

공시일	2023-09-18
기준일	2023-09-15

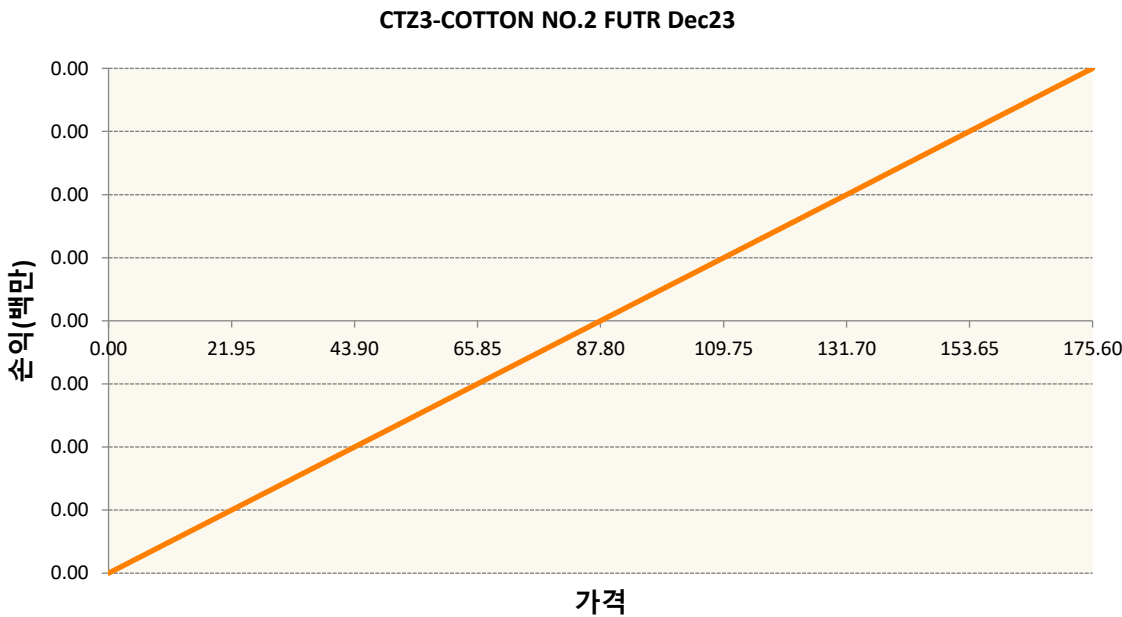
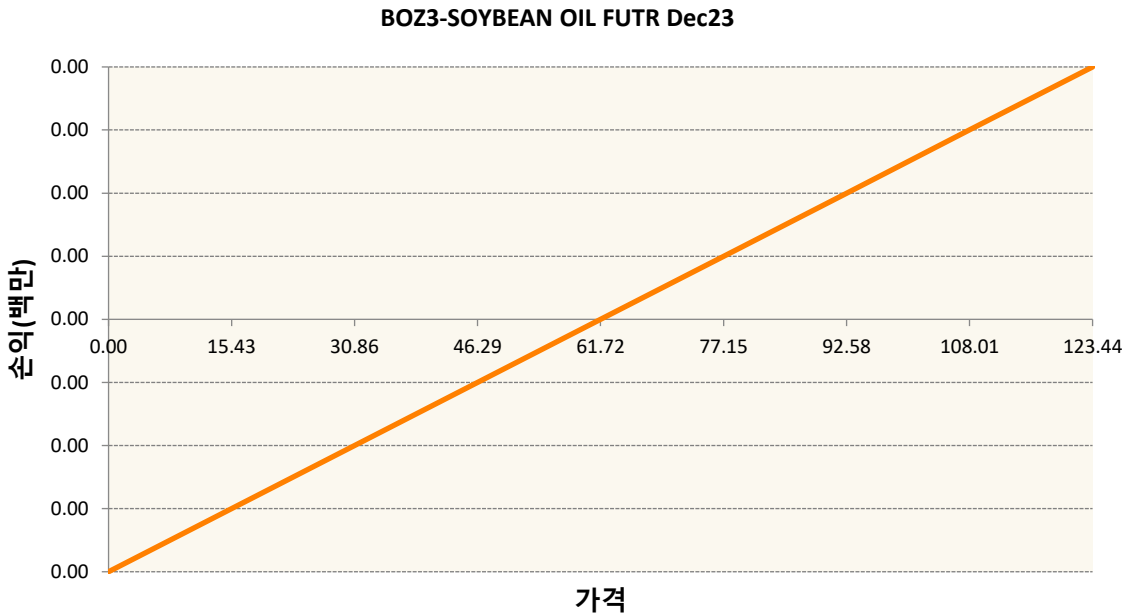
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

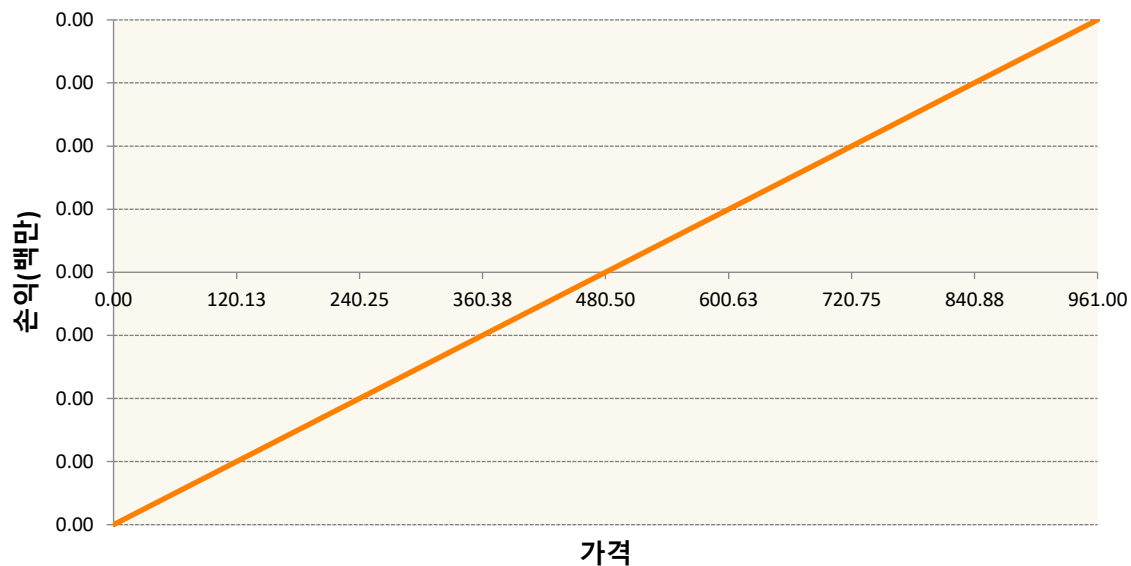
(단위:USD 백만)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	543	-543	장내
누계	유가증권	선물	5,043	0	5,043	
누계	통화	선물	0	543	-543	장내

