

공시일	2023-09-01
기준일	2023-08-31

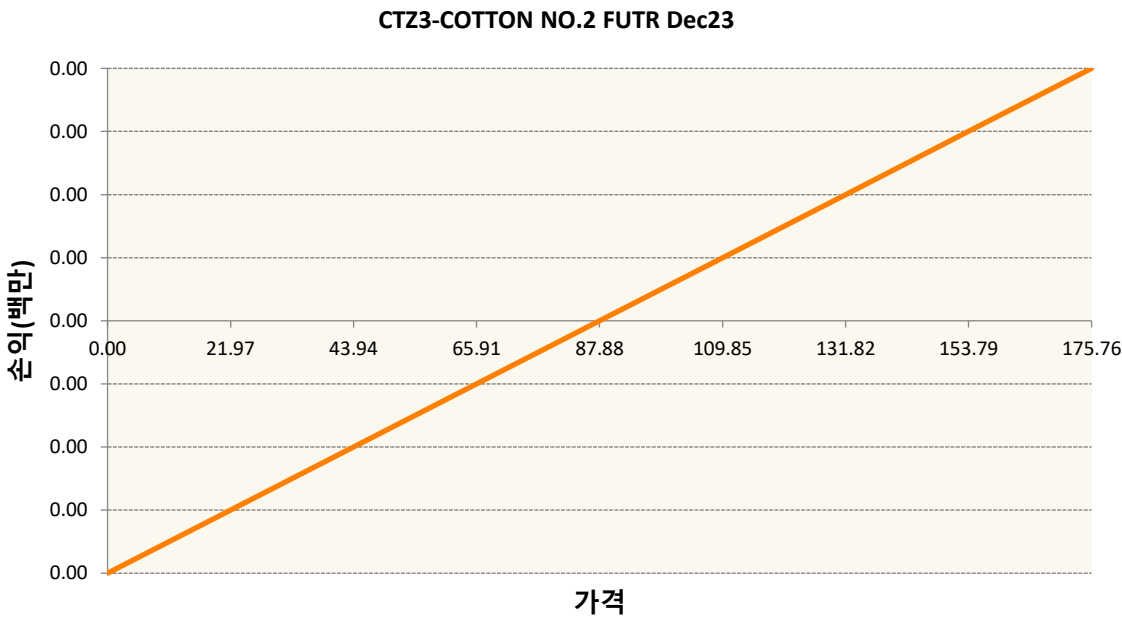
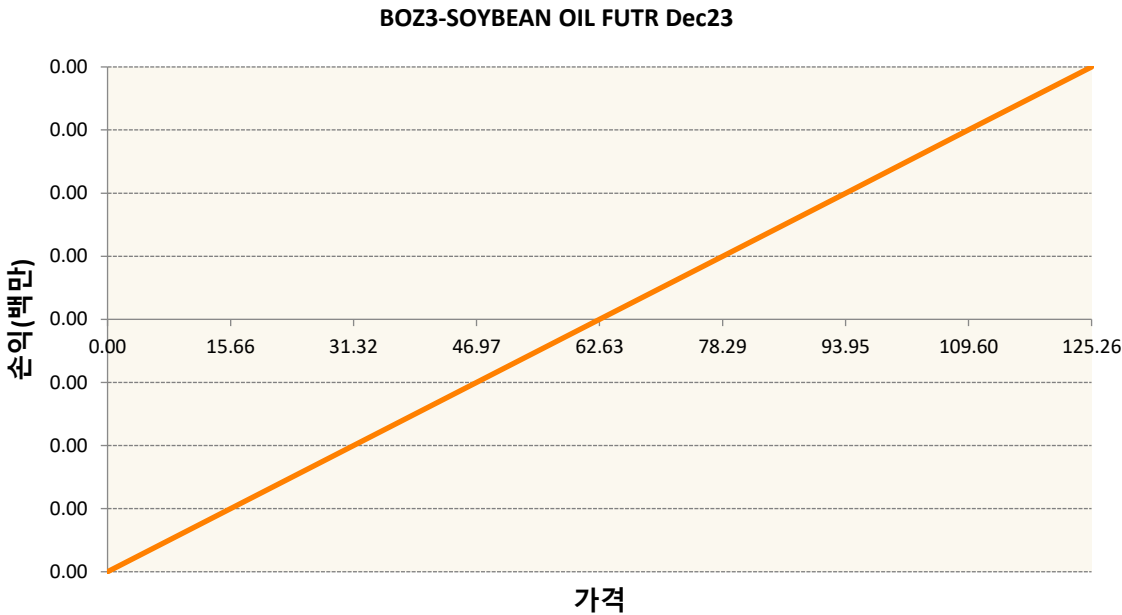
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

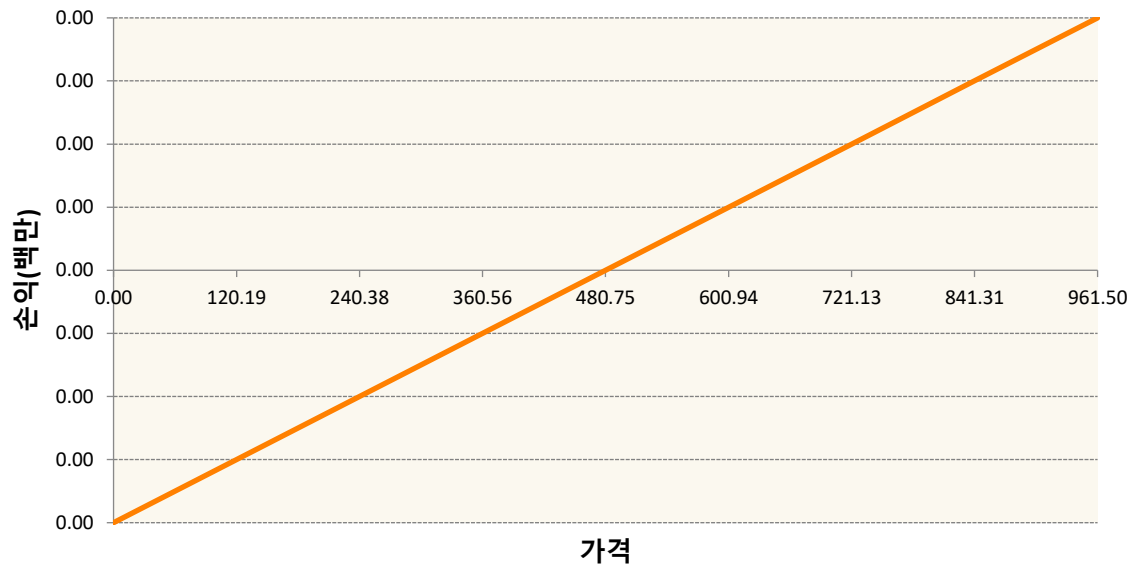
(단위:USD 백만)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,072	542	4,530	

