

공시일	2023-08-29
기준일	2023-08-28

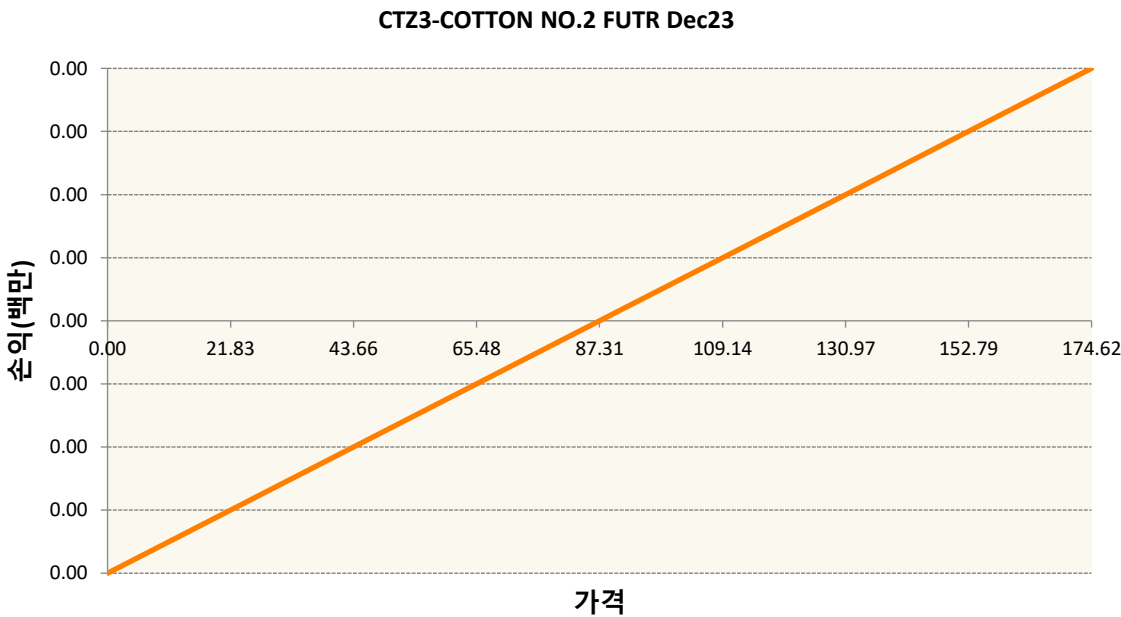
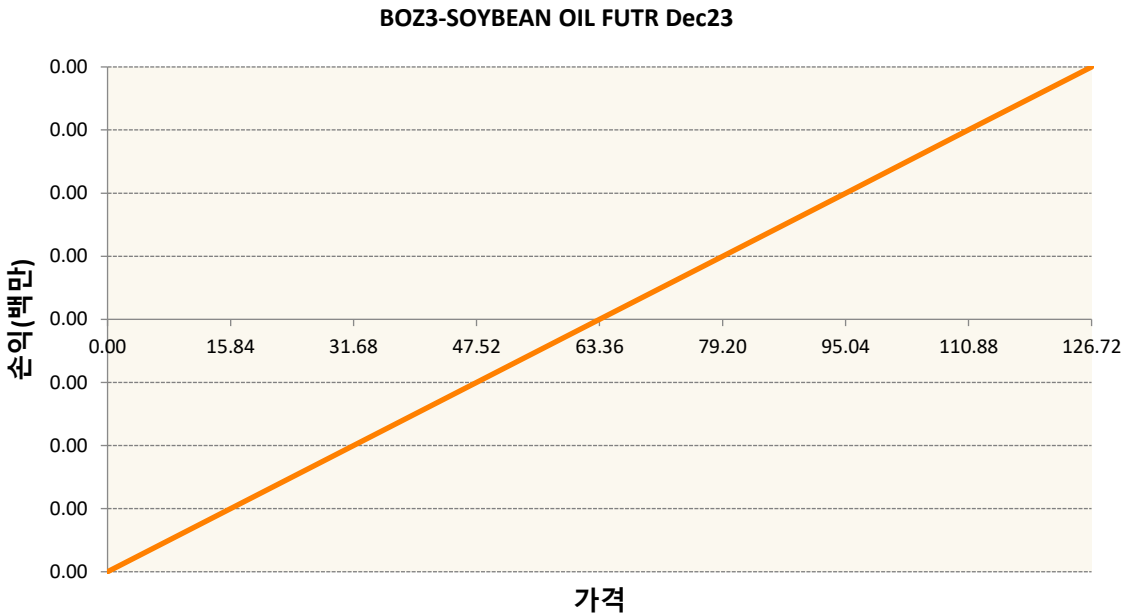
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

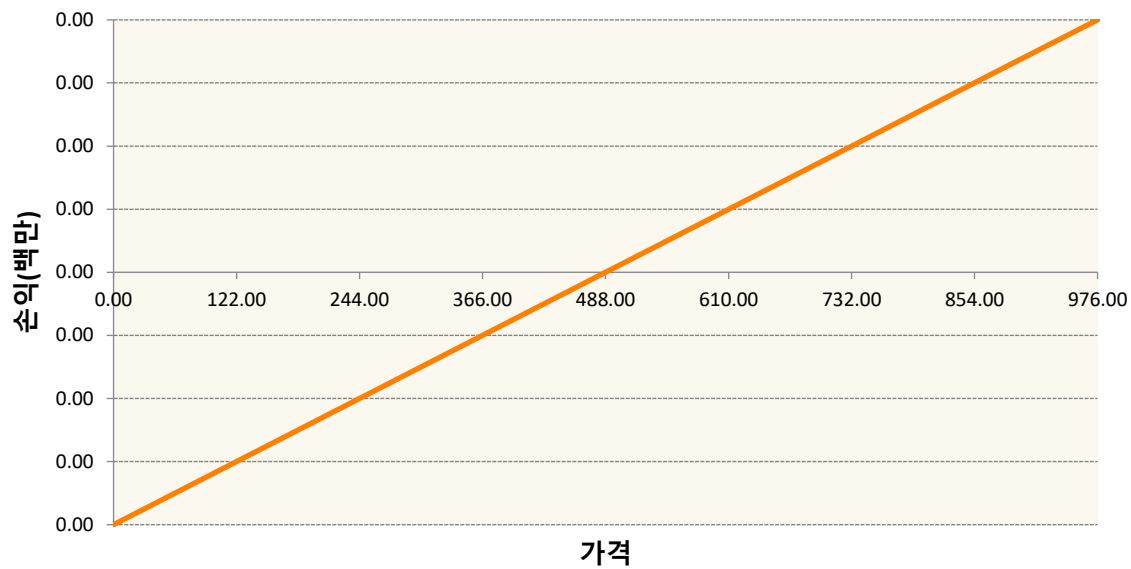
(단위:USD 백만)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,099	541	4,557	