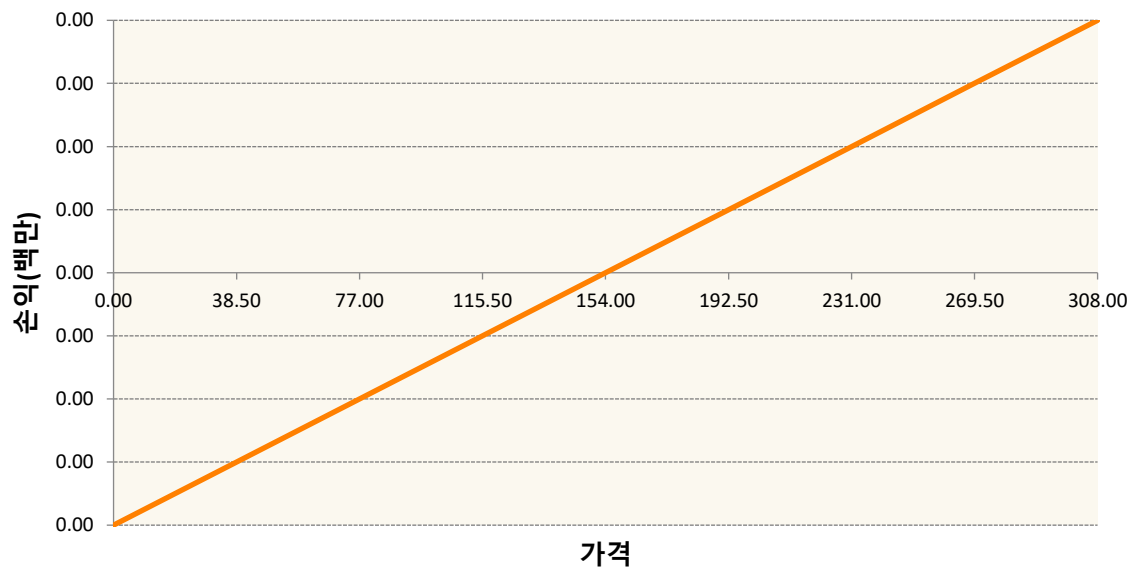
2. 만기시점의 손익구조



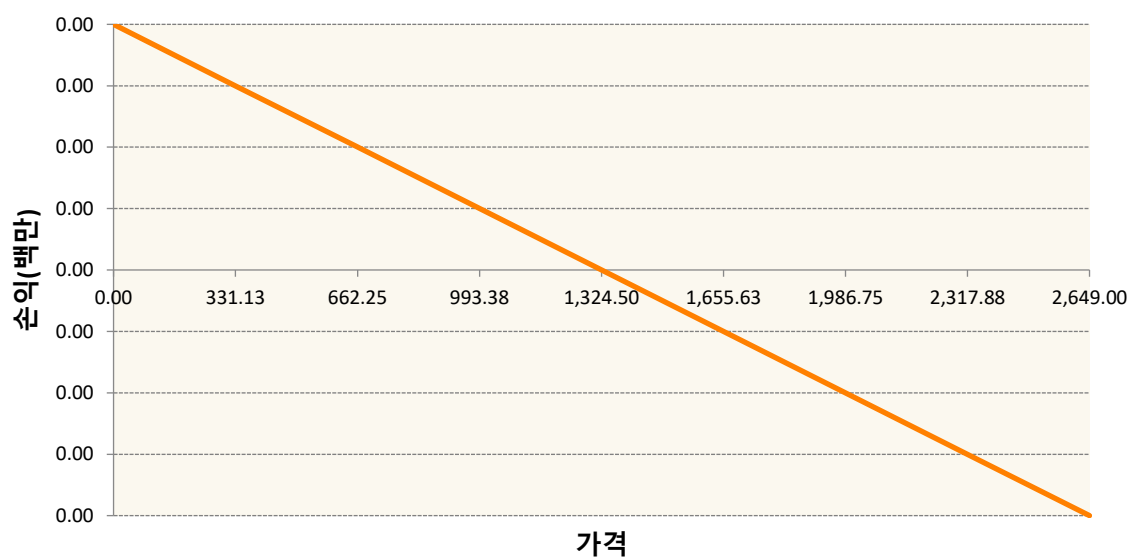
CZ3-CORN FUTURE Dec23



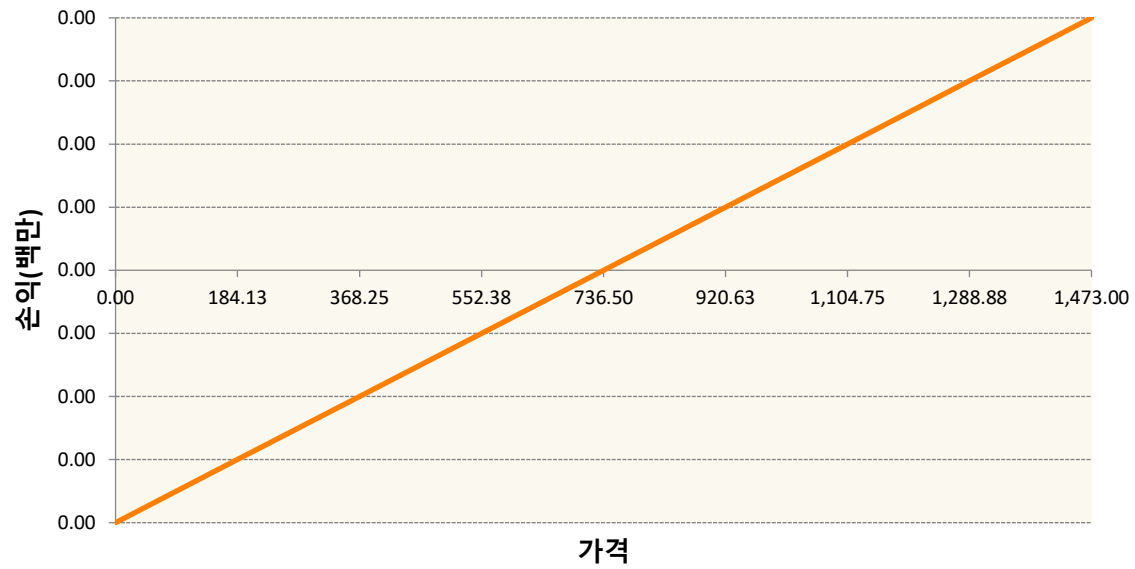
KCZ3-COFFEE 'C' FUTURE DEC23



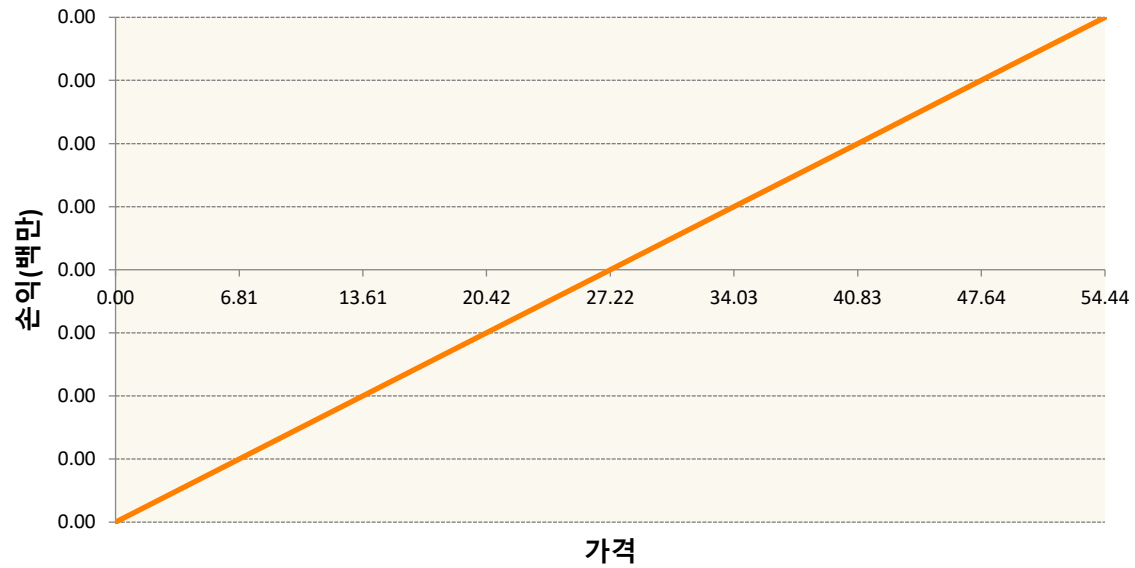
KR4175TA0001-2023-10 달러선물



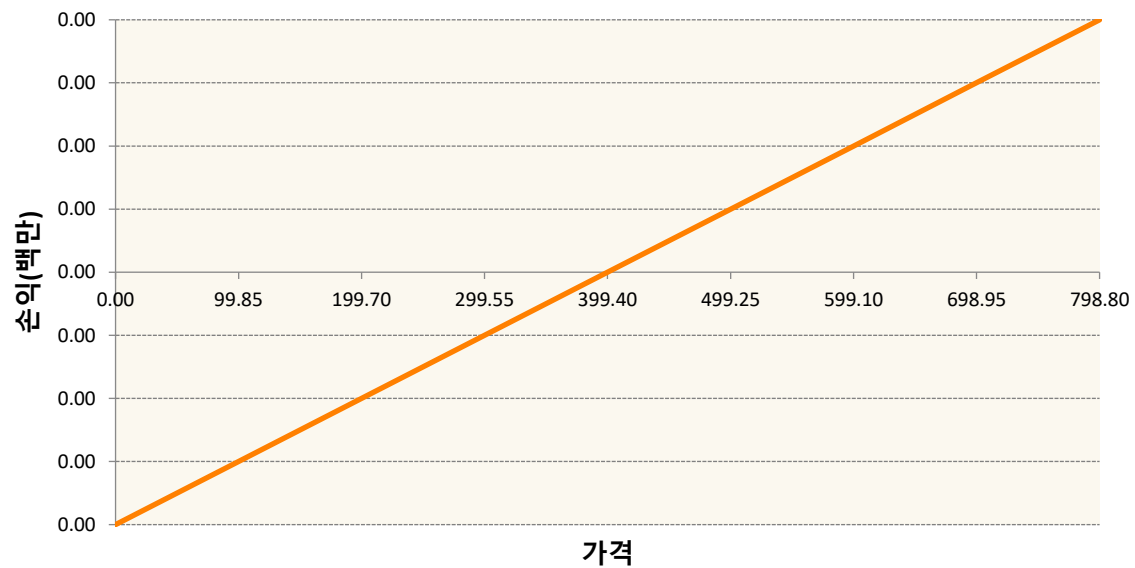
KWZ3-KC HRW WHEAT FUT DEC23

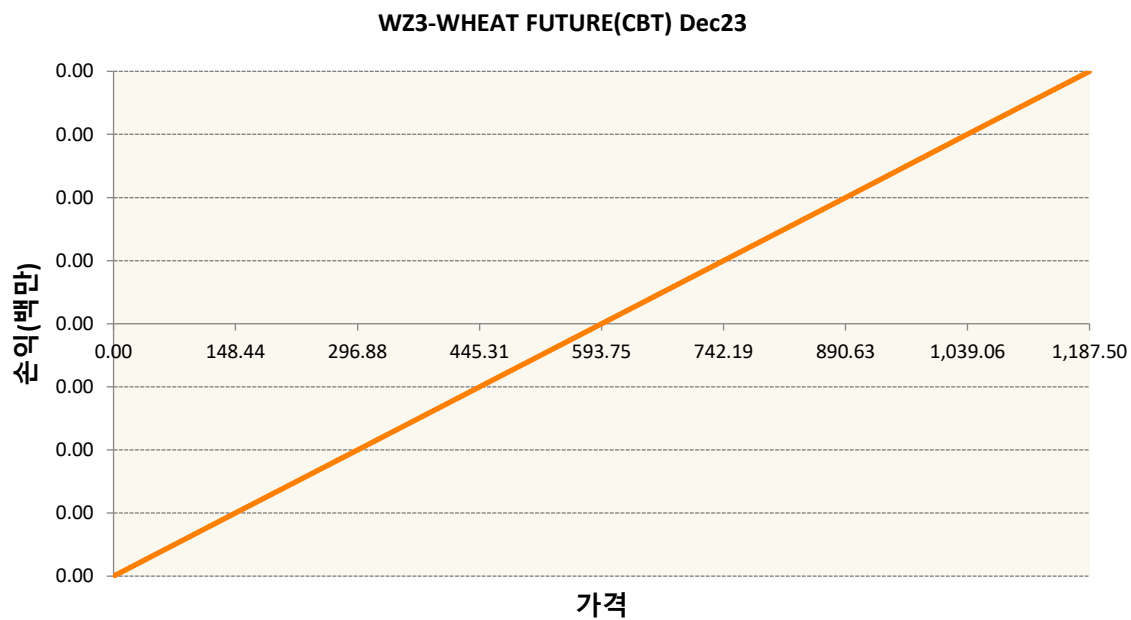
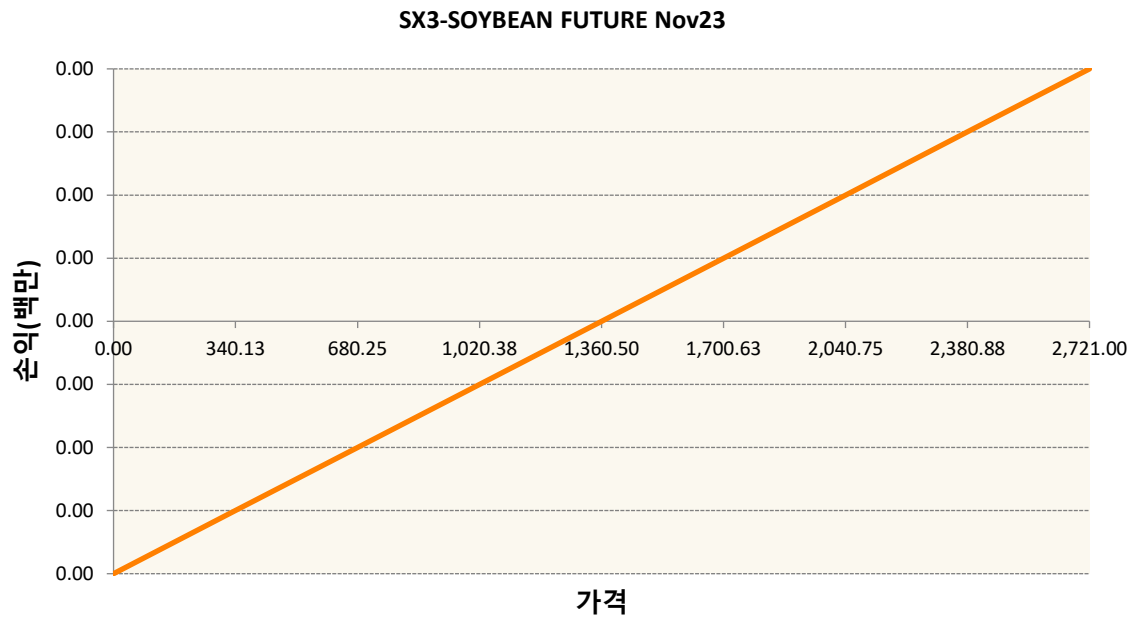


SBH4-Sugar #11 (WORLD) Mar24



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	2023-09-18
기준일	2023-09-15

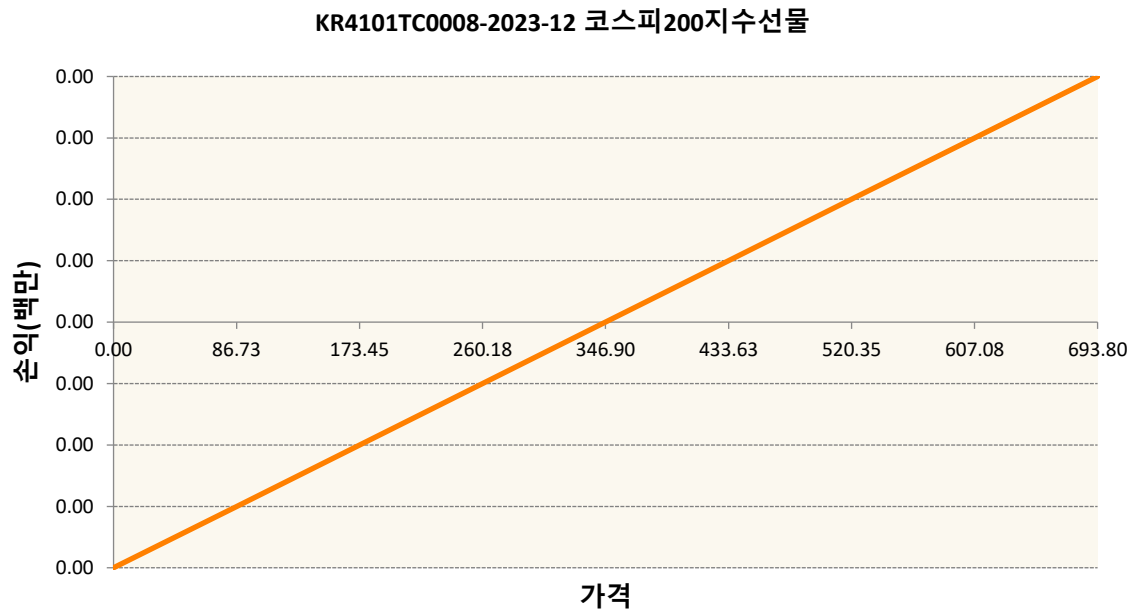
스마트인덱스모

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	1,388	0	1,388	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101TC0008		2023-12 코스피200지수선물					110
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-110	-110	-110	-110	-110	-110	-110
-5.33%	-74	-74	-74	-74	-74	-74	-74
-2.67%	-37	-37	-37	-37	-37	-37	-37
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	37	37	37	37	37	37	37
5.33%	74	74	74	74	74	74	74
8.00%	110	110	110	110	110	110	110

