

공시일	2023-09-20
기준일	2023-09-19

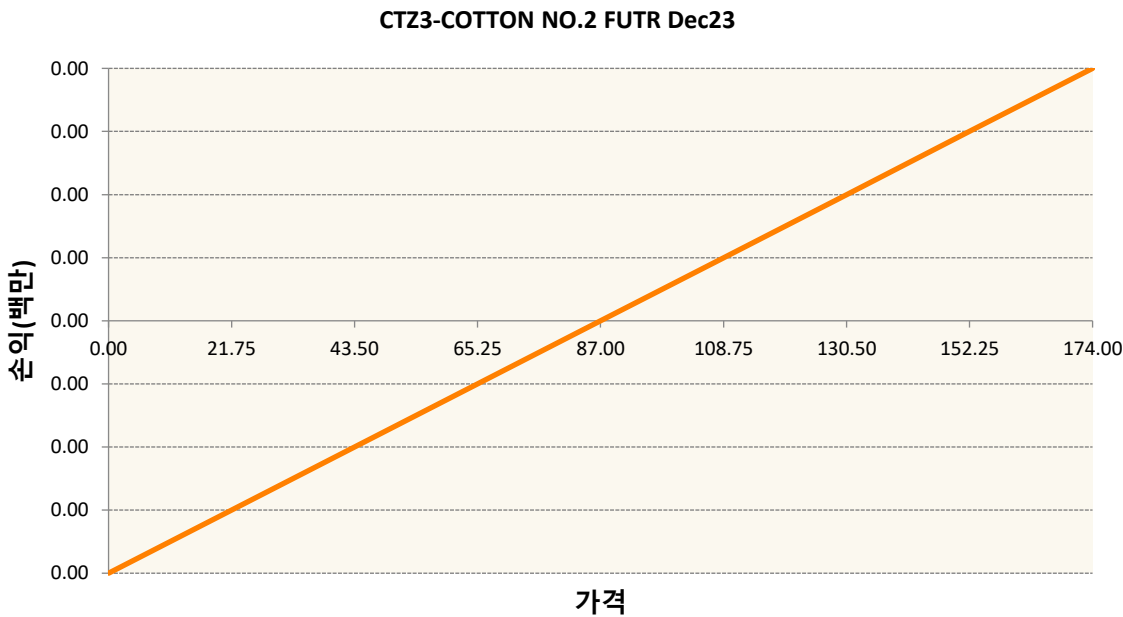
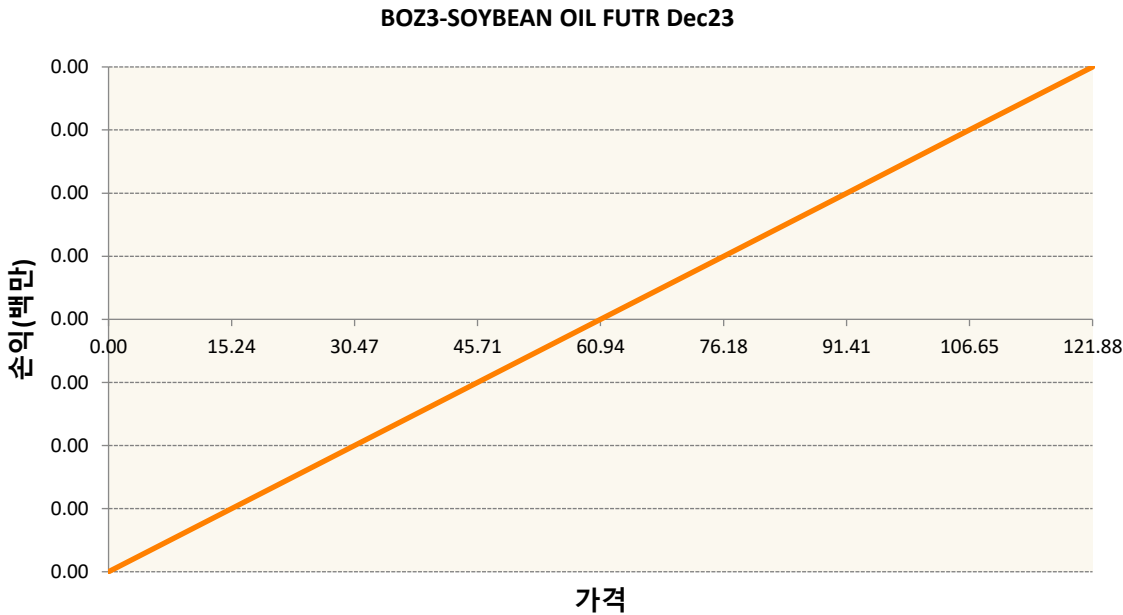
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

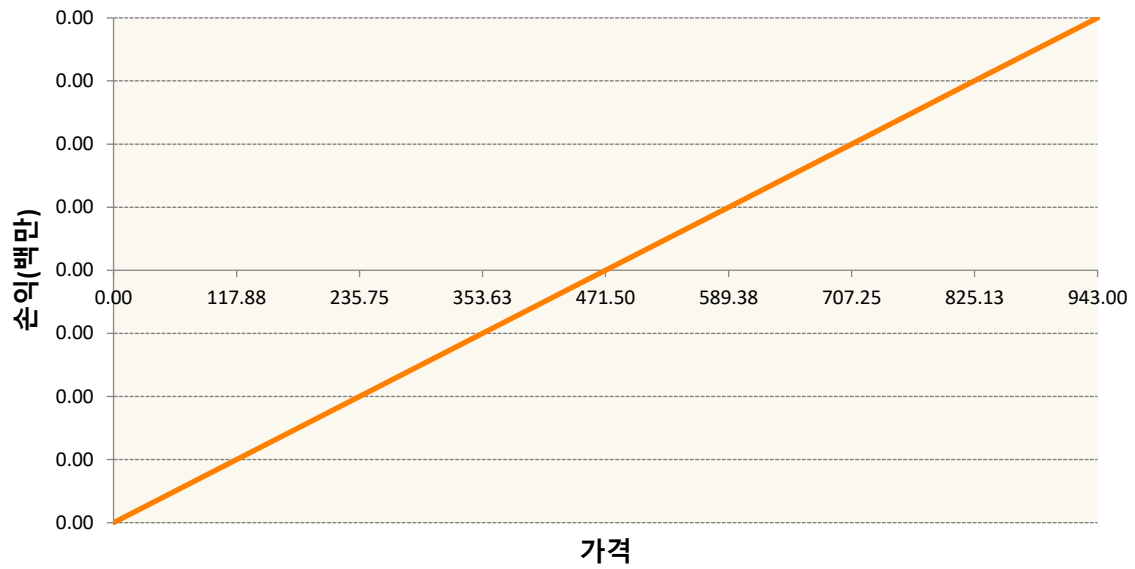
(단위:USD 백만)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	4,991	0	4,991	
누계	통화	선물	0	544	-544	장내

