

공시일	2023-03-14
기준일	2023-03-13

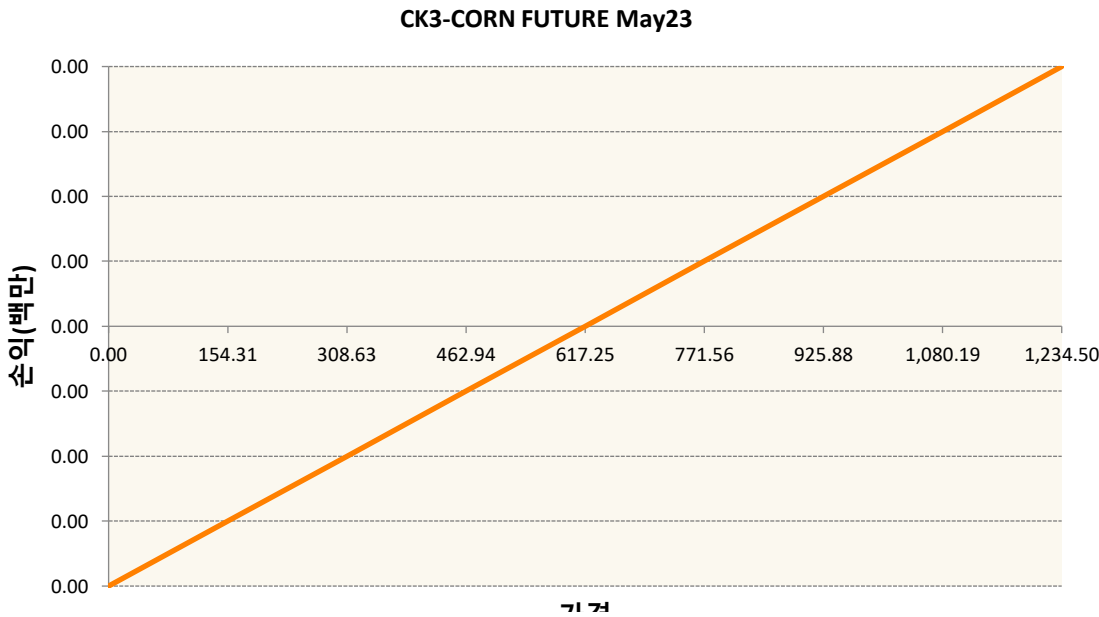
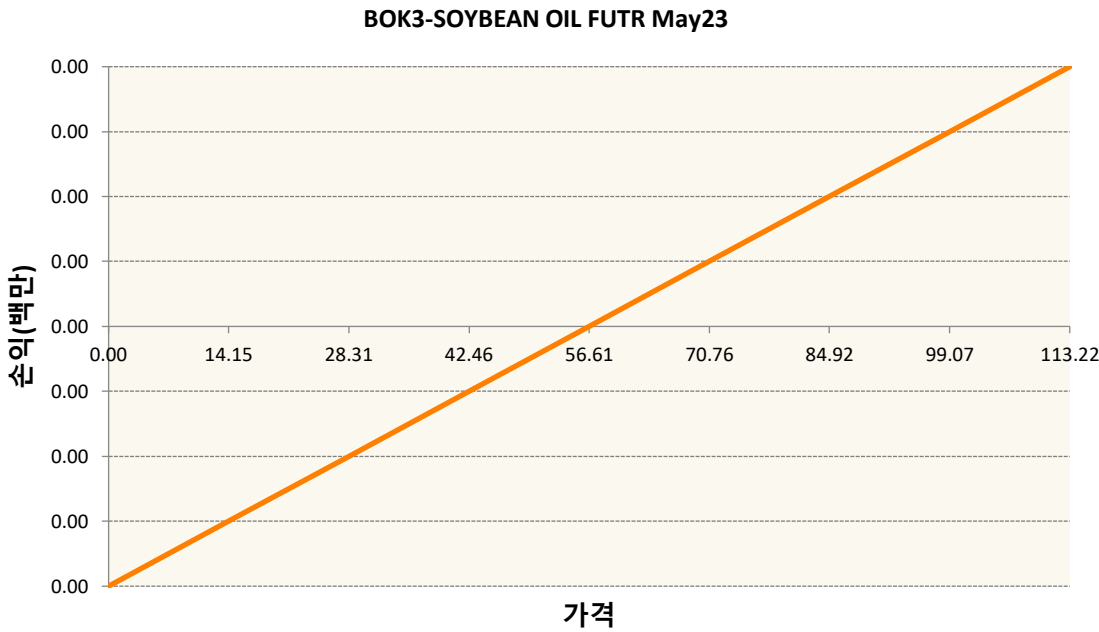
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

(단위:USD 백만)

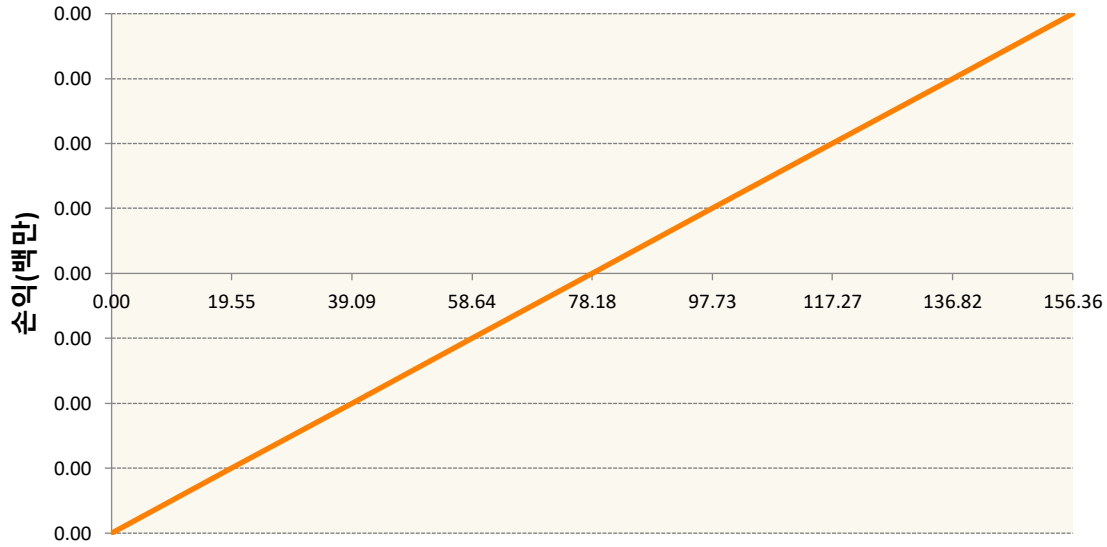
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,482	520	4,961	