공시일	2023-09-18
기준일	2023-09-15

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	319
-----------------------------	-----

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

320

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2023-09-18
기준일	2023-09-15

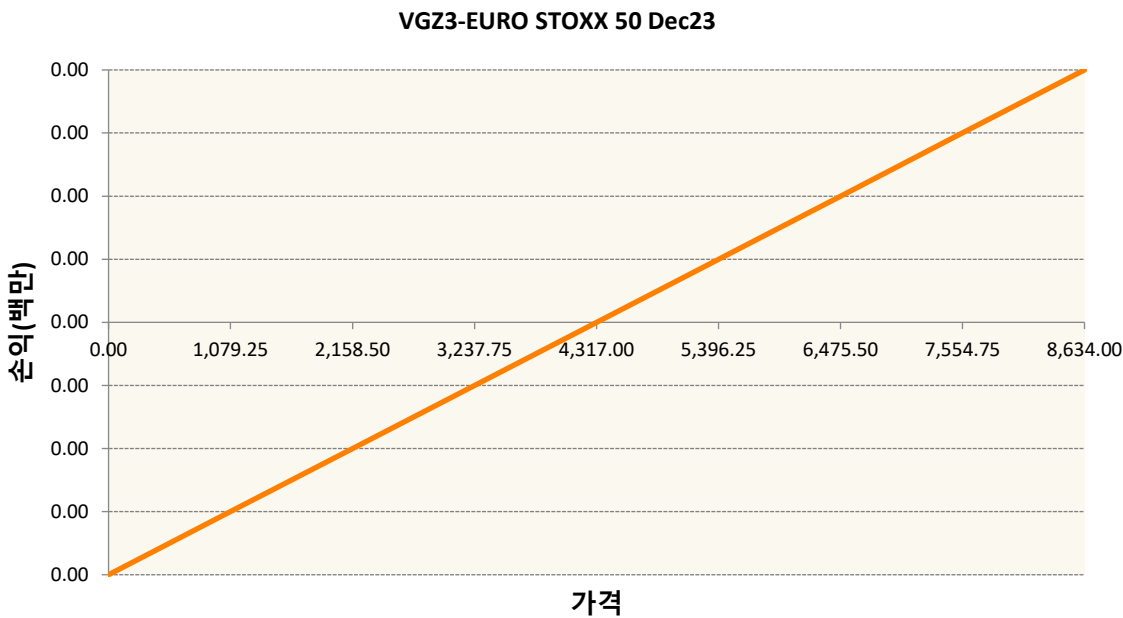
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	430	0	430	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGZ3 EURO STOXX 50 Dec23

34

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

(단위:백만원)

31

공시일	2023-09-18
기준일	2023-09-15

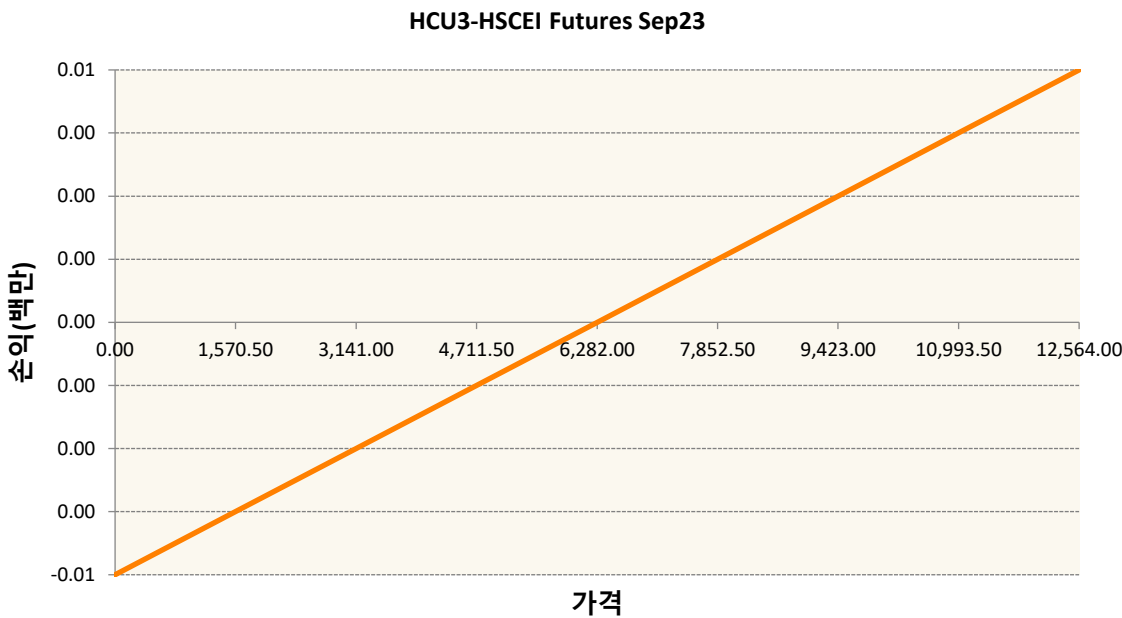
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,165	0	1,165	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCU3	HSCEI Futures Sep23	93
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

142

공시일	2023-09-18
기준일	2023-09-15

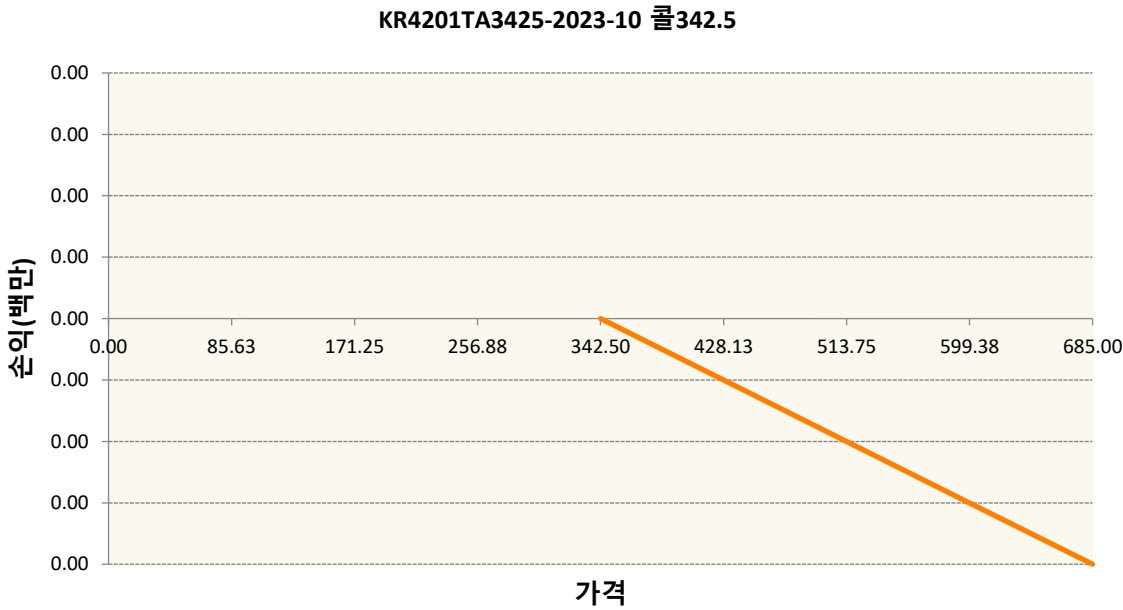
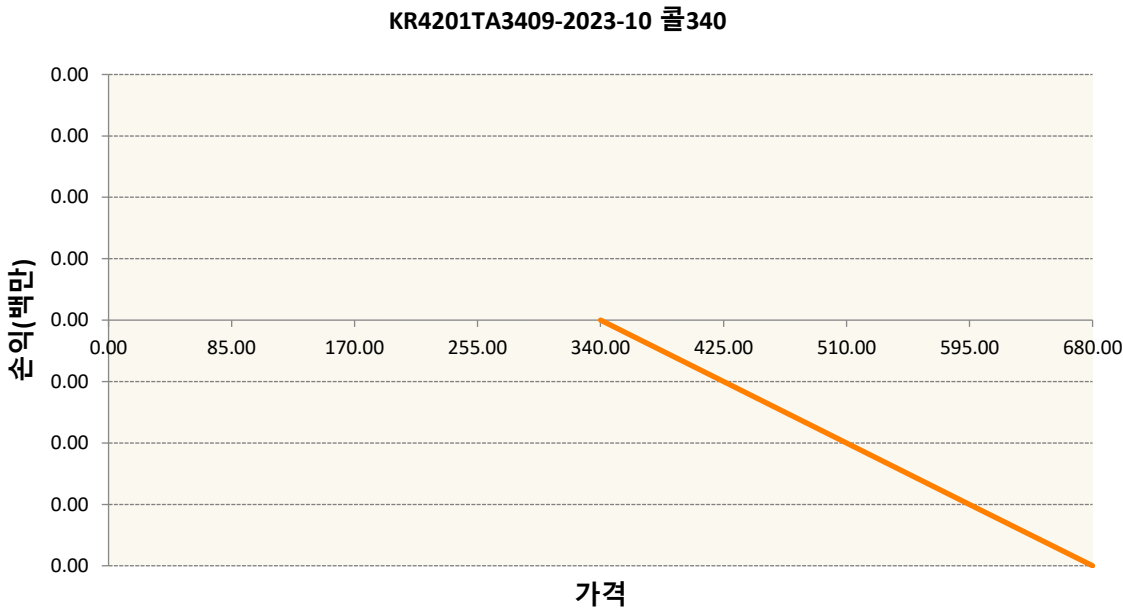
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

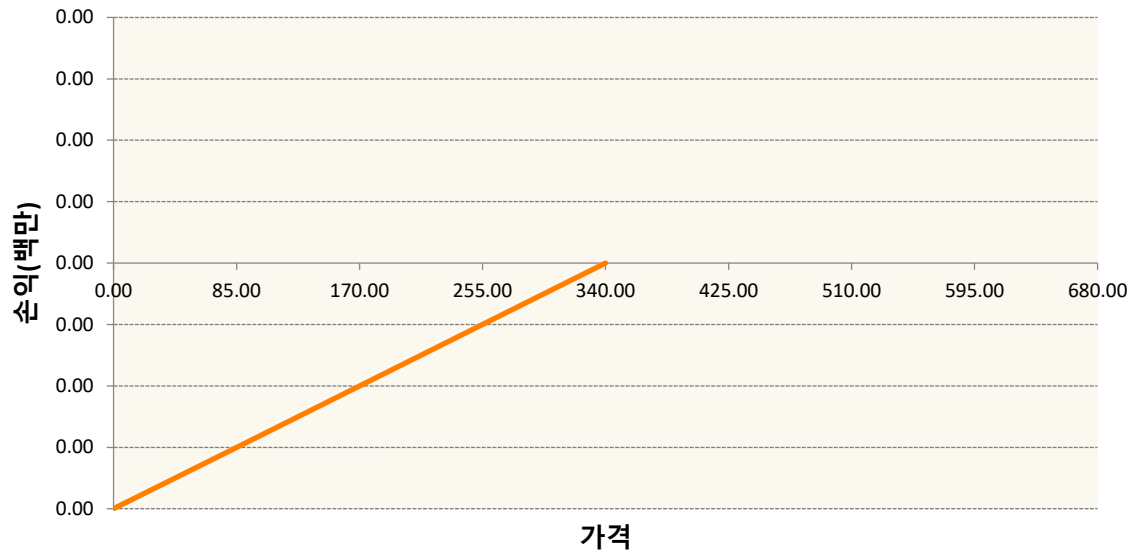
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	40,293	-40,293	장내
누계	유가증권	옵션	0	53,908	-53,908	장내

