

공시일	2023-03-17
기준일	2023-03-16

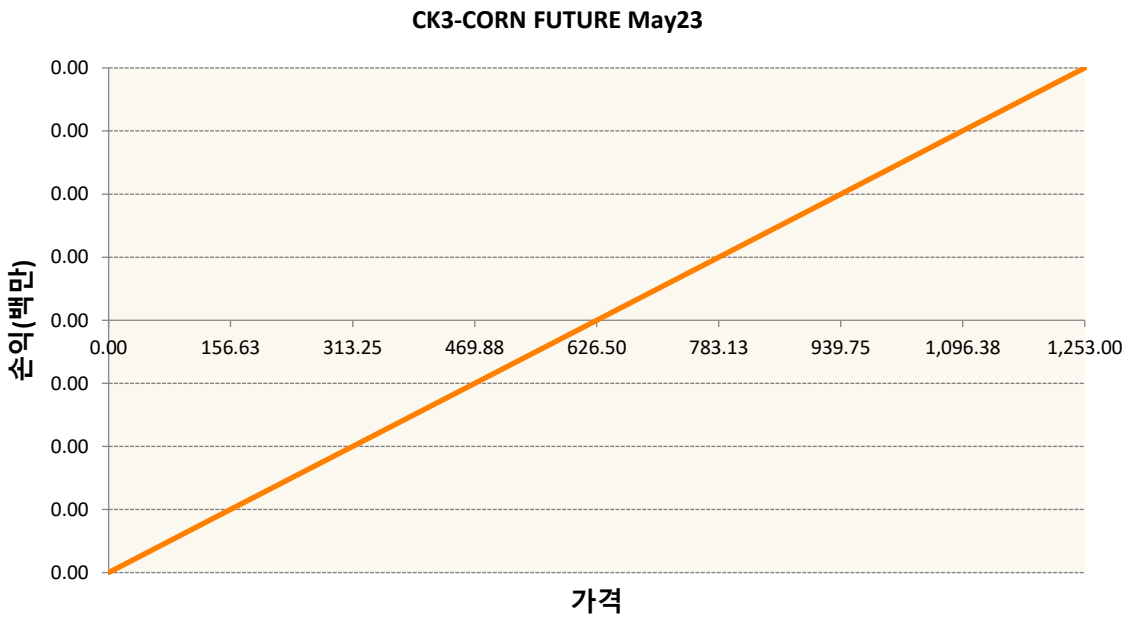
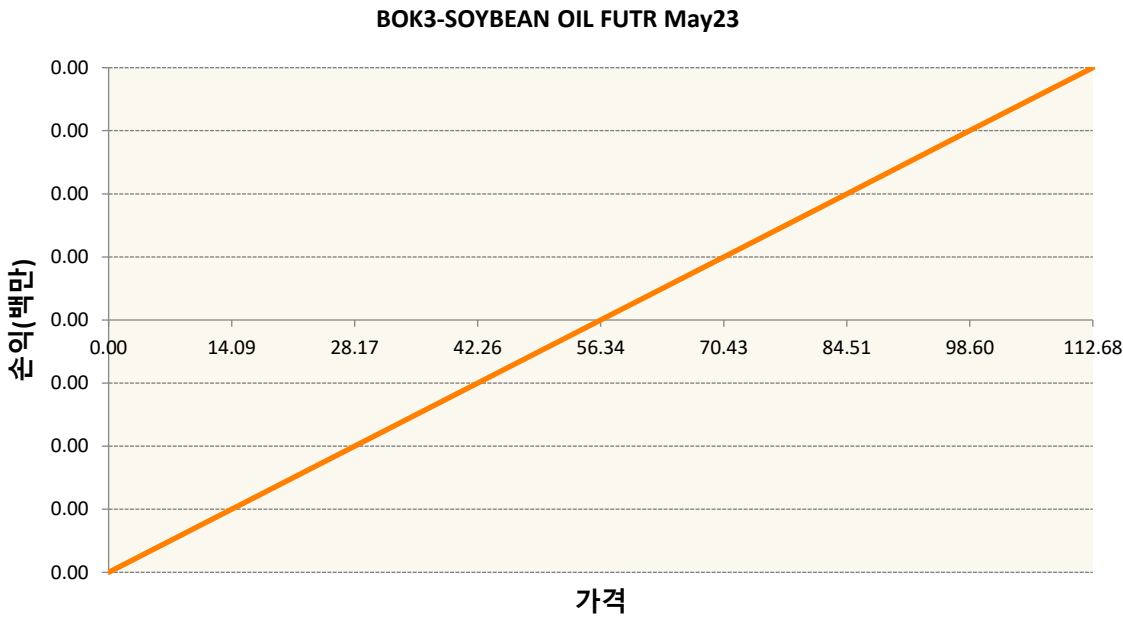
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

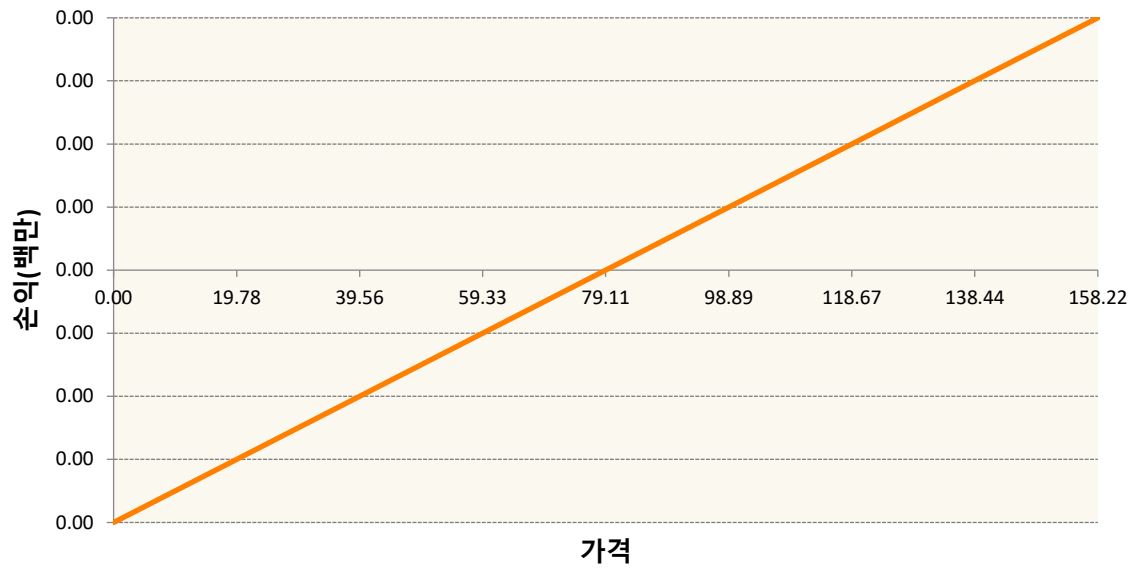
(단위:USD 백만)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,547	525	5,022	