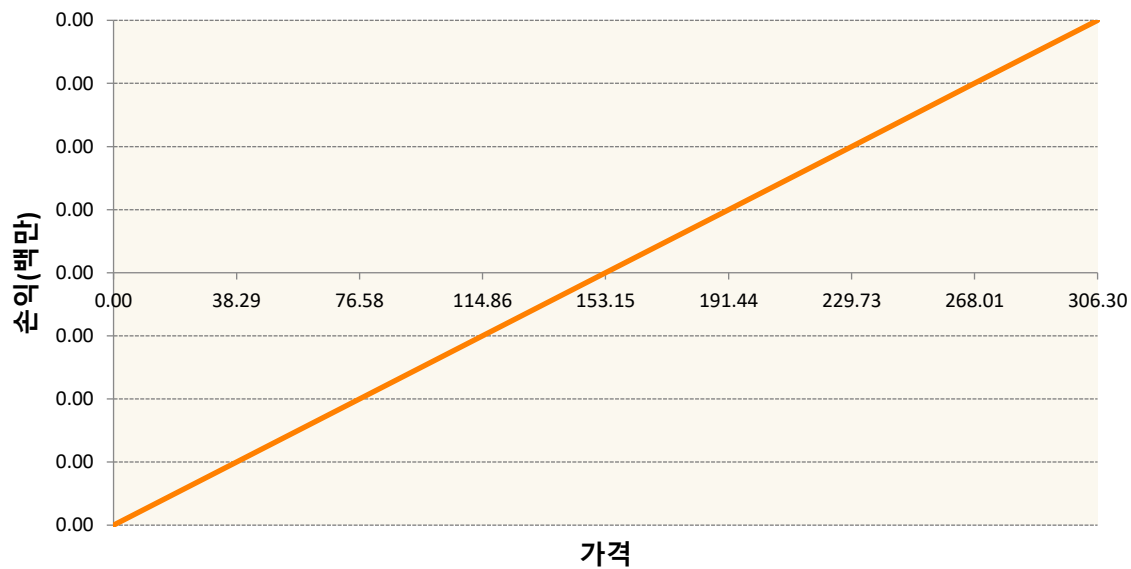
2. 만기시점의 손익구조



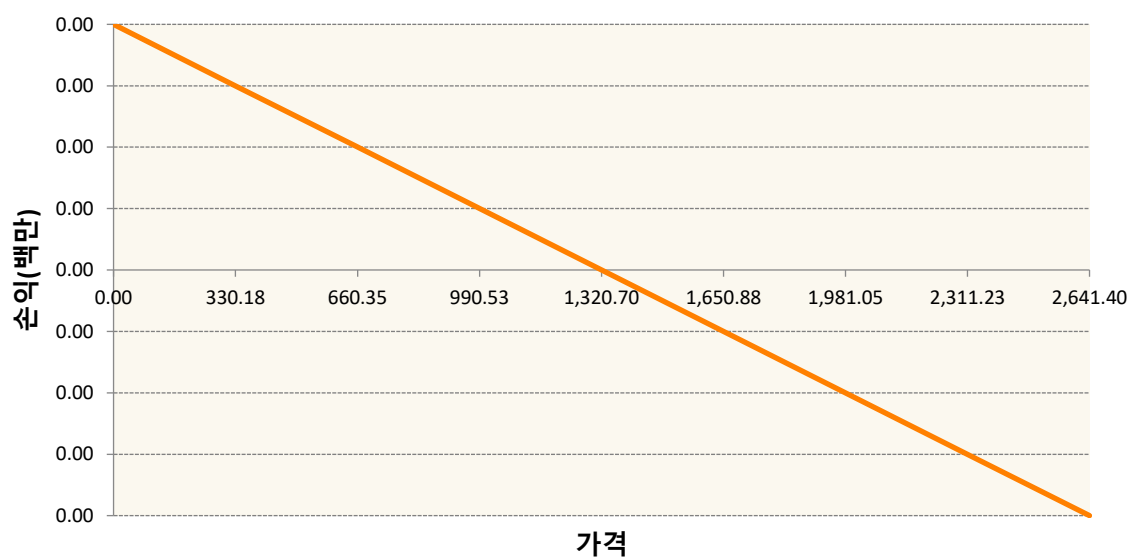
CZ3-CORN FUTURE Dec23



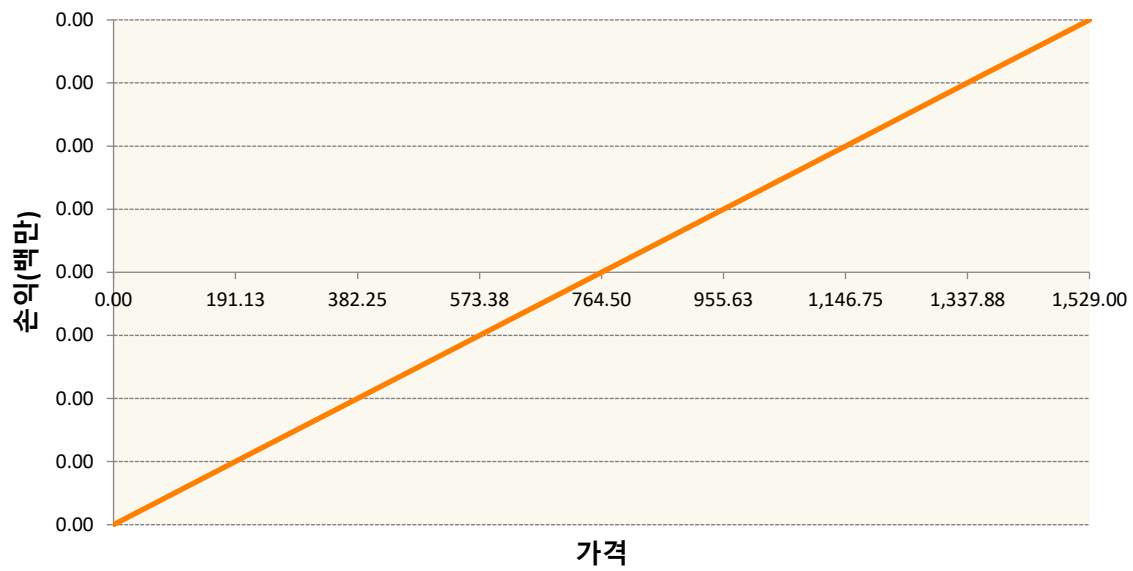
KCZ3-COFFEE 'C' FUTURE DEC23



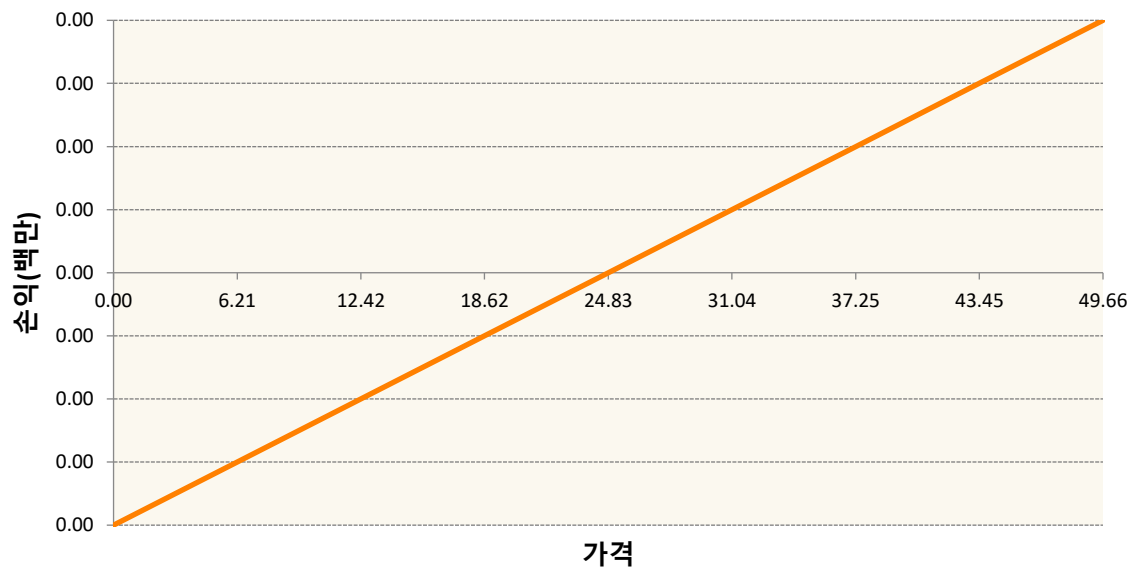
KR4175T90007-2023-09 달러선물



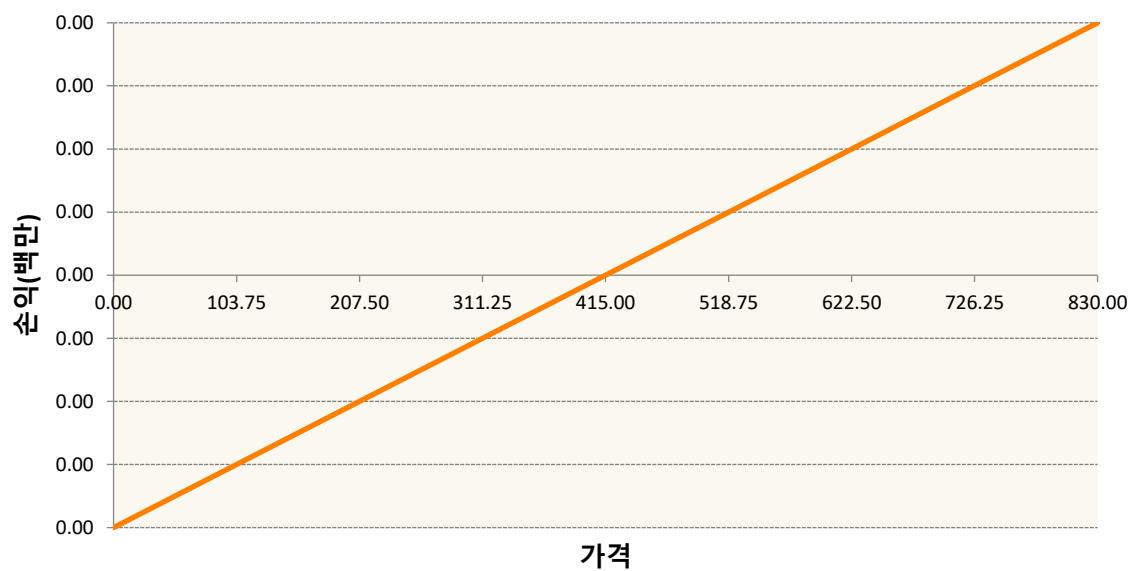
KWZ3-KC HRW WHEAT FUT DEC23

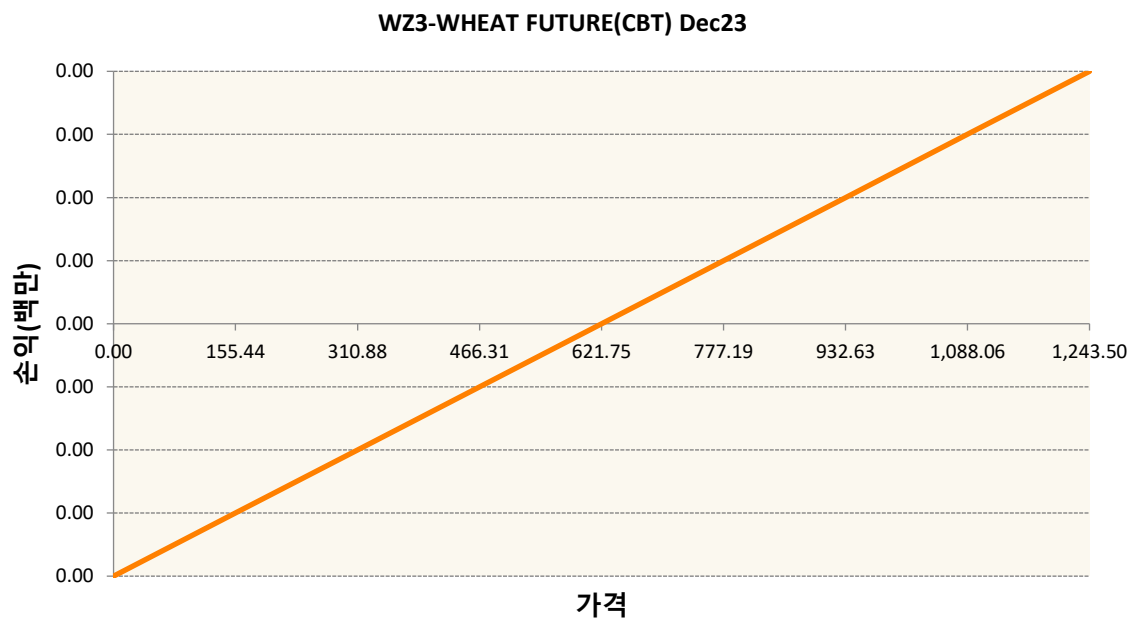
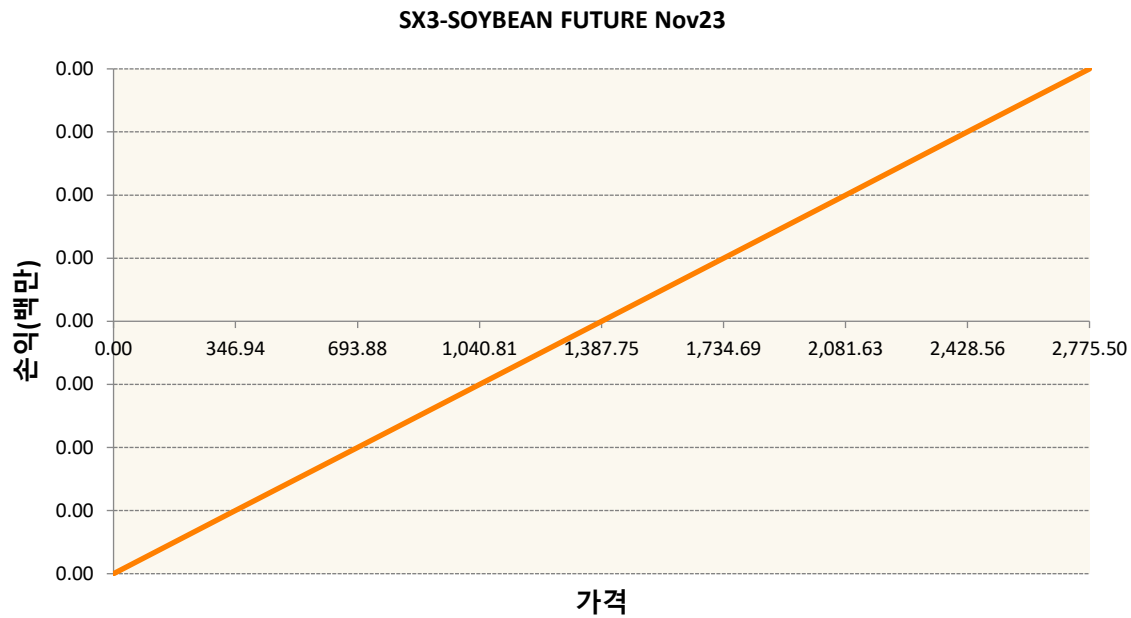


SBV3-Sugar #11 (WORLD) Oct23



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	2023-08-29
기준일	2023-08-28

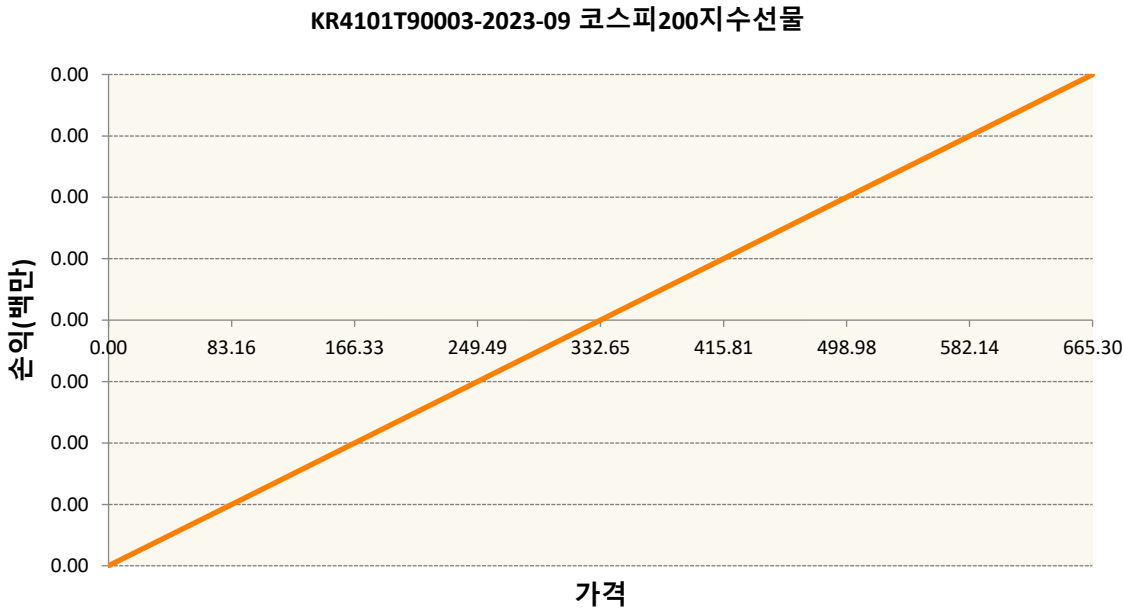
스마트인덱스모

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	1,580	0	1,580	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101T90003			2023-09 코스피200지수선물				126
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-126	-126	-126	-126	-126	-126	-126
-5.33%	-84	-84	-84	-84	-84	-84	-84
-2.67%	-42	-42	-42	-42	-42	-42	-42
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	42	42	42	42	42	42	42
5.33%	84	84	84	84	84	84	84
8.00%	126	126	126	126	126	126	126

