공시일	2023-09-13
기준일	2023-09-12

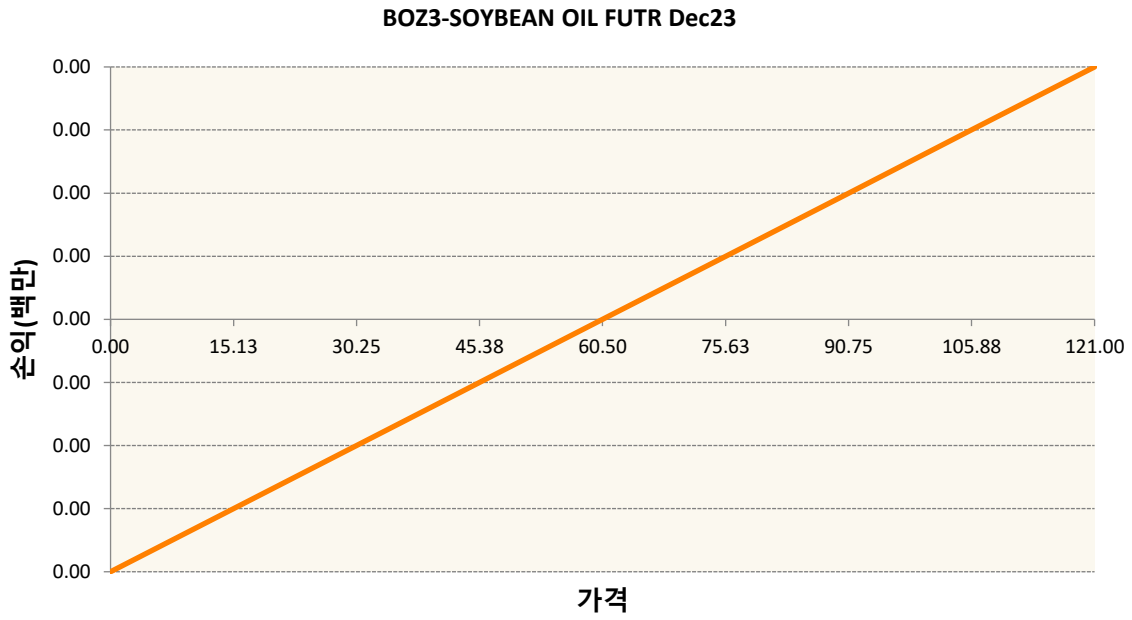
포커스농산물모(채권-파생형)

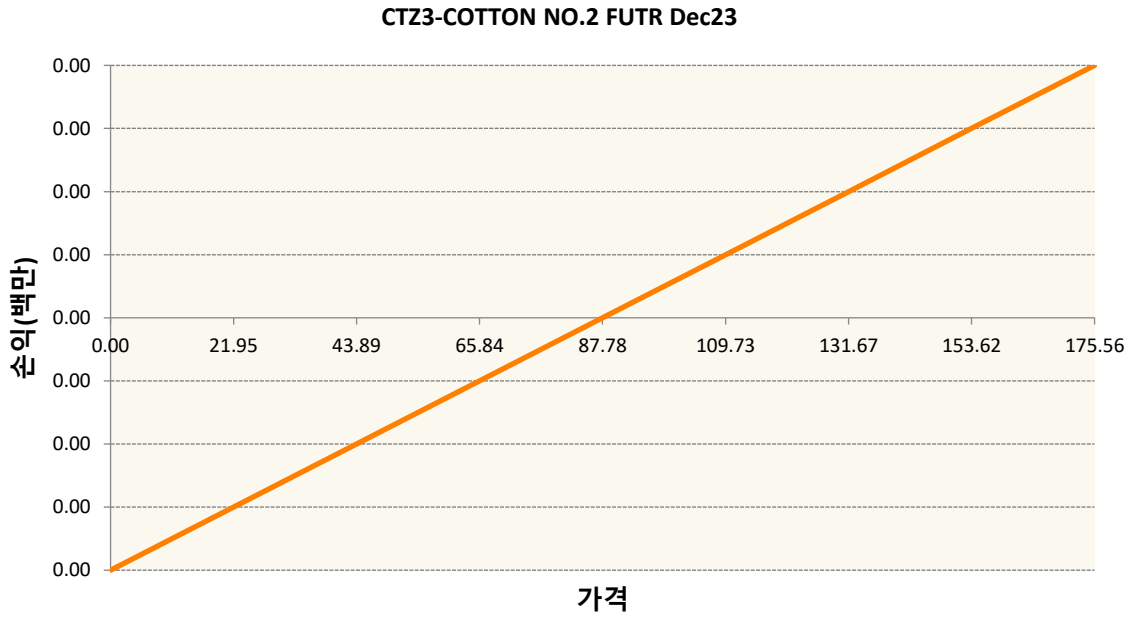
1. 계약금액

(단위:USD 백만)

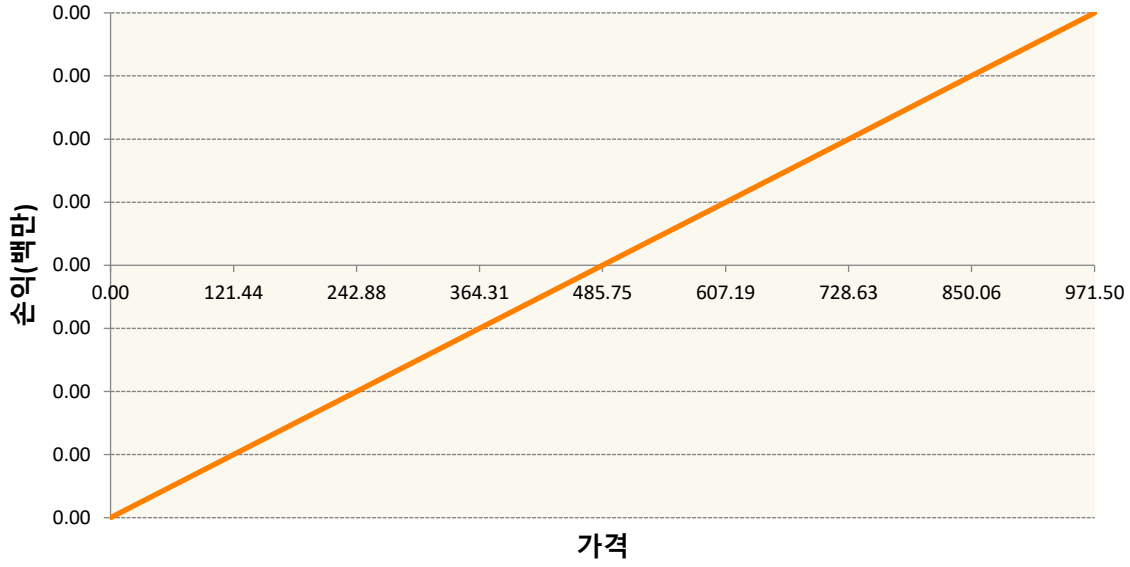
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,023	544	4,479	

