

공시일	2023-07-14
기준일	2023-07-13

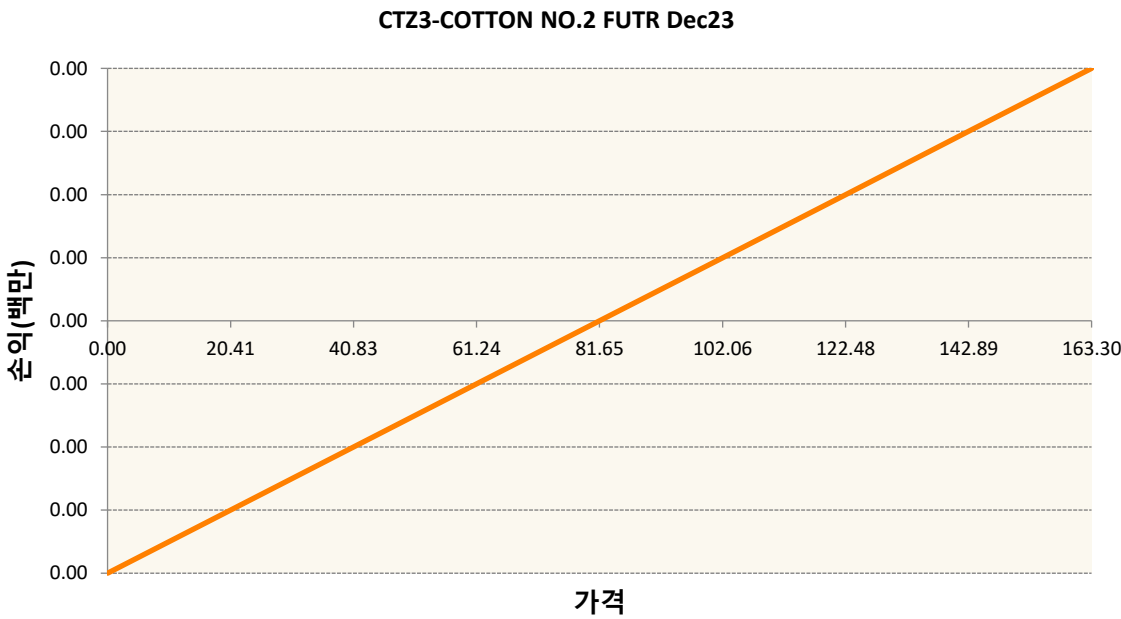
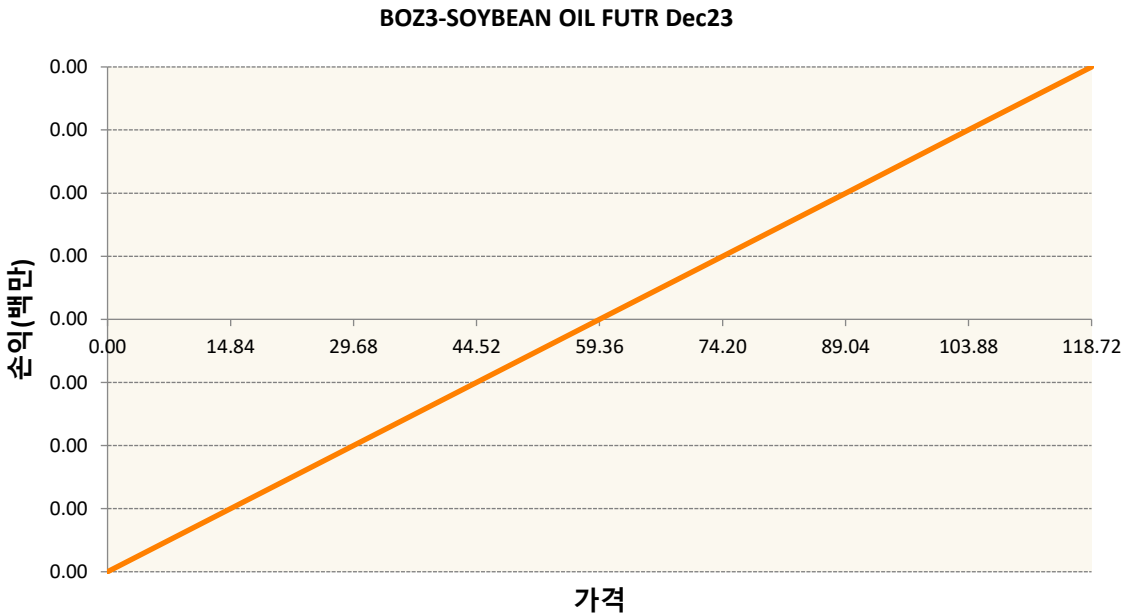
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

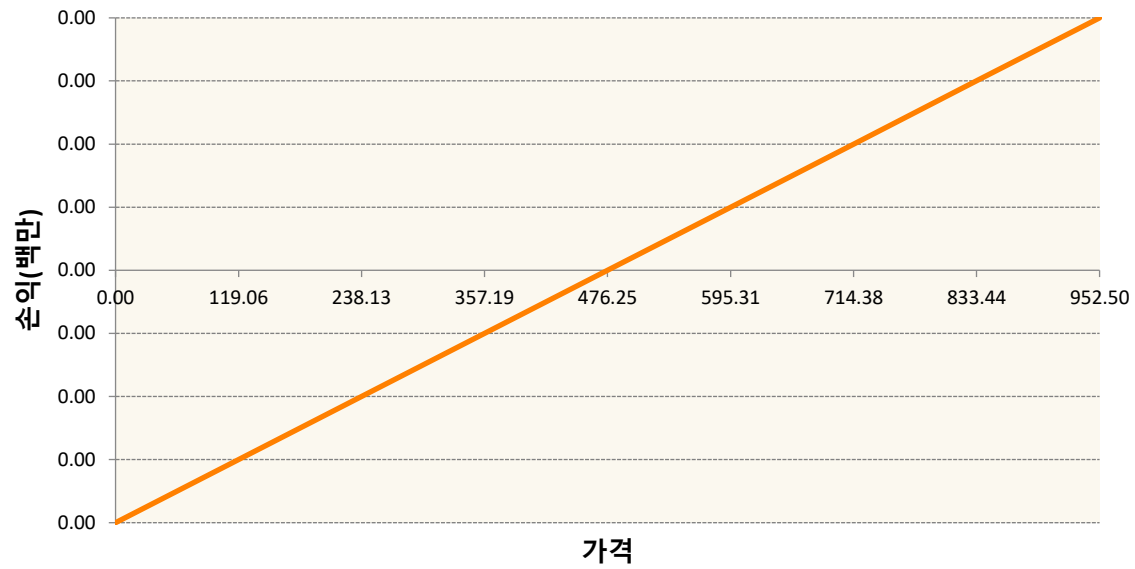
(단위:USD 백만)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,128	445	4,683	

