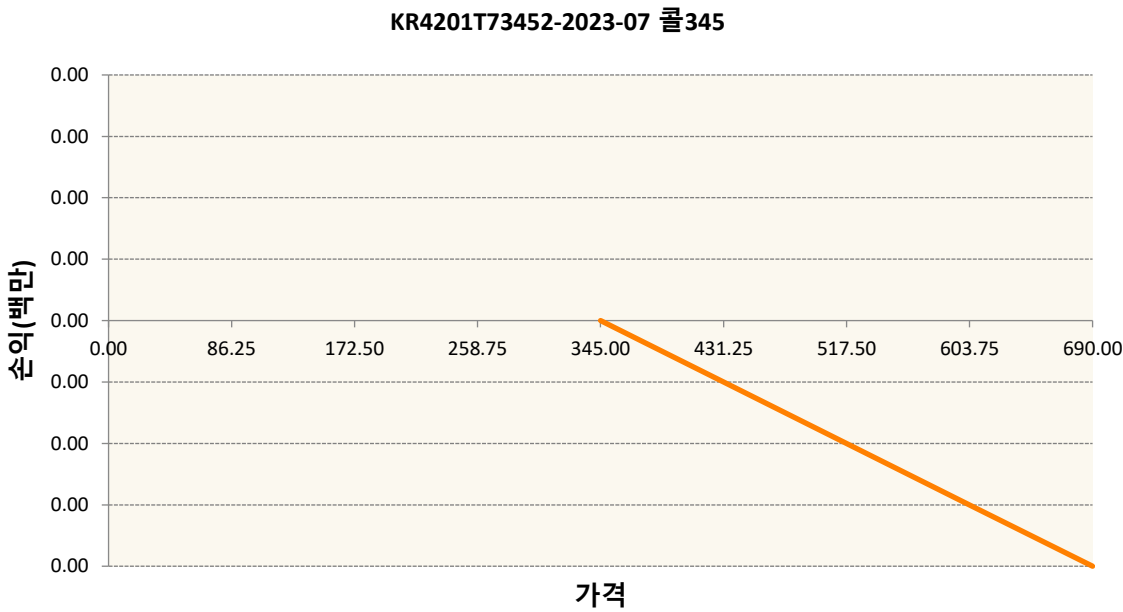
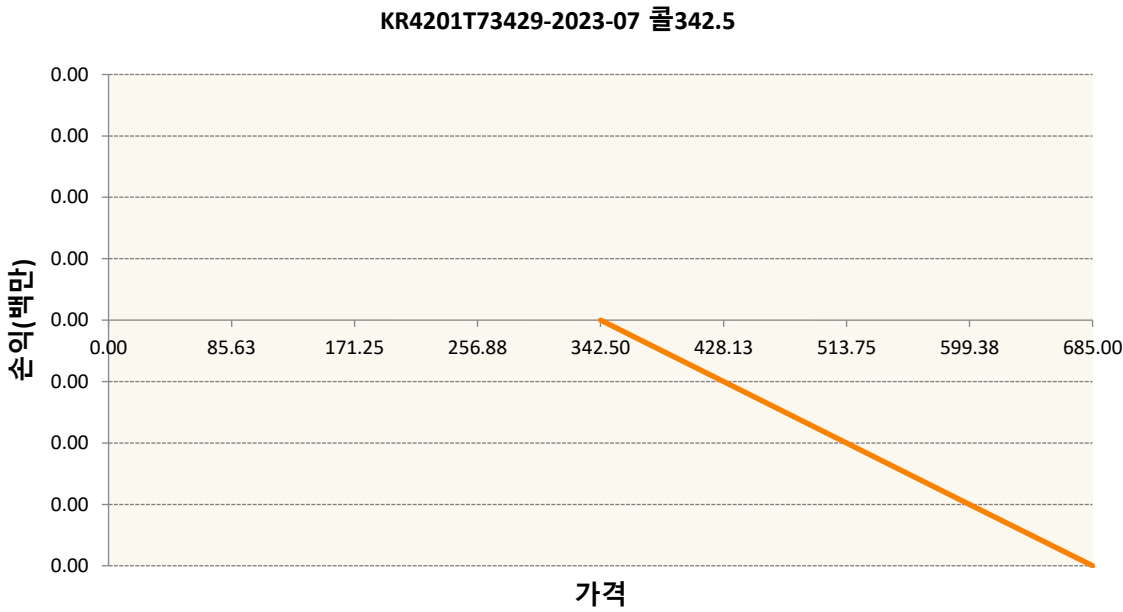
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

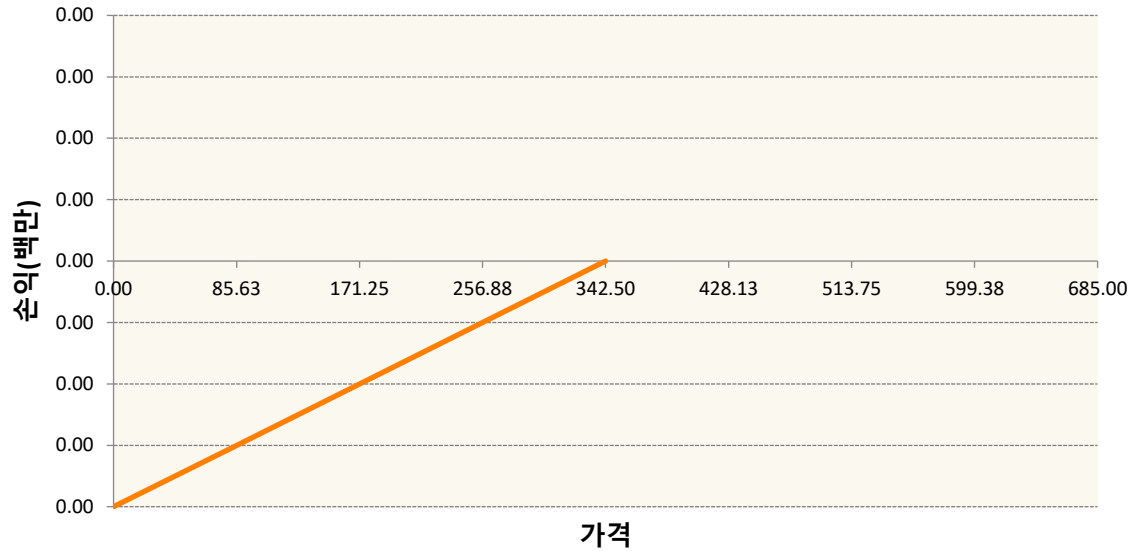
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	55,444	-55,444	장내