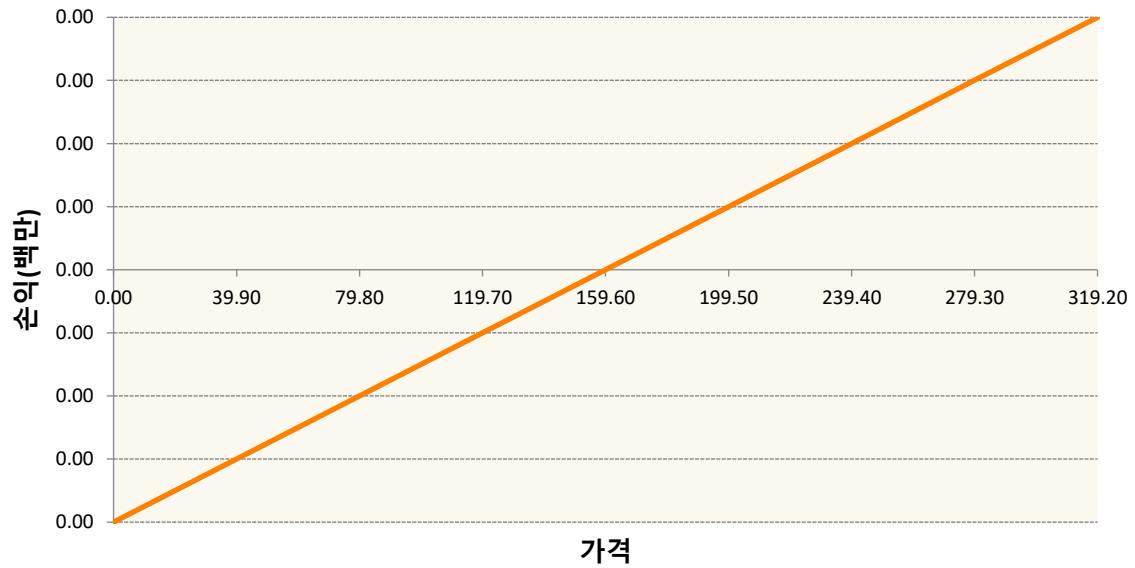
2. 만기시점의 손익구조



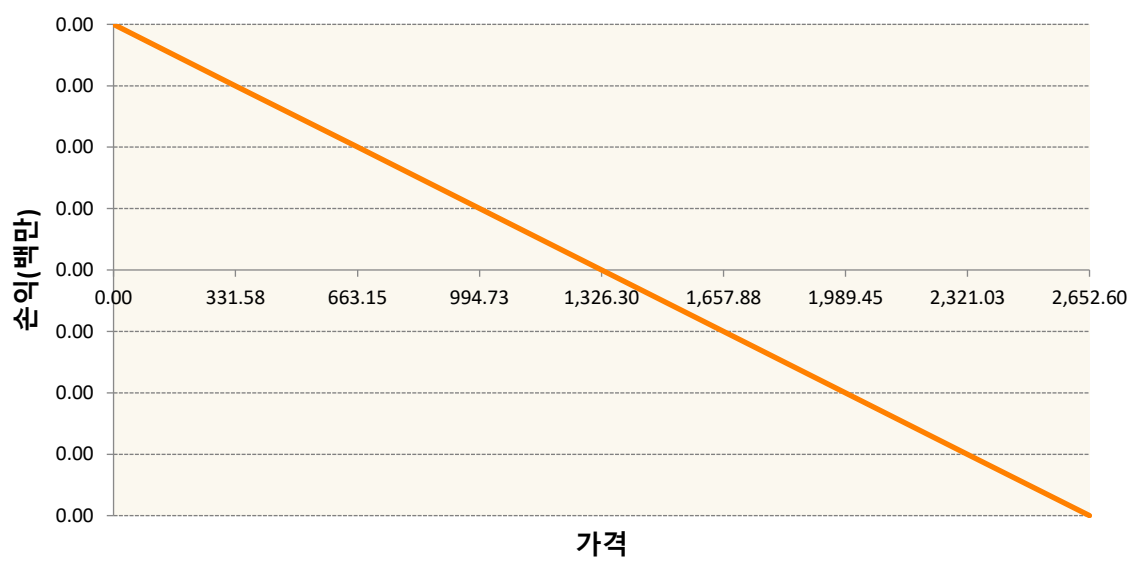
CZ3-CORN FUTURE Dec23



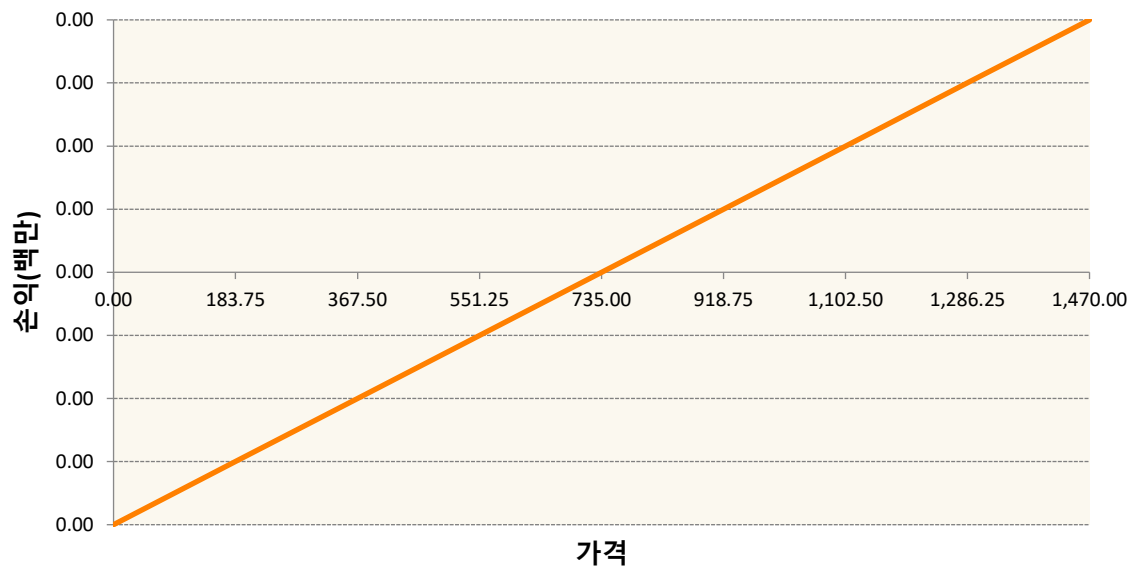
KCZ3-COFFEE 'C' FUTURE DEC23



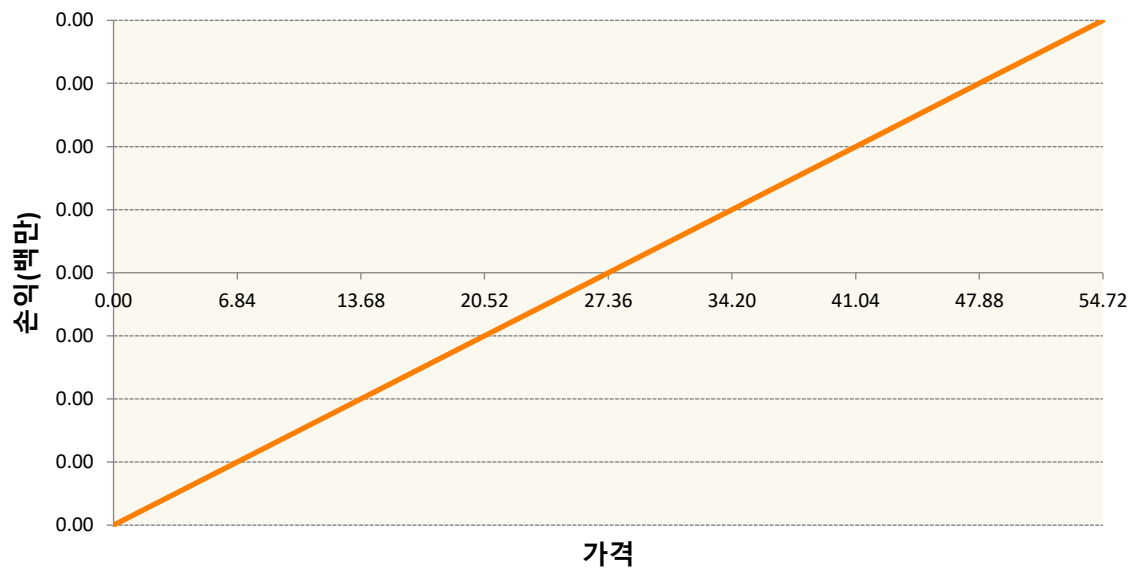
KR4175TA0001-2023-10 달러선물



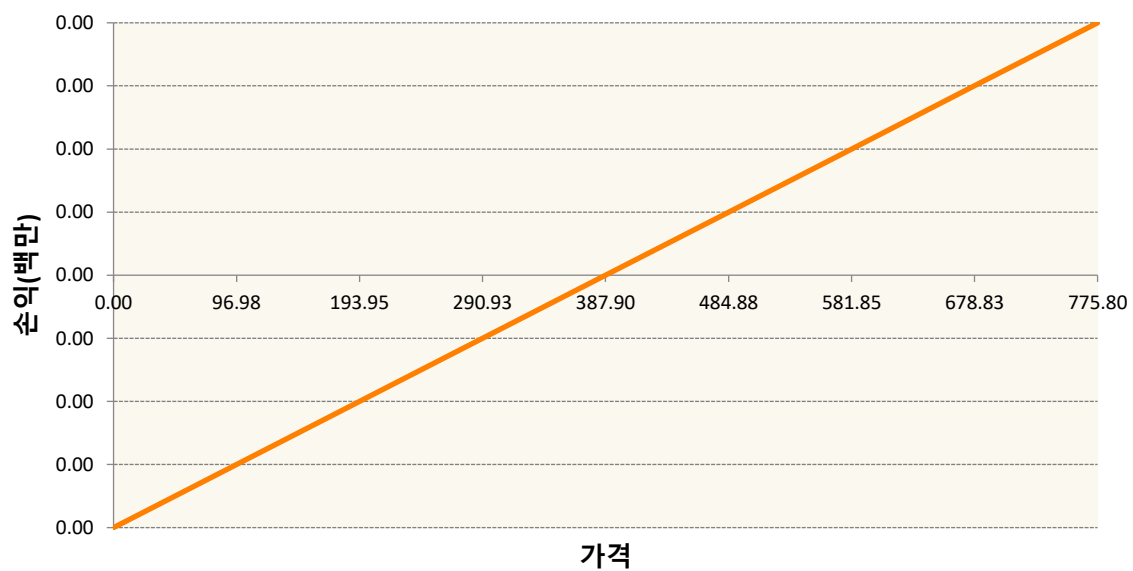
KWZ3-KC HRW WHEAT FUT DEC23

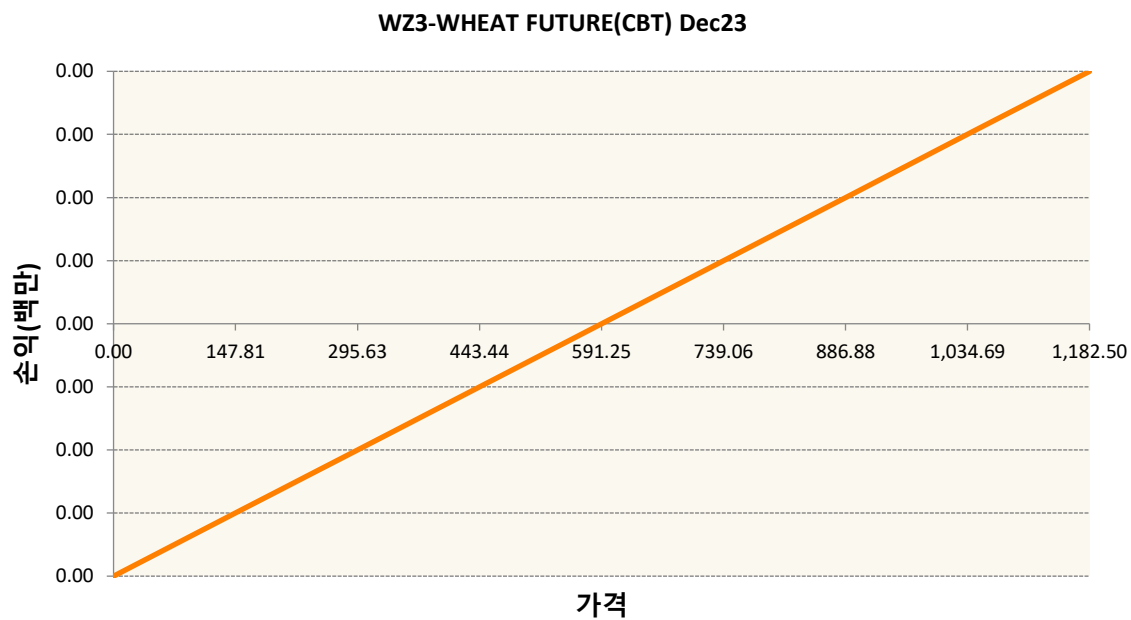
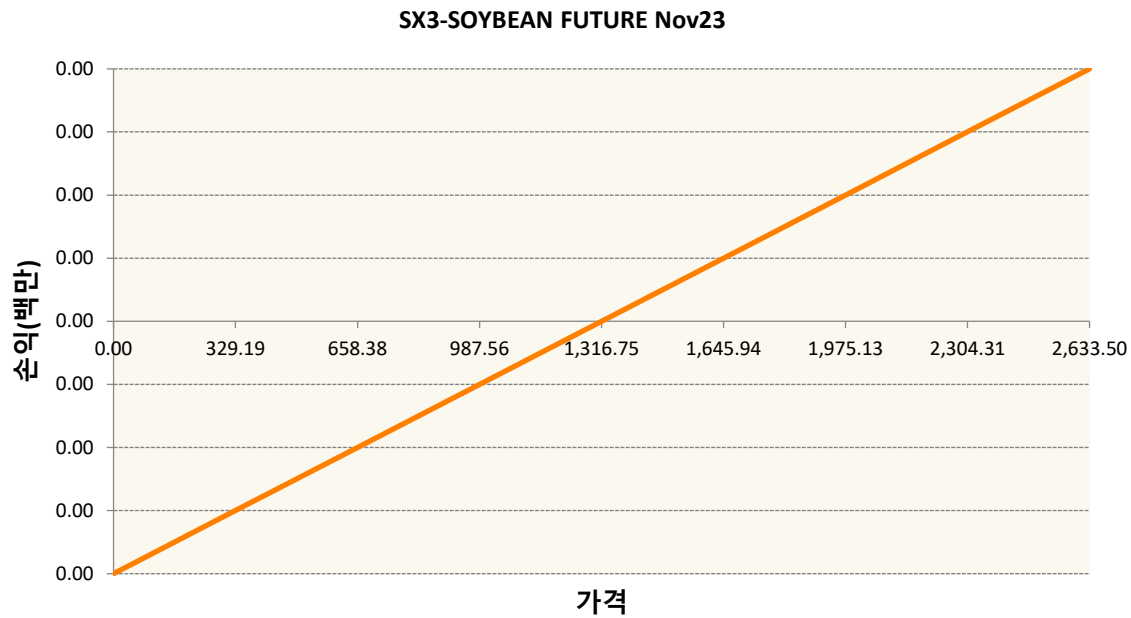


SBH4-Sugar #11 (WORLD) Mar24



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	2023-09-20
기준일	2023-09-19

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	320
-----------------------------	-----

* 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	2023-09-20
기준일	2023-09-19