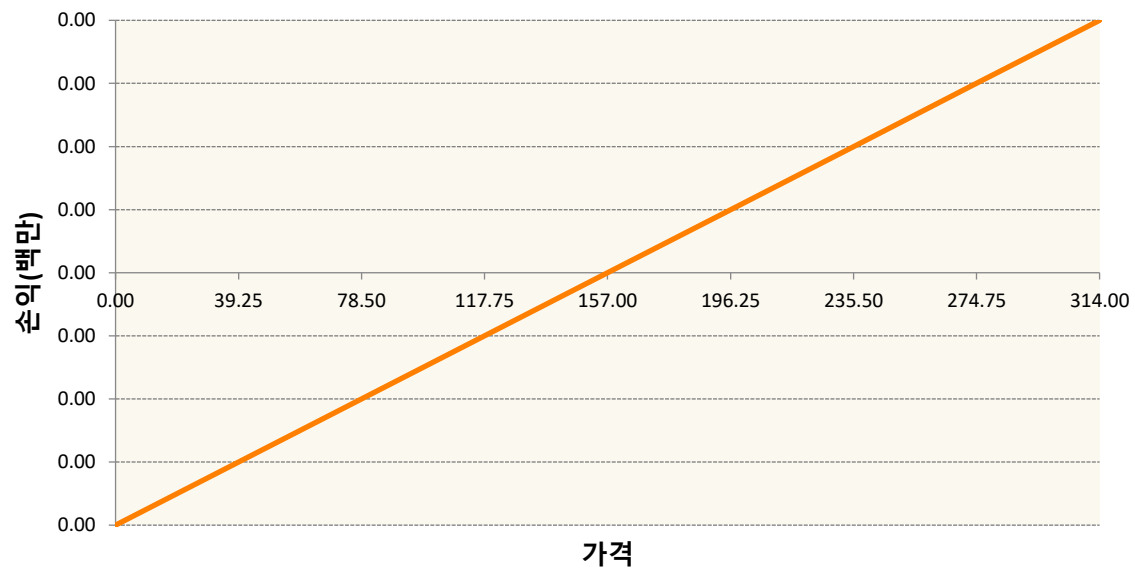
2. 만기시점의 손익구조



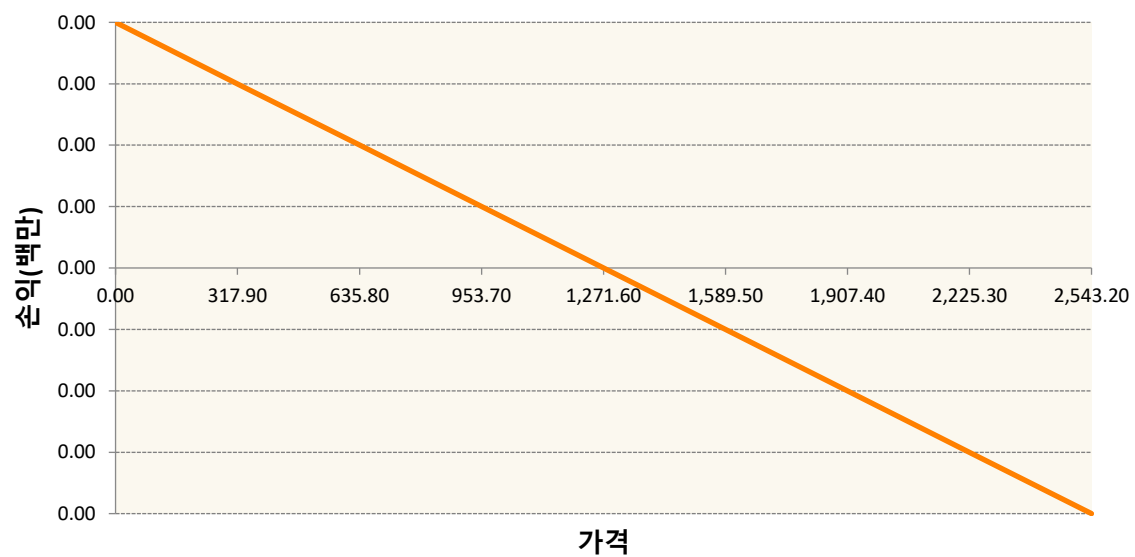
CU3-CORN FUTURE Sep23



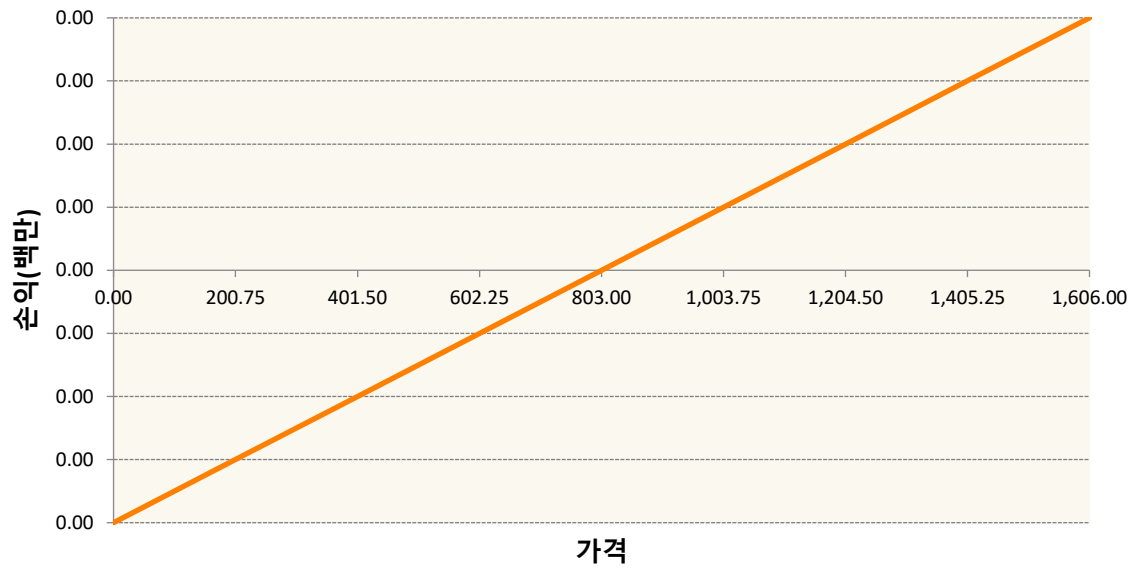
KCU3-COFFEE 'C' FUTURE Sep23



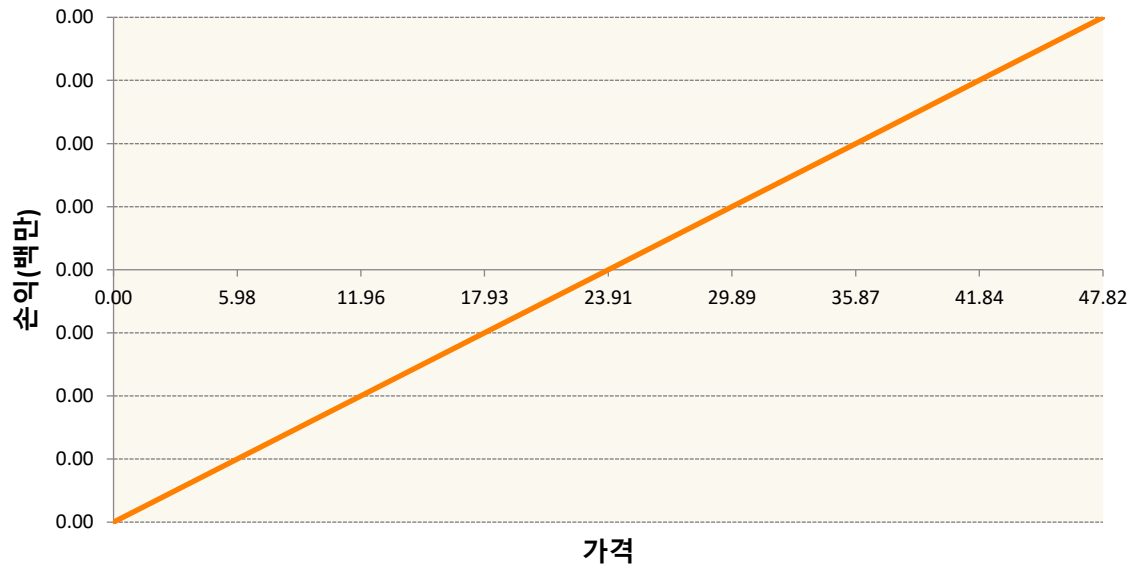
KR4175T80008-2023-08 달러선물



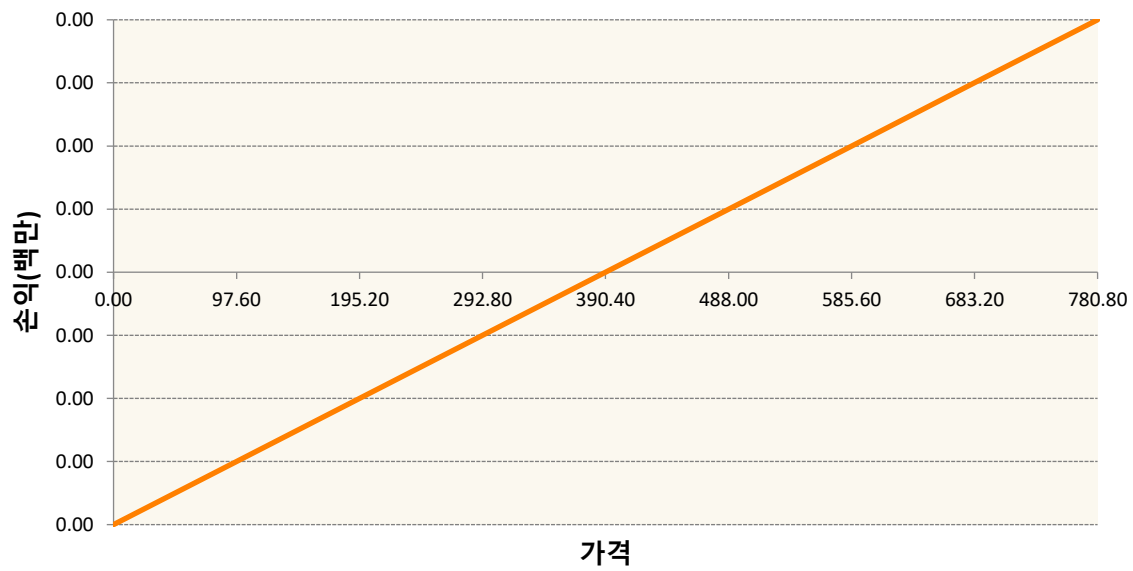
KWU3-KC HRW WHEAT FUT Sep23

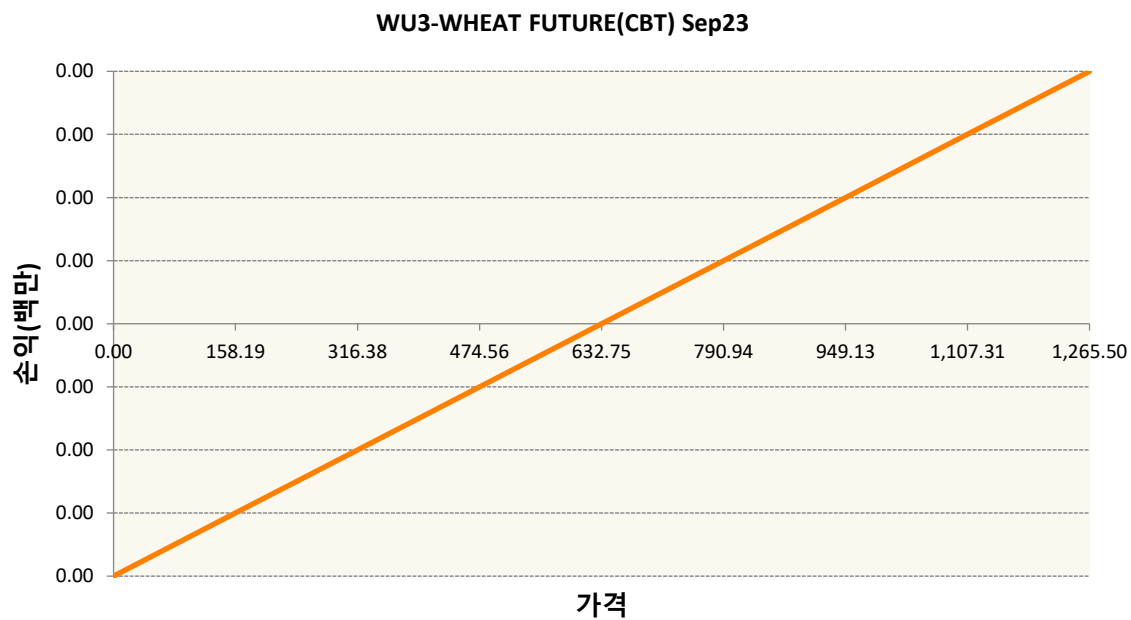
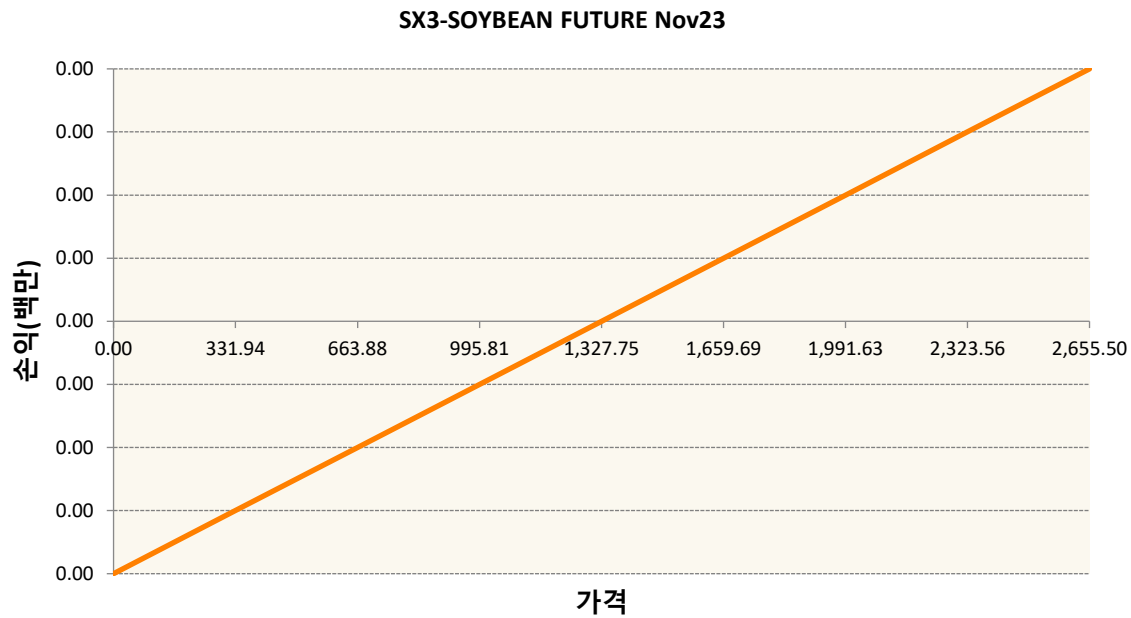


