

공시일	2023-08-22
기준일	2023-08-21

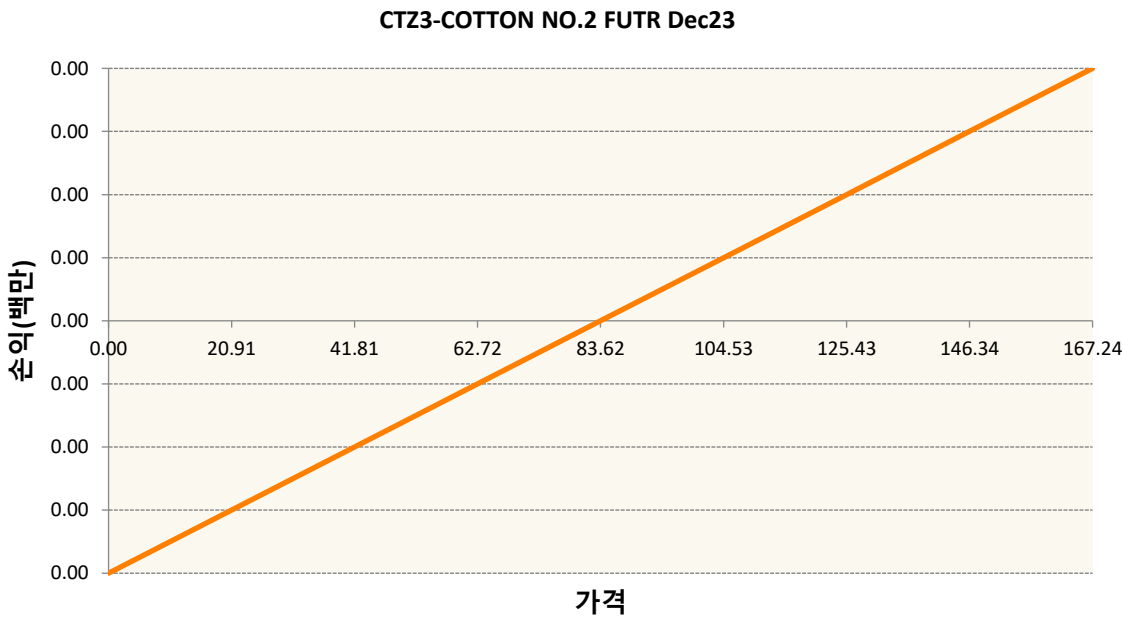
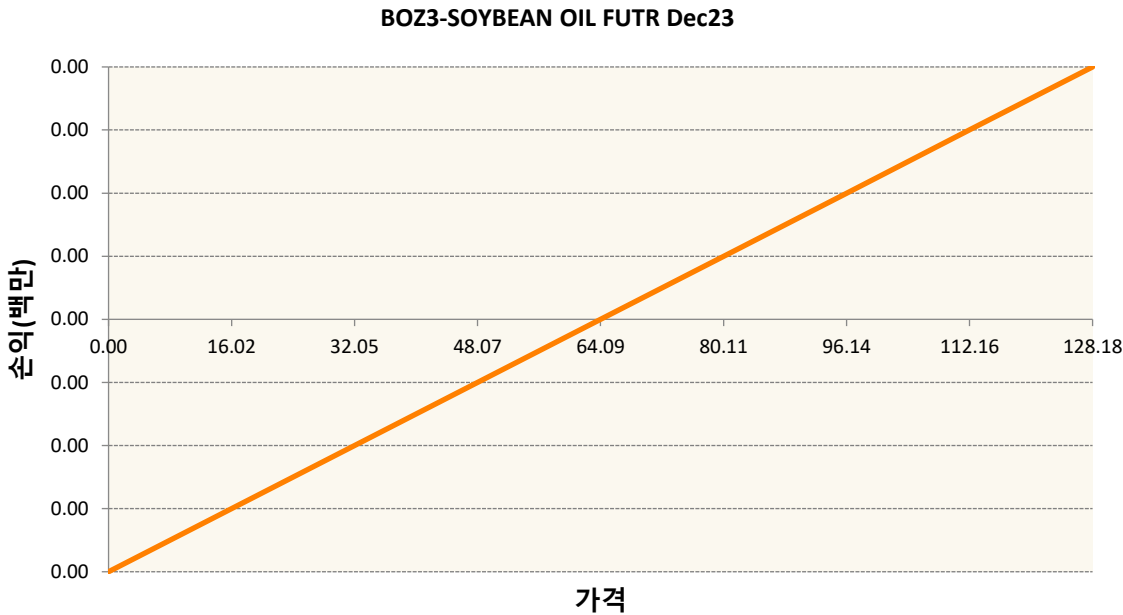
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

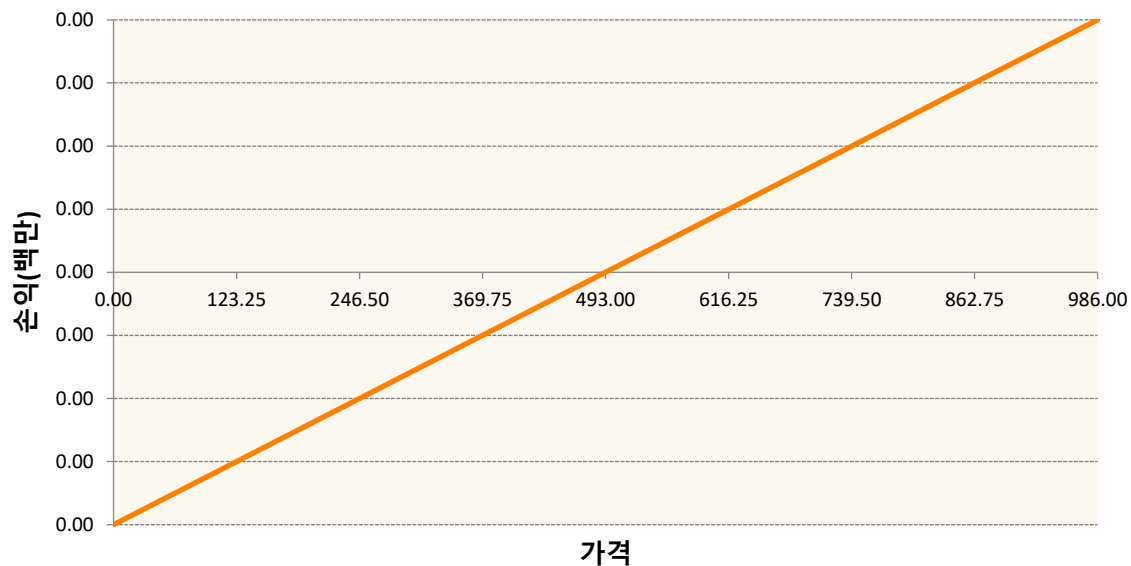
(단위:USD 백만)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,013	362	4,651	