2. 만기시점의 손익구조

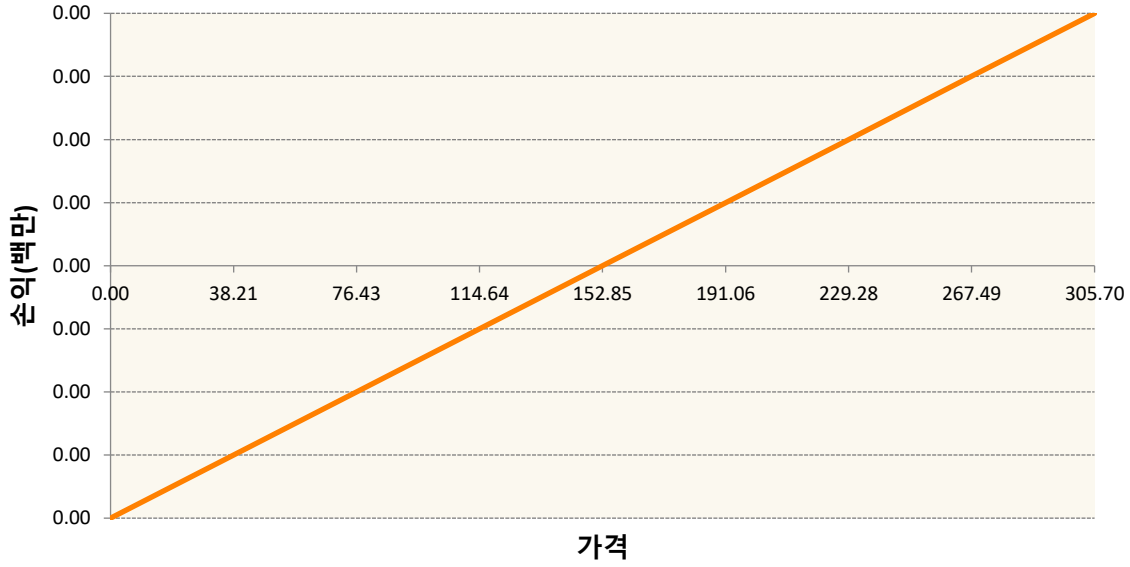




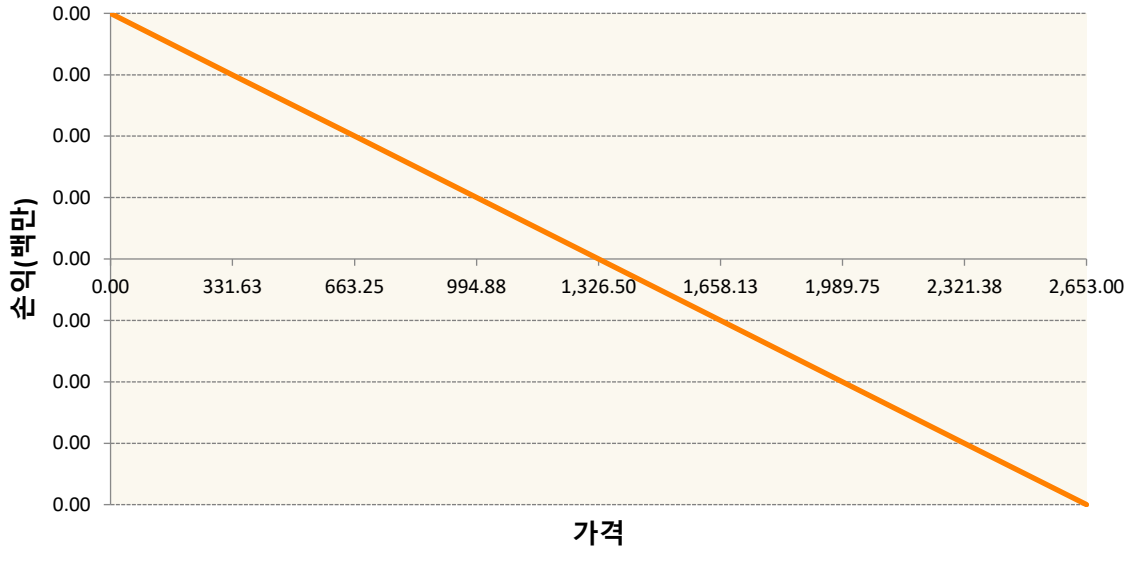
CZ3-CORN FUTURE Dec23



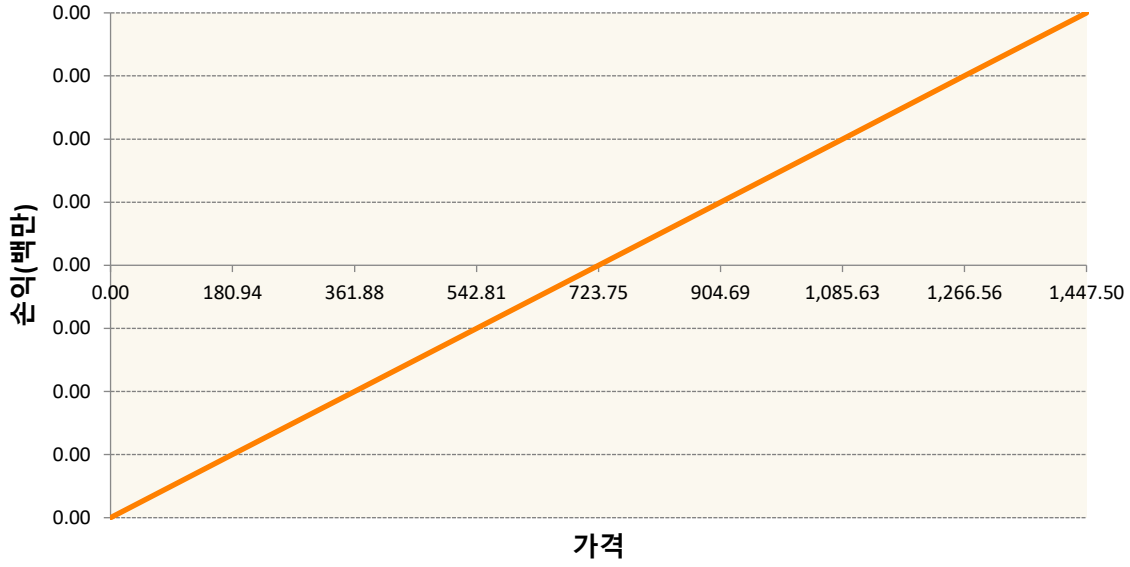
KCZ3-COFFEE 'C' FUTURE DEC23



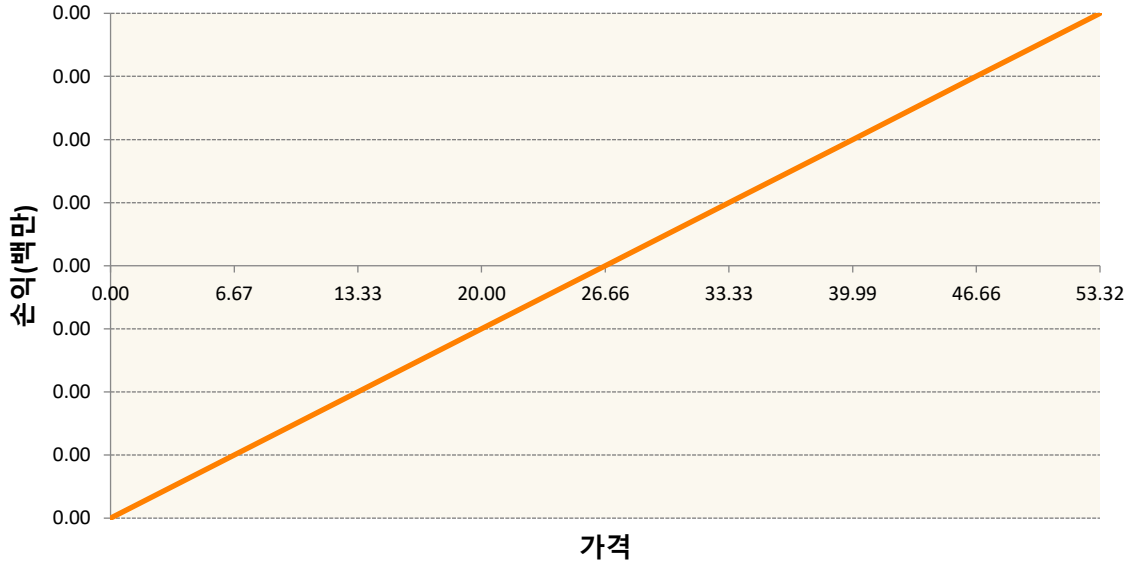
KR4175T90007-2023-09 달러선물



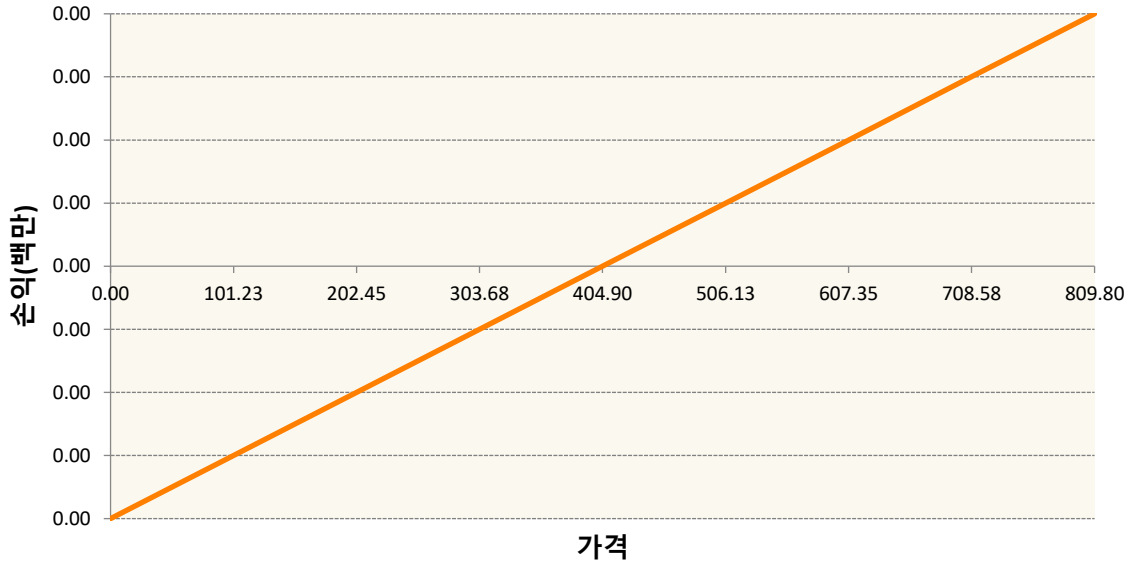
KWZ3-KC HRW WHEAT FUT DEC23

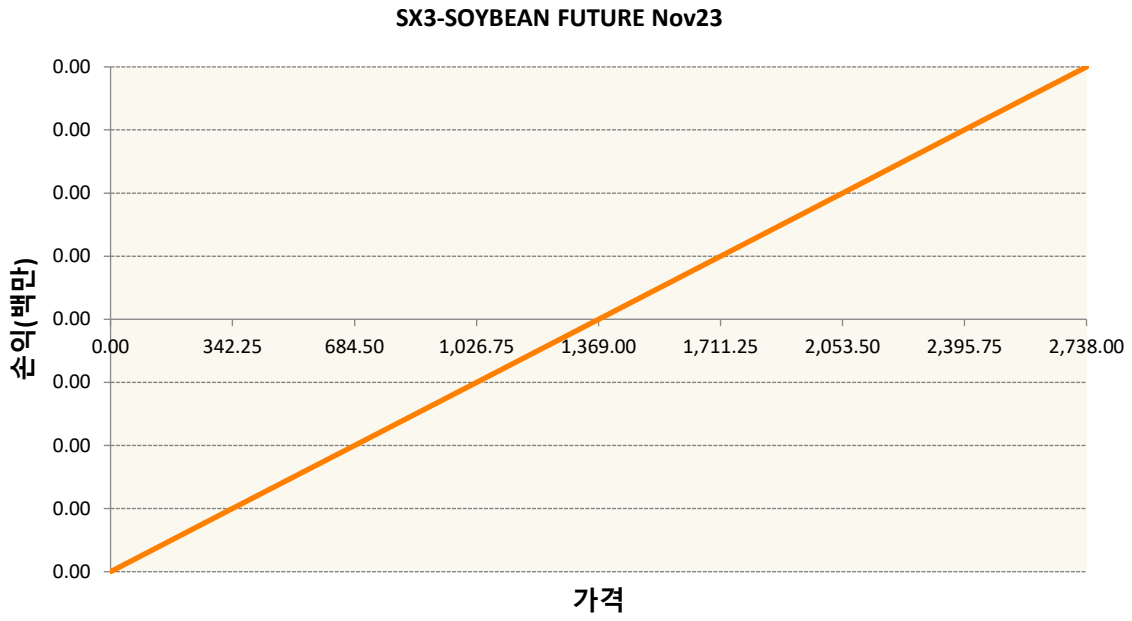


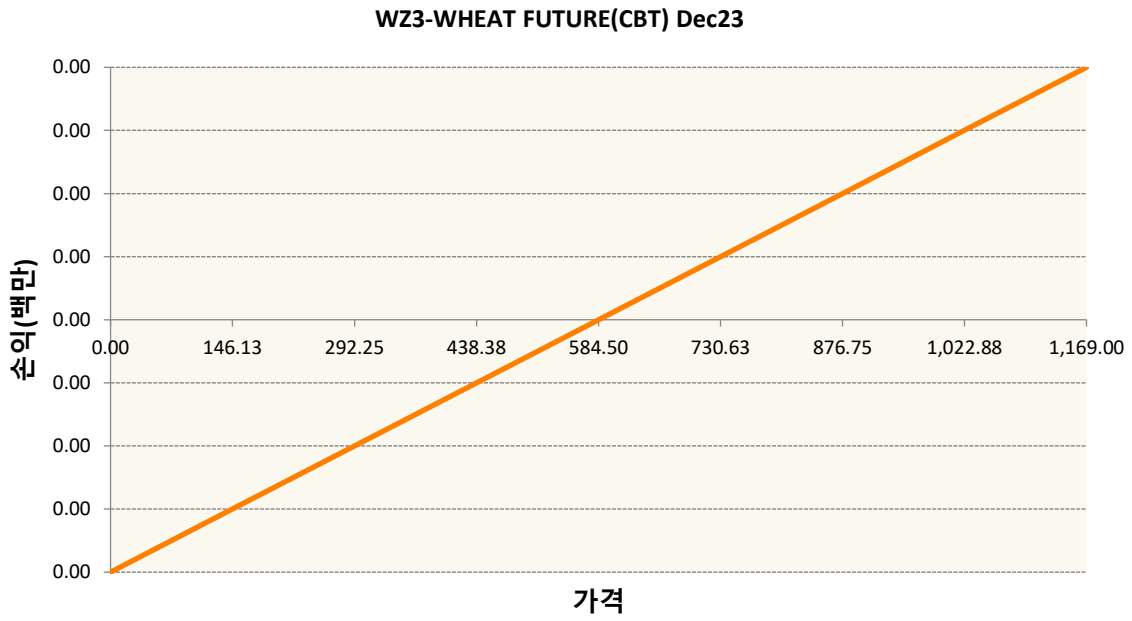
SBH4-Sugar #11 (WORLD) Mar24



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	2023-09-13
기준일	2023-09-12

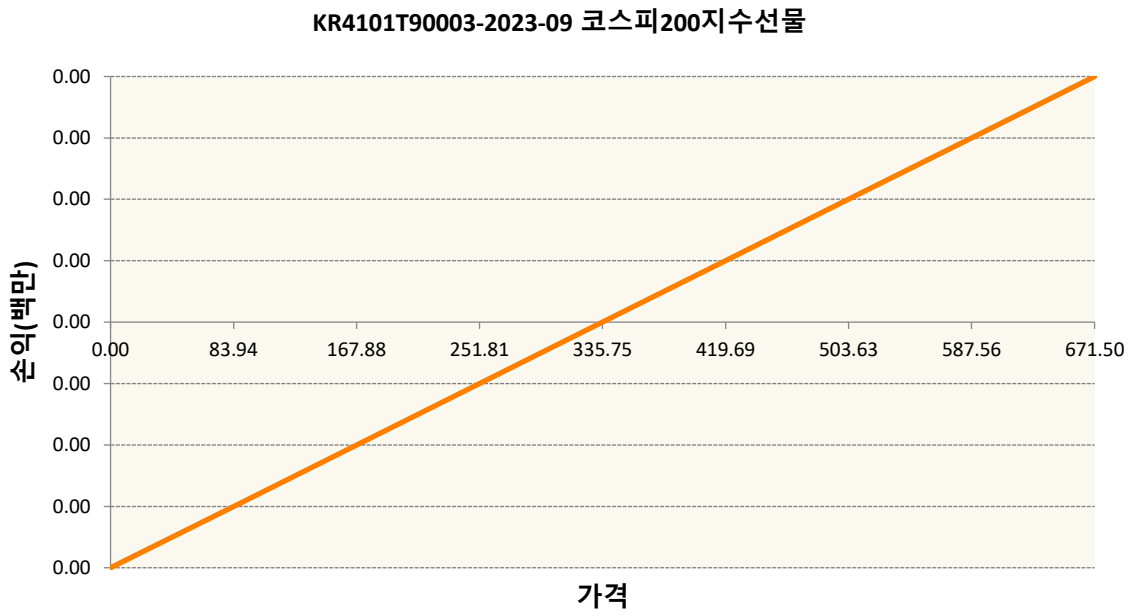
스마트인덱스모

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	1,091	0	1,091	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101T90003 2023-09 코스피200지수선물 87

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-87	-87	-87	-87	-87	-87	-87
-5.33%	-58	-58	-58	-58	-58	-58	-58
-2.67%	-29	-29	-29	-29	-29	-29	-29
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	29	29	29	29	29	29	29
5.33%	58	58	58	58	58	58	58
8.00%	87	87	87	87	87	87	87

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

81

공시일	2023-09-13
기준일	2023-09-12

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)

332

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2023-09-13
기준일	2023-09-12

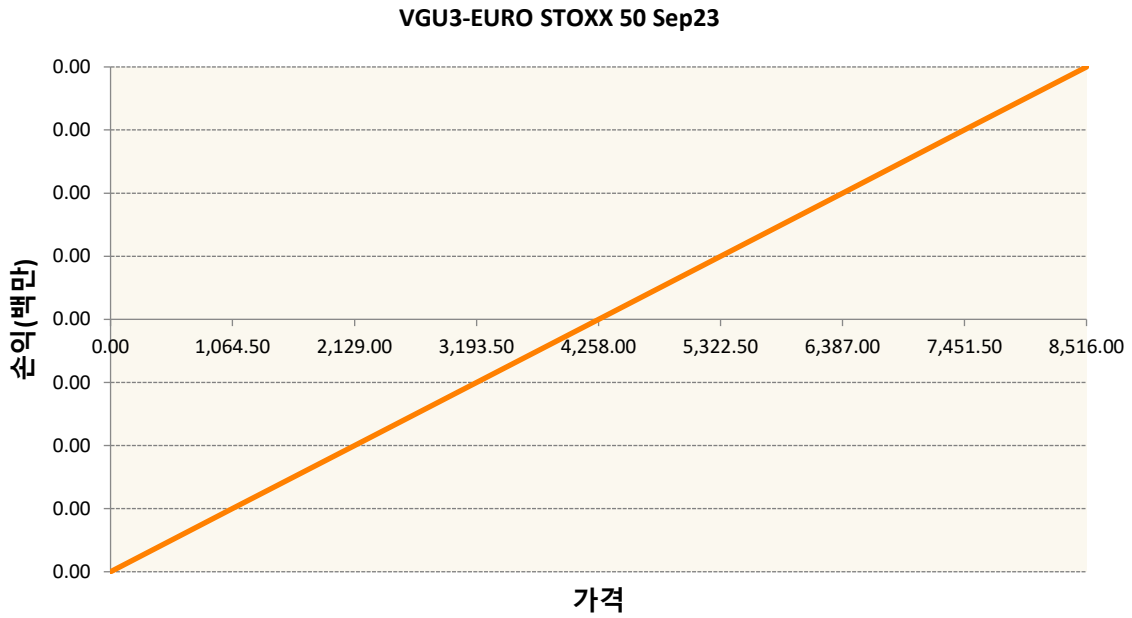
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	352	0	352	