SBV3-Sugar #11 (WORLD) Oct23



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	2023-07-14
기준일	2023-07-13

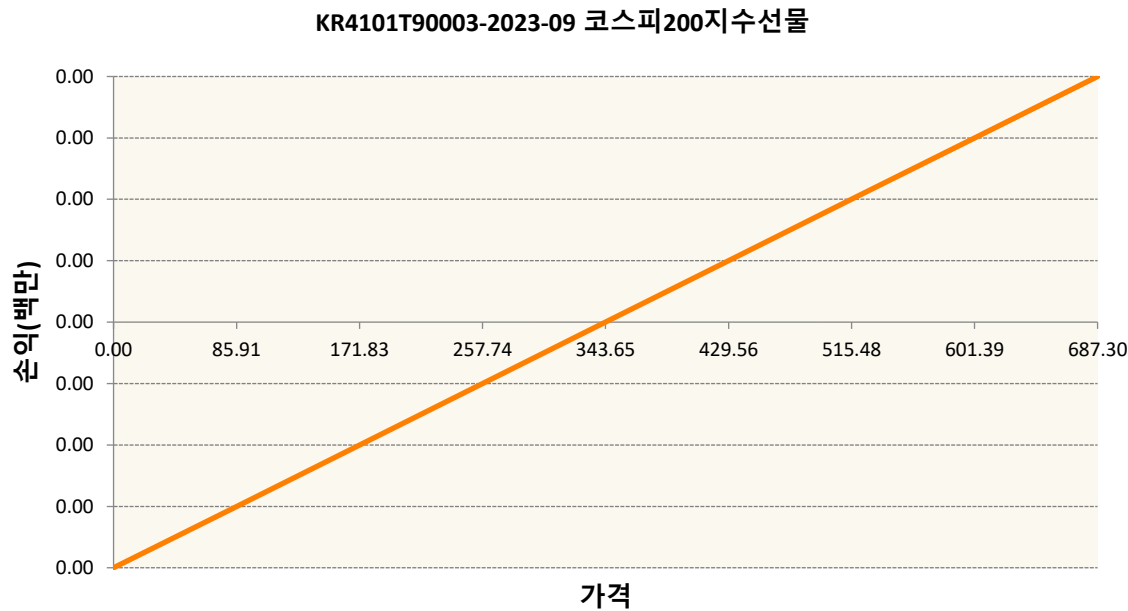
스마트인덱스모

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	602	0	602	장내
누계	유가증권	선물	1,117	0	1,117	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101T90003			2023-09 코스피200지수선물				89
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-89	-89	-89	-89	-89	-89	-89
-5.33%	-59	-59	-59	-59	-59	-59	-59
-2.67%	-30	-30	-30	-30	-30	-30	-30
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	30	30	30	30	30	30	30
5.33%	59	59	59	59	59	59	59
8.00%	89	89	89	89	89	89	89

공시일	2023-07-14
기준일	2023-07-13

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	337
-----------------------------	-----

* 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	2023-07-14
기준일	2023-07-13

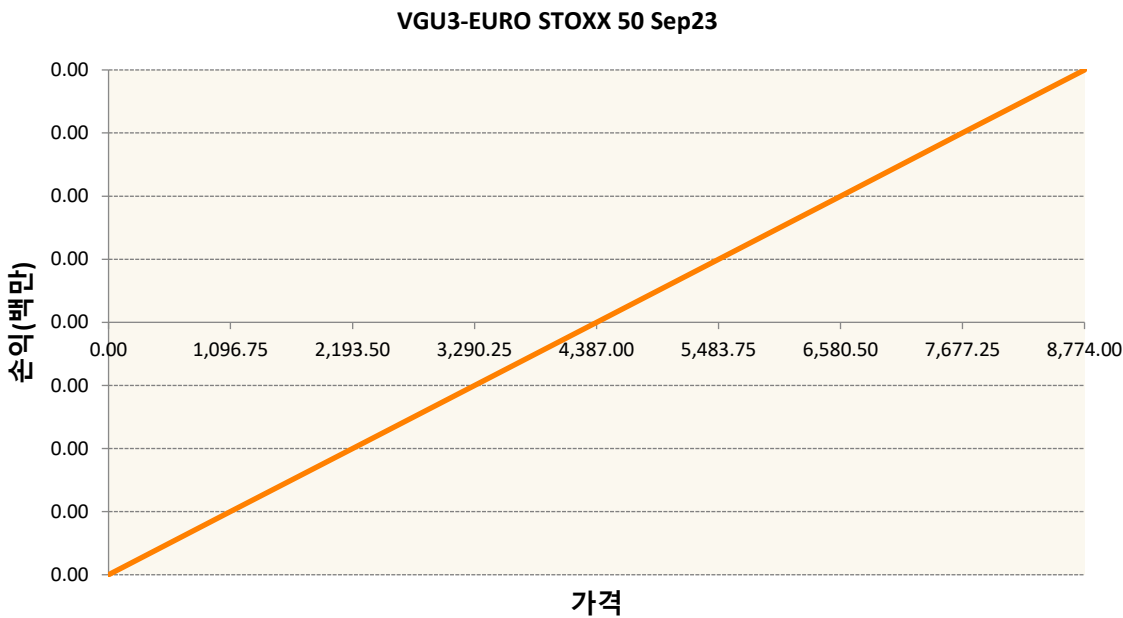
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	424	0	424	

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	2023-07-14
기준일	2023-07-13

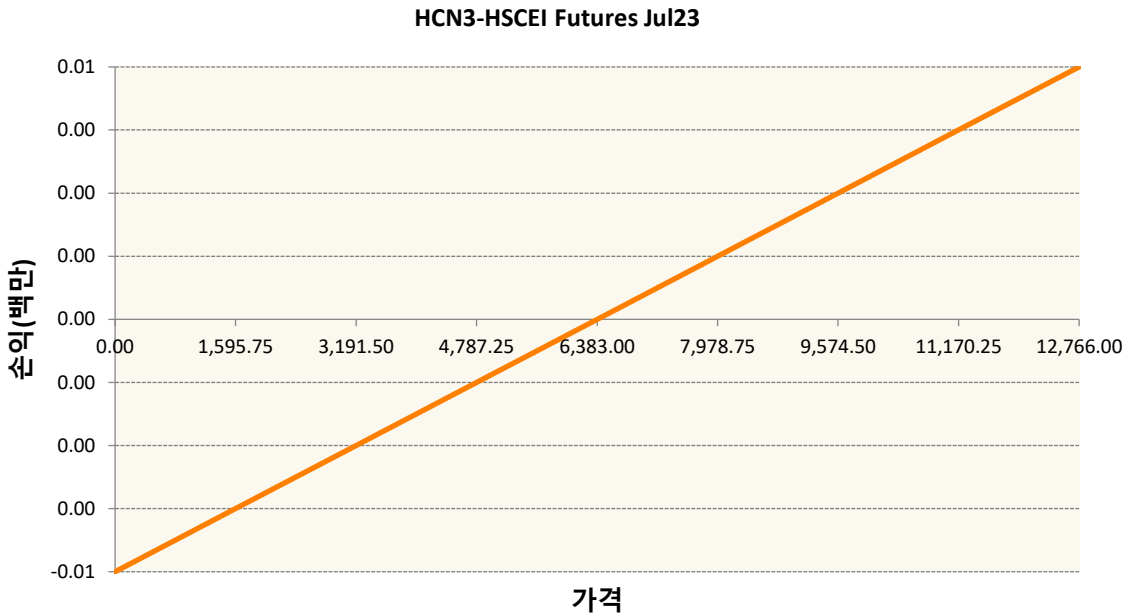
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,171	0	1,171	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCN3	HSCEI Futures Jul23	94
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