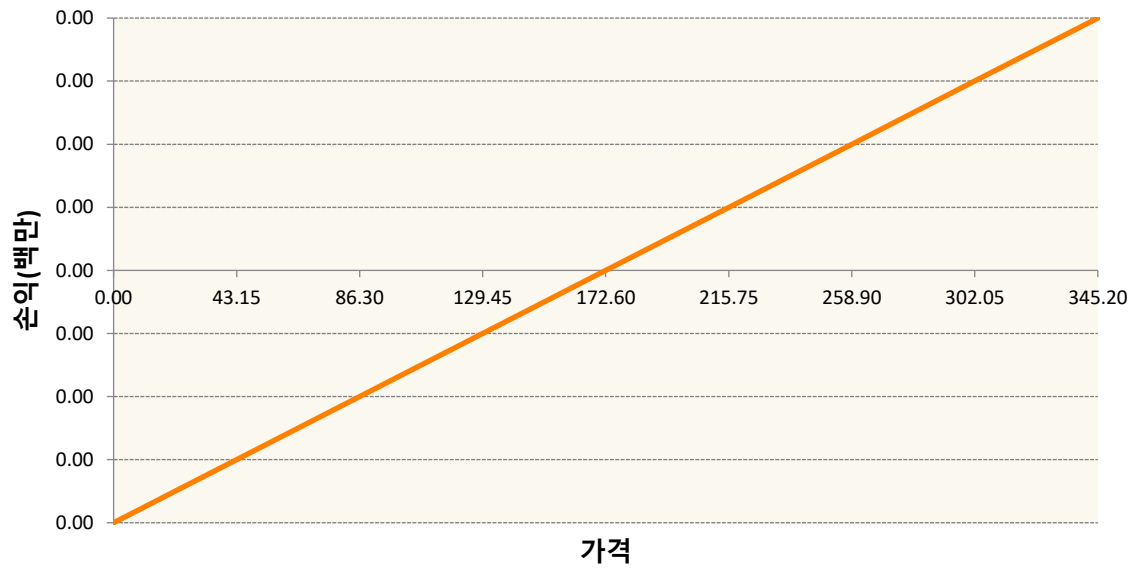
2. 만기시점의 손익구조



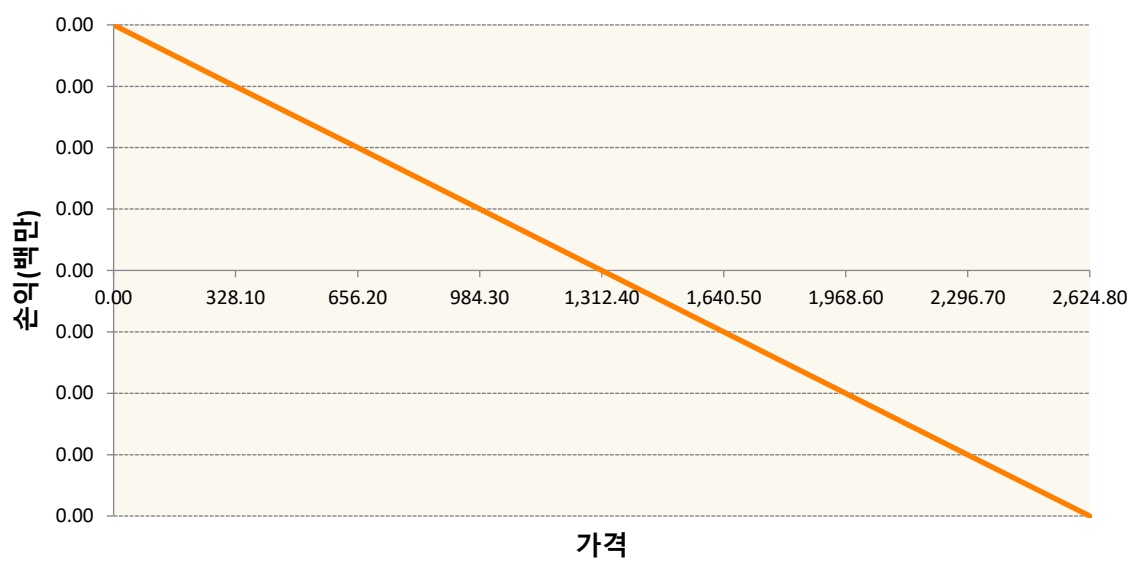
CTK3-COTTON NO.2 FUTR May23



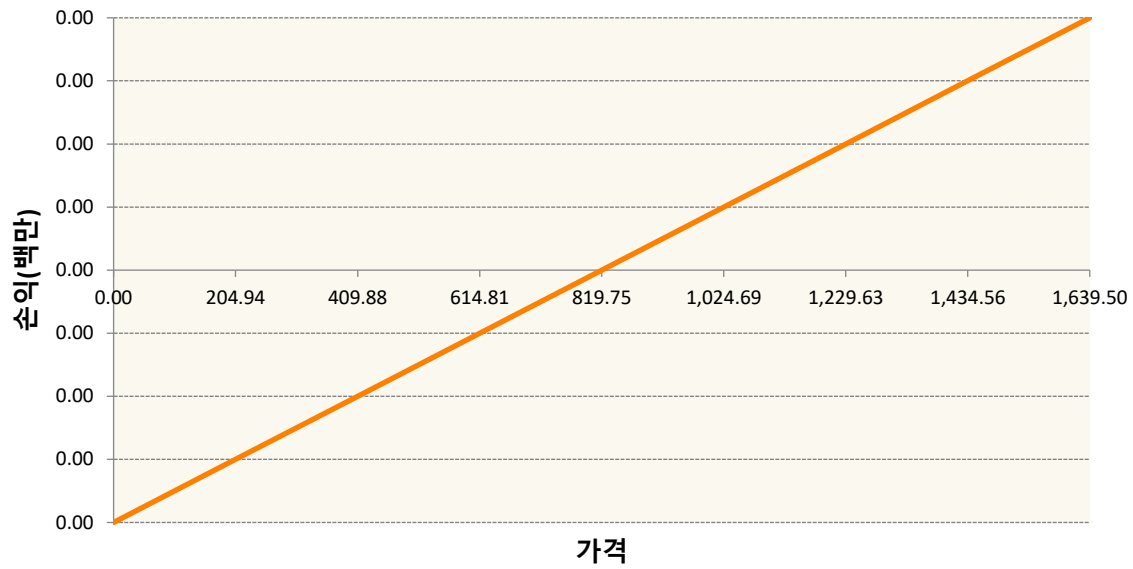
KCK3-COFFEE 'C' FUTURE May23



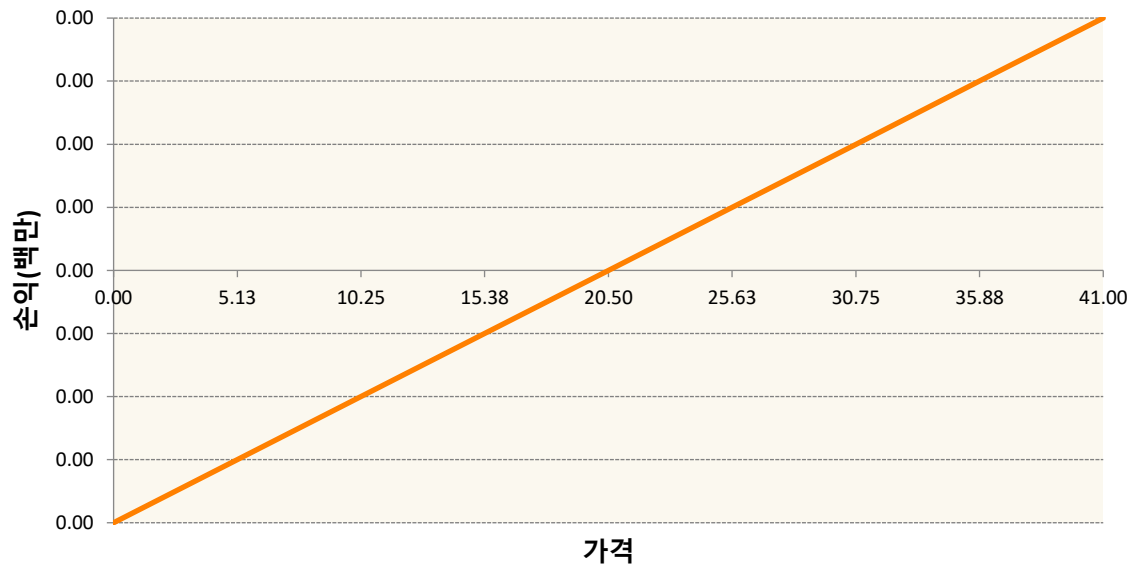
KR4175T30003-2023-03 달러선물



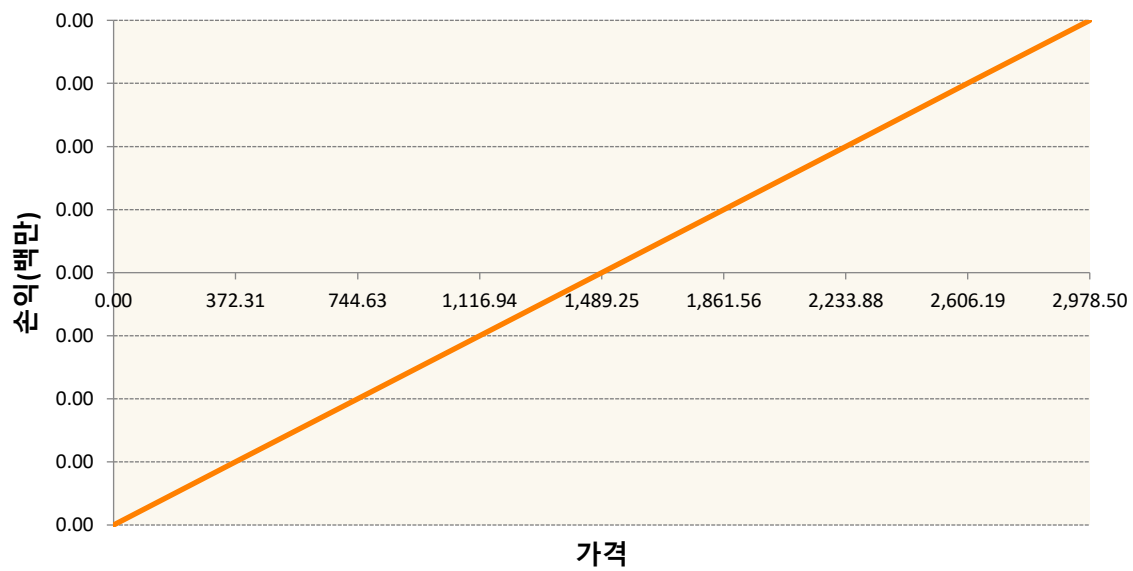
KWK3-KC HRW WHEAT FUT May23



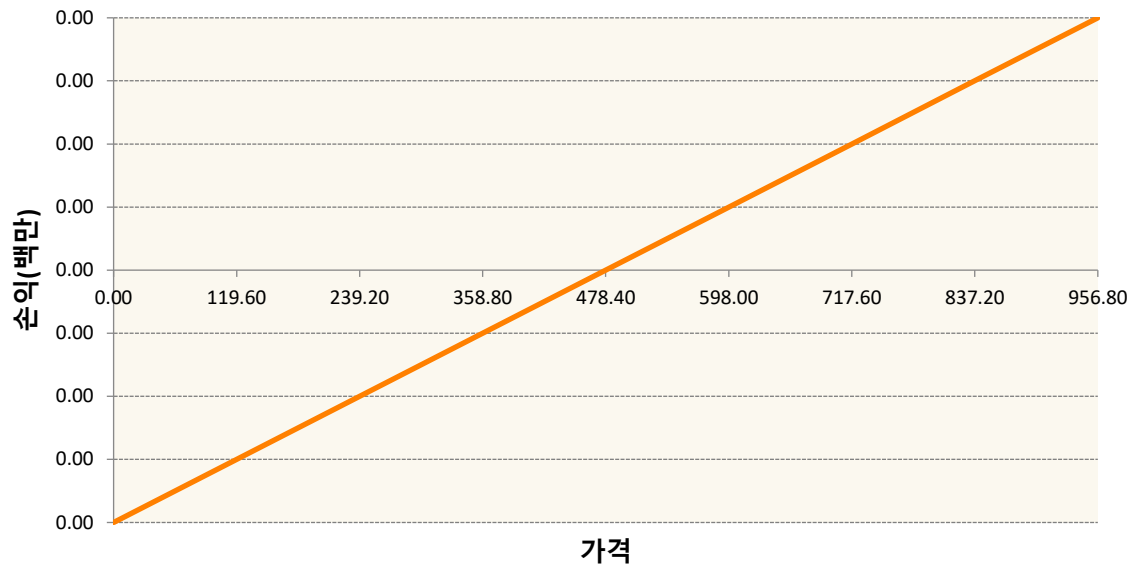
SBK3-Sugar #11 (WORLD) May23