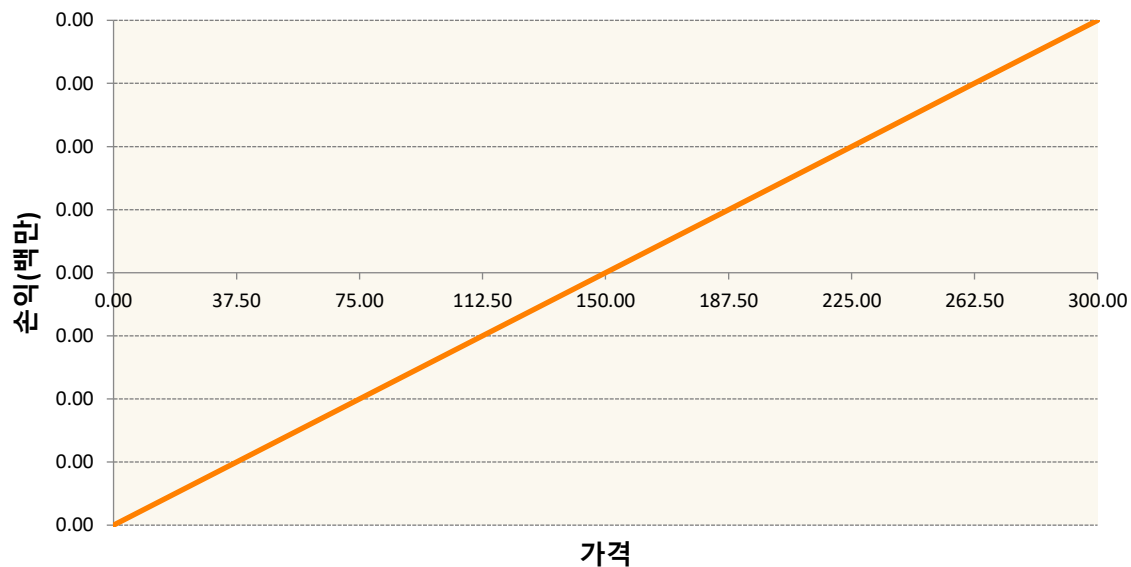
2. 만기시점의 손익구조



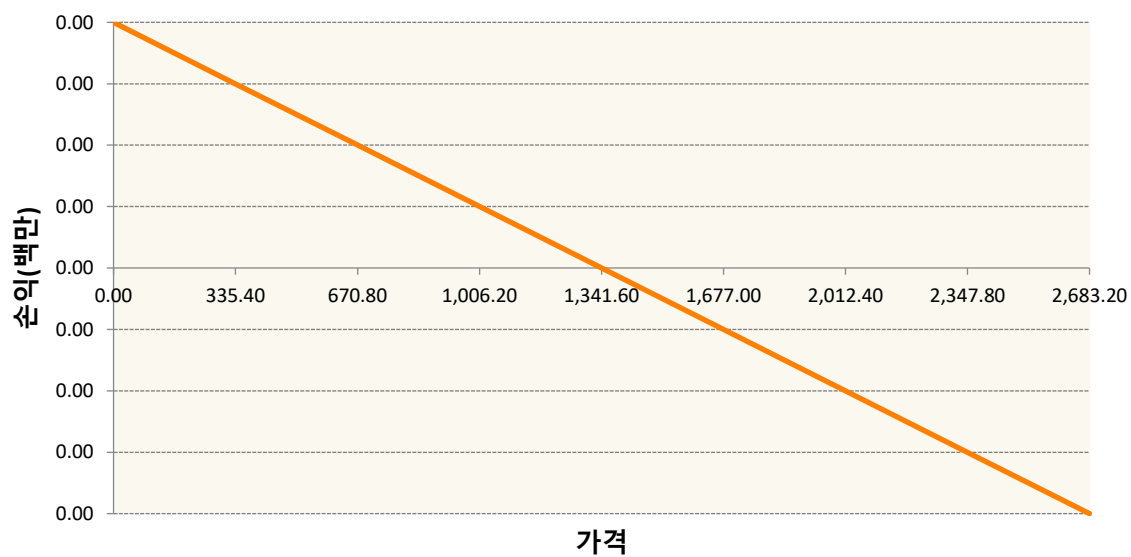
CZ3-CORN FUTURE Dec23



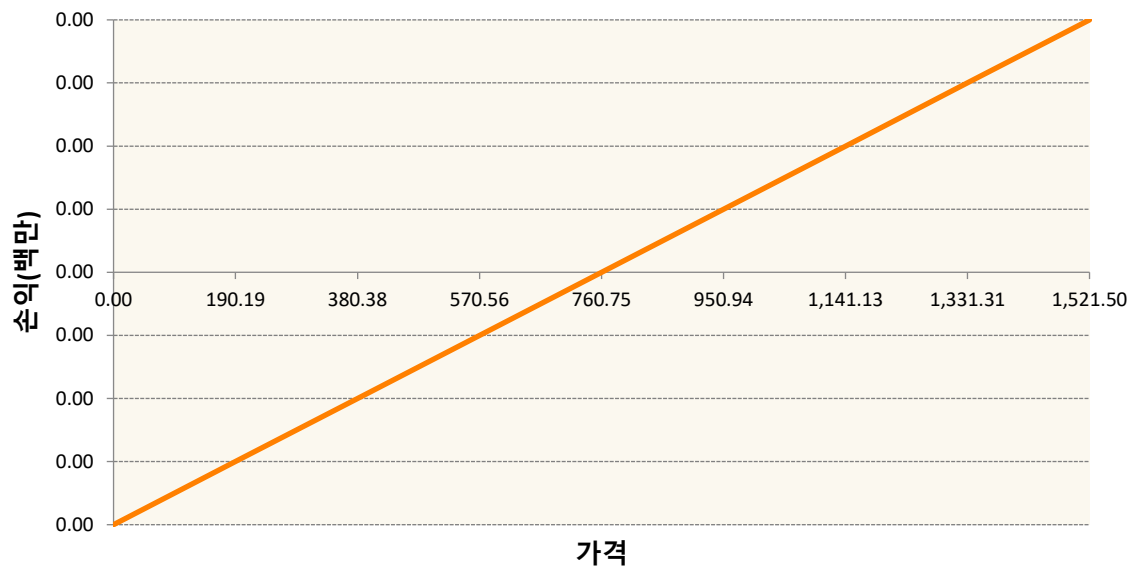
KCZ3-COFFEE 'C' FUTURE DEC23



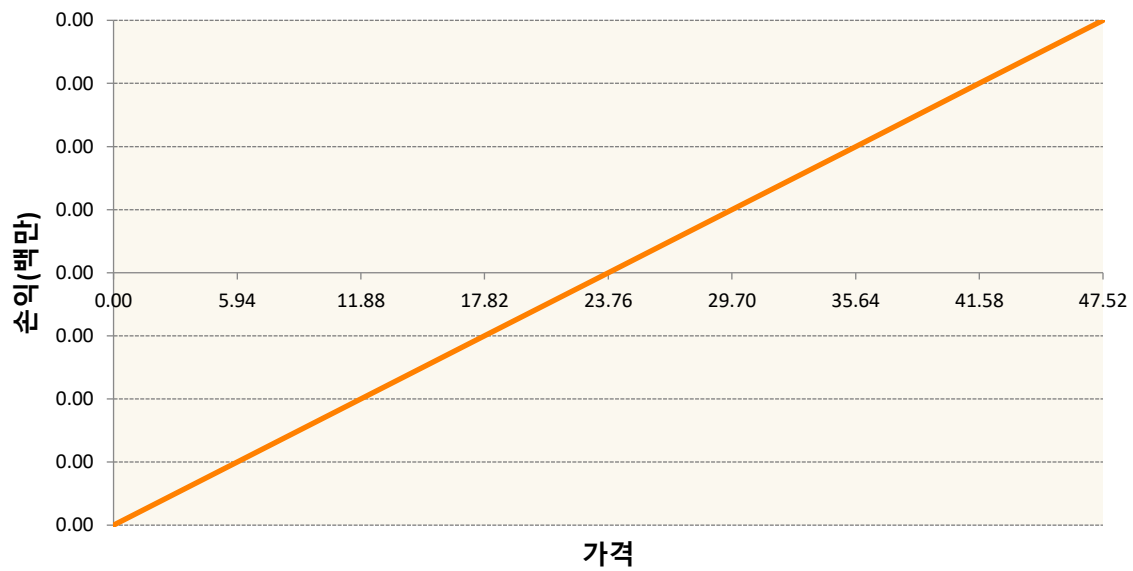
KR4175T90007-2023-09 달러선물



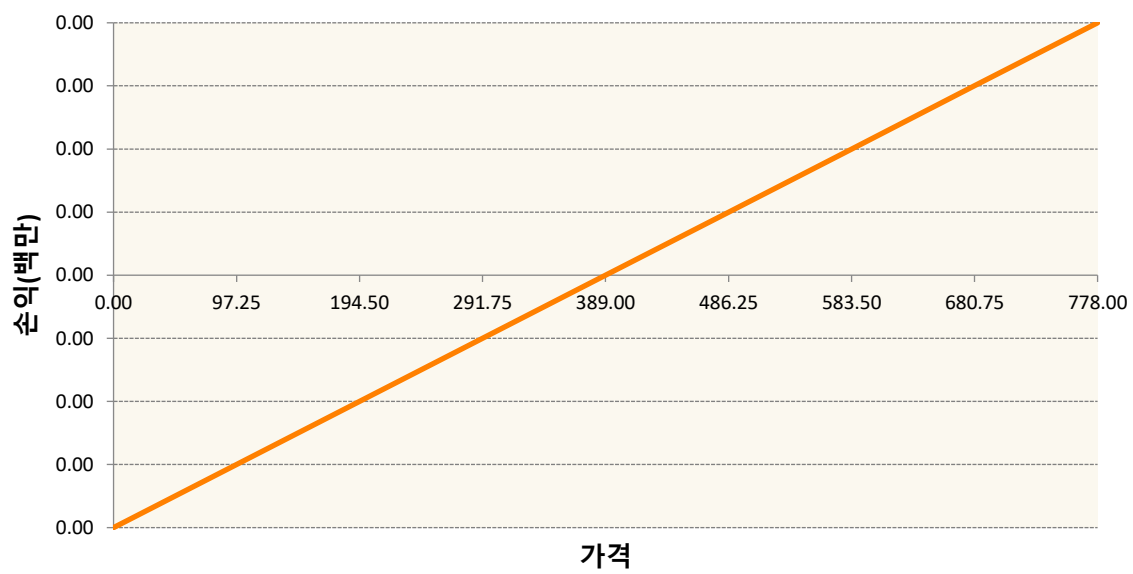
KWZ3-KC HRW WHEAT FUT DEC23

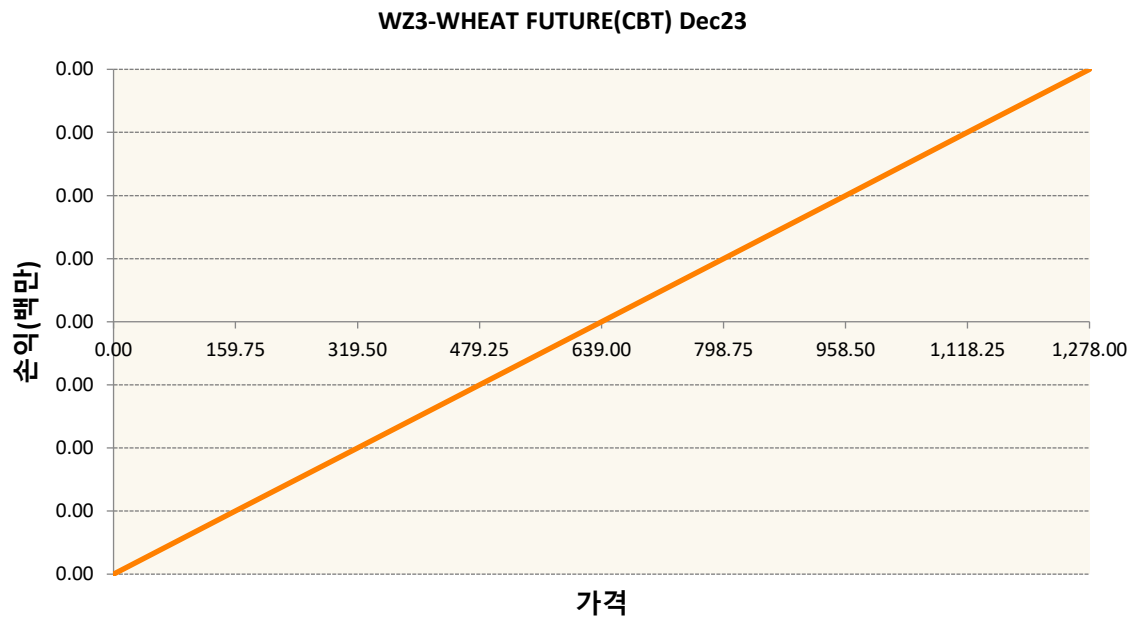
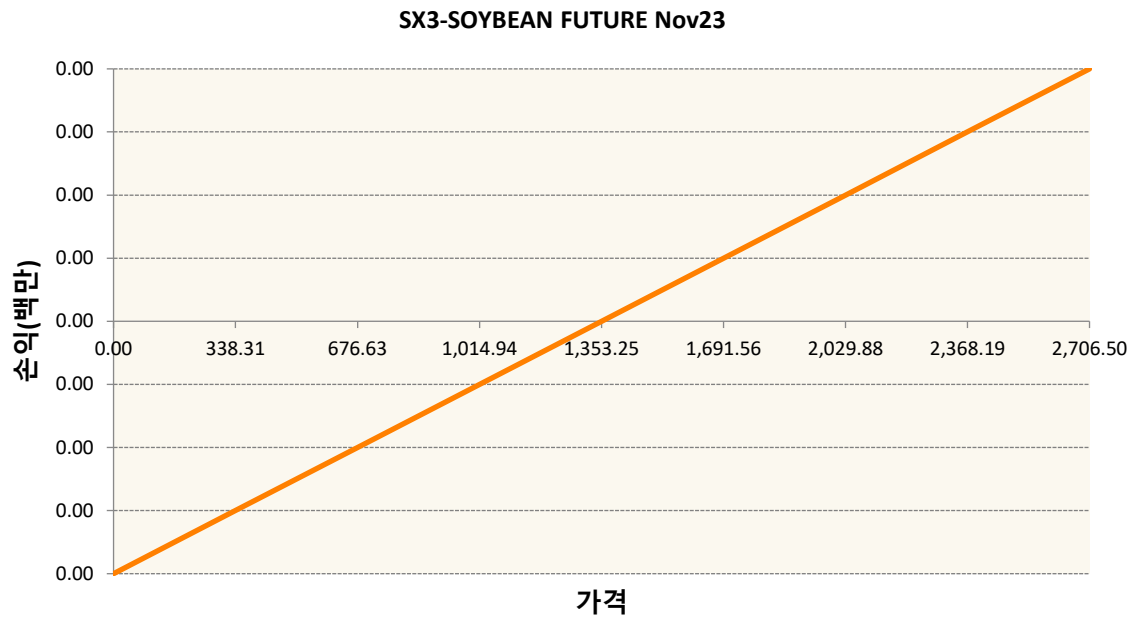