2. 만기시점의 손익구조



KR4301TA3408-2023-10 풋340



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201TA3409		2023-10 콜340						1,300
		기초자산의 변동성						
가격		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	610	596	579	559	538	515	490	
-5.33%	542	514	485	455	423	391	358	
-2.67%	385	348	310	272	234	196	158	
0%	112	75	38	0	-38	-76	-114	
2.67%	-270	-298	-327	-357	-389	-422	-456	
5.33%	-728	-743	-761	-782	-805	-829	-856	
8.00%	-1,224	-1,231	-1,240	-1,251	-1,265	-1,282	-1,300	
KR4201TA3425		2023-10 콜342.5						1,683
		기초자산의 변동성						
가격		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	720	705	686	664	639	611	581	
-5.33%	651	618	583	546	507	466	424	
-2.67%	478	429	381	331	282	232	182	
0%	156	104	52	0	-52	-104	-156	
2.67%	-319	-360	-404	-448	-494	-541	-589	
5.33%	-909	-933	-962	-994	-1,028	-1,065	-1,103	
8.00%	-1,561	-1,573	-1,588	-1,607	-1,629	-1,655	-1,683	
KR4301TA3408		2023-10 풋340						537
		기초자산의 변동성						
가격		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-531	-531	-531	-532	-533	-535	-537	
-5.33%	-291	-294	-298	-302	-306	-312	-317	
-2.67%	-87	-96	-105	-113	-122	-131	-140	
0%	24	17	8	0	-9	-17	-26	

2.67%	54	51	48	45	40	36	30
5.33%	57	57	56	56	54	53	51
8.00%	57	57	57	57	57	57	56

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

(단위:백만원)

3,565

공시일	2023-09-18
기준일	2023-09-15

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	4,580	0	4,580	

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	2023-09-18
기준일	2023-09-15

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	4,655	0	4,655	

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	2023-09-18
기준일	2023-09-15

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	17,523	0	17,523	
누계	통화	선도	530	17,800	-17,270	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
FXW213D6S(KRW/USD 27-09-23E		557
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)
	829

공시일	2023-09-18
기준일	2023-09-15

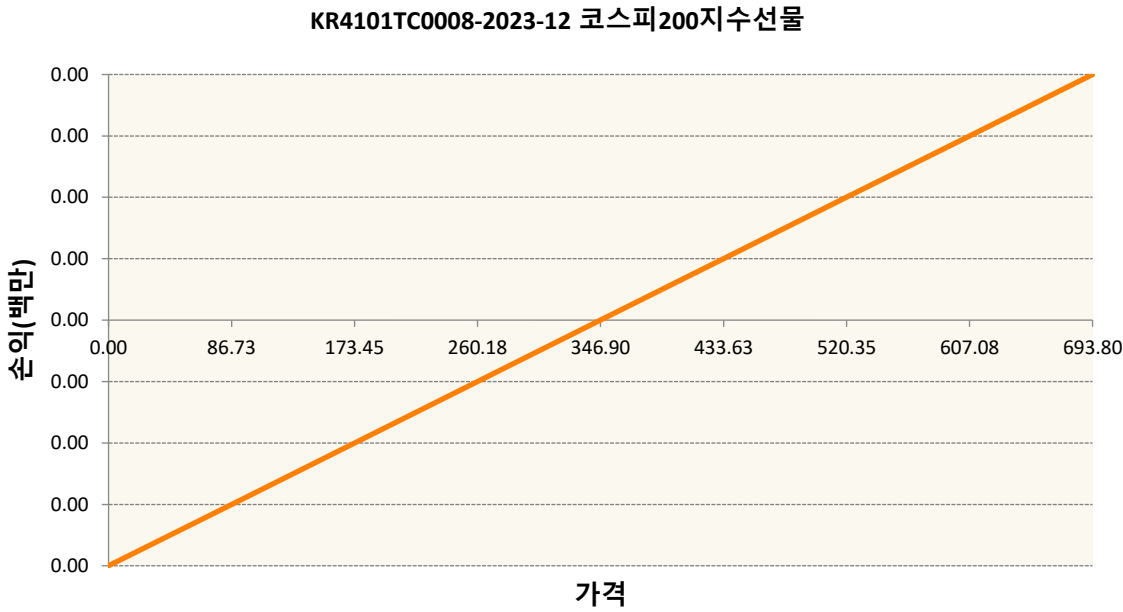
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

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	607	0	607	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101TC0008			2023-12 코스피200지수선물				48
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-48	-48	-48	-48	-48	-48	-48
-5.33%	-32	-32	-32	-32	-32	-32	-32
-2.67%	-16	-16	-16	-16	-16	-16	-16
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	16	16	16	16	16	16	16
5.33%	32	32	32	32	32	32	32
8.00%	48	48	48	48	48	48	48

공시일	2023-09-18
기준일	2023-09-15

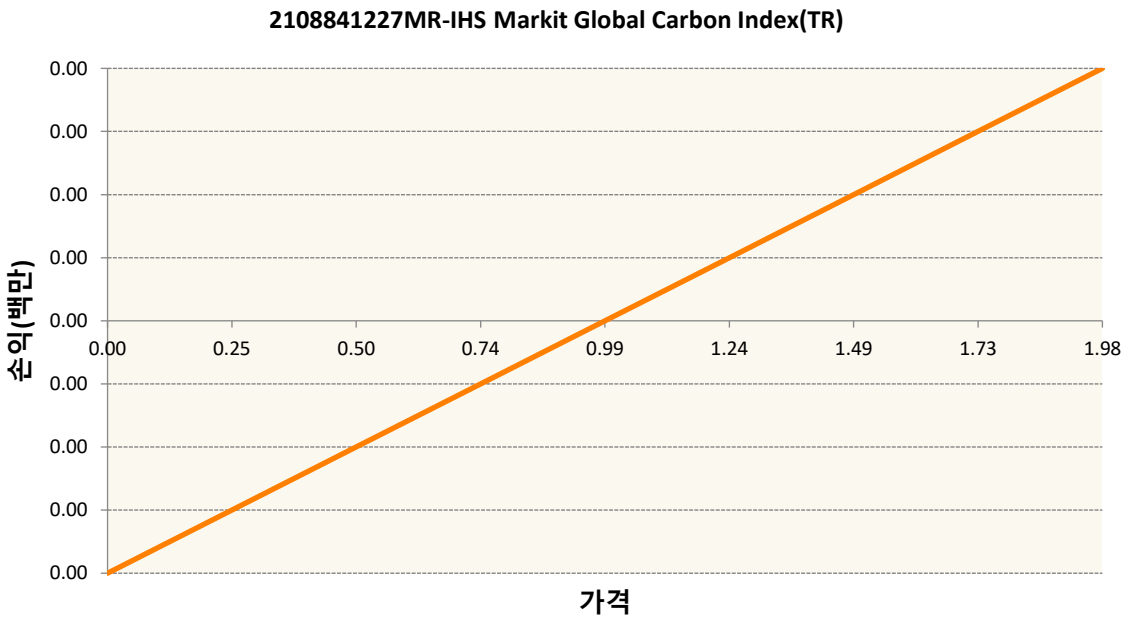
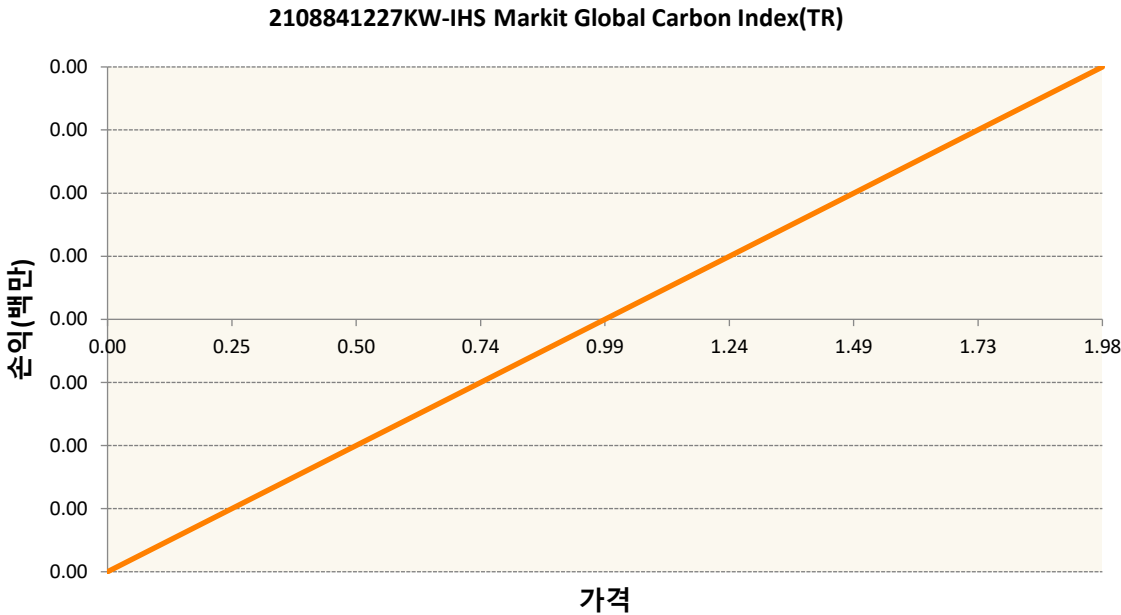
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

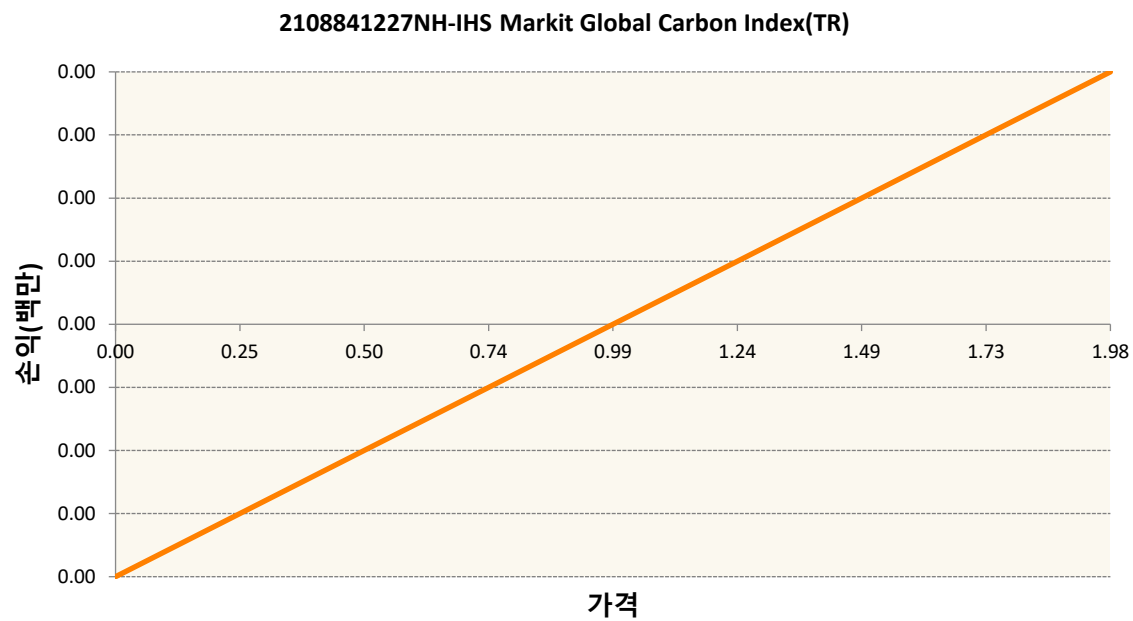
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	26,010	0	26,010	

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108841227IHS Markit Global Carbon Index(TR)		1,760
2108841227IHS Markit Global Carbon Index(TR)		207
2108841227IHS Markit Global Carbon Index(TR)		104