2. 만기시점의 손익구조



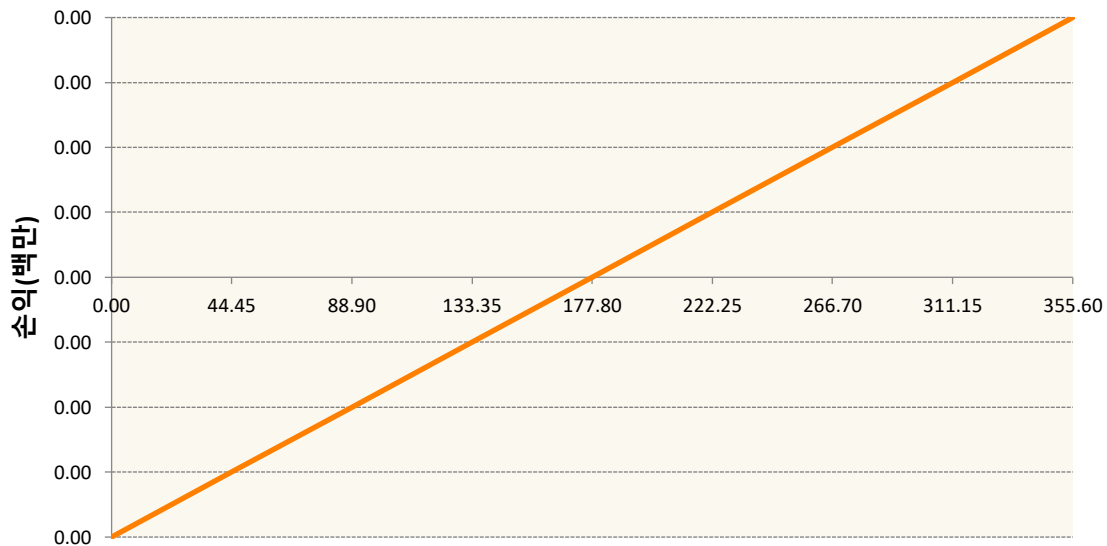
가격

CTK3-COTTON NO.2 FUTR May23



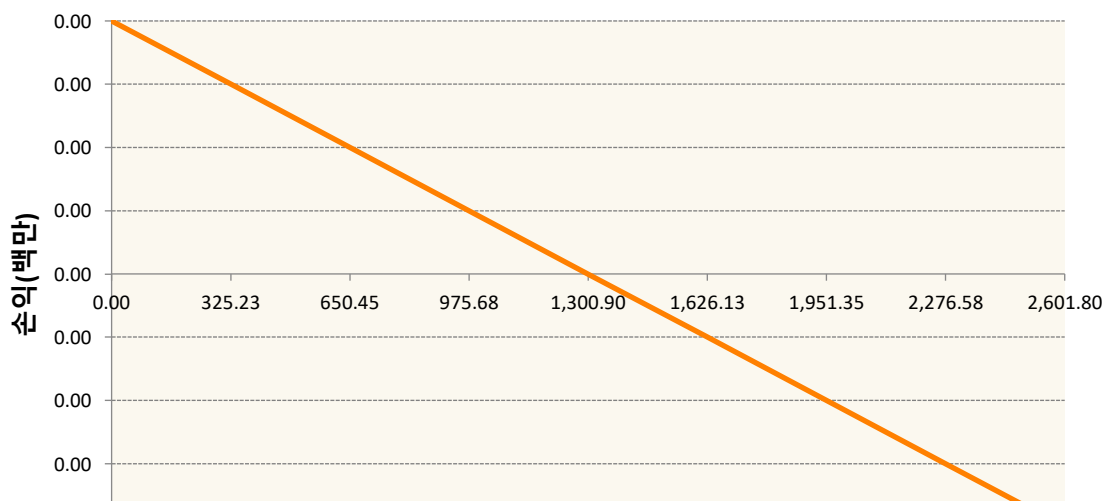
가격

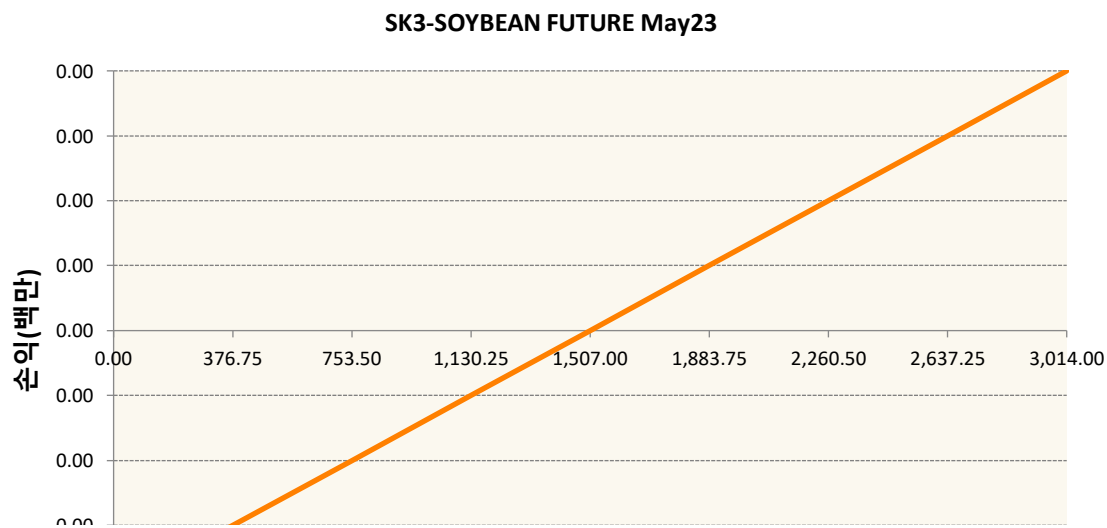
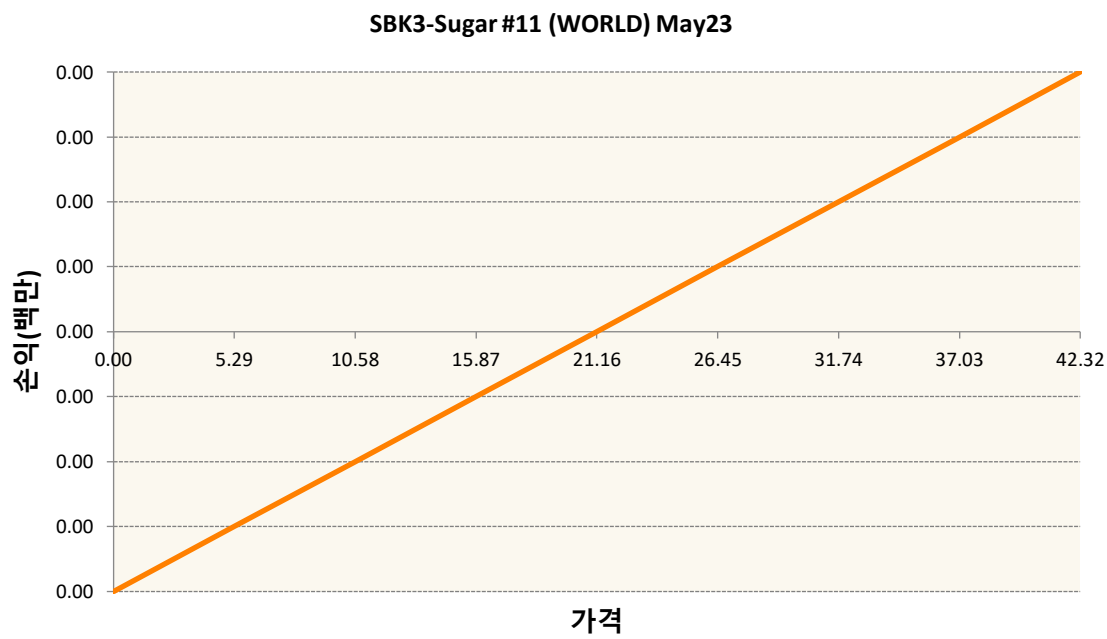
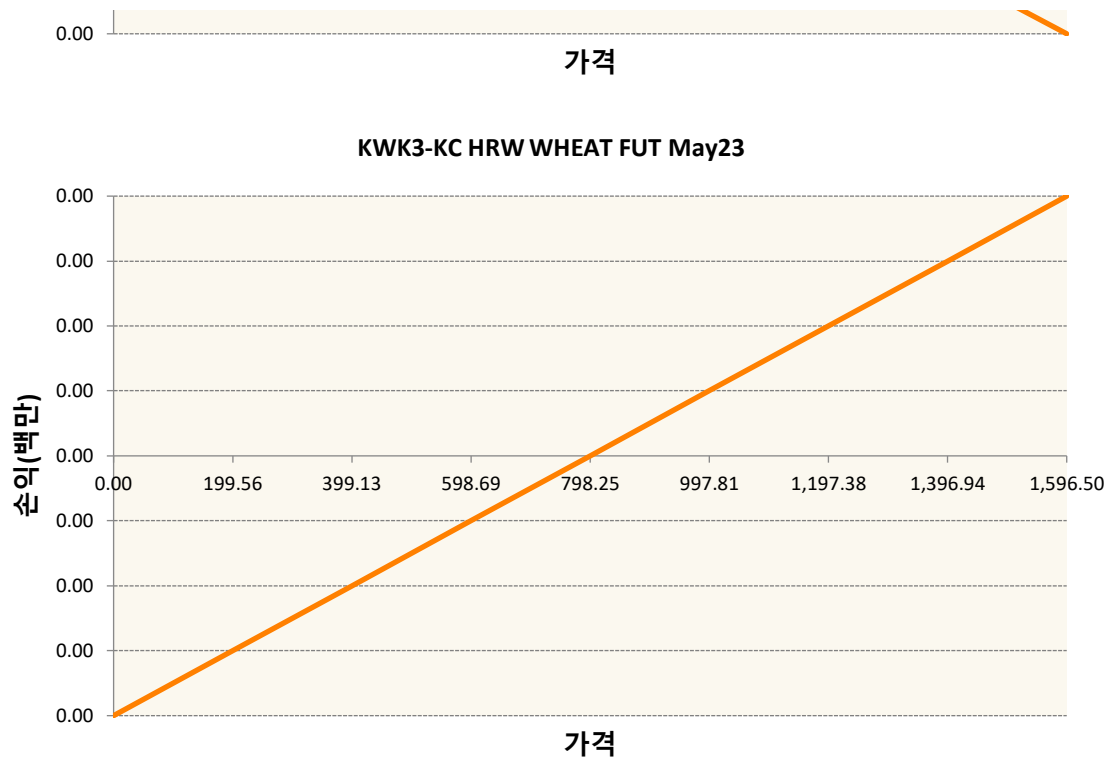
KCK3-COFFEE 'C' FUTURE May23

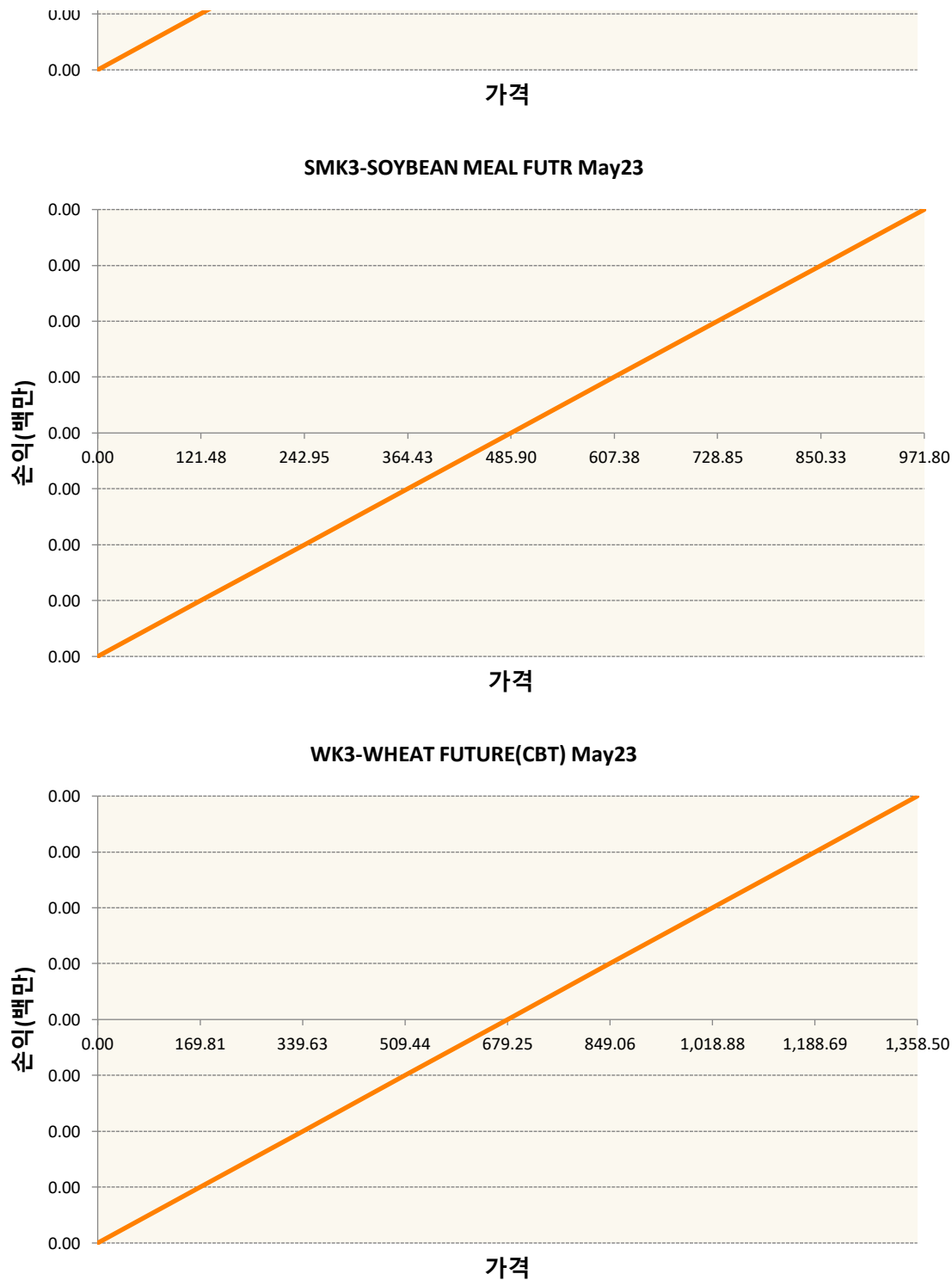


가격

KR4175T30003-2023-03 달러선물







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

215

공시일	2023-03-14
기준일	2023-03-13

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	4,420	0	4,420	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI5000C 신한CSI500미래220311	354
-----------------------------	-----

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

486

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2023-03-14
기준일	2023-03-13

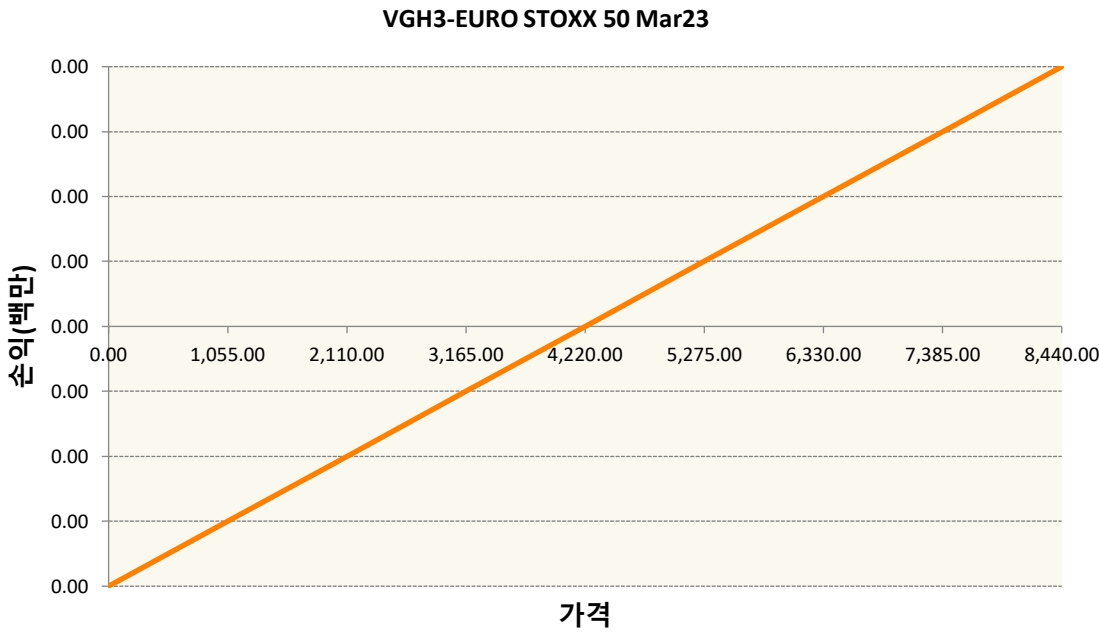
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	468	0	468	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGH3	EURO STOXX 50 Mar23	37
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