SBV3-Sugar #11 (WORLD) Oct23



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	2023-08-22
기준일	2023-08-21

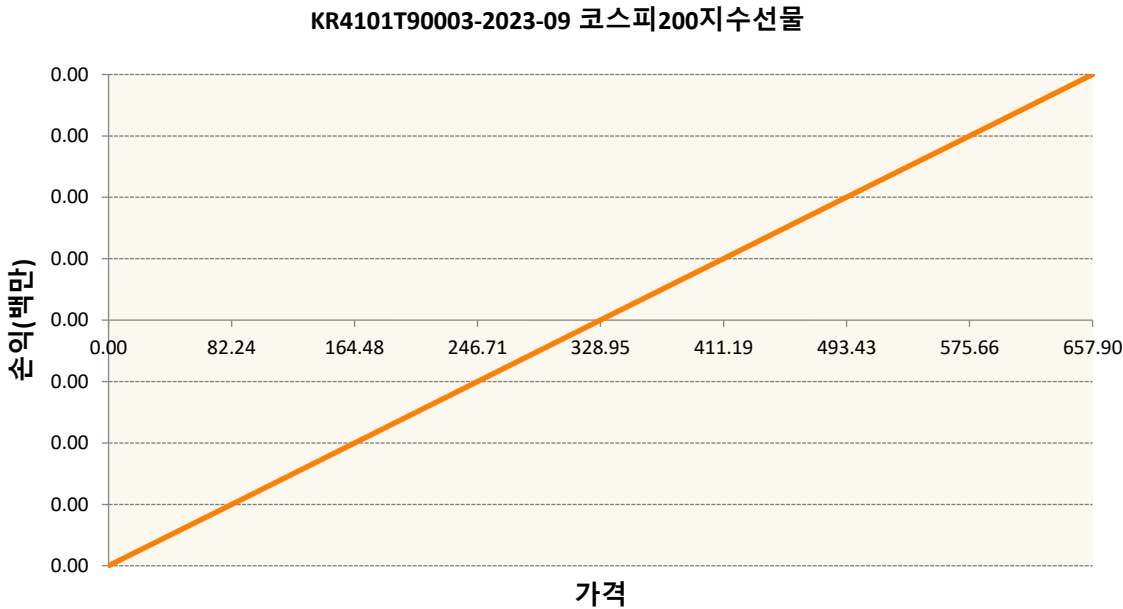
스마트인덱스모

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	987	0	987	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101T90003			2023-09 코스피200지수선물				79
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-79	-79	-79	-79	-79	-79	-79
-5.33%	-53	-53	-53	-53	-53	-53	-53
-2.67%	-26	-26	-26	-26	-26	-26	-26
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	26	26	26	26	26	26	26
5.33%	53	53	53	53	53	53	53
8.00%	79	79	79	79	79	79	79

공시일	2023-08-22
기준일	2023-08-21

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	323
-----------------------------	-----

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

329

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2023-08-22
기준일	2023-08-21

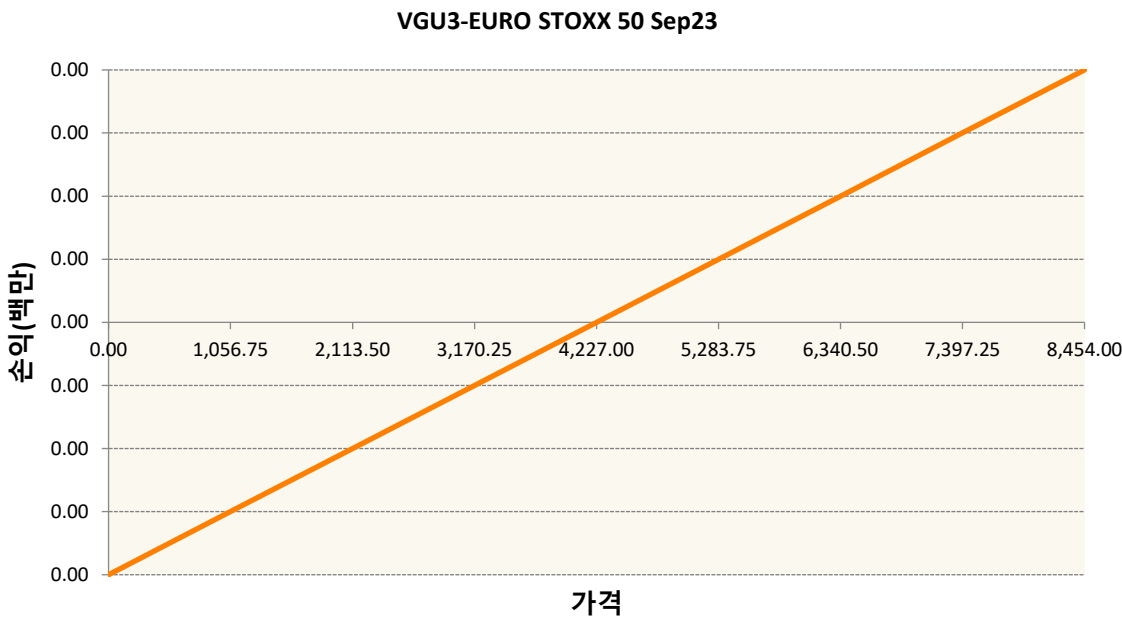
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	349	0	349	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGU3	EURO STOXX 50 Sep23	28
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

26

공시일	2023-08-22
기준일	2023-08-21

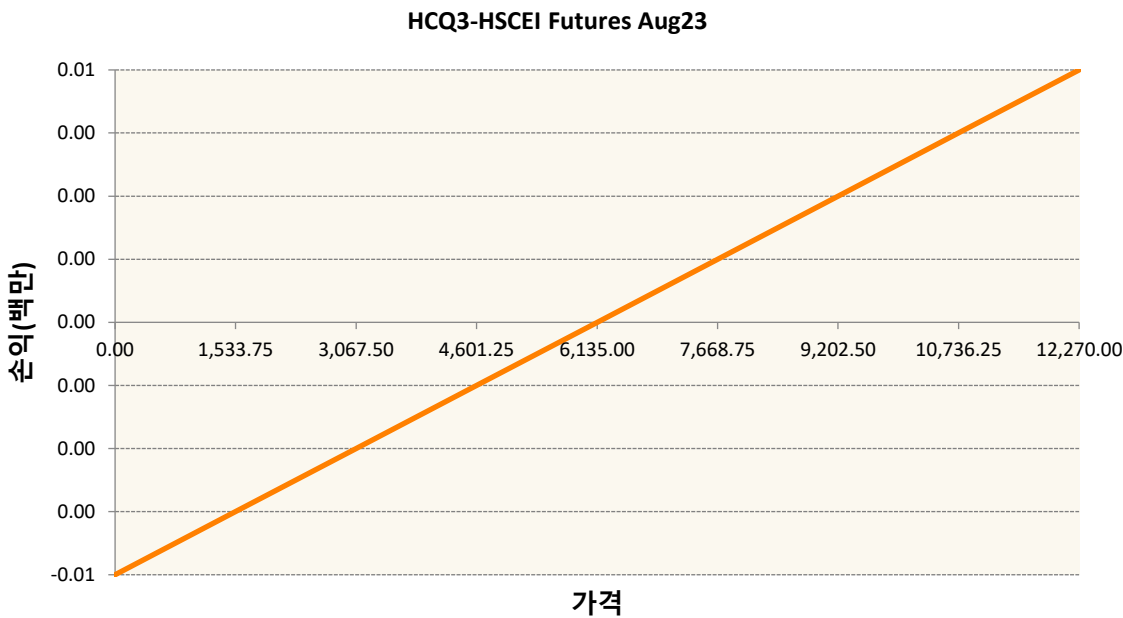
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,100	0	1,100	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCQ3	HSCEI Futures Aug23	88
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

136

공시일	2023-08-22
기준일	2023-08-21

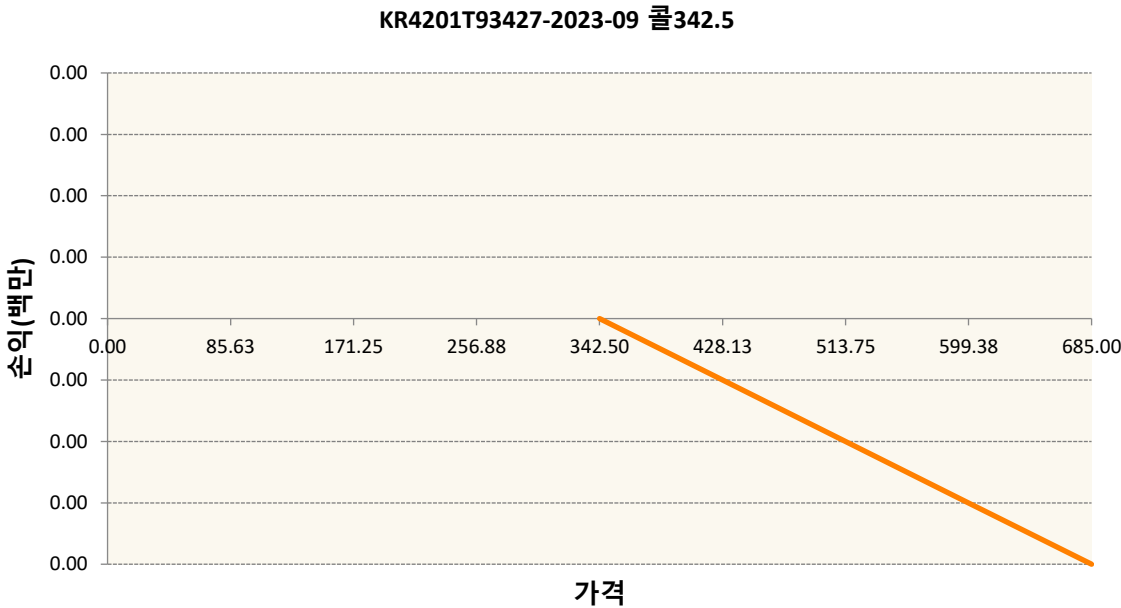
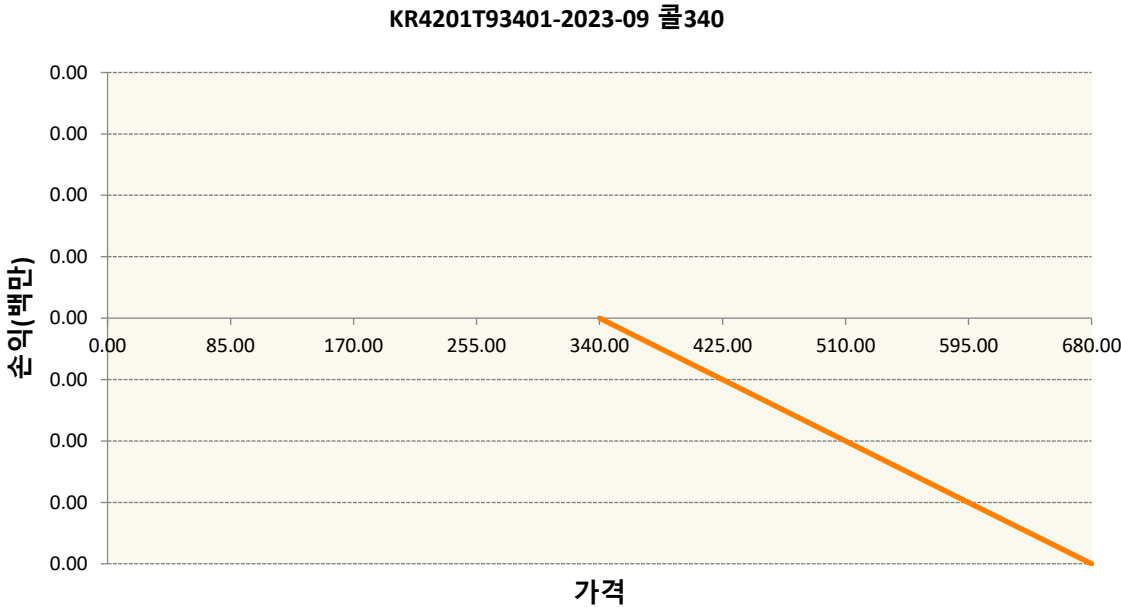
커버드콜모(주식혼합-파생형)