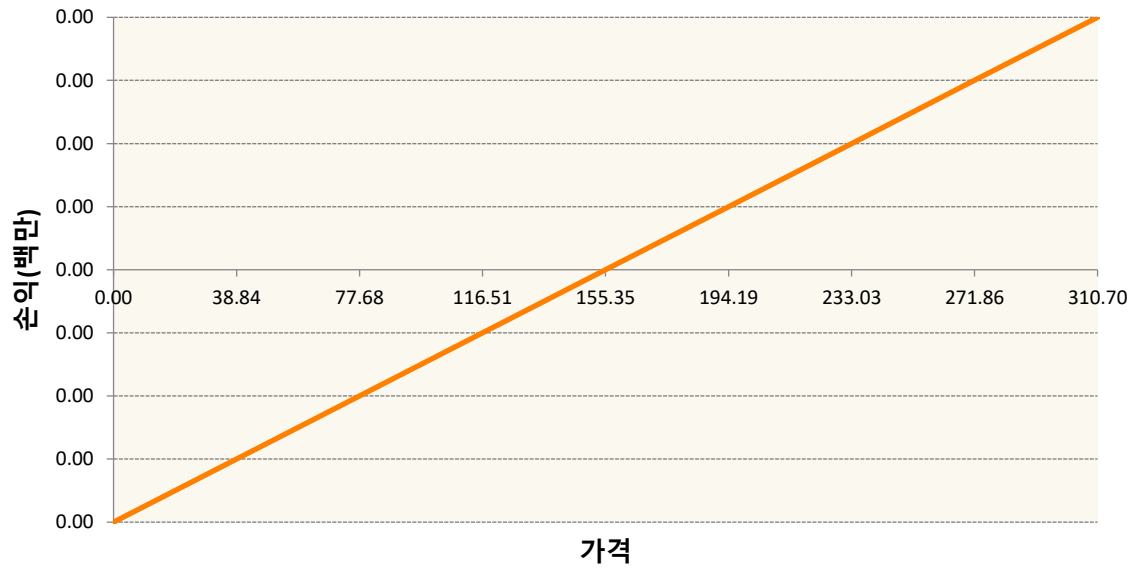
2. 만기시점의 손익구조



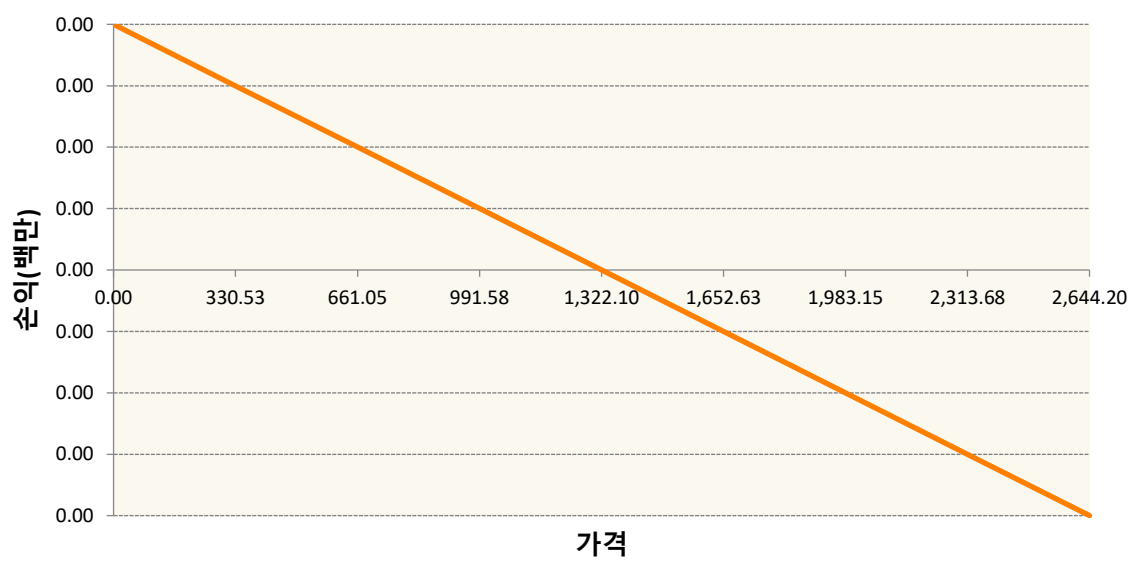
CZ3-CORN FUTURE Dec23



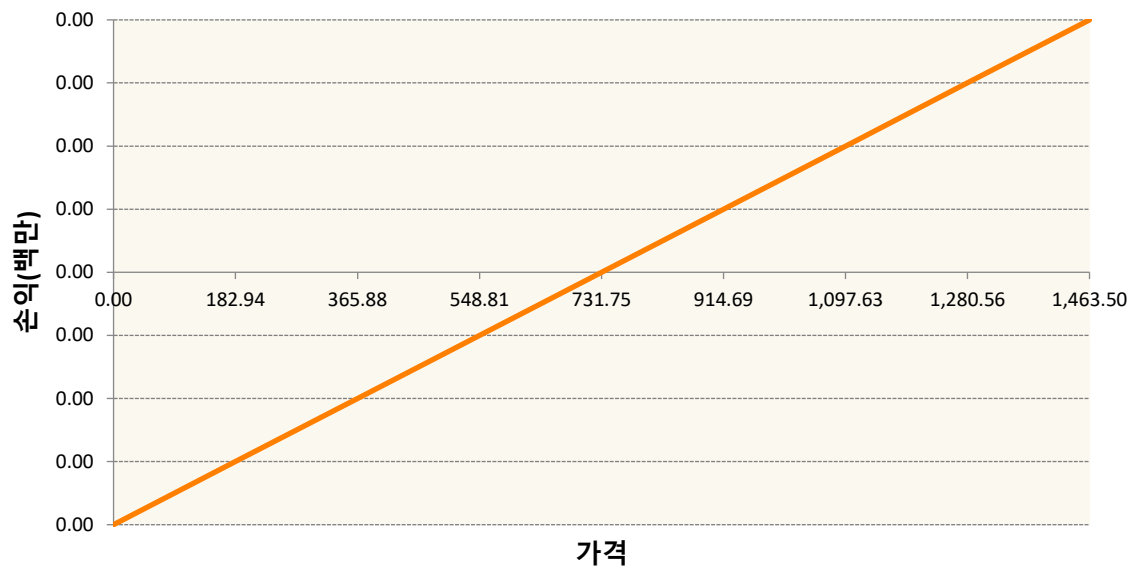
KCZ3-COFFEE 'C' FUTURE DEC23



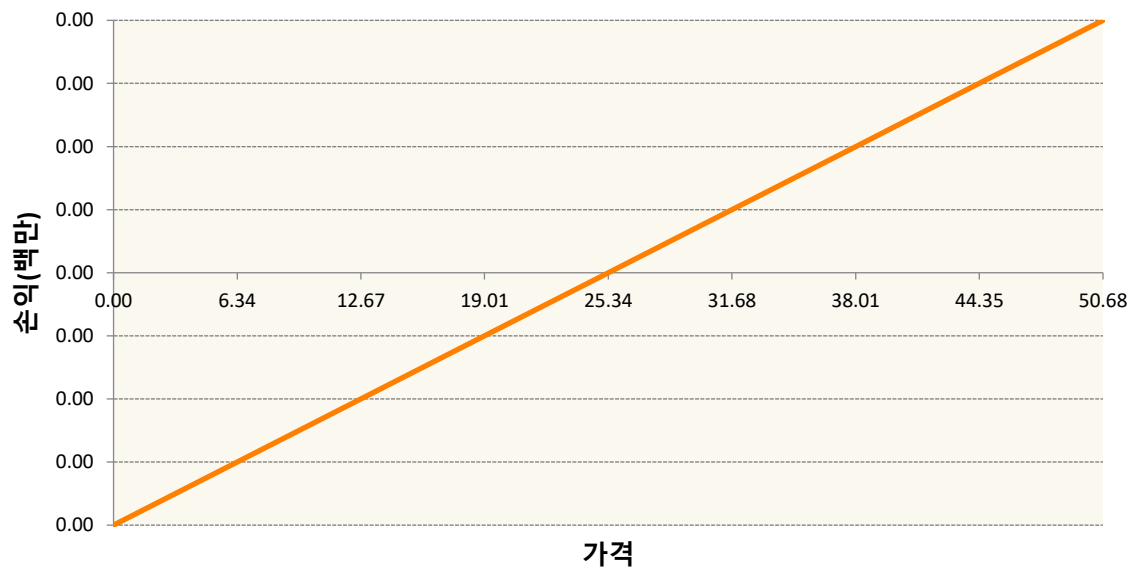
KR4175T90007-2023-09 달러선물



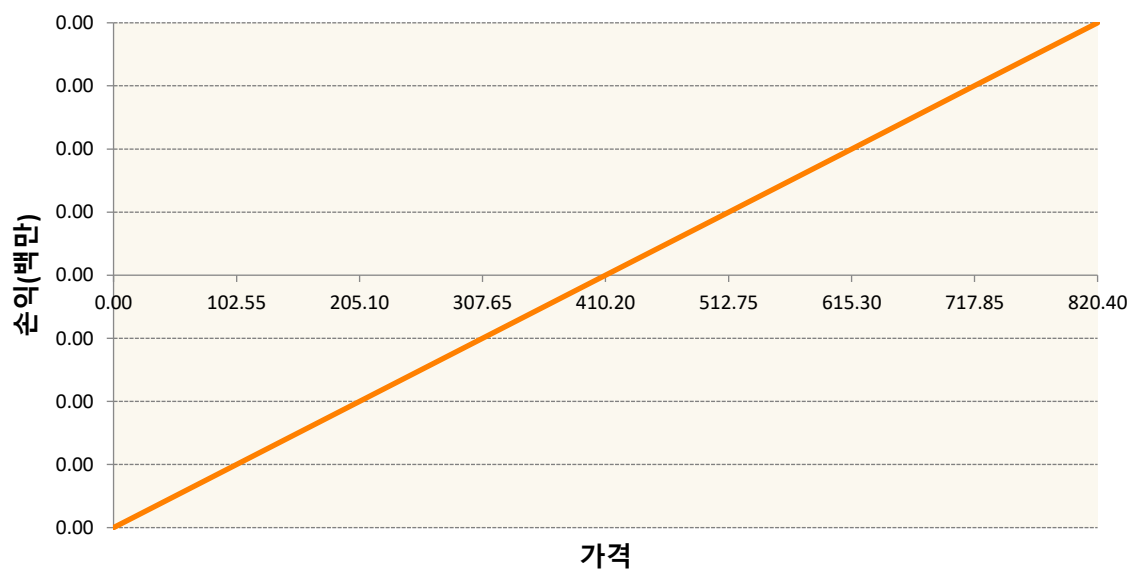
KWZ3-KC HRW WHEAT FUT DEC23

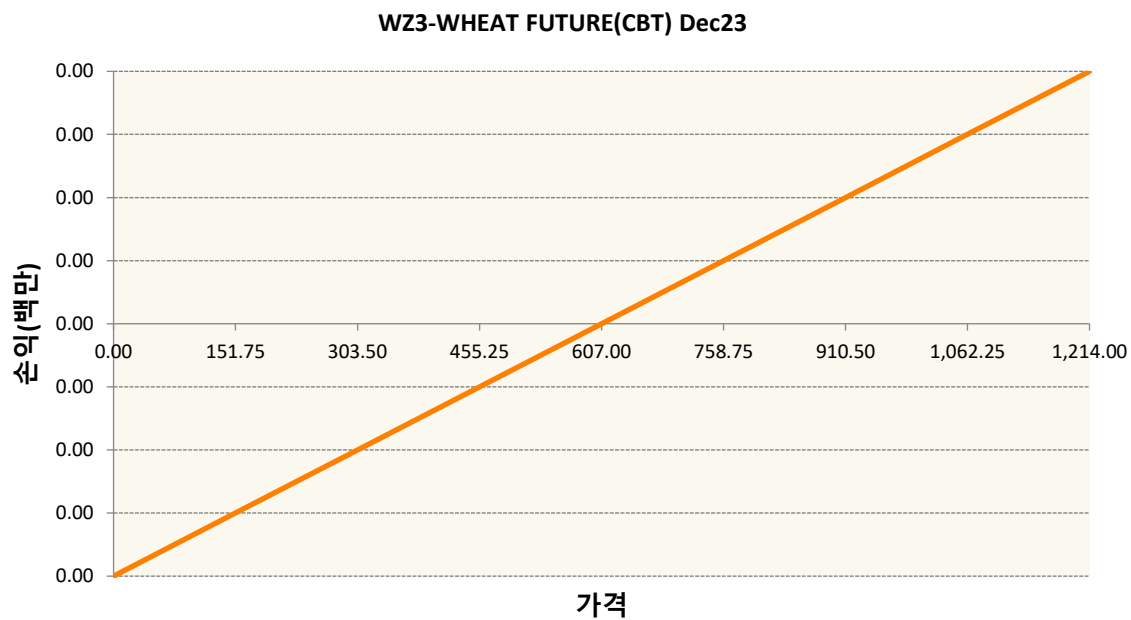
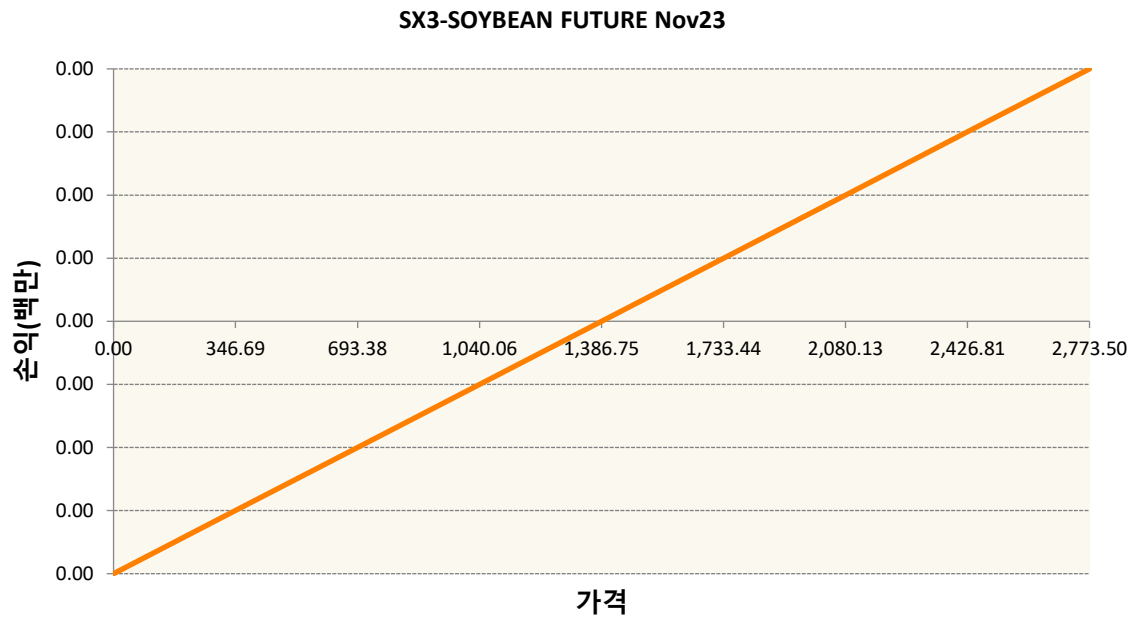


SBV3-Sugar #11 (WORLD) Oct23



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	2023-09-01
기준일	2023-08-31

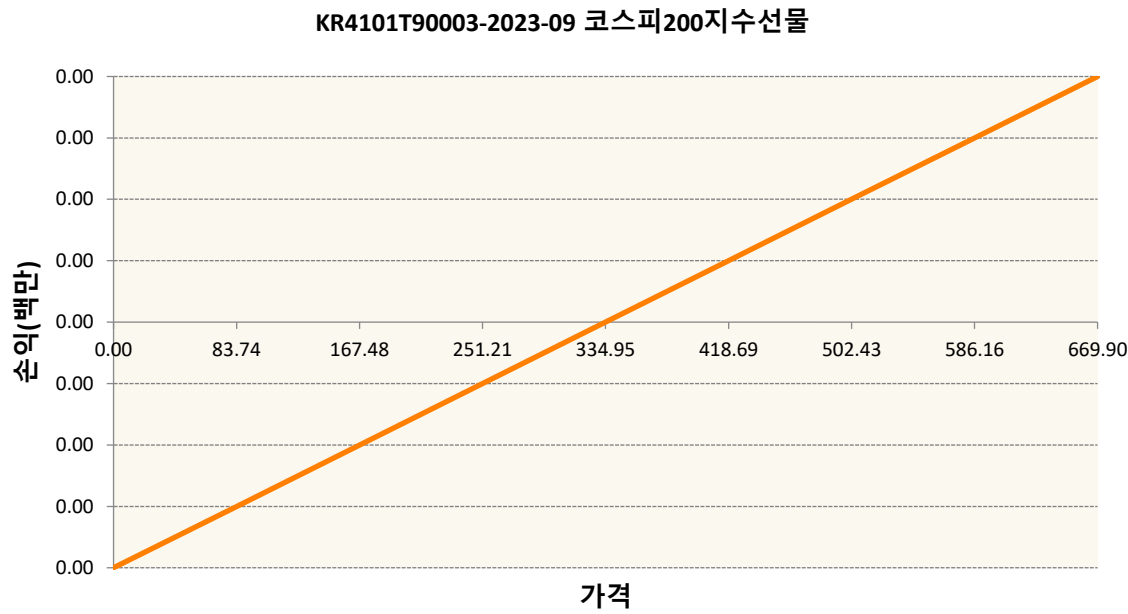
스마트인덱스모

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	1,591	0	1,591	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101T90003			2023-09 코스피200지수선물				127
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-127	-127	-127	-127	-127	-127	-127
-5.33%	-85	-85	-85	-85	-85	-85	-85
-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%	85	85	85	85	85	85	85
8.00%	127	127	127	127	127	127	127

공시일	2023-09-01
기준일	2023-08-31

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)