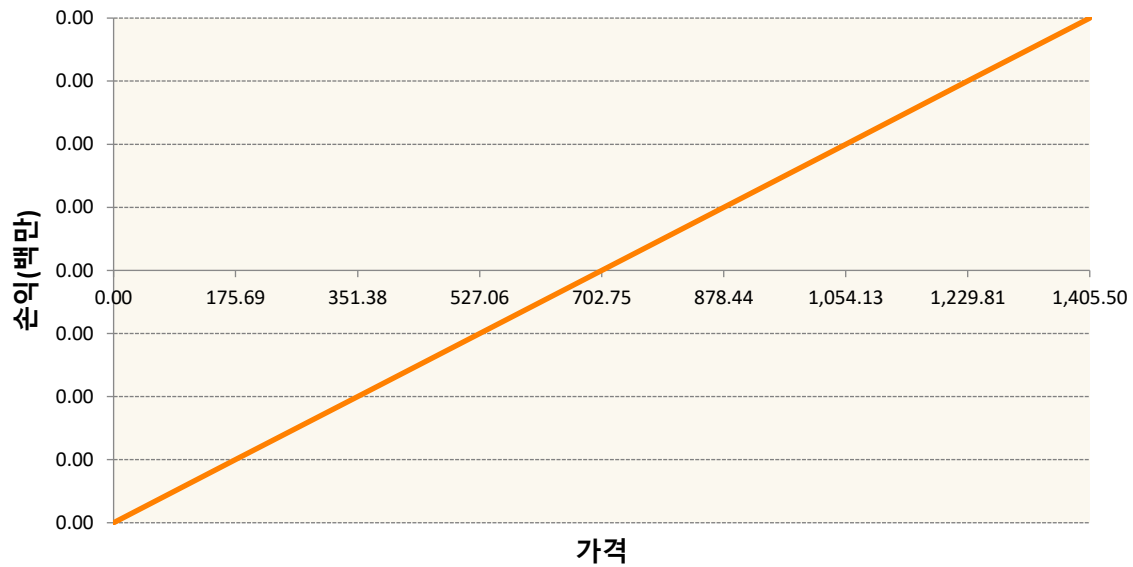
SK3-SOYBEAN FUTURE May23



SMK3-SOYBEAN MEAL FUTR May23



WK3-WHEAT FUTURE(CBT) May23



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

공시일	2023-03-17
기준일	2023-03-16

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	4,470	0	4,470	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 신한CSI500미래230314	363
-----------------------------	-----