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	2023-09-13
기준일	2023-09-12

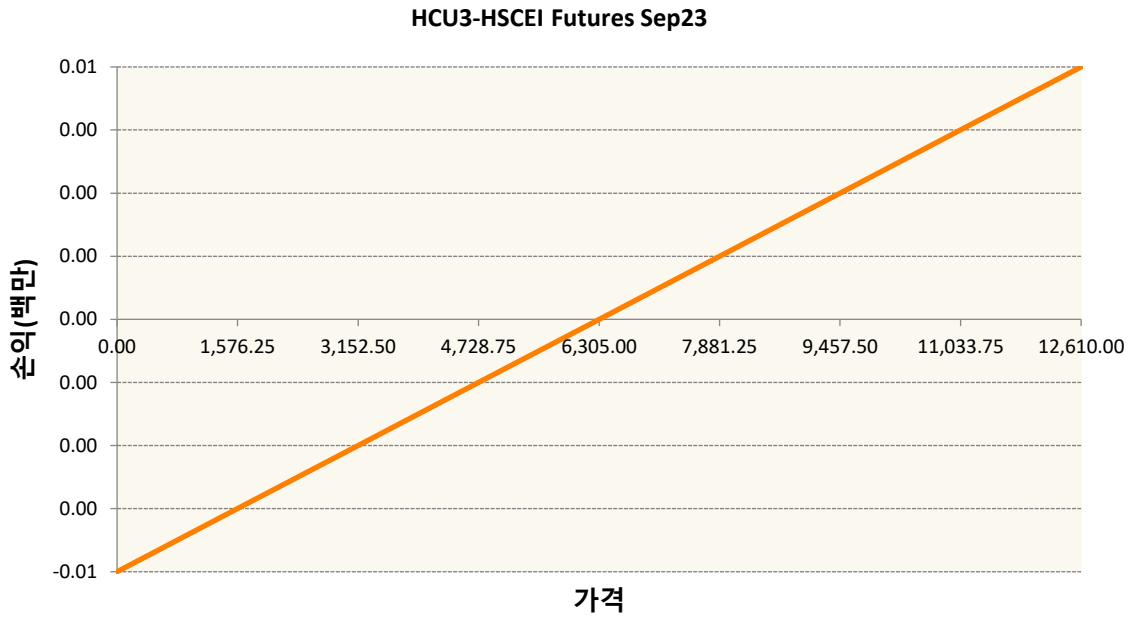
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,169	0	1,169	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCU3	HSCEI Futures Sep23	94

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

(단위:백만원)

143

공시일	2023-09-13
기준일	2023-09-12

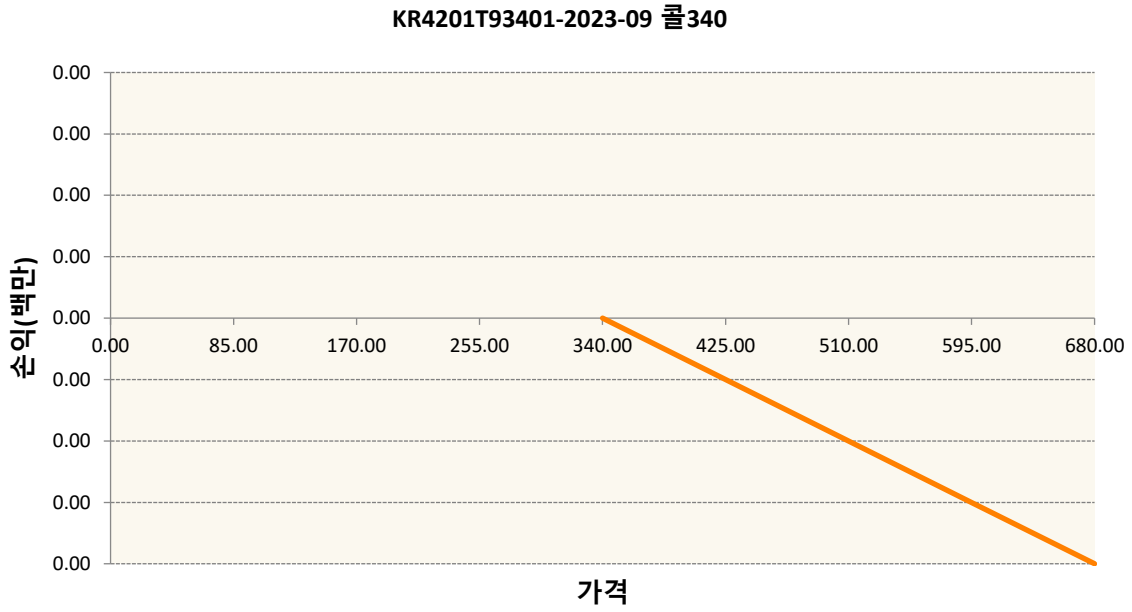
커버드콜모(주식혼합-파생형)

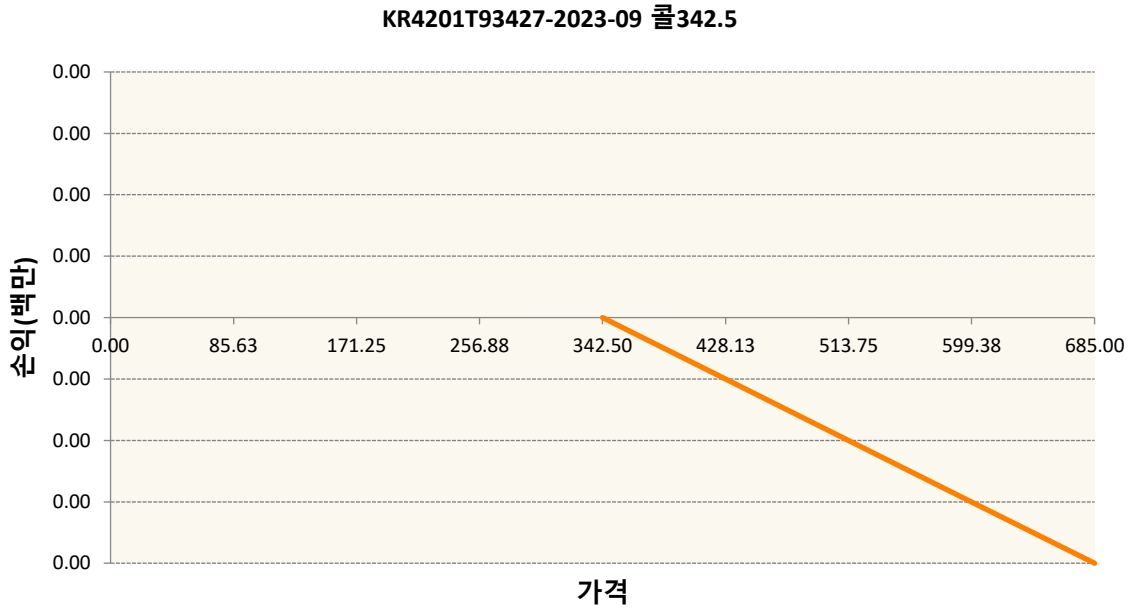
1. 계약금액

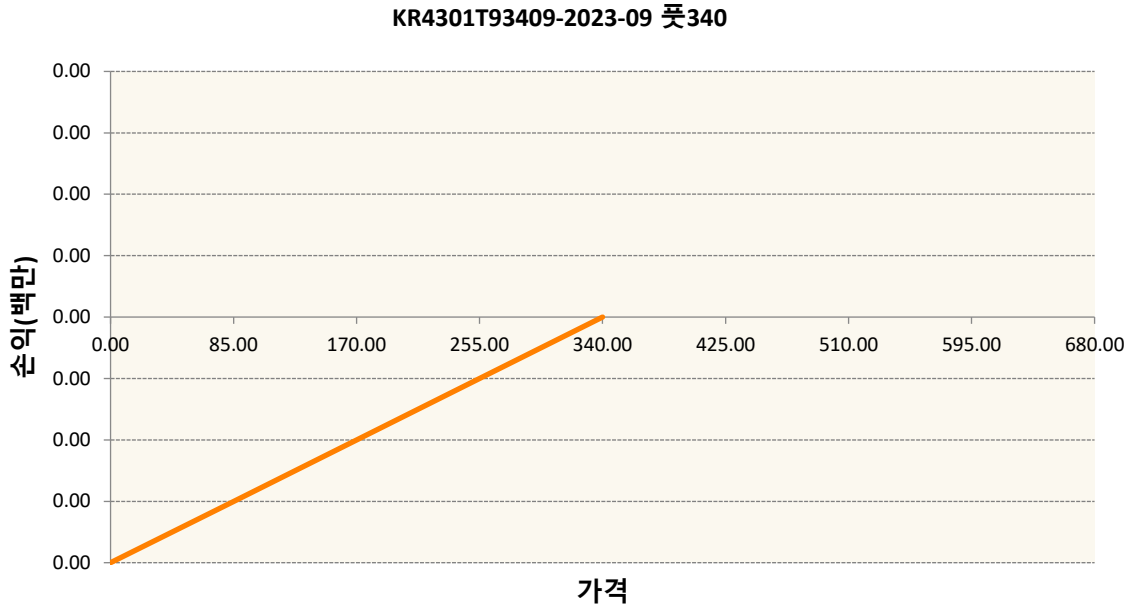
(단위:백만원)

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







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

	KR4201T93401	2023-09 콜340					2,225
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	73	73	73	73	73	73	73
-5.33%	73	73	73	73	73	73	72
-2.67%	72	72	72	71	70	68	65
0%	39	27	14	0	-15	-30	-46
2.67%	-424	-436	-449	-463	-478	-493	-509
5.33%	-1,308	-1,308	-1,309	-1,310	-1,311	-1,314	-1,317
8.00%	-2,225	-2,225	-2,225	-2,225	-2,225	-2,225	-2,225
	KR4201T93427	2023-09 콜342.5					569
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	9	9	9	9	9	9	9
-5.33%	9	9	9	9	9	9	9
-2.67%	9	9	9	9	9	9	8
0%	6	5	2	0	-3	-6	-9
2.67%	-76	-81	-86	-91	-96	-102	-107
5.33%	-309	-310	-310	-311	-312	-314	-315
8.00%	-568	-568	-568	-568	-568	-569	-569
	KR4301T93409	2023-09 풋340					769
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-769	-769	-769	-769	-769	-769	-769
-5.33%	-511	-511	-511	-511	-511	-511	-511
-2.67%	-254	-254	-254	-254	-254	-254	-254
0%	2	2	1	0	-1	-2	-4

2.67%	130	129	128	127	126	125	123
5.33%	130	130	130	130	130	130	130
8.00%	130	130	130	130	130	130	130

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

4,207

공시일	2023-09-13
기준일	2023-09-12

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	4,560	0	4,560	

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	2023-09-13
기준일	2023-09-12

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	4,635	0	4,635	

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	2023-09-13
기준일	2023-09-12

H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	266	-266	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	17,446	0	17,446	
누계	통화	선도	531	17,826	-17,295	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213D6S(	KRW/USD 27-09-23E	558
FXW213D7T(	KRW/USD 31-10-23E	264
FXW213D8W	KRW/USD 30-11-23E	604
FXW213D98(	USD/KRW 27-09-23E	42

IE00BD8RGM75 * 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

830

공시일	2023-09-13
기준일	2023-09-12

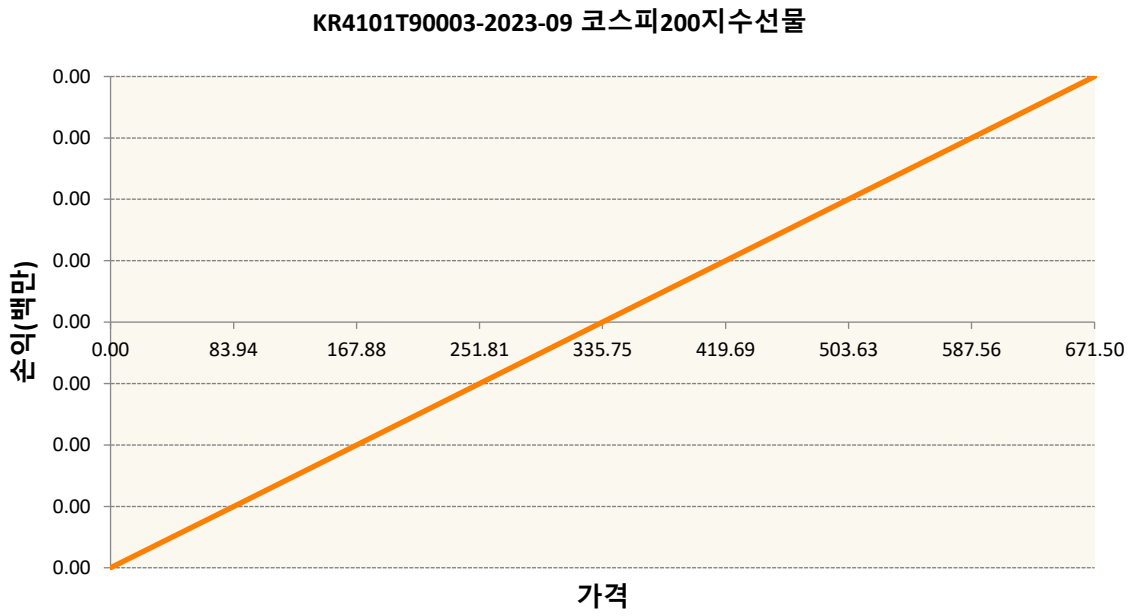
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