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)		(단위:백만원)
		2,904

공시일	2023-09-18
기준일	2023-09-15

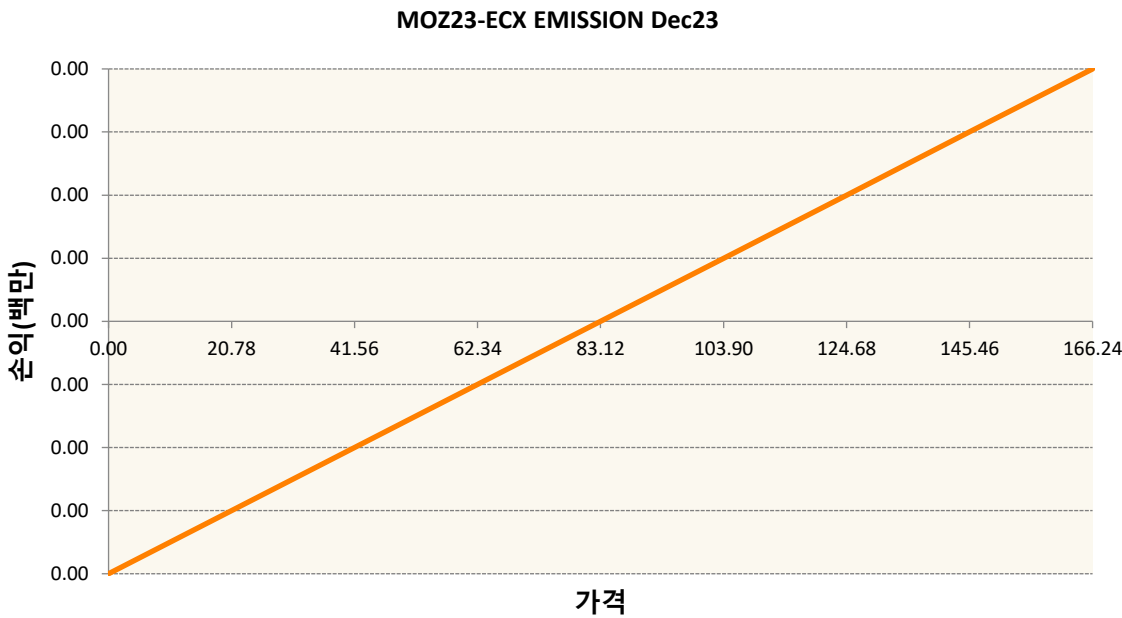
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	7,942	0	7,942	
누계	지수	스왑	479	0	479	장외
누계	통화	선도	0	1,931	-1,931	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213D8W KRW/EUR 27-09-23E	5
FXW213D8W KRW/EUR 27-09-23E	150
MOZ23 ECX EMISSION Dec23	635
SWICEUACN ICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX	0.34

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

(단위:백만원)

1,330

공시일	2023-09-18
기준일	2023-09-15

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)	29
SWCSI00000 신한CSI Index 230622 (키움)	29
SWCSI00000 신한CSI Index 230622 (미래)	29
SWCSI00000 신한CSI Index 230622 (메리츠)	29

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

(단위:백만원)

190

공시일	2023-09-18
기준일	2023-09-15

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)	22
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 230116(메리츠)	31
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 230116(미래)	26
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 230427(키움)	6

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

(단위:백만원)

103

공시일	2023-09-18
기준일	2023-09-15

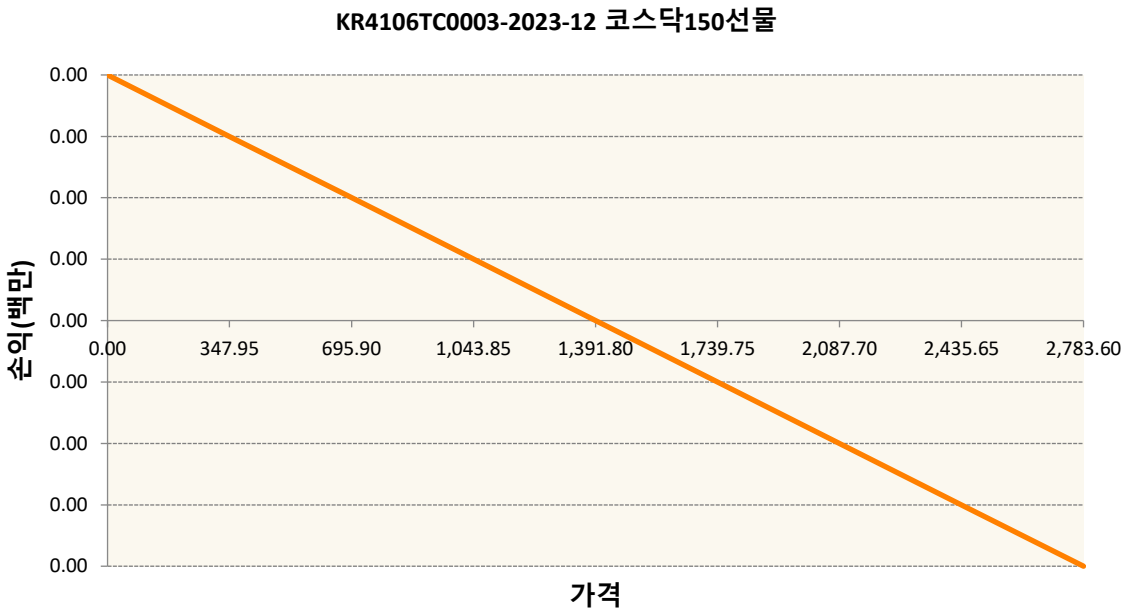
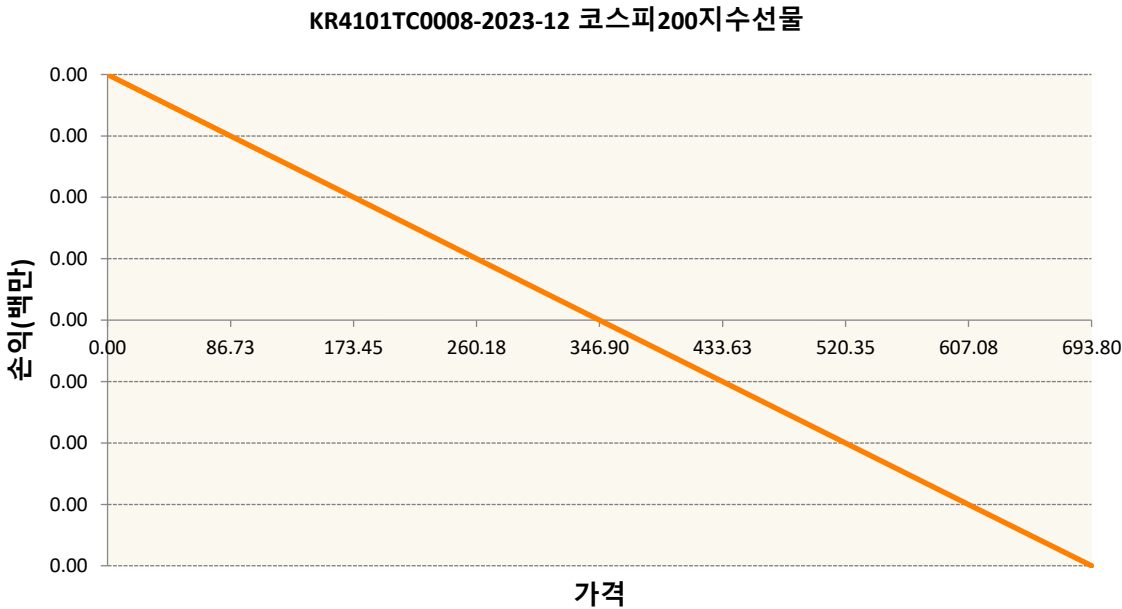
에퀴티알파일반사모혼합자산

1. 계약금액

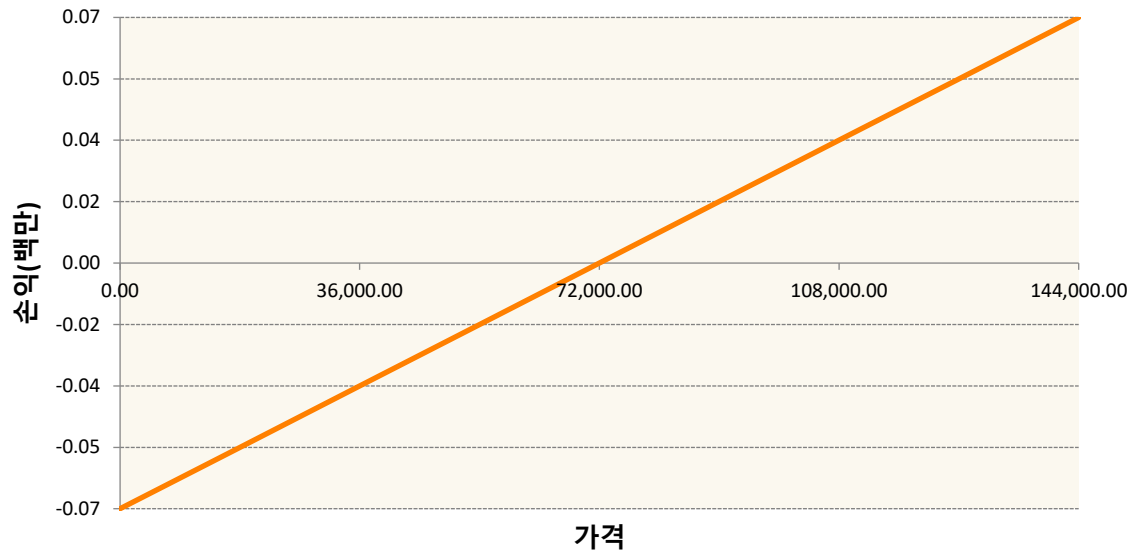
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	774	7	767	장내
신규	유가증권	ELS	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	2,082	3,599	-1,517	장내
누계	유가증권	ELS	0	0	0	장외