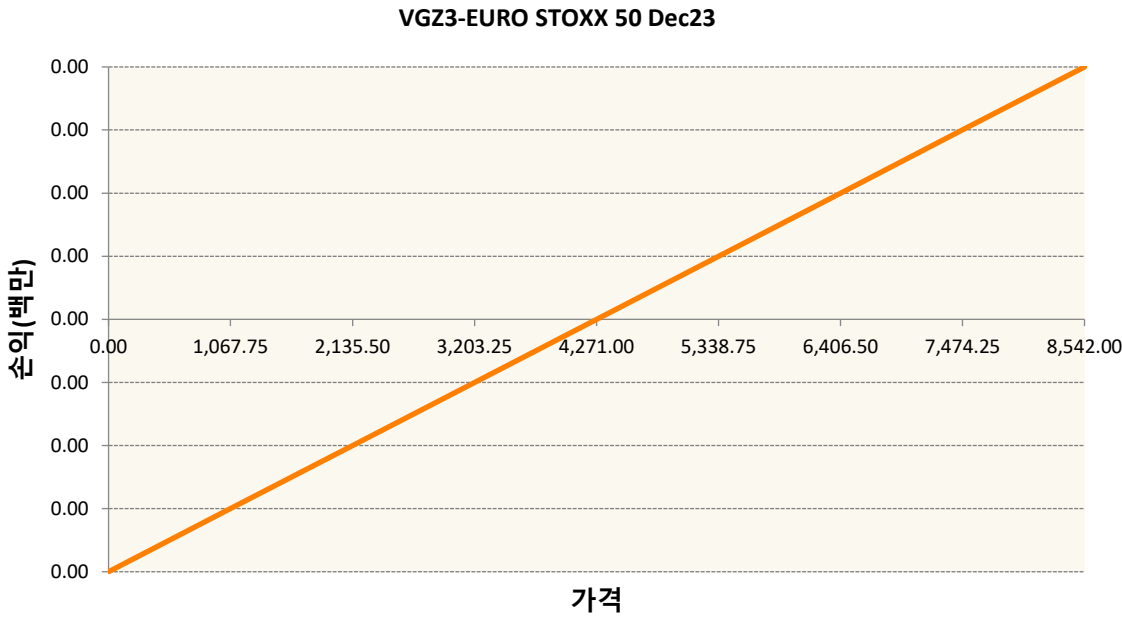
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	425	0	425	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGZ3	EURO STOXX 50 Dec23	34
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

30

공시일	2023-09-20
기준일	2023-09-19

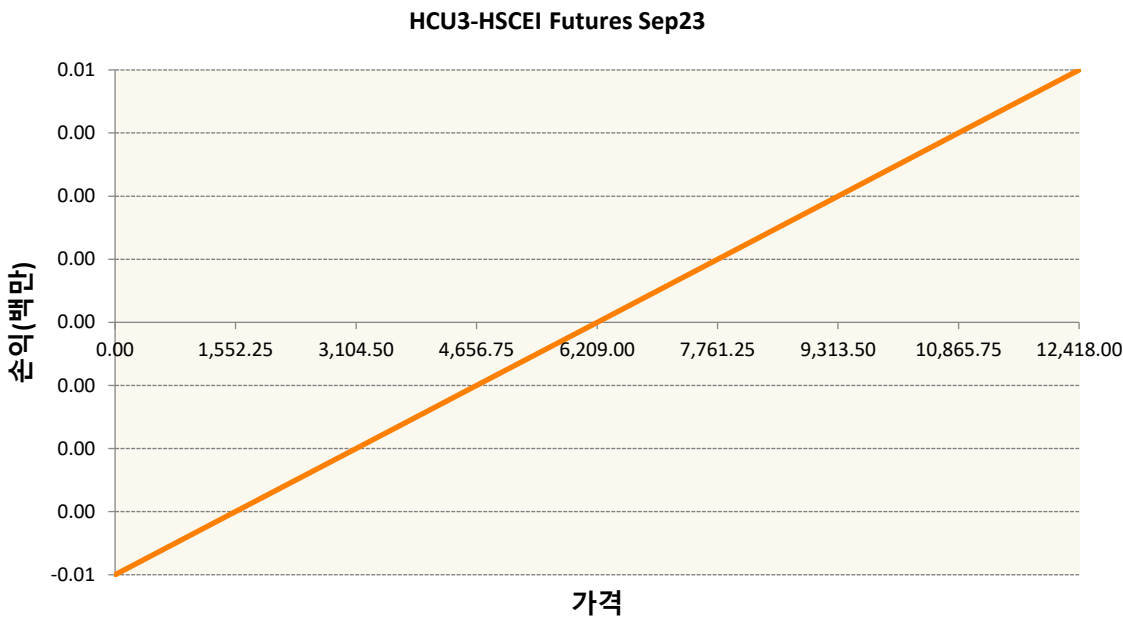
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,151	0	1,151	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCU3	HSCEI Futures Sep23	92
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

138

공시일	2023-09-20
기준일	2023-09-19

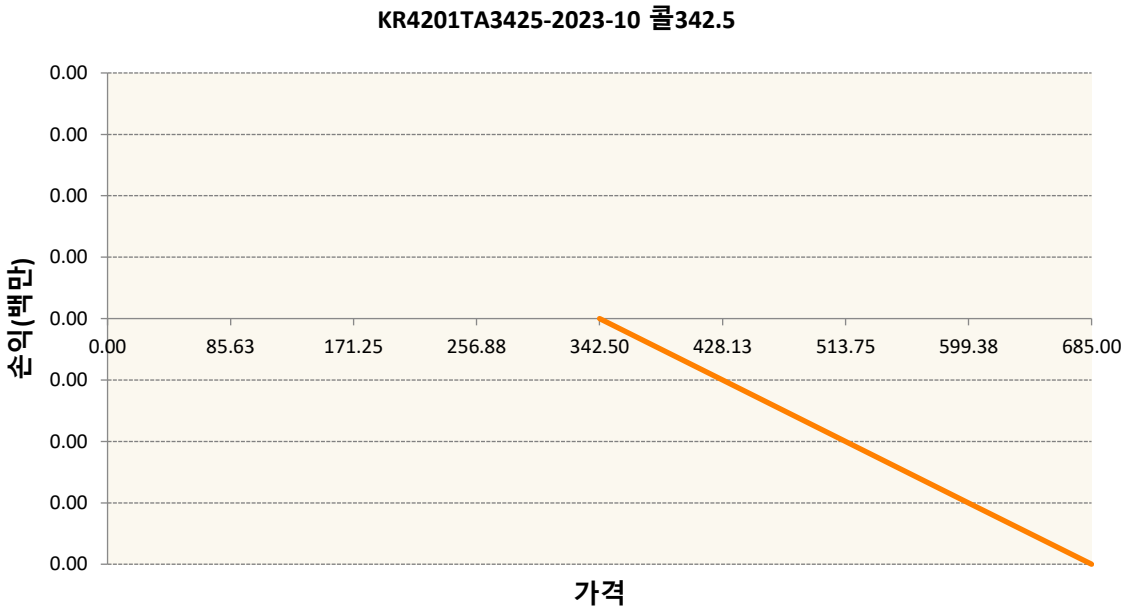
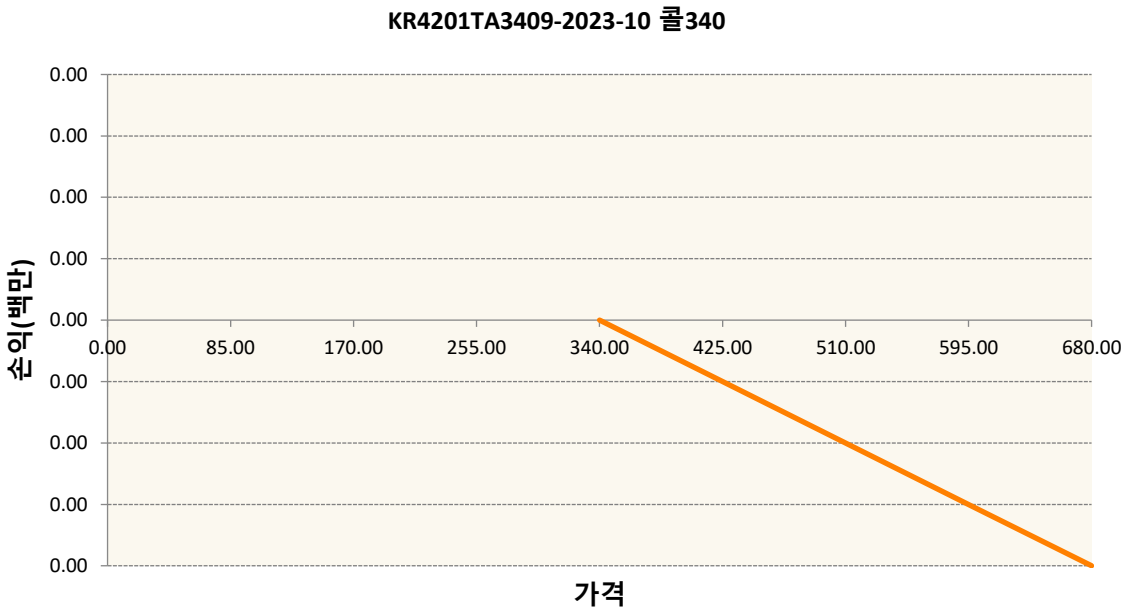
커버드콜모(주식혼합-파생형)

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	53,908	-53,908	장내

2. 만기시점의 손익구조



KR4301TA3408-2023-10 풋340



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201TA3409			2023-10 콜340				1,175
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	398	393	385	376	364	351	335
-5.33%	373	358	340	320	299	276	252
-2.67%	291	263	233	203	172	141	109
0%	107	71	36	0	-36	-71	-107
2.67%	-202	-233	-265	-298	-331	-364	-398
5.33%	-613	-633	-655	-679	-704	-731	-759
8.00%	-1,085	-1,094	-1,106	-1,120	-1,136	-1,155	-1,175
KR4201TA3425			2023-10 콜342.5				1,499
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	452	447	439	429	416	401	383
-5.33%	428	412	393	370	345	317	288
-2.67%	345	311	276	239	200	160	119
0%	140	94	47	0	-47	-94	-142
2.67%	-226	-272	-317	-363	-410	-457	-504
5.33%	-743	-774	-808	-844	-882	-921	-962
8.00%	-1,356	-1,372	-1,392	-1,415	-1,440	-1,468	-1,499
KR4301TA3408			2023-10 풋340				617
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-615	-615	-615	-615	-615	-616	-617
-5.33%	-376	-377	-378	-379	-381	-384	-387
-2.67%	-147	-152	-157	-163	-169	-176	-183
0%	28	19	9	0	-9	-19	-28

2.67%	107	101	94	87	80	72	64
5.33%	123	122	120	117	114	111	106
8.00%	125	125	124	124	123	122	120

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

(단위:백만원)

3,351

공시일	2023-09-20
기준일	2023-09-19

H2O글로벌본드(USD)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	1,327	-1,327	
누계	유가증권	수익증권	3,239	0	3,239	

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	2023-09-20
기준일	2023-09-19

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	4,641	0	4,641	

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	2023-09-20
기준일	2023-09-19

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	17,470	0	17,470	
누계	통화	선도	531	17,835	-17,304	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	605
FXW213D98(USD/KRW 27-09-23E	43
IE00BD8RGM75	