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	54,558	-54,558	장내

2. 만기시점의 손익구조



KR4301T93409-2023-09 풋340



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201T93401			2023-09 콜340				1,667
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	412	407	400	389	375	357	335
-5.33%	396	381	361	337	308	275	240
-2.67%	337	302	263	219	173	123	72
0%	180	122	62	0	-63	-127	-193
2.67%	-137	-209	-281	-353	-425	-497	-569
5.33%	-646	-714	-783	-852	-922	-992	-1,063
8.00%	-1,326	-1,376	-1,429	-1,485	-1,544	-1,605	-1,667
KR4201T93427			2023-09 콜342.5				442
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	97	96	95	92	89	85	79
-5.33%	94	91	86	81	74	66	56
-2.67%	82	74	64	53	41	29	15
0%	47	32	16	0	-17	-34	-52
2.67%	-29	-49	-69	-89	-109	-129	-149
5.33%	-157	-178	-198	-218	-239	-259	-280
8.00%	-337	-353	-370	-387	-405	-423	-442
KR4301T93409			2023-09 풋340				661
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-640	-641	-643	-646	-650	-655	-661
-5.33%	-393	-397	-402	-409	-417	-426	-436
-2.67%	-157	-167	-178	-190	-203	-217	-232
0%	50	34	17	0	-18	-36	-54

2.67%	213	193	173	153	133	112	92
5.33%	322	303	284	265	245	225	205
8.00%	383	369	354	339	322	305	288

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

(단위:백만원)

2,519

공시일	2023-08-22
기준일	2023-08-21

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	5,894	0	5,894	

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	2023-08-22
기준일	2023-08-21

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	4,661	0	4,661	

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	2023-08-22
기준일	2023-08-21

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	17,814	0	17,814	
누계	통화	선도	1,343	19,166	-17,823	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
FXW213D5S(KRW/USD 31-08-23E		702
FXW213D6S(KRW/USD 27-09-23E		564
FXW213D7T(KRW/USD 31-10-23E		267
FXW213D81(USD/KRW 31-08-23E		32
FXW213D84(USD/KRW 31-08-23E		43
FXW213D8J(USD/KRW 31-08-23E		32
IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	950

공시일	2023-08-22
기준일	2023-08-21

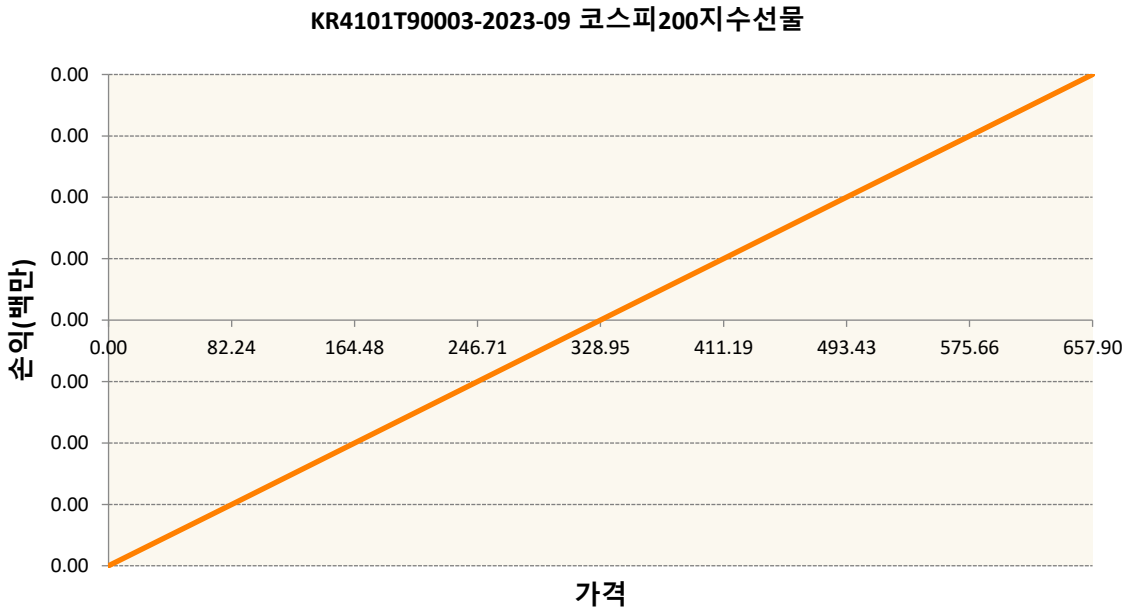
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

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	329	0	329	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101T90003			2023-09 코스피200지수선물				26
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-26	-26	-26	-26	-26	-26	-26
-5.33%	-18	-18	-18	-18	-18	-18	-18
-2.67%	-9	-9	-9	-9	-9	-9	-9
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	9	9	9	9	9	9	9
5.33%	18	18	18	18	18	18	18
8.00%	26	26	26	26	26	26	26

공시일	2023-08-22
기준일	2023-08-21

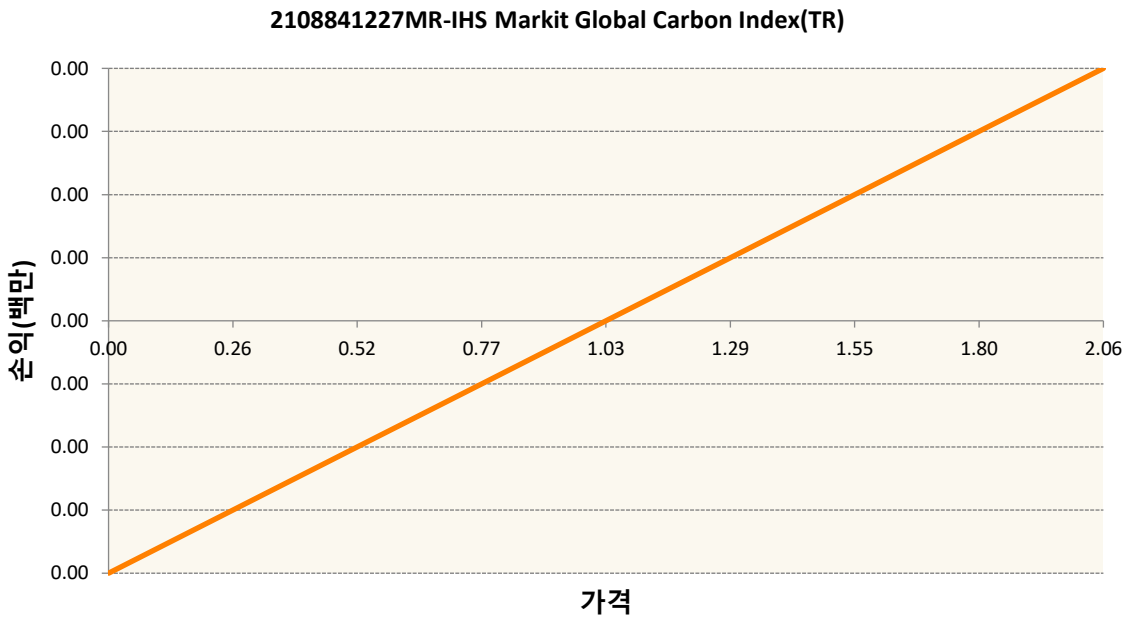
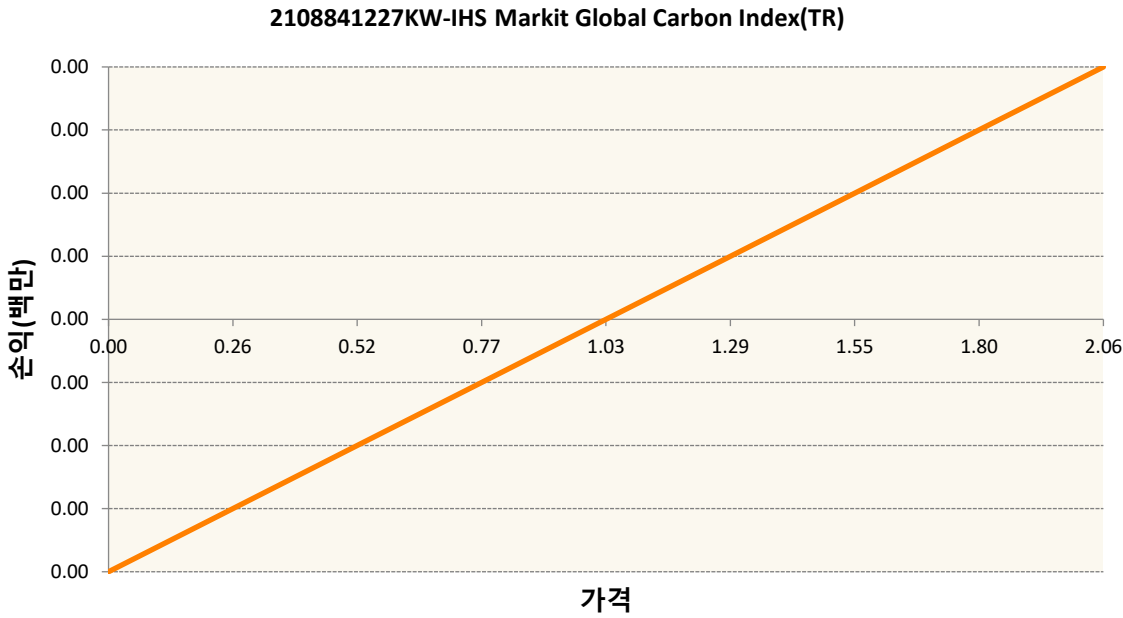
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

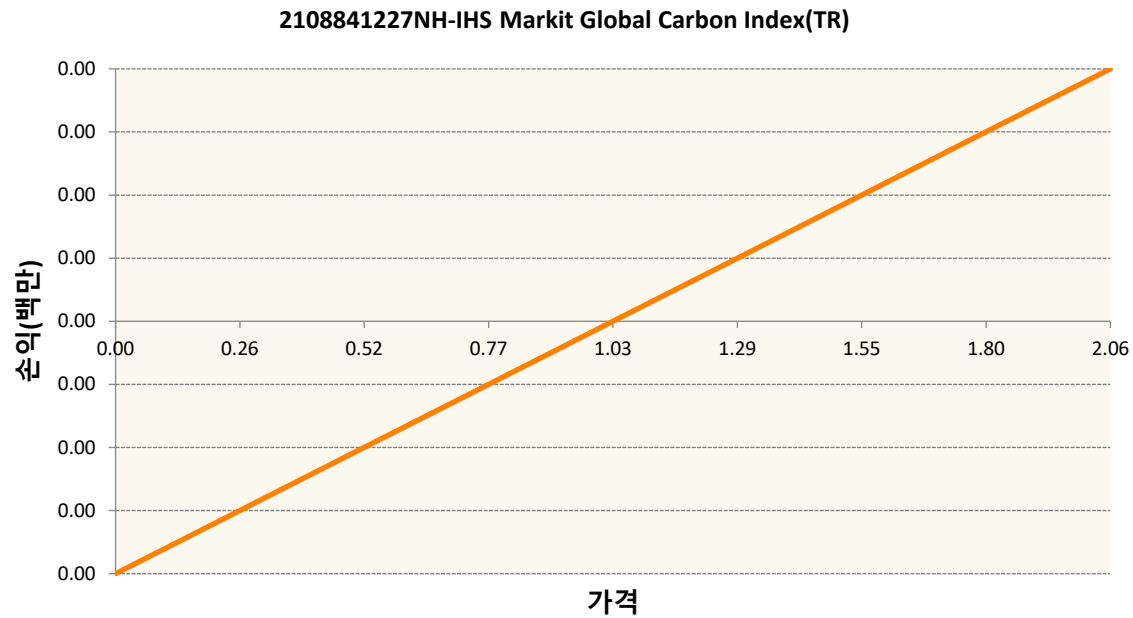
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	27,061	0	27,061	