149

공시일	2023-07-14
기준일	2023-07-13

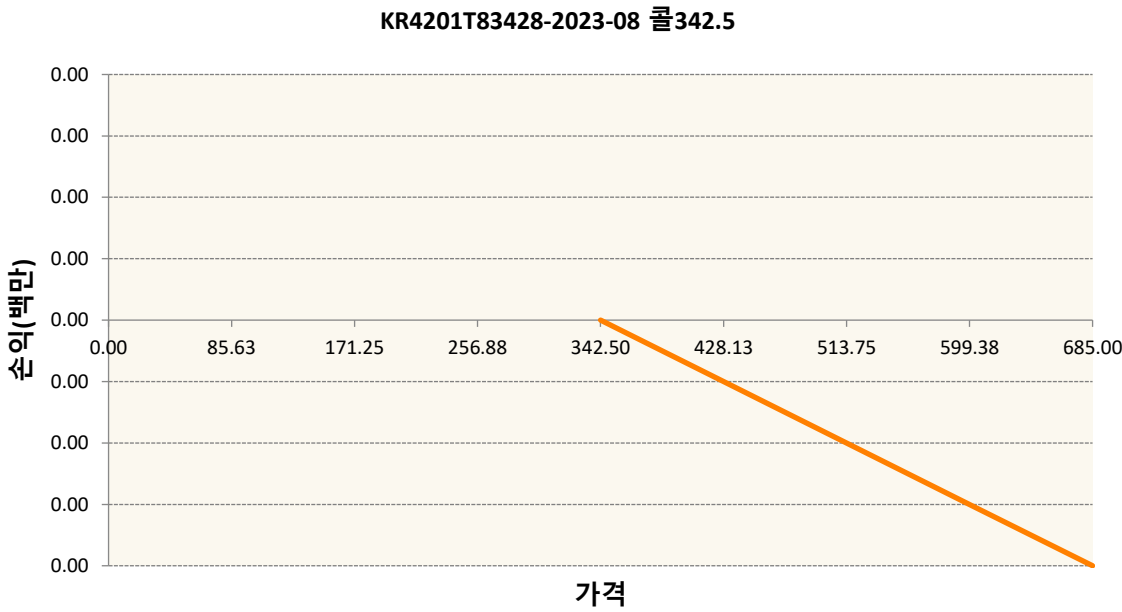
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	36,494	-36,494	장내
누계	유가증권	옵션	0	35,963	-35,963	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201T83428			2023-08 콜342.5				2,187
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	807	792	773	749	721	689	654
-5.33%	745	710	670	627	580	530	477
-2.67%	573	514	452	389	325	259	193
0%	218	145	73	0	-73	-146	-218
2.67%	-351	-417	-484	-552	-621	-691	-761
5.33%	-1,105	-1,149	-1,198	-1,251	-1,306	-1,364	-1,424
8.00%	-1,974	-1,997	-2,026	-2,060	-2,099	-2,141	-2,187

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

(단위:백만원)

2,145

공시일	2023-07-14
기준일	2023-07-13

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	5,677	0	5,677	

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	2023-07-14
기준일	2023-07-13

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	4,593	0	4,593	

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	2023-07-14
기준일	2023-07-13

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	18,288	0	18,288	
누계	통화	선도	255	18,186	-17,932	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213D4S(KRW/USD 31-07-23E	253
FXW213D5S(KRW/USD 31-08-23E	667
FXW213D6S(KRW/USD 27-09-23E	535
FXW213D6V(USD/KRW 31-07-23E	20
IE00BD8RGM75	

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

3,174

공시일	2023-07-14
기준일	2023-07-13

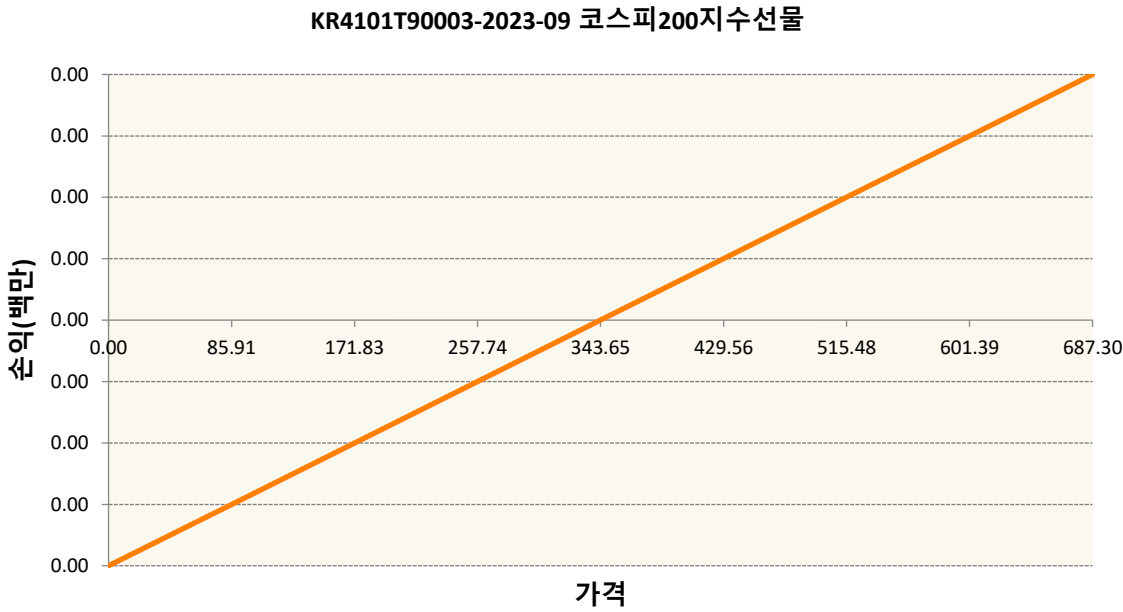
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	258	0	258	장내
누계	유가증권	선물	859	0	859	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101T90003			2023-09 코스피200지수선물				68
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-68	-68	-68	-68	-68	-68	-68
-5.33%	-45	-45	-45	-45	-45	-45	-45
-2.67%	-23	-23	-23	-23	-23	-23	-23
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	23	23	23	23	23	23	23
5.33%	45	45	45	45	45	45	45
8.00%	68	68	68	68	68	68	68

공시일	2023-07-14
기준일	2023-07-13

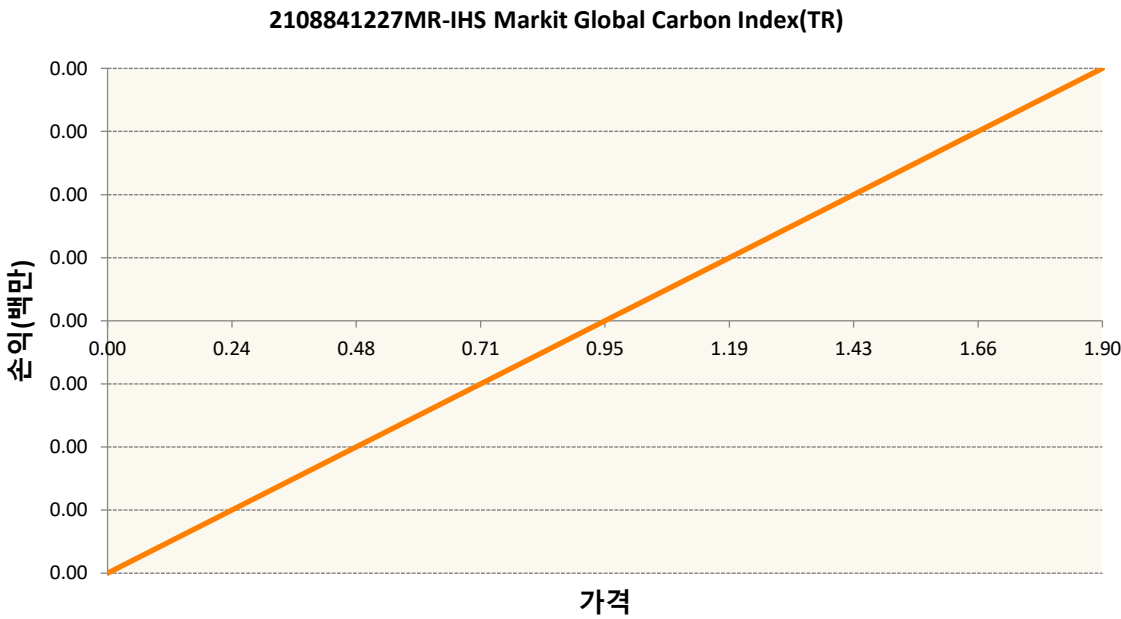
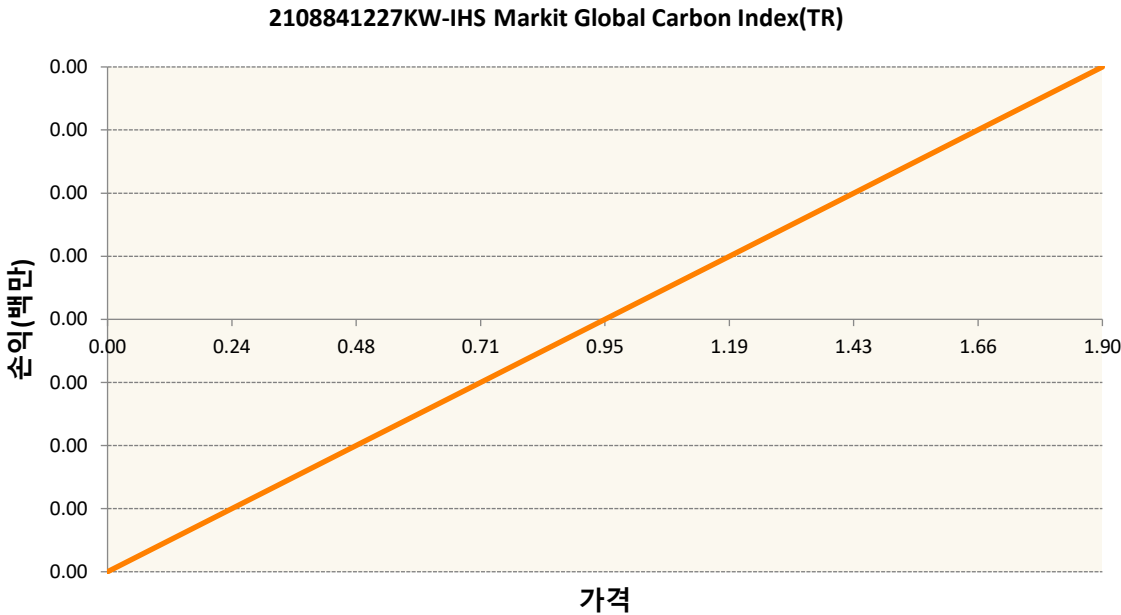
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