330

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2023-09-01
기준일	2023-08-31

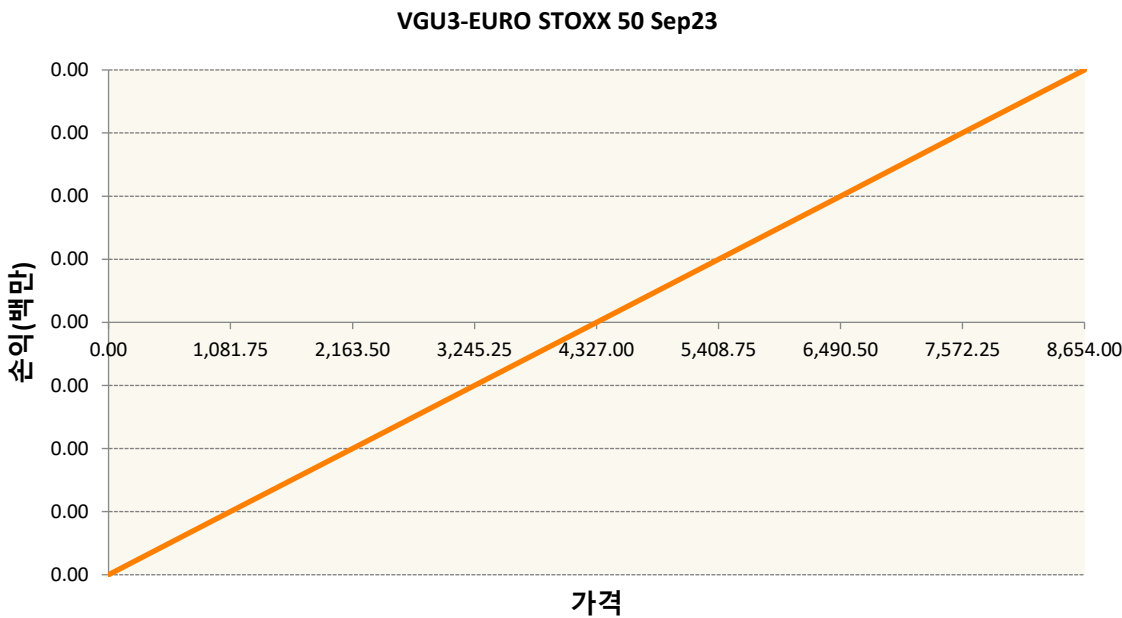
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	358	0	358	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGU3	EURO STOXX 50 Sep23	29
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

26

공시일	2023-09-01
기준일	2023-08-31

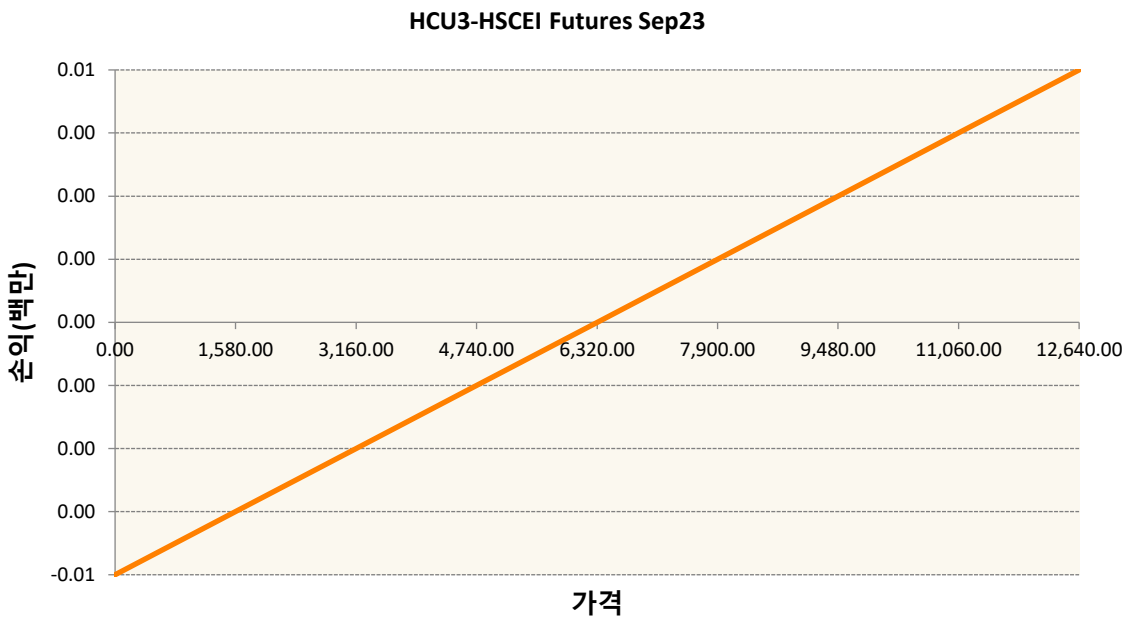
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,172	0	1,172	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCU3	HSCEI Futures Sep23	94
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

146

공시일	2023-09-01
기준일	2023-08-31

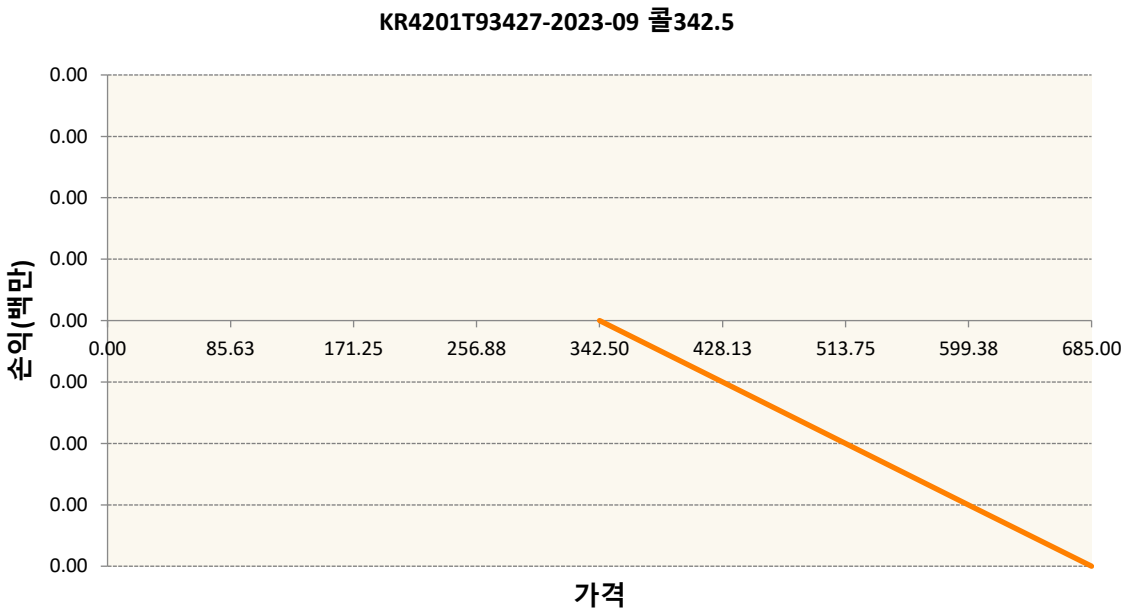
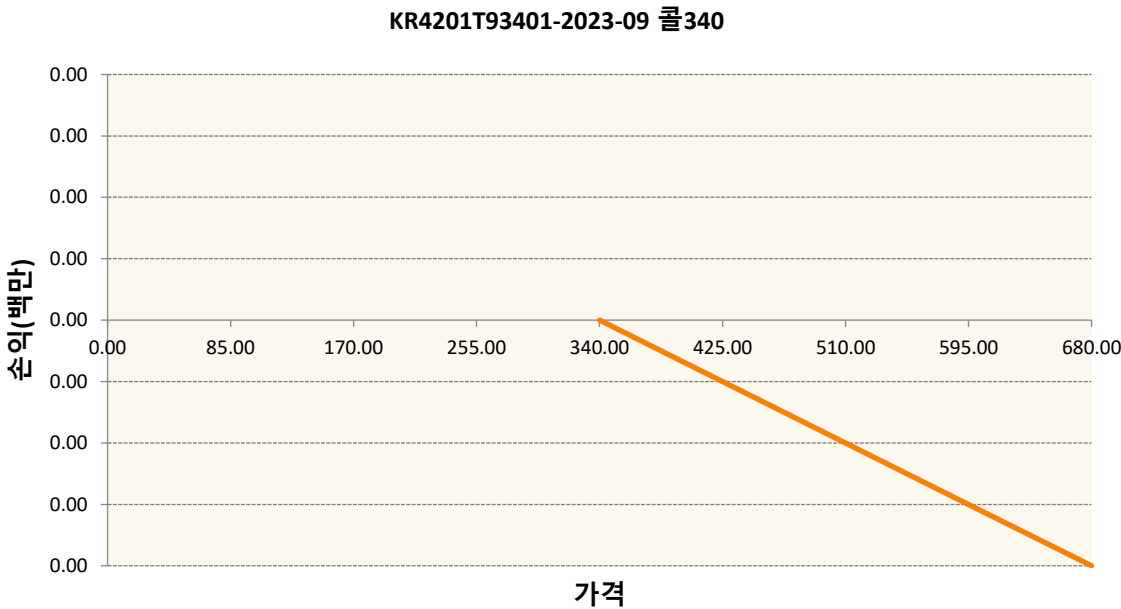
커버드콜모(주식혼합-파생형)

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				1,966
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	403	402	400	396	390	382	371
-5.33%	395	387	376	362	345	324	301
-2.67%	342	316	286	254	219	182	143
0%	146	98	49	0	-50	-100	-151
2.67%	-299	-349	-400	-452	-503	-555	-607
5.33%	-994	-1,026	-1,061	-1,099	-1,138	-1,180	-1,223
8.00%	-1,839	-1,852	-1,868	-1,888	-1,911	-1,938	-1,966
KR4201T93427			2023-09 콜342.5				520
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	90	90	89	89	87	86	83
-5.33%	89	87	85	82	78	73	68
-2.67%	79	73	66	59	50	41	31
0%	38	26	13	0	-13	-27	-41
2.67%	-67	-82	-97	-112	-127	-142	-157
5.33%	-245	-256	-268	-280	-293	-305	-319
8.00%	-475	-480	-486	-494	-501	-510	-520
KR4301T93409			2023-09 풋340				665
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-656	-657	-657	-658	-660	-662	-665
-5.33%	-402	-404	-407	-411	-416	-422	-428
-2.67%	-160	-168	-176	-185	-195	-206	-216
0%	41	28	14	0	-14	-28	-42

2.67%	173	158	144	130	115	101	86
5.33%	234	225	215	205	194	182	170
8.00%	253	250	245	240	233	226	218

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

(단위:백만원)

3,163

공시일	2023-09-01
기준일	2023-08-31

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	4,610	0	4,610	

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	2023-09-01
기준일	2023-08-31

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	4,685	0	4,685	

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	2023-09-01
기준일	2023-08-31

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	17,903	0	17,903	
누계	통화	선도	0	17,745	-17,745	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
FXW213D6S(KRW/USD 27-09-23E		555
FXW213D7T(KRW/USD 31-10-23E		263
FXW213D8W(KRW/USD 30-11-23E		602
IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	818

공시일	2023-09-01
기준일	2023-08-31

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

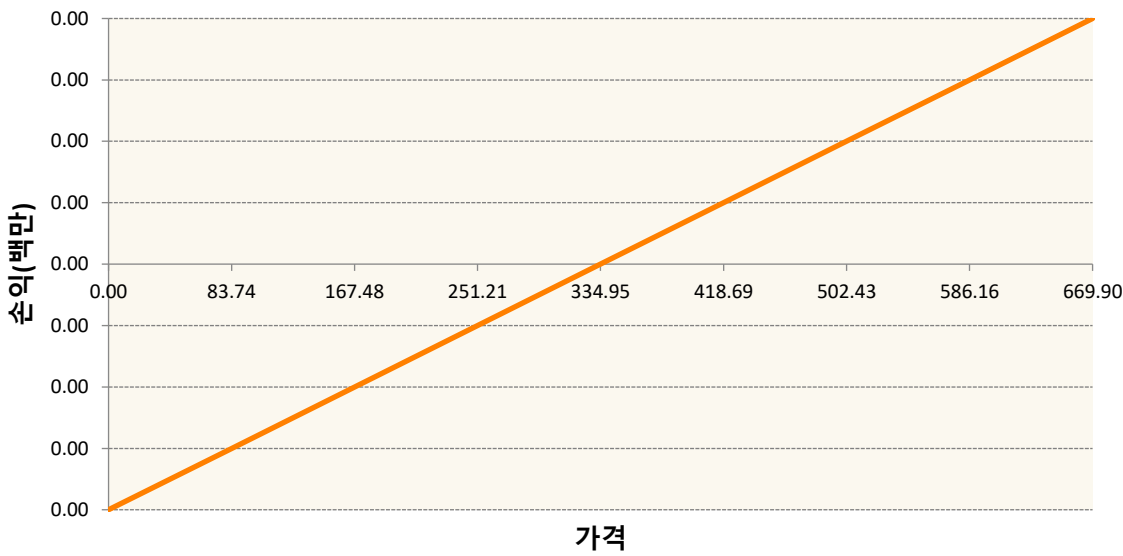
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	670	0	670	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101T90003-2023-09 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101T90003			2023-09 코스피200지수선물				54
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-54	-54	-54	-54	-54	-54	-54
-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%	54	54	54	54	54	54	54