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108841227IHS Markit Global Carbon Index(TR)		1,840
2108841227IHS Markit Global Carbon Index(TR)		216
2108841227IHS Markit Global Carbon Index(TR)		108

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)		(단위:백만원)
		3,090

공시일 2023-08-22

기준일 2023-08-21

SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

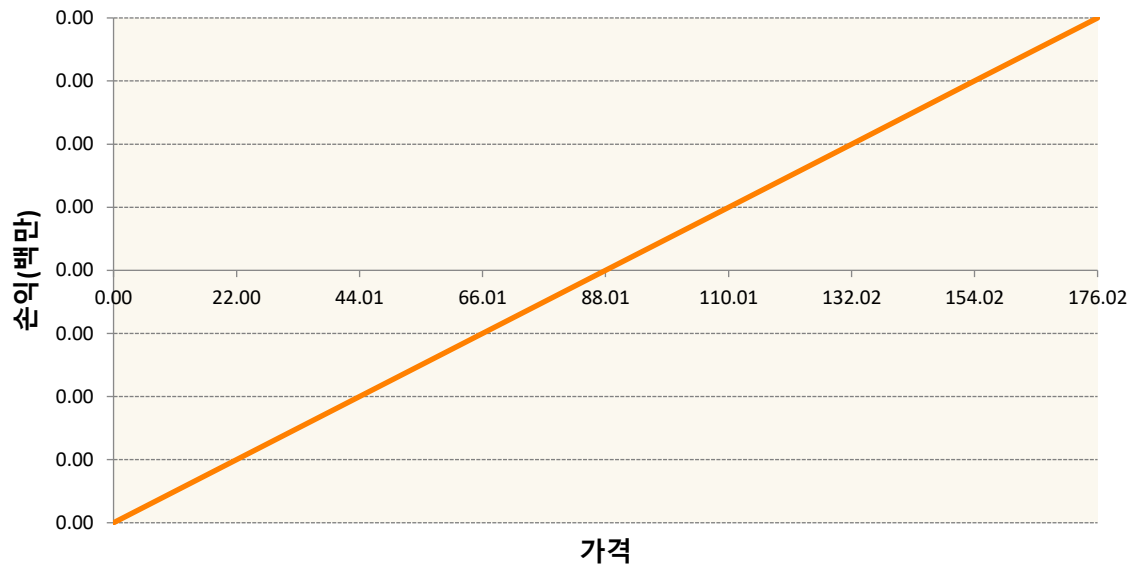
1. 계약금액

(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	8,803	0	8,803	
누계	통화	선도	612	2,547	-1,935	장외

2. 만기시점의 손익구조

MOZ23-ECX EMISSION Dec23



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213D7T(KRW/EUR 31-08-23E	23
FXW213D7T(KRW/EUR 31-08-23E	35
FXW213D7T(KRW/EUR 31-08-23E	64
FXW213D7T(KRW/EUR 31-08-23E	82
FXW213D82(EUR/KRW 31-08-23E	49
MOZ23 ECX EMISSION Dec23	704

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

(단위:백만원)

1,589

공시일	2023-08-22
기준일	2023-08-21

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)	17
SWCSI00000 신한CSI Index 230622 (키움)	17
SWCSI00000 신한CSI Index 230622 (미래)	17
SWCSI00000 신한CSI Index 230622 (메리츠)	17

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

(단위:백만원)

110

공시일	2023-08-22
기준일	2023-08-21

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)	17
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 230116(메리츠)	24
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 230116(미래)	20
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 230427(키움)	5

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

(단위:백만원)

80

공시일	2023-08-22
기준일	2023-08-21

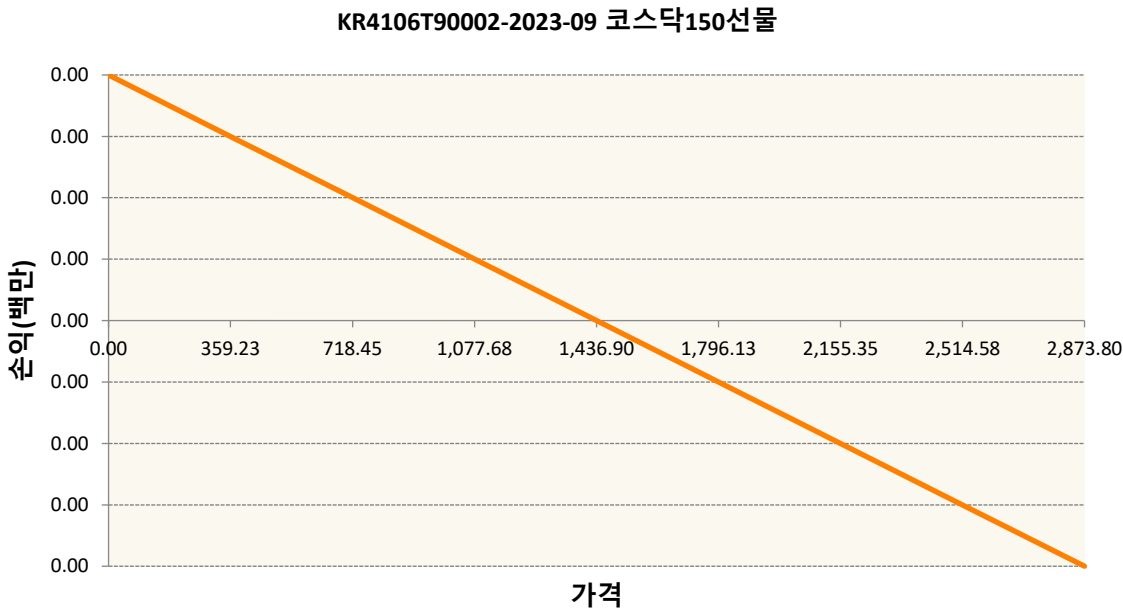
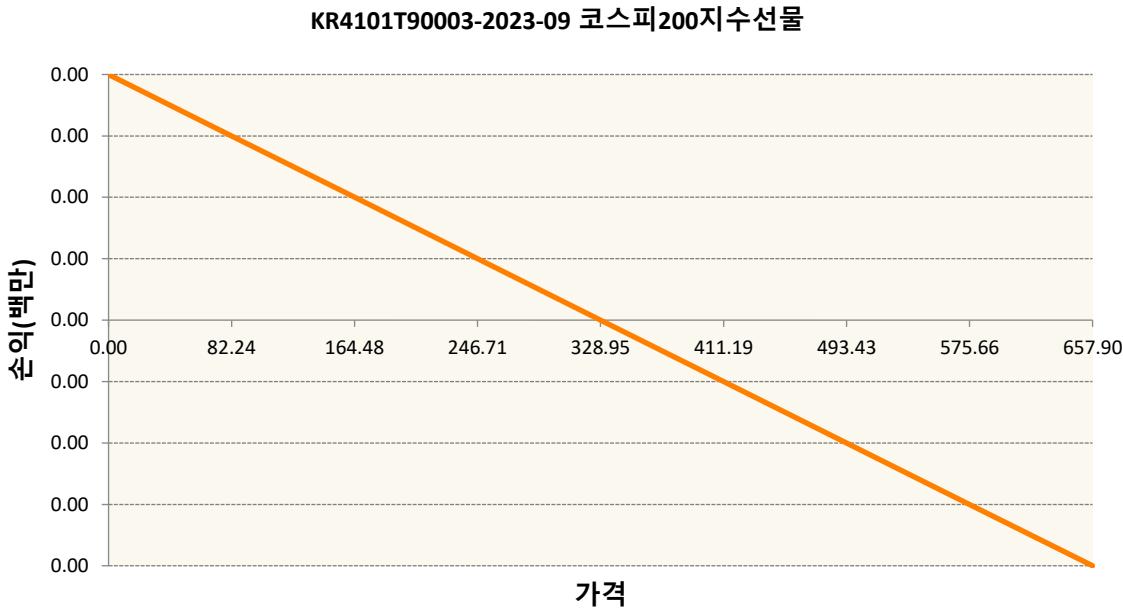
에퀴티알파일반사모혼합자산

1. 계약금액

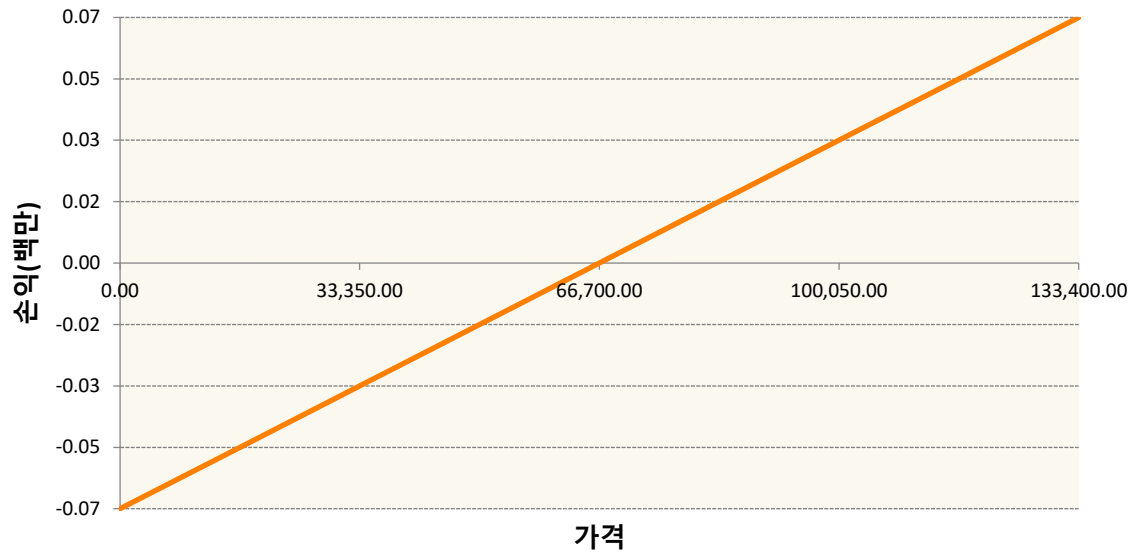
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	822	-822	장내
누계	유가증권	선물	1,954	4,249	-2,296	장내