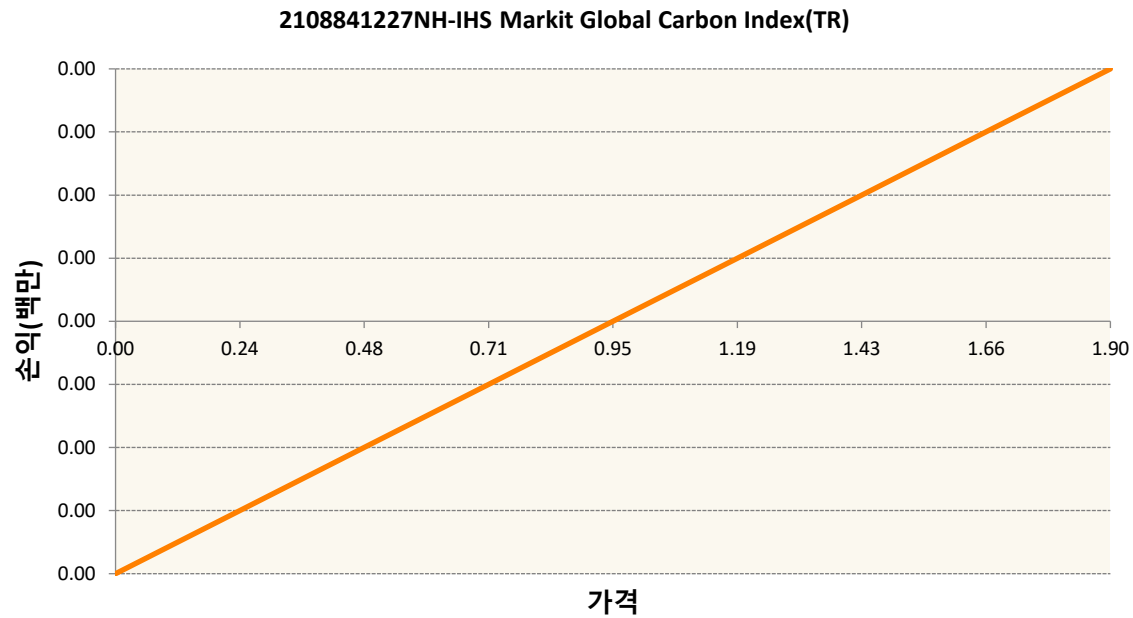
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	24,959	0	24,959	

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108841227IHS Markit Global Carbon Index(TR)		1,700
2108841227IHS Markit Global Carbon Index(TR)		200
2108841227IHS Markit Global Carbon Index(TR)		100

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)		(단위:백만원)
		3,187

공시일 2023-07-14

기준일 2023-07-13

SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

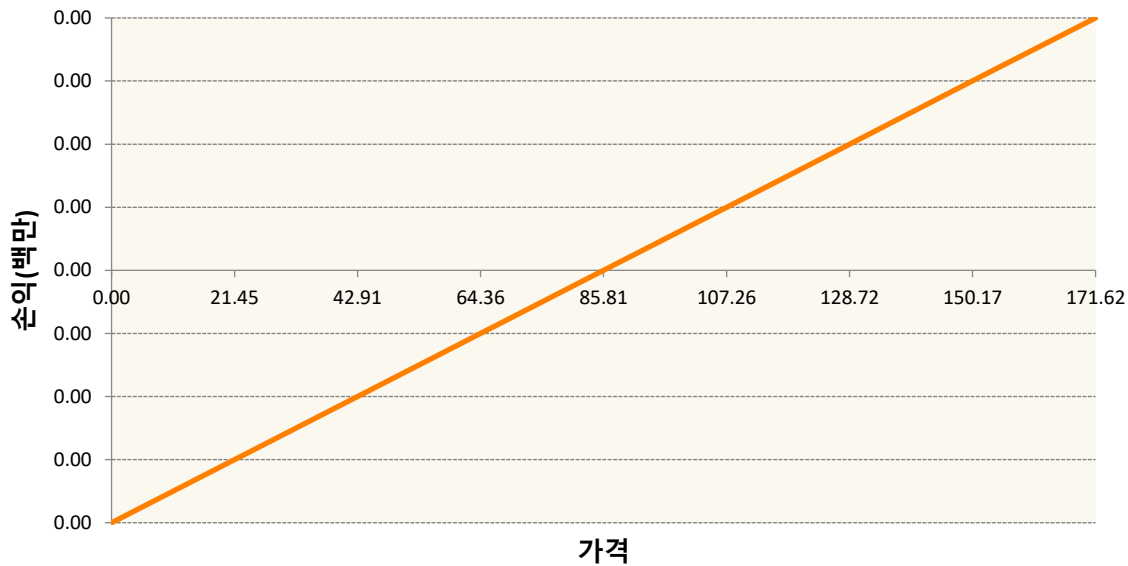
1. 계약금액

(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	8,673	0	8,673	
누계	통화	선도	0	2,291	-2,291	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	694

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

(단위:백만원)

1,251

공시일	2023-07-14
기준일	2023-07-13

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)	0.44
SWCSI00000 신한CSI Index 230622 (키움)	0.44
SWCSI00000 신한CSI Index 230622 (미래)	0.44
SWCSI00000 신한CSI Index 230622 (메리츠)	0.44

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

(단위:백만원)

3

공시일	2023-07-14
기준일	2023-07-13

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)	9
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 230116(메리츠)	12
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 230116(미래)	10
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 230427(키움)	3

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

(단위:백만원)

54

공시일	2023-07-14
기준일	2023-07-13

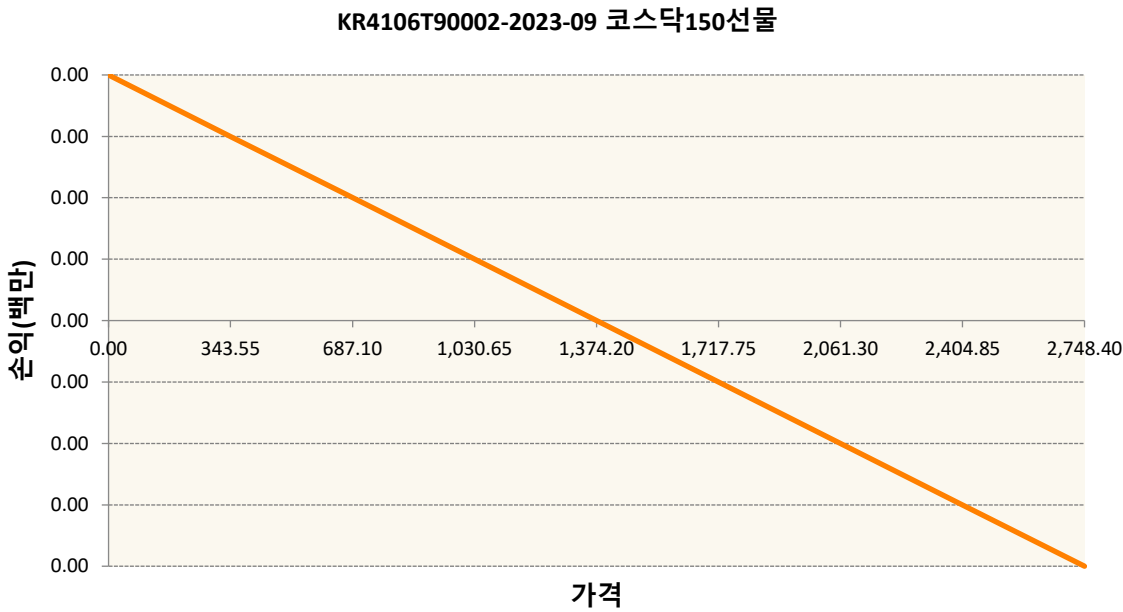
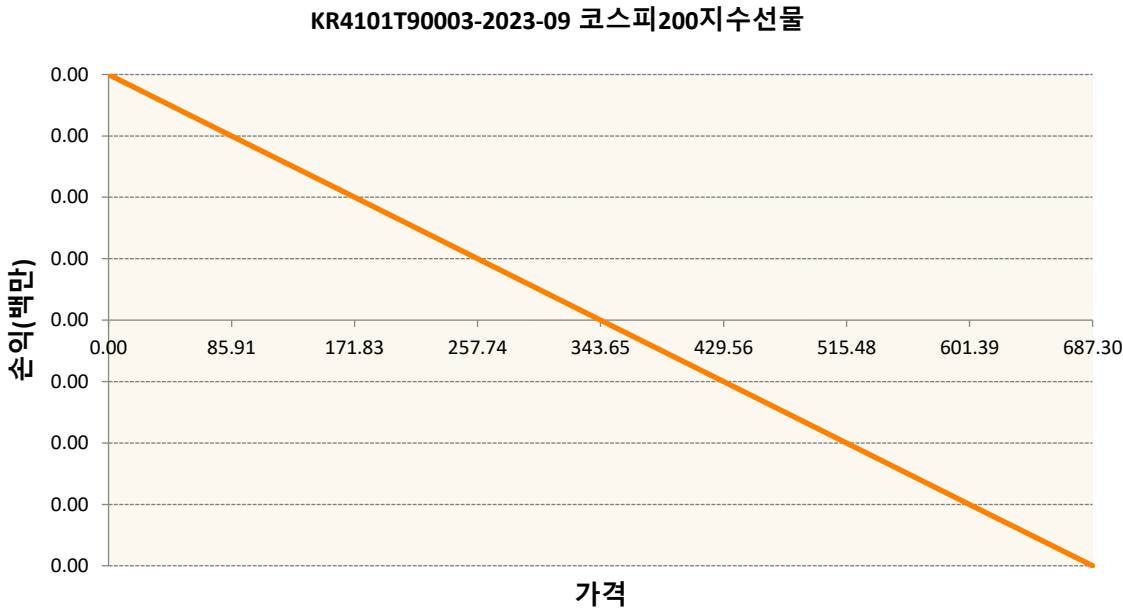
에쿼티알파일반사모혼합자산

1. 계약금액

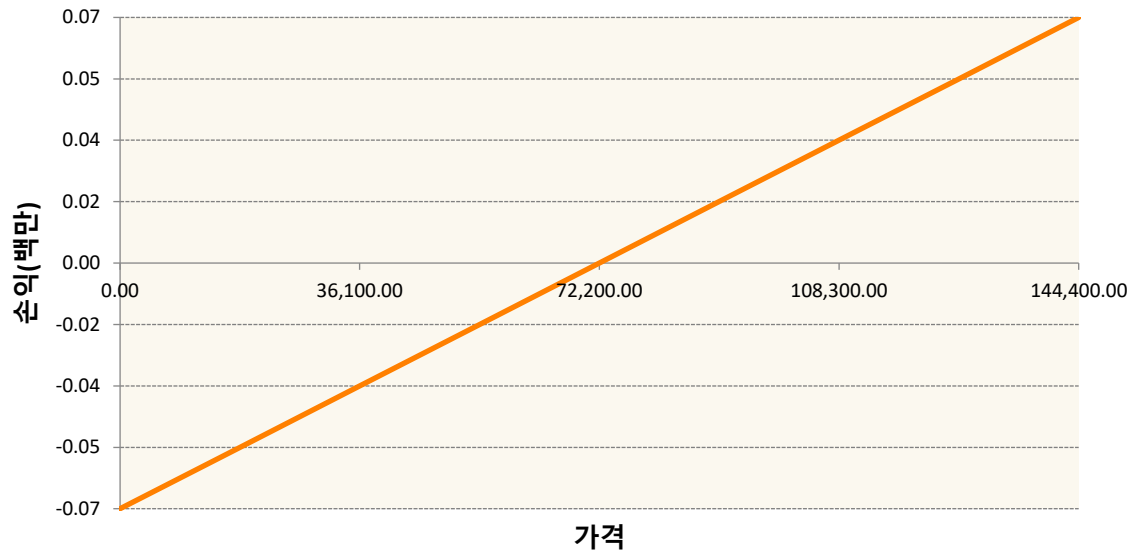
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	1,059	0	1,059	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	370	1,756	-1,386	장내
누계	유가증권	스왑	0	0	0	장외