40

공시일	2023-03-14
기준일	2023-03-13

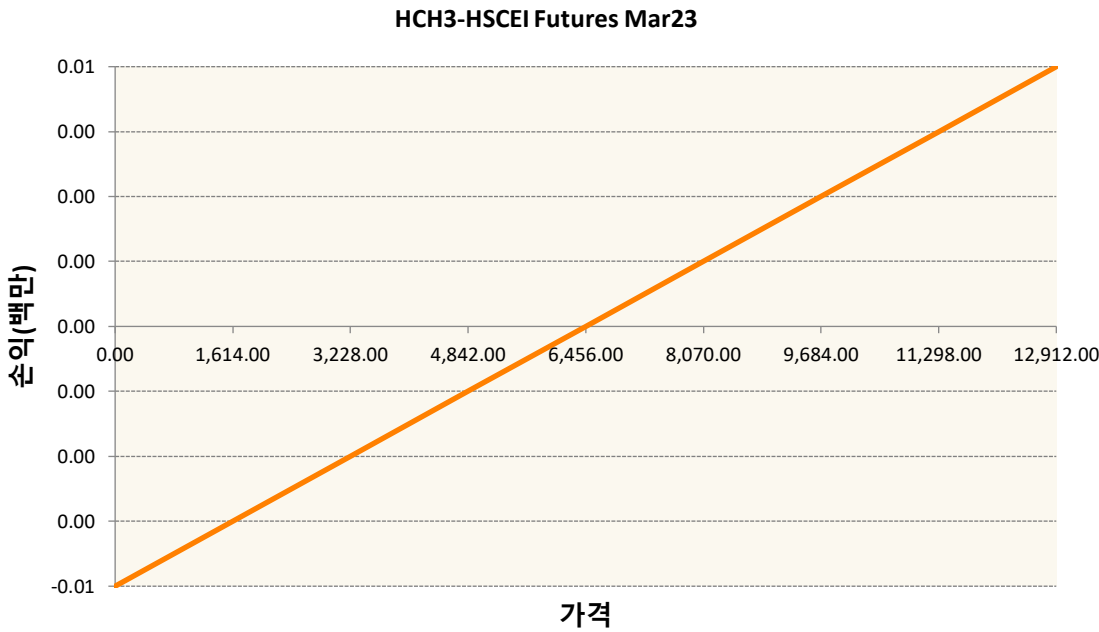
차이나인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,073	0	1,073	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCH3	HSCEI Futures Mar23	86
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

115

공시일	2023-03-14
기준일	2023-03-13

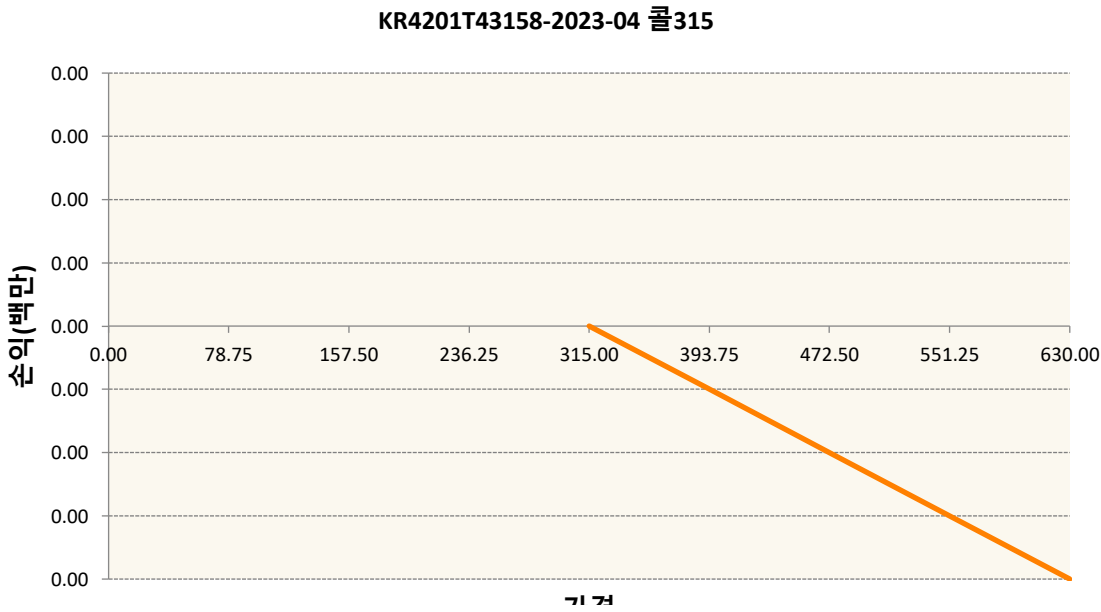
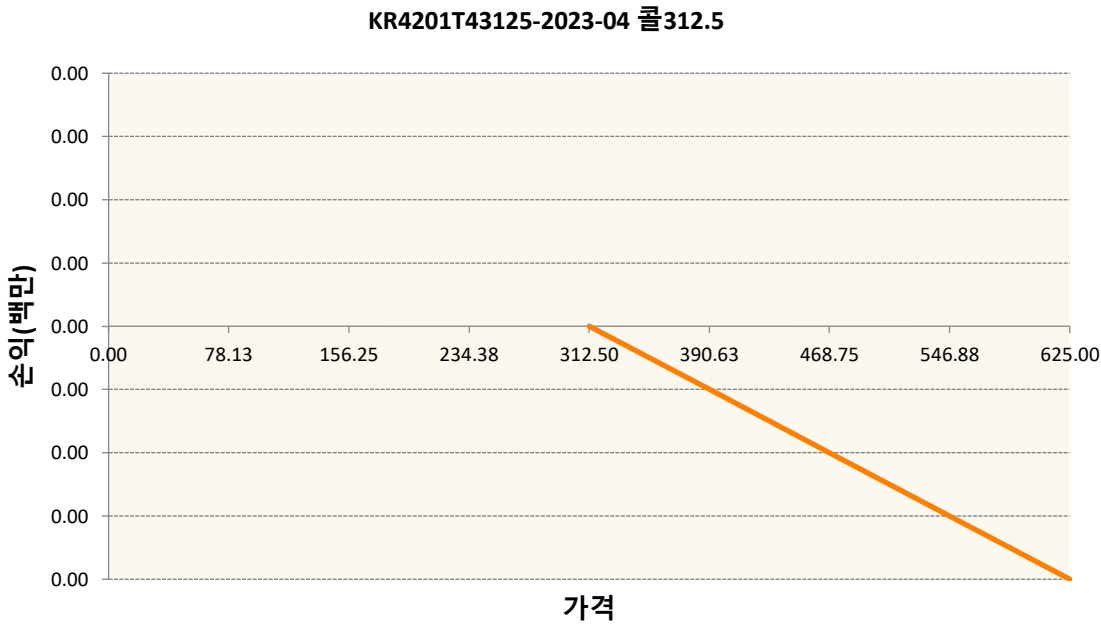
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

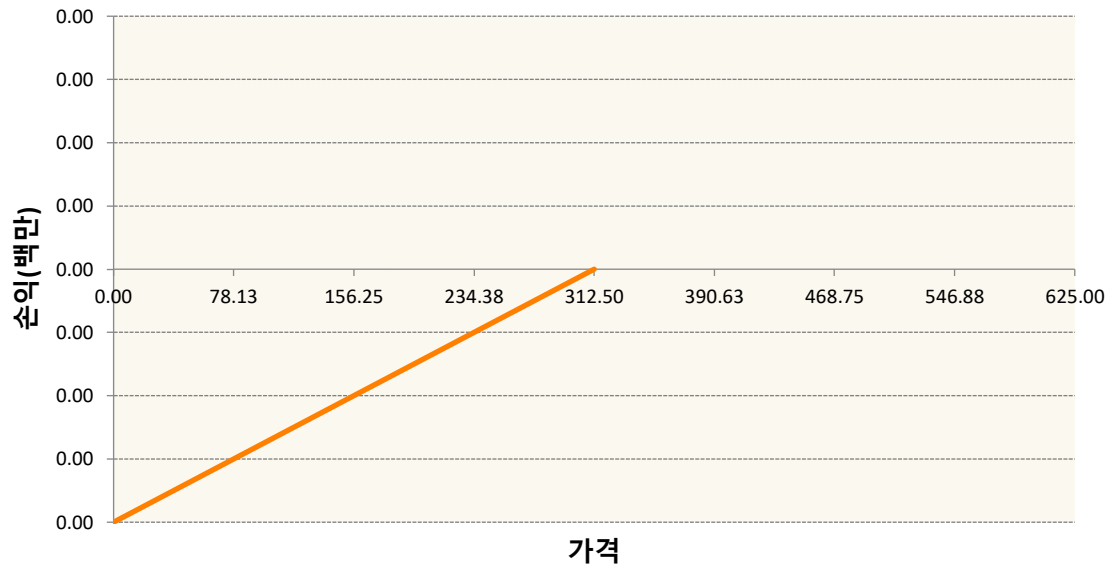
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	55,114	-55,114	장내

2. 만기시점의 손익구조



가격

KR4301T43123-2023-04 풋312.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201T43125		2023-04 콜312.5						711
		기초자산의 변동성						
가격		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%		347	335	321	306	289	270	251
-5.33%		305	285	264	242	218	195	170
-2.67%		223	196	169	141	114	86	58
0%		88	58	29	0	-29	-58	-88
2.67%		-102	-129	-155	-183	-210	-238	-266
5.33%		-339	-358	-380	-403	-426	-451	-476
8.00%		-608	-620	-635	-652	-671	-690	-711
KR4201T43158		2023-04 콜315						2,027
		기초자산의 변동성						
가격		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%		903	875	841	801	757	709	657
-5.33%		808	757	701	641	578	513	445
-2.67%		606	532	457	380	302	223	144
0%		256	171	85	0	-85	-171	-256
2.67%		-259	-340	-422	-505	-588	-672	-756
5.33%		-922	-986	-1,054	-1,125	-1,199	-1,274	-1,350
8.00%		-1,695	-1,738	-1,787	-1,841	-1,900	-1,962	-2,027
KR4301T43123		2023-04 풋312.5						562
		기초자산의 변동성						
가격		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%		-480	-491	-502	-516	-530	-546	-562
-5.33%		-258	-275	-293	-312	-331	-352	-373

-2.67%	-69	-92	-115	-138	-162	-185	-209
0%	74	50	25	0	-25	-50	-74
2.67%	172	149	126	103	80	56	32
5.33%	229	212	194	175	155	134	113
8.00%	259	249	236	222	206	189	171

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

(단위:백만원)

3,083

공시일	2023-03-14
기준일	2023-03-13

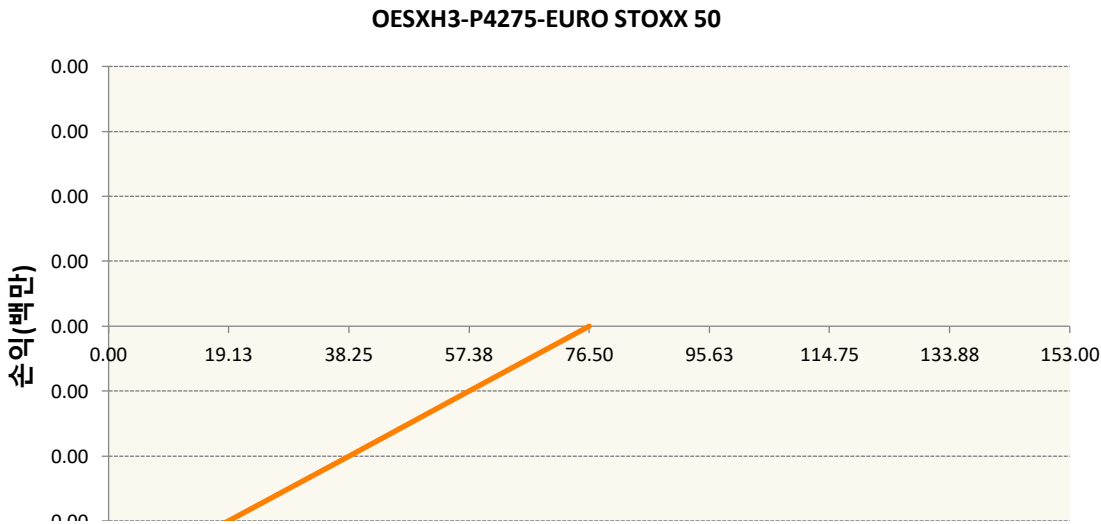
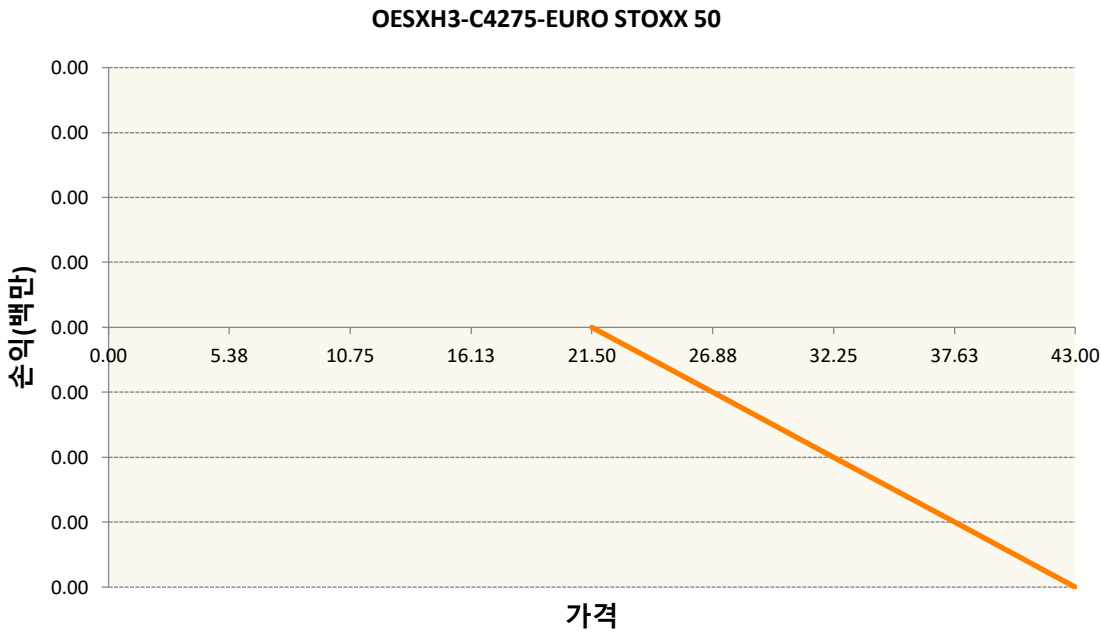
유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