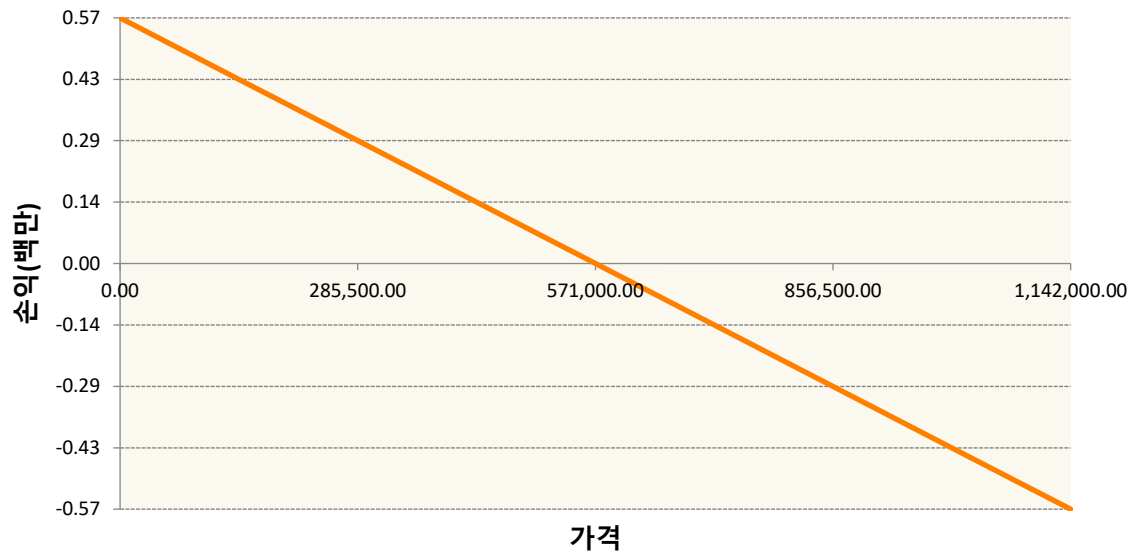
2. 만기시점의 손익구조



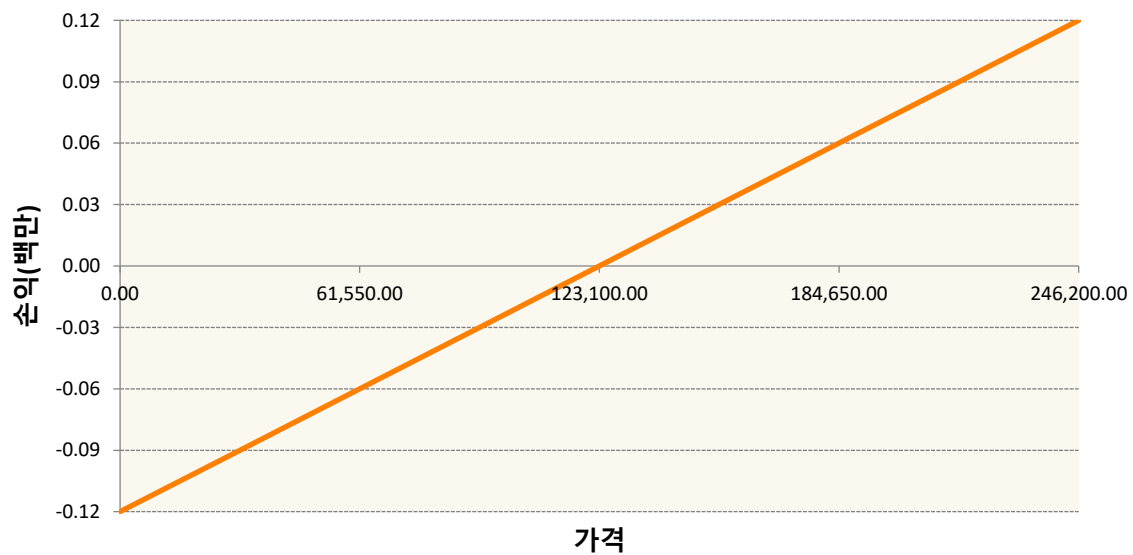
KR4111TA0008-2023-10 삼성전자개별선물



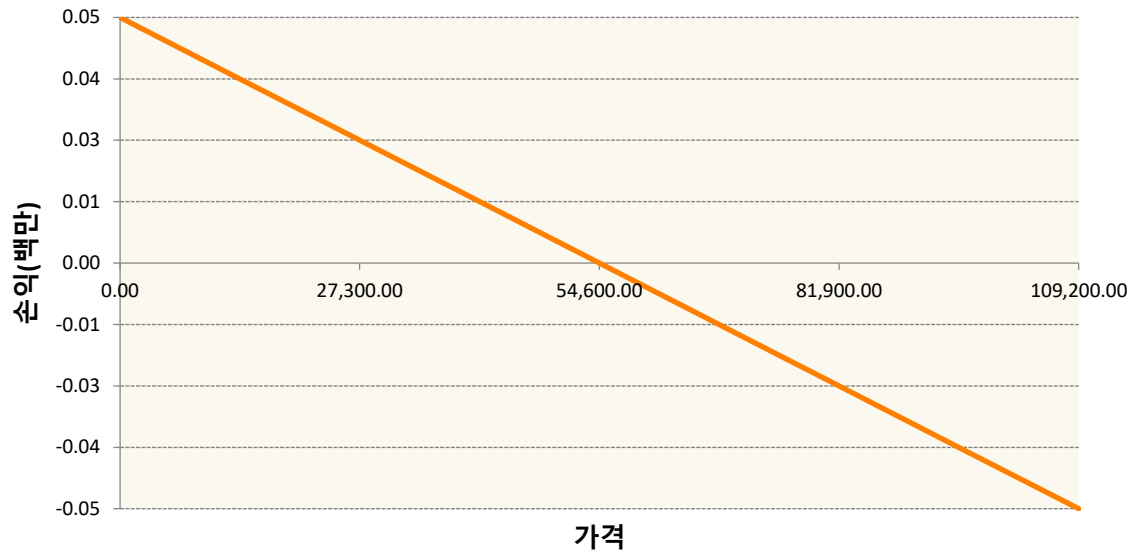
KR4147TA0006-2023-10 LG화학개별선물



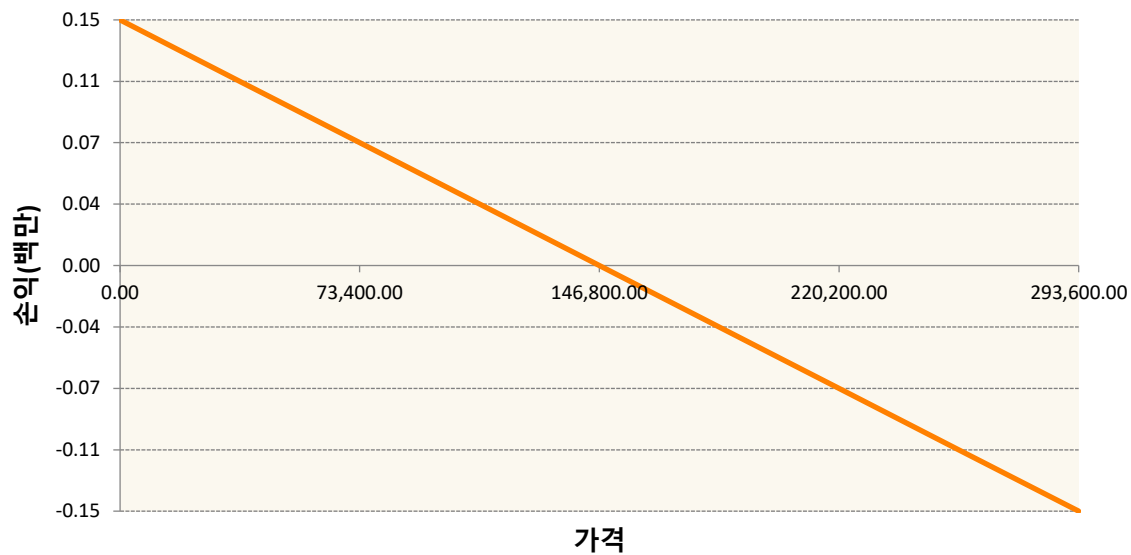
KR4150TA0000-2023-10 SK하이닉스개별선물



KR41CNTA0000-2023-10 포스코DX개별선물



KR41CPTA0008-2023-10 셀트리온개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101TC00 2023-12 코스피200지수선물	208
KR4106TC00 2023-12 코스닥150선물	48
KR4111TA00 2023-10 삼성전자개별선물	140
KR4147TA00 2023-10 LG화학개별선물	14
KR4150TA00 2023-10 SK하이닉스개별선물	26
KR41CNTA00 2023-10 포스코DX개별선물	4
KR41CPTA00 2023-10 셀트리온개별선물	14
KRS0004572 ELWKB금융_주식스왑	2

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

(단위:백만원)

공시일	2023-09-18
기준일	2023-09-15

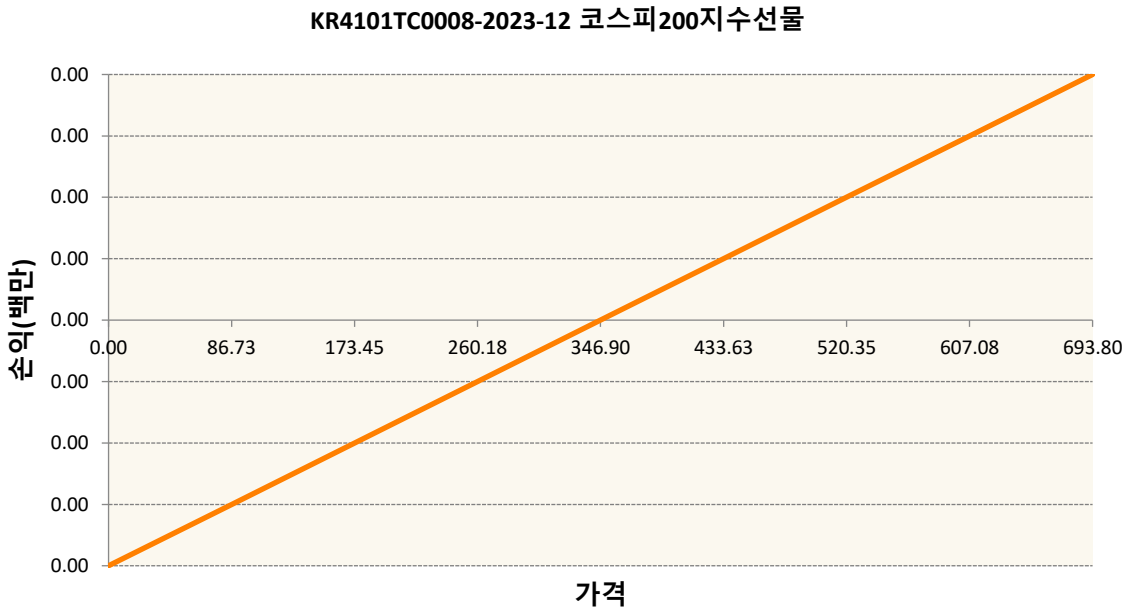
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

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	1,388	0	1,388	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101TC0008		2023-12 코스피200지수선물					110
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-110	-110	-110	-110	-110	-110	-110
-5.33%	-74	-74	-74	-74	-74	-74	-74
-2.67%	-37	-37	-37	-37	-37	-37	-37
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	37	37	37	37	37	37	37
5.33%	74	74	74	74	74	74	74
8.00%	110	110	110	110	110	110	110

공시일	2023-09-18
기준일	2023-09-15

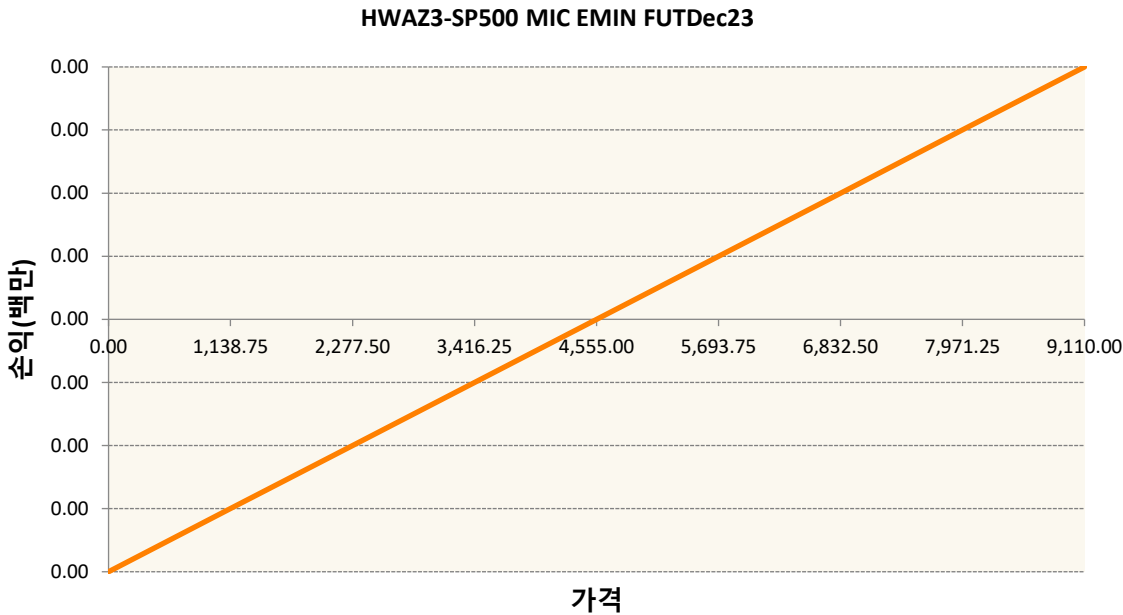
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

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	1,057	0	1,057	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HWAZ3	SP500 MIC EMIN FUTDec23	85
-------	-------------------------	----

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

(단위:백만원)