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

471

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2023-03-17
기준일	2023-03-16

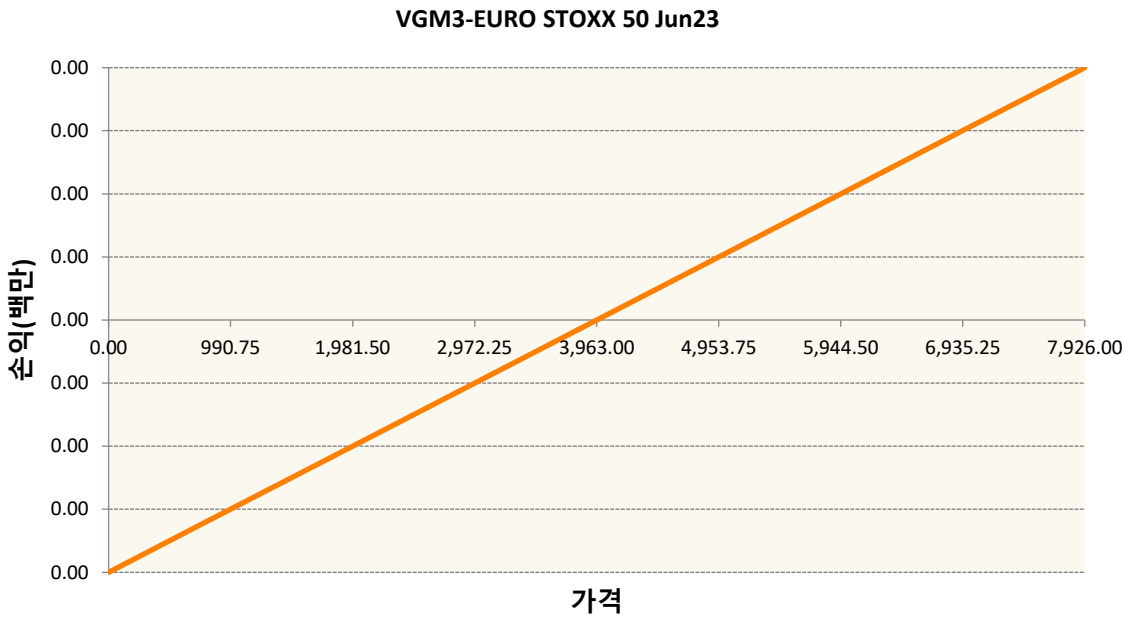
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	442	0	442	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM3	EURO STOXX 50 Jun23	35
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

38

공시일	2023-03-17
기준일	2023-03-16

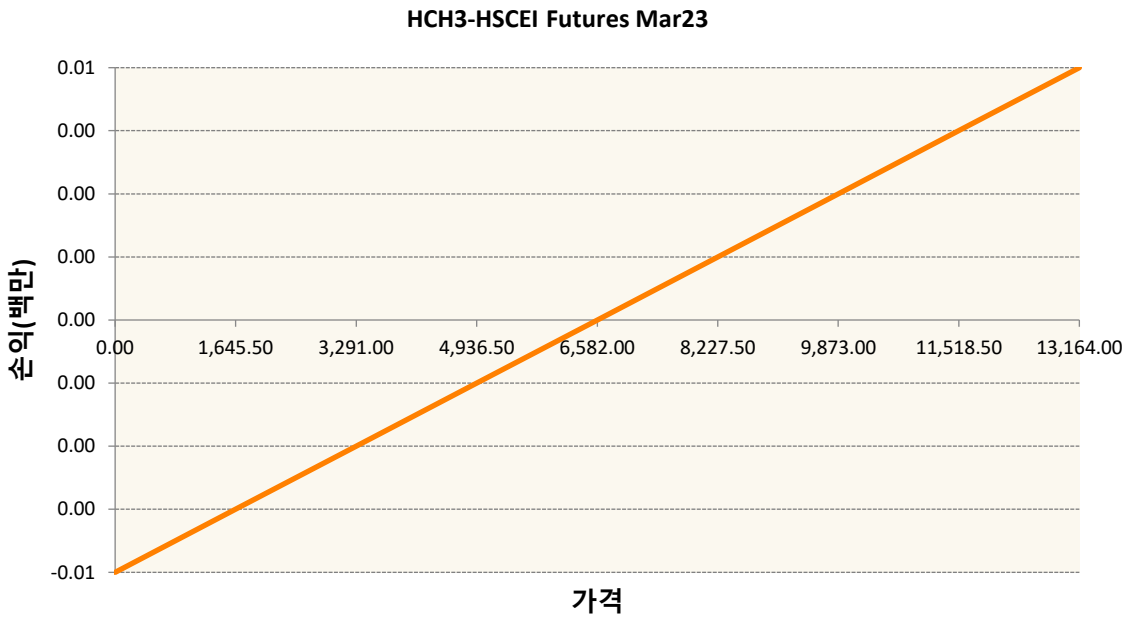
차이나인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,094	0	1,094	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCH3	HSCEI Futures Mar23	87
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