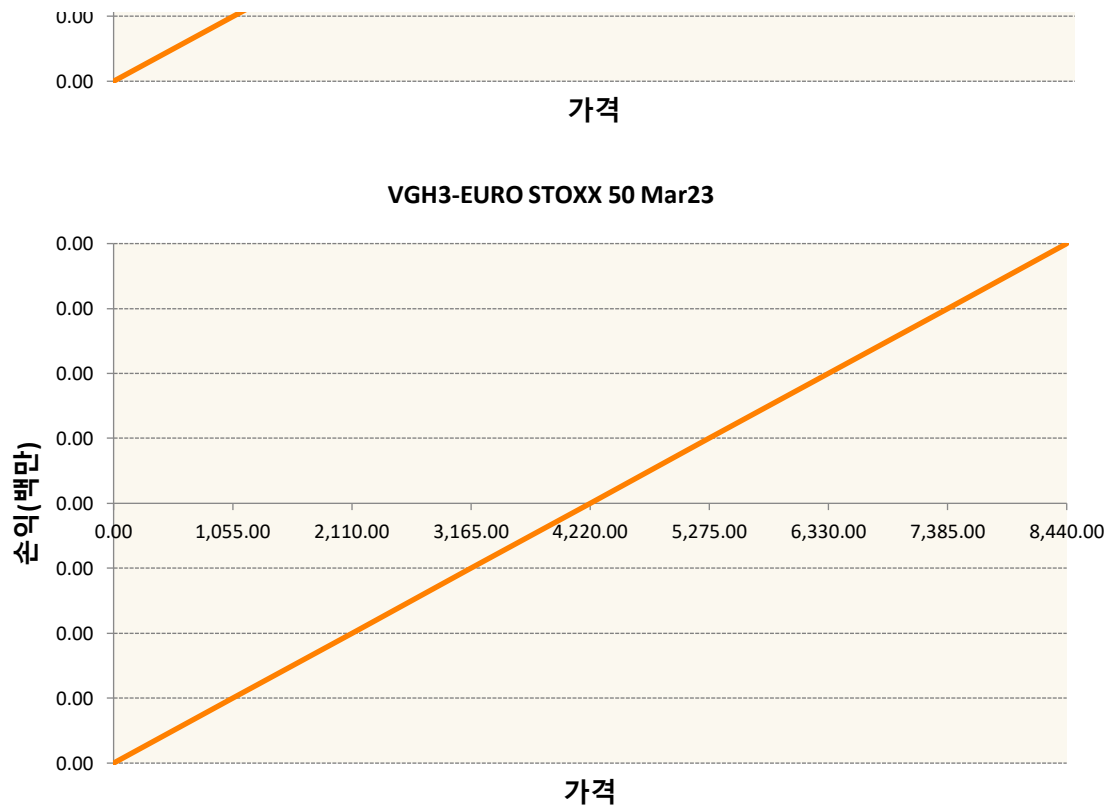
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	938	0	938	
누계	유가증권	옵션	0	39	-39	장내
누계	통화	선도	0	1,814	-1,814	장외

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
FXW213CCN KRW/EUR 24-03-23E		56
FXW213D1R KRW/EUR 28-04-23E		45
FXW213D2N KRW/EUR 26-05-23E		45
OESXH3-C42 EURO STOXX 50		1
OESXH3-P42 EURO STOXX 50		2
VGH3 EURO STOXX 50 Mar23		75

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	193

공시일	2023-03-14
기준일	2023-03-13

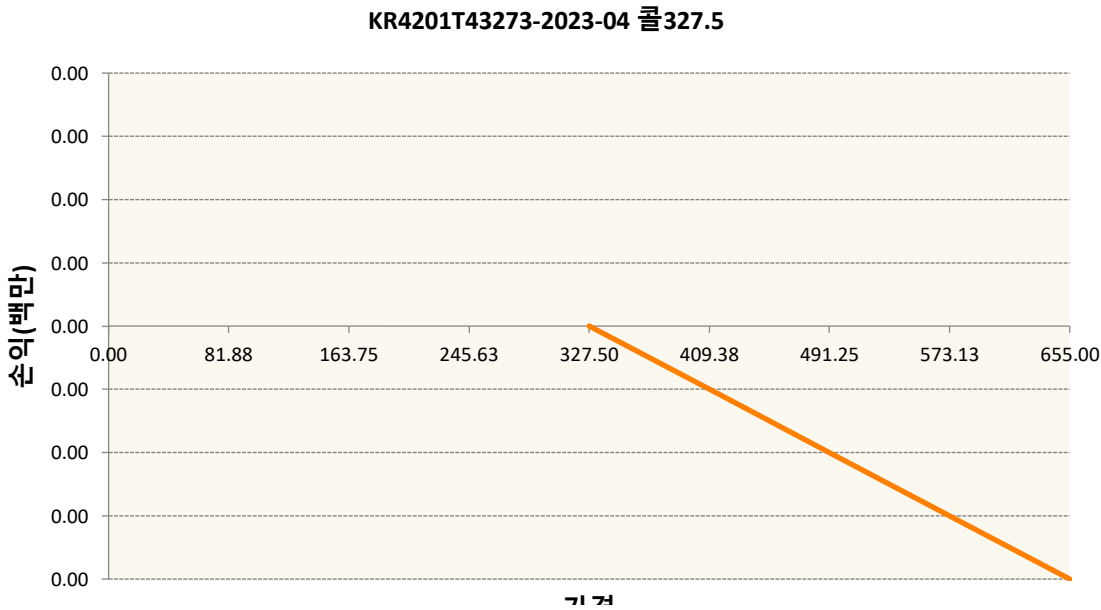
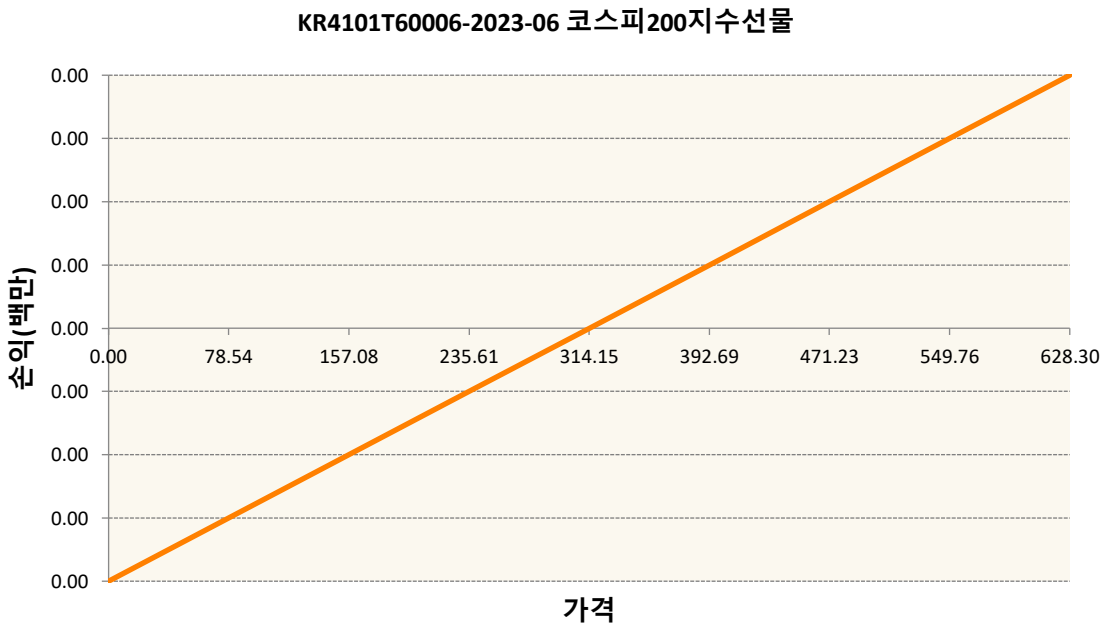
리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

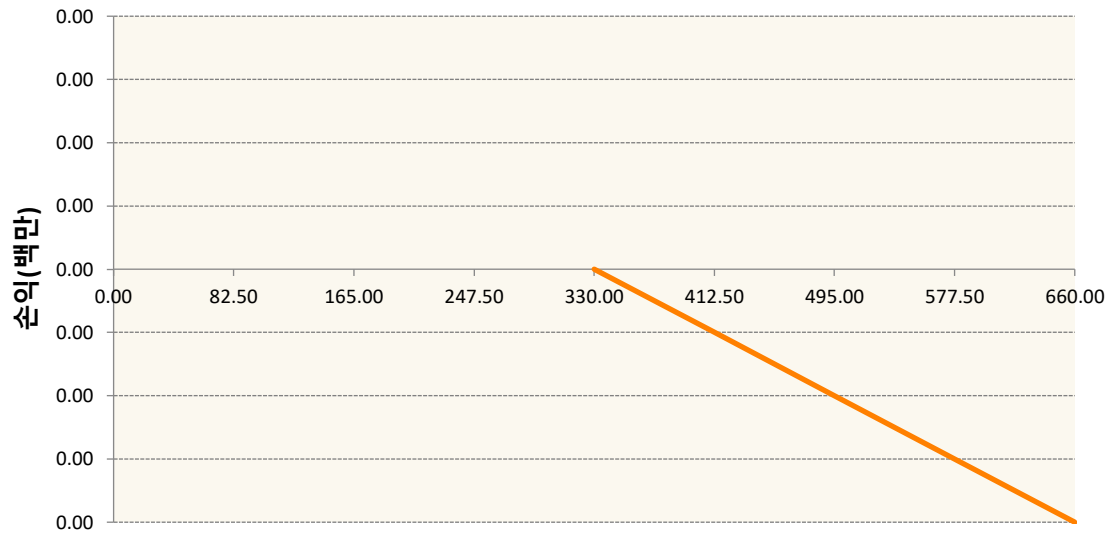
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	393	0	393	장내
누계	유가증권	옵션	157	3,874	-3,718	장내