공시일	2023-08-29
기준일	2023-08-28

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	312
-----------------------------	-----

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

316

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2023-08-29
기준일	2023-08-28

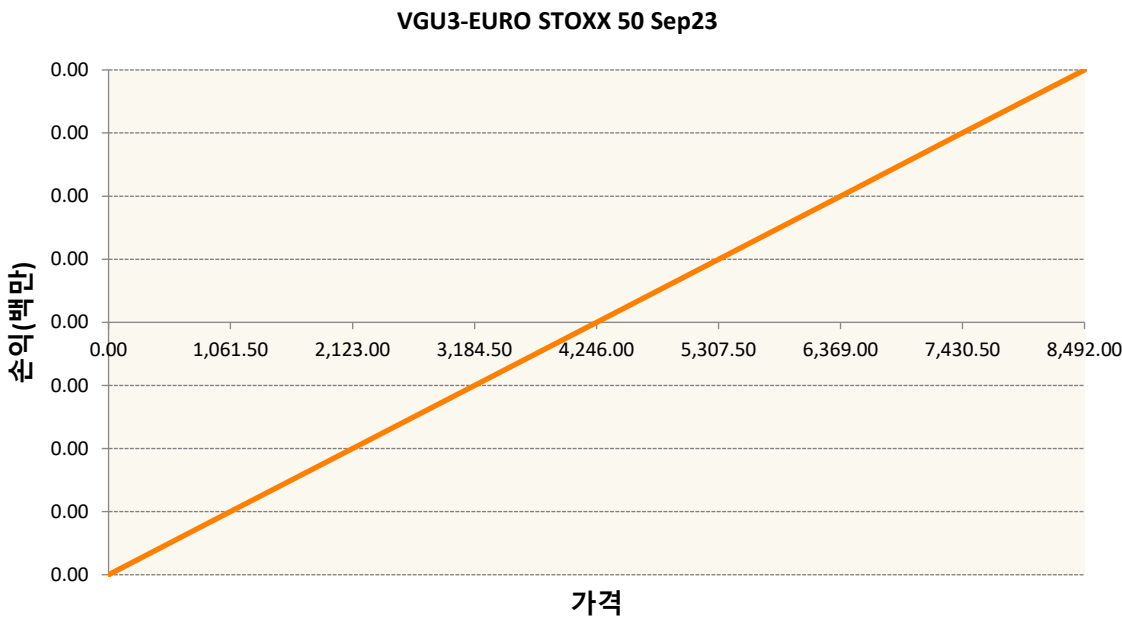
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	351	0	351	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

25

공시일	2023-08-29
기준일	2023-08-28

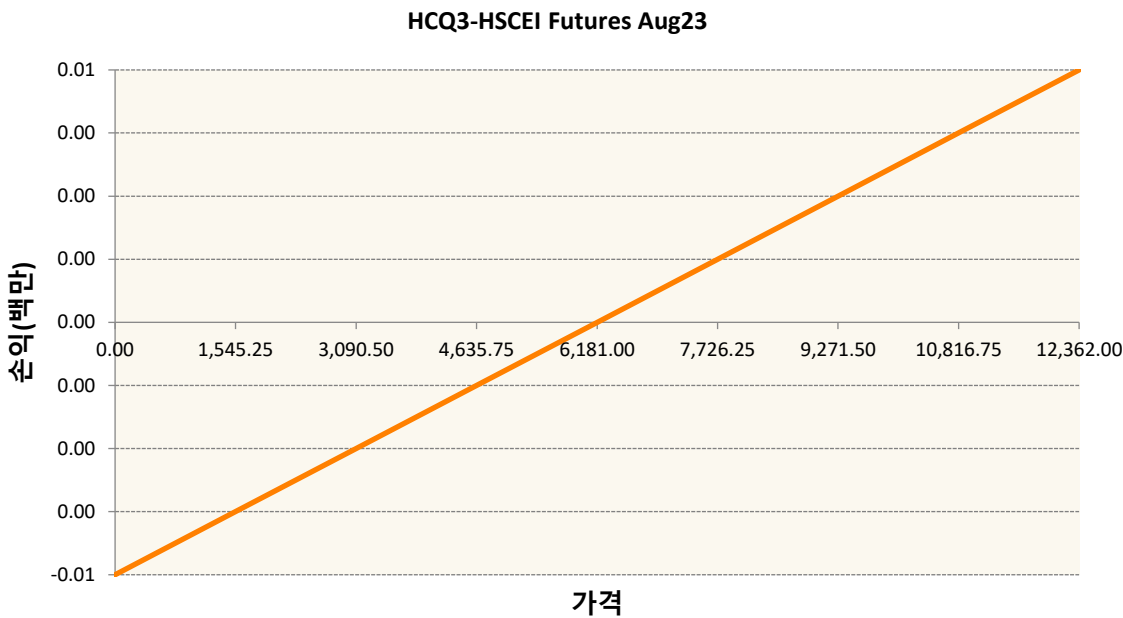
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,110	0	1,110	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCQ3	HSCEI Futures Aug23	89
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

137

공시일	2023-08-29
기준일	2023-08-28

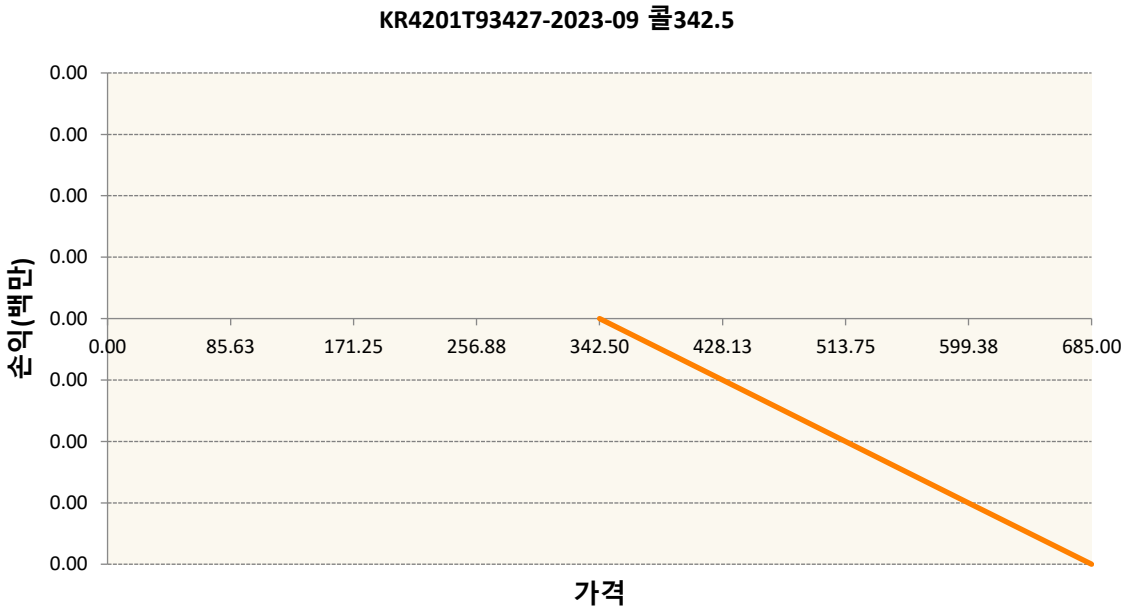
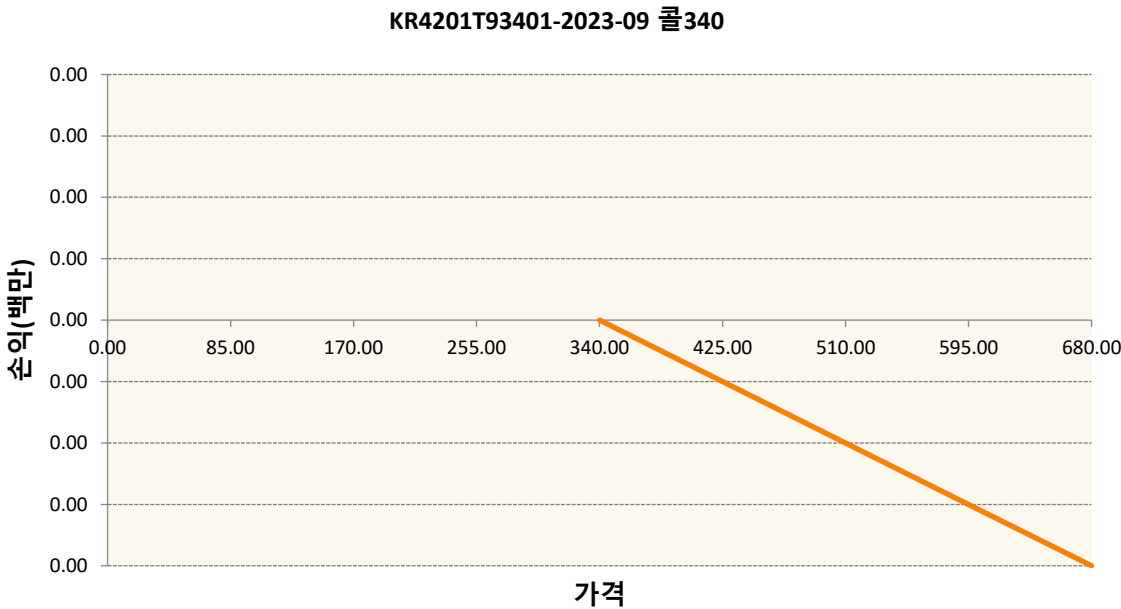
커버드콜모(주식혼합-파생형)

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					1,835
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	402	400	396	390	381	370	356
-5.33%	391	381	367	349	328	303	275
-2.67%	336	307	274	237	198	157	113
0%	159	107	54	0	-55	-110	-166
2.67%	-227	-287	-347	-407	-467	-526	-586
5.33%	-844	-891	-939	-990	-1,042	-1,095	-1,149
8.00%	-1,631	-1,655	-1,684	-1,718	-1,754	-1,793	-1,835
KR4201T93427		2023-09 콜342.5					485
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	92	91	91	89	88	85	82
-5.33%	90	88	85	81	76	70	63
-2.67%	79	73	65	56	46	36	25
0%	41	28	14	0	-15	-30	-45
2.67%	-50	-67	-84	-101	-118	-135	-152
5.33%	-207	-222	-237	-252	-268	-284	-300
8.00%	-418	-427	-437	-448	-459	-472	-485
KR4301T93409		2023-09 풋340					664
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-651	-652	-653	-655	-657	-660	-664
-5.33%	-400	-403	-407	-412	-418	-424	-432
-2.67%	-160	-169	-178	-188	-199	-211	-223
0%	45	30	15	0	-15	-31	-47

2.67%	191	174	157	141	124	107	90
5.33%	273	260	246	232	217	202	187
8.00%	307	300	292	282	272	261	249

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

(단위:백만원)

2,873

공시일	2023-08-29
기준일	2023-08-28

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	4,556	0	4,556	

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	2023-08-29
기준일	2023-08-28

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	4,630	0	4,630	

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	2023-08-29
기준일	2023-08-28

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	17,696	0	17,696	
누계	통화	선도	1,323	18,892	-17,568	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
FXW213D5S(KRW/USD 31-08-23E		692
FXW213D6S(KRW/USD 27-09-23E		556
FXW213D7T(KRW/USD 31-10-23E		263
FXW213D81(USD/KRW 31-08-23E		32
FXW213D84(USD/KRW 31-08-23E		42
FXW213D8J(USD/KRW 31-08-23E		32
IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	938