118

공시일	2023-03-17
기준일	2023-03-16

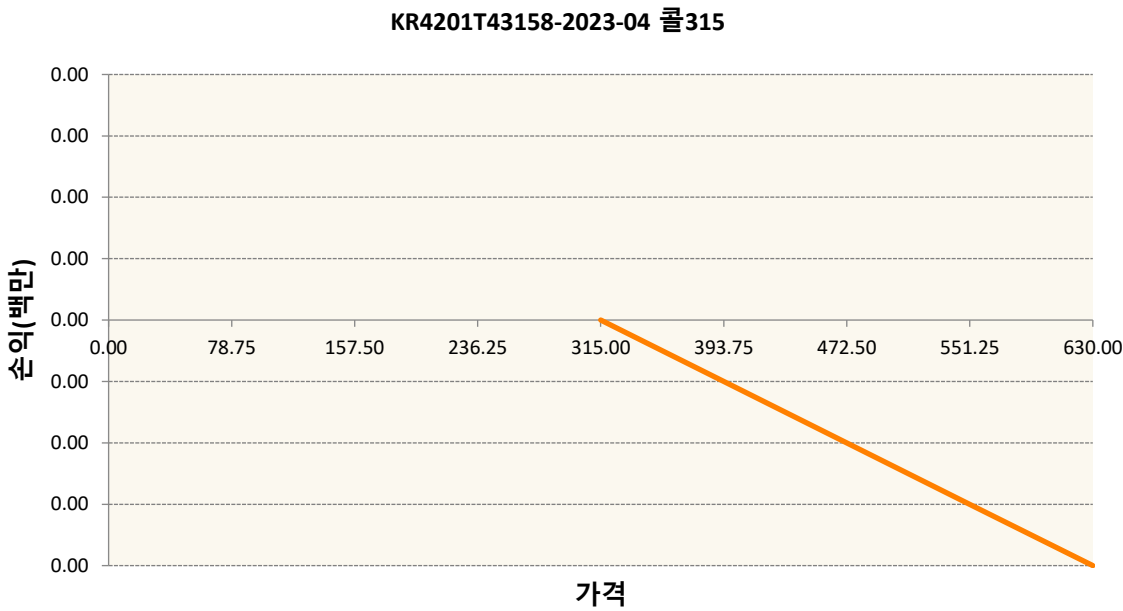
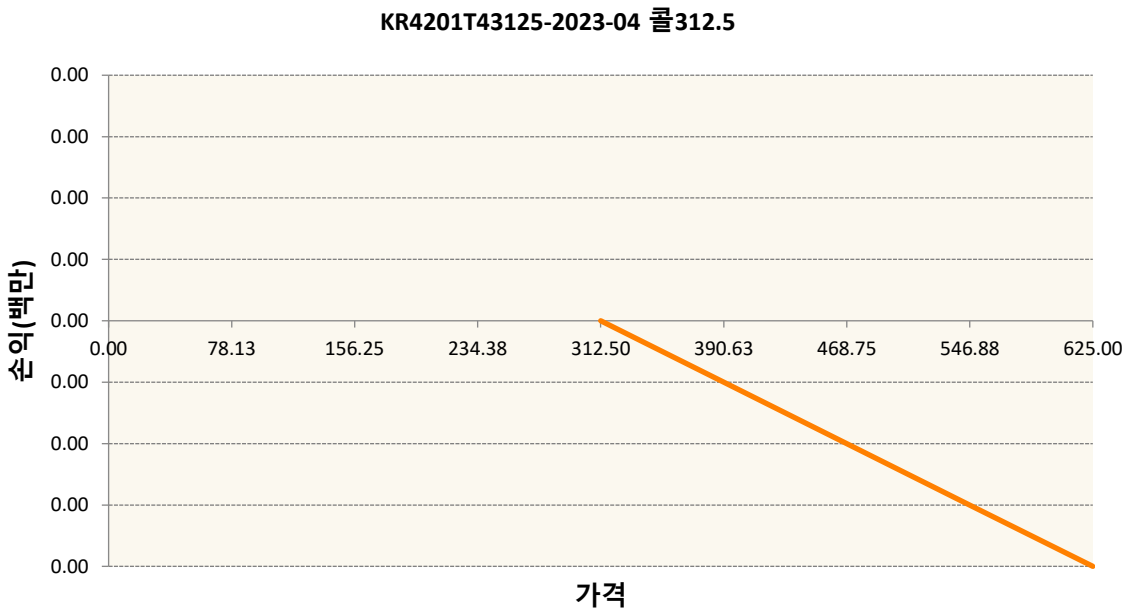
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

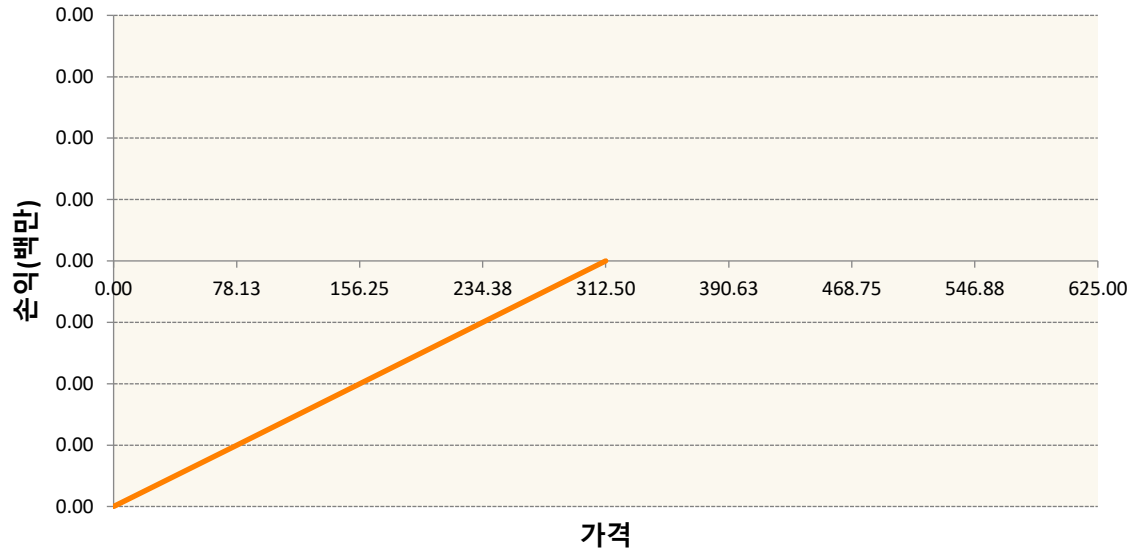
(단위:백만원)

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



KR4301T43123-2023-04 풋312.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201T43125			2023-04 콜312.5				647
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	260	253	244	233	220	207	191
-5.33%	236	222	206	189	170	151	130
-2.67%	182	160	137	114	90	65	40
0%	82	55	28	0	-28	-55	-83
2.67%	-73	-101	-128	-156	-184	-212	-240
5.33%	-281	-304	-328	-352	-377	-403	-429
8.00%	-530	-546	-564	-583	-603	-625	-647
KR4201T43158			2023-04 콜315				1,824
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	656	641	620	593	563	527	488
-5.33%	606	572	532	488	439	387	331
-2.67%	481	424	362	298	232	164	94
0%	232	156	78	0	-79	-158	-237
2.67%	-176	-258	-340	-423	-505	-587	-670
5.33%	-748	-820	-893	-969	-1,046	-1,123	-1,201
8.00%	-1,454	-1,506	-1,563	-1,624	-1,688	-1,755	-1,824
KR4301T43123			2023-04 풋312.5				601
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-543	-549	-557	-566	-576	-588	-601
-5.33%	-308	-320	-334	-349	-365	-381	-399
-2.67%	-100	-118	-138	-158	-178	-199	-221
0%	70	47	23	0	-23	-47	-70

2.67%	192	169	146	122	99	75	51
5.33%	270	251	231	210	189	167	145
8.00%	313	300	285	269	251	233	214

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

(단위:백만원)