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

831

공시일	2023-09-20
기준일	2023-09-19

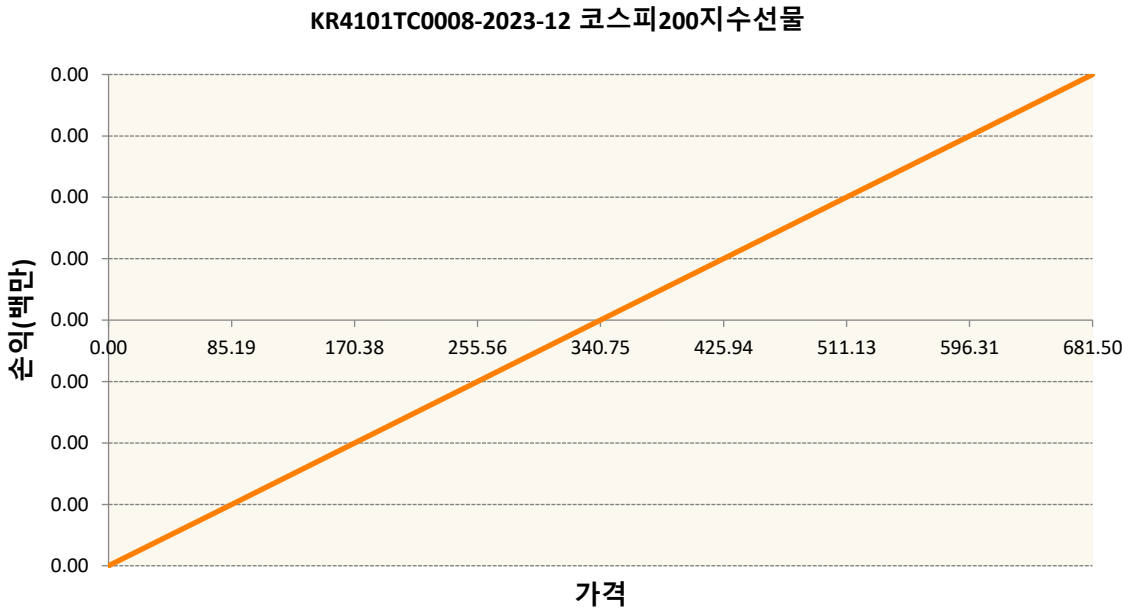
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

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	596	0	596	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101TC0008		2023-12 코스피200지수선물					47
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-47	-47	-47	-47	-47	-47	-47
-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%	47	47	47	47	47	47	47

공시일	2023-09-20
기준일	2023-09-19

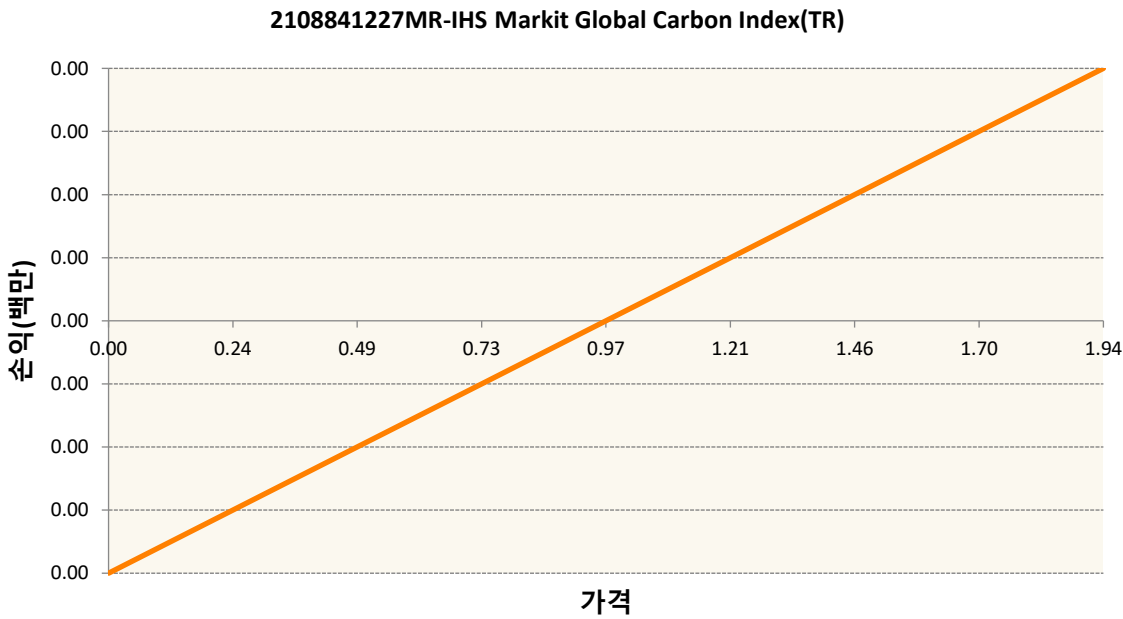
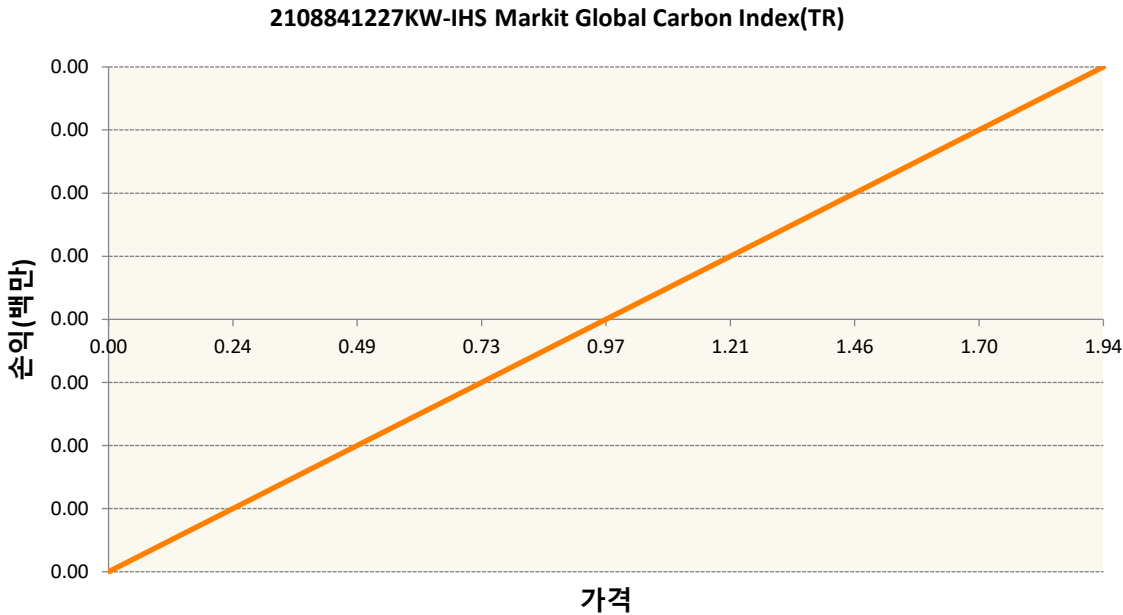
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

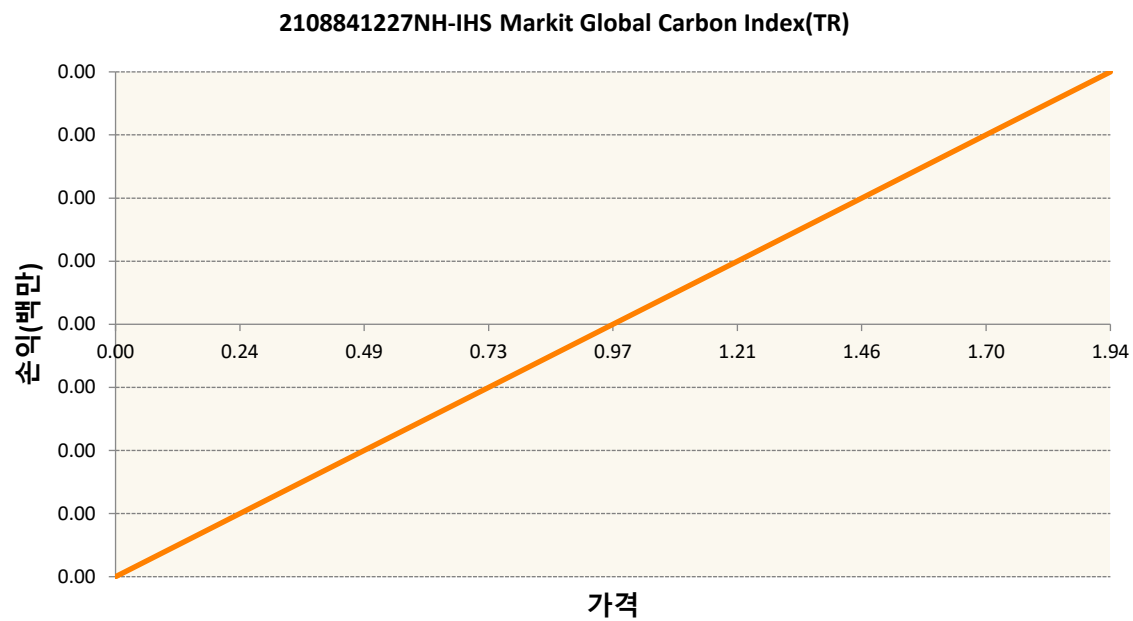
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	25,485	0	25,485	

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108841227IHS Markit Global Carbon Index(TR)		1,726
2108841227IHS Markit Global Carbon Index(TR)		203
2108841227IHS Markit Global Carbon Index(TR)		102

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)		(단위:백만원)
		2,846

공시일	2023-09-20
기준일	2023-09-19

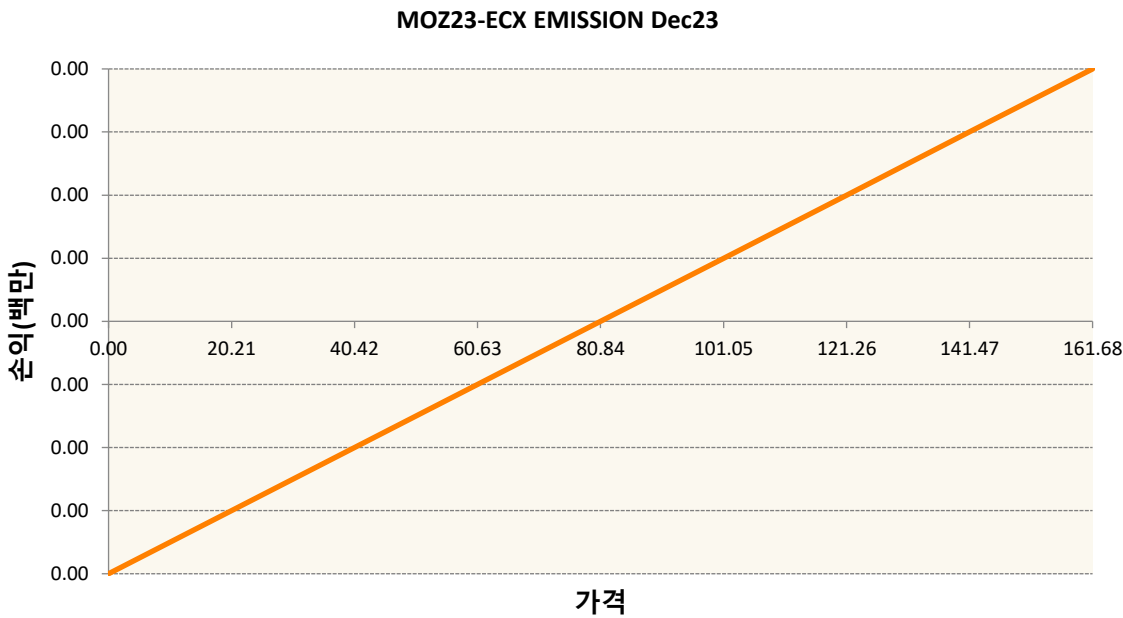
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	7,835	0	7,835	
누계	지수	스왑	479	0	479	장외
누계	통화	선도	0	1,937	-1,937	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	627
SWICEUACN ICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX	1

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

(단위:백만원)