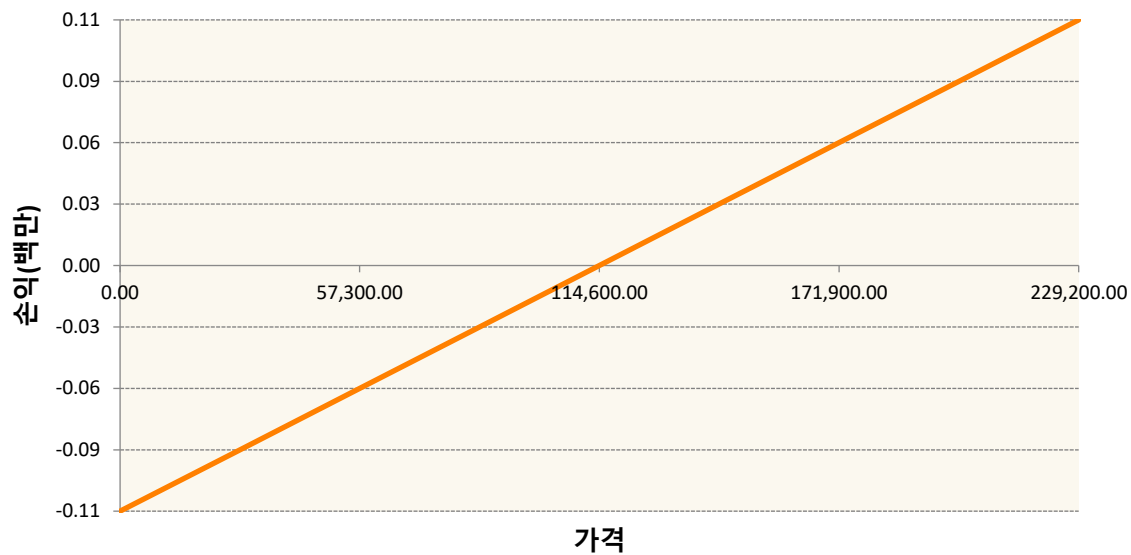
2. 만기시점의 손익구조



KR4111T80003-2023-08 삼성전자개별선물



KR4150T80001-2023-08 SK하이닉스개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101T900 2023-09 코스피200지수선물	76
KR4106T900 2023-09 코스닥150선물	65
KR4111T800 2023-08 삼성전자개별선물	2
KR4150T800 2023-08 SK하이닉스개별선물	28
KRS0004212 SWAP_SPDR S&P BIOTECH_0413	1
KRS0004404 SWAP_PRSH ST FTRS ETF_0629	0.44

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

(단위:백만원)

273

공시일	2023-07-14
기준일	2023-07-13

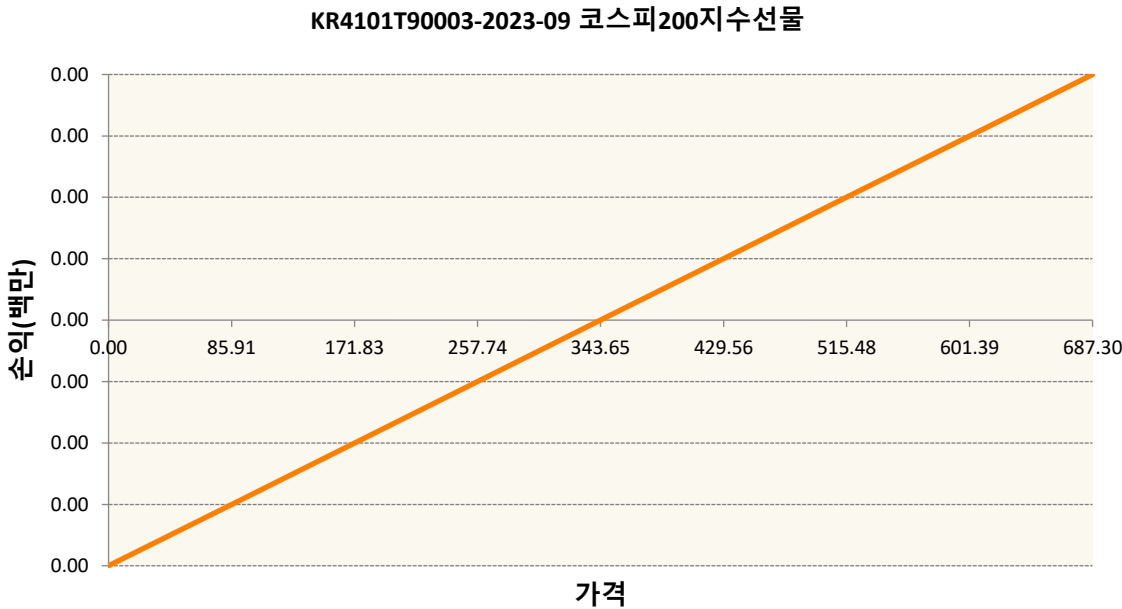
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

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	2,491	0	2,491	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101T90003				2023-09 코스피200지수선물			198
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-198	-198	-198	-198	-198	-198	-198
-5.33%	-132	-132	-132	-132	-132	-132	-132
-2.67%	-66	-66	-66	-66	-66	-66	-66
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	66	66	66	66	66	66	66
5.33%	132	132	132	132	132	132	132
8.00%	198	198	198	198	198	198	198

공시일	2023-07-14
기준일	2023-07-13

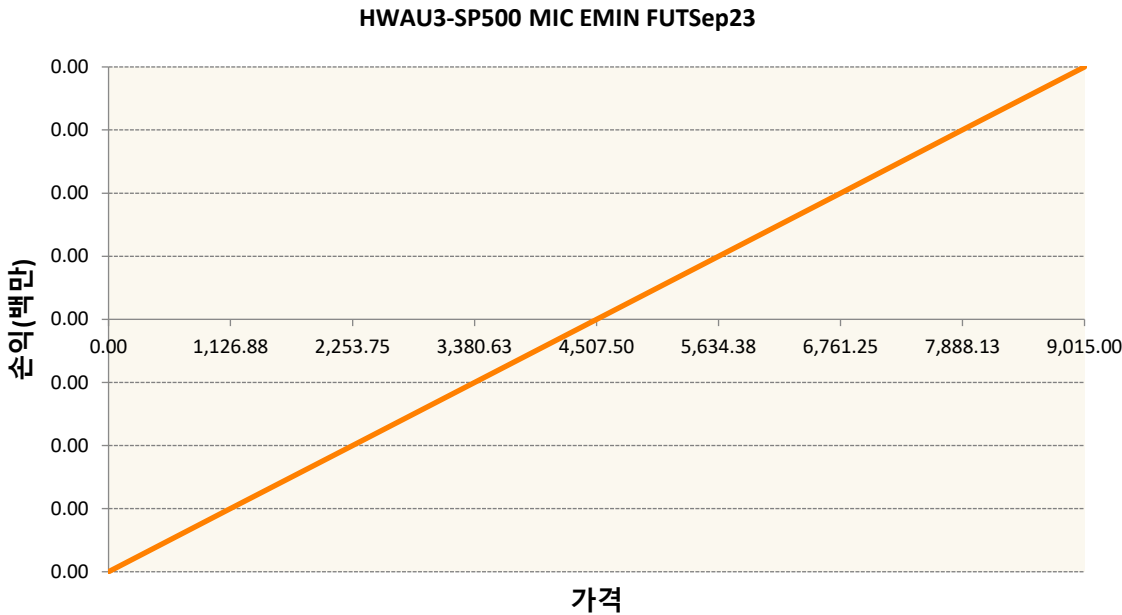
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

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	953	0	953	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HWAU3	SP500 MIC EMIN FUTSep23	76
-------	-------------------------	----

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

(단위:백만원)

122

공시일	2023-07-14
기준일	2023-07-13

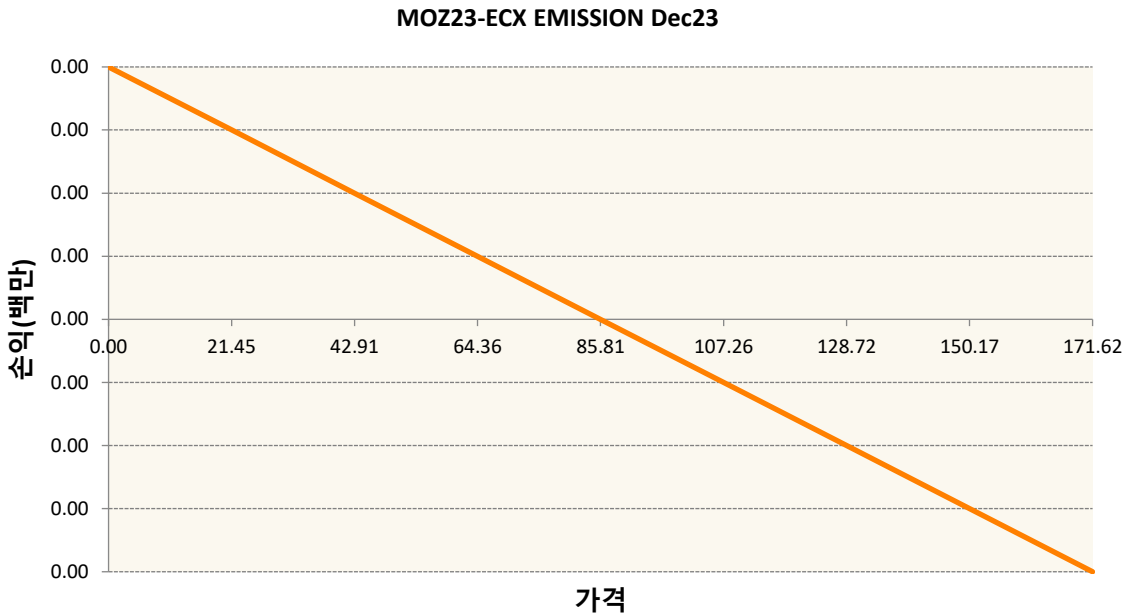
SOL유럽탄소배출권선물인버스ICE특별자산상

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	9,059	-9,059	
누계	통화	선도	22	2,113	-2,091	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	725