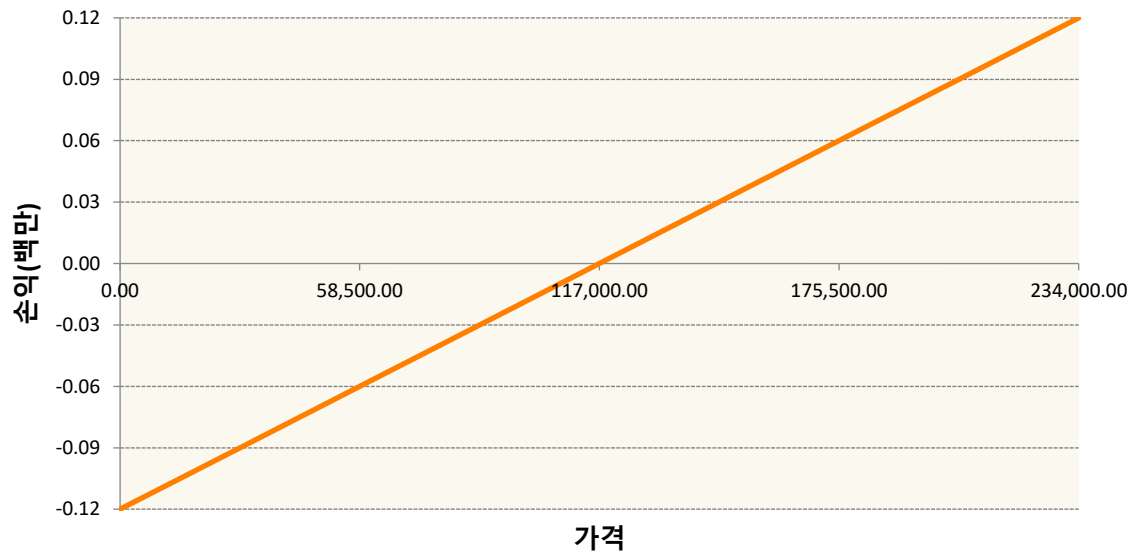
2. 만기시점의 손익구조



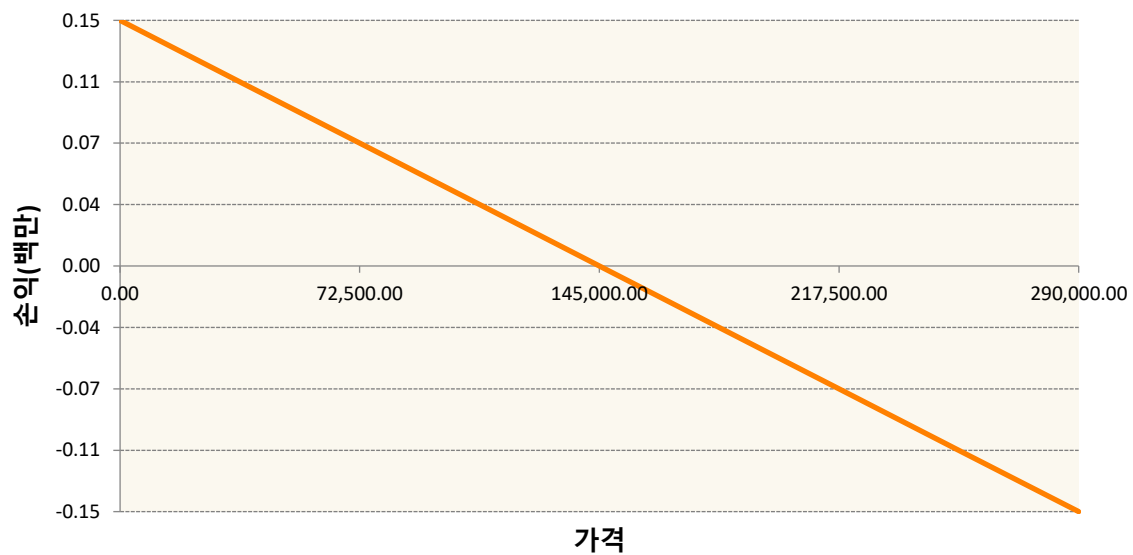
KR4111T90002-2023-09 삼성전자개별선물



KR4150T90000-2023-09 SK하이닉스개별선물



KR41CPT90007-2023-09 셀트리온개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
KR4101T900	2023-09 코스피200지수선물	289
KR4106T900	2023-09 코스닥150선물	37
KR4111T900	2023-09 삼성전자개별선물	118
KR4150T900	2023-09 SK하이닉스개별선물	38
KR41CPT900	2023-09 셀트리온개별선물	14

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	609

공시일	2023-08-22
기준일	2023-08-21

코리아인덱스(주식-파생형)(종)

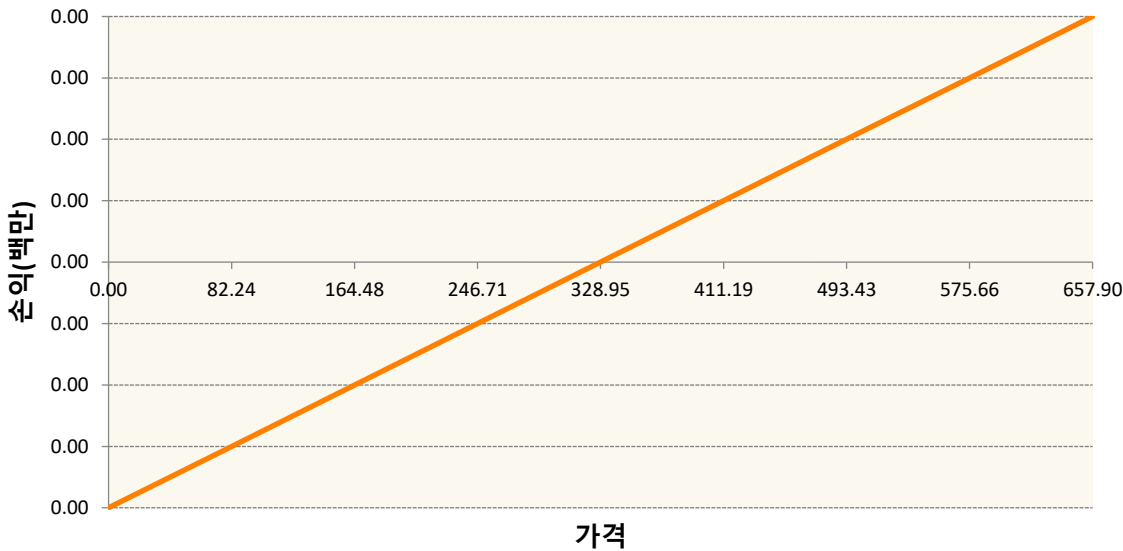
1. 계약금액

(단위:백만원)

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

2. 만기시점의 손익구조

KR4101T90003-2023-09 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101T90003			2023-09 코스피200지수선물				85
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-85	-85	-85	-85	-85	-85	-85
-5.33%	-57	-57	-57	-57	-57	-57	-57
-2.67%	-28	-28	-28	-28	-28	-28	-28
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	28	28	28	28	28	28	28
5.33%	57	57	57	57	57	57	57
8.00%	85	85	85	85	85	85	85

공시일	2023-08-22
기준일	2023-08-21

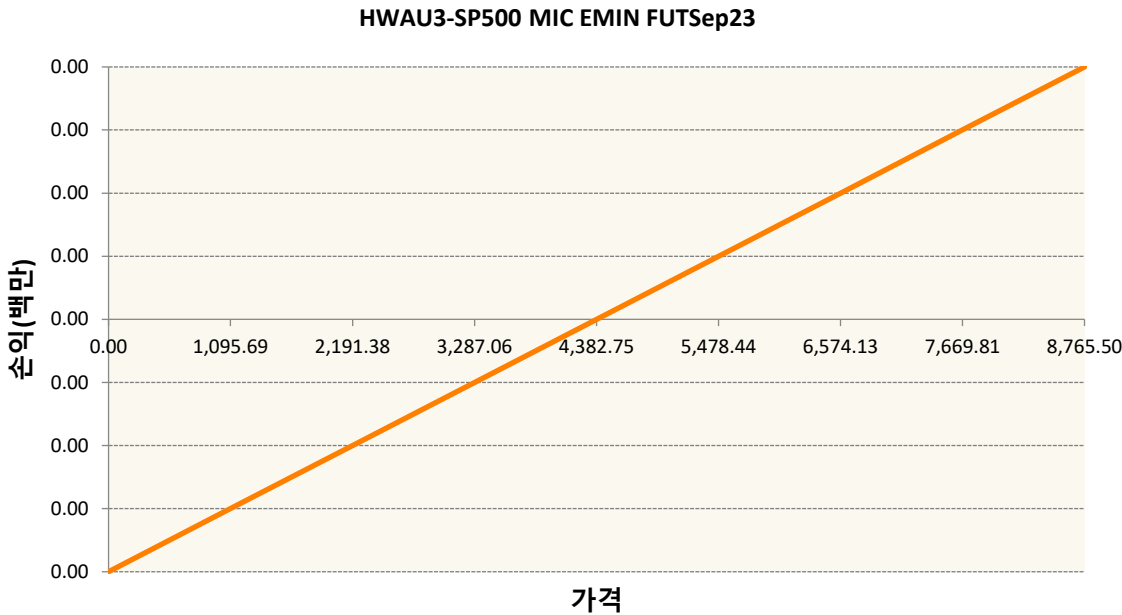
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

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)

77

공시일	2023-08-22
기준일	2023-08-21

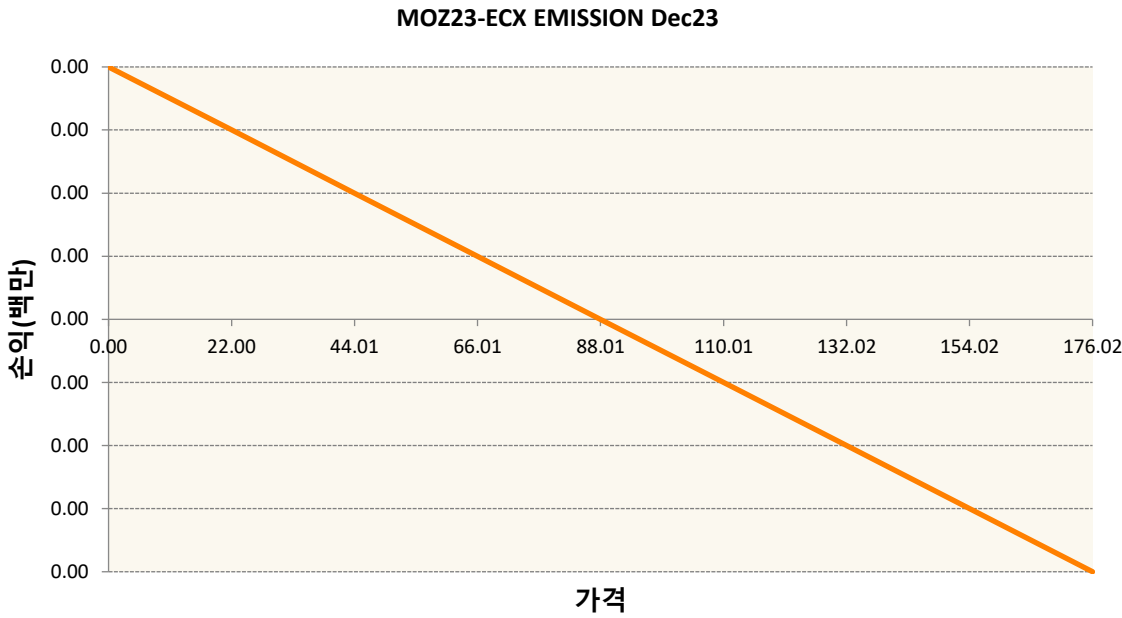
SOL유럽탄소배출권선물인버스ICE특별자산상

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	7,967	-7,967	
누계	통화	선도	0	1,972	-1,972	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213D7T(KRW/EUR 31-08-23E	18
FXW213D7T(KRW/EUR 31-08-23E	35
FXW213D7T(KRW/EUR 31-08-23E	35
FXW213D7T(KRW/EUR 31-08-23E	70
MOZ23 ECX EMISSION Dec23	637