84

공시일	2023-09-18
기준일	2023-09-15

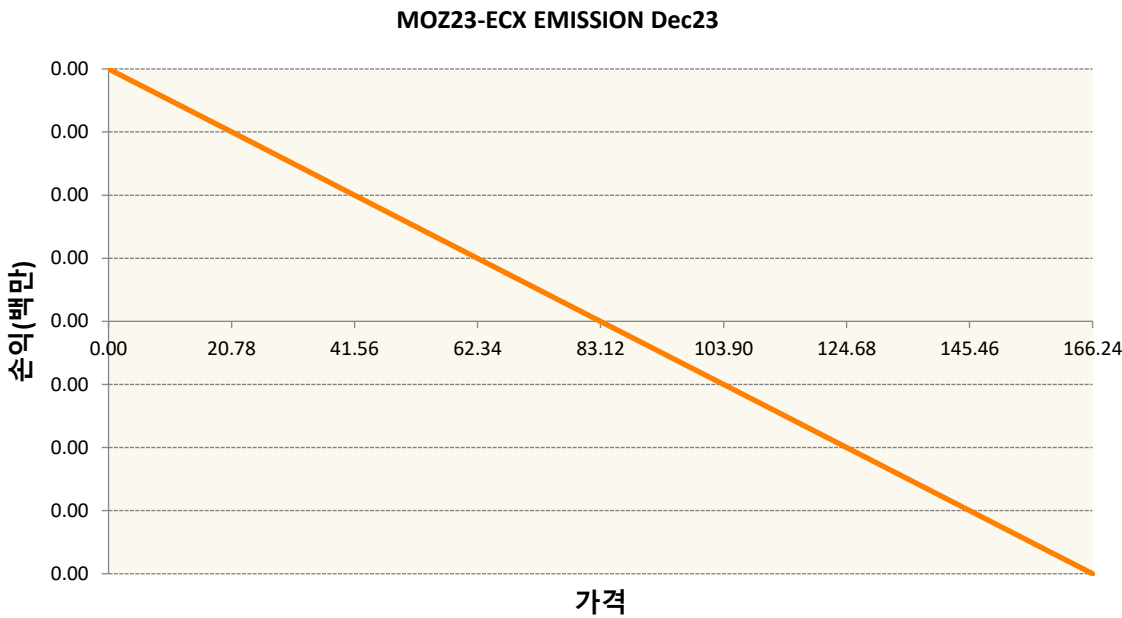
SOL유럽탄소배출권선물인버스ICE특별자산상

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	9,095	-9,095	
누계	지수	스왑	479	0	479	장외
누계	통화	선도	0	1,848	-1,848	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213D8W KRW/EUR 27-09-23E	148
MOZ23 ECX EMISSION Dec23	728
SWICEUACN ICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX	0.33

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

(단위:백만원)

1,501

공시일	2023-09-18
기준일	2023-09-15

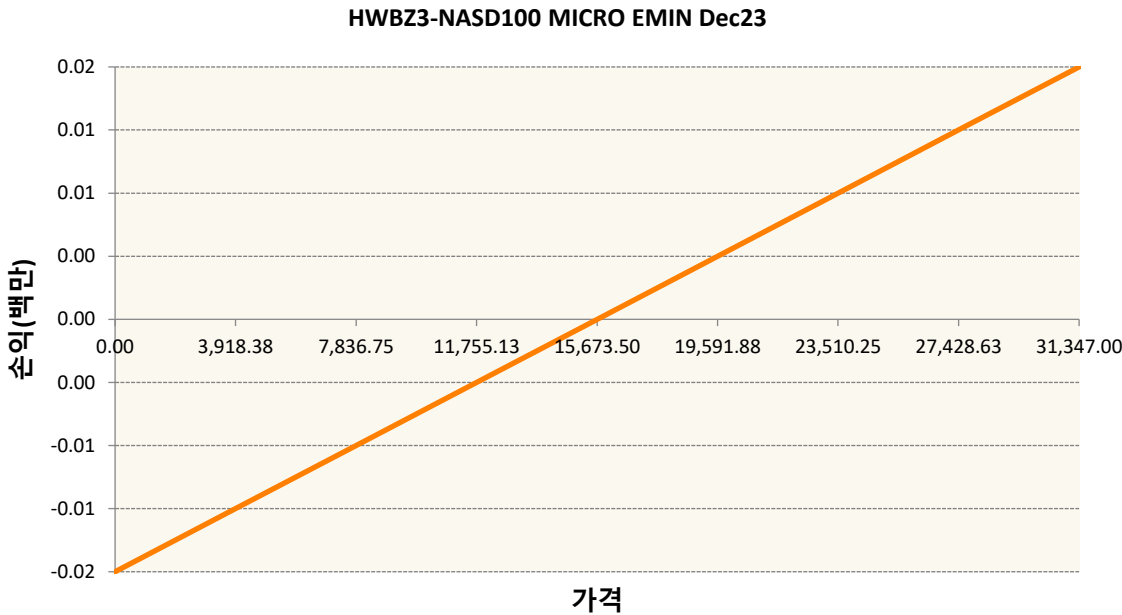
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

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	1,081	0	1,081	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HWBZ3 NASD100 MICRO EMIN Dec23

86

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

(단위:백만원)

86

공시일	2023-09-18
기준일	2023-09-15

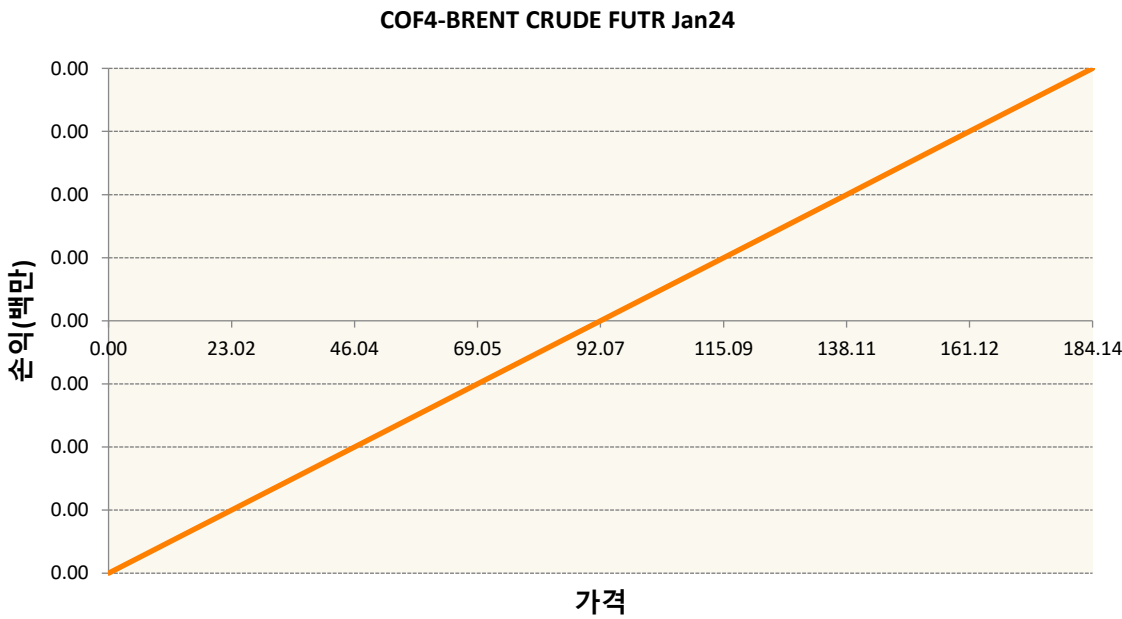
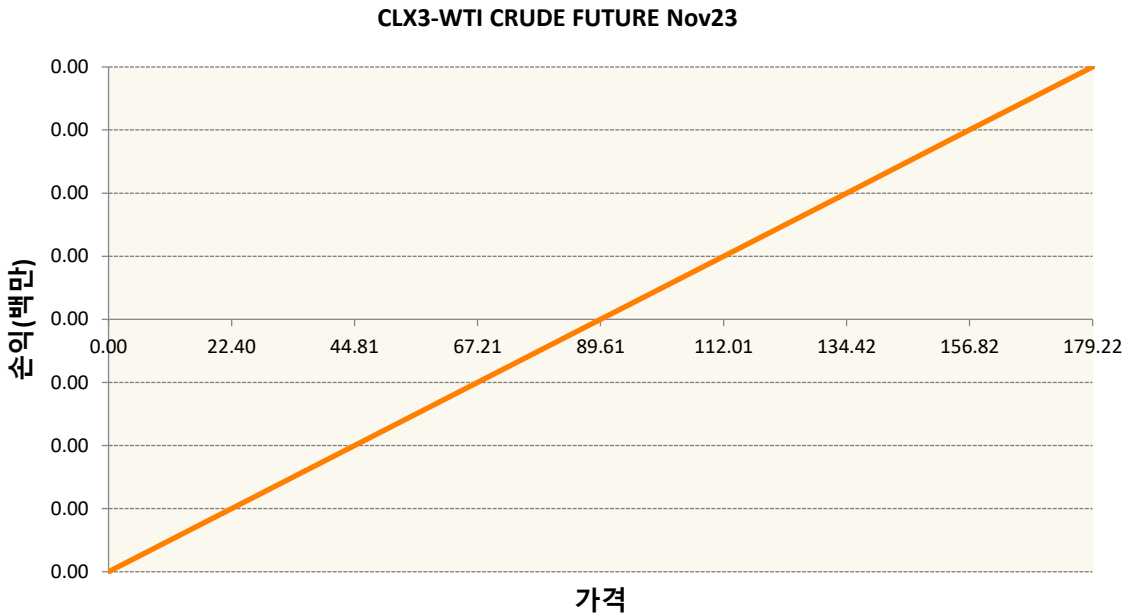
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

1. 계약금액

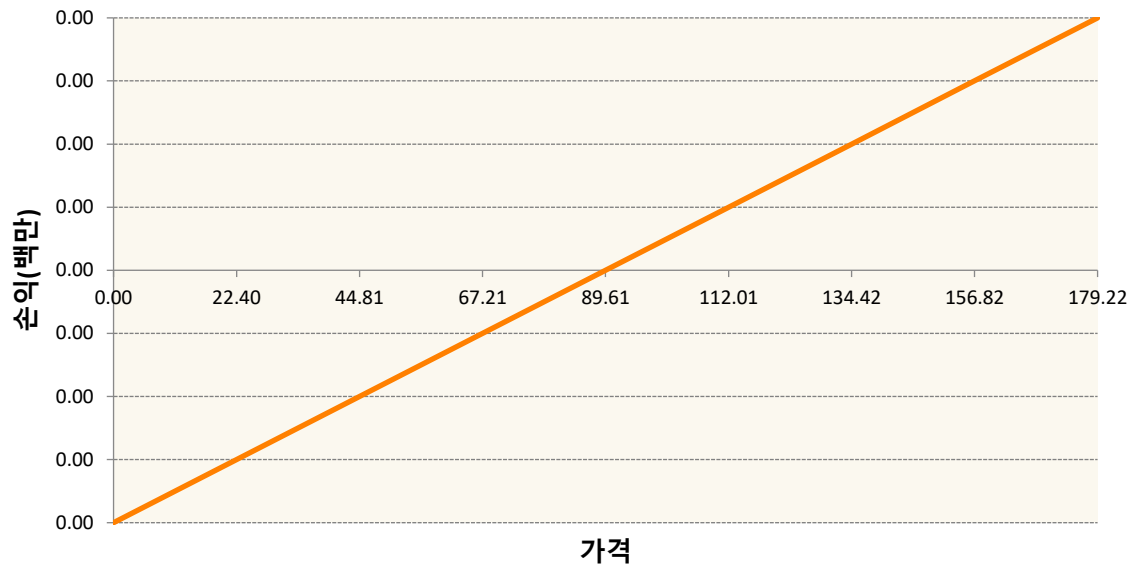
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	252	-252	장내
누계	유가증권	선물	1,577	0	1,577	
누계	통화	선물	0	252	-252	장내