2. 만기시점의 손익구조



KR4301T73427-2023-07 풋342.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201T73429		2023-07 콜342.5						2,448
		기초자산의 변동성						
가격		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	59	59	59	59	59	59	59	59
-5.33%	59	59	59	59	59	59	59	59
-2.67%	59	59	58	58	57	55	53	53
0%	36	25	13	0	-14	-29	-45	-45
2.67%	-411	-427	-445	-463	-481	-500	-520	-520
5.33%	-1,401	-1,401	-1,402	-1,404	-1,407	-1,410	-1,415	-1,415
8.00%	-2,447	-2,447	-2,447	-2,447	-2,447	-2,447	-2,448	-2,448
KR4201T73452		2023-07 콜345						331
		기초자산의 변동성						
가격		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	8	8	8	8	8	8	8	8
-5.33%	8	8	8	8	8	8	8	8
-2.67%	8	8	8	8	7	7	6	6
0%	5	4	2	0	-2	-5	-7	-7
2.67%	-40	-44	-48	-52	-56	-60	-64	-64
5.33%	-172	-172	-174	-175	-177	-179	-181	-181
8.00%	-330	-330	-330	-330	-330	-331	-331	-331
KR4301T73427		2023-07 풋342.5						728
		기초자산의 변동성						
가격		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-728	-728	-728	-728	-728	-728	-728	-728
-5.33%	-480	-480	-480	-480	-480	-480	-480	-480
-2.67%	-233	-233	-233	-234	-234	-234	-235	-235
0%	8	6	3	0	-3	-7	-11	-11

2.67%	150	146	142	138	134	129	124
5.33%	164	164	163	163	162	161	160
8.00%	164	164	164	164	164	164	164

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

(단위:백만원)

3,887

공시일	2023-07-12
기준일	2023-07-11

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	5,752	0	5,752	

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	2023-07-12
기준일	2023-07-11

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	4,654	0	4,654	

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	2023-07-12
기준일	2023-07-11

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	18,530	0	18,530	
누계	통화	선도	259	18,468	-18,209	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213D4S(KRW/USD 31-07-23E	257
FXW213D5S(KRW/USD 31-08-23E	677
FXW213D6S(KRW/USD 27-09-23E	543
FXW213D6V(USD/KRW 31-07-23E	21
IE00BD8RGM75	

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

3,225

공시일	2023-07-12
기준일	2023-07-11

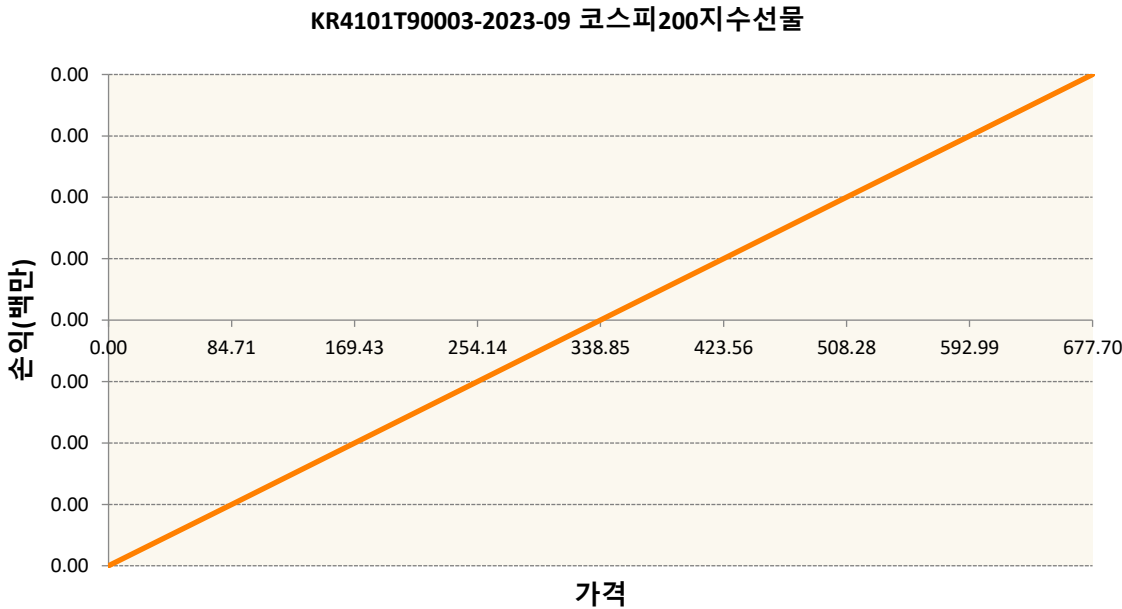
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

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	593	0	593	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	2023-07-12
기준일	2023-07-11

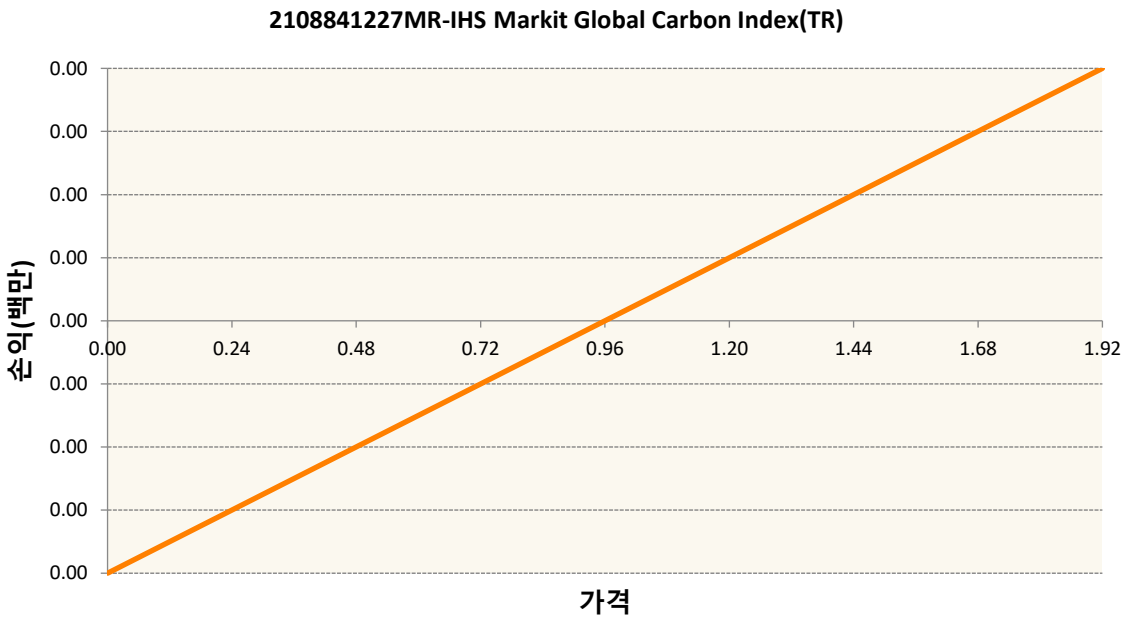
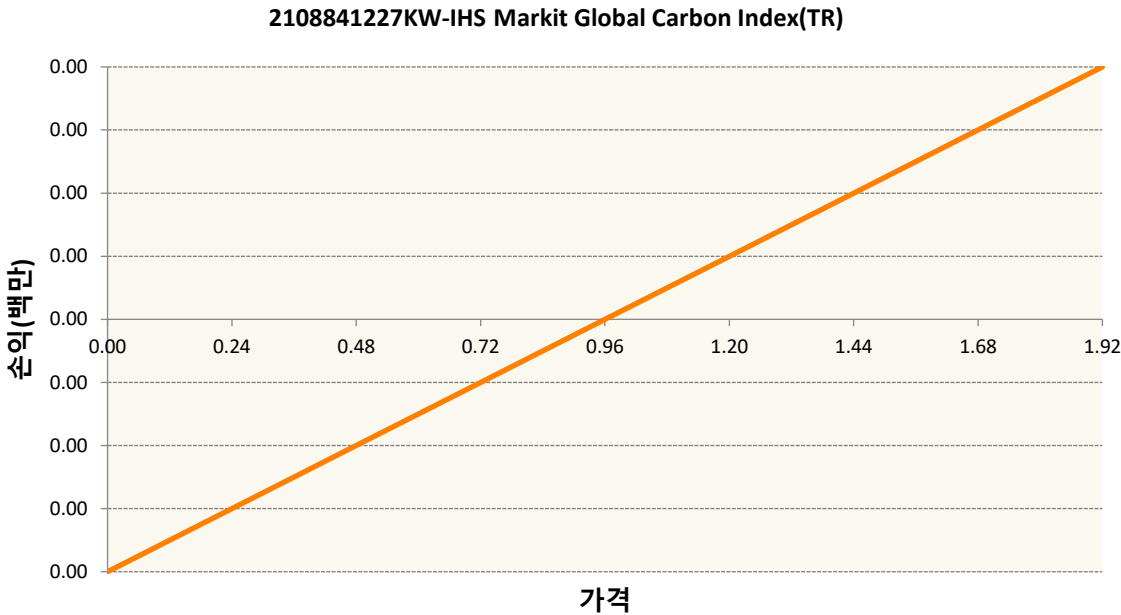
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