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

(단위:백만원)

1,384

공시일	2023-08-22
기준일	2023-08-21

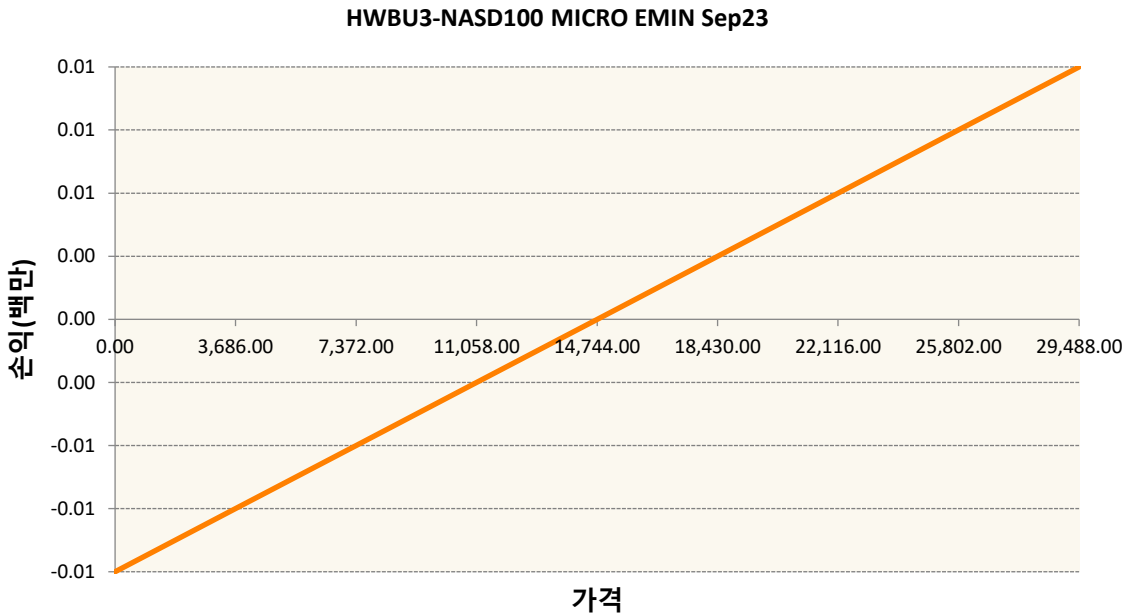
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

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	829	0	829	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HWBU3 NASD100 MICRO EMIN Sep23

66

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

(단위:백만원)

67

공시일	2023-08-22
기준일	2023-08-21

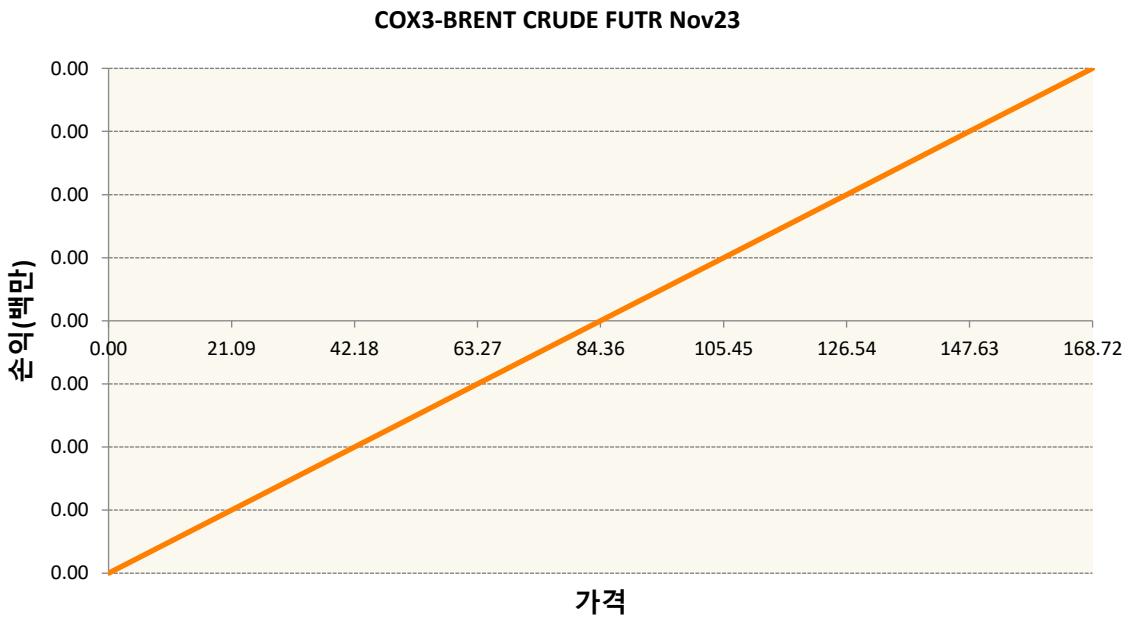
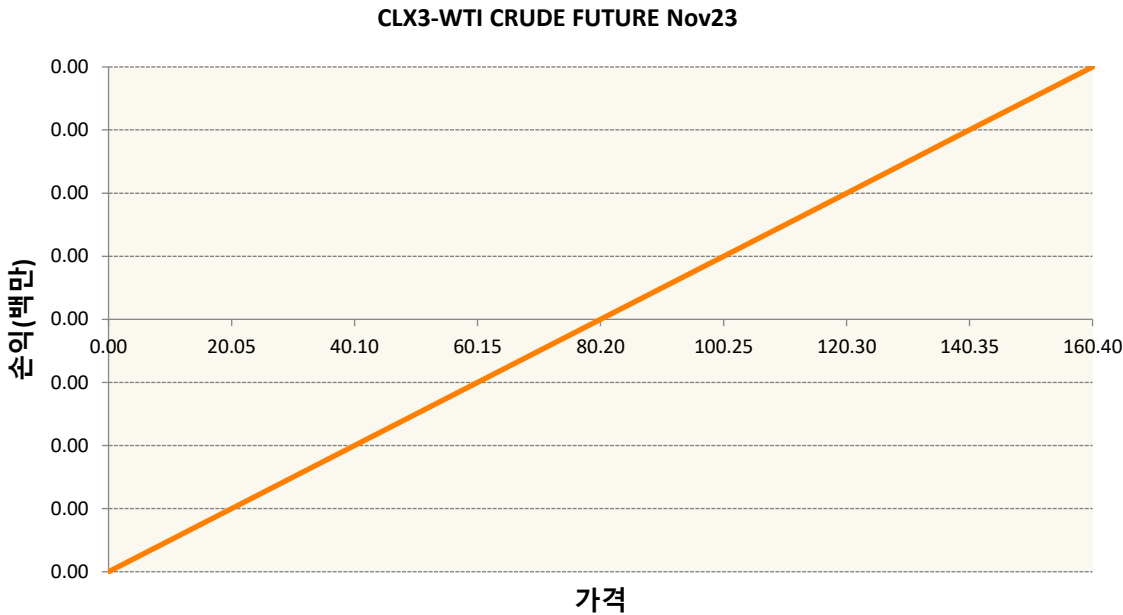
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

1. 계약금액

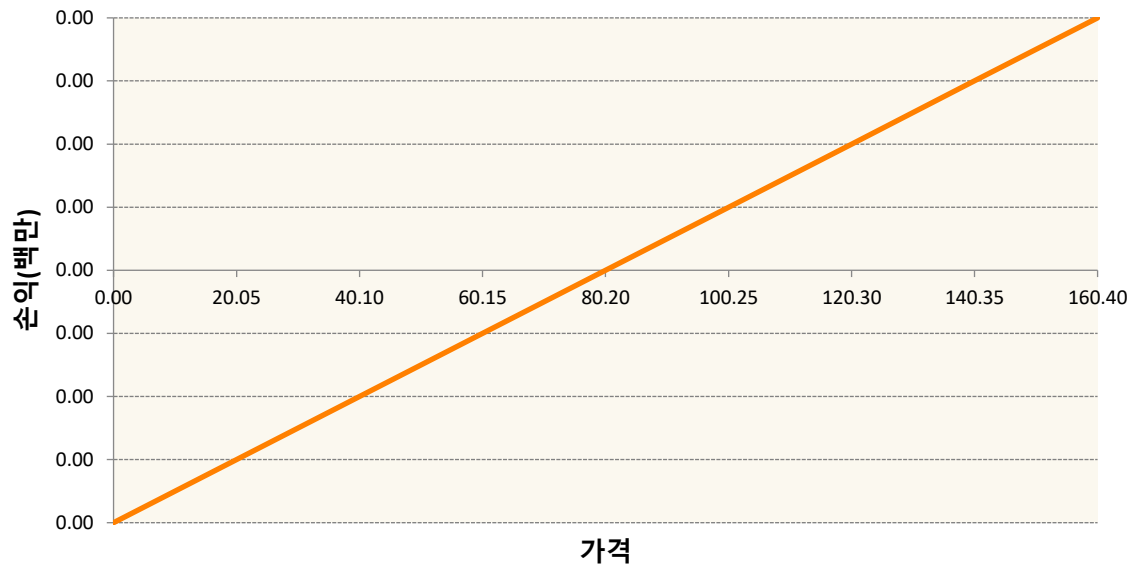
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,476	268	1,207	