공시일	2023-08-29
기준일	2023-08-28

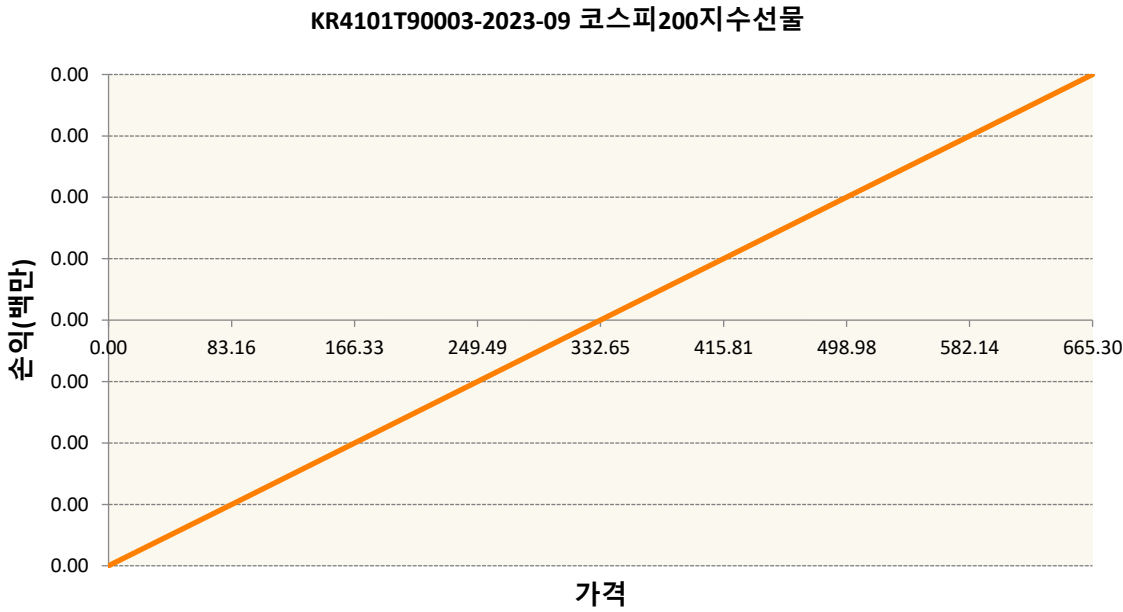
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

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	665	0	665	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101T90003			2023-09 코스피200지수선물				53
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-53	-53	-53	-53	-53	-53	-53
-5.33%	-35	-35	-35	-35	-35	-35	-35
-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%	35	35	35	35	35	35	35
8.00%	53	53	53	53	53	53	53

공시일	2023-08-29
기준일	2023-08-28

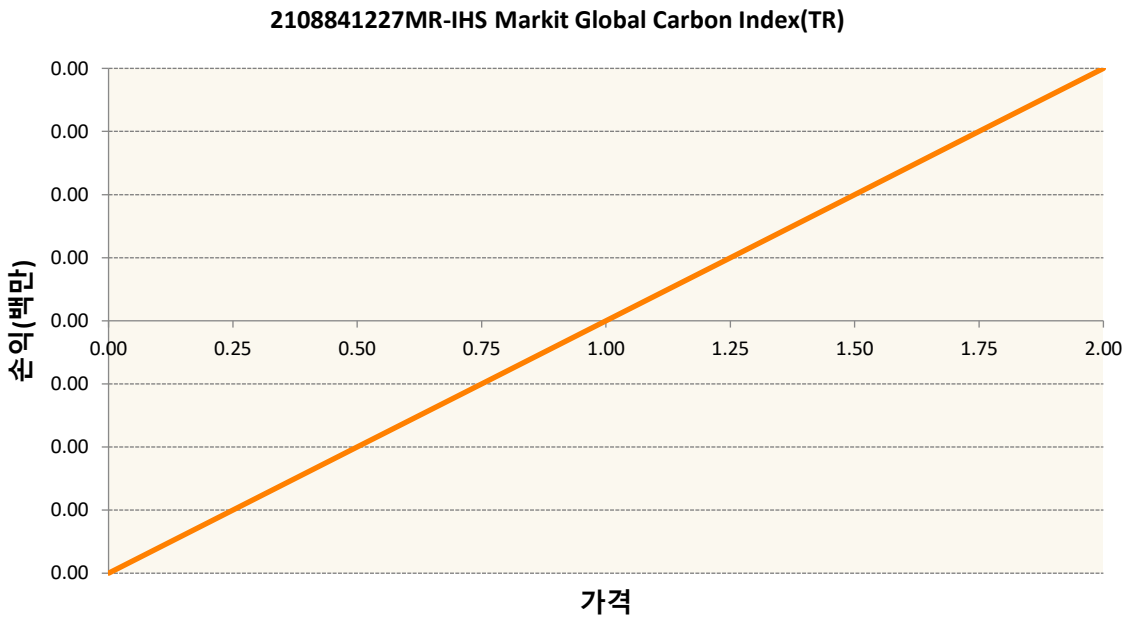
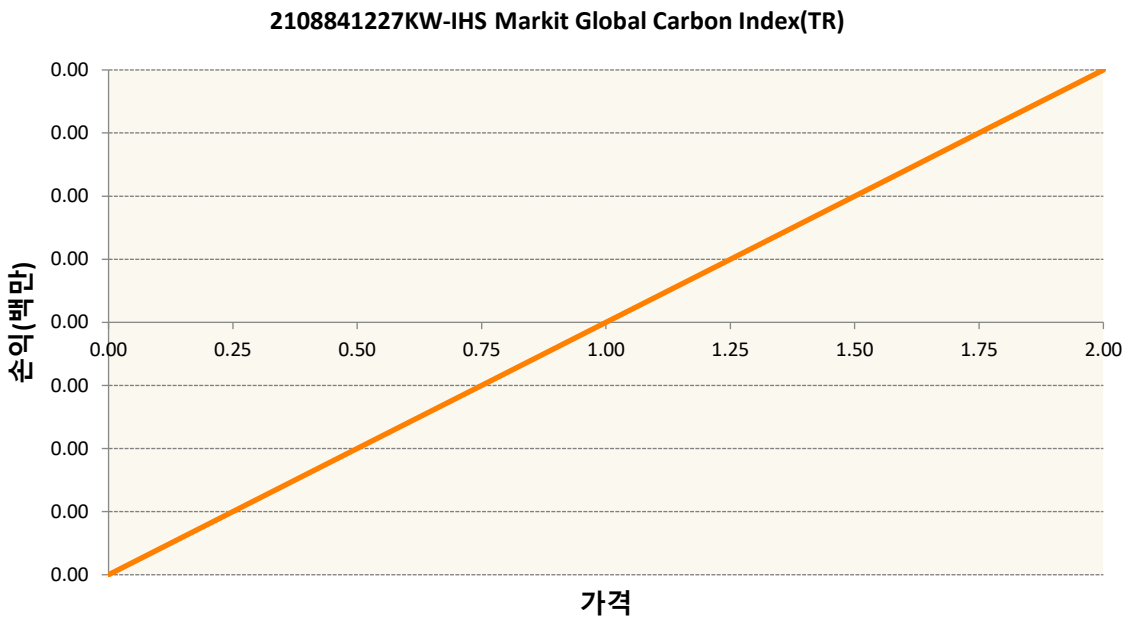
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

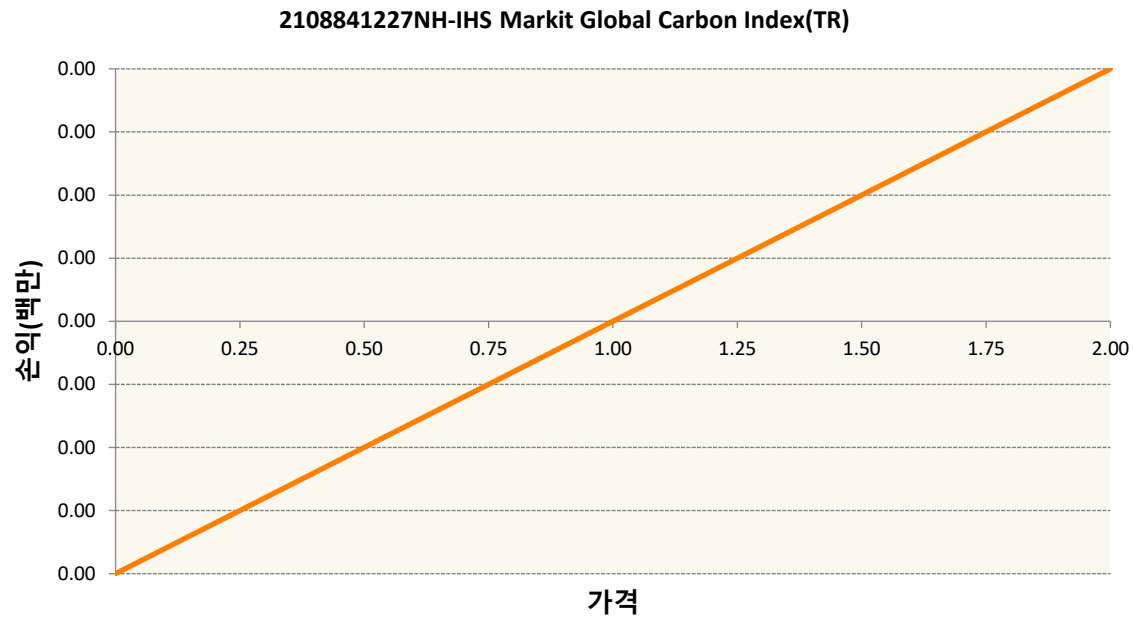
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	26,273	0	26,273	

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108841227IHS Markit Global Carbon Index(TR)		1,786
2108841227IHS Markit Global Carbon Index(TR)		210
2108841227IHS Markit Global Carbon Index(TR)		105

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)		(단위:백만원)
		2,995

공시일 2023-08-29

기준일 2023-08-28

SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

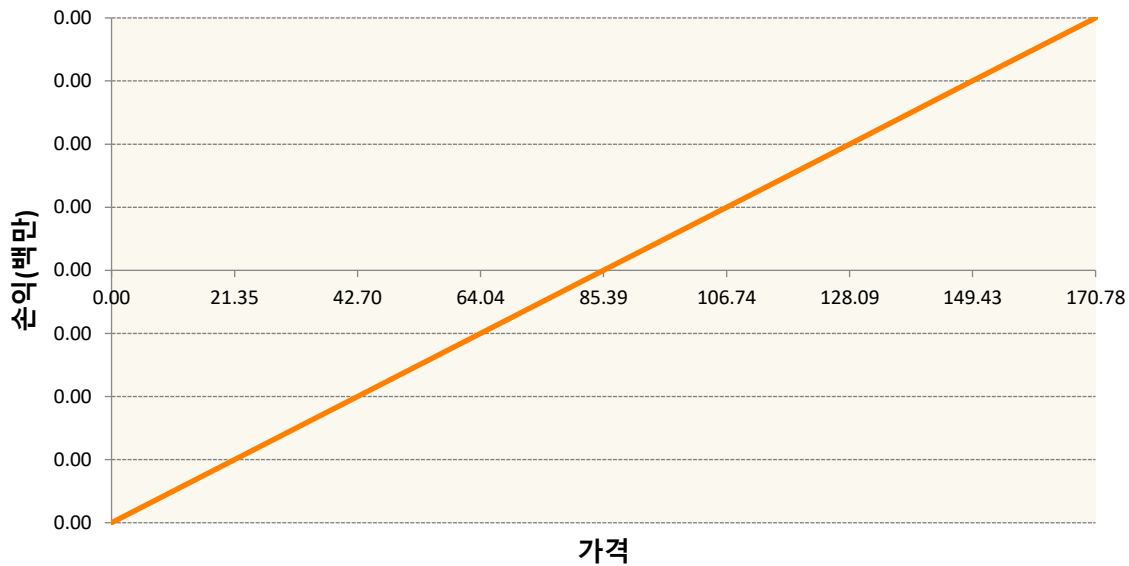
1. 계약금액

(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	8,516	0	8,516	
누계	통화	선도	600	2,496	-1,896	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	34
FXW213D7T(KRW/EUR 31-08-23E	62
FXW213D7T(KRW/EUR 31-08-23E	80
FXW213D82(EUR/KRW 31-08-23E	48
MOZ23 ECX EMISSION Dec23	681

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

(단위:백만원)

1,542

공시일	2023-08-29
기준일	2023-08-28

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)	26
SWCSI00000 신한CSI Index 230622 (키움)	26
SWCSI00000 신한CSI Index 230622 (미래)	26
SWCSI00000 신한CSI Index 230622 (메리츠)	26

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

(단위:백만원)

168

공시일	2023-08-29
기준일	2023-08-28

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)	24
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 230116(메리츠)	33
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 230116(미래)	28
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 230427(키움)	7

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

(단위:백만원)