2,818

공시일	2023-03-17
기준일	2023-03-16

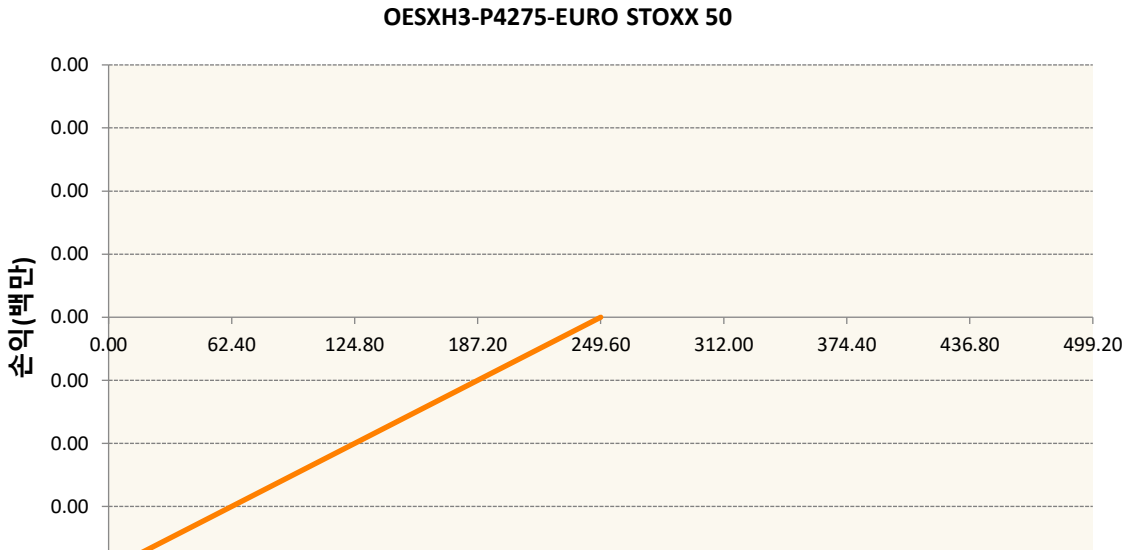
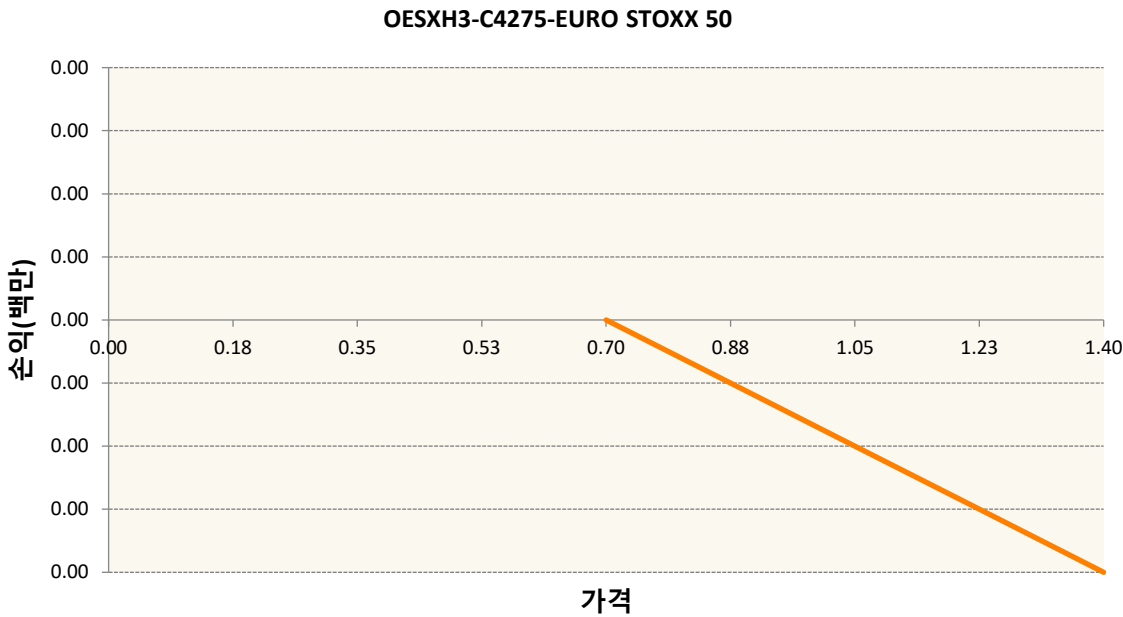
유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

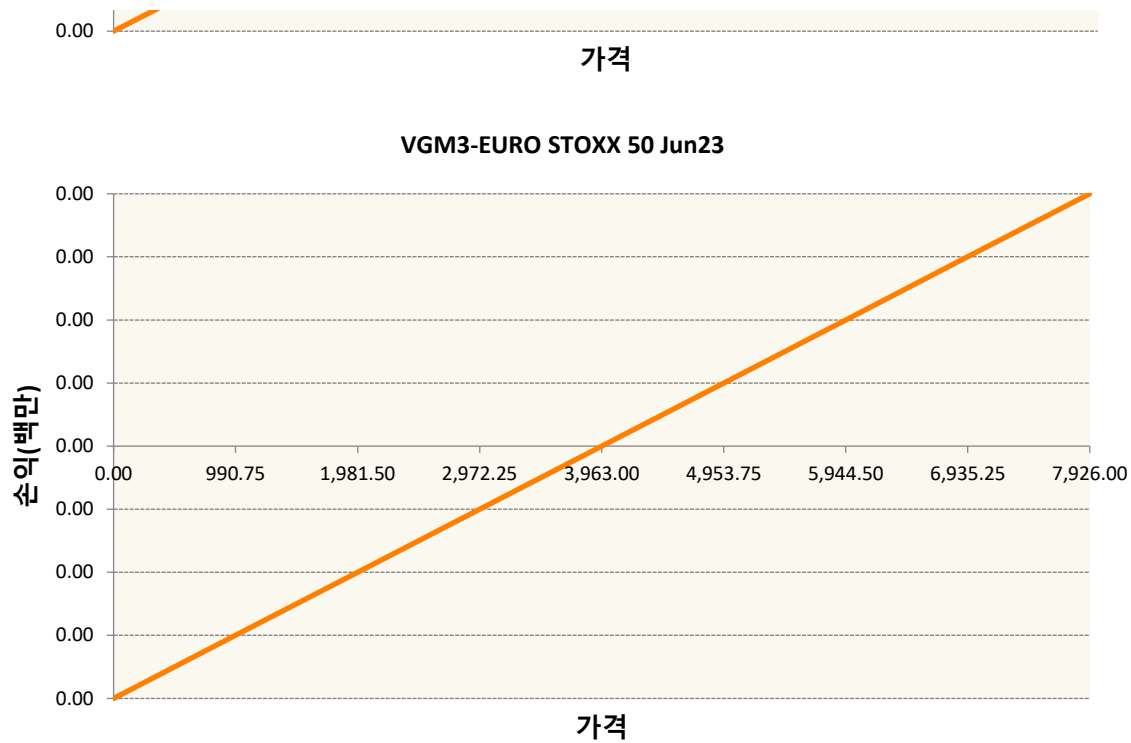
1. 계약금액

(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	883	0	883	
누계	유가증권	옵션	0	98	-98	장내
누계	통화	선도	139	1,811	-1,671	장외

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
FXW213CCM KRW/EUR 24-03-23E		56
FXW213D1R KRW/EUR 28-04-23E		45
FXW213D2N KRW/EUR 26-05-23E		45
FXW213D3G EUR/KRW 24-03-23E		11
OESXH3-C42 EURO STOXX 50		0.02
OESXH3-P42 EURO STOXX 50		8
VGM3 EURO STOXX 50 Jun23		71