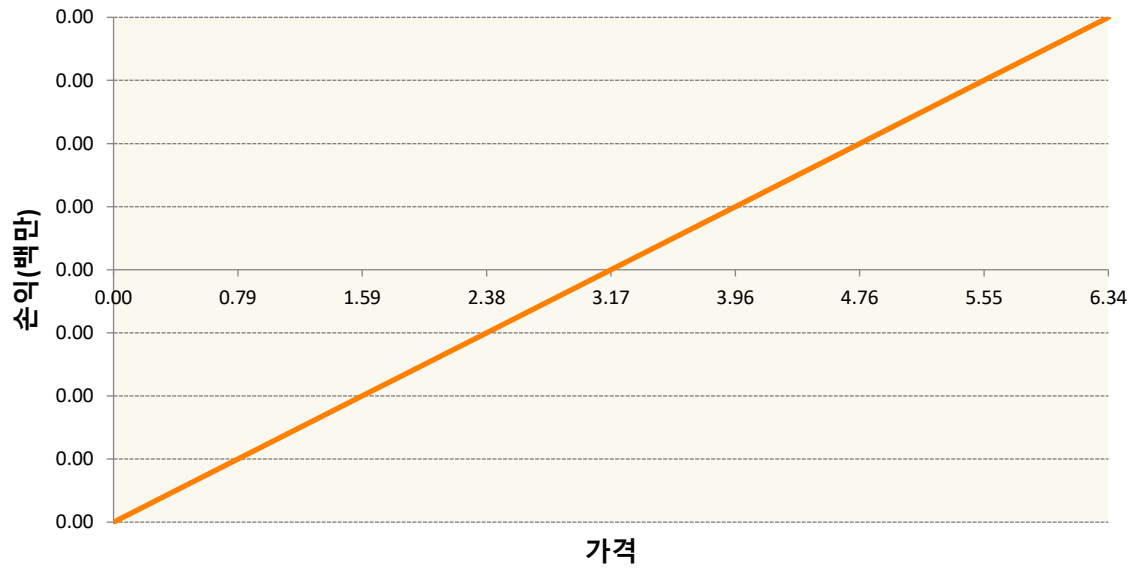
2. 만기시점의 손익구조



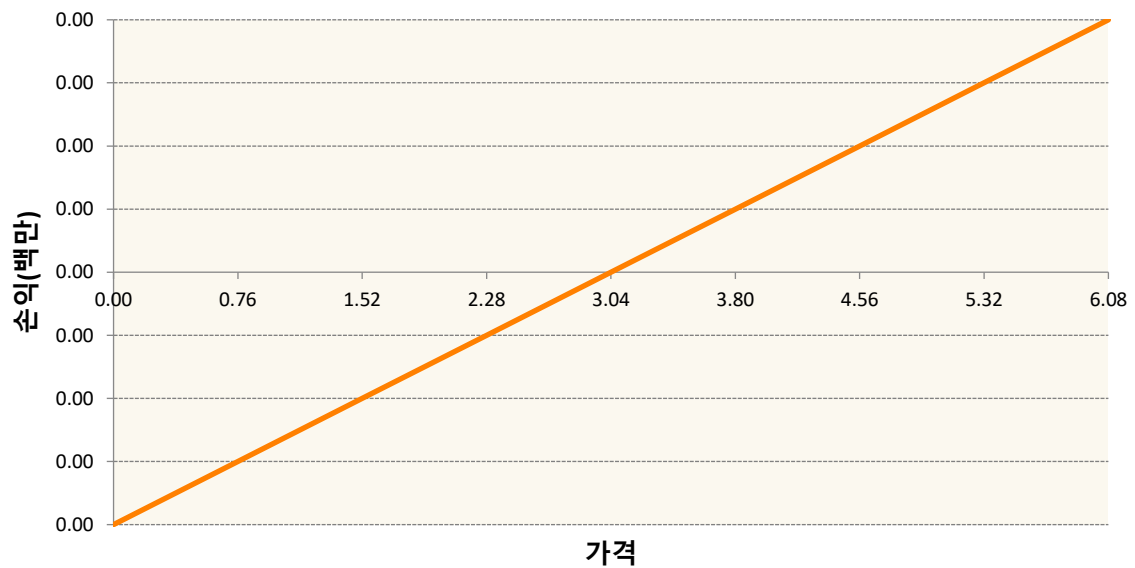
ECX3-E-MINI CRUDE OIL Nov23



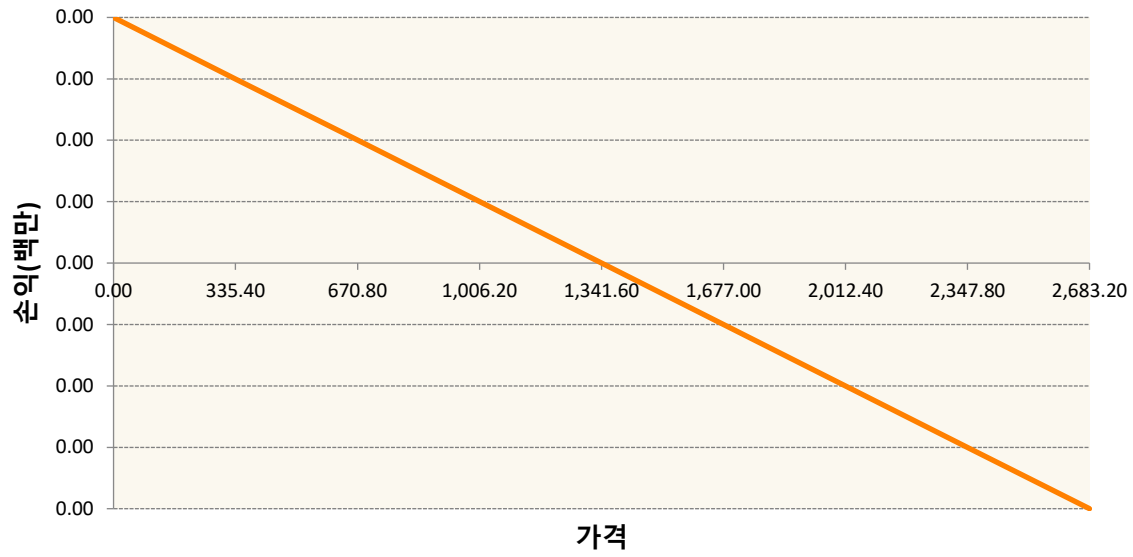
EOX3-E-MINI NATURAL GAS Nov23



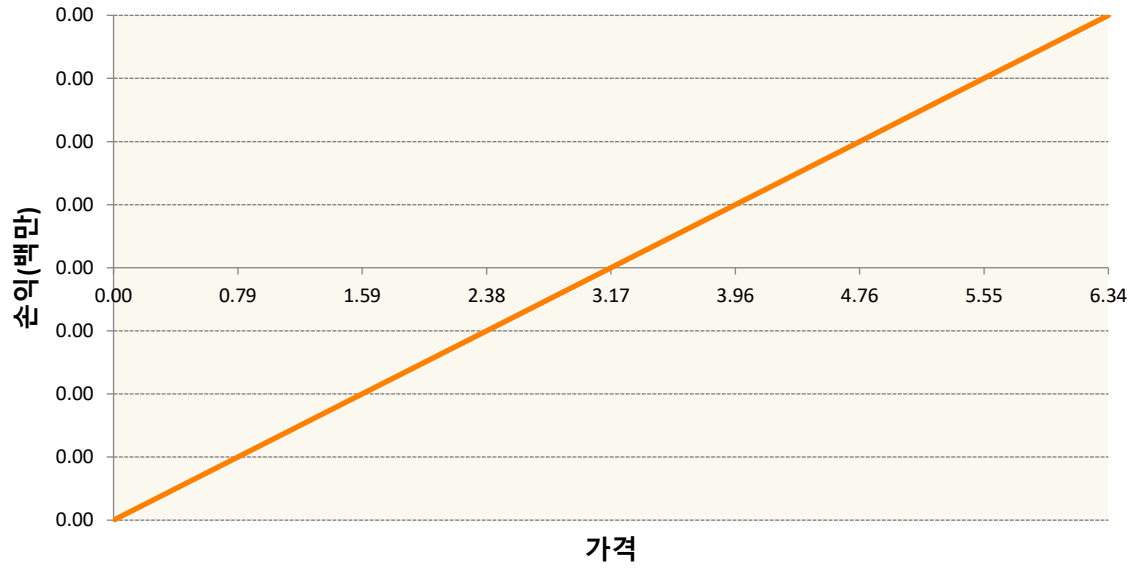
HOX3-NY Harb ULSD Fut Nov23



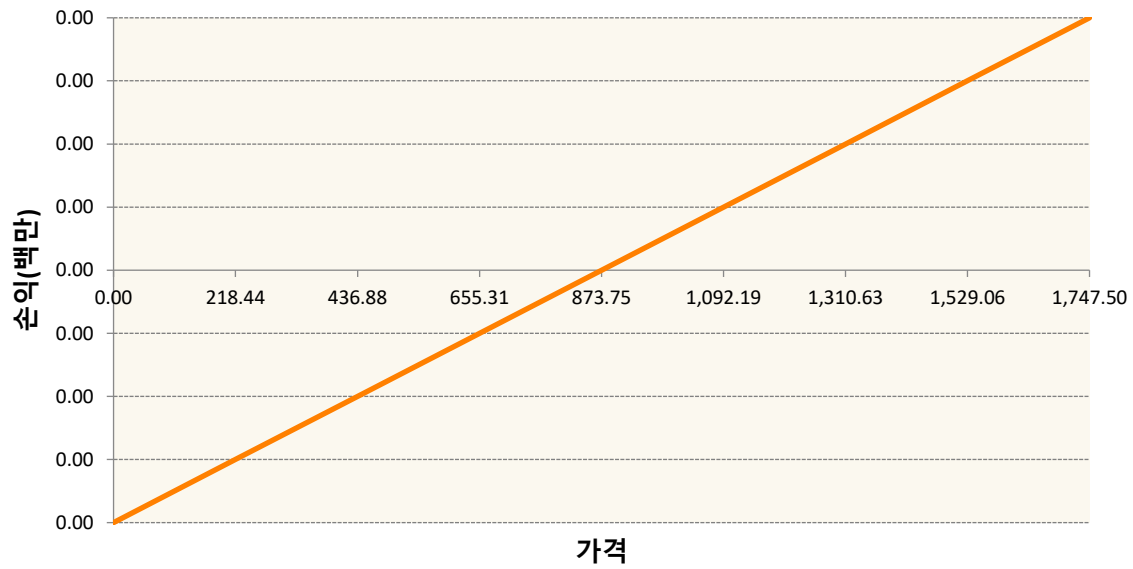
KR4175T90007-2023-09 달러선물

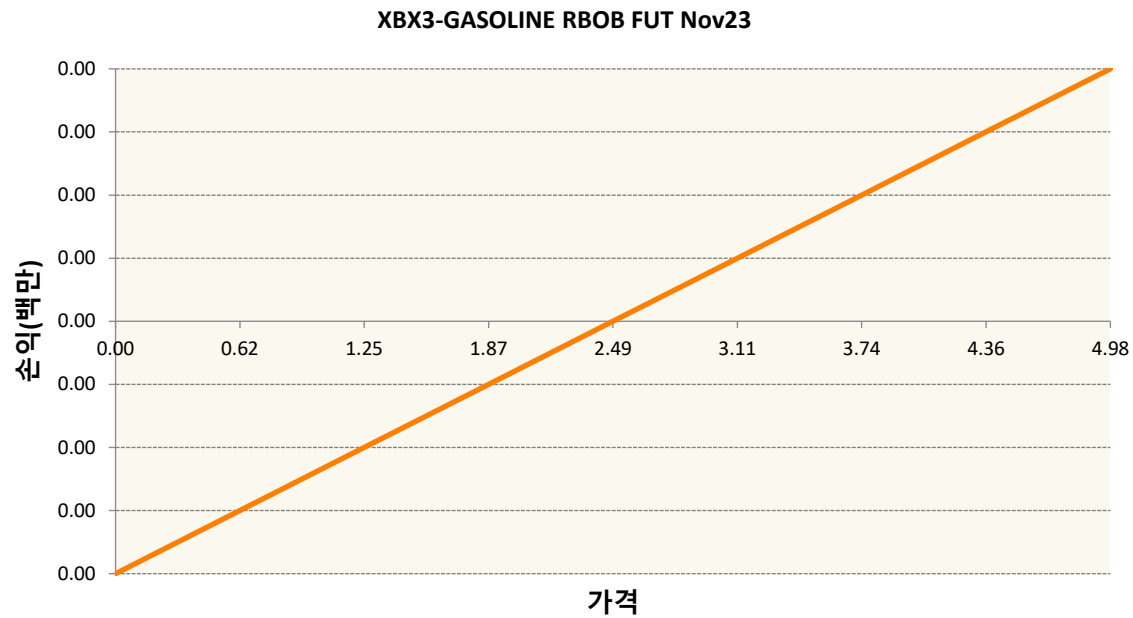


NGX23-NATURAL GAS FUTR Nov23



QSX3-Low Su Gasoil G Nov23





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
CLX3	WTI CRUDE FUTURE Nov23	25
COX3	BRENT CRUDE FUTR Nov23	26
ECX3	E-MINI CRUDE OIL Nov23	8
EOX3	E-MINI NATURAL GAS Nov23	2
HOX3	NY Harb ULSD Fut Nov23	13
KR4175T900 2023-09 달러선물		21
NGX23	NATURAL GAS FUTR Nov23	23
QSX3	Low Su Gasoil G Nov23	9
XBX3	GASOLINE RBOB FUT Nov23	11

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	314