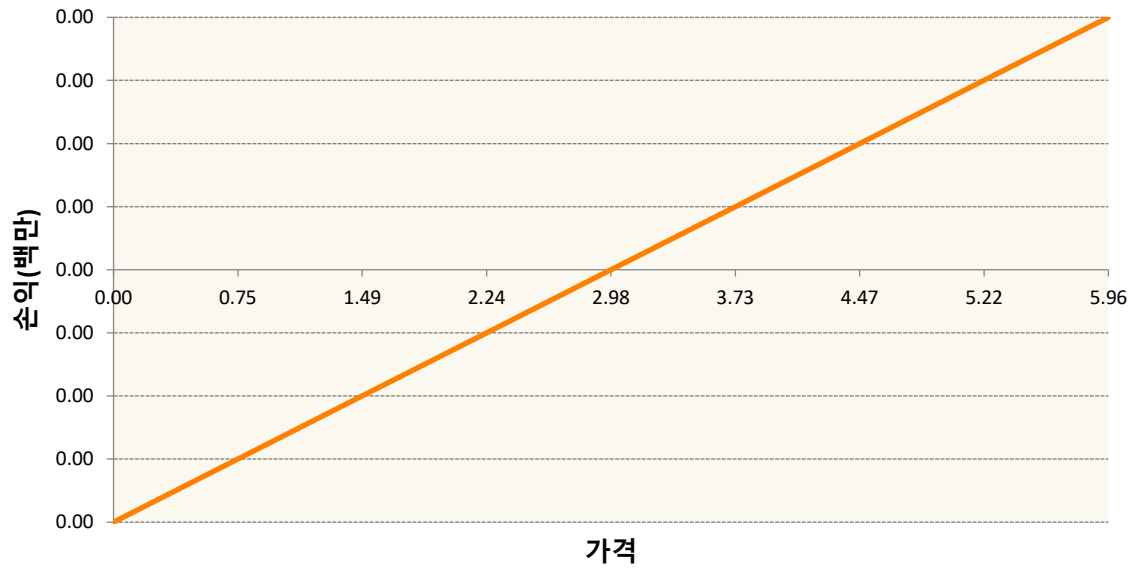
2. 만기시점의 손익구조



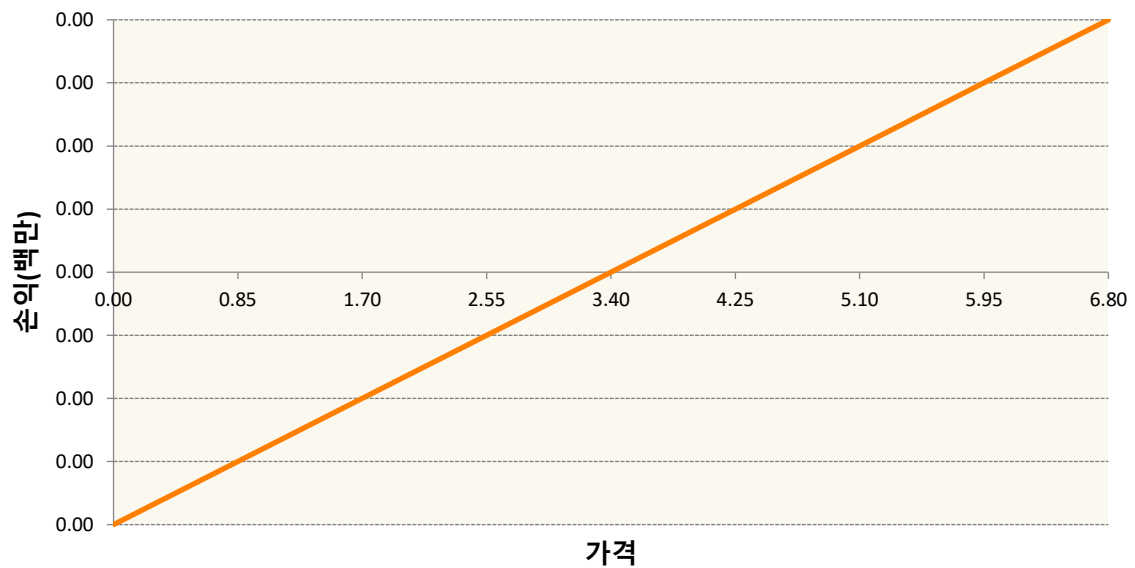
ECX3-E-MINI CRUDE OIL Nov23



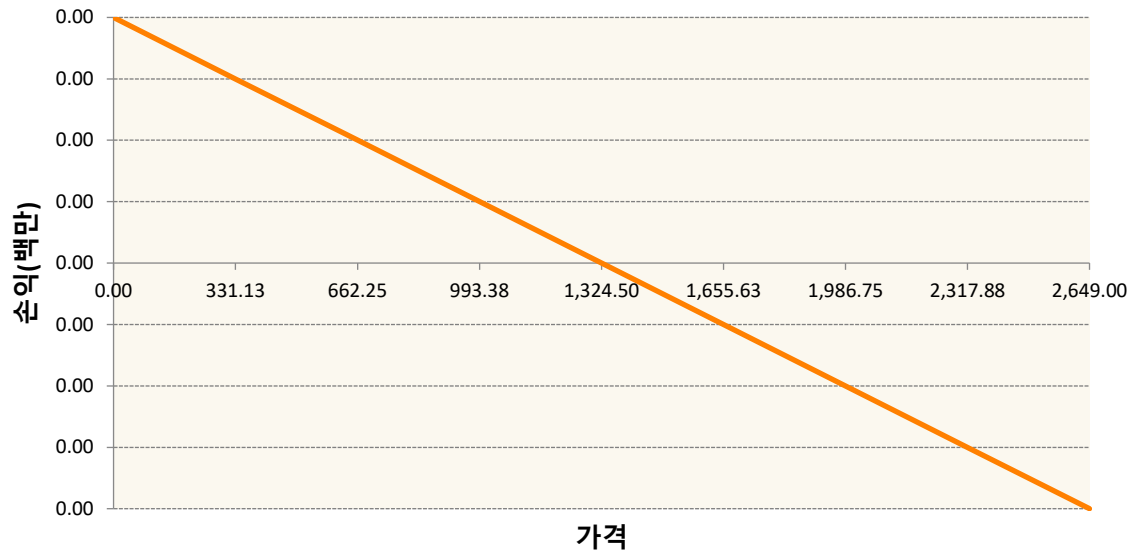
EOX3-E-MINI NATURAL GAS Nov23



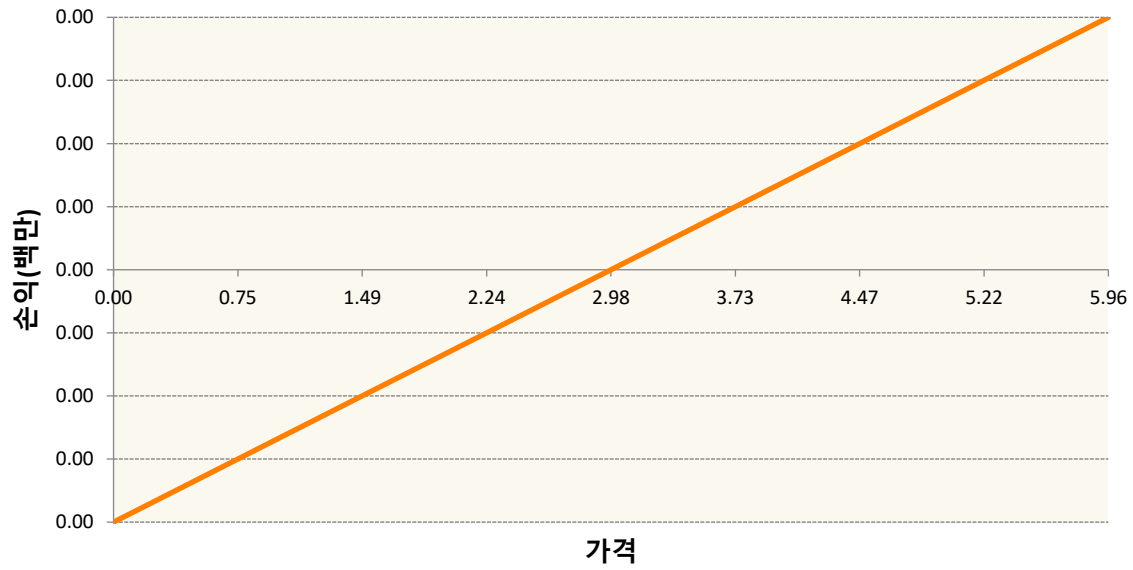
HOX3-NY Harb ULSD Fut Nov23



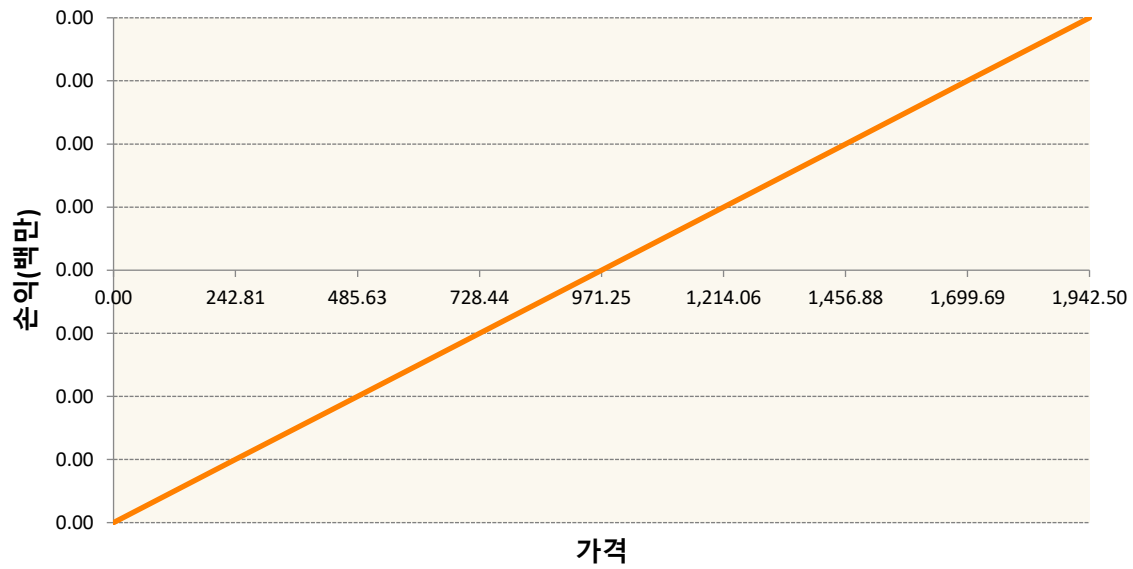
KR4175TA0001-2023-10 달러선물

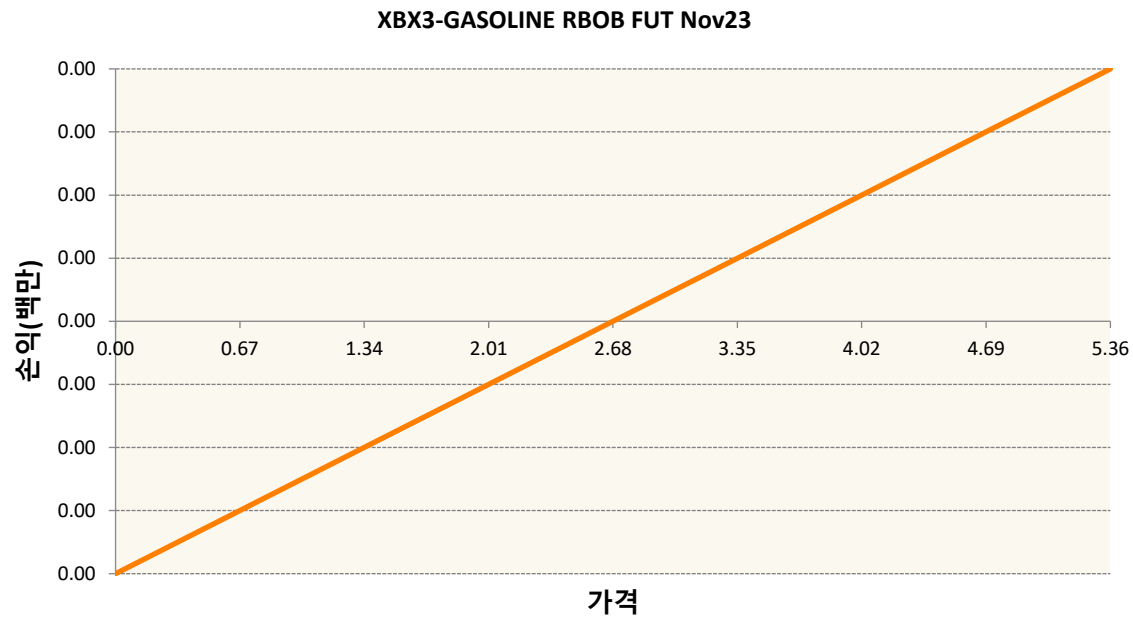


NGX23-NATURAL GAS FUTR Nov23



QX3-Low Su Gasoil G Nov23





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
CLX3	WTI CRUDE FUTURE Nov23	28
COF4	BRENT CRUDE FUTR Jan24	29
ECX3	E-MINI CRUDE OIL Nov23	5
EOX3	E-MINI NATURAL GAS Nov23	2
HOX3	NY Harb ULSD Fut Nov23	15
KR4175TA00 2023-10 달러선물		20
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)
	326