112

공시일	2023-08-29
기준일	2023-08-28

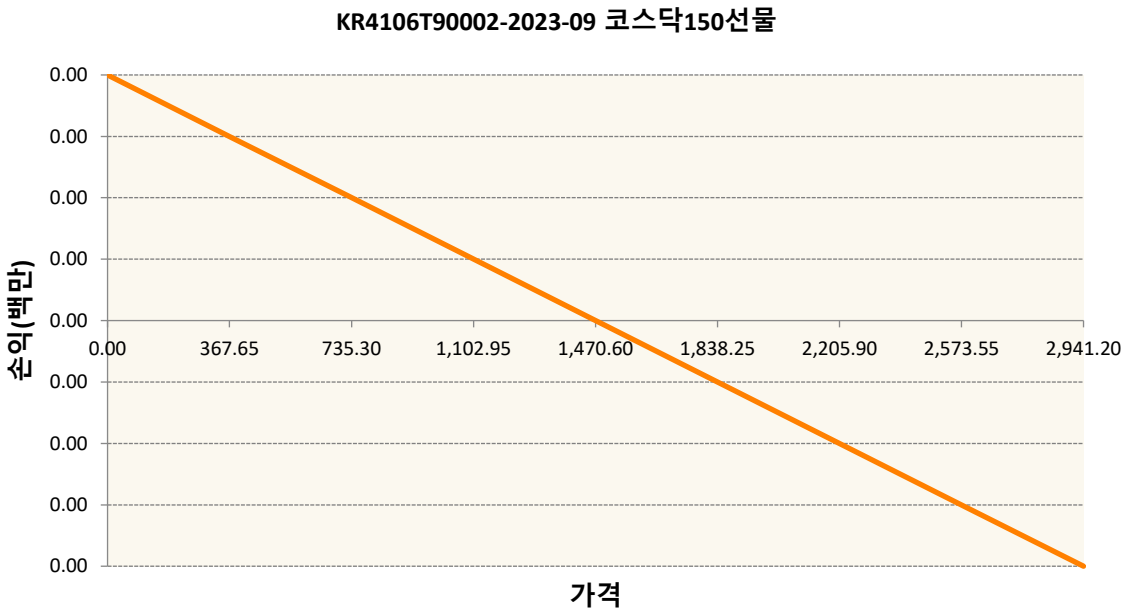
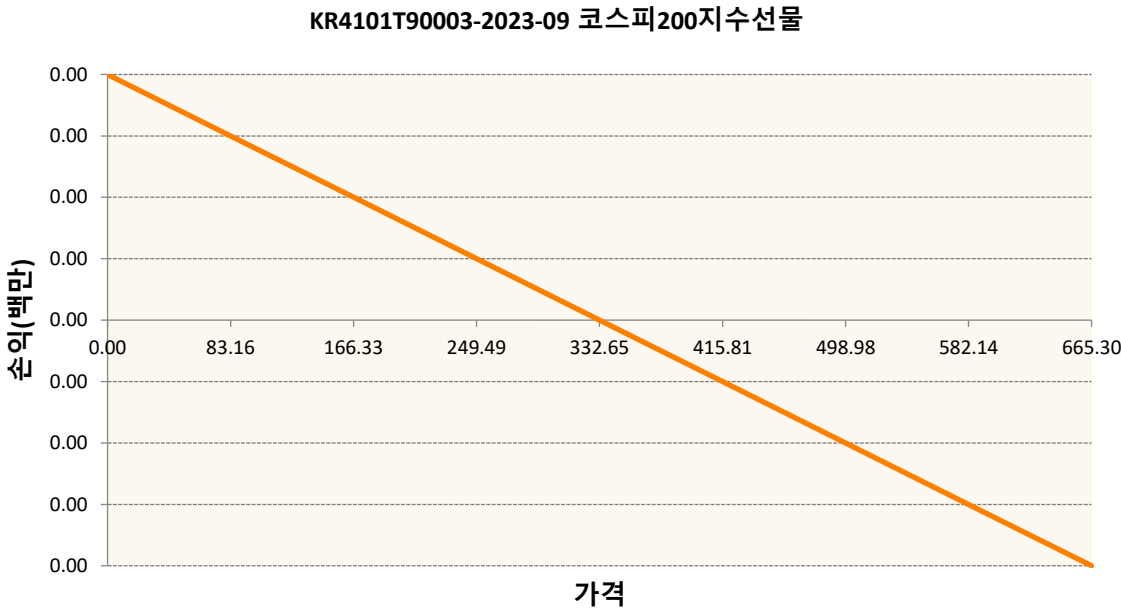
에퀴티알파일반사모혼합자산

1. 계약금액

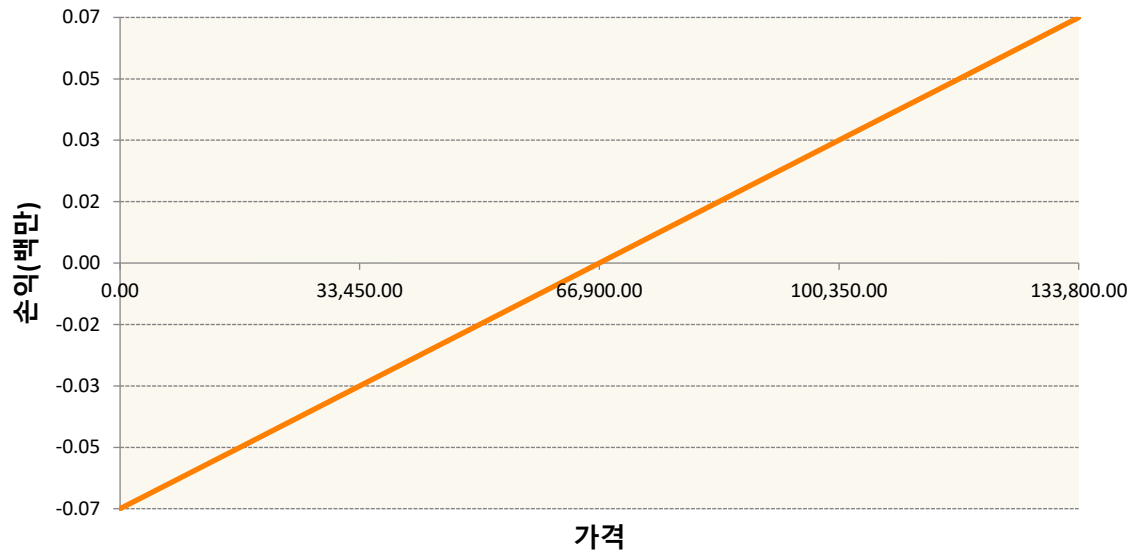
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	187	-187	장내
누계	유가증권	선물	1,956	3,121	-1,165	장내