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

(단위:백만원)

1,290

공시일	2023-07-14
기준일	2023-07-13

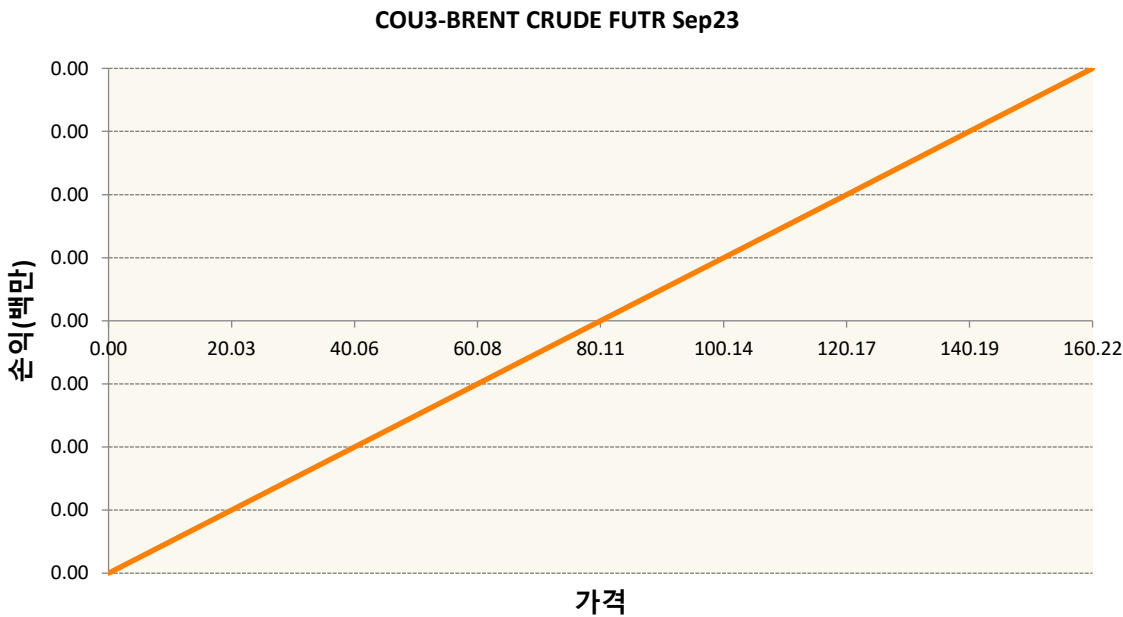
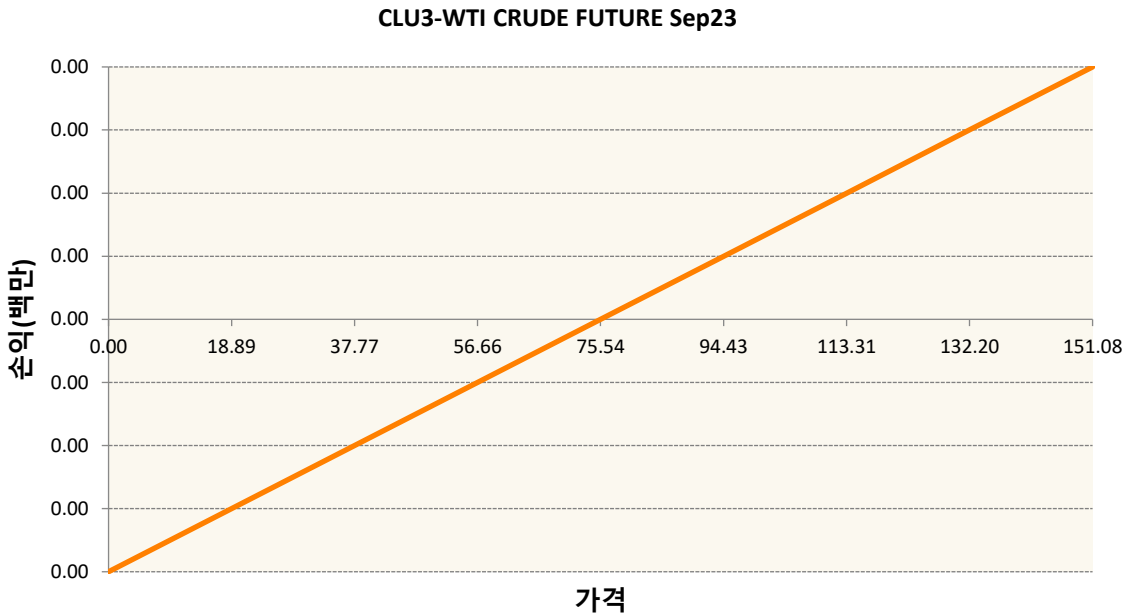
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

1. 계약금액

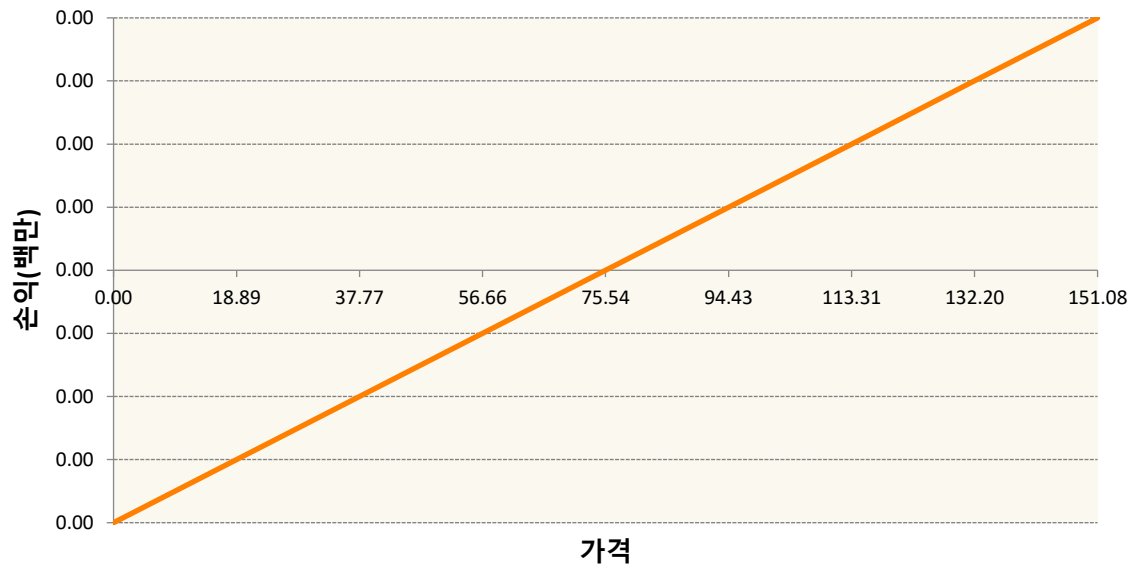
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,344	191	1,153	