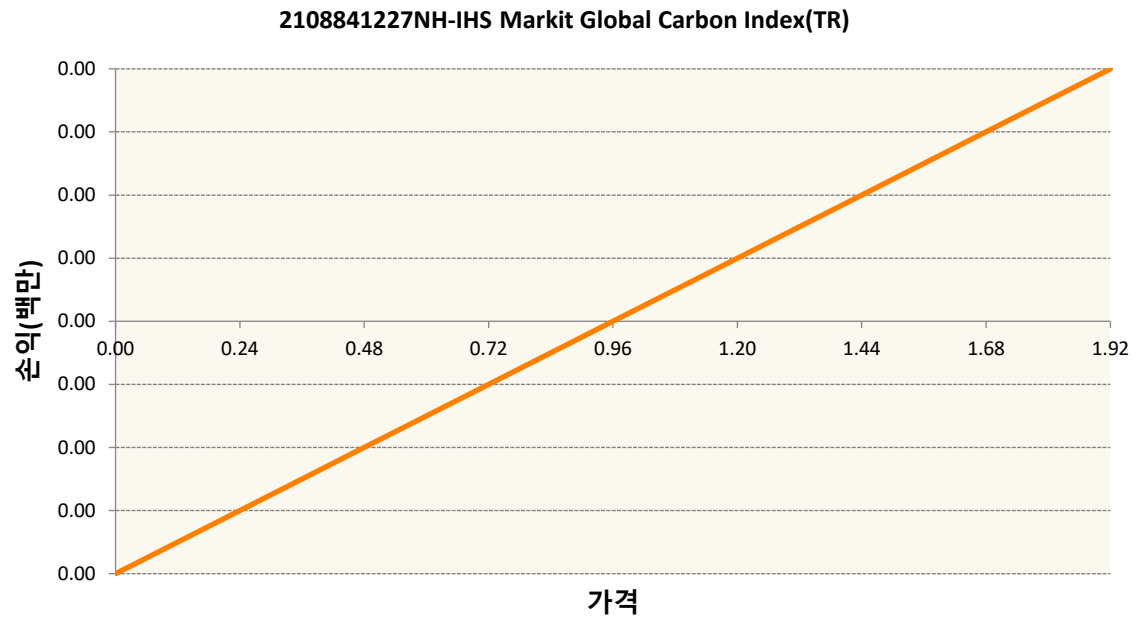
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	25,222	0	25,222	

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108841227IHS Markit Global Carbon Index(TR)		1,719
2108841227IHS Markit Global Carbon Index(TR)		202
2108841227IHS Markit Global Carbon Index(TR)		101

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)		(단위:백만원)
		3,229

공시일 2023-07-12

기준일 2023-07-11

SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

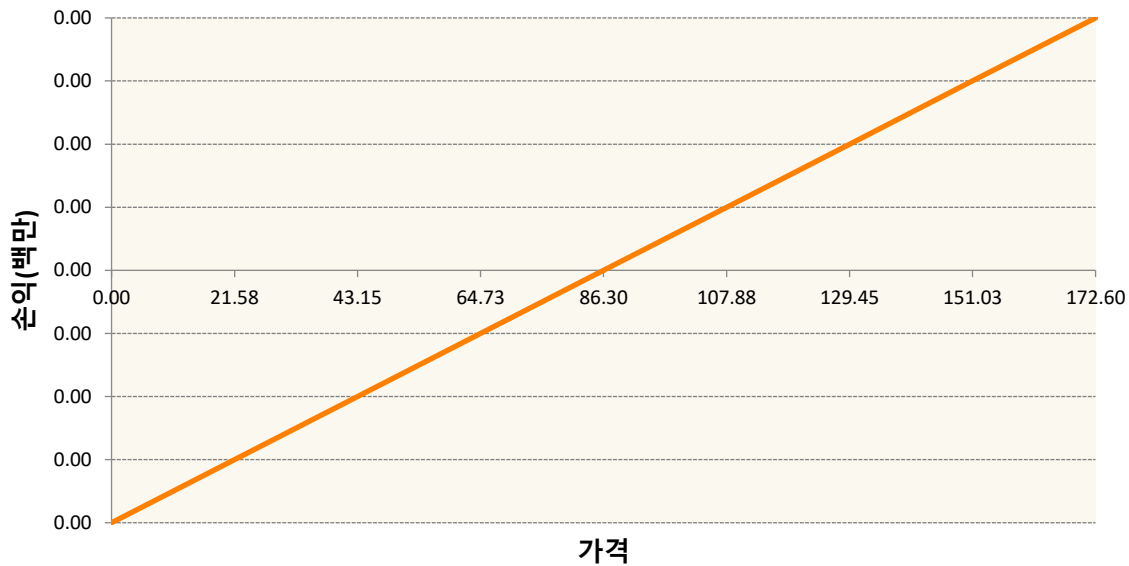
1. 계약금액

(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	8,727	0	8,727	
누계	통화	선도	0	2,301	-2,301	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	698

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

(단위:백만원)

1,261

공시일	2023-07-12
기준일	2023-07-11

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)	1
SWCSI00000 신한CSI Index 230622 (키움)	1
SWCSI00000 신한CSI Index 230622 (미래)	1
SWCSI00000 신한CSI Index 230622 (메리츠)	1

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

(단위:백만원)

5

공시일	2023-07-12
기준일	2023-07-11

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)	6
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 230116(메리츠)	8
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 230116(미래)	7
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 230427(키움)	2

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

(단위:백만원)