2. 만기시점의 손익구조



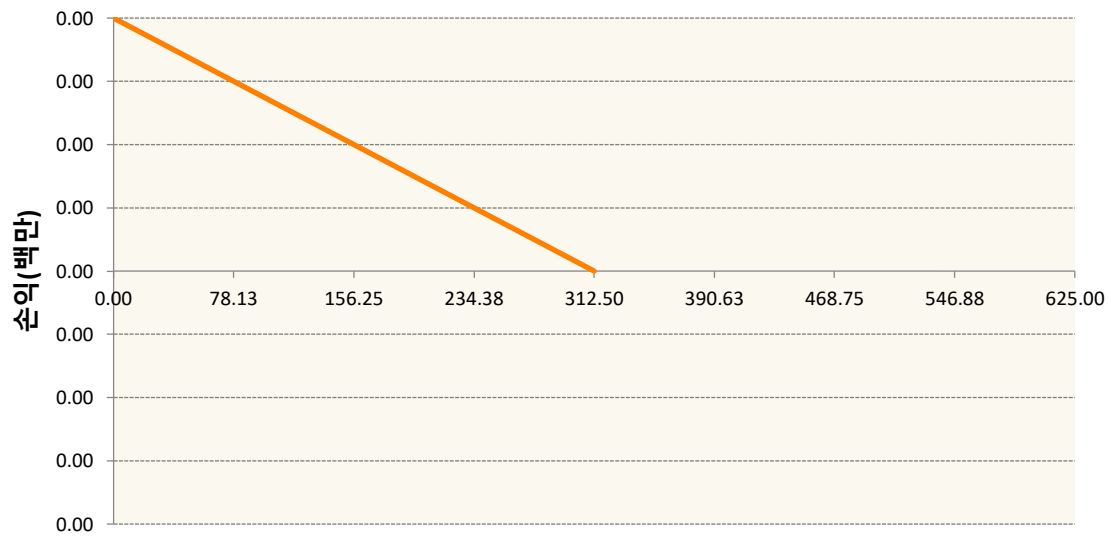
가격

KR4201T43307-2023-04 콜330



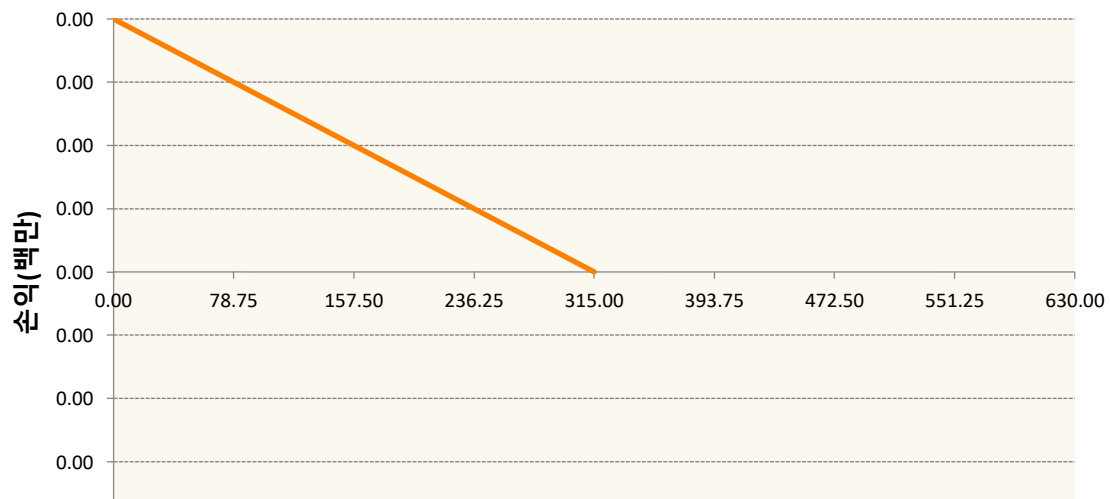
가격

KR4301T43123-2023-04 풋312.5



가격

KR4301T43156-2023-04 풋315



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101T60006		2023-06 코스피200지수선물						31
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-31	-31	-31	-31	-31	-31	-31	
-5.33%	-21	-21	-21	-21	-21	-21	-21	
-2.67%	-10	-10	-10	-10	-10	-10	-10	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	10	10	10	10	10	10	10	
5.33%	21	21	21	21	21	21	21	
8.00%	31	31	31	31	31	31	31	
KR4201T43273		2023-04 콜327.5						18
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	5	5	5	5	5	4	4	
-5.33%	5	5	5	4	4	3	3	
-2.67%	4	4	3	3	2	1	0	
0%	2	2	1	0	-1	-2	-3	
2.67%	-1	-2	-3	-4	-5	-6	-7	
5.33%	-6	-7	-8	-9	-10	-11	-12	
8.00%	-13	-14	-14	-15	-16	-17	-18	
KR4201T43307		2023-04 콜330						145
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	38	37	36	35	33	30	28	
-5.33%	36	34	32	29	26	22	18	
-2.67%	31	27	23	18	13	8	2	
0%	19	13	7	0	-7	-14	-21	
2.67%	-4	-12	-20	-28	-37	-45	-53	
5.33%	-42	-51	-59	-68	-77	-86	-94	
8.00%	-95	-103	-111	-119	-128	-136	-145	
KR4301T43123		2023-04 풋312.5						5
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	4	4	4	4	4	4	5	
-5.33%	2	2	2	3	3	3	3	
-2.67%	1	1	1	1	1	1	2	
0%	-1	0	0	0	0	0	1	
2.67%	-1	-1	-1	-1	-1	0	0	
5.33%	-2	-2	-2	-1	-1	-1	-1	

8.00%	-2	-2	-2	-2	-2	-2	-1
KR4301T43156 2023-04 풋315							5
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	4	4	4	4	5	5	5
-5.33%	2	2	3	3	3	3	3
-2.67%	1	1	1	1	1	2	2
0%	-1	0	0	0	0	0	1
2.67%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	0
5.33%	-2	-2	-2	-2	-1	-1	-1
8.00%	-2	-2	-2	-2	-2	-2	-2

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	170

공시일	2023-03-14
기준일	2023-03-13

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	6,849	0	6,849	

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	2023-03-14
기준일	2023-03-13

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	5,468	0	5,468	

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	2023-03-14
기준일	2023-03-13

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	19,407	0	19,407	
누계	통화	선도	0	19,560	-19,560	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213CCS KRW/USD 28-03-23E	552
FXW213D1S KRW/USD 28-04-23E	311
FXW213D2C KRW/USD 31-05-23E	702
IE00BD8RGM75	

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

889

공시일	2023-03-14
기준일	2023-03-13

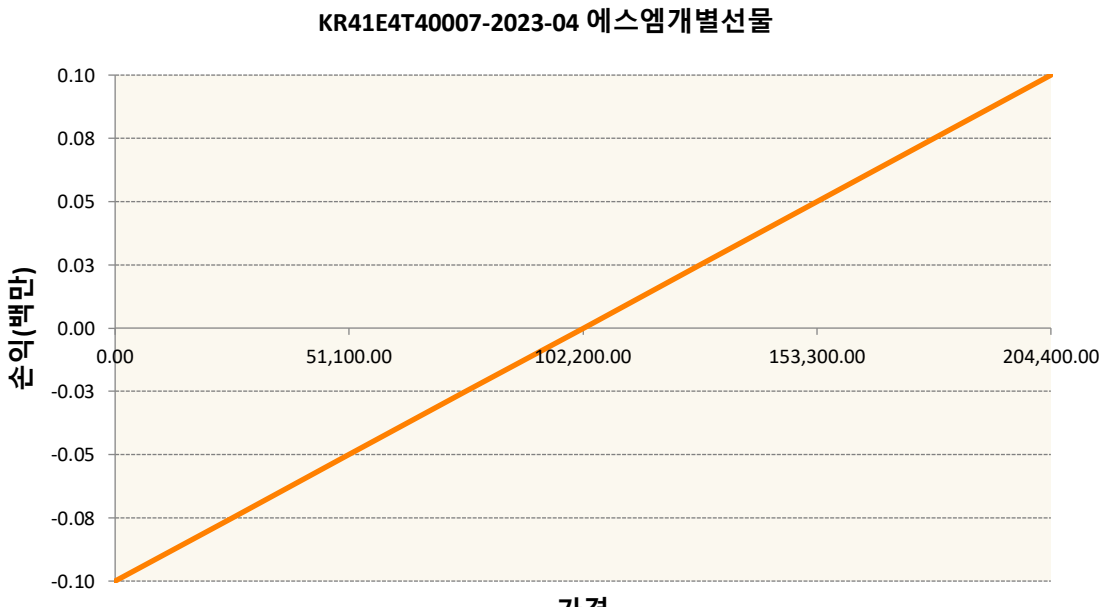
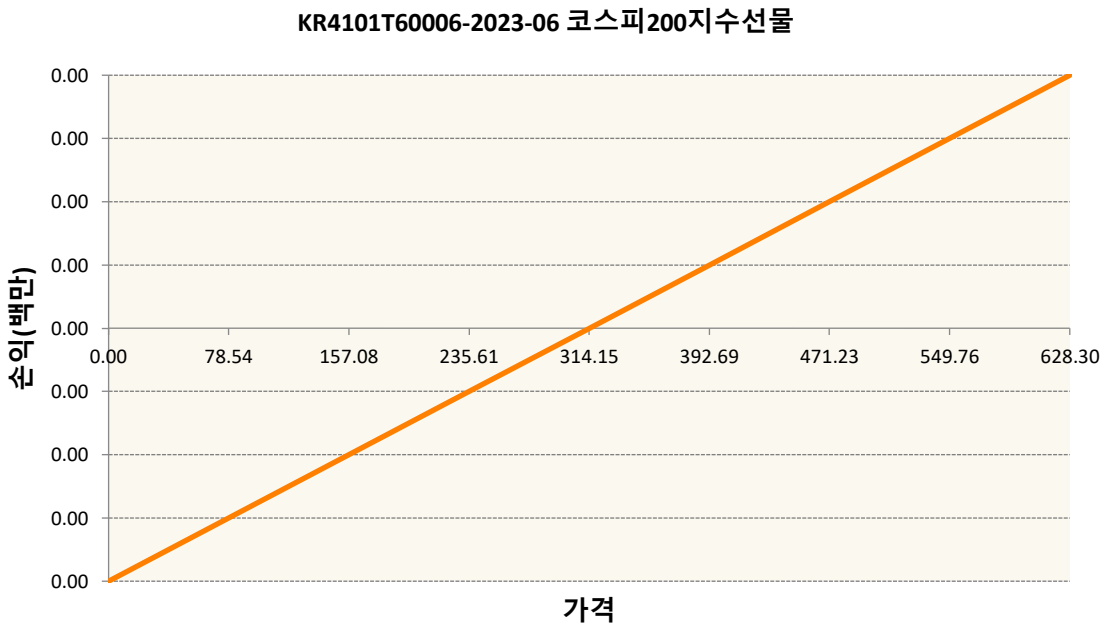
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	17	0	17	장내
누계	유가증권	선물	1,353	0	1,353	장내

2. 만기시점의 손익구조



가액

3. 시나리오 별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101T60006			2023-06 코스피200지수선물				106
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-106	-106	-106	-106	-106	-106	-106
-5.33%	-71	-71	-71	-71	-71	-71	-71
-2.67%	-35	-35	-35	-35	-35	-35	-35
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	35	35	35	35	35	35	35
5.33%	71	71	71	71	71	71	71
8.00%	106	106	106	106	106	106	106
KR41E4T40007			2023-04 에스엠개별선물				2
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-2	-2	-2	-2	-2	-2	-2
-5.33%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1
-2.67%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	1	1	1	1	1	1	1
5.33%	1	1	1	1	1	1	1
8.00%	2	2	2	2	2	2	2