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	504	0	504	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

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

38

공시일	2023-09-13
기준일	2023-09-12

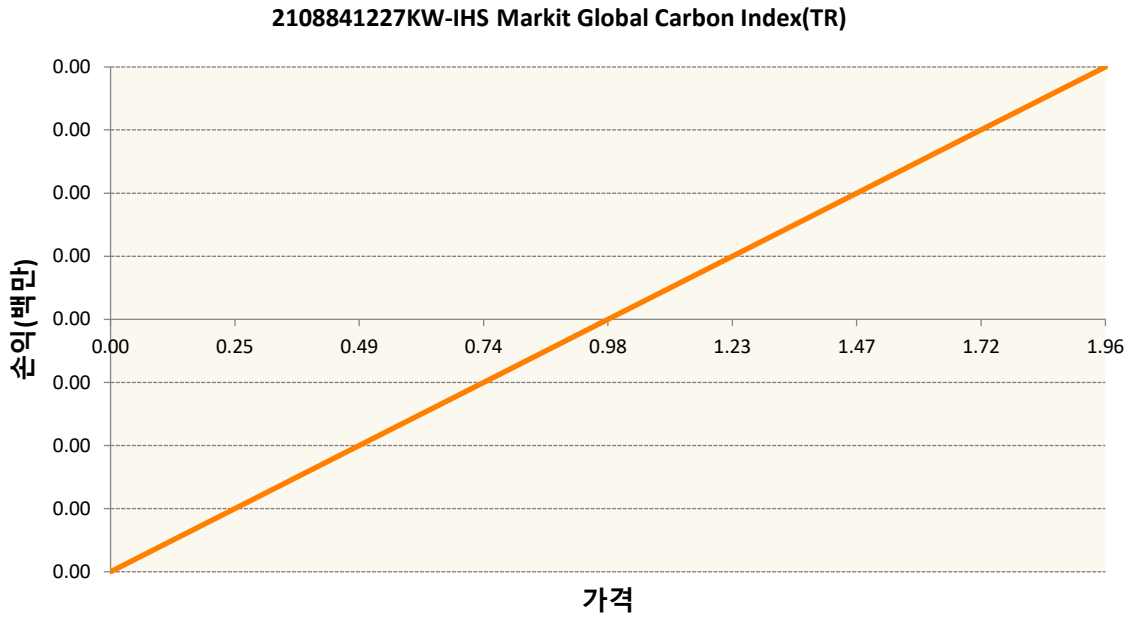
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

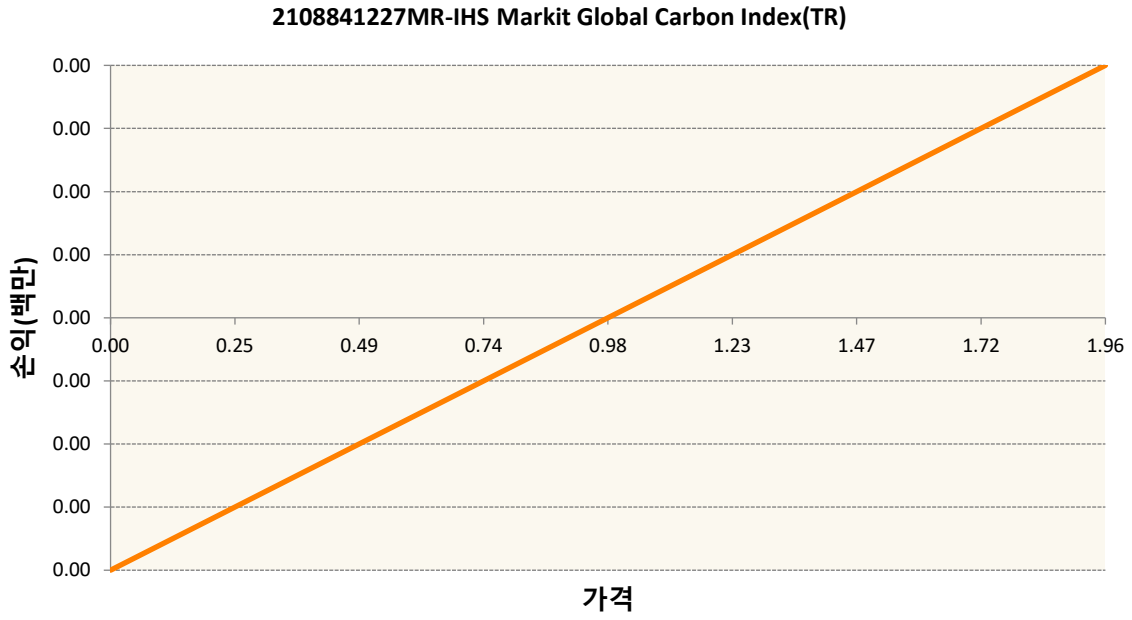
1. 계약금액

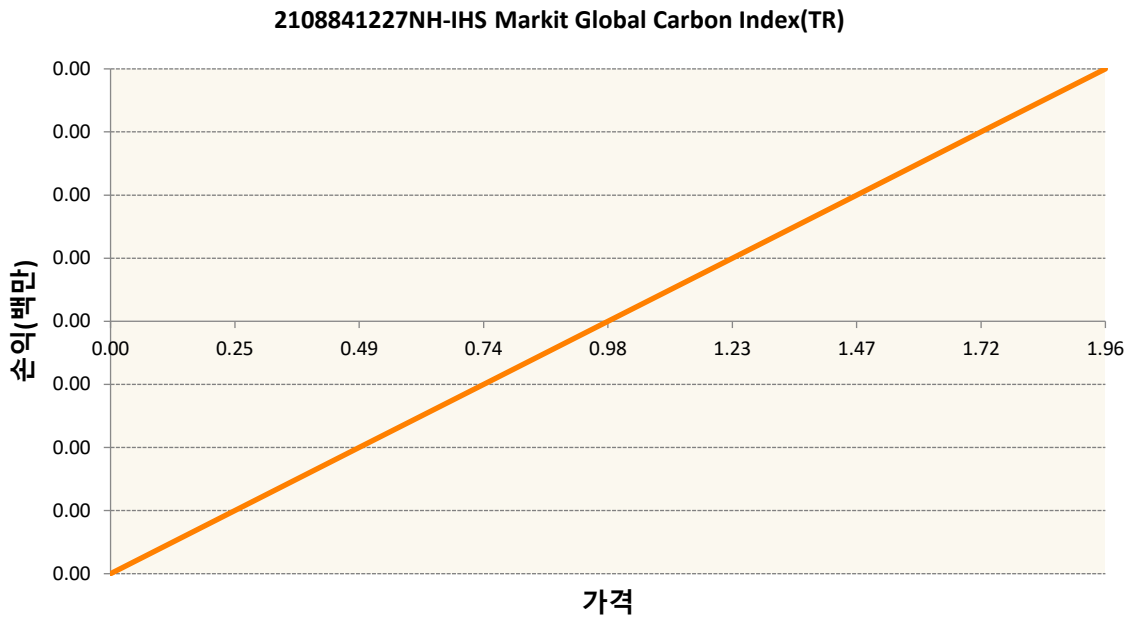
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	25,747	0	25,747	

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
2108841227IIHS Markit Global Carbon Index(TR)	1,751
2108841227IIHS Markit Global Carbon Index(TR)	206
2108841227IIHS Markit Global Carbon Index(TR)	103

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	2,897

공시일	2023-09-13
기준일	2023-09-12

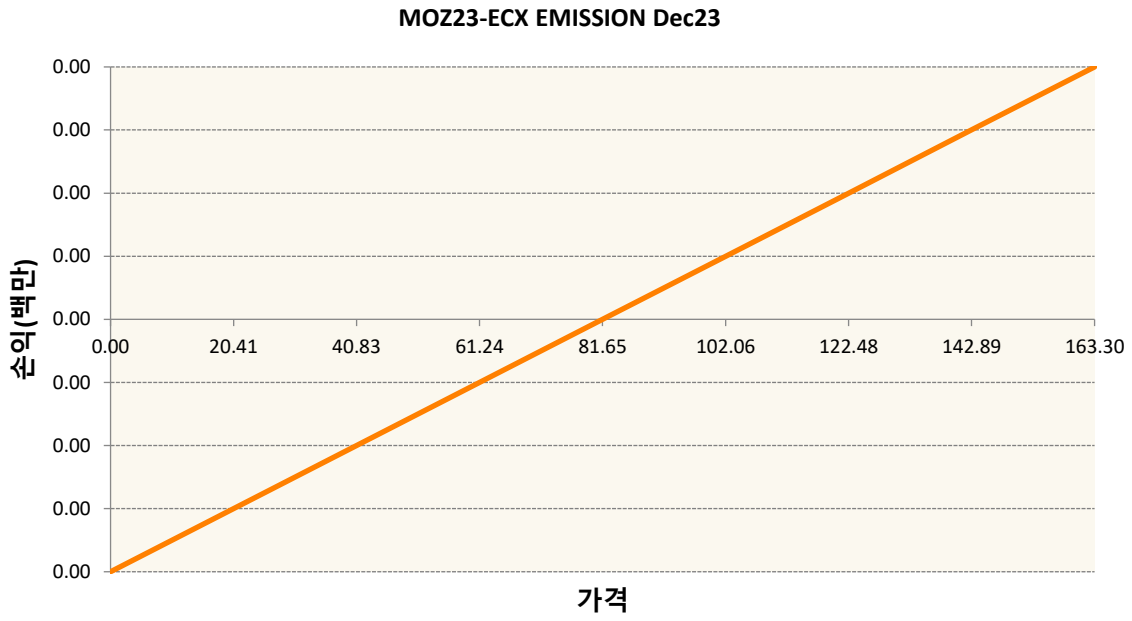
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	7,800	0	7,800	
누계	지수	스왑	479	0	479	장외
누계	통화	선도	0	1,946	-1,946	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213D8W\ KRW/EUR 27-09-23E	5
FXW213D8W\ KRW/EUR 27-09-23E	151
MOZ23 ECX EMISSION Dec23	624
SWICEUACN ICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX	1

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

(단위:백만원)

1,322

공시일	2023-09-13
기준일	2023-09-12

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)	27
SWCSI00000 신한CSI Index 230622 (키움)	27
SWCSI00000 신한CSI Index 230622 (미래)	27
SWCSI00000 신한CSI Index 230622 (메리츠)	27

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

(단위:백만원)

172

공시일	2023-09-13
기준일	2023-09-12

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)	18
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 230116(메리츠)	25
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 230116(미래)	21
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 230427(키움)	5

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

(단위:백만원)