36

공시일	2023-07-12
기준일	2023-07-11

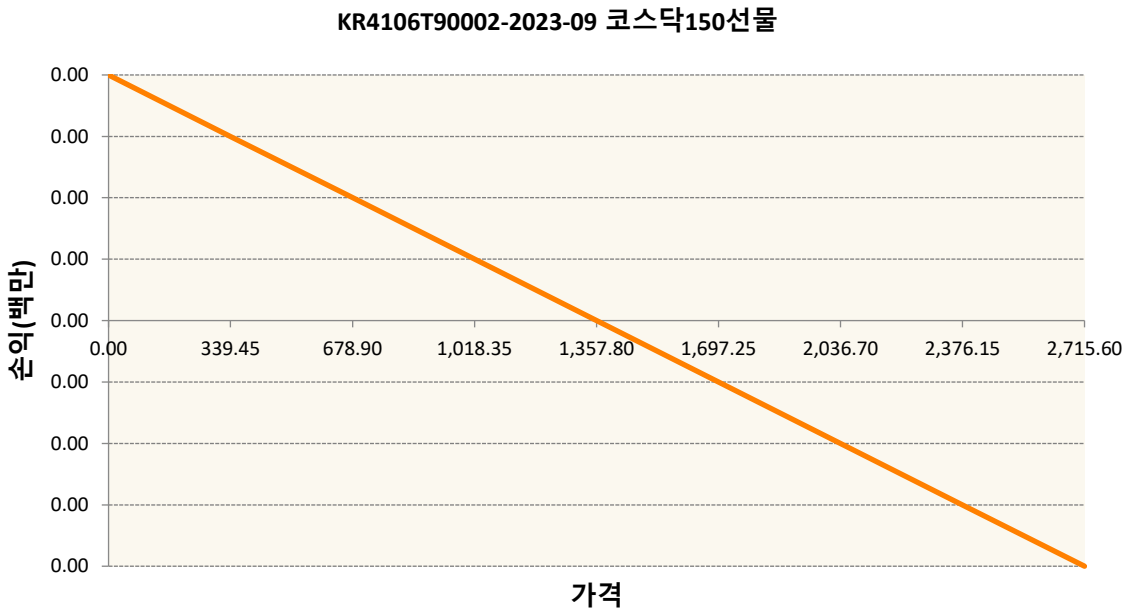
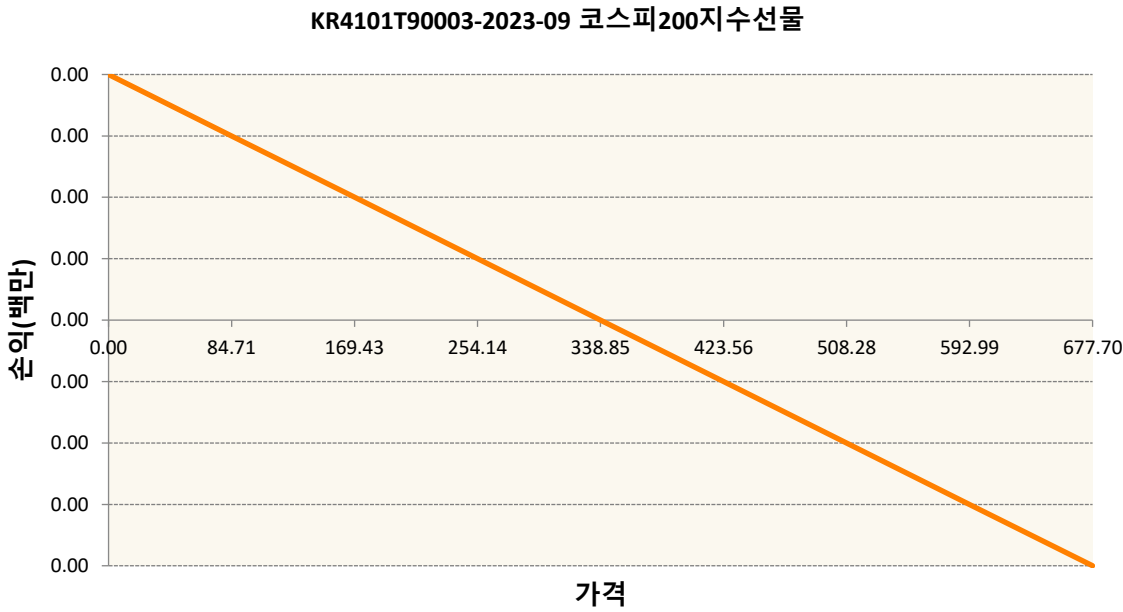
에쿼티알파일반사모혼합자산

1. 계약금액

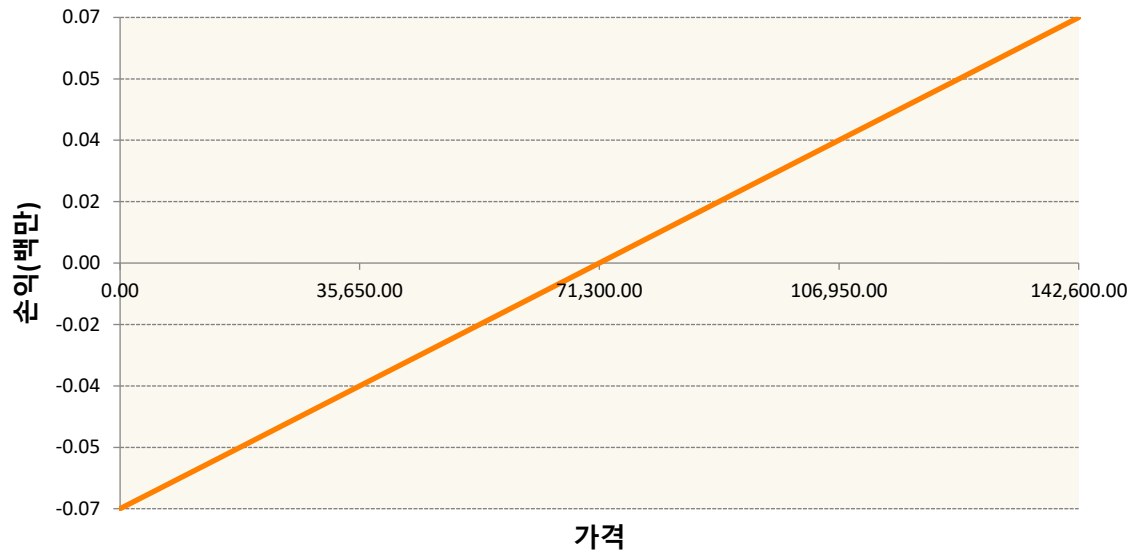
(단위:백만원)

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	20	2,574	-2,554	장내
누계	유가증권	스왑	0	0	0	장외

2. 만기시점의 손익구조



KR4111T70004-2023-07 삼성전자개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101T900 2023-09 코스피200지수선물	129
KR4106T900 2023-09 코스닥150선물	77
KR4111T700 2023-07 삼성전자개별선물	2
KRS0004212 SWAP_SPDR S&P BIOTECH_0413	1
KRS0004404 SWAP_PRSH ST FTRS ETF_0629	0.07