공시일	2023-09-01
기준일	2023-08-31

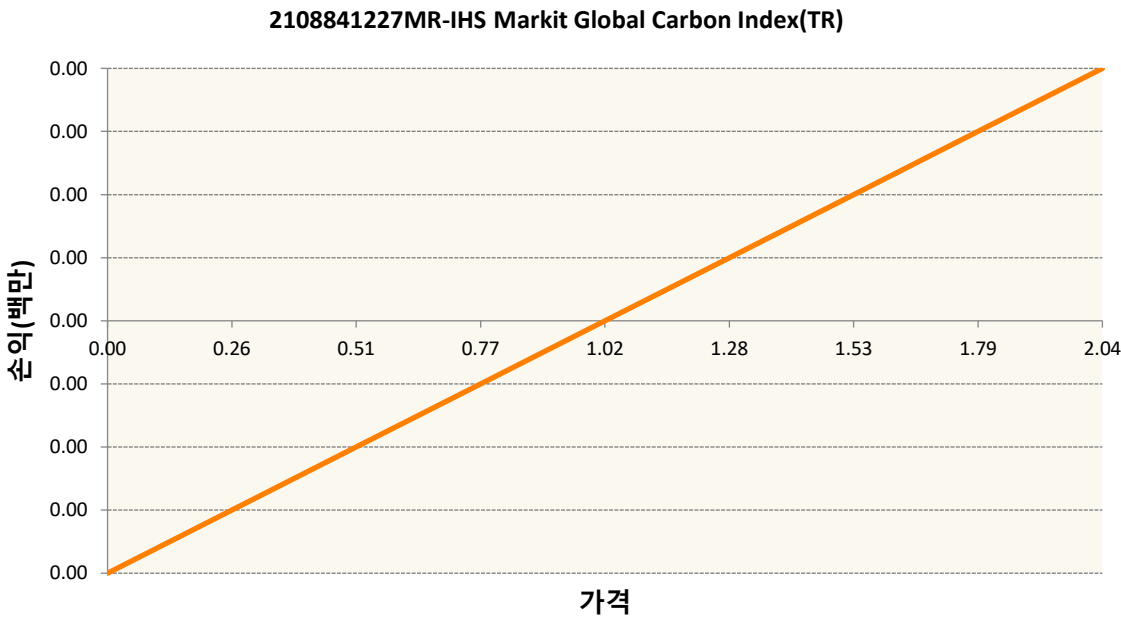
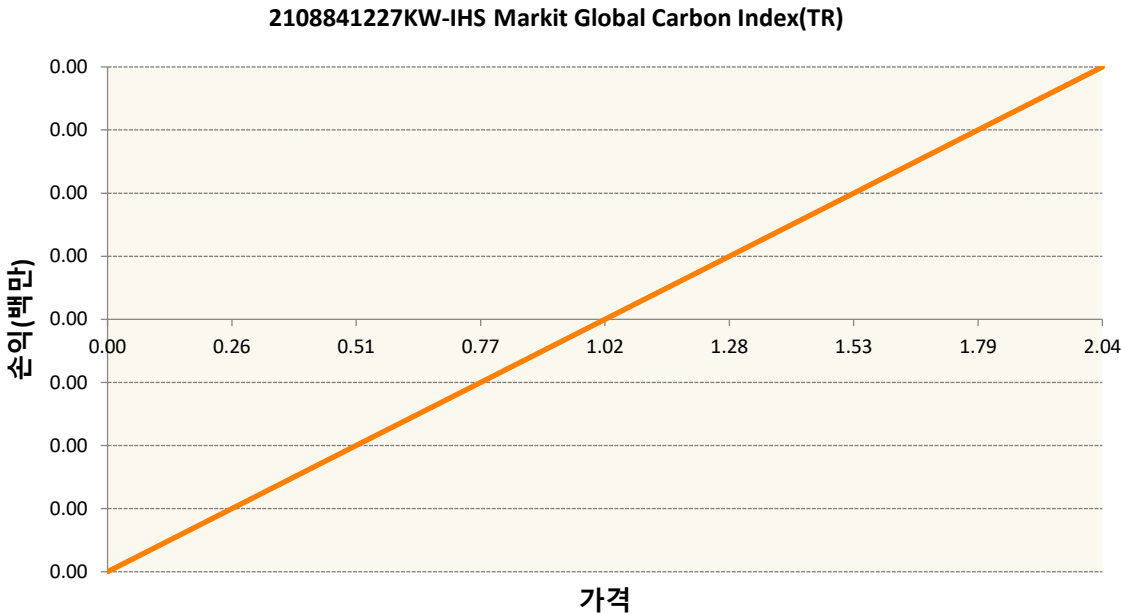
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

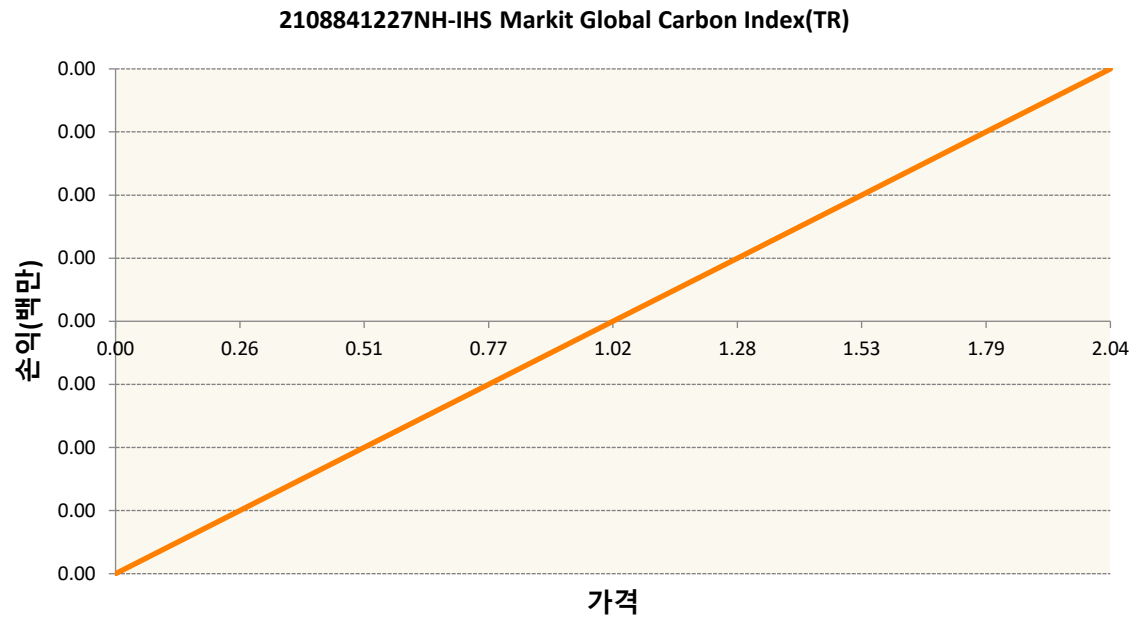
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	26,798	0	26,798	

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108841227IHS Markit Global Carbon Index(TR)		1,817
2108841227IHS Markit Global Carbon Index(TR)		214
2108841227IHS Markit Global Carbon Index(TR)		107

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)		(단위:백만원)
		3,034

공시일	2023-09-01
기준일	2023-08-31

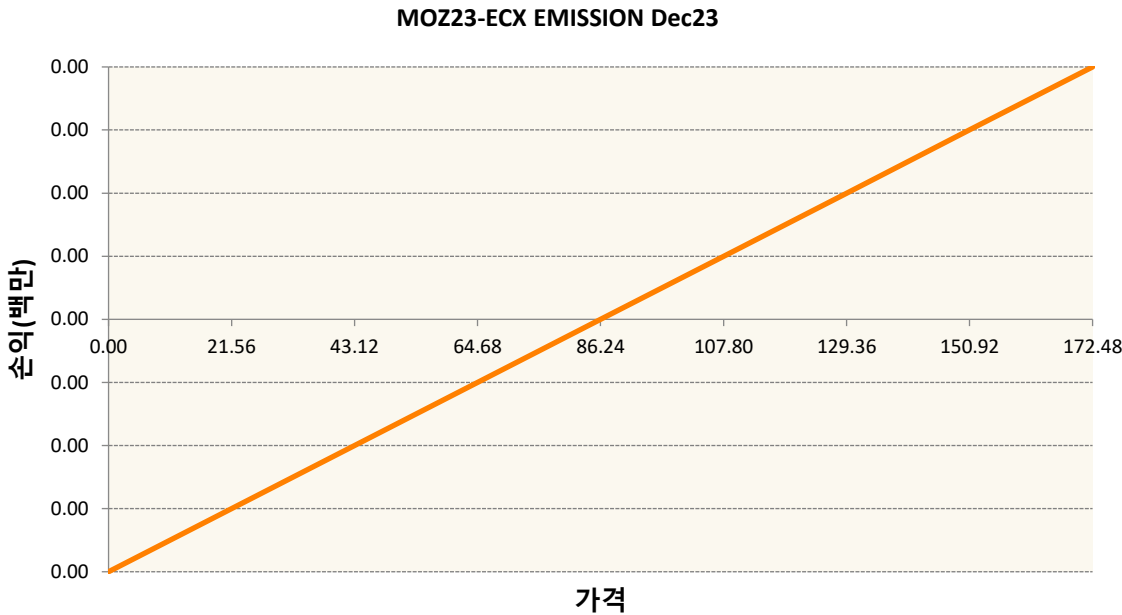
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	8,733	0	8,733	
누계	통화	선도	0	1,970	-1,970	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213D8W KRW/EUR 27-09-23E	5
FXW213D8W KRW/EUR 27-09-23E	153
MOZ23 ECX EMISSION Dec23	699

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

(단위:백만원)

1,501

공시일	2023-09-01
기준일	2023-08-31

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)	21
SWCSI00000 신한CSI Index 230622 (키움)	21
SWCSI00000 신한CSI Index 230622 (미래)	21
SWCSI00000 신한CSI Index 230622 (메리츠)	21

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

(단위:백만원)

135

공시일	2023-09-01
기준일	2023-08-31

SOL차이나육성산업엑티브상장지

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)	13
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 230116(메리츠)	19
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 230116(미래)	16
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 230427(키움)	4

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

(단위:백만원)