85

공시일	2023-09-13
기준일	2023-09-12

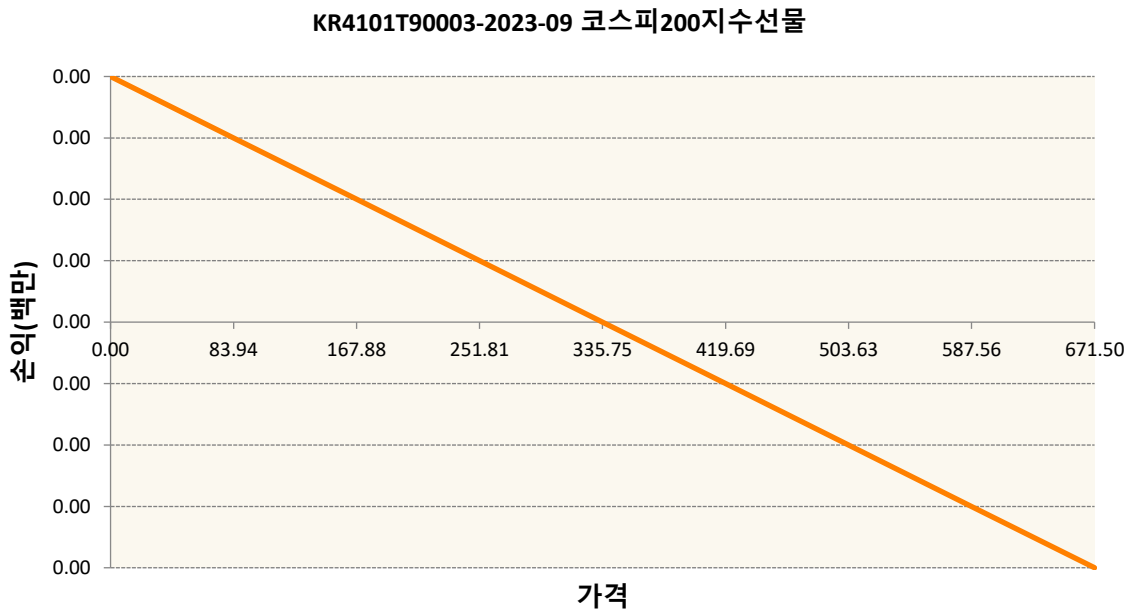
에쿼티알파일반사모혼합자산

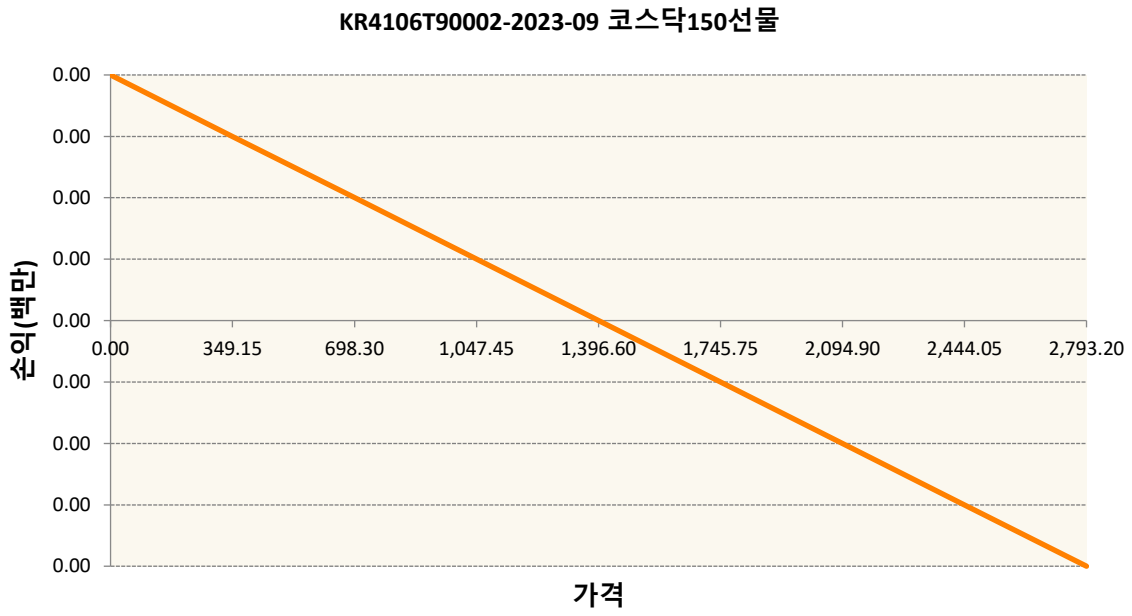
1. 계약금액

(단위:백만원)

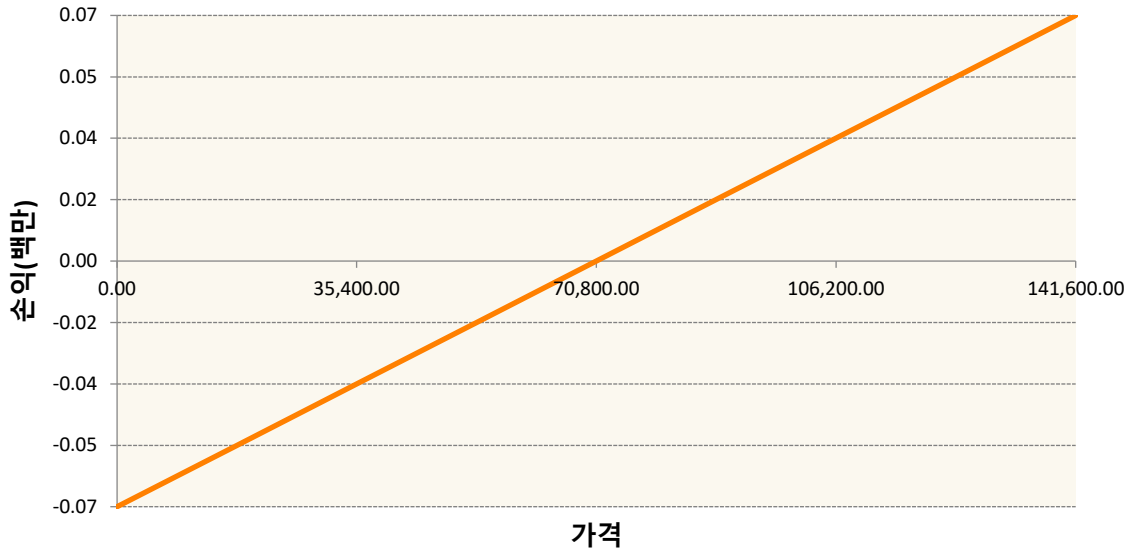
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	44	-44	장내
신규	유가증권	ELS	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	2,036	3,699	-1,663	장내
누계	유가증권	ELS	0	0	0	장외