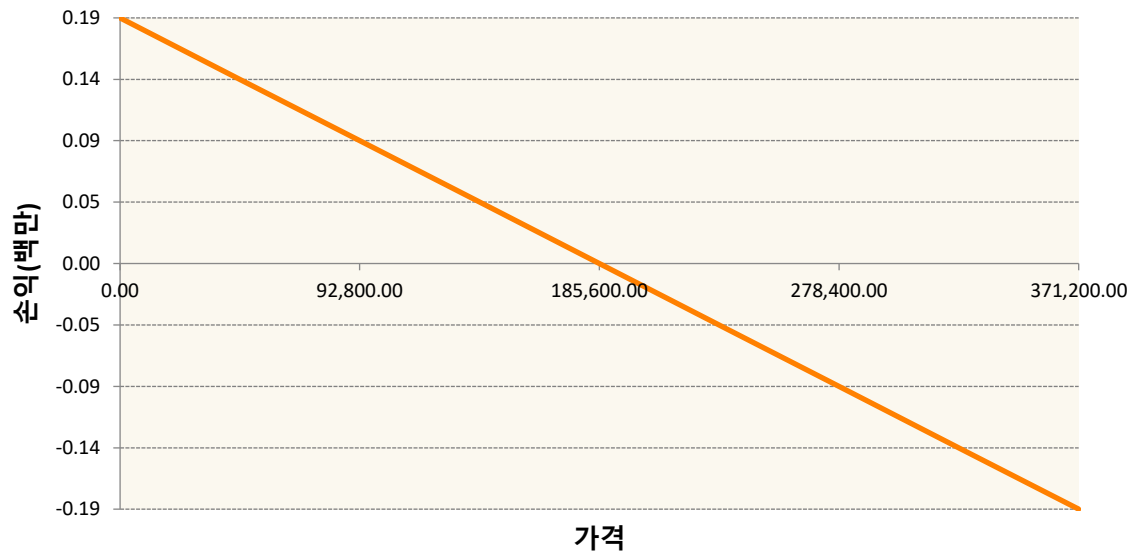
2. 만기시점의 손익구조



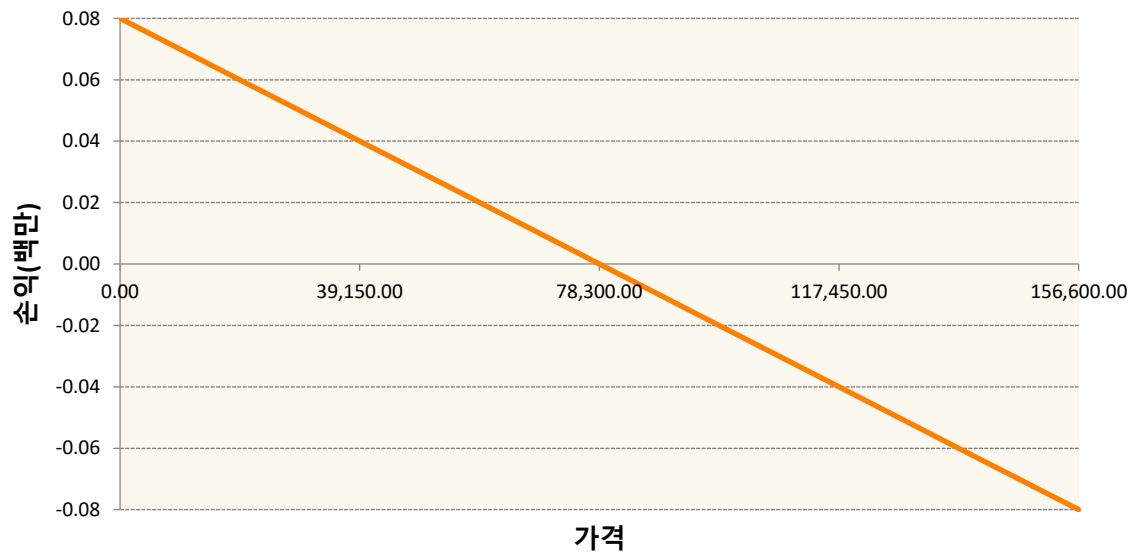
KR4111T90002-2023-09 삼성전자개별선물



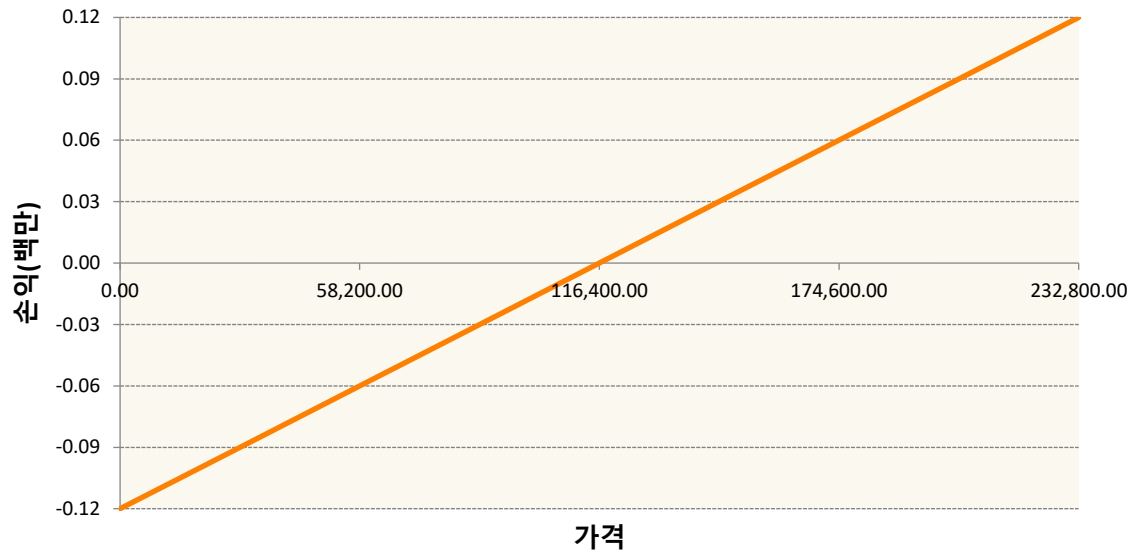
KR4116T90001-2023-09 현대차개별선물



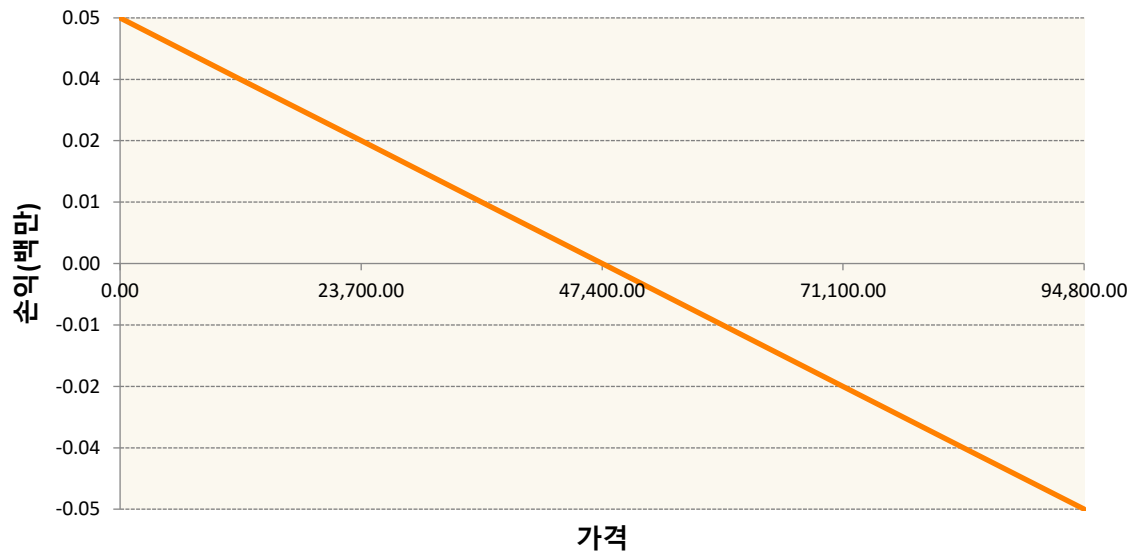
KR4119T90005-2023-09 기아개별선물



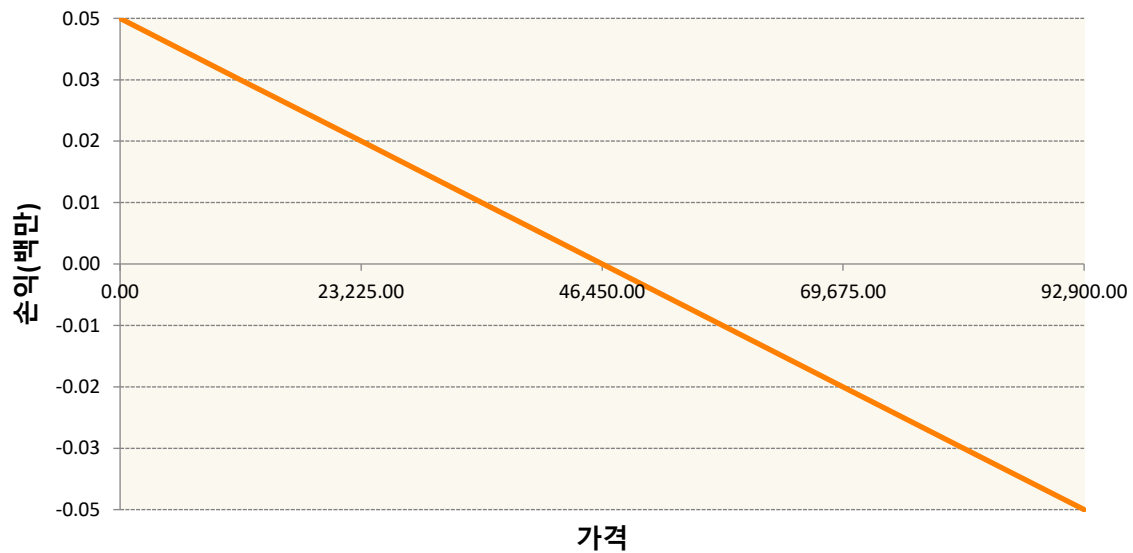
KR4150T90000-2023-09 SK하이닉스개별선물



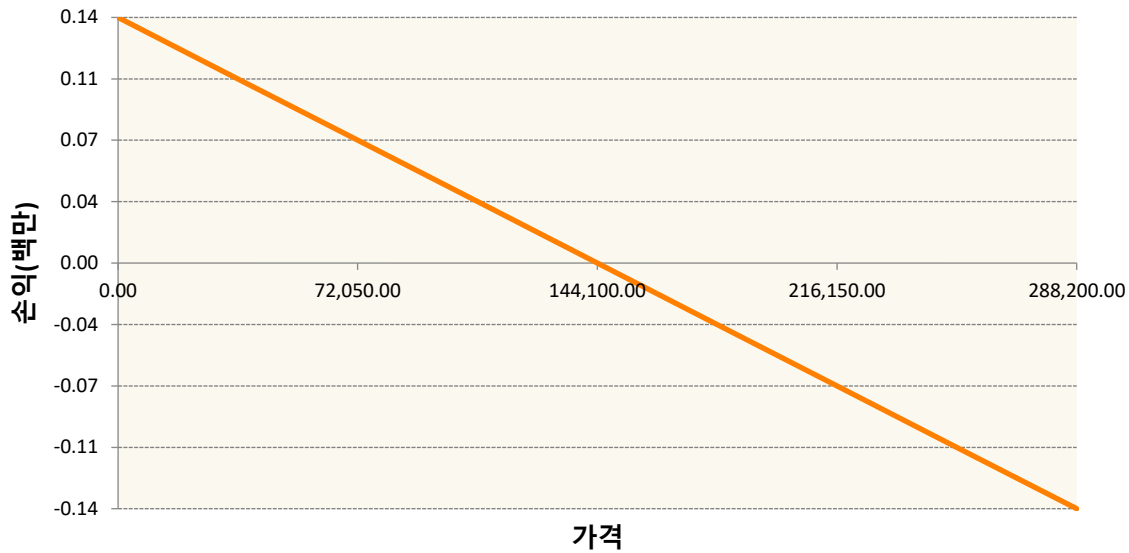
KR41CNT90002-2023-09 포스코 ICT개별선물



KR41CNTA0000-2023-10 포스코DX개별선물



KR41CPT90007-2023-09 셀트리온개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101T900 2023-09 코스피200지수선물	100
KR4106T900 2023-09 코스닥150선물	119
KR4111T900 2023-09 삼성전자개별선물	119
KR4116T900 2023-09 현대차개별선물	7
KR4119T900 2023-09 기아개별선물	7
KR4150T900 2023-09 SK하이닉스개별선물	38
KR41CNT900 2023-09 포스코 ICT개별선물	1
KR41CNTA00 2023-10 포스코DX개별선물	2
KR41CPT900 2023-09 셀트리온개별선물	14

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

(단위:백만원)

603

공시일	2023-08-29
기준일	2023-08-28

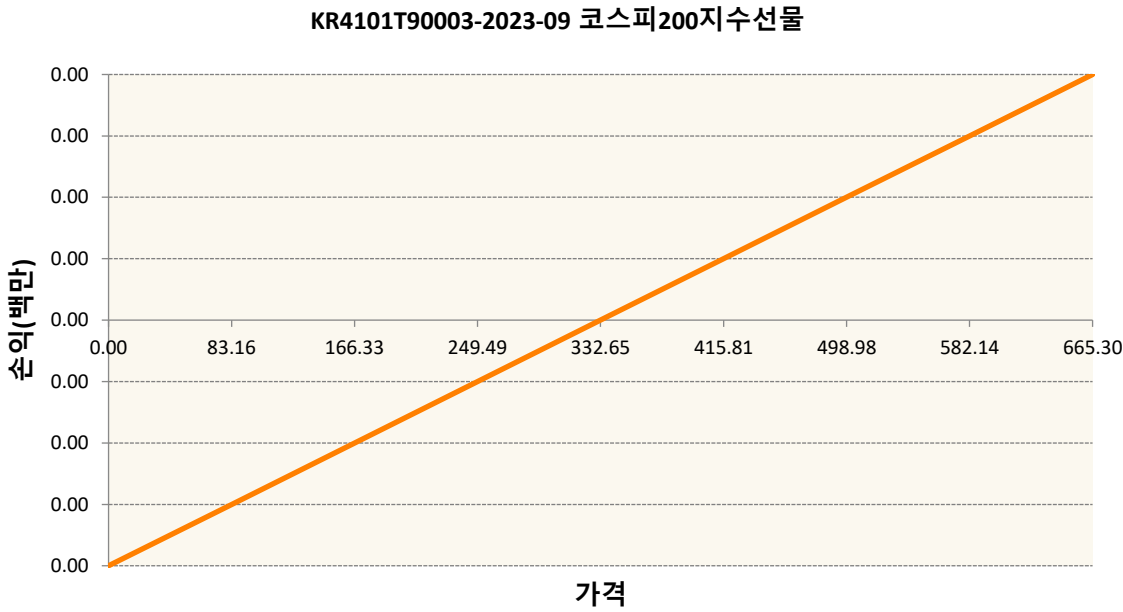
코리아인텍스(주식-파생형)(종)

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	1,497	0	1,497	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101T90003			2023-09 코스피200지수선물				120
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-120	-120	-120	-120	-120	-120	-120
-5.33%	-80	-80	-80	-80	-80	-80	-80
-2.67%	-40	-40	-40	-40	-40	-40	-40
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	40	40	40	40	40	40	40
5.33%	80	80	80	80	80	80	80
8.00%	120	120	120	120	120	120	120

공시일	2023-08-29
기준일	2023-08-28

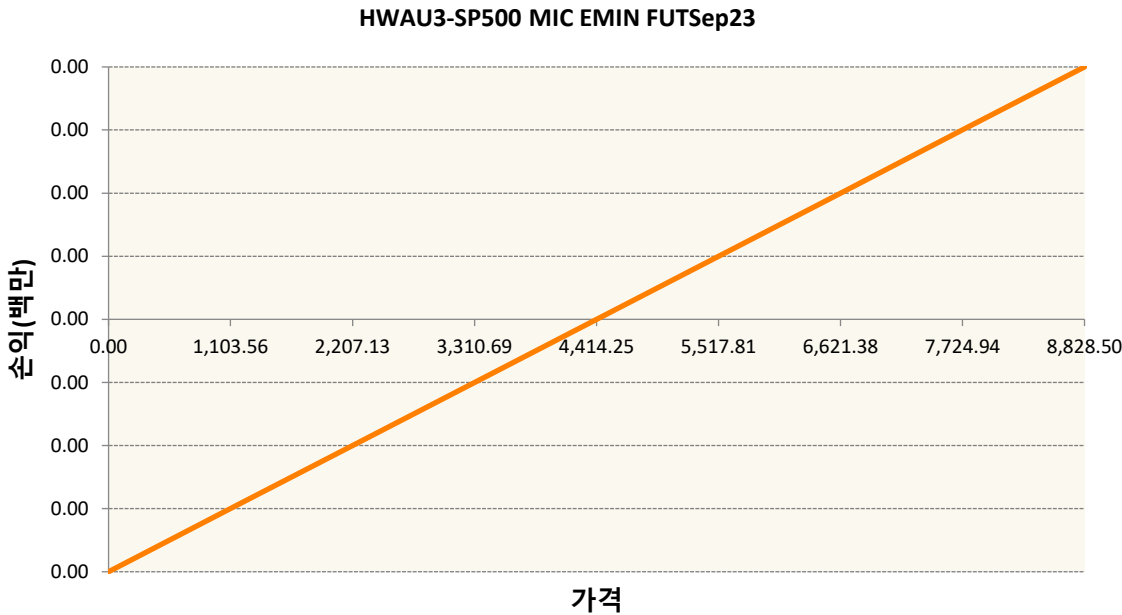
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

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	1,019	0	1,019	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HWAU3	SP500 MIC EMIN FUTSep23	82
-------	-------------------------	----

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

(단위:백만원)