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

(단위:백만원)

333

공시일	2023-07-12
기준일	2023-07-11

코리아인덱스(주식-파생형)(종)

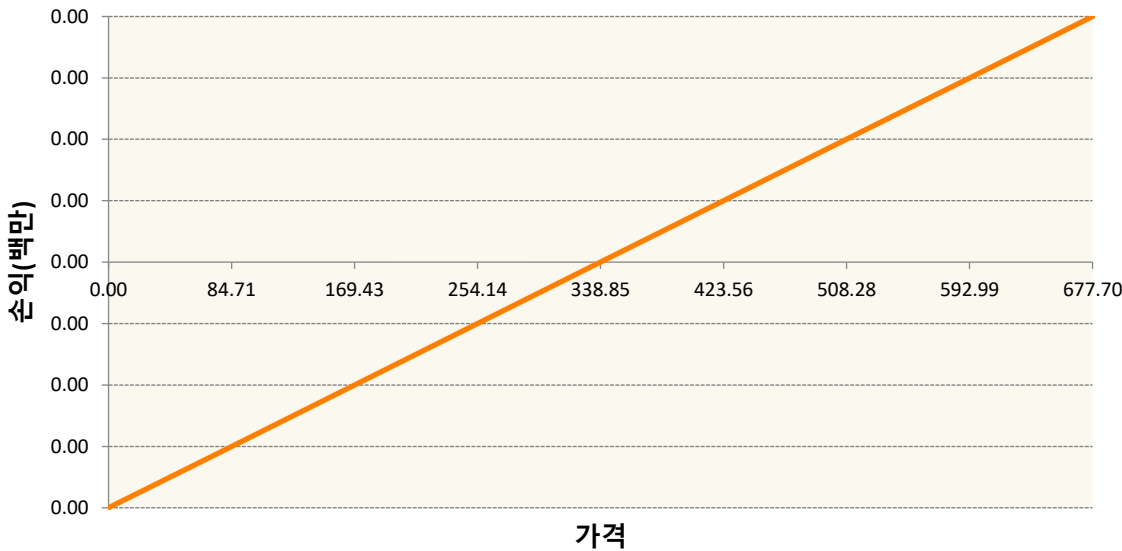
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,457	0	2,457	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101T90003-2023-09 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101T90003		2023-09 코스피200지수선물					195
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-195	-195	-195	-195	-195	-195	-195
-5.33%	-130	-130	-130	-130	-130	-130	-130
-2.67%	-65	-65	-65	-65	-65	-65	-65
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	65	65	65	65	65	65	65
5.33%	130	130	130	130	130	130	130
8.00%	195	195	195	195	195	195	195

공시일	2023-07-12
기준일	2023-07-11

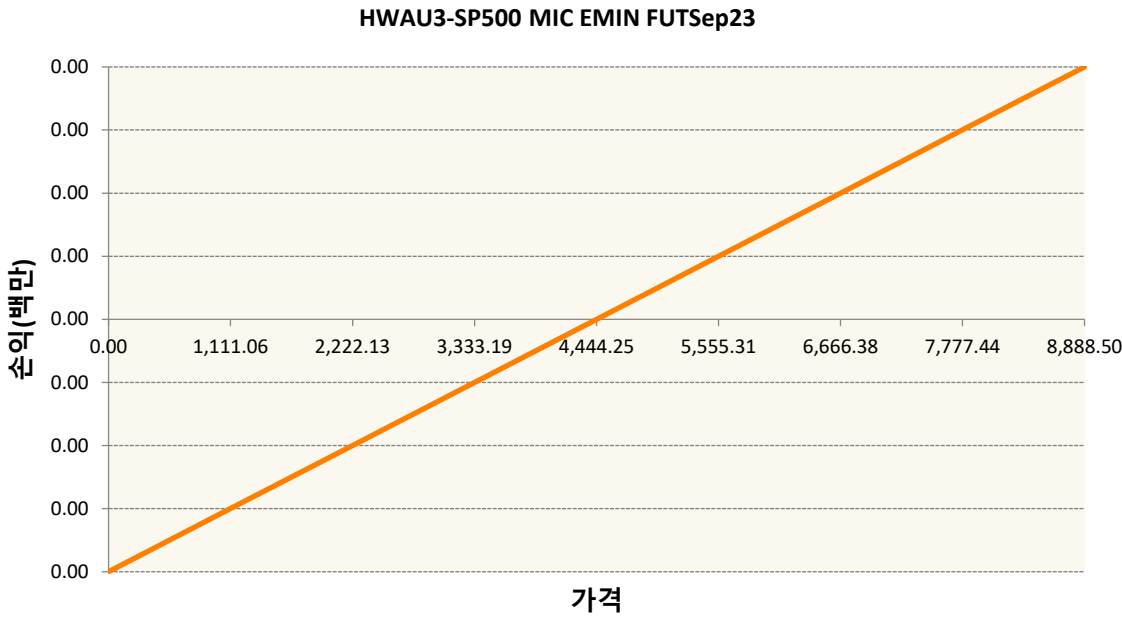
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

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	911	0	911	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HWAU3	SP500 MIC EMIN FUTSep23	73
-------	-------------------------	----

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

(단위:백만원)

116

공시일	2023-07-12
기준일	2023-07-11

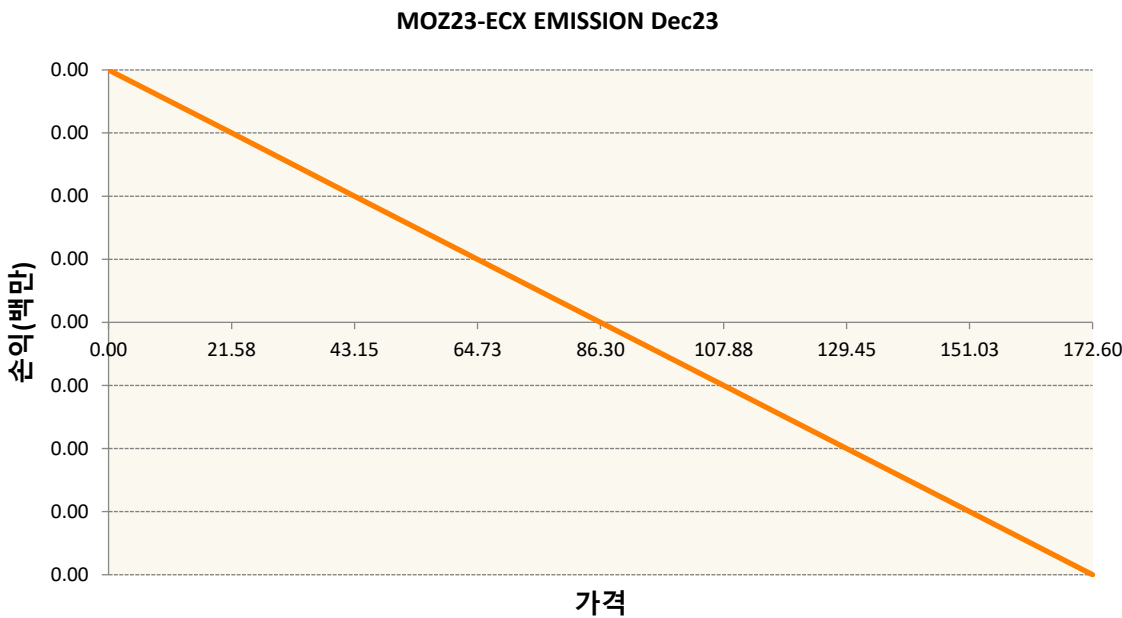
SOL유럽탄소배출권선물인버스ICE특별자산상

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	9,014	-9,014	
누계	통화	선도	22	2,122	-2,100	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	721