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

116

공시일	2023-03-14
기준일	2023-03-13

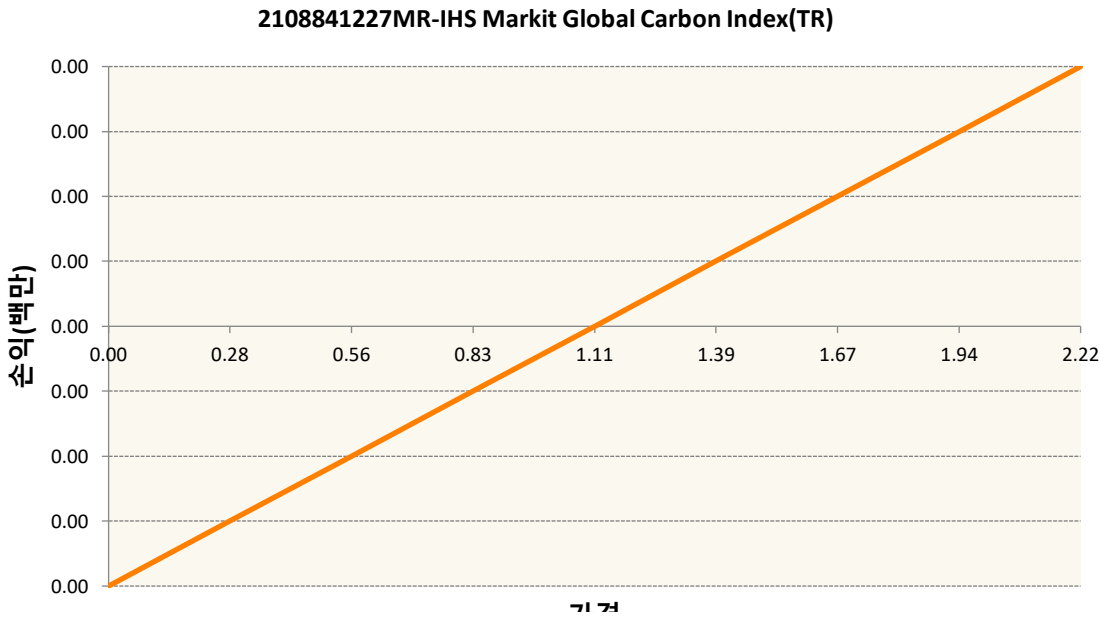
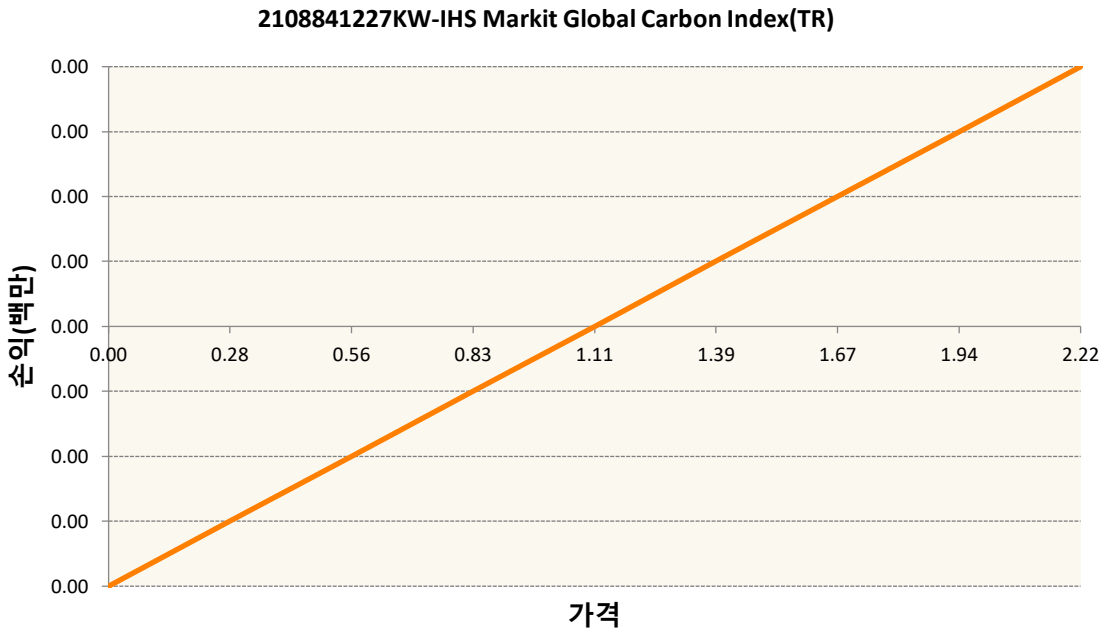
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

1. 계약금액

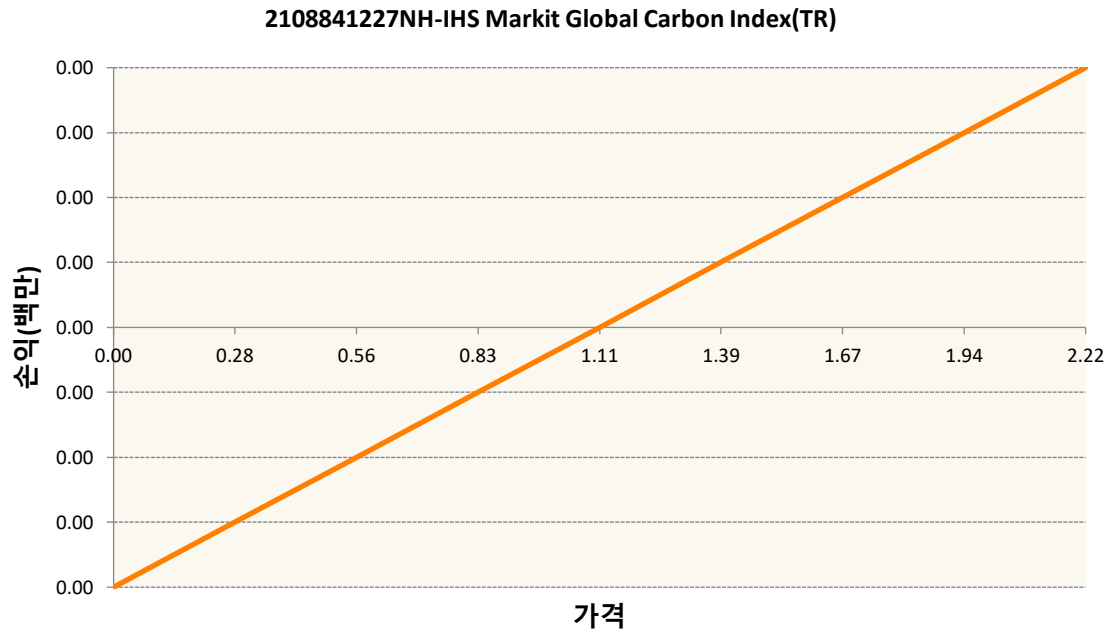
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	27,024	0	27,024	

2. 만기시점의 손익구조



가격



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2108841227 IHS Markit Global Carbon Index(TR)	1,840
2108841227 IHS Markit Global Carbon Index(TR)	216
2108841227 IHS Markit Global Carbon Index(TR)	108

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

4,158

공시일 2023-03-14

기준일 2023-03-13

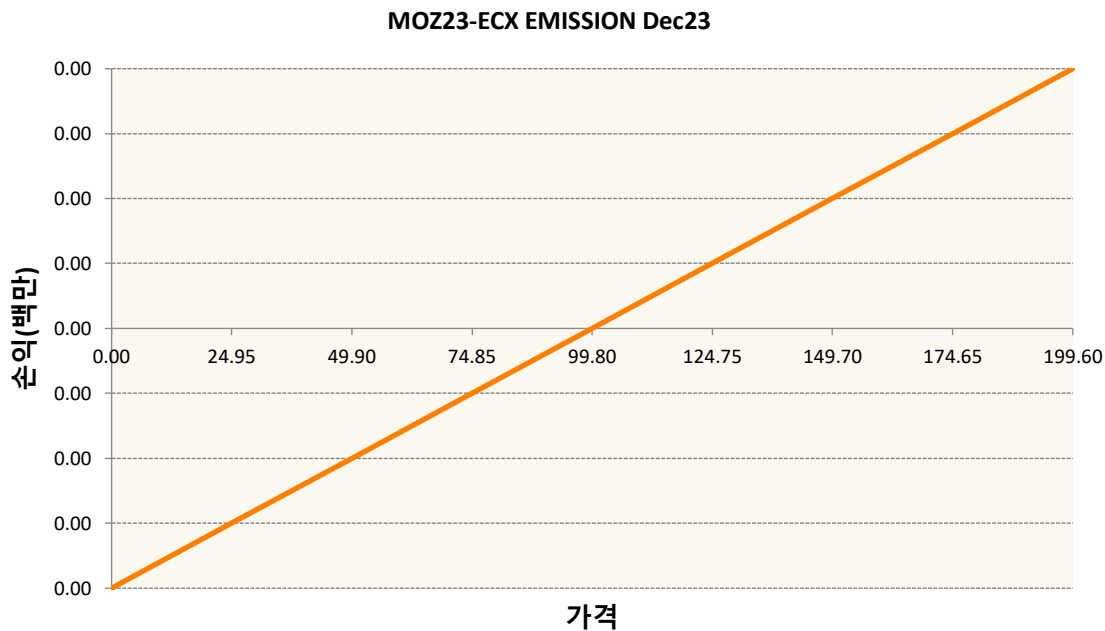
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	10,338	0	10,338	
누계	통화	선도	558	4,225	-3,667	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213D2C KRW/EUR 31-03-23E	145
FXW213D2C KRW/EUR 31-03-23E	145
FXW213D36 EUR/KRW 31-03-23E	45
FXW213D39 KRW/EUR 31-03-23E	48
MOZ23 ECX EMISSION Dec23	827

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

(단위:백만원)

2,409

공시일	2023-03-14
기준일	2023-03-13

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	9,319	0	9,319	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI0000C 신한CSI Index 221222 (NH)	10
SWCSI0000C 신한CSI Index 221222 (키움)	10
SWCSI0000C 신한CSI Index 221222 (미래)	10
SWCSI0000C 신한CSI Index 221222 (메리츠)	10

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

(단위:백만원)

71

공시일	2023-03-14
기준일	2023-03-13

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	8,619	0	8,619	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWSTAR000 신한 STAR 50 Index 230116(NH)	6
SWSTAR000 신한 STAR 50 Index 230116(메리츠)	8
SWSTAR000 신한 STAR 50 Index 230116(미래)	7
SWSTAR000 신한 STAR 50 Index 230116(키움)	6

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

(단위:백만원)

32

공시일	2023-03-14
기준일	2023-03-13

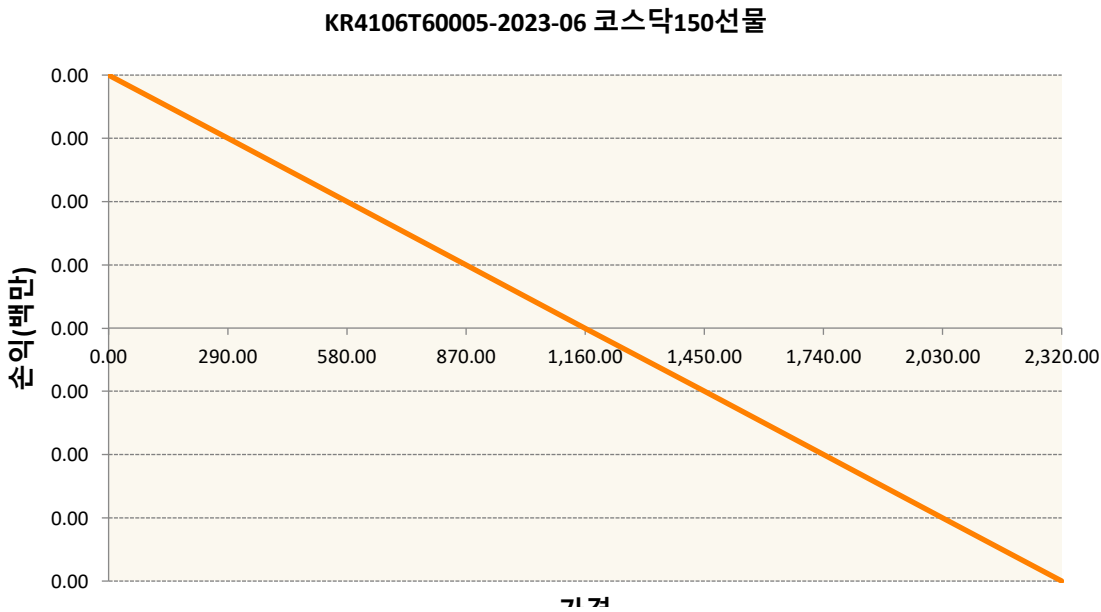
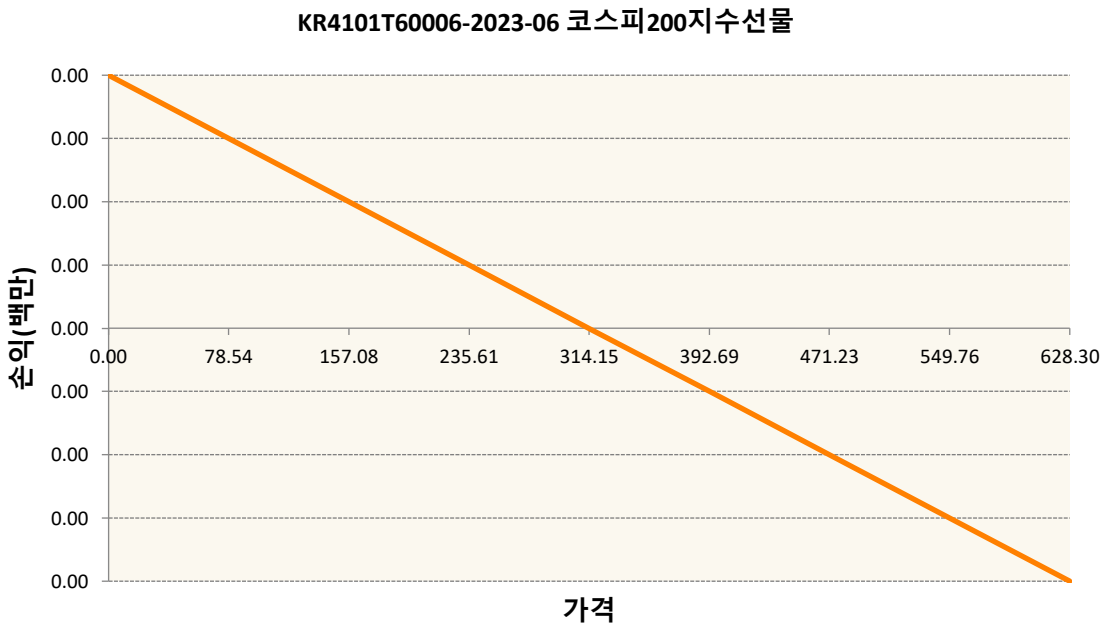
에쿼티알파일반사모혼합자산