82

공시일	2023-08-29
기준일	2023-08-28

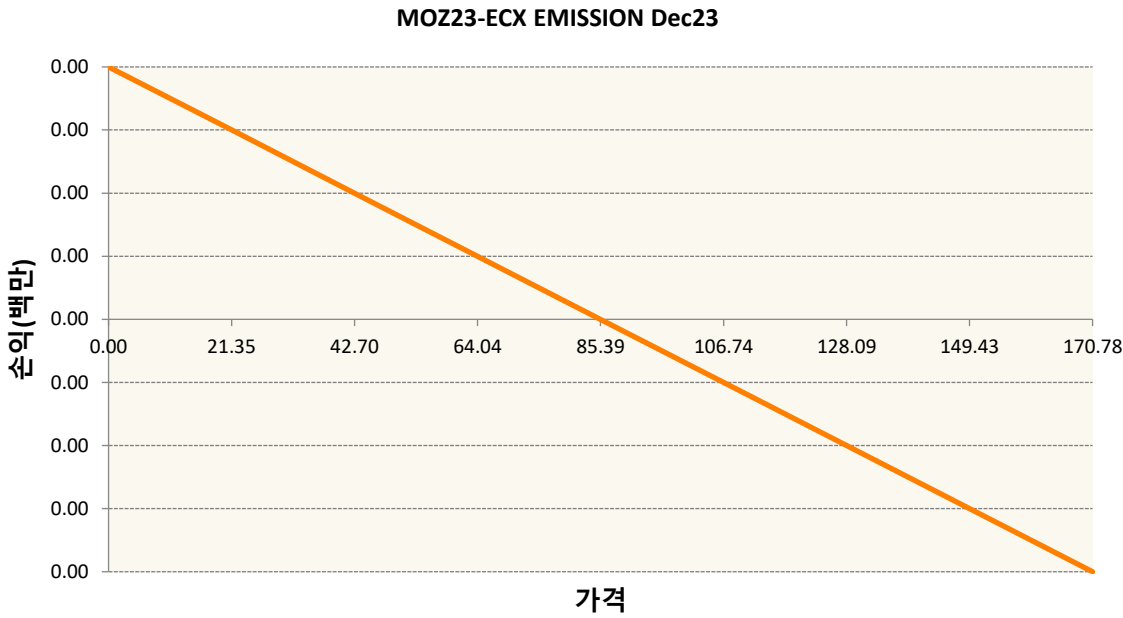
SOL유럽탄소배출권선물인버스ICE특별자산상

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	8,807	-8,807	
누계	통화	선도	0	1,933	-1,933	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213D7T(KRW/EUR 31-08-23E	17
FXW213D7T(KRW/EUR 31-08-23E	34
FXW213D7T(KRW/EUR 31-08-23E	34
FXW213D7T(KRW/EUR 31-08-23E	69
MOZ23 ECX EMISSION Dec23	705

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

(단위:백만원)

1,516

공시일	2023-08-29
기준일	2023-08-28

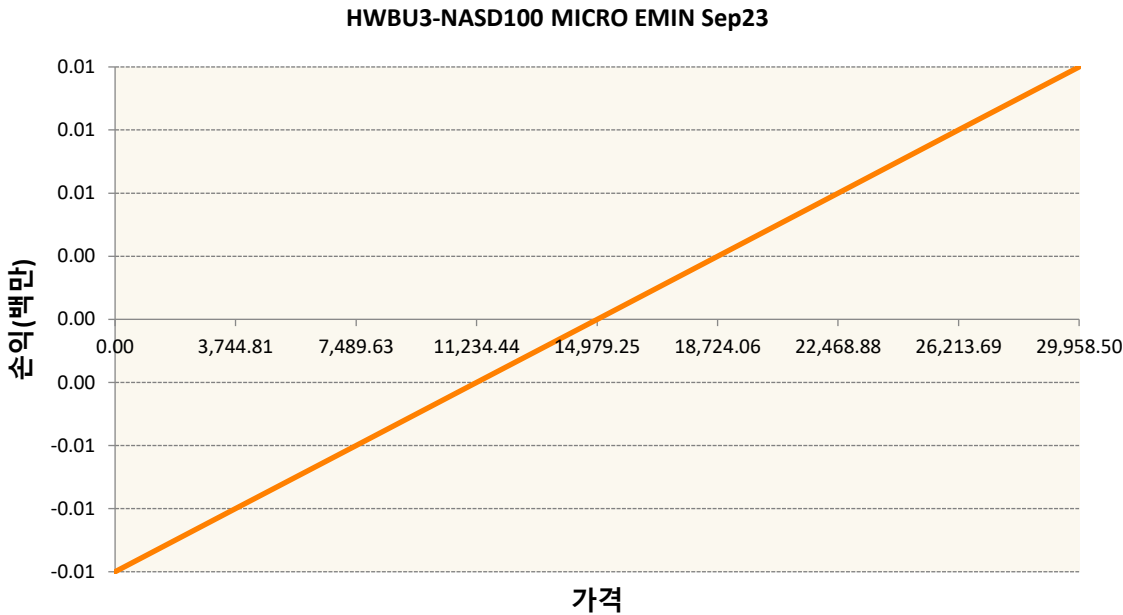
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

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	1,001	0	1,001	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HWBU3 NASD100 MICRO EMIN Sep23

80

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

(단위:백만원)

81

공시일	2023-08-29
기준일	2023-08-28

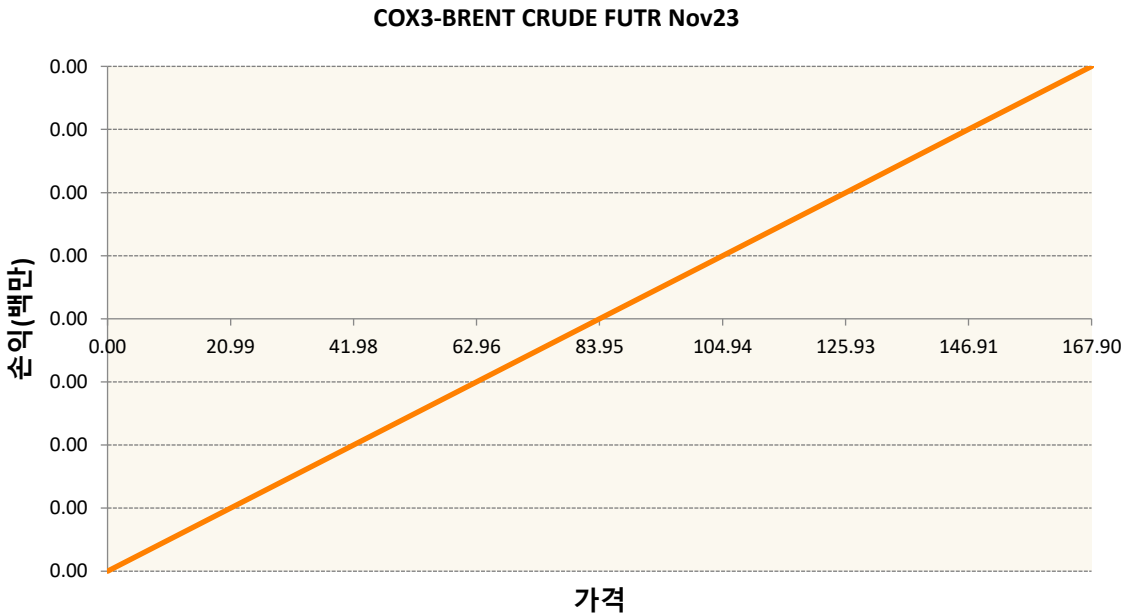
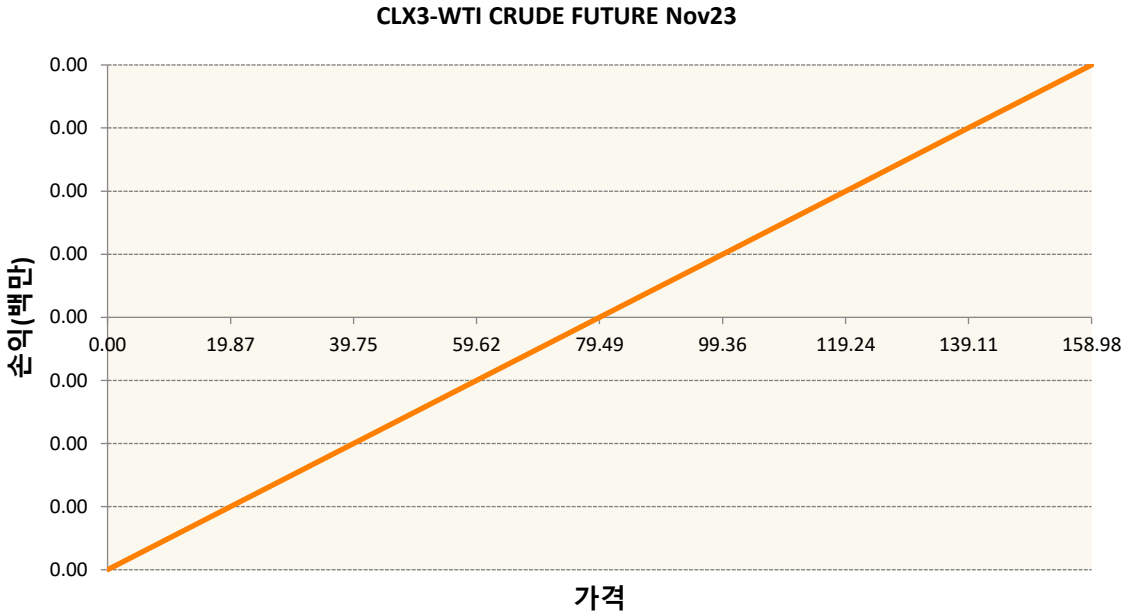
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

1. 계약금액

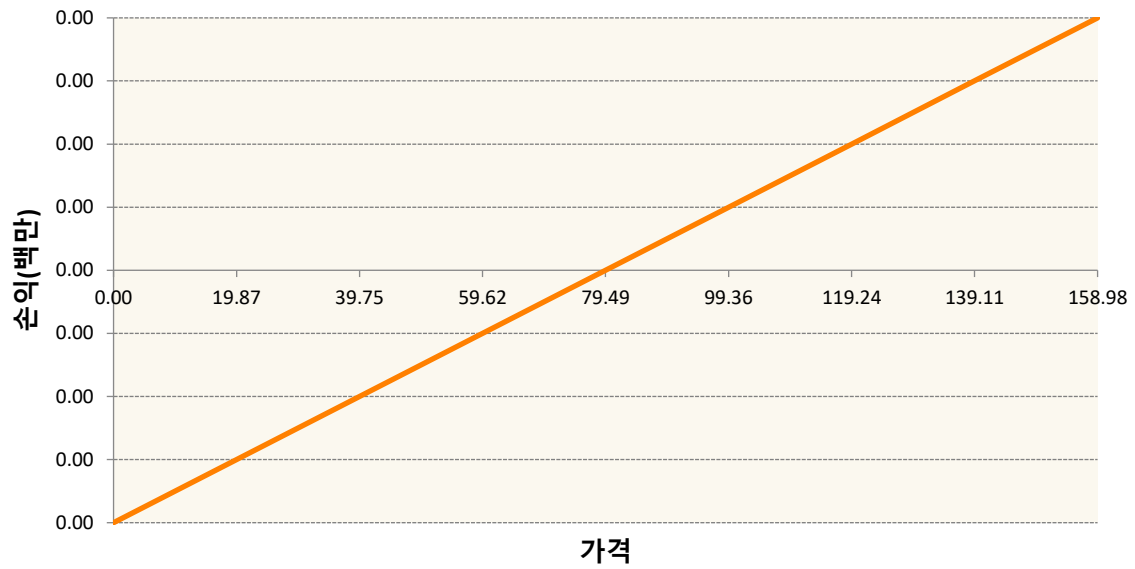
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,520	291	1,229	