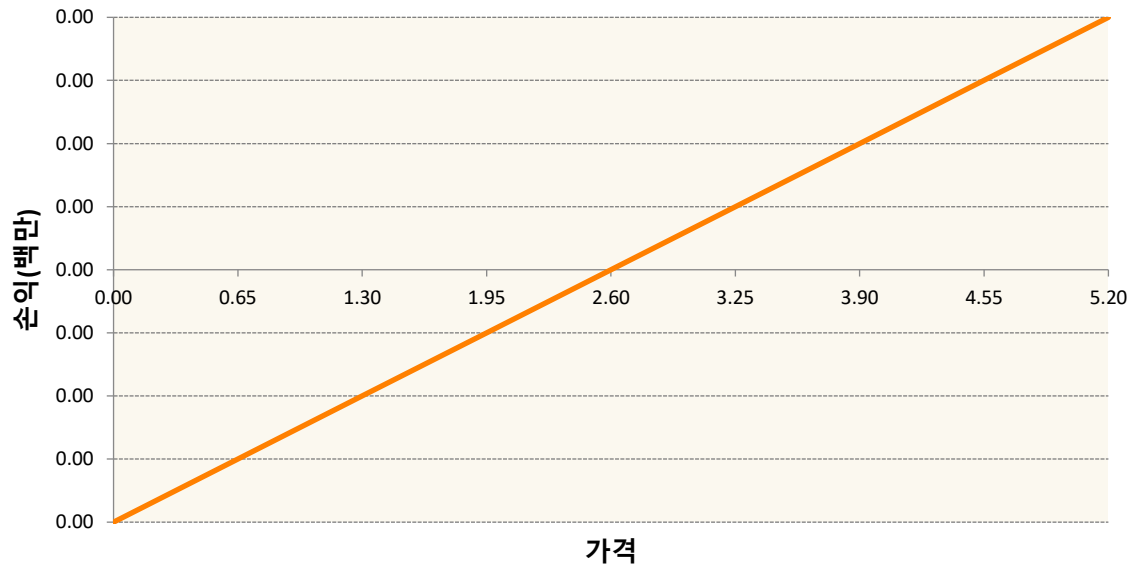
2. 만기시점의 손익구조



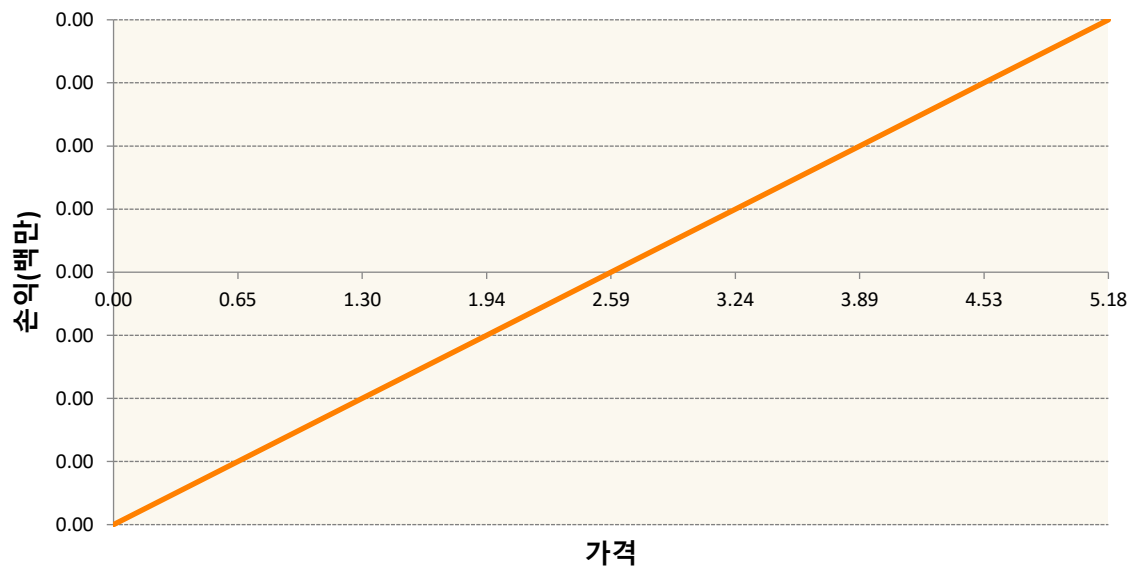
ECU3-E-mini Crude Oil Sep23



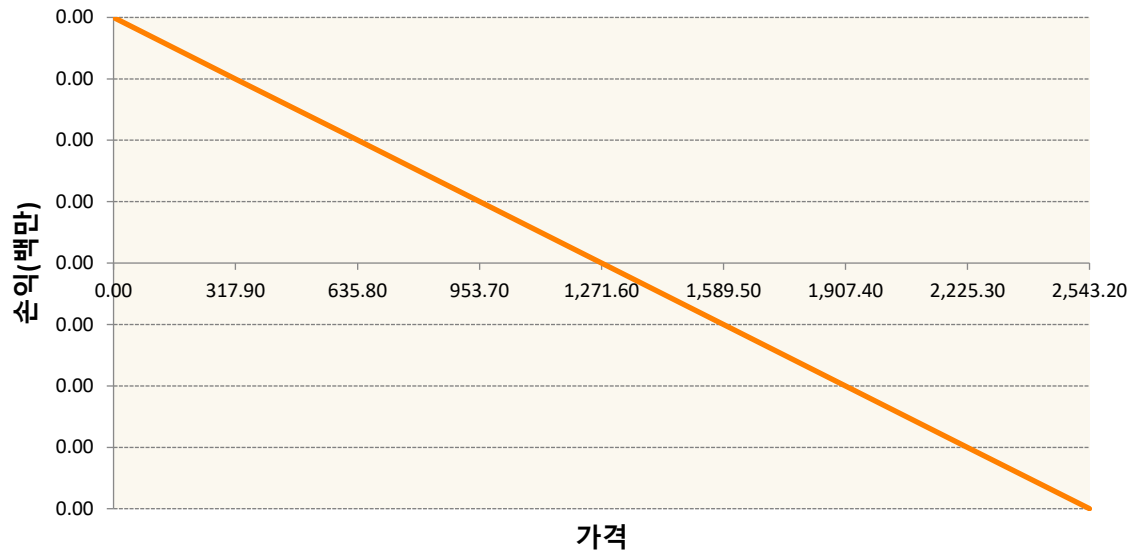
EOU3-E-MINI NATURAL GAS Sep23



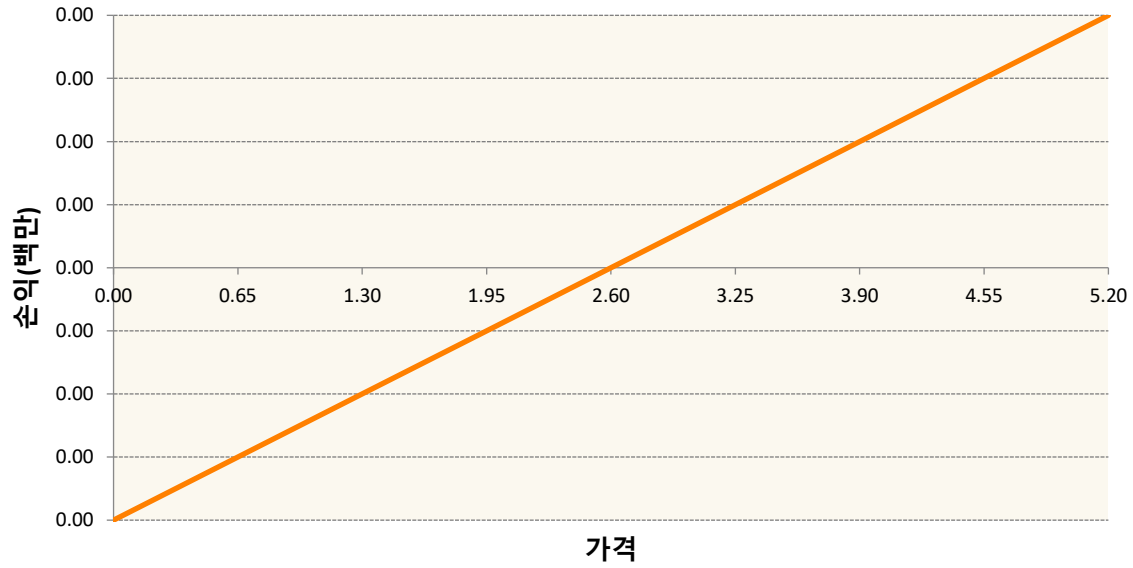
HOU3-NY Harb ULSD Fut Sep23



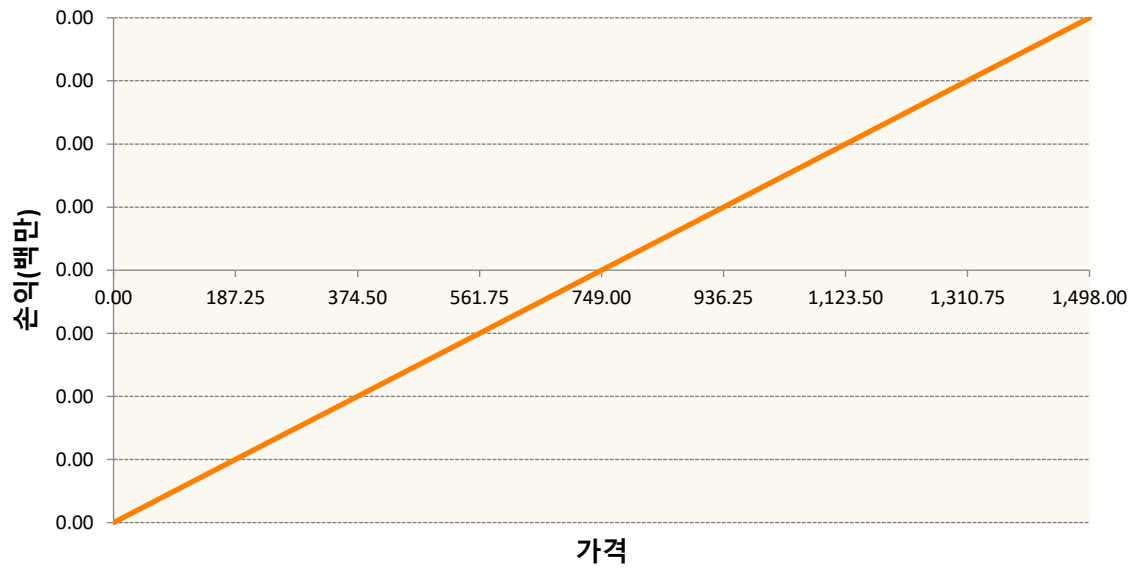
KR4175T80008-2023-08 달러선물

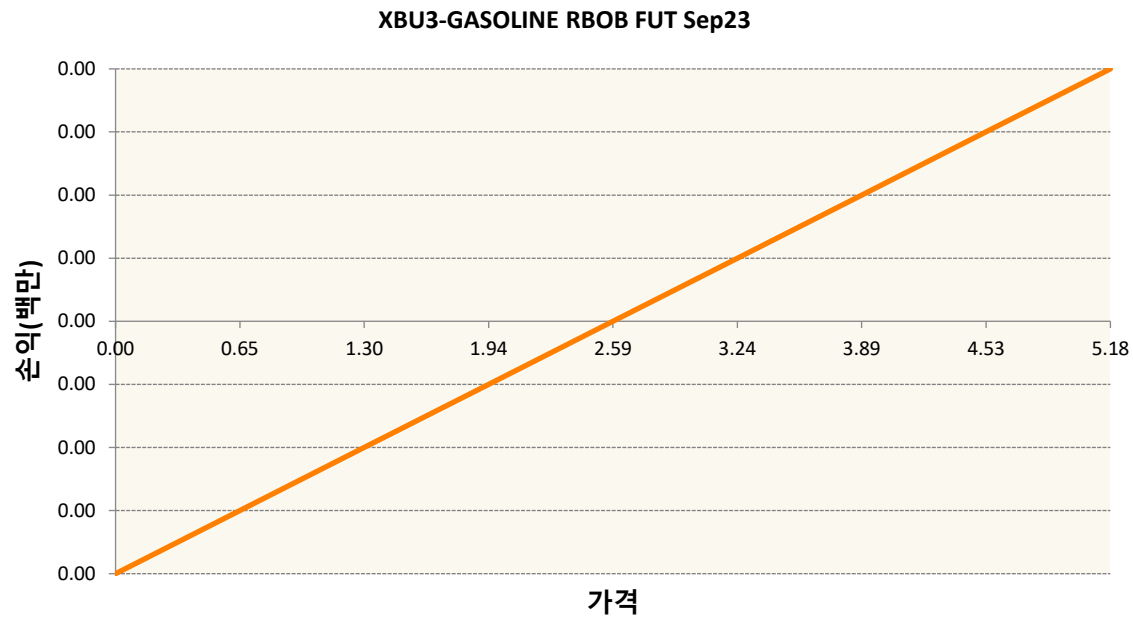


NGU23-NATURAL GAS FUTR Sep23



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
KR4175T800 2023-08 달러선물		15
NGU23	NATURAL GAS FUTR Sep23	21
QSU3	Low Su Gasoil G Sep23	8
XBU3	GASOLINE RBOB FUT Sep23	11

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	196