1. 계약금액

(단위:백만원)

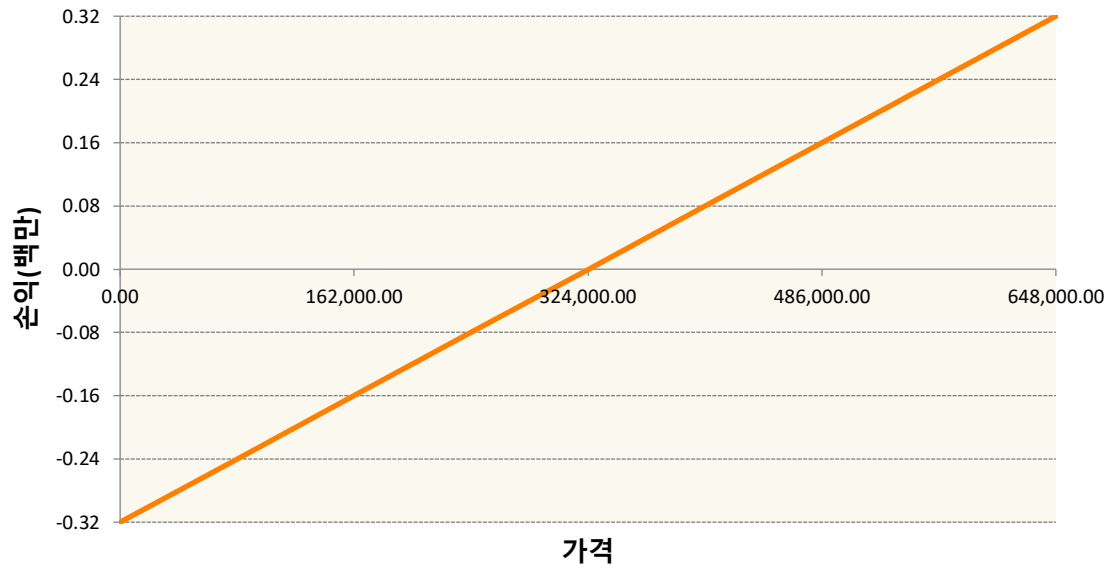
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	434	155	279	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	486	3,513	-3,027	장내
누계	유가증권	스왑	0	0	0	장외

2. 만기시점의 손익구조

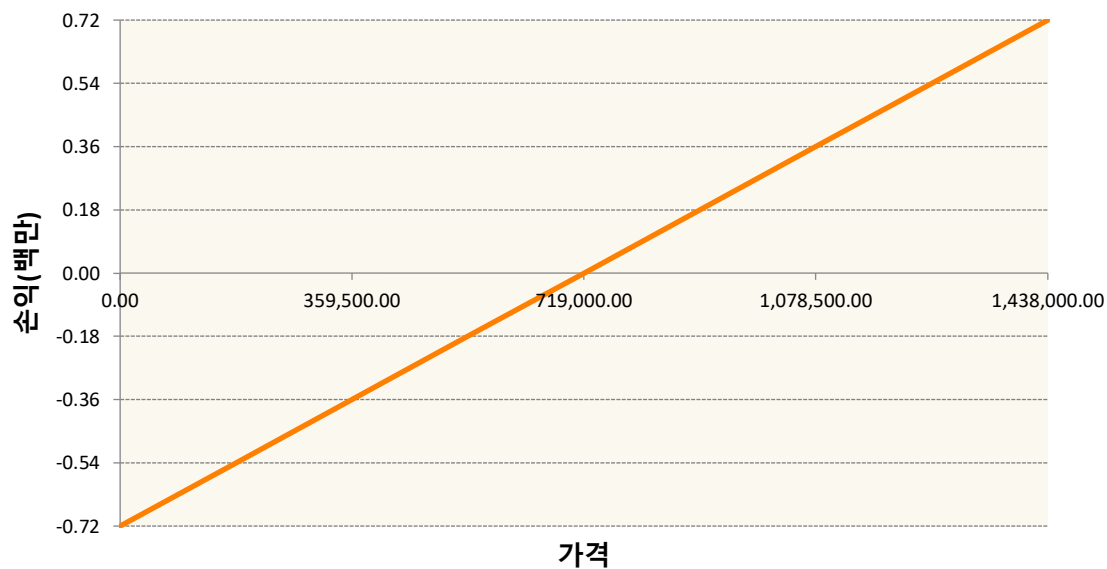


가격

KR4113T40003-2023-04 POSCO홀딩스개별선물



KR4147T40001-2023-04 LG화학개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101T600 2023-06 코스피200지수선물	170
KR4106T600 2023-06 코스닥150선물	111
KR4113T400 2023-04 POSCO홀딩스개별선물	13
KR4147T400 2023-04 LG화학개별선물	26
KRS0004054 SWAP_MICROSOFT CP_0221	0.37
KRS0004054 SWAP_FIRST TRUST ECL_0221	1
KRS0004099 SWAP_MICRON TECH_0308	0.35

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

(단위:백만원)

255

공시일	2023-03-14
기준일	2023-03-13

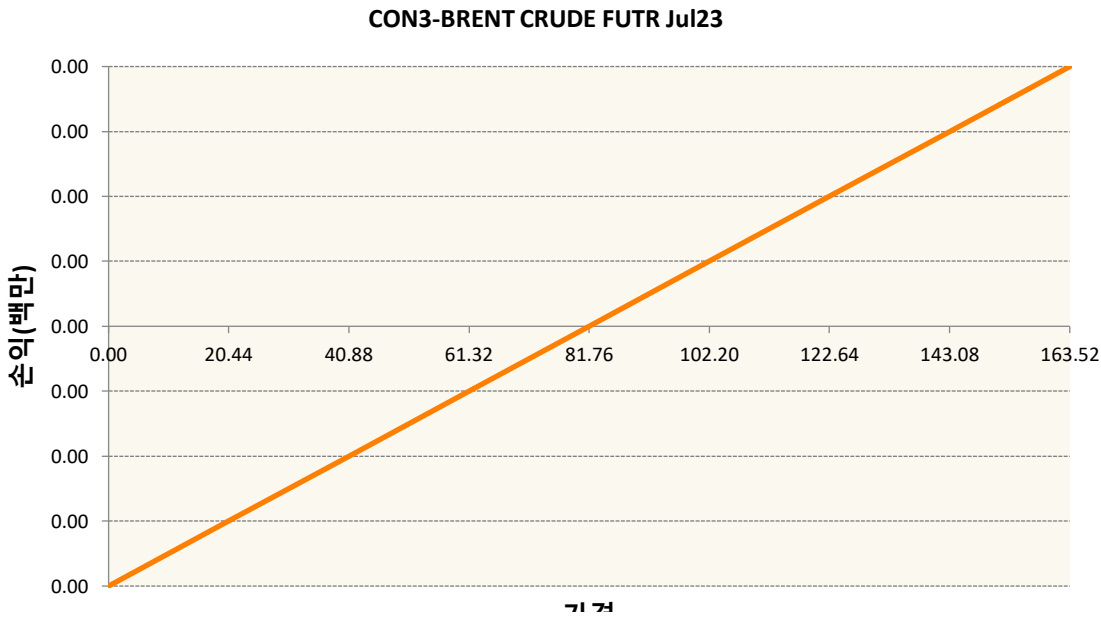
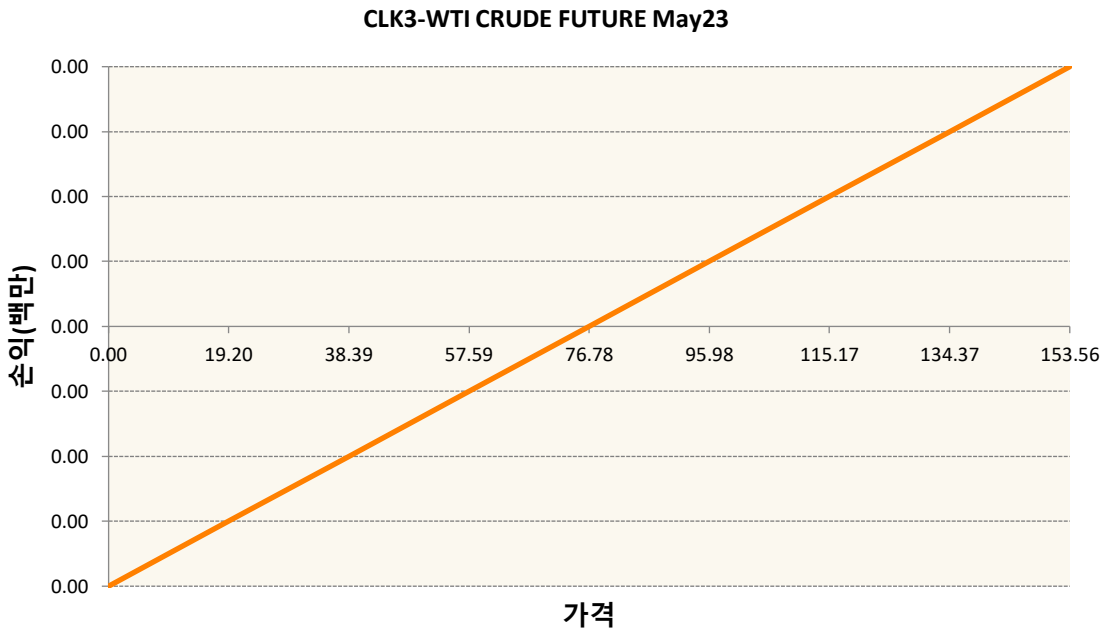
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