64

공시일	2023-09-01
기준일	2023-08-31

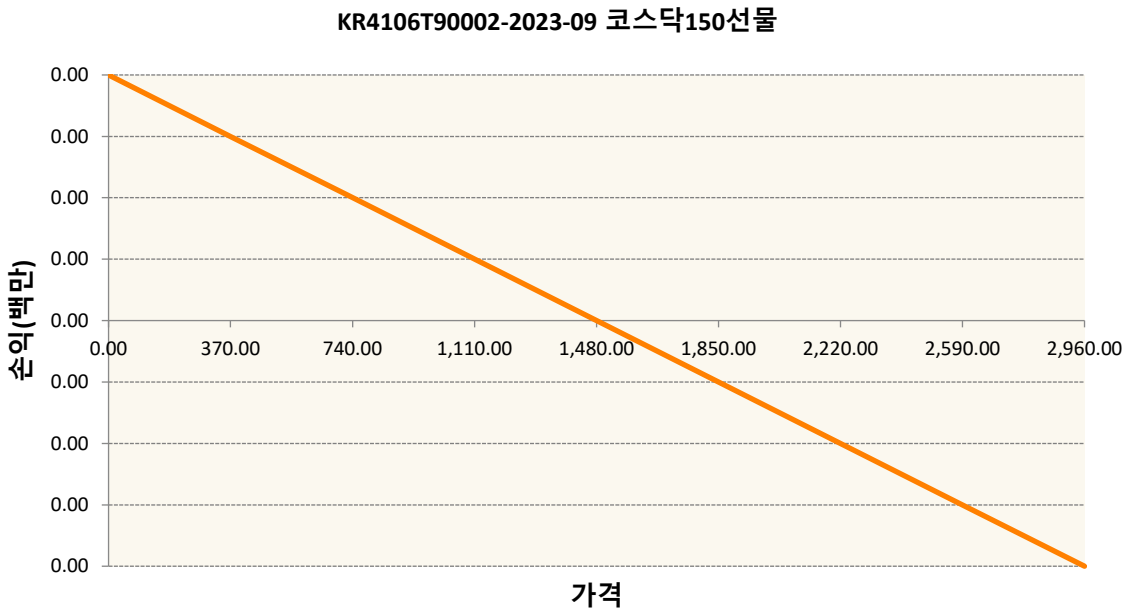
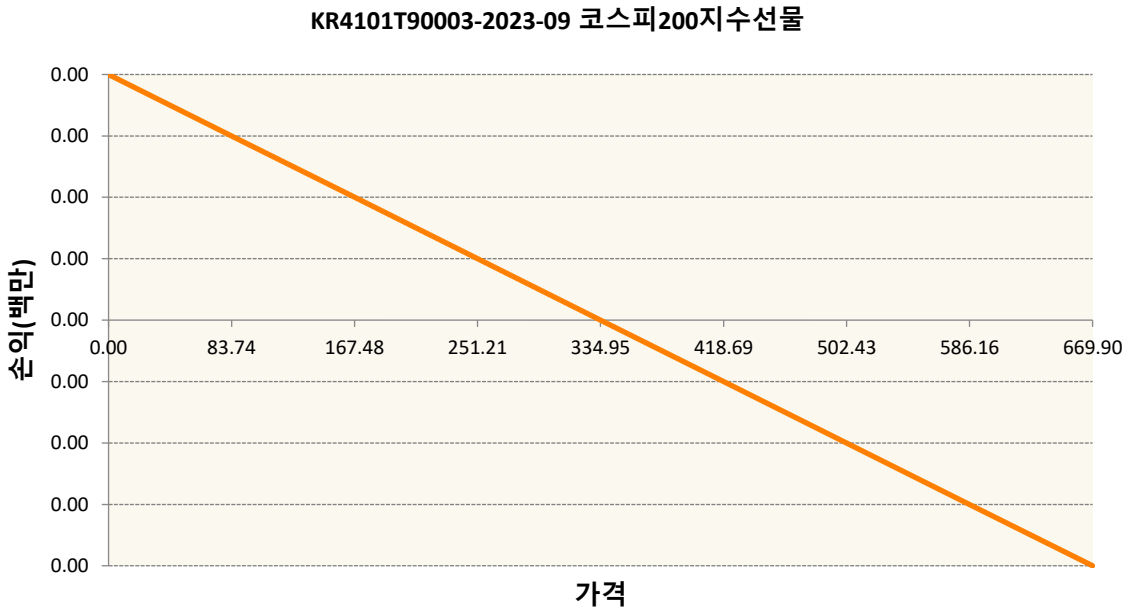
에퀴티알파일반사모혼합자산

1. 계약금액

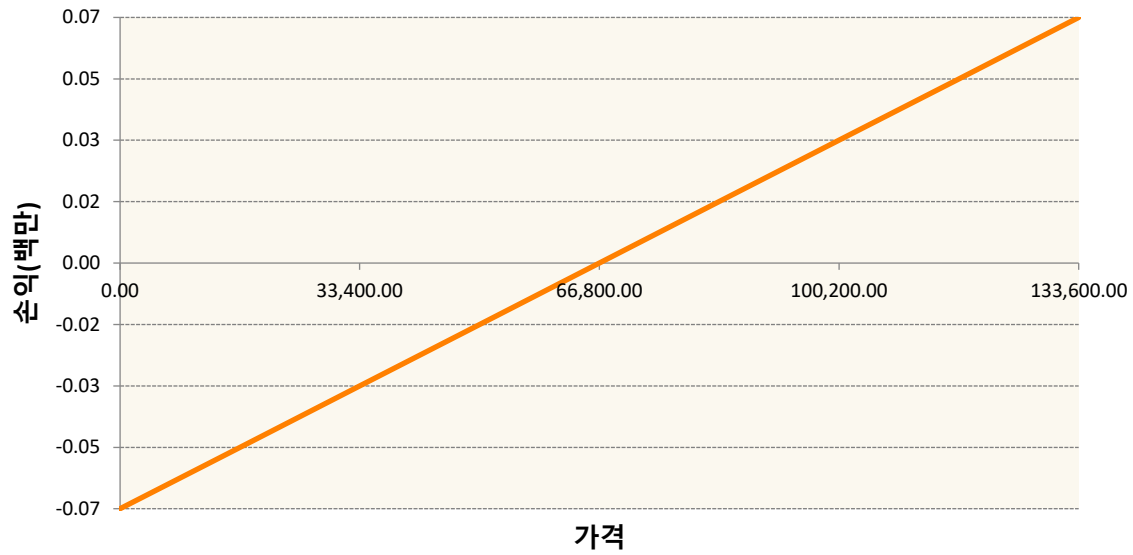
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	11	-11	장내
누계	유가증권	선물	1,977	3,223	-1,247	장내