1,315

공시일	2023-09-20
기준일	2023-09-19

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)	30
SWCSI00000 신한CSI Index 230622 (키움)	30
SWCSI00000 신한CSI Index 230622 (미래)	30
SWCSI00000 신한CSI Index 230622 (메리츠)	30

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

(단위:백만원)

191

공시일	2023-09-20
기준일	2023-09-19

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)	32
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 230116(미래)	26
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 230427(키움)	7

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

(단위:백만원)

105

공시일	2023-09-20
기준일	2023-09-19

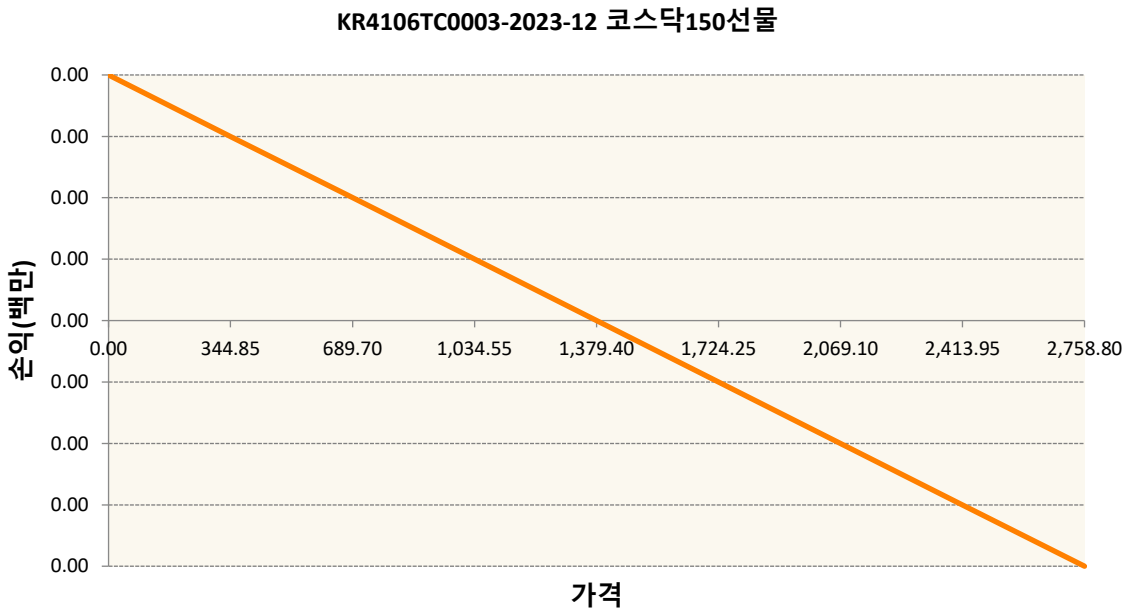
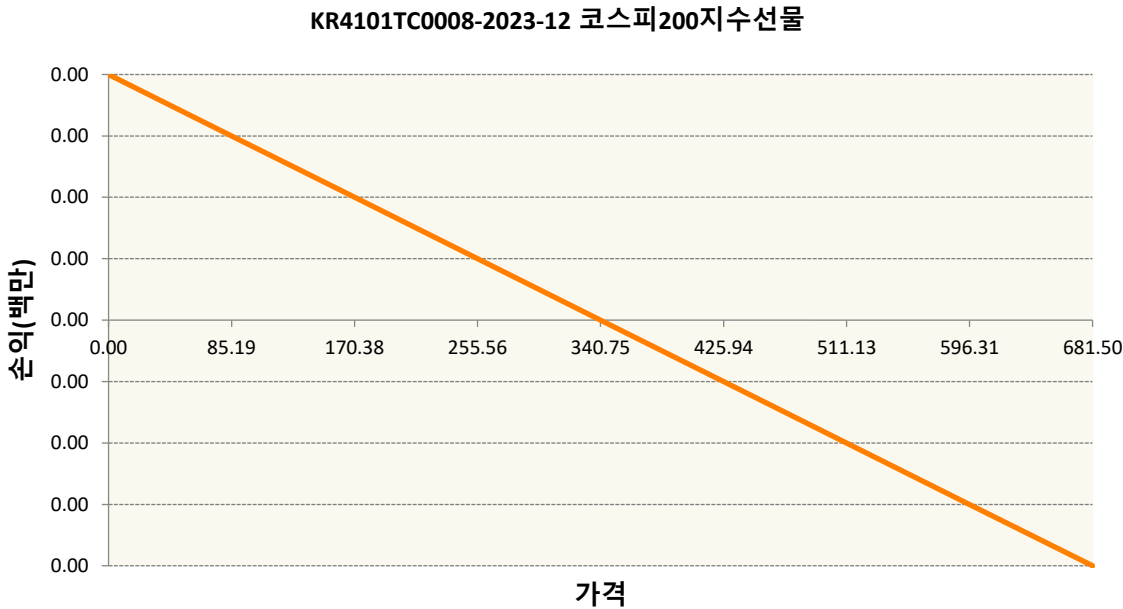
에쿼티알파일반사모혼합자산

1. 계약금액

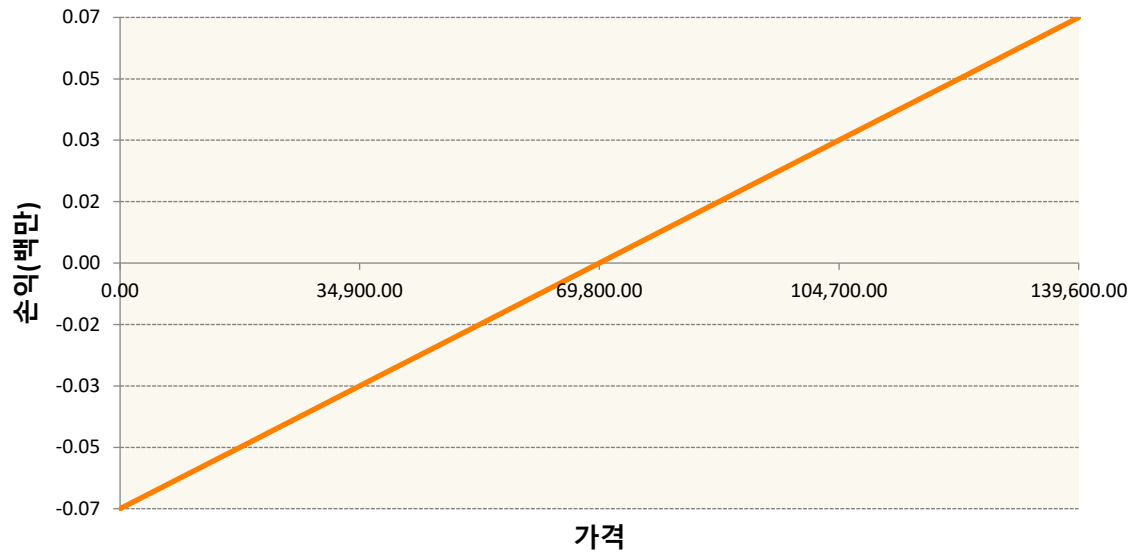
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	427	16	411	장내
신규	유가증권	ELS	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	2,019	3,557	-1,539	장내
누계	유가증권	ELS	0	0	0	장외