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

(단위:백만원)

1,288

공시일	2023-07-12
기준일	2023-07-11

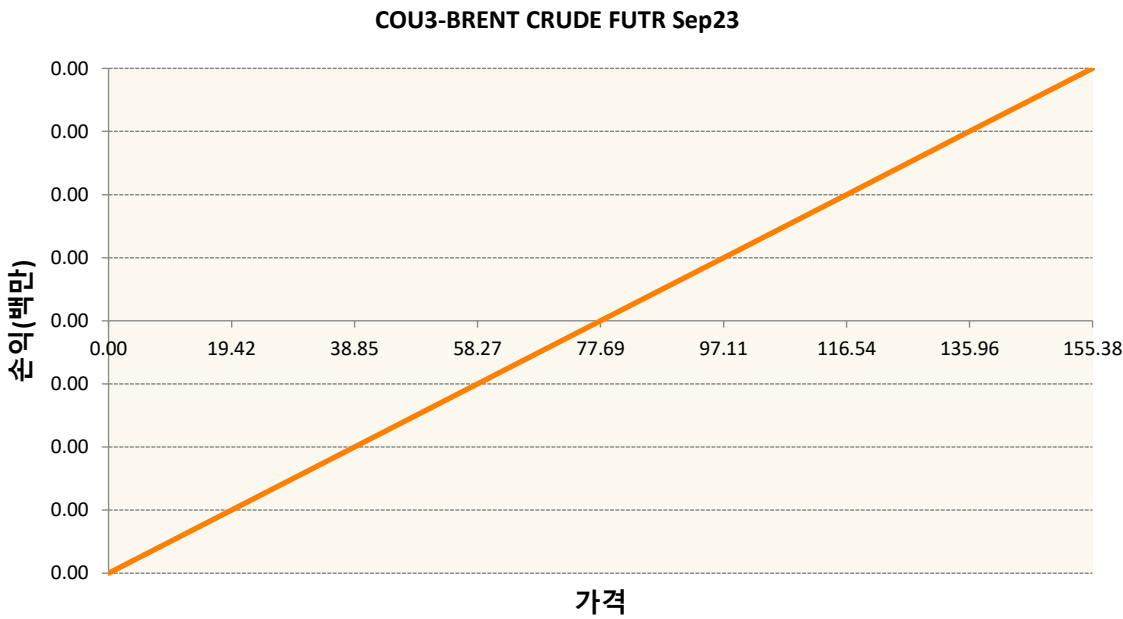
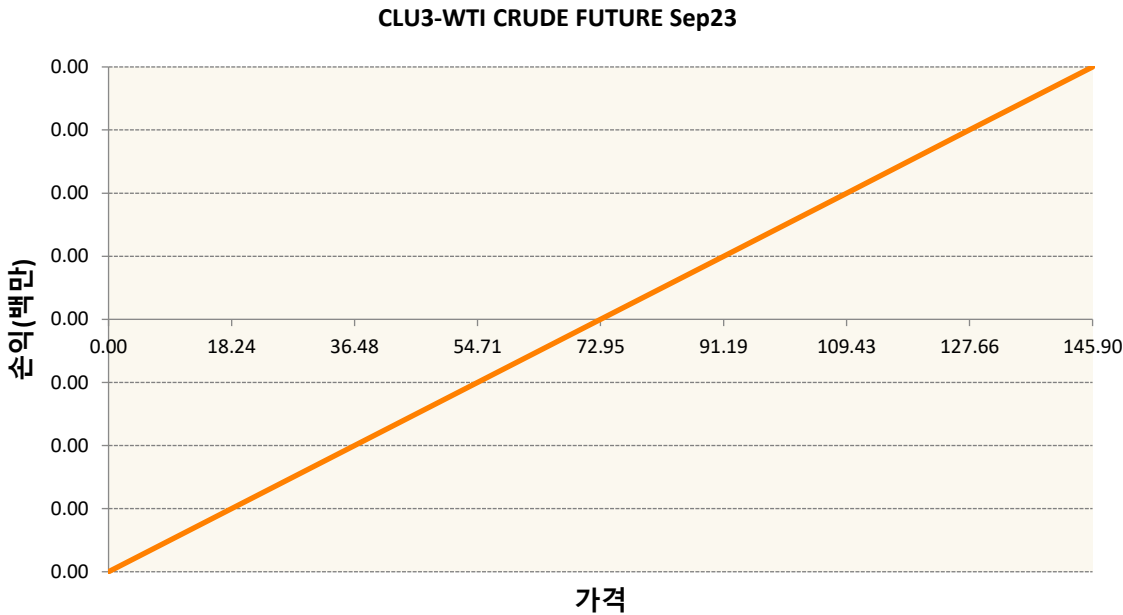
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

1. 계약금액

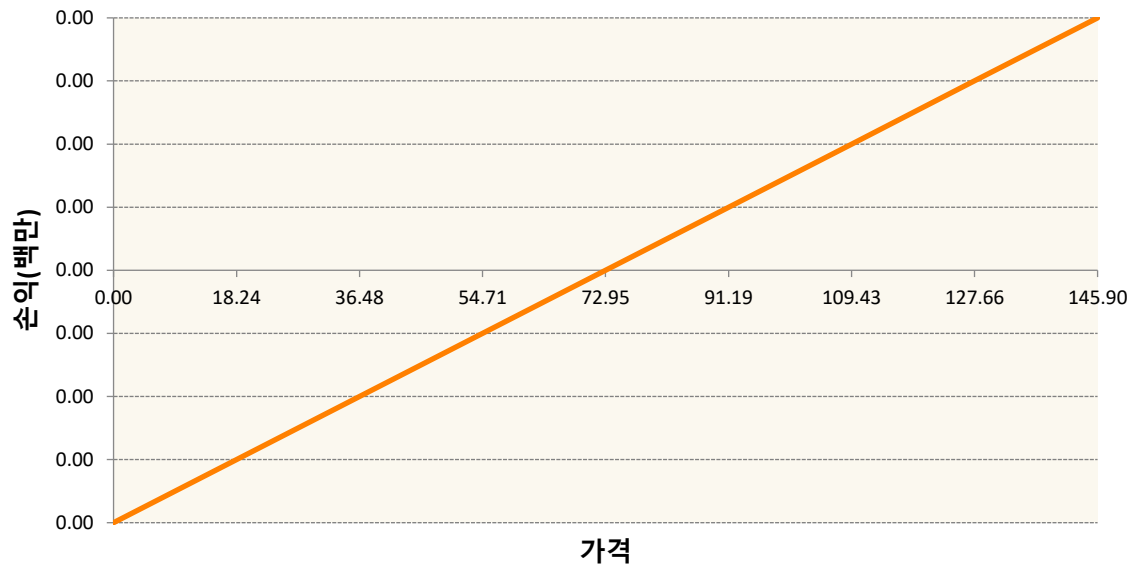
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,312	194	1,118	