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	204

공시일	2023-03-17
기준일	2023-03-16

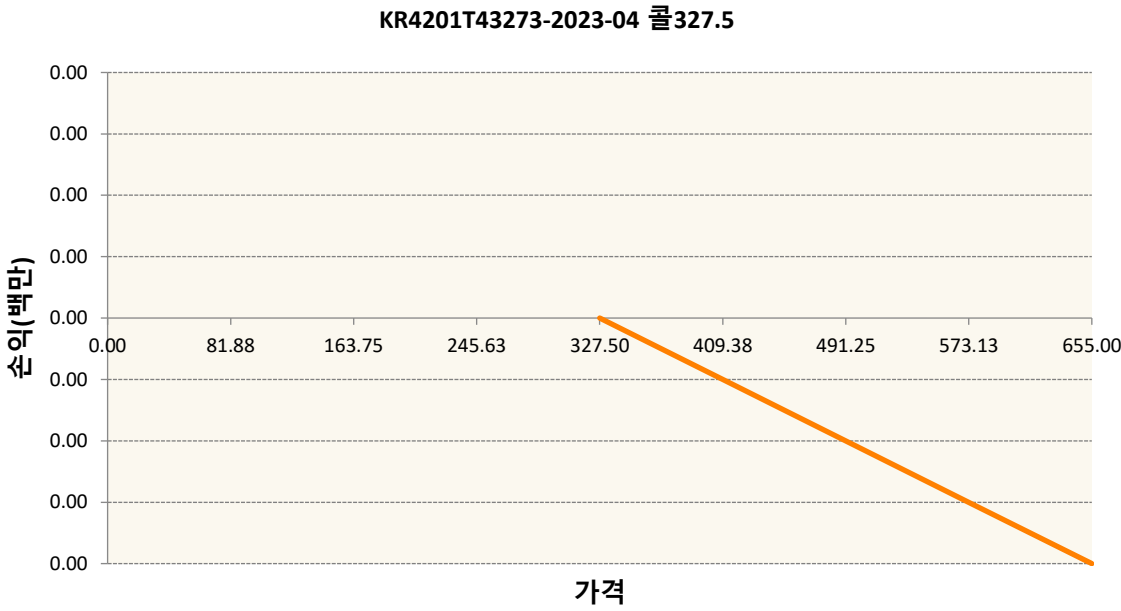
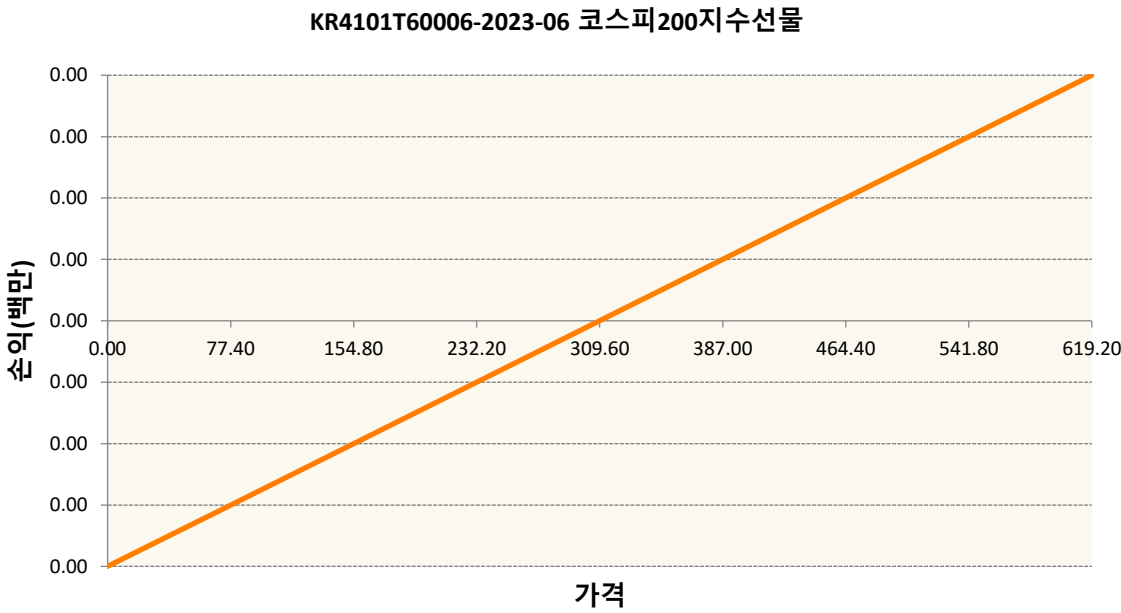
리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

1. 계약금액

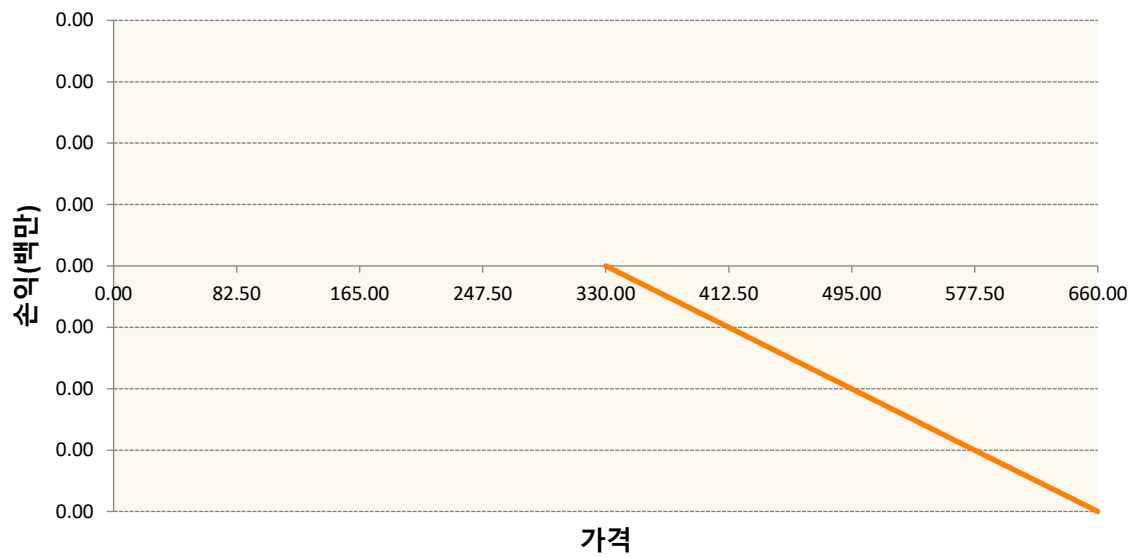
(단위:백만원)

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	387	0	387	장내
누계	유가증권	옵션	157	3,874	-3,718	장내