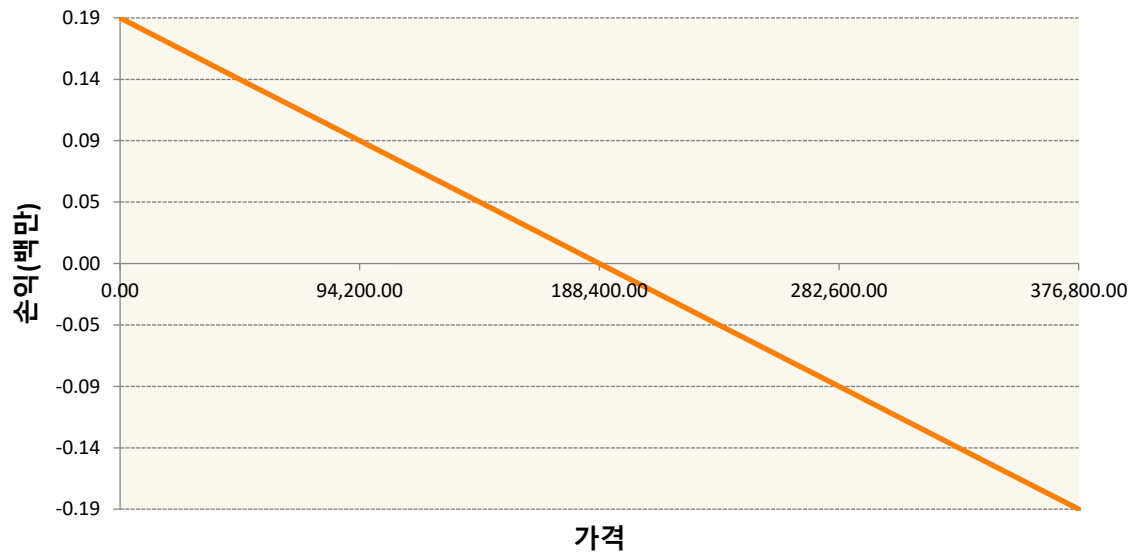
2. 만기시점의 손익구조



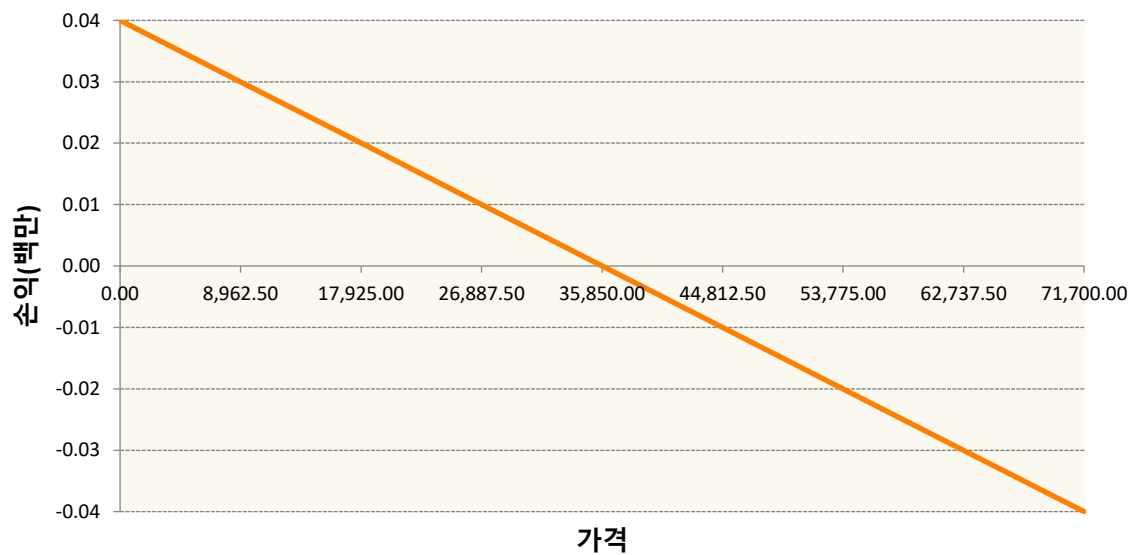
KR4111T90002-2023-09 삼성전자개별선물



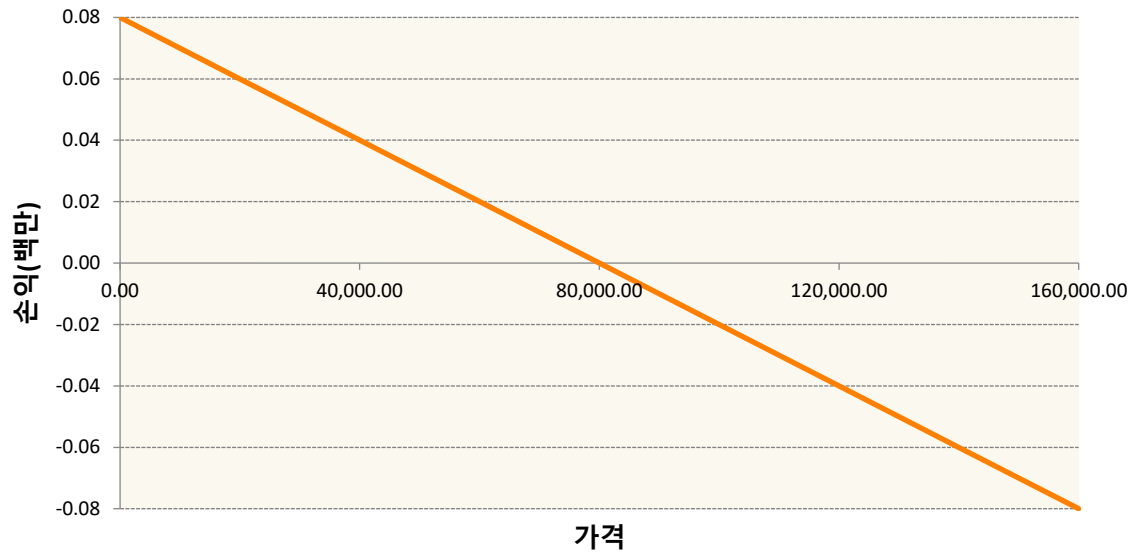
KR4116T90001-2023-09 현대차개별선물



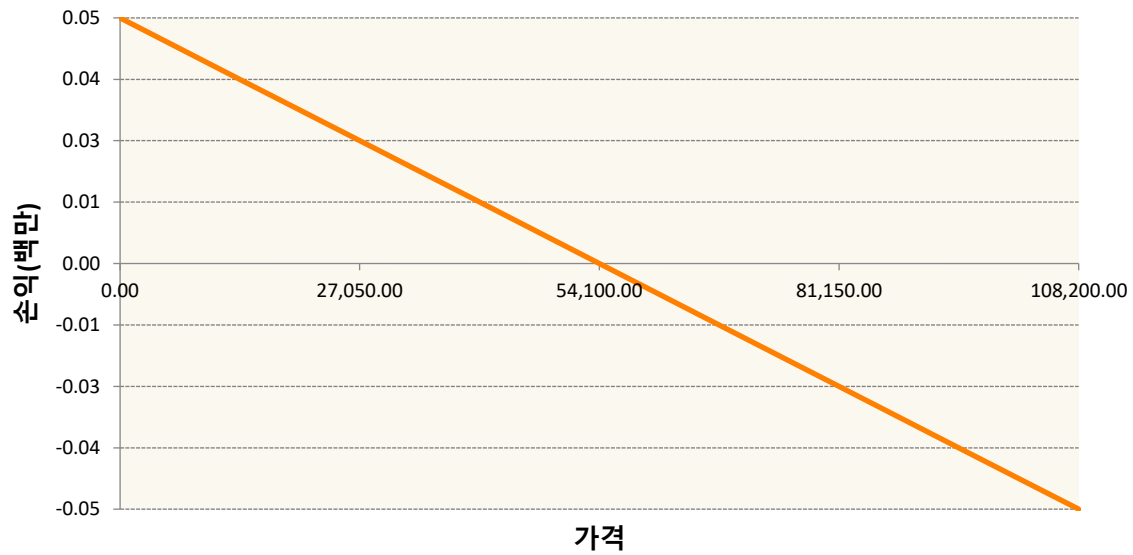
KR4118T90007-2023-09 신한지주개별선물



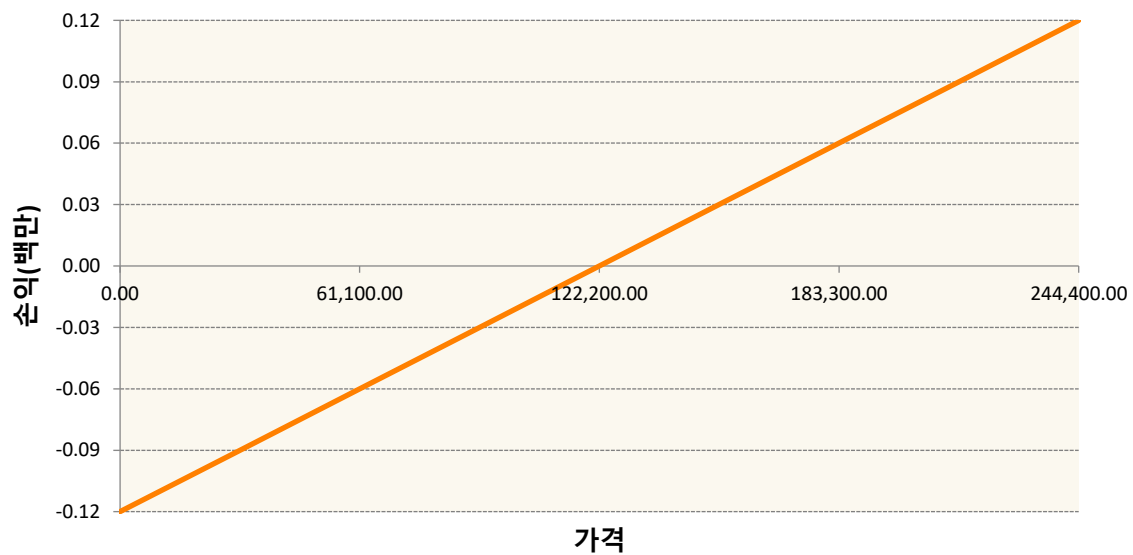
KR4119T90005-2023-09 기아개별선물



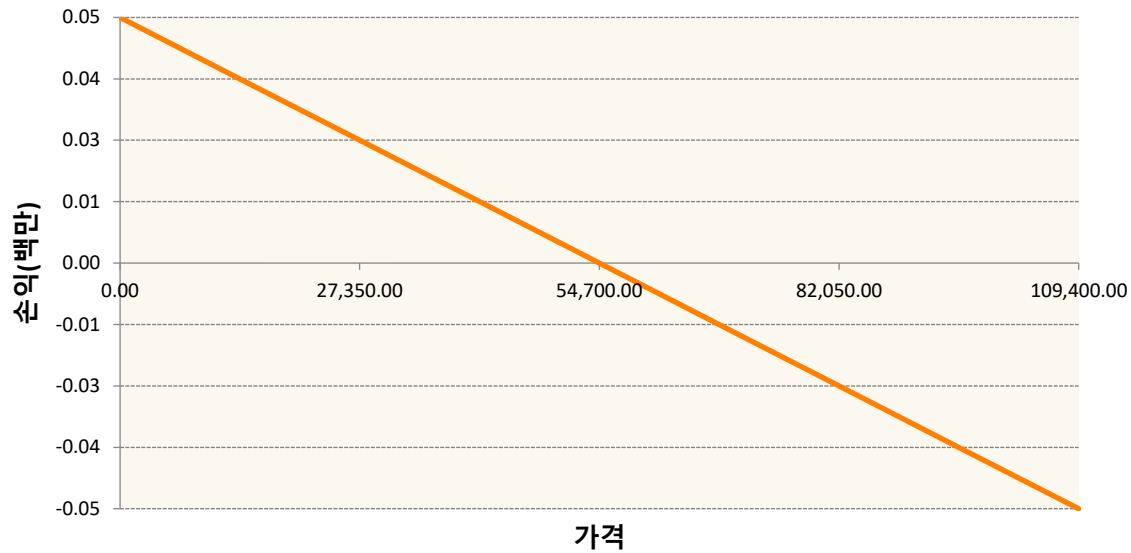
KR4146T90008-2023-09 KB금융개별선물



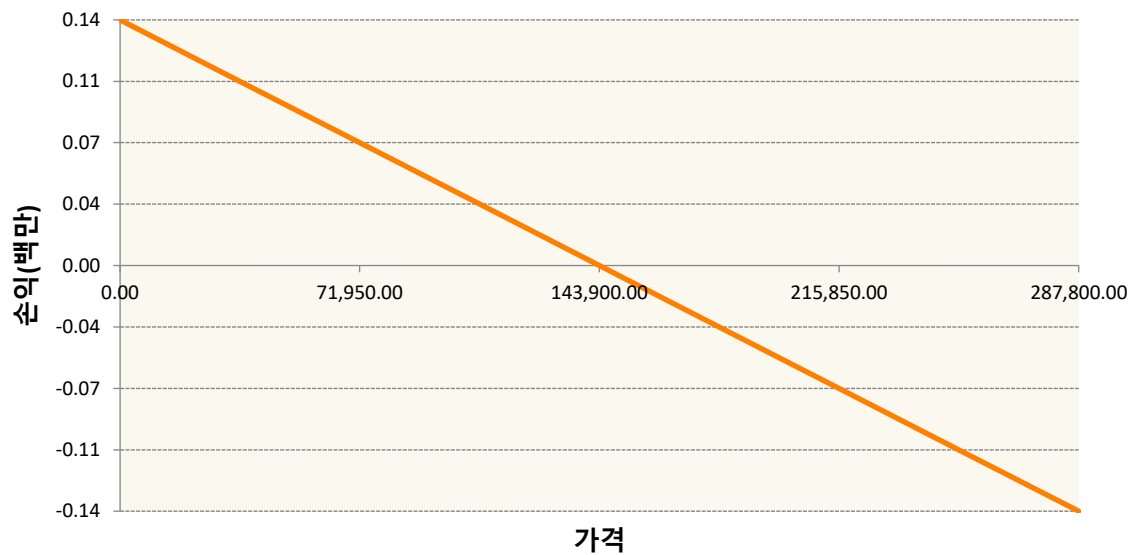
KR4150T90000-2023-09 SK하이닉스개별선물



KR41CNTA0000-2023-10 포스코DX개별선물



KR41CPT90007-2023-09 셀트리온개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101T900 2023-09 코스피200지수선물	167
KR4106T900 2023-09 코스닥150선물	51
KR4111T900 2023-09 삼성전자개별선물	118
KR4116T900 2023-09 현대차개별선물	7
KR4118T900 2023-09 신한지주개별선물	4
KR4119T900 2023-09 기아개별선물	7
KR4146T900 2023-09 KB금융개별선물	4
KR4150T900 2023-09 SK하이닉스개별선물	40
KR41CNTA0 2023-10 포스코DX개별선물	4
KR41CPT900 2023-09 셀트리온개별선물	14

공시일	2023-09-01
기준일	2023-08-31

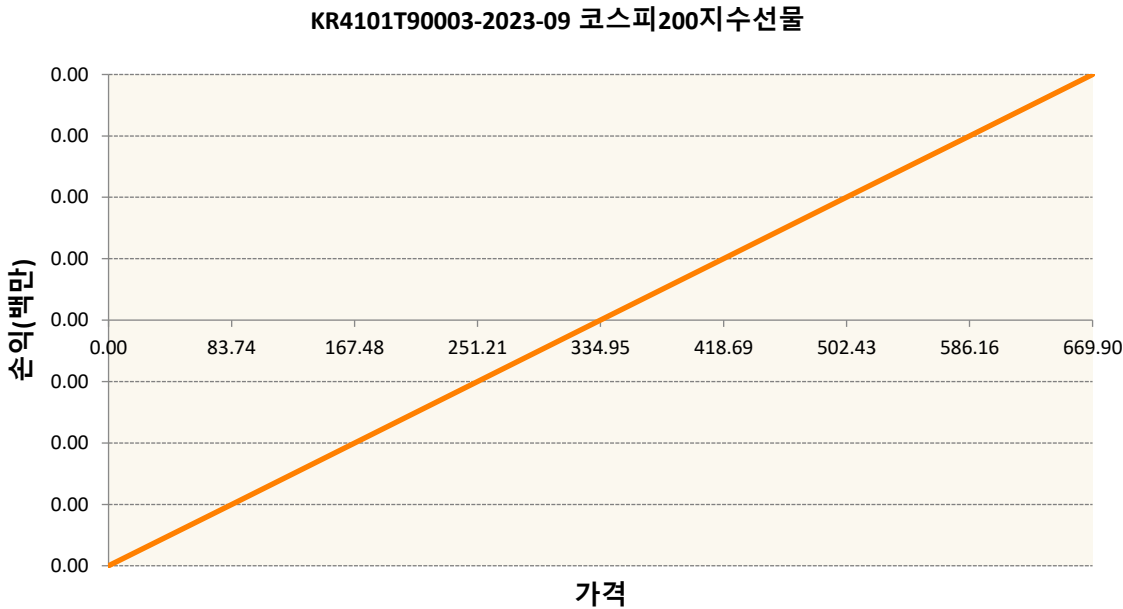
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

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	1,507	0	1,507	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101T90003		2023-09 코스피200지수선물					121
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-121	-121	-121	-121	-121	-121	-121
-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%	121	121	121	121	121	121	121

공시일	2023-09-01
기준일	2023-08-31

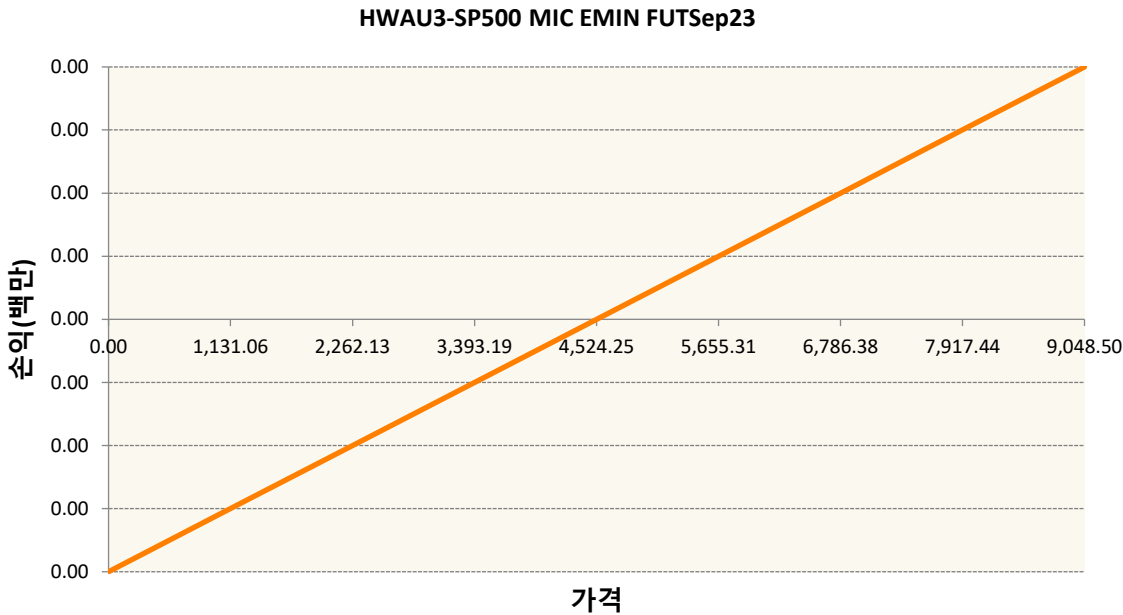
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

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	1,045	0	1,045	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HWAU3	SP500 MIC EMIN FUTSep23	84
-------	-------------------------	----

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

(단위:백만원)