2. 만기시점의 손익구조

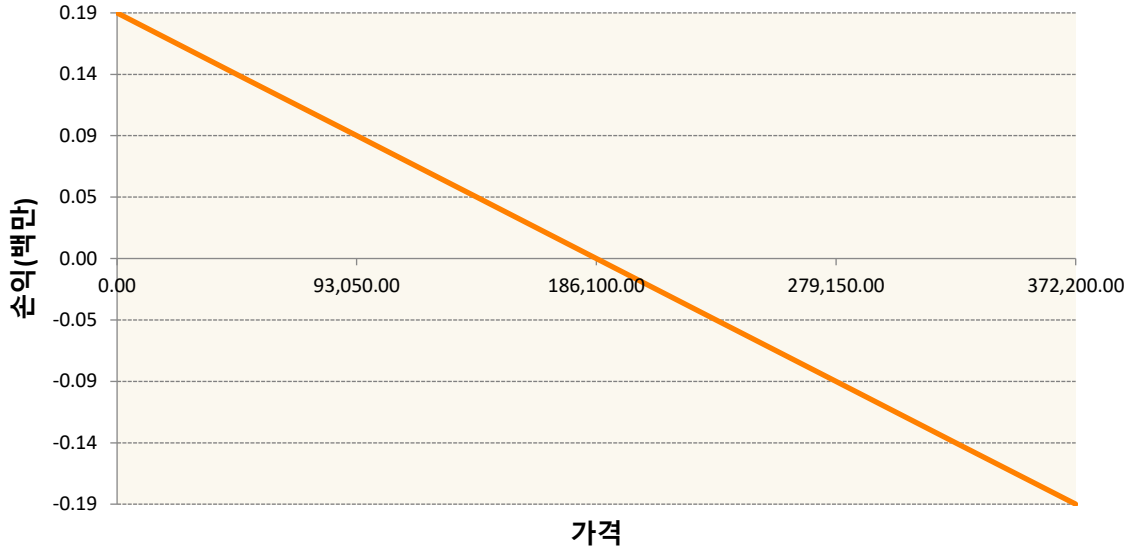




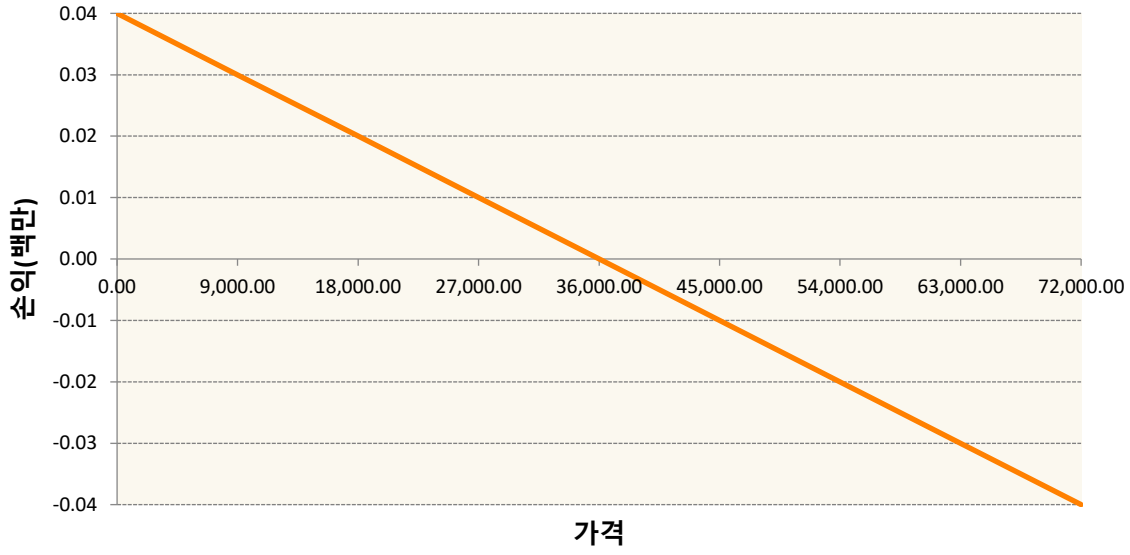
KR4111T90002-2023-09 삼성전자개별선물



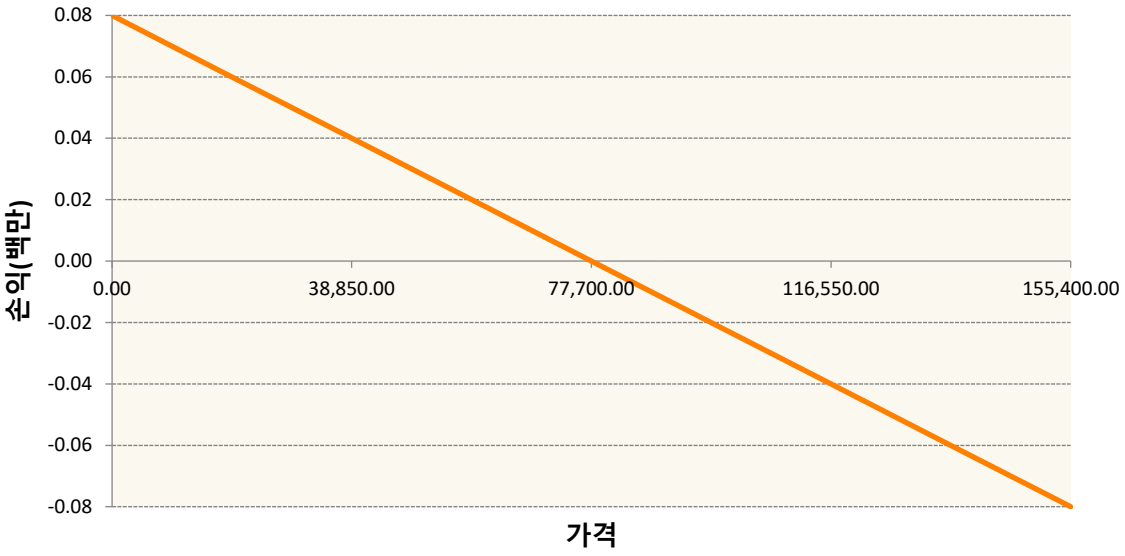
KR4116T90001-2023-09 현대차개별선물



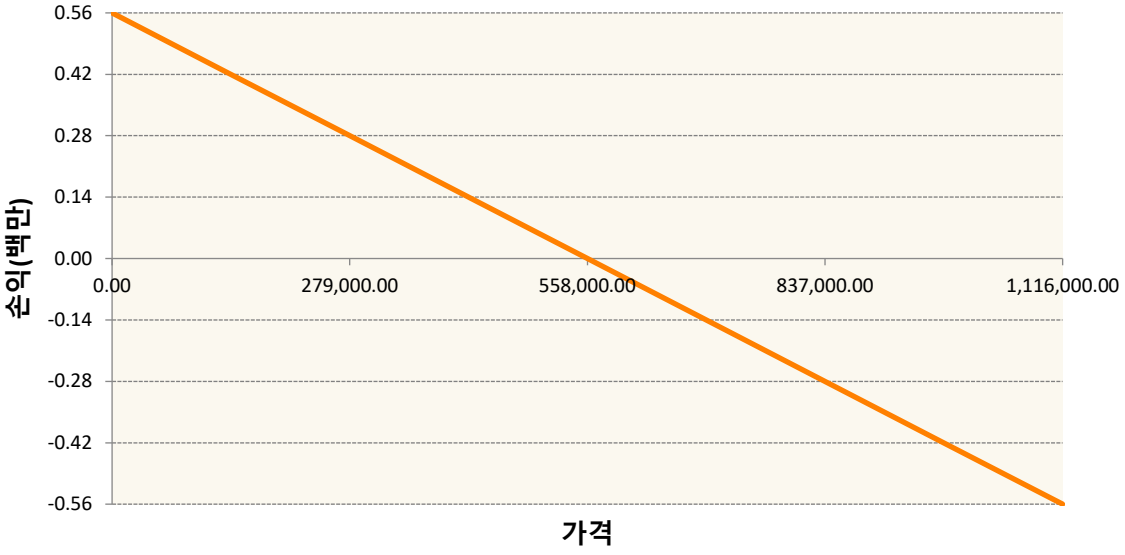
KR4118T90007-2023-09 신한지주개별선물



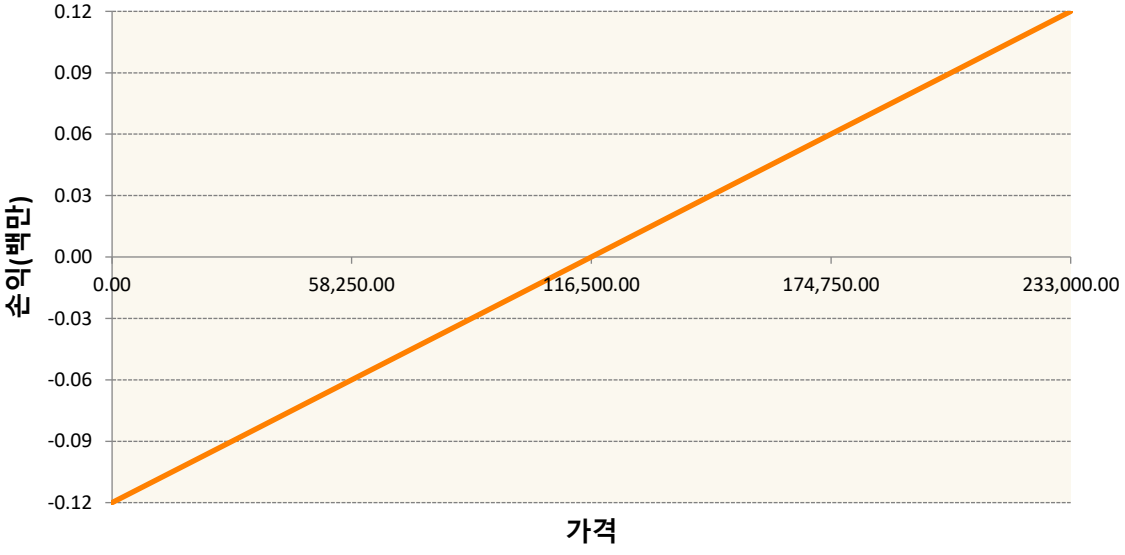
KR4119T90005-2023-09 기아개별선물



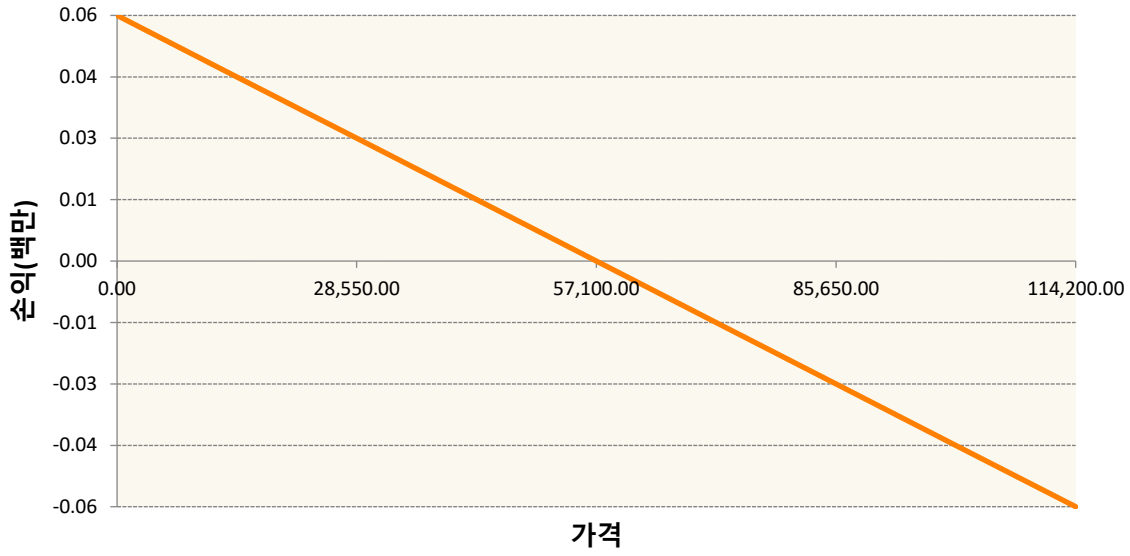
KR4147T90006-2023-09 LG화학개별선물



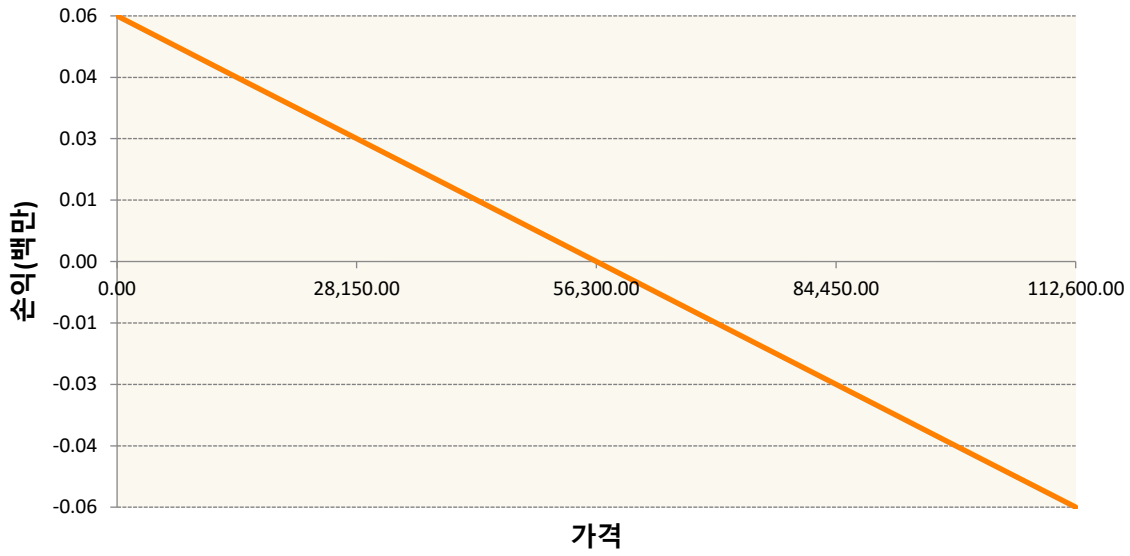
KR4150T90000-2023-09 SK하이닉스개별선물



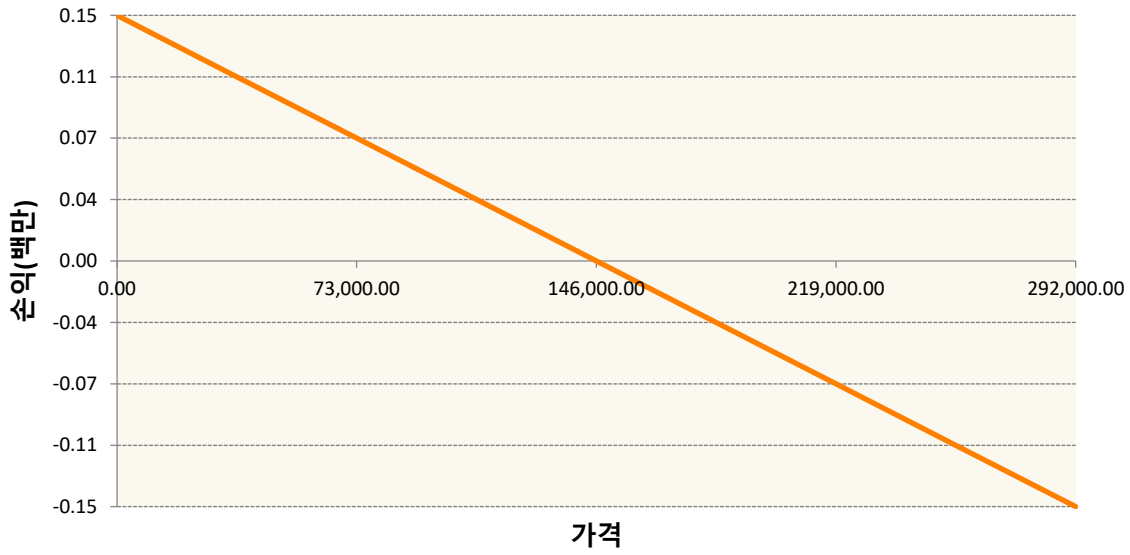
KR41CNT90002-2023-09 포스코 ICT개별선물



KR41CNTA0000-2023-10 포스코DX개별선물



KR41CPT90007-2023-09 셀트리온개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101T900	2023-09	코스피200지수선물	195
KR4106T900	2023-09	코스닥150선물	48
KR4111T900	2023-09	삼성전자개별선물	138
KR4116T900	2023-09	현대차개별선물	7
KR4118T900	2023-09	신한지주개별선물	4
KR4119T900	2023-09	기아개별선물	7
KR4147T900	2023-09	LG화학개별선물	13
KR4150T900	2023-09	SK하이닉스개별선물	25
KR41CNT90(	2023-09	포스코 ICT개별선물	4
KR41CNTA0(	2023-10	포스코DX개별선물	4
KR41CPT900	2023-09	셀트리온개별선물	14
KRS0004572	ELWKB금융_주식스왑		1
KRS0004586	ELWSK스퀘어_주식스왑3		0.09

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

621

공시일	2023-09-13
기준일	2023-09-12

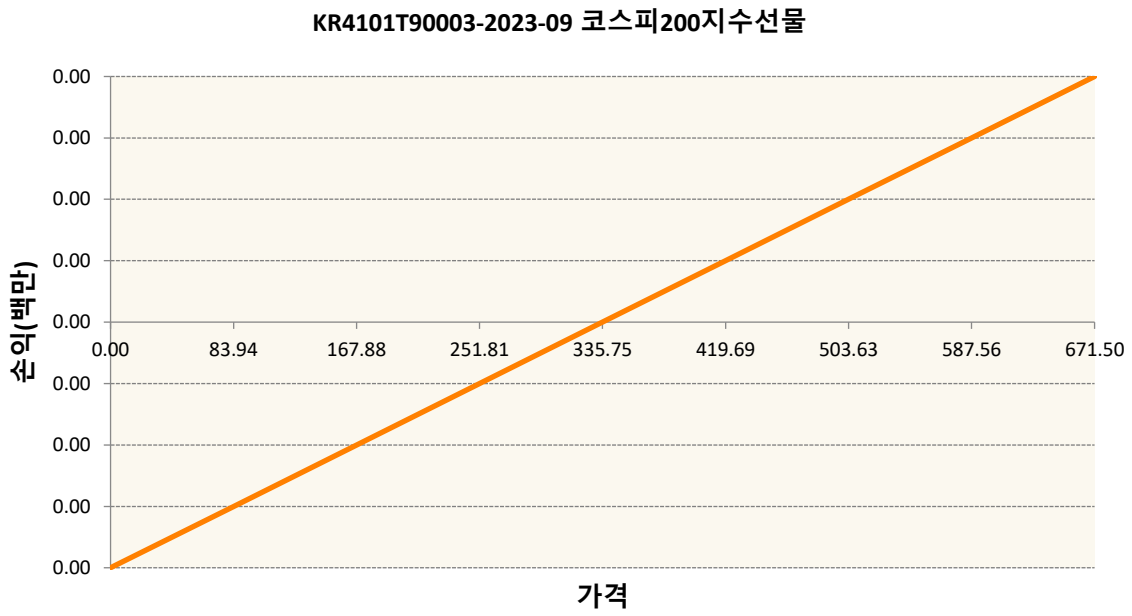
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	252	-252	장내
누계	유가증권	선물	1,091	0	1,091	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101T90003 2023-09 코스피200지수선물 87

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-87	-87	-87	-87	-87	-87	-87
-5.33%	-58	-58	-58	-58	-58	-58	-58
-2.67%	-29	-29	-29	-29	-29	-29	-29
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	29	29	29	29	29	29	29
5.33%	58	58	58	58	58	58	58
8.00%	87	87	87	87	87	87	87

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

81

공시일	2023-09-13
기준일	2023-09-12

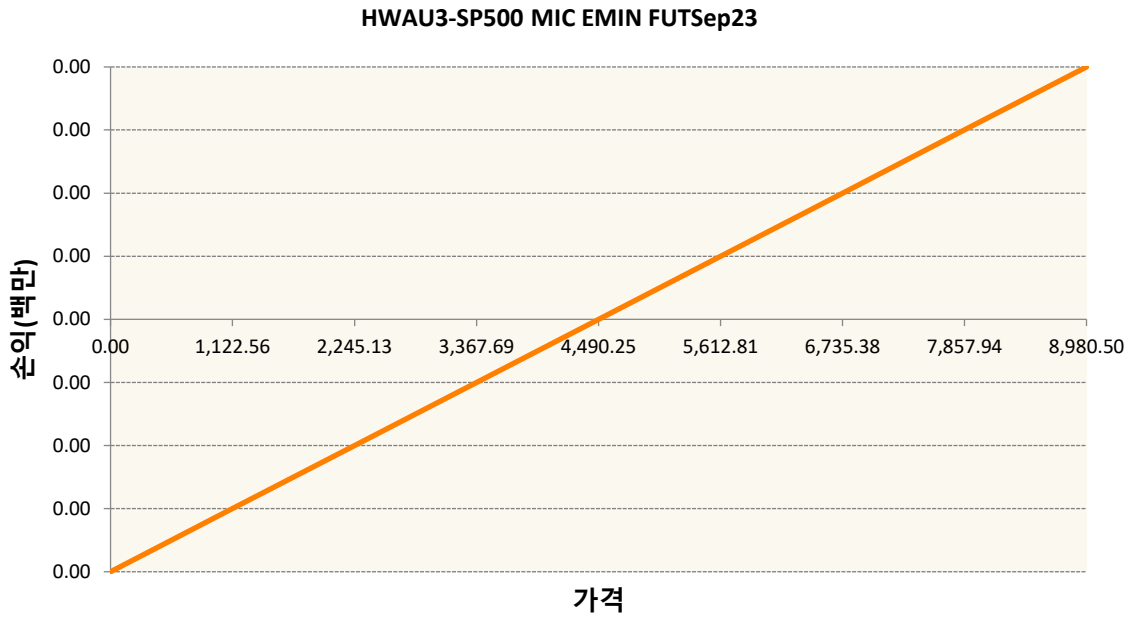
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