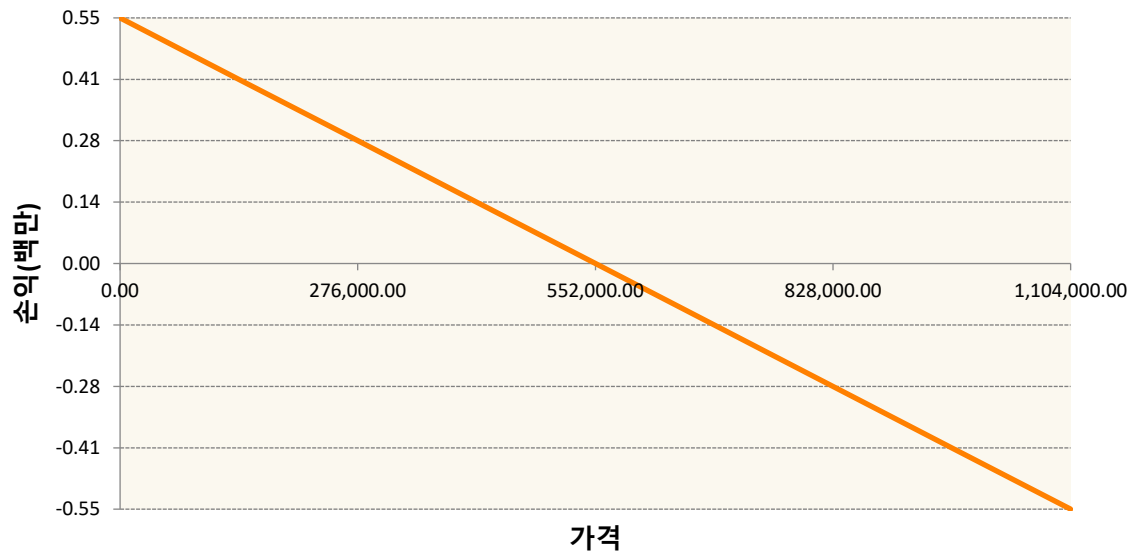
2. 만기시점의 손익구조



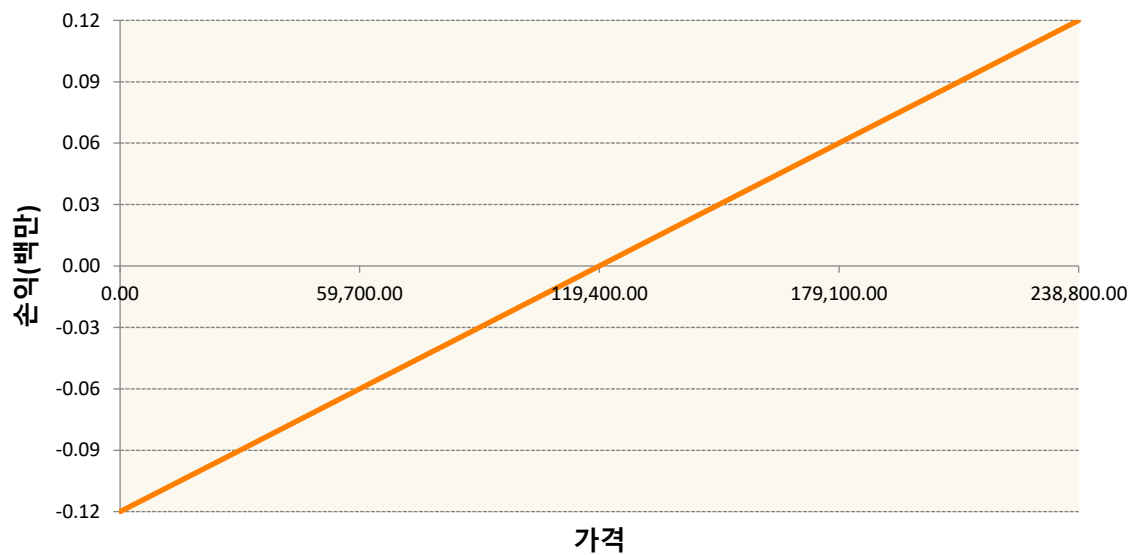
KR4111TA0008-2023-10 삼성전자개별선물



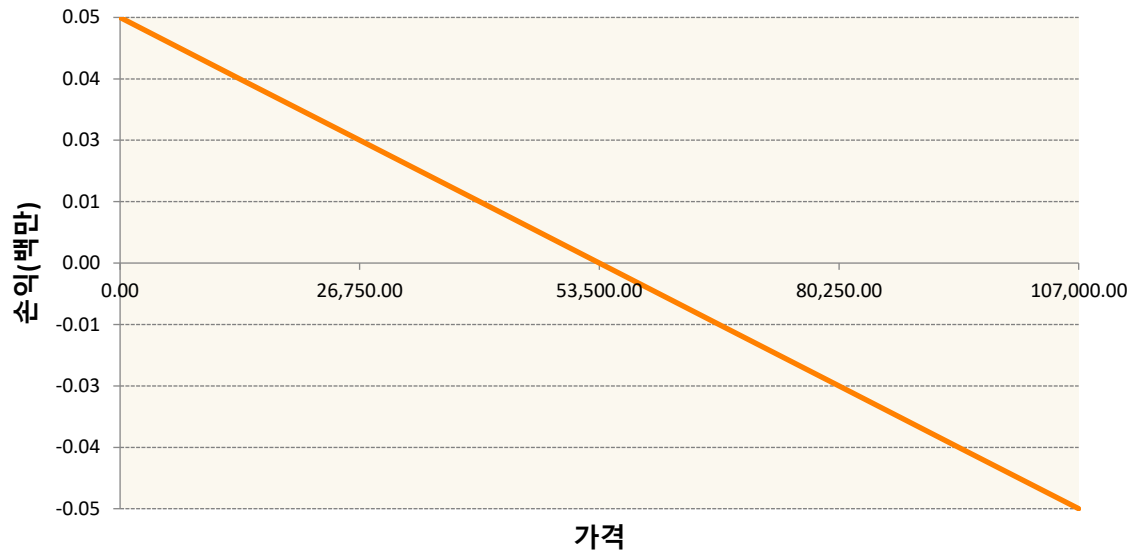
KR4147TA0006-2023-10 LG화학개별선물



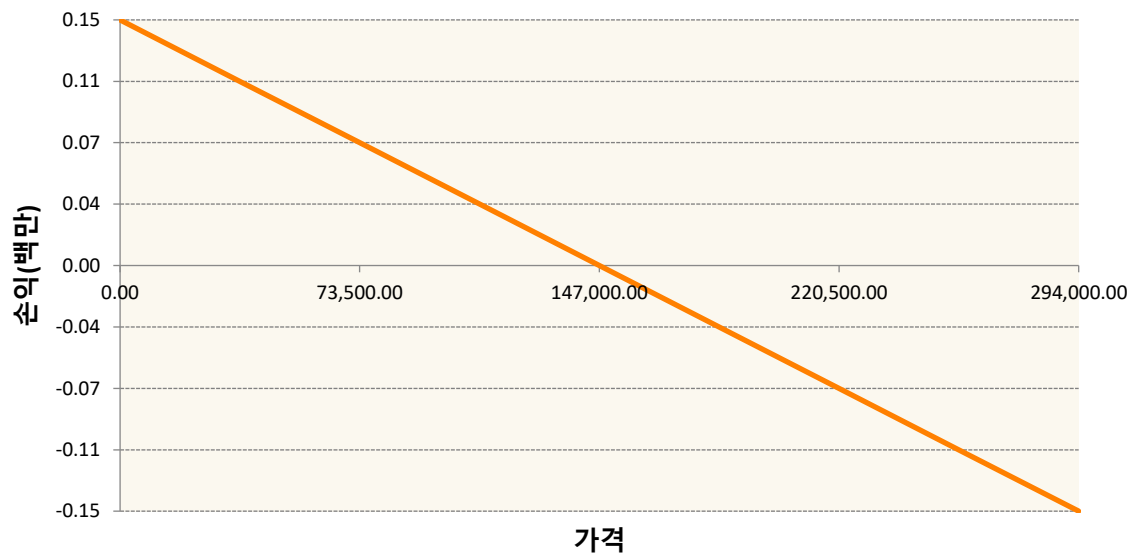
KR4150TA0000-2023-10 SK하이닉스개별선물



KR41CNTA0000-2023-10 포스코DX개별선물



KR41CPTA0008-2023-10 셀트리온개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101TC00 2023-12 코스피200지수선물	204
KR4106TC00 2023-12 코스닥150선물	47
KR4111TA00 2023-10 삼성전자개별선물	136
KR4147TA00 2023-10 LG화학개별선물	13
KR4150TA00 2023-10 SK하이닉스개별선물	25
KR41CNTA00 2023-10 포스코DX개별선물	6
KR41CPTA00 2023-10 셀트리온개별선물	14
KRS0004572 ELWKB금융_주식스왑	0.32

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

(단위:백만원)

공시일	2023-09-20
기준일	2023-09-19

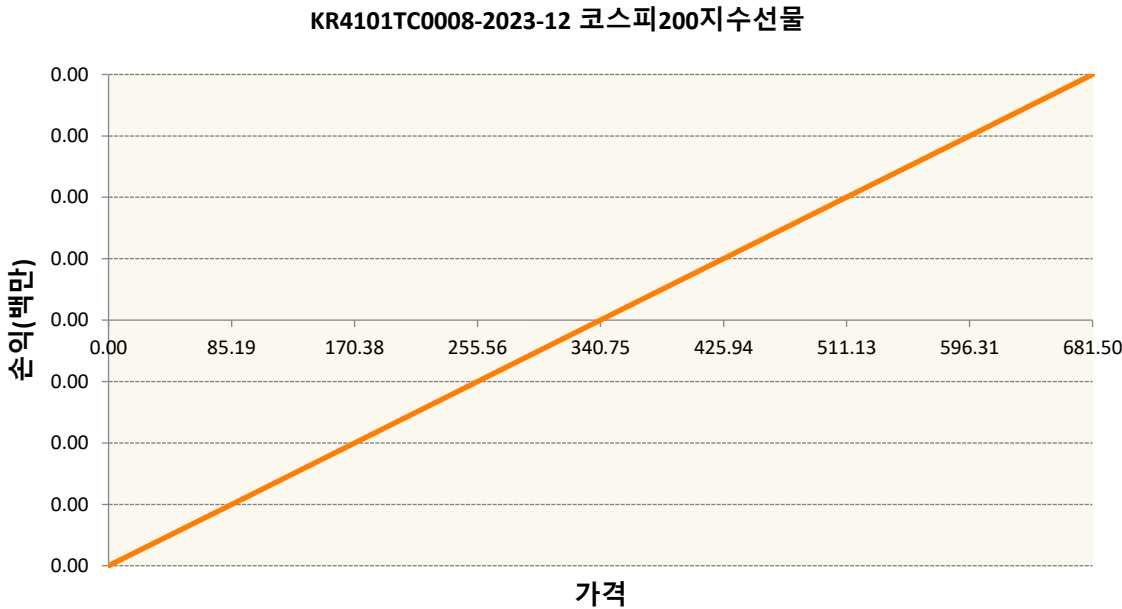
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

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	1,363	0	1,363	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101TC0008			2023-12 코스피200지수선물				108
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-108	-108	-108	-108	-108	-108	-108
-5.33%	-72	-72	-72	-72	-72	-72	-72
-2.67%	-36	-36	-36	-36	-36	-36	-36
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	36	36	36	36	36	36	36
5.33%	72	72	72	72	72	72	72
8.00%	108	108	108	108	108	108	108

공시일	2023-09-20
기준일	2023-09-19

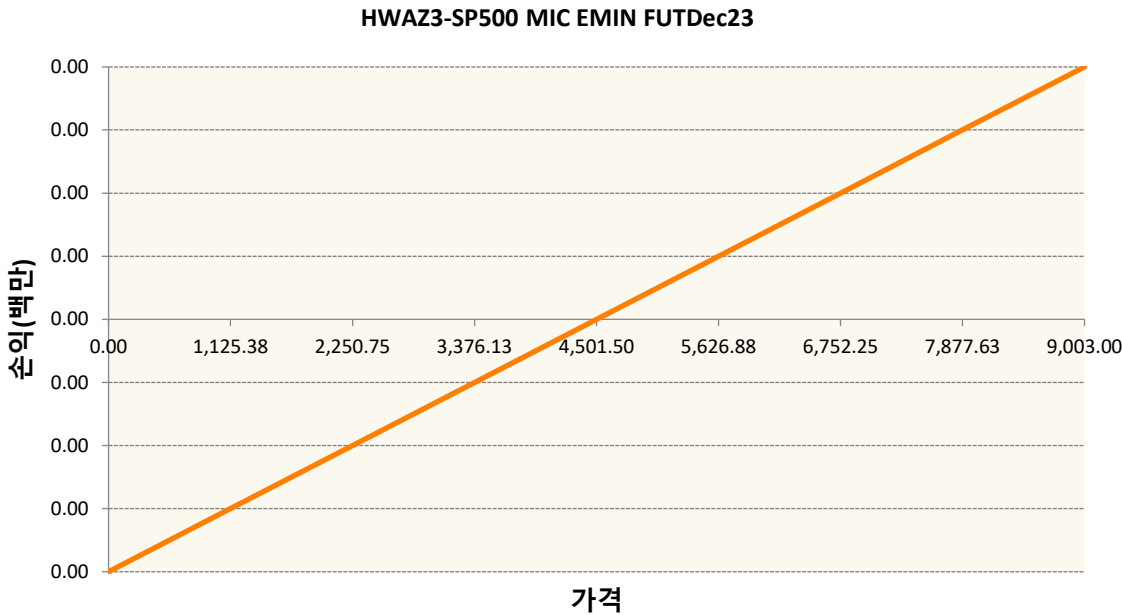
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

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	1,044	0	1,044	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HWAZ3	SP500 MIC EMIN FUTDec23	84
-------	-------------------------	----

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

(단위:백만원)

83

공시일	2023-09-20
기준일	2023-09-19

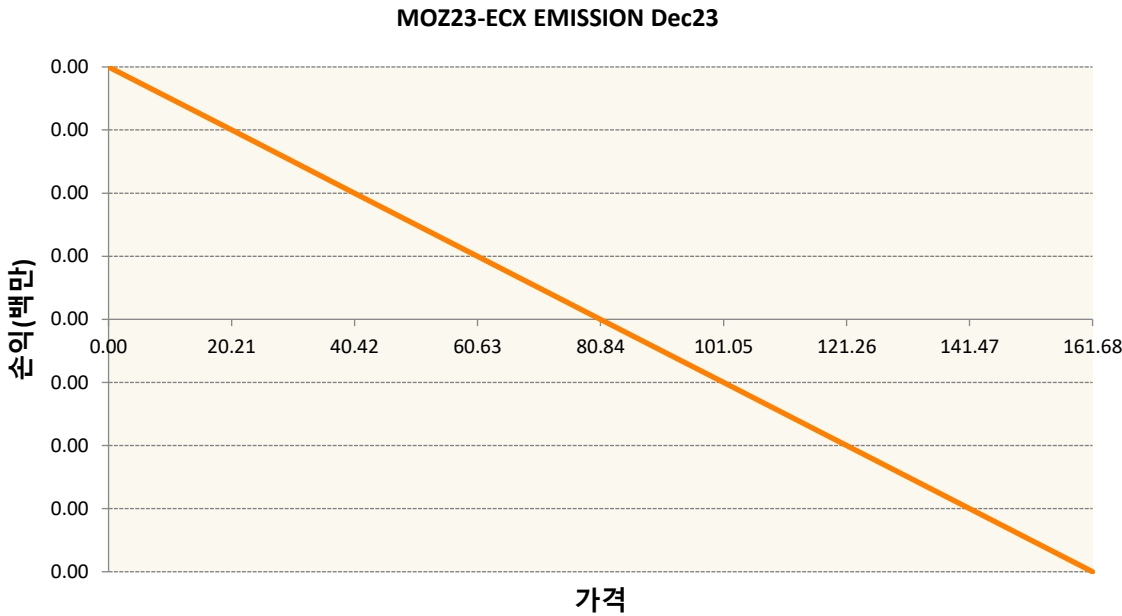
SOL유럽탄소배출권선물인버스ICE특별자산상

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	9,671	-9,671	
누계	지수	스왑	479	0	479	장외
누계	통화	선도	0	1,854	-1,854	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213D8W KRW/EUR 27-09-23E	148
MOZ23 ECX EMISSION Dec23	774
SWICEUACN ICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX	1