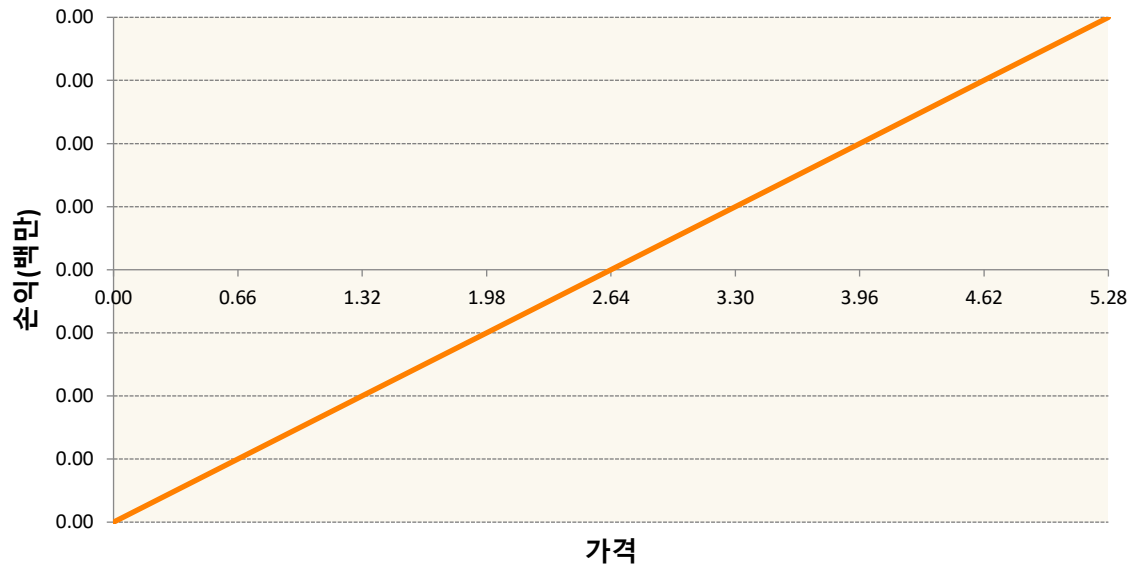
2. 만기시점의 손익구조



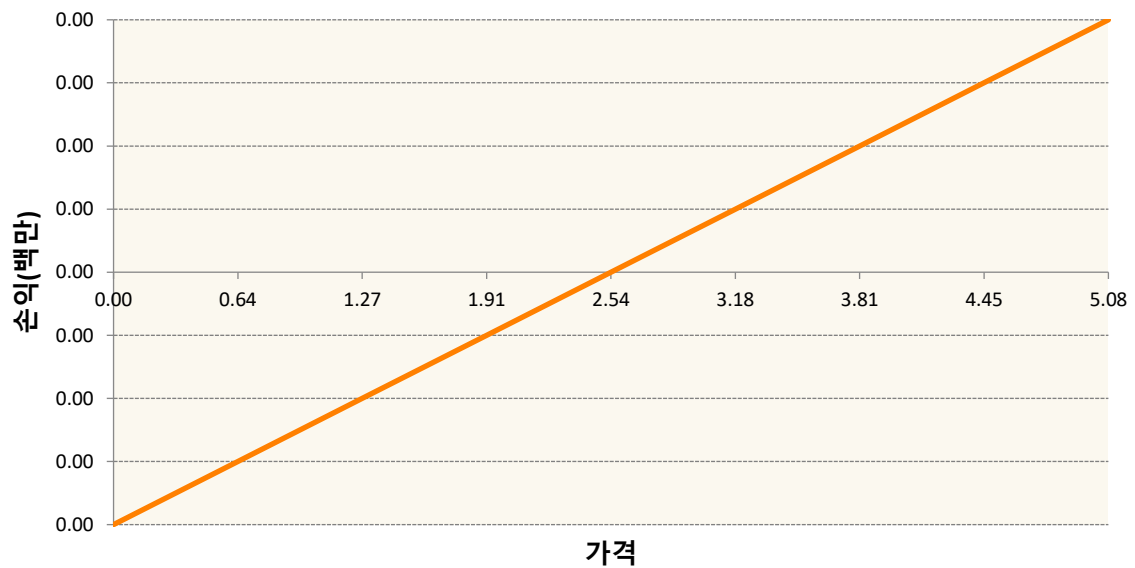
ECU3-E-mini Crude Oil Sep23



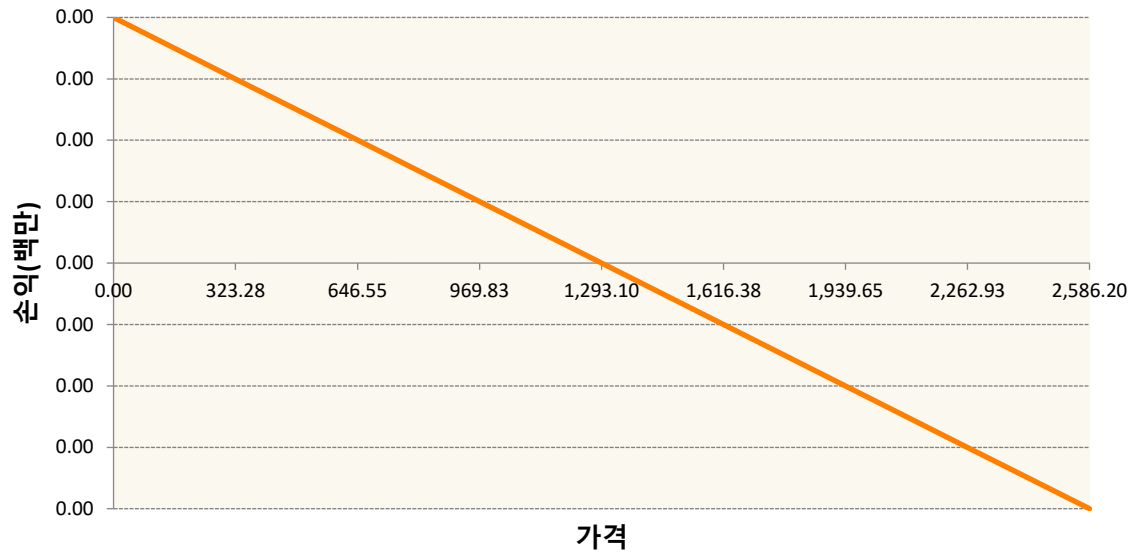
EOU3-E-MINI NATURAL GAS Sep23



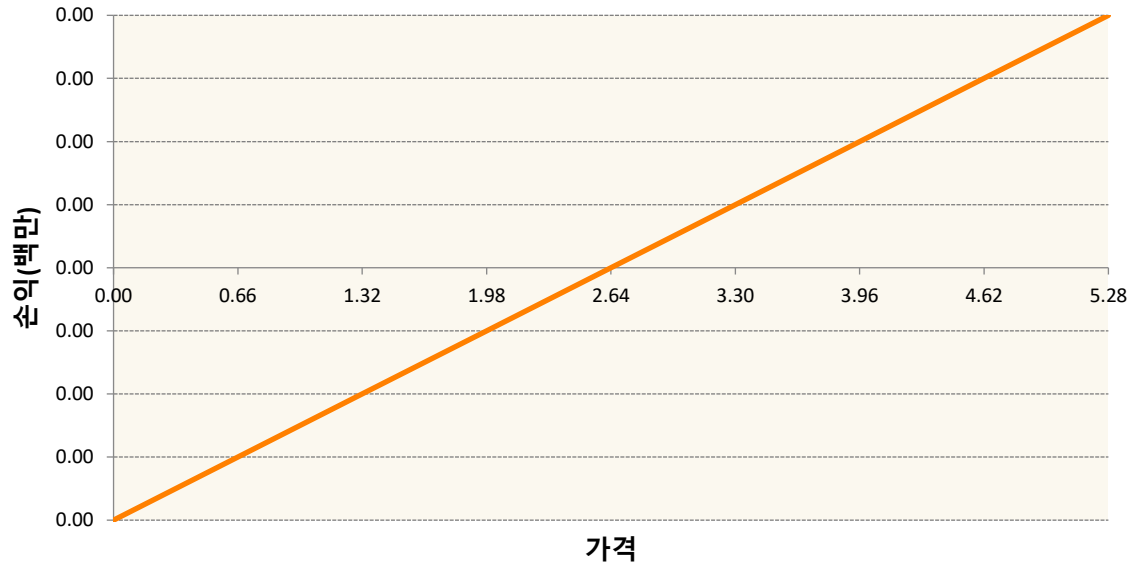
HOU3-NY Harb ULSD Fut Sep23



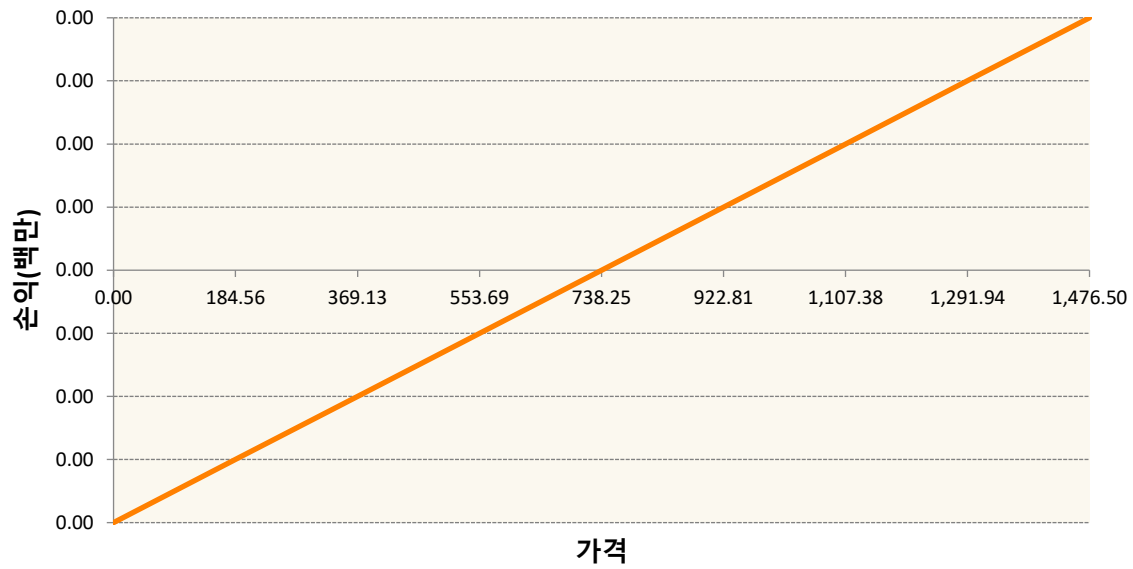
KR4175T70009-2023-07 달러선물

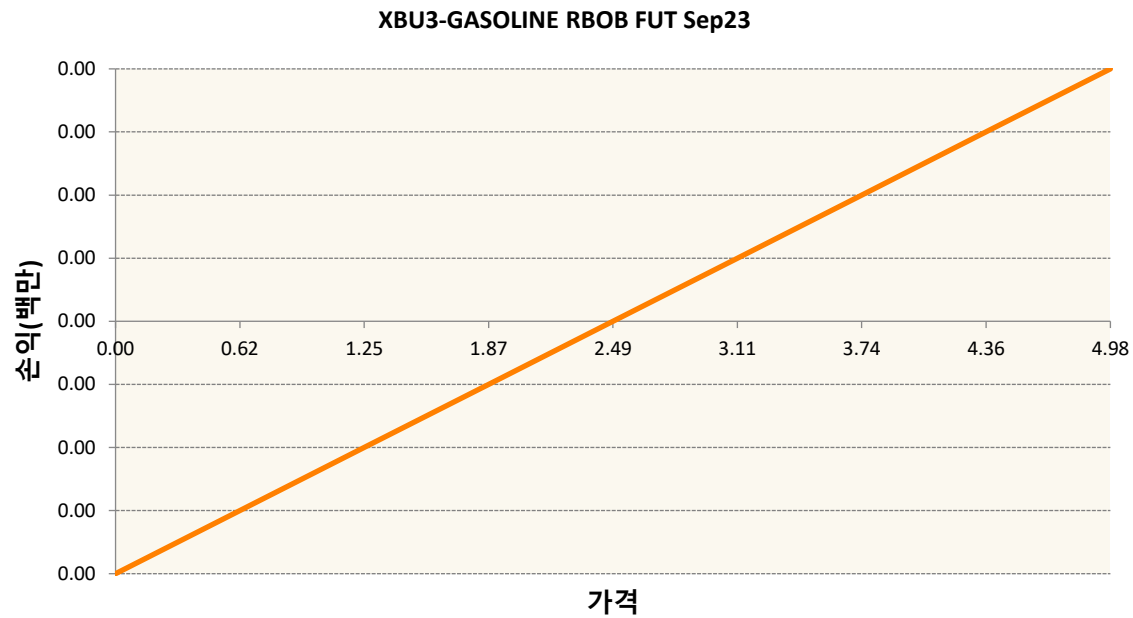


NGU23-NATURAL GAS FUTR Sep23



QSU3-Low Su Gasoil G Sep23





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
CLU3	WTI CRUDE FUTURE Sep23	23
COU3	BRENT CRUDE FUTR Sep23	25
ECU3	E-mini Crude Oil Sep23	4
EOU3	E-MINI NATURAL GAS Sep23	3
HOU3	NY Harb ULSD Fut Sep23	11
KR4175T700	2023-07 달러선물	16
NGU23	NATURAL GAS FUTR Sep23	22
QSU3	Low Su Gasoil G Sep23	8
XBU3	GASOLINE RBOB FUT Sep23	11

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	192