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	1,038	0	1,038	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HWAU3	SP500 MIC EMIN FUTSep23	83

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

(단위:백만원)

83

공시일	2023-09-13
기준일	2023-09-12

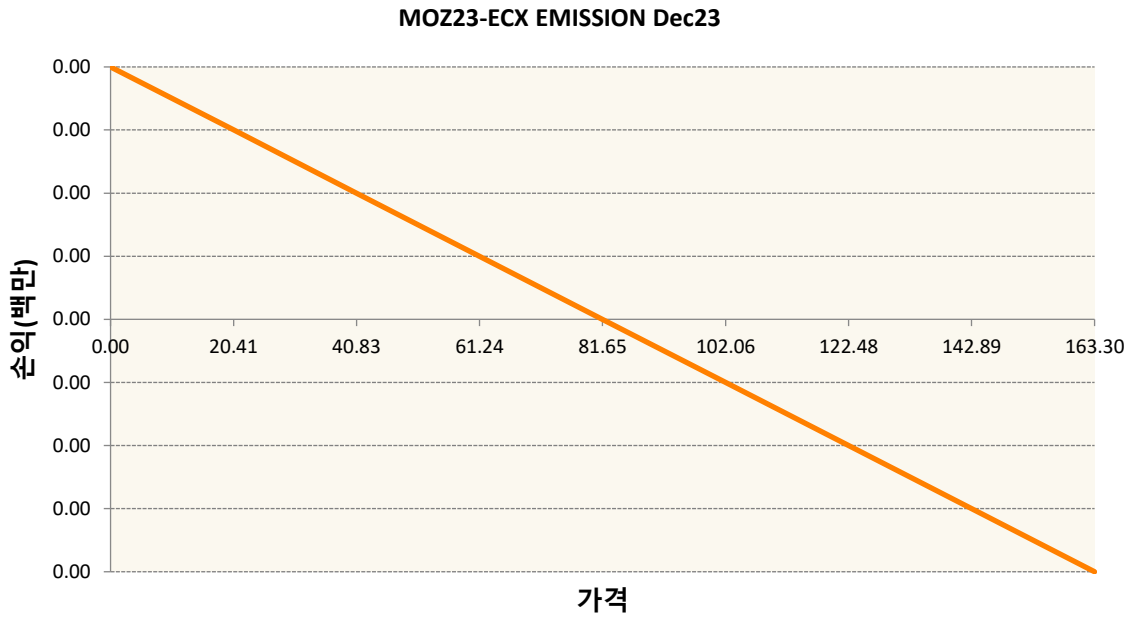
SOL유럽탄소배출권선물인버스ICE특별자산상

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	0	9,431	-9,431	
누계	지수	스왑	479	0	479	장외
누계	통화	선도	0	1,862	-1,862	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213D8W	KRW/EUR 27-09-23E	149
MOZ23	ECX EMISSION Dec23	754
SWICEUACN	ICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX	1

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

(단위:백만원)

1,569

공시일	2023-09-13
기준일	2023-09-12

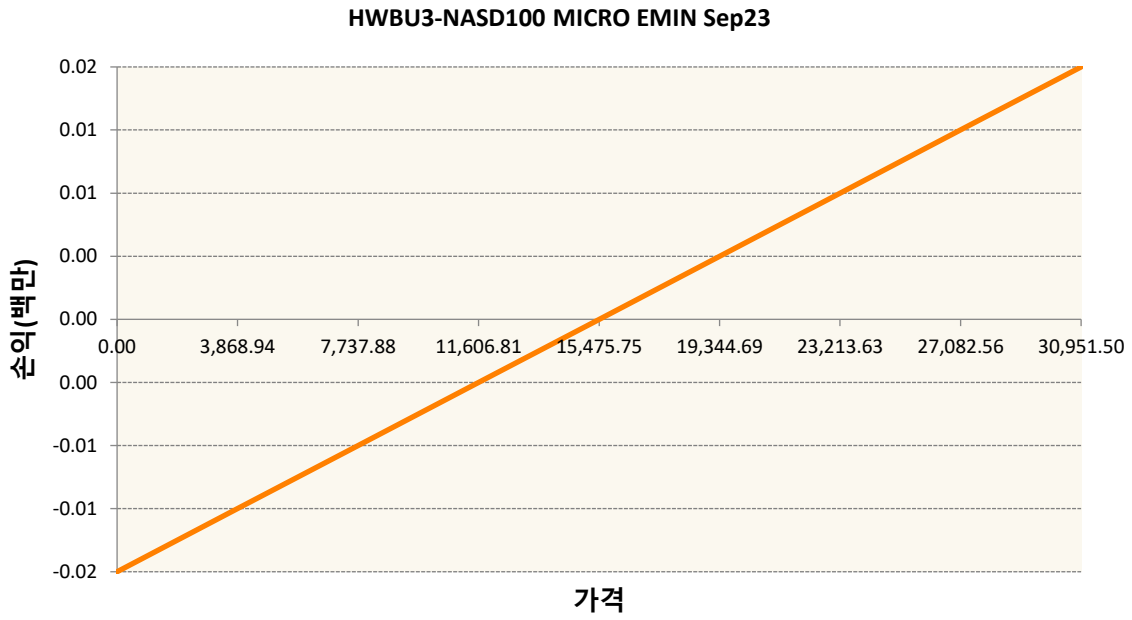
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

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	1,034	0	1,034	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HWBU3	NASD100 MICRO EMIN Sep23	83

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

(단위:백만원)

83

공시일	2023-09-13
기준일	2023-09-12

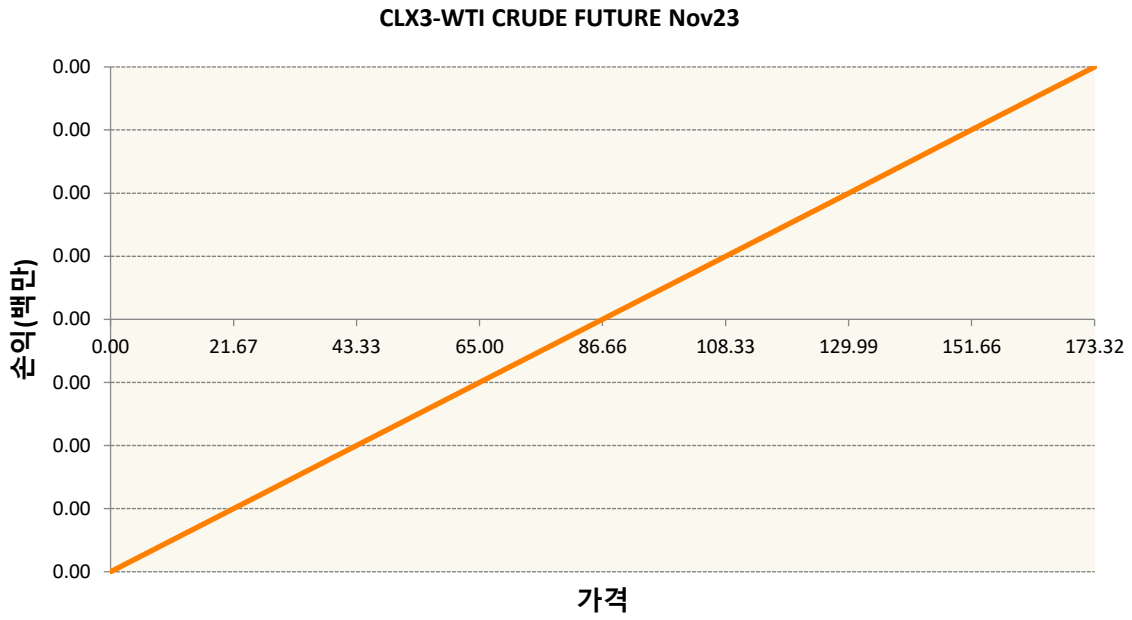
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

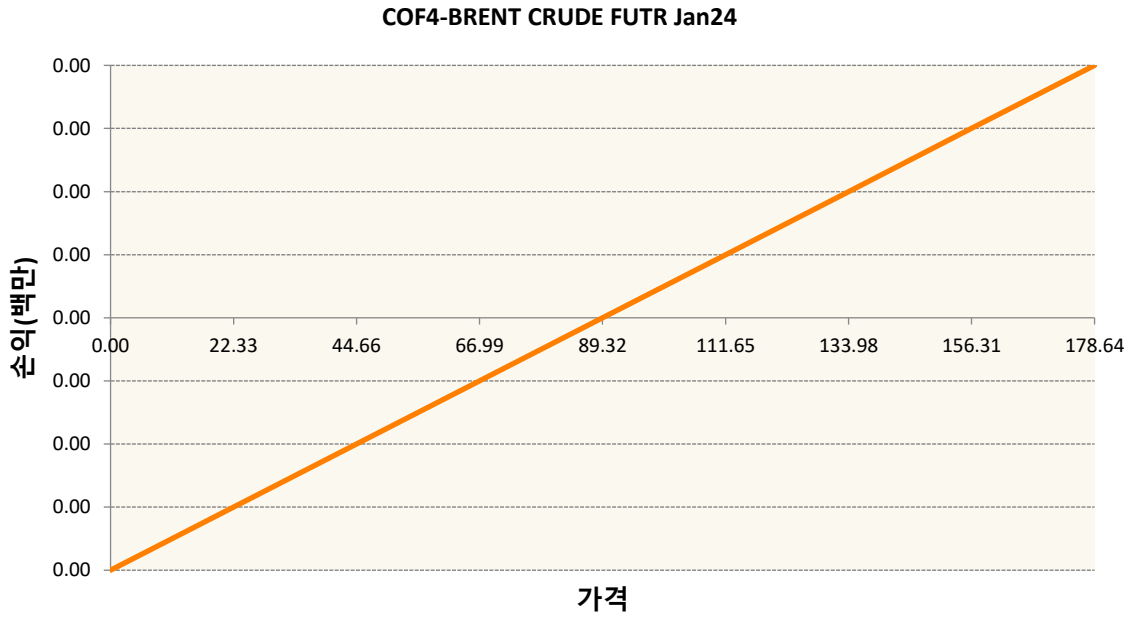
1. 계약금액

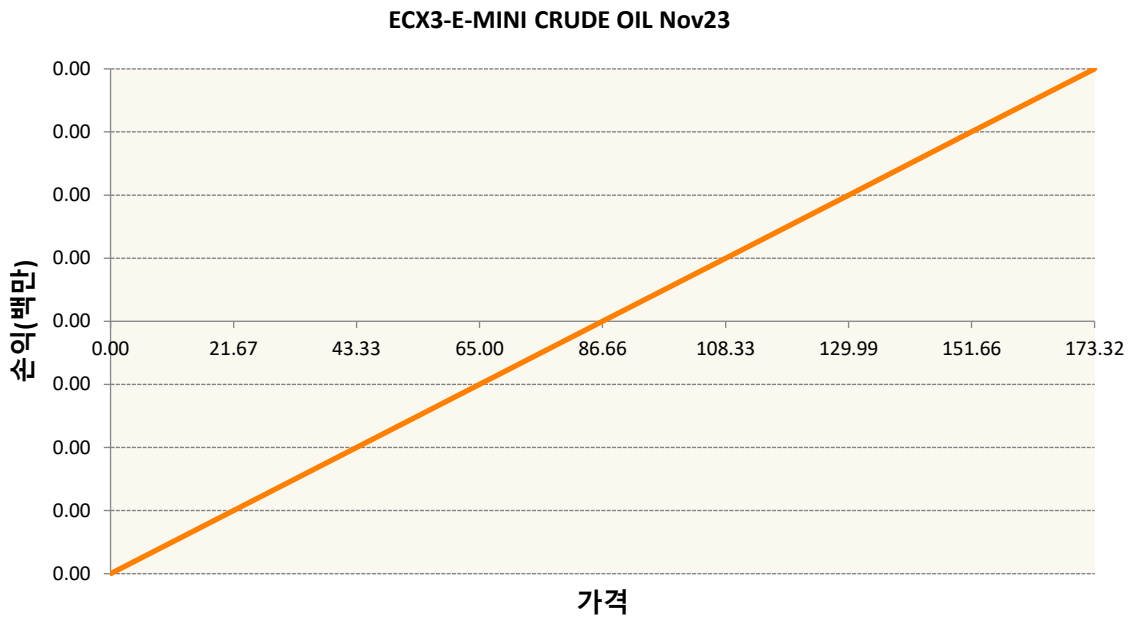
(단위:백만원)