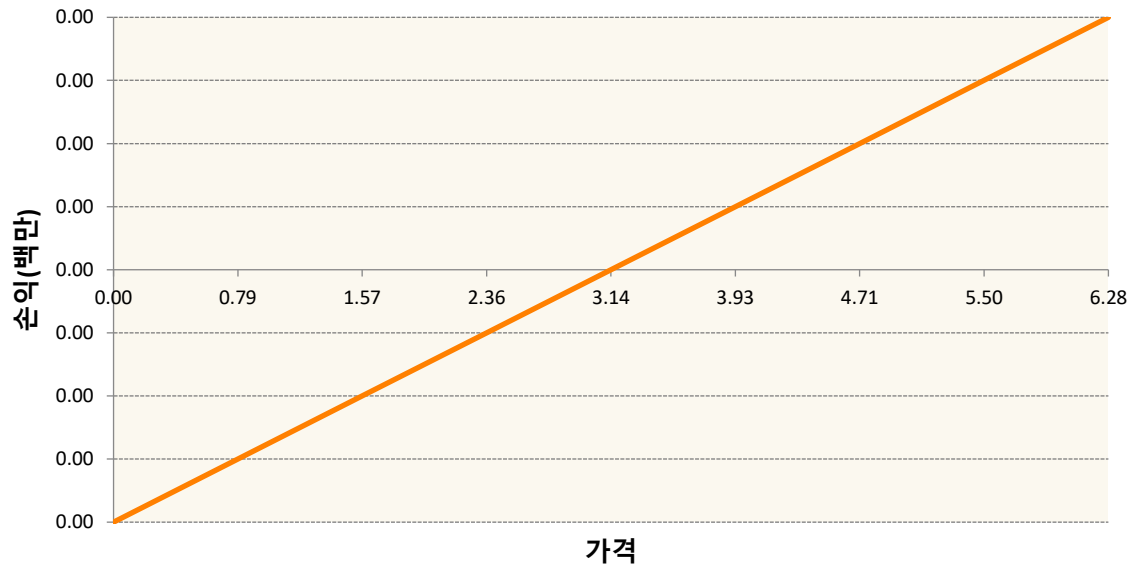
2. 만기시점의 손익구조



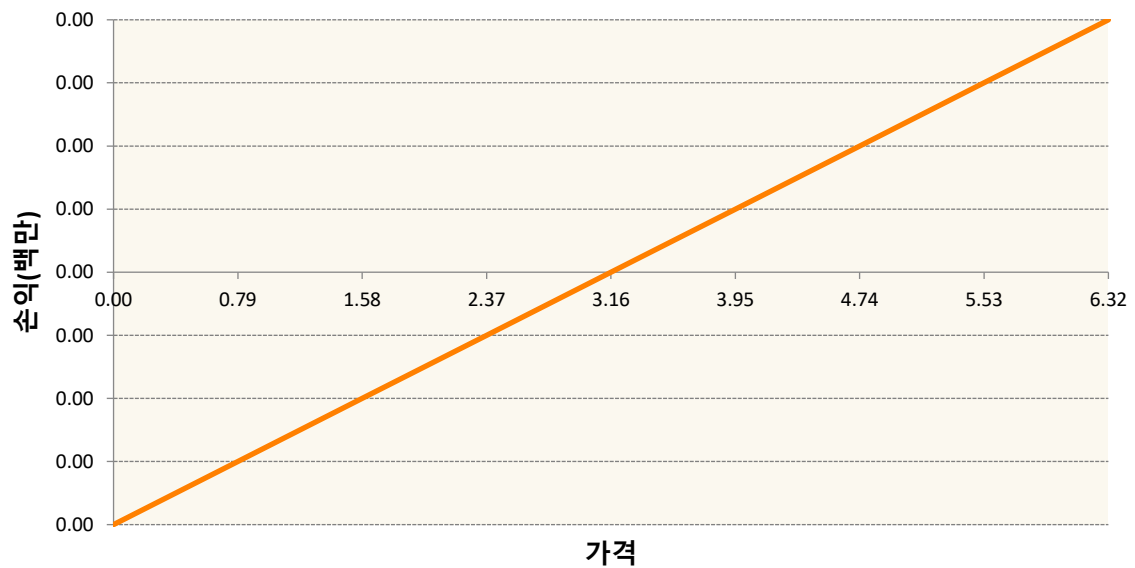
ECX3-E-MINI CRUDE OIL Nov23



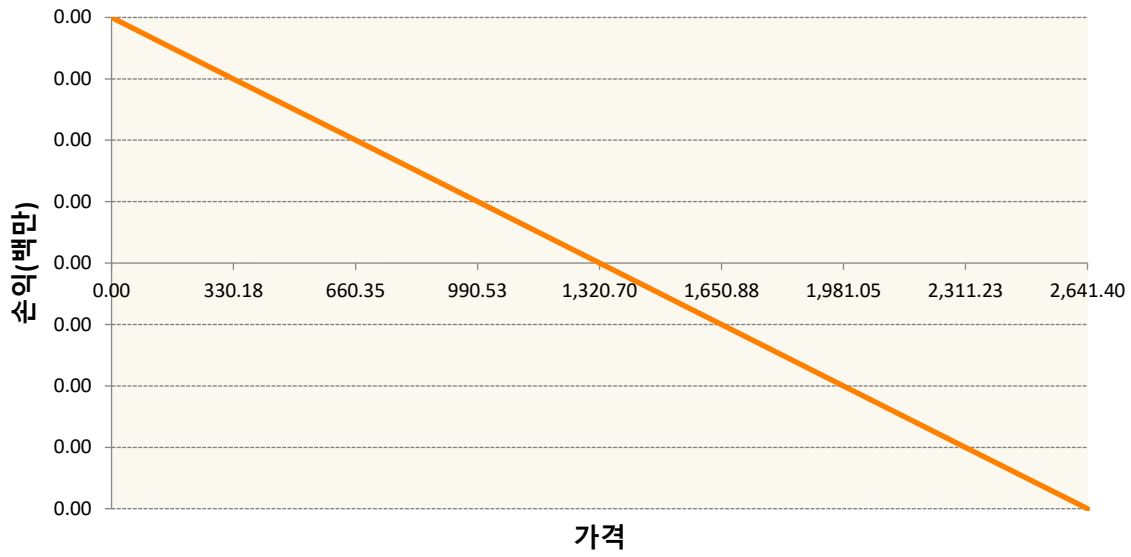
EOX3-E-MINI NATURAL GAS Nov23



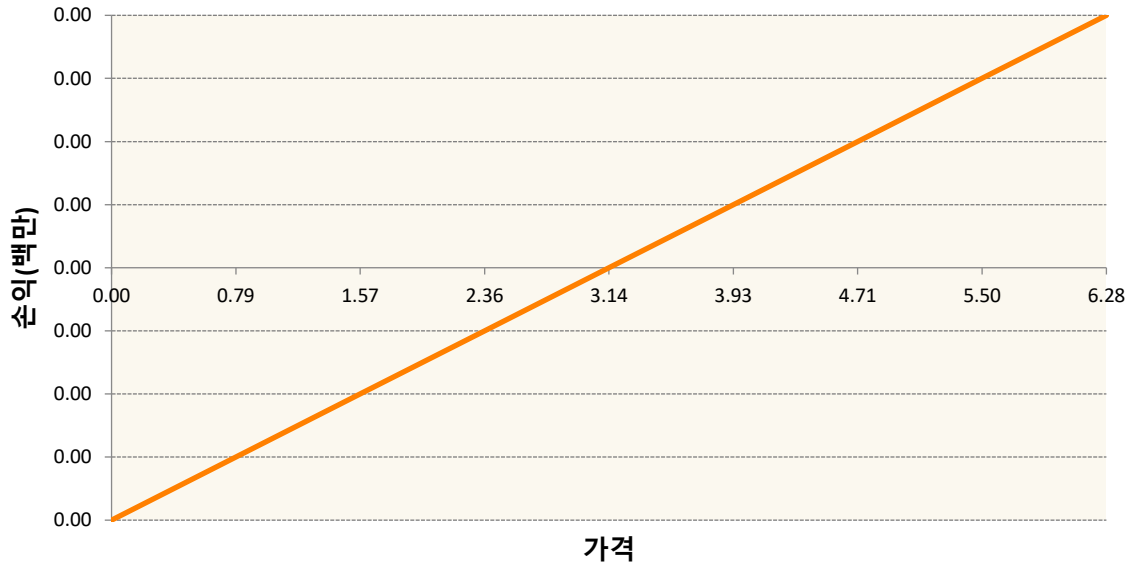
HOX3-NY Harb ULSD Fut Nov23



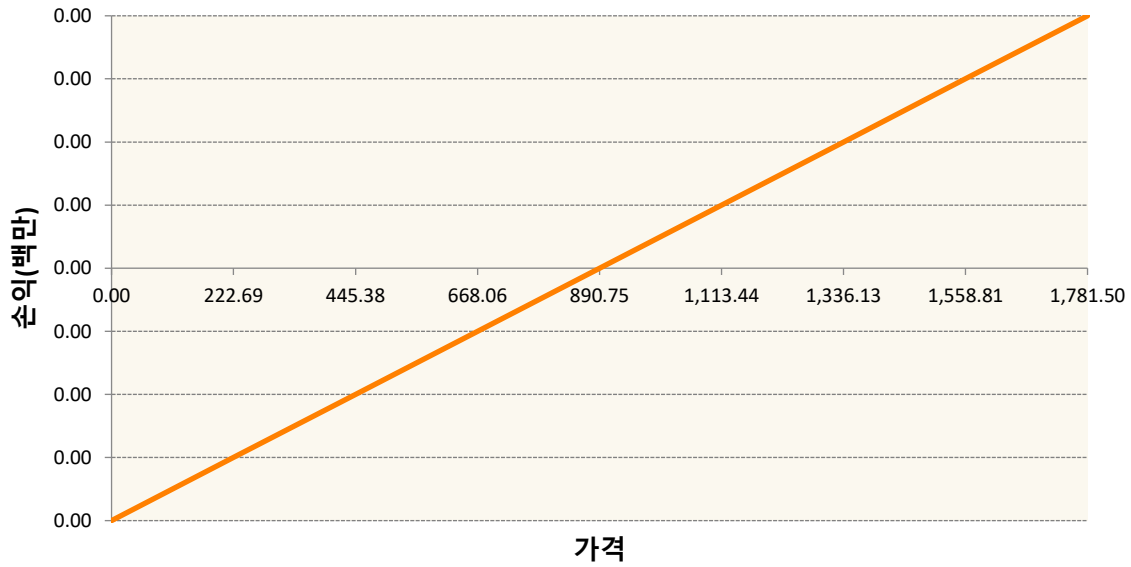
KR4175T90007-2023-09 달러선물

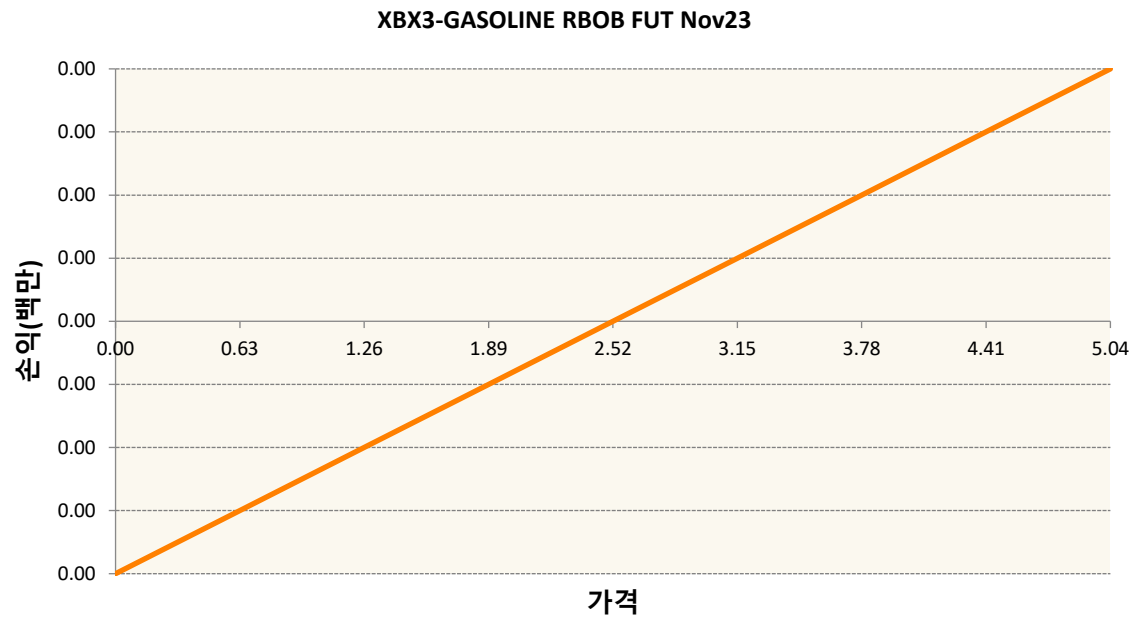


NGX23-NATURAL GAS FUTR Nov23



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	14
KR4175T900 2023-09 달러선물		23
NGX23	NATURAL GAS FUTR Nov23	26
QSX3	Low Su Gasoil G Nov23	9
XBX3	GASOLINE RBOB FUT Nov23	11

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	326