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

(단위:백만원)

1,590

공시일	2023-09-20
기준일	2023-09-19

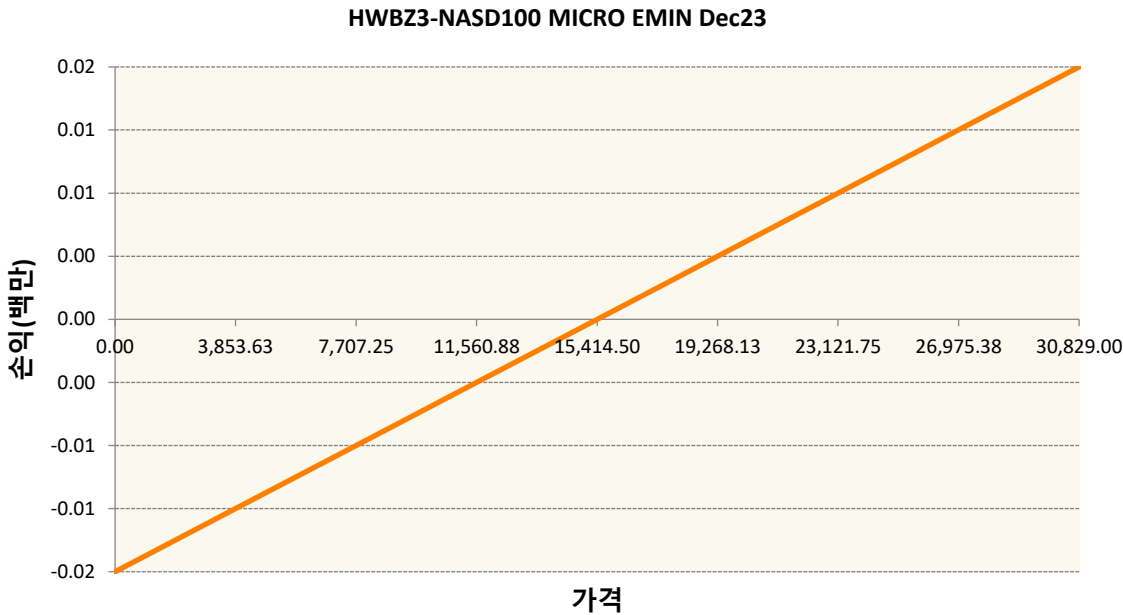
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

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	1,063	0	1,063	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HWBZ3 NASD100 MICRO EMIN Dec23

85

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

(단위:백만원)

85

공시일	2023-09-20
기준일	2023-09-19

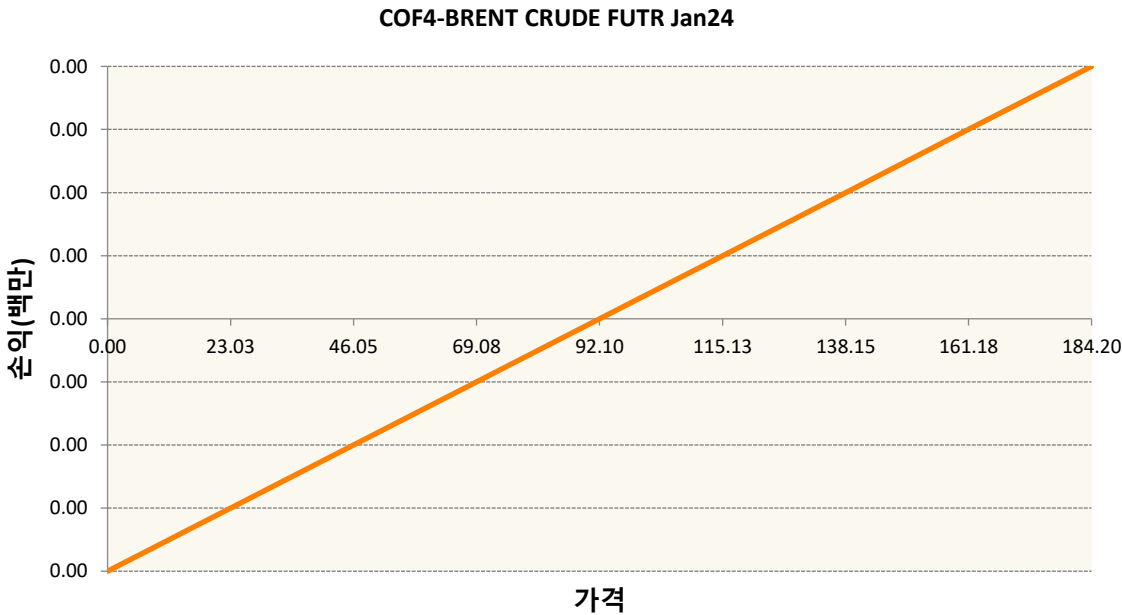
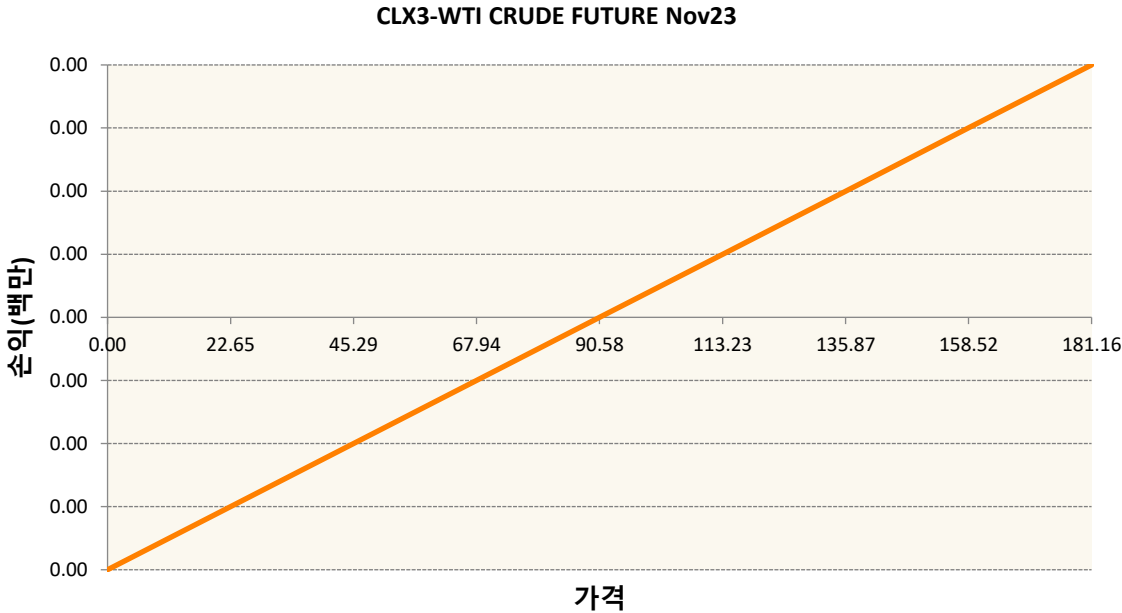
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

1. 계약금액

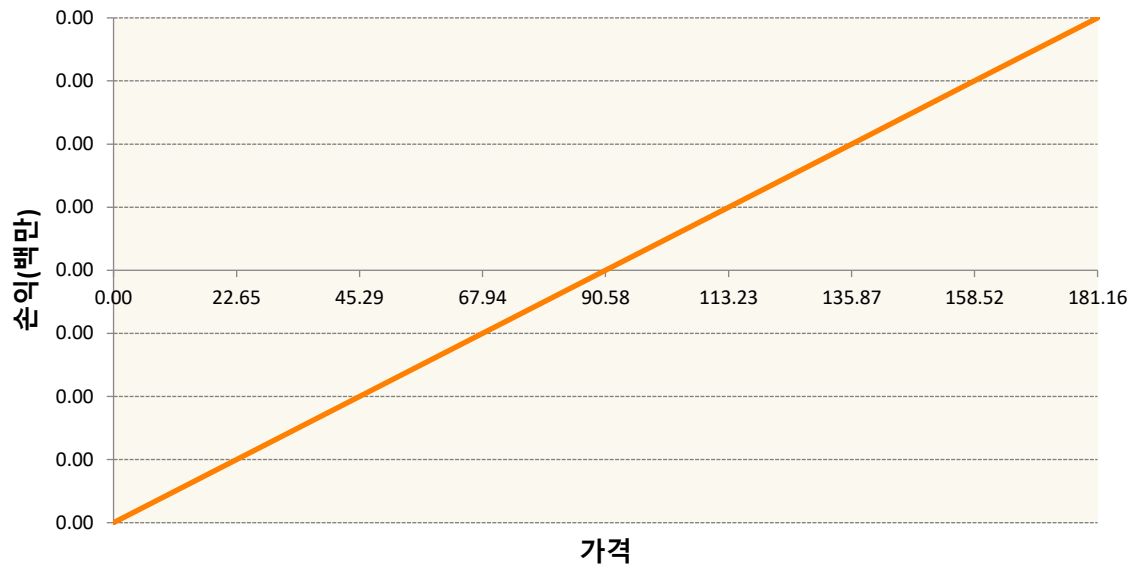
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,567	0	1,567	
누계	통화	선물	0	252	-252	장내