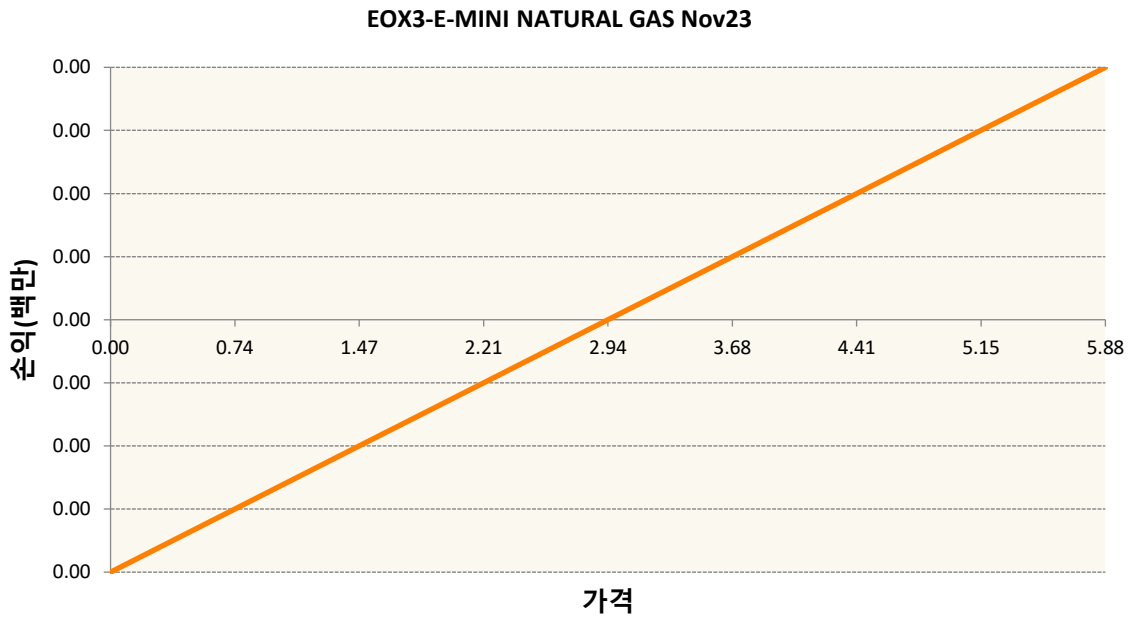
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,534	318	1,216	

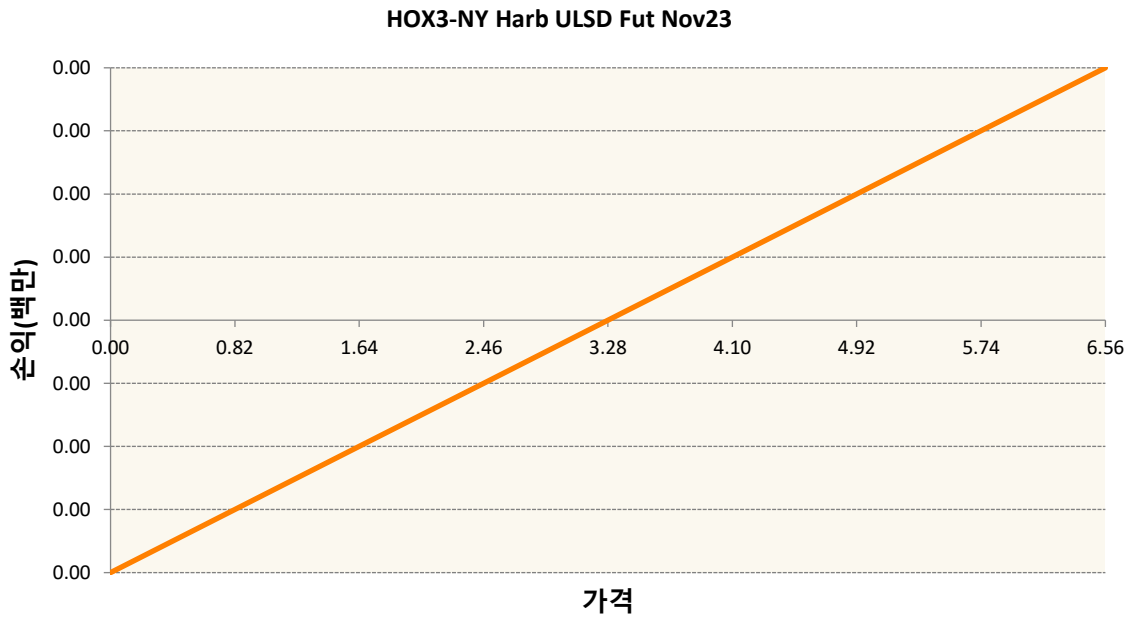
2. 만기시점의 손익구조



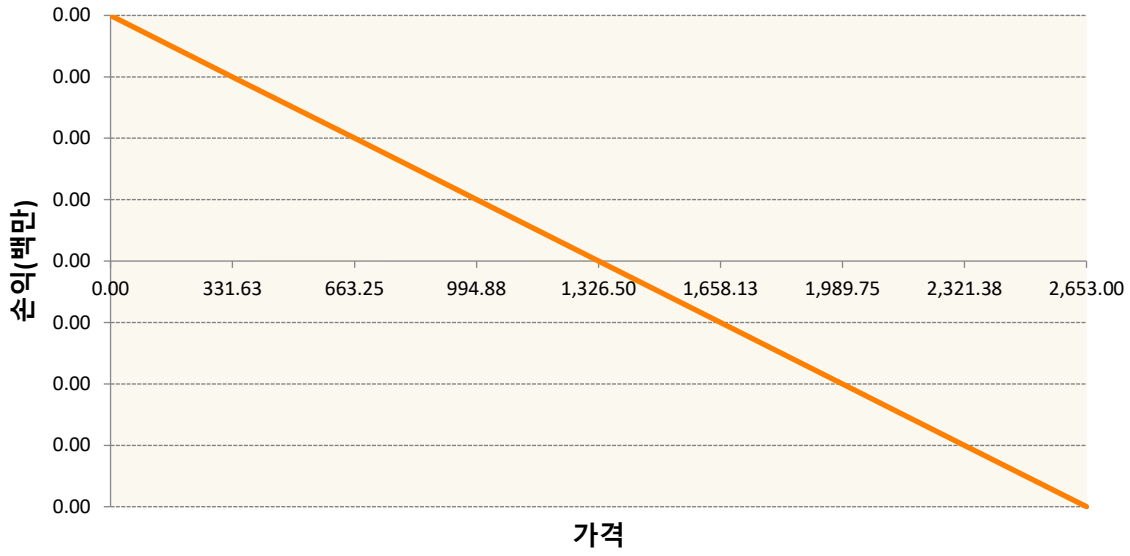



ECX3-E-MINI CRUDE OIL Nov23
손익(백만)
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
21.67
43.33
65.00
86.66
108.33
129.99
151.66
173.32
가격

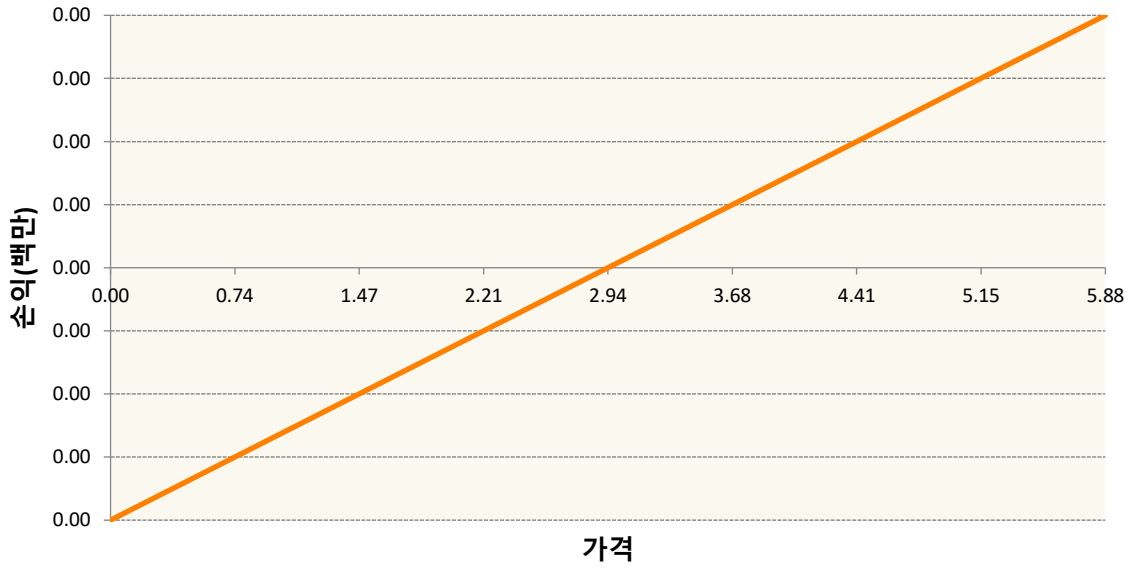

EOX3-E-MINI NATURAL GAS Nov23
손익(백만)
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.74
1.47
2.21
2.94
3.68
4.41
5.15
5.88
가격


HOX3-NY Harb ULSD Fut Nov23
손익(백만)
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.82
1.64
2.46
3.28
4.10
4.92
5.74
6.56
가격

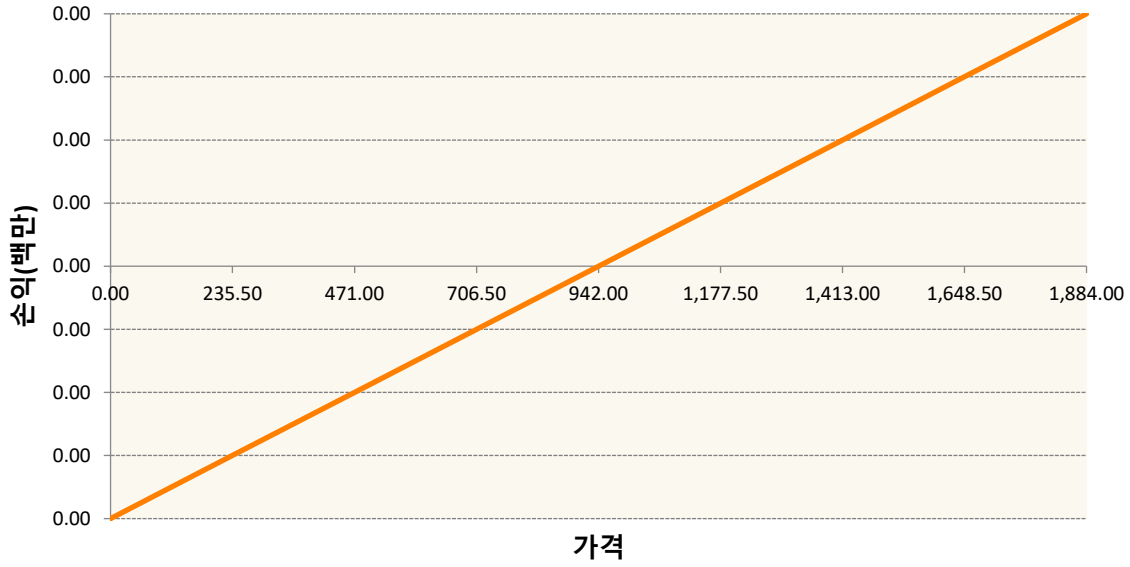
KR4175T90007-2023-09 달러선물

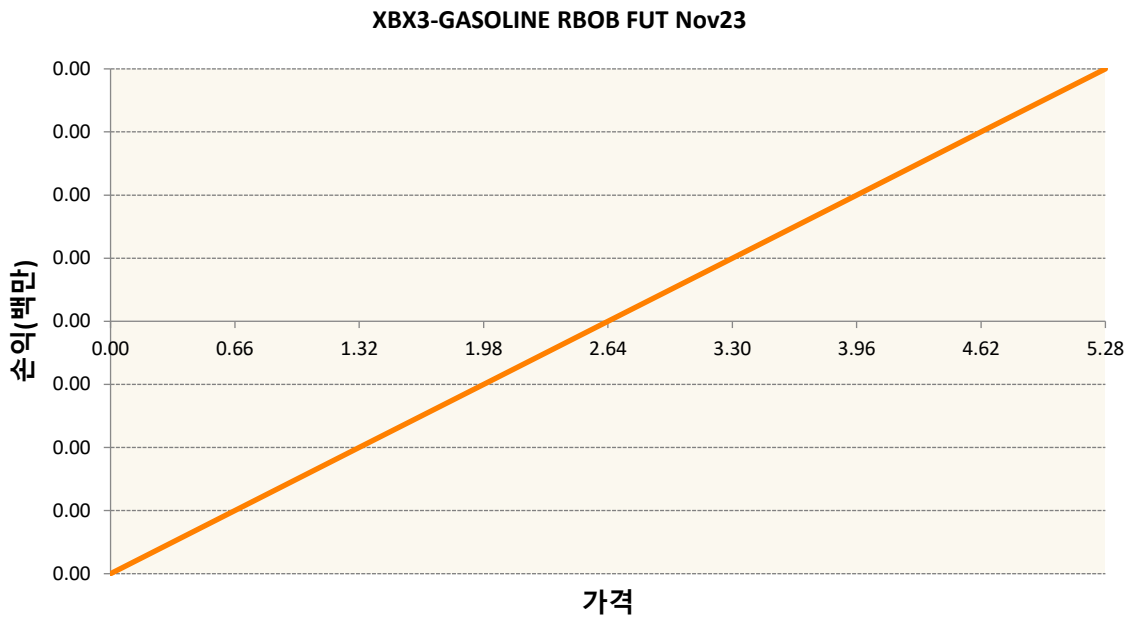


NGX23-NATURAL GAS FUTR Nov23



QSX3-Low Su Gasoil G Nov23





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
CLX3	WTI CRUDE FUTURE Nov23	27
COF4	BRENT CRUDE FUTR Jan24	28
ECX3	E-MINI CRUDE OIL Nov23	5
EOX3	E-MINI NATURAL GAS Nov23	2
HOX3	NY Harb ULSD Fut Nov23	14
KR4175T900	2023-09 달러선물	25
NGX23	NATURAL GAS FUTR Nov23	25
QSX3	Low Su Gasoil G Nov23	10
XBX3	GASOLINE RBOB FUT Nov23	12

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	320