84

공시일	2023-09-01
기준일	2023-08-31

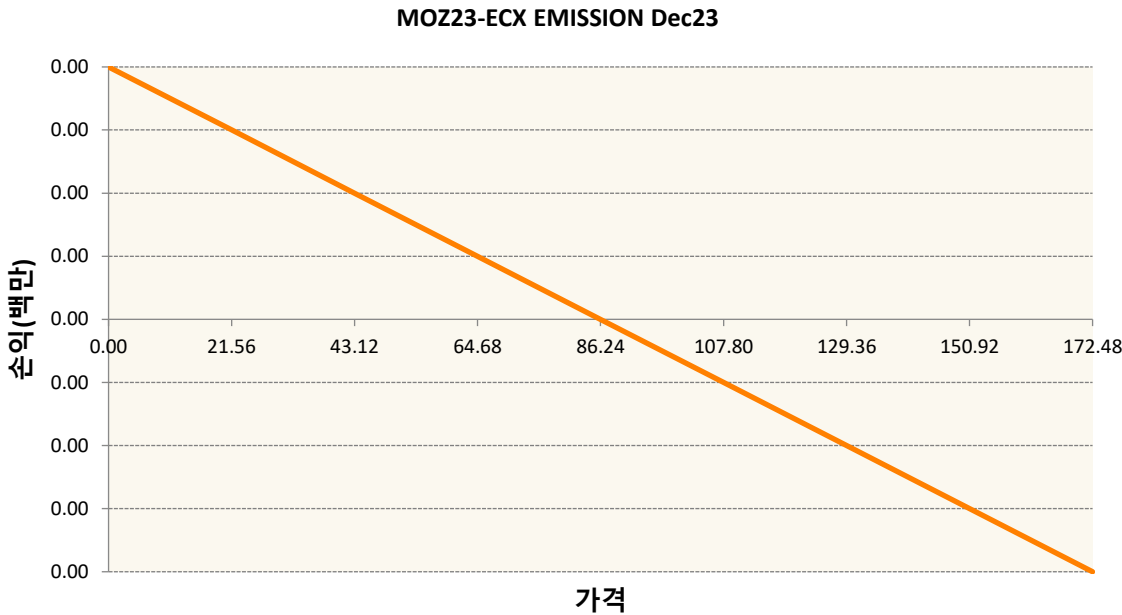
SOL유럽탄소배출권선물인버스ICE특별자산상

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	8,575	-8,575	
누계	통화	선도	0	1,886	-1,886	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213D8W KRW/EUR 27-09-23E	151
MOZ23 ECX EMISSION Dec23	686

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

(단위:백만원)

1,471

공시일	2023-09-01
기준일	2023-08-31

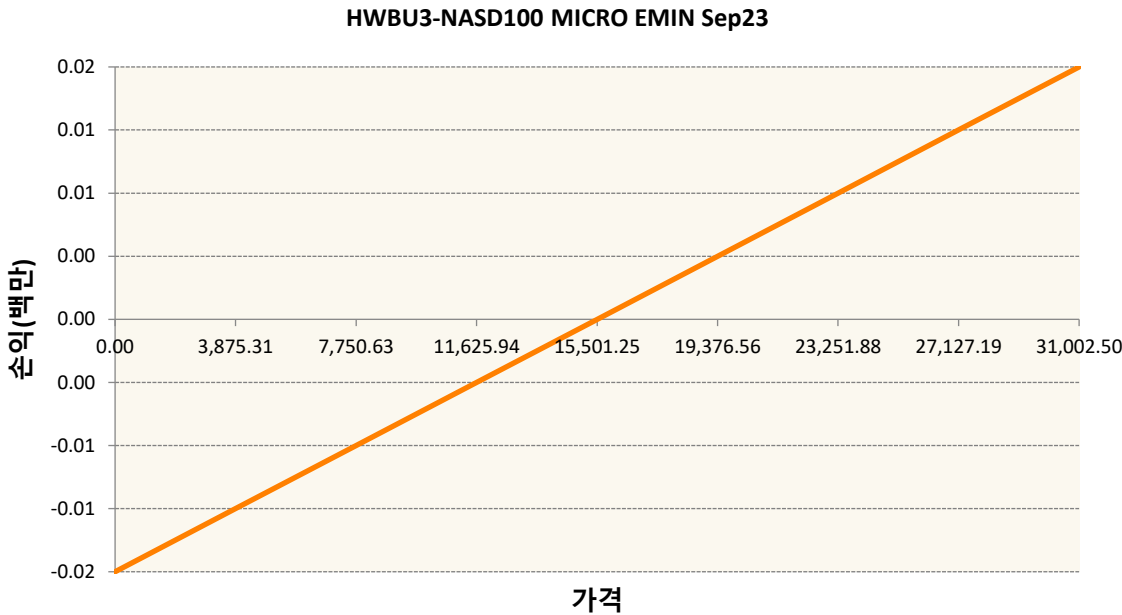
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

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	994	0	994	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)

80

공시일	2023-09-01
기준일	2023-08-31

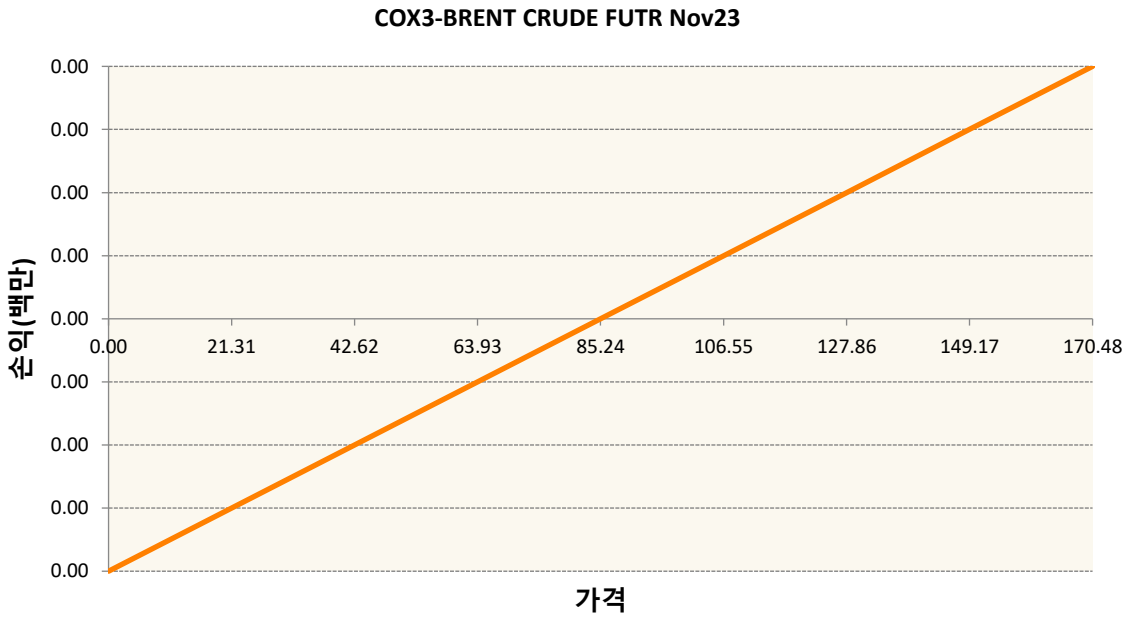
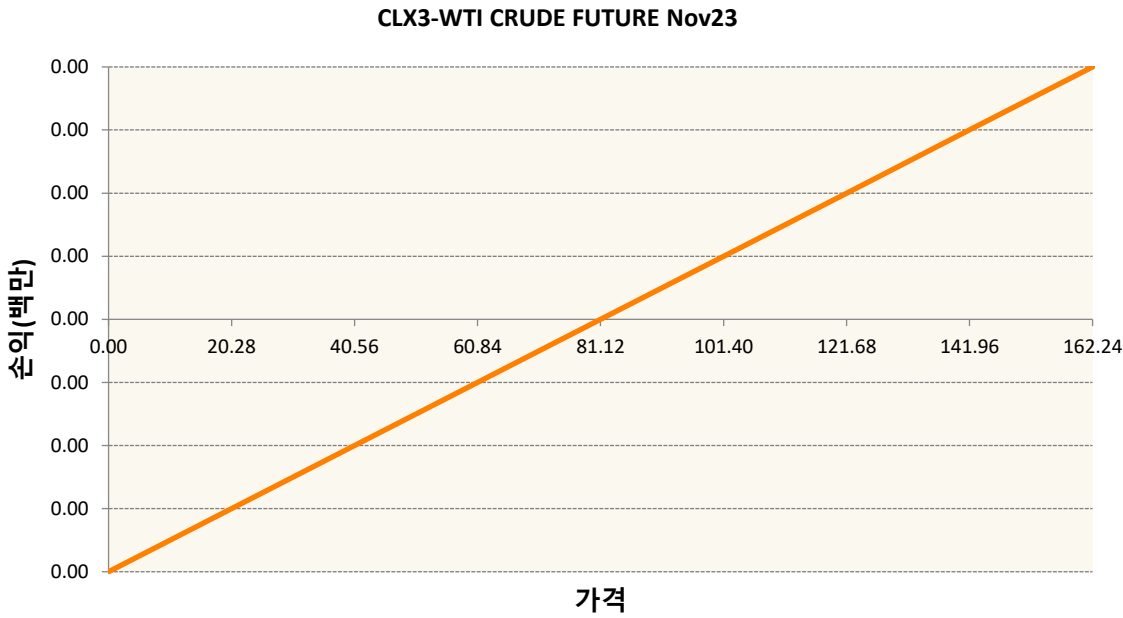
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

1. 계약금액

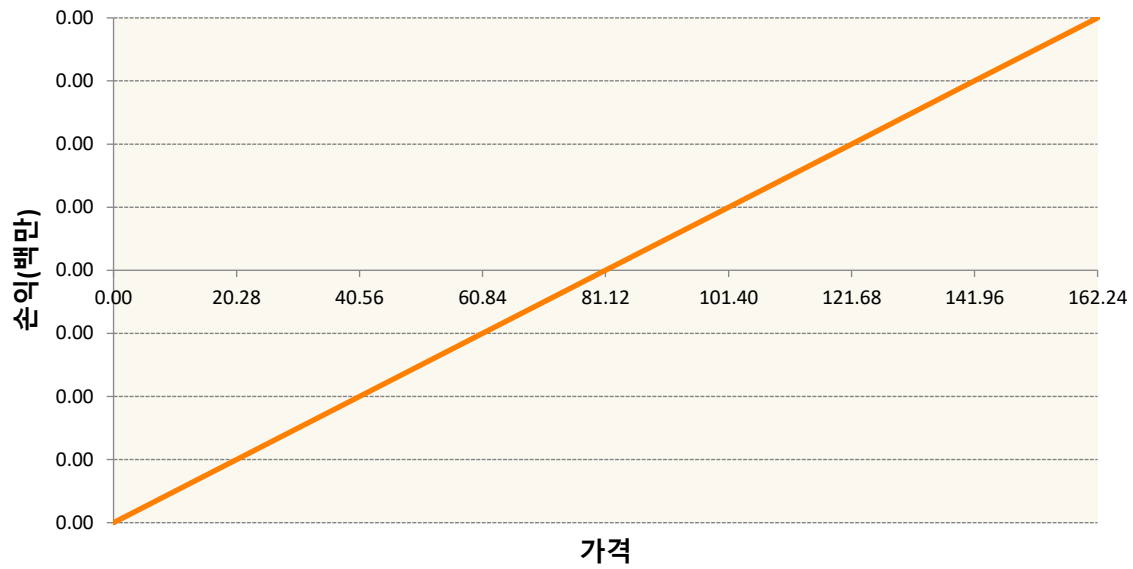
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,522	291	1,231	