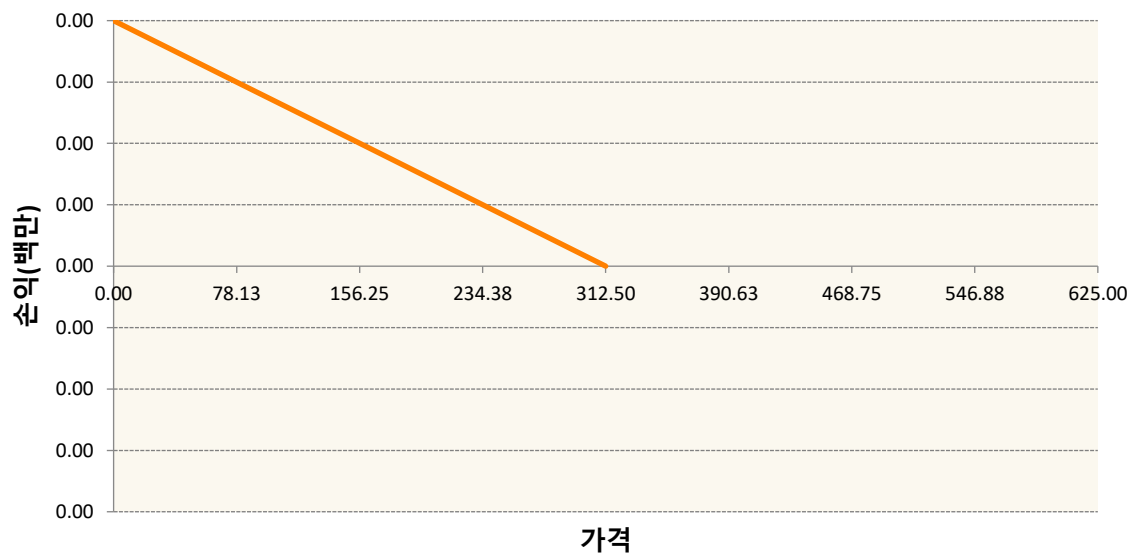
2. 만기시점의 손익구조



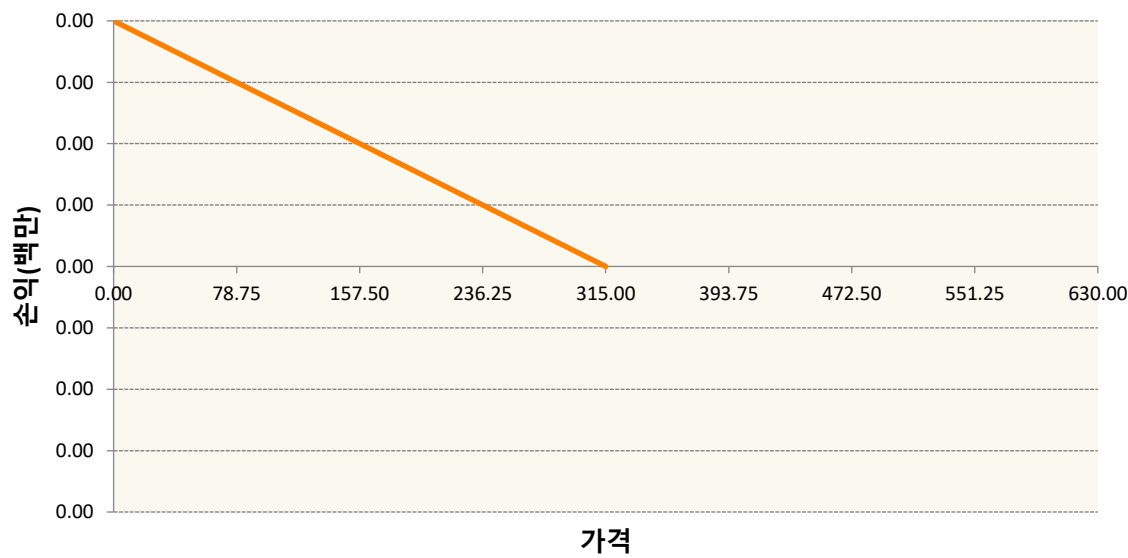
KR4201T43307-2023-04 콜330



KR4301T43123-2023-04 풋312.5



KR4301T43156-2023-04 풋315



(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					16
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	4	3	3	3	3	3	3
-5.33%	3	3	3	3	2	2	2
-2.67%	3	3	2	2	1	1	0
0%	2	1	1	0	-1	-1	-2
2.67%	0	-1	-2	-3	-4	-5	-6
5.33%	-4	-5	-6	-7	-8	-9	-10
8.00%	-10	-11	-12	-13	-14	-15	-16
KR4201T43307		2023-04 콜330					121
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	24	23	23	22	21	20	18
-5.33%	23	22	21	19	17	14	11
-2.67%	21	19	16	13	9	5	0
0%	14	10	5	0	-6	-11	-17
2.67%	-1	-7	-14	-21	-28	-35	-43
5.33%	-28	-36	-45	-53	-61	-69	-77
8.00%	-71	-79	-88	-96	-104	-113	-121
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	5	5	5	5
-5.33%	2	3	3	3	3	3	3
-2.67%	1	1	1	1	1	2	2
0%	-1	0	0	0	0	0	1
2.67%	-2	-1	-1	-1	-1	-1	0
5.33%	-2	-2	-2	-2	-2	-1	-1
8.00%	-3	-2	-2	-2	-2	-2	-2
KR4301T43156		2023-04 풋315					5
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	5	5	5	5	5	5	5
-5.33%	3	3	3	3	3	3	3
-2.67%	1	1	1	1	2	2	2
0%	-1	0	0	0	0	0	1
2.67%	-2	-1	-1	-1	-1	-1	-1
5.33%	-2	-2	-2	-2	-2	-2	-1
8.00%	-3	-3	-3	-2	-2	-2	-2

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

(단위:백만원)

141

공시일	2023-03-17
기준일	2023-03-16

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	6,910	0	6,910	

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	2023-03-17
기준일	2023-03-16

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	5,516	0	5,516	

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	2023-03-17
기준일	2023-03-16

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	19,579	0	19,579	
누계	통화	선도	0	19,728	-19,728	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
FXW213CCSI KRW/USD 28-03-23E		557
FXW213D1SI KRW/USD 28-04-23E		314
FXW213D2Q KRW/USD 31-05-23E		708
IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	894

공시일	2023-03-17
기준일	2023-03-16

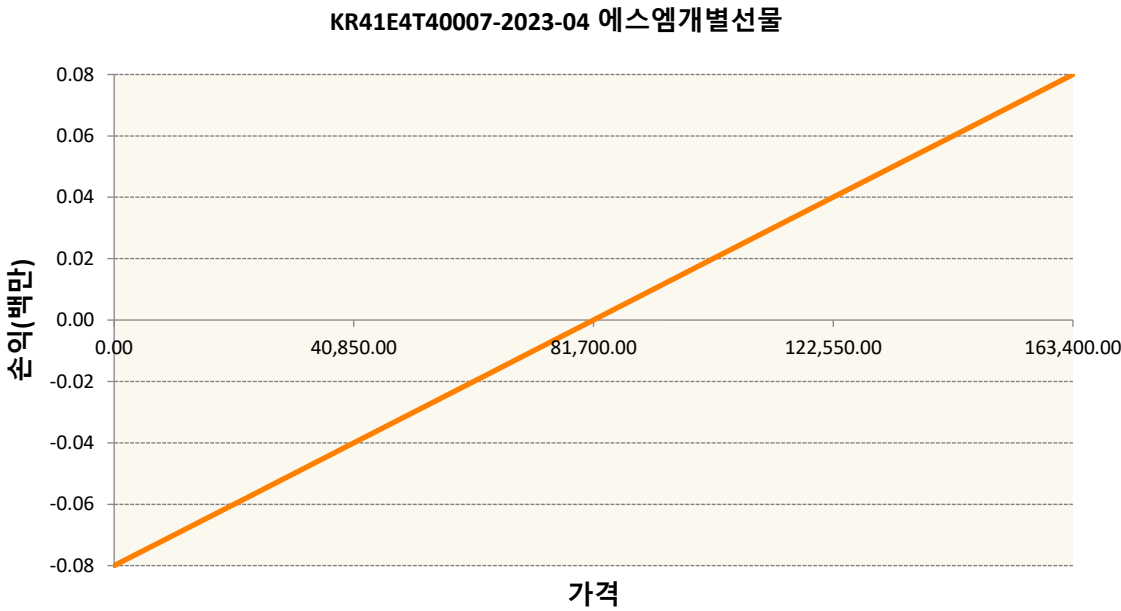