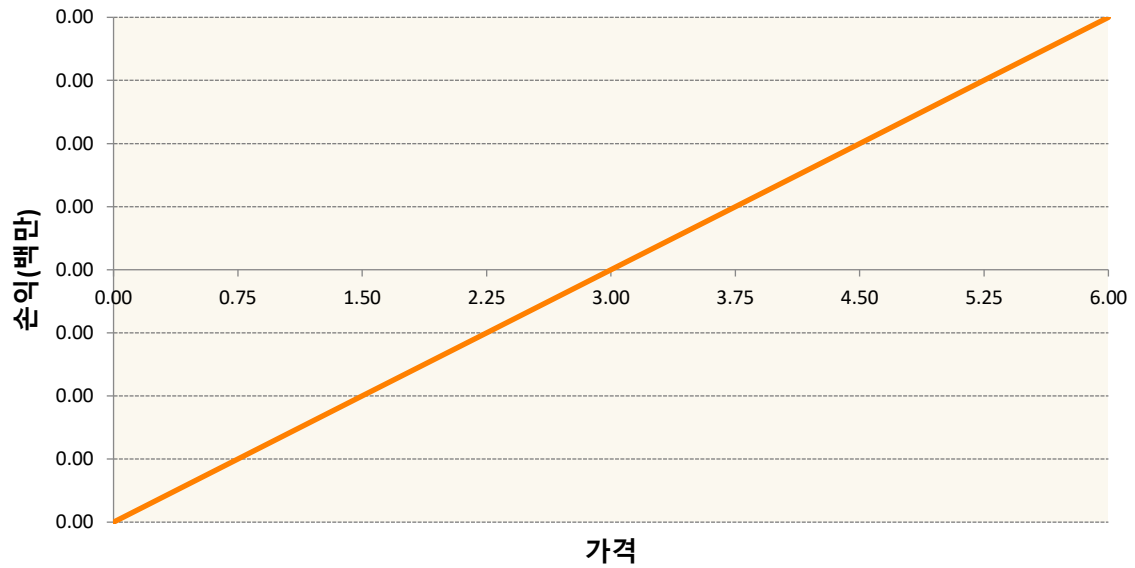
2. 만기시점의 손익구조



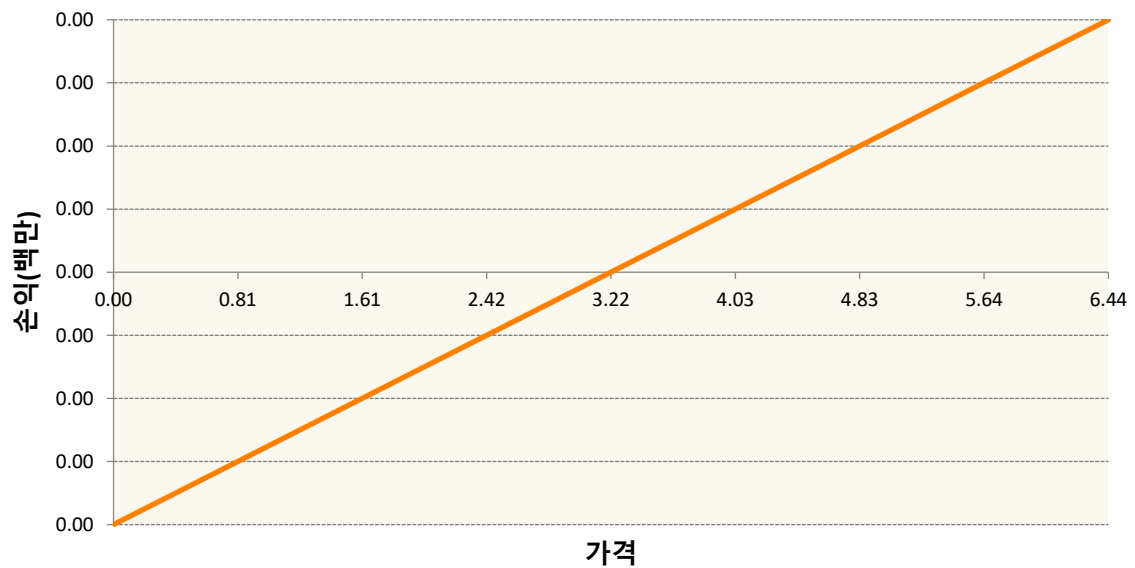
ECX3-E-MINI CRUDE OIL Nov23



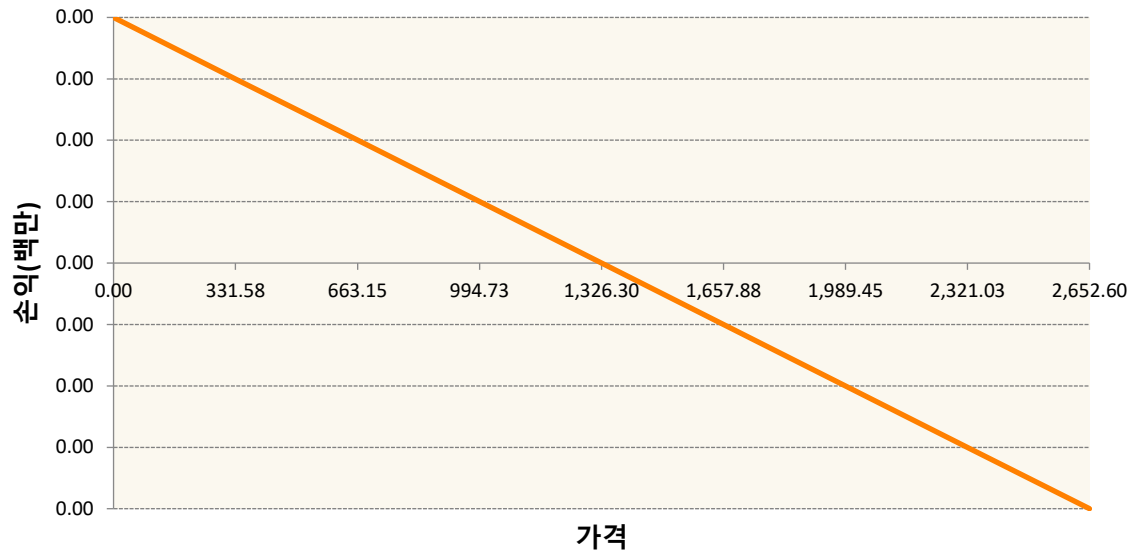
EOX3-E-MINI NATURAL GAS Nov23



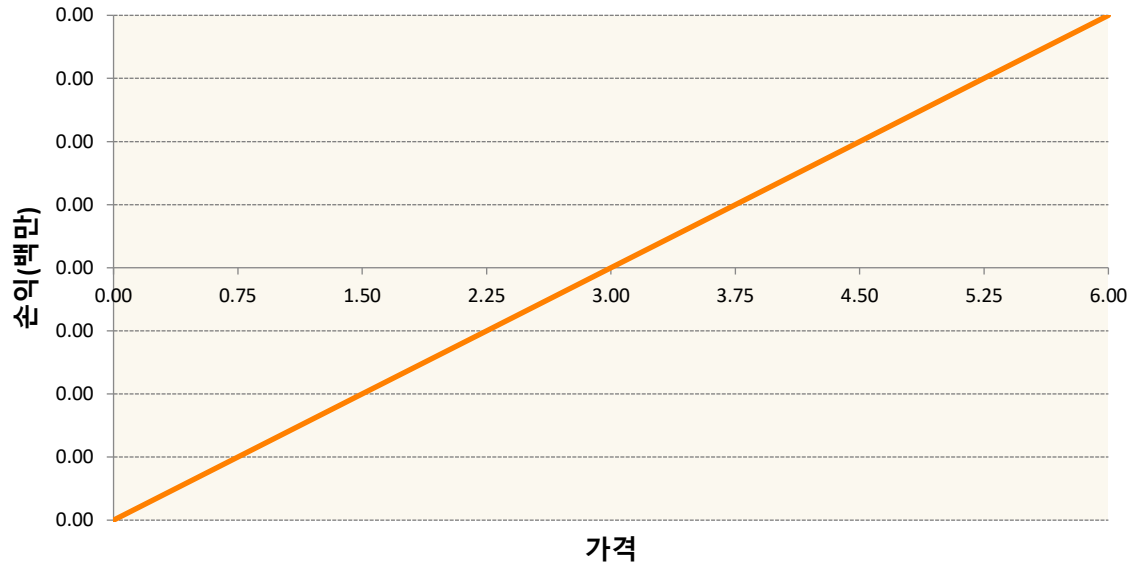
HOX3-NY Harb ULSD Fut Nov23



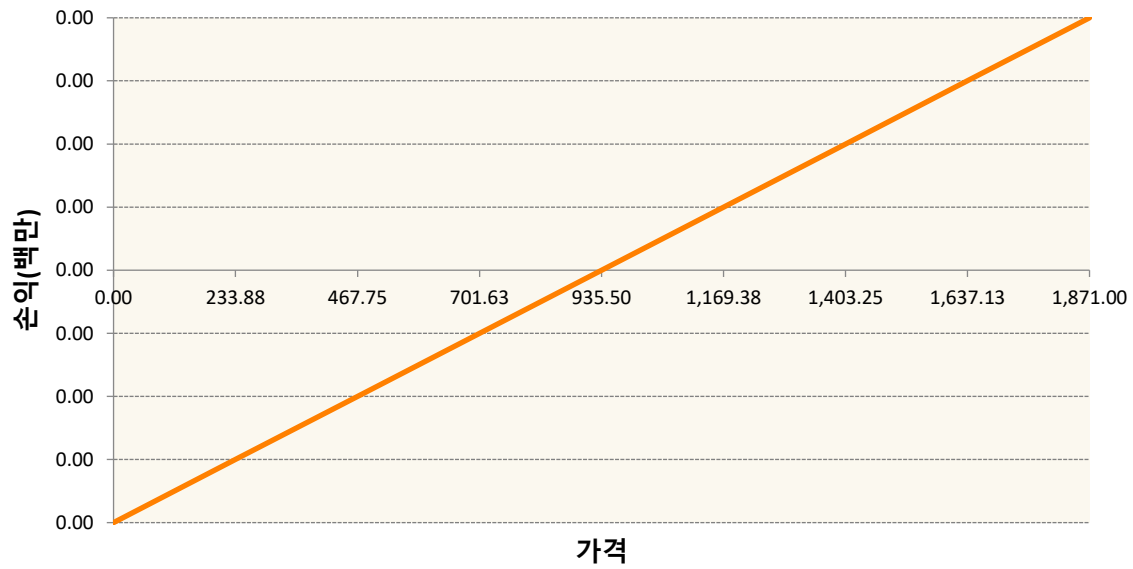
KR4175TA0001-2023-10 달러선물

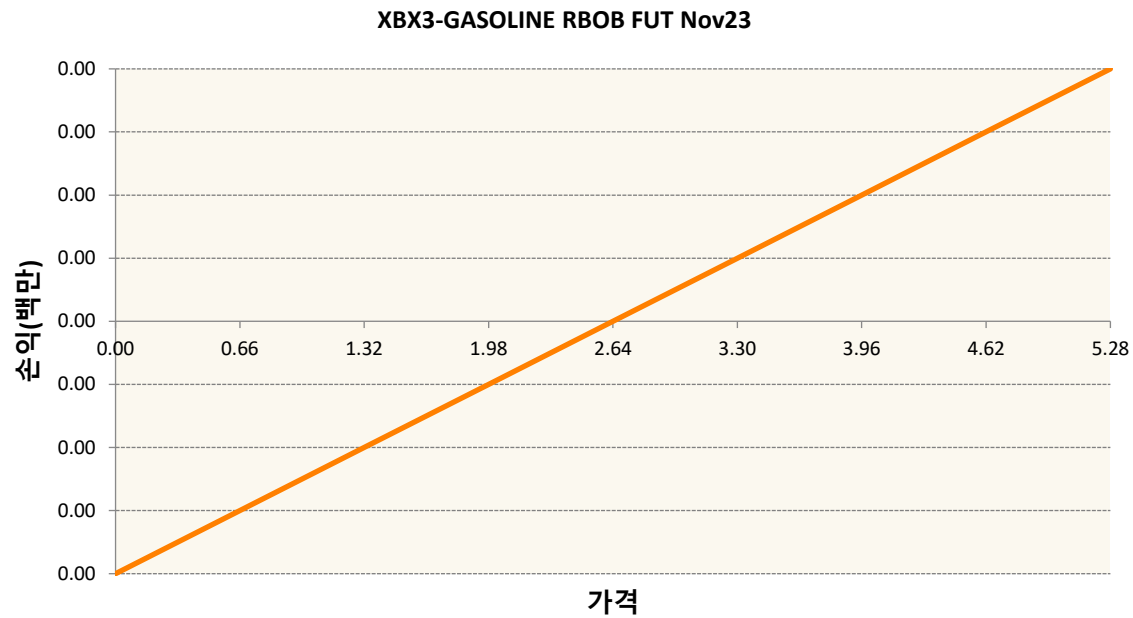


NGX23-NATURAL GAS FUTR Nov23



QX3-Low Su Gasoil G Nov23





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
CLX3	WTI CRUDE FUTURE Nov23	29
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	14
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)
	324