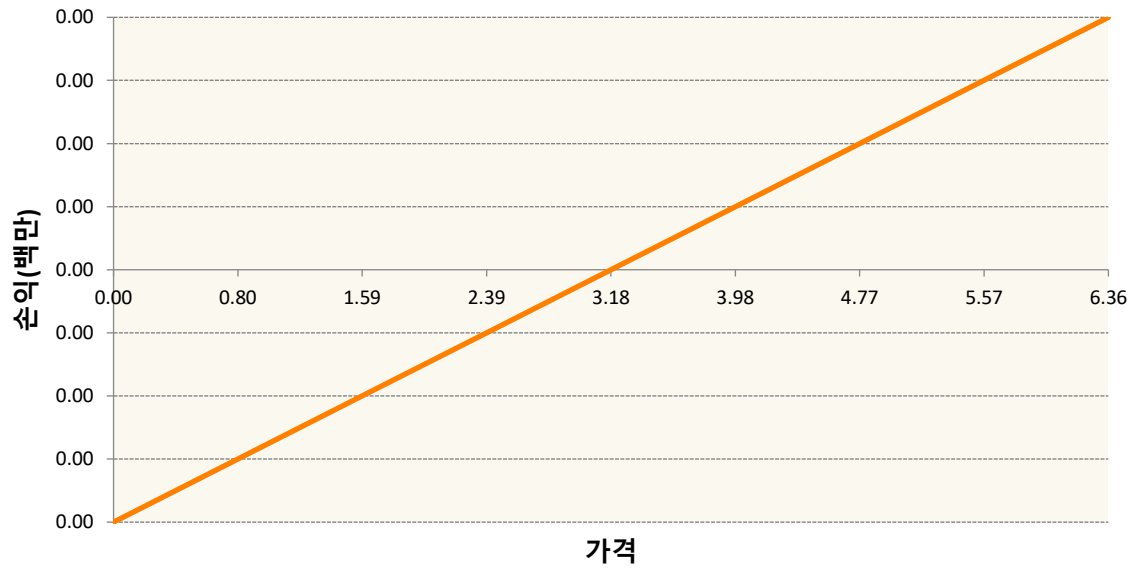
2. 만기시점의 손익구조



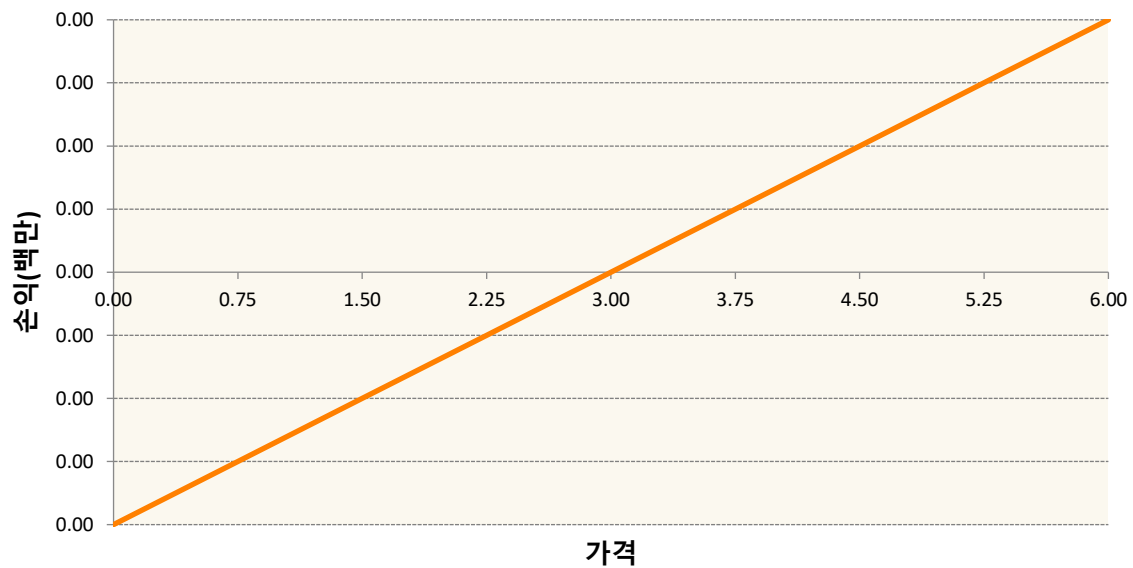
ECX3-E-MINI CRUDE OIL Nov23



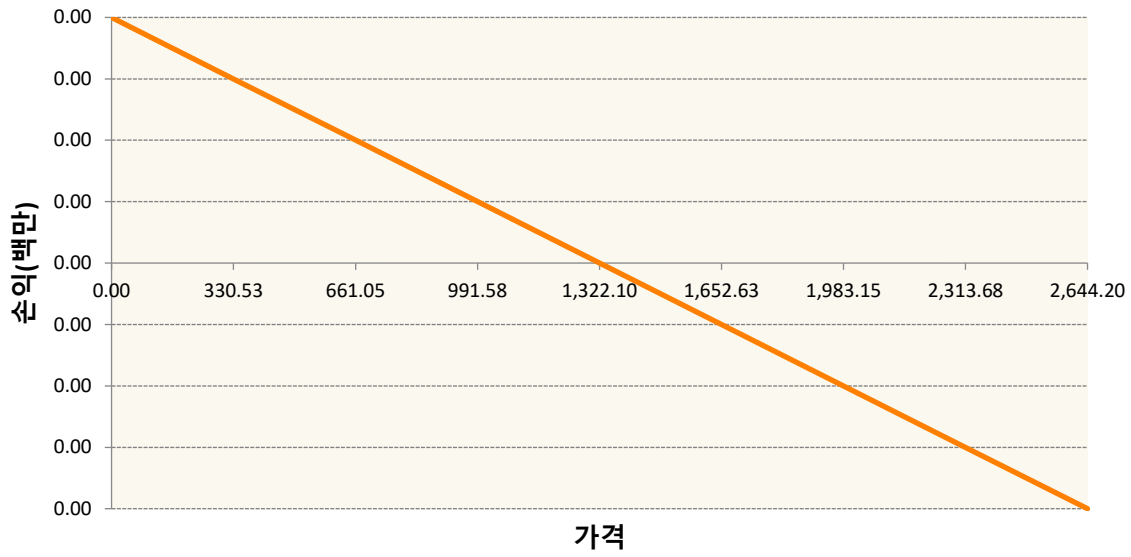
EOX3-E-MINI NATURAL GAS Nov23



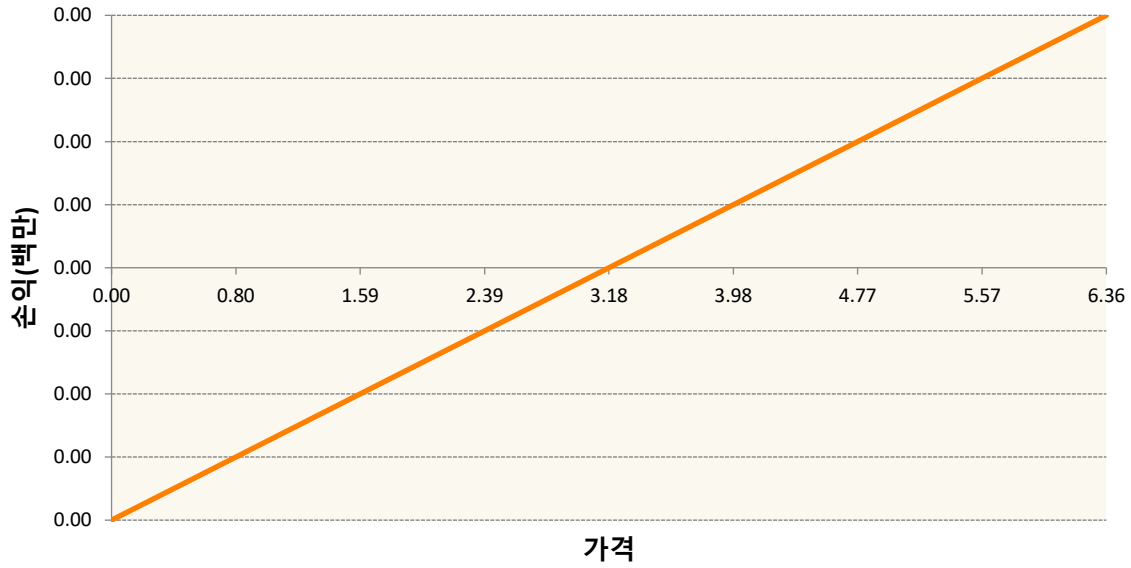
HOX3-NY Harb ULSD Fut Nov23



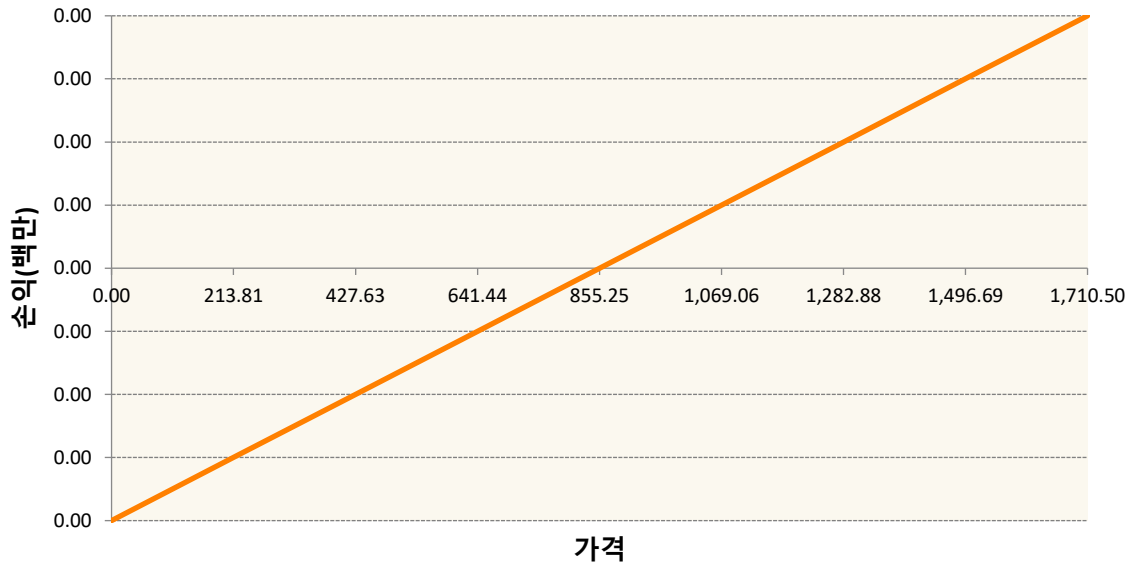
KR4175T90007-2023-09 달러선물

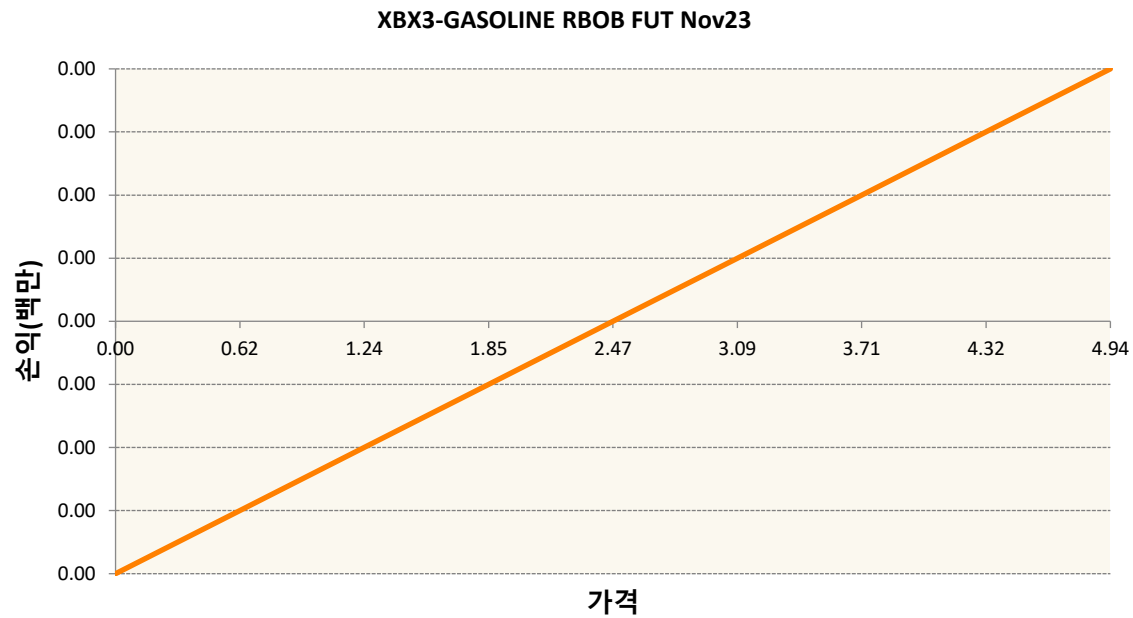


NGX23-NATURAL GAS FUTR Nov23



QX3-Low Su Gasoil G Nov23





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
CLX3	WTI CRUDE FUTURE Nov23	26
COX3	BRENT CRUDE FUTR Nov23	26
ECX3	E-MINI CRUDE OIL Nov23	9
EOX3	E-MINI NATURAL GAS Nov23	2
HOX3	NY Harb ULSD Fut Nov23	13
KR4175T900 2023-09 달러선물		23
NGX23	NATURAL GAS FUTR Nov23	27
QSX3	Low Su Gasoil G Nov23	9
XBX3	GASOLINE RBOB FUT Nov23	11

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	324