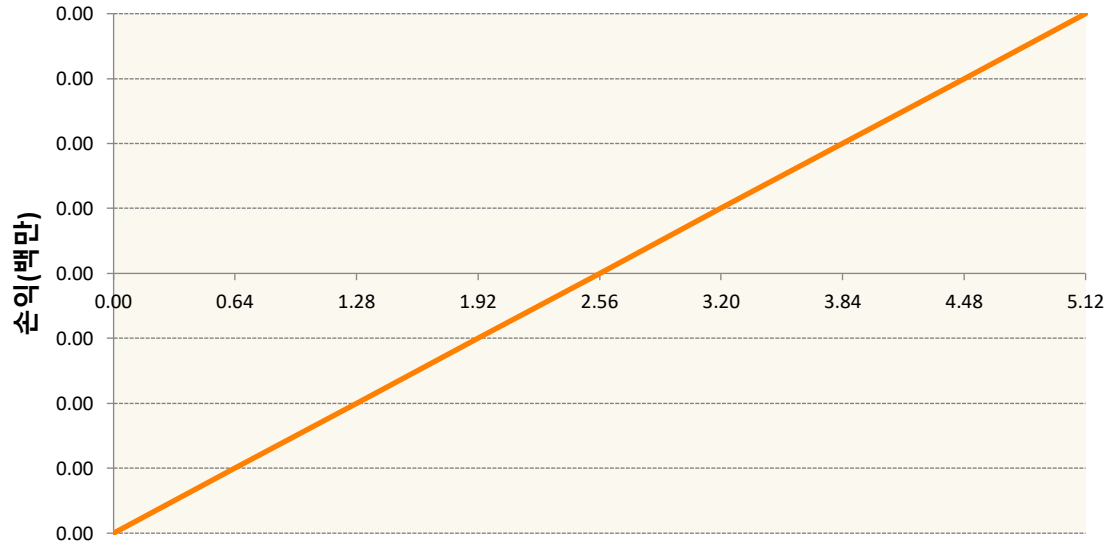
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,658	325	1,333	

2. 만기시점의 손익구조



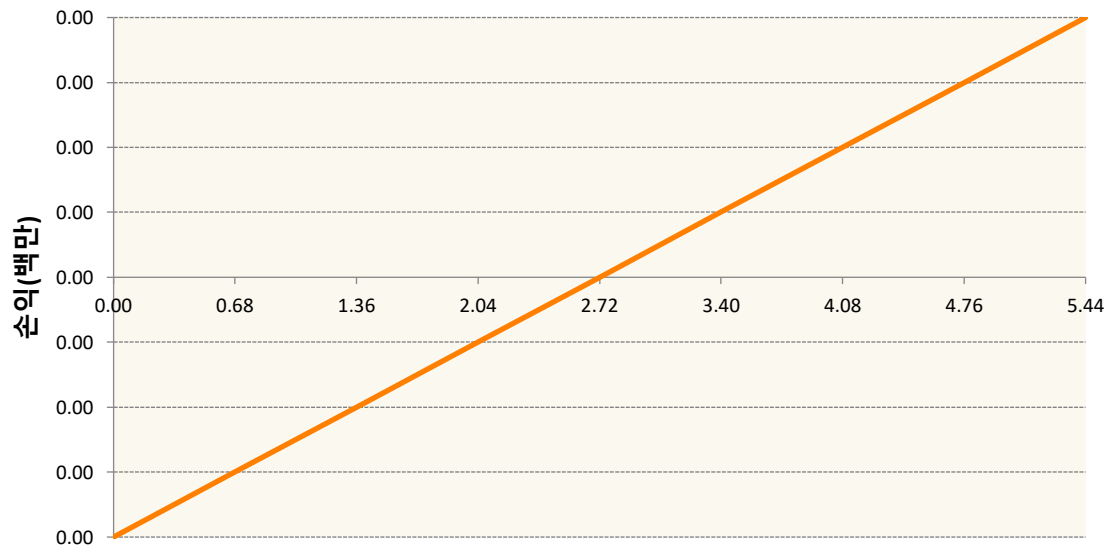
가격

EOK3-E-MINI NATURAL GAS May23



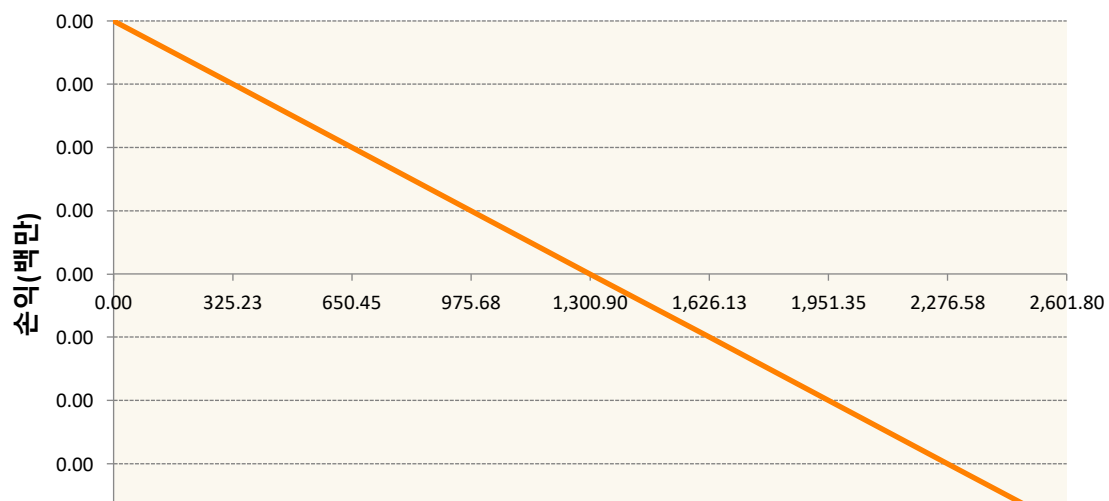
가격

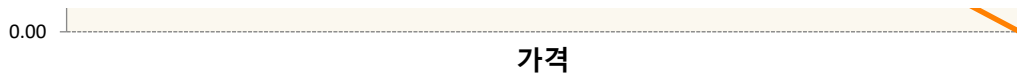
HOK3-NY Harb ULSD Fut May23



가격

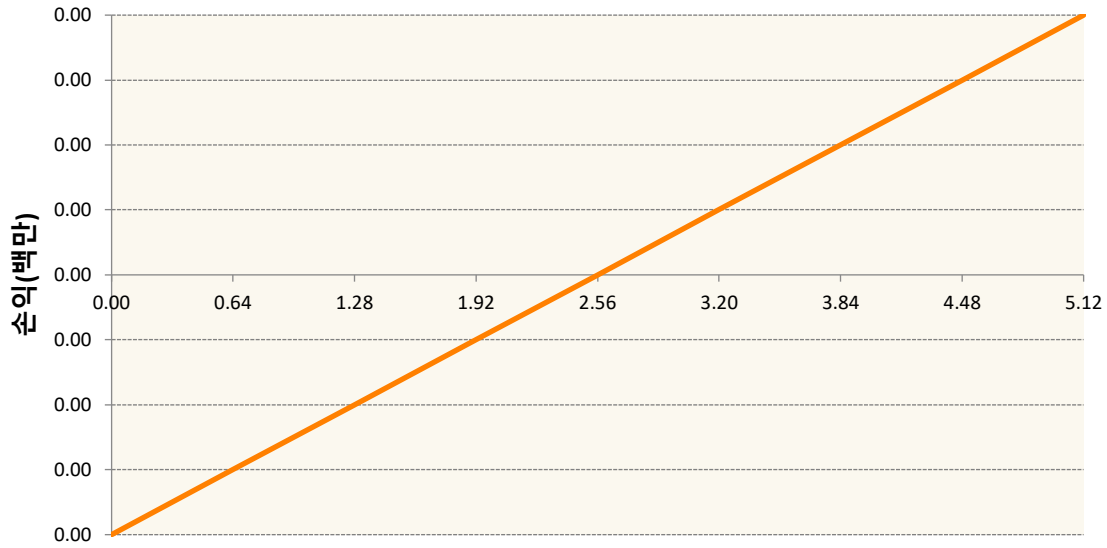
KR4175T30003-2023-03 달러선물





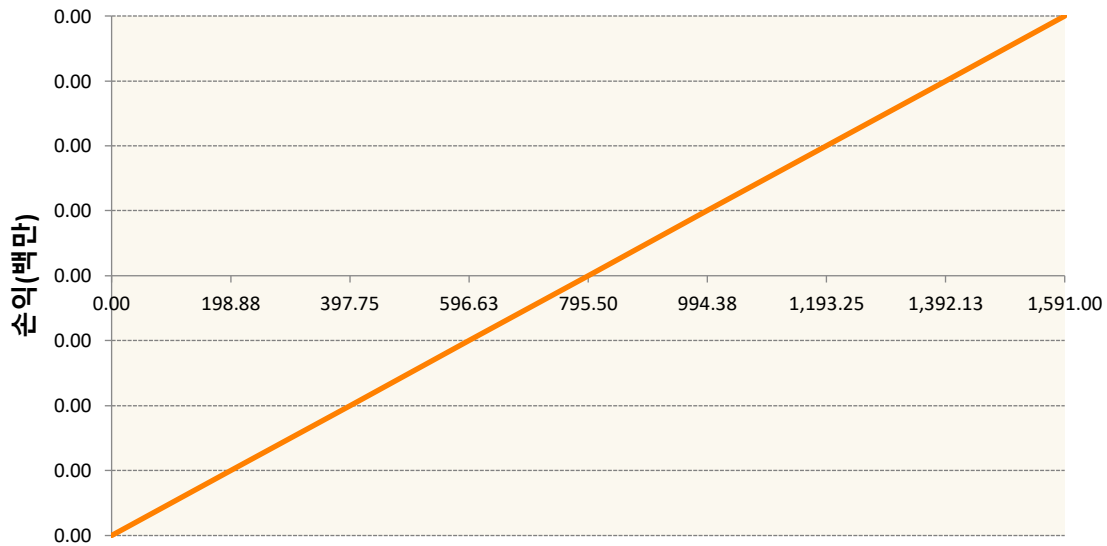
가격

NGK23-NATURAL GAS FUTR May23



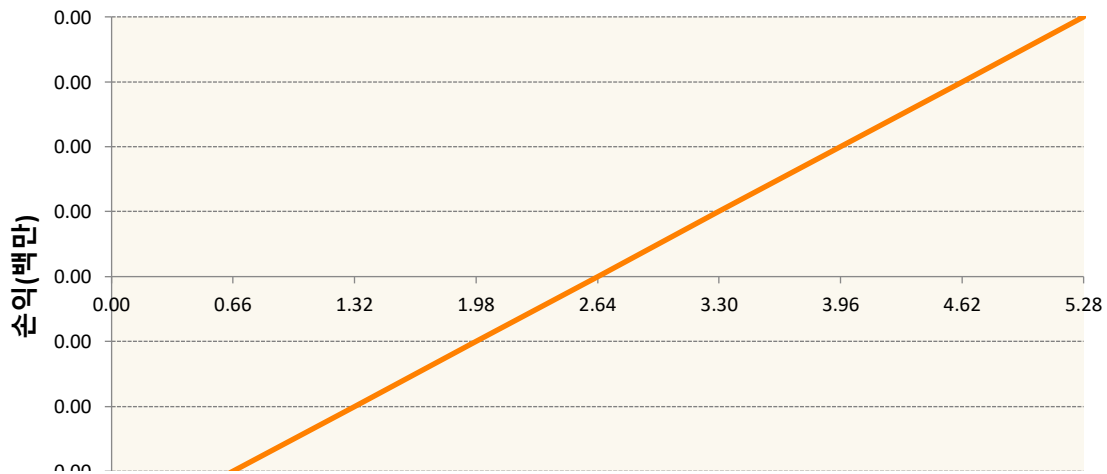
가격

QSK3-Low Su Gasoil G May23

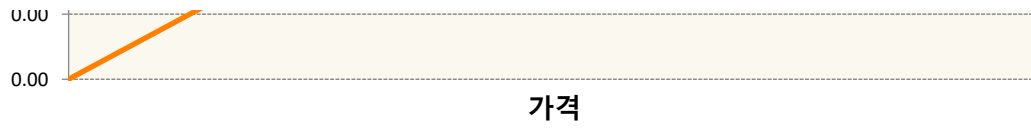


가격

XBK3-GASOLINE RBOB FUT May23



손익(백만)



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLK3	WTI CRUDE FUTURE May23	31
CON3	BRENT CRUDE FUTR Jul23	35
EOK3	E-MINI NATURAL GAS May23	1
HOK3	NY Harb ULSD Fut May23	12
KR4175T300 2023-03 달러선물		26
NGK23	NATURAL GAS FUTR May23	26
QSK3	Low Su Gasoil G May23	16
XBK3	GASOLINE RBOB FUT May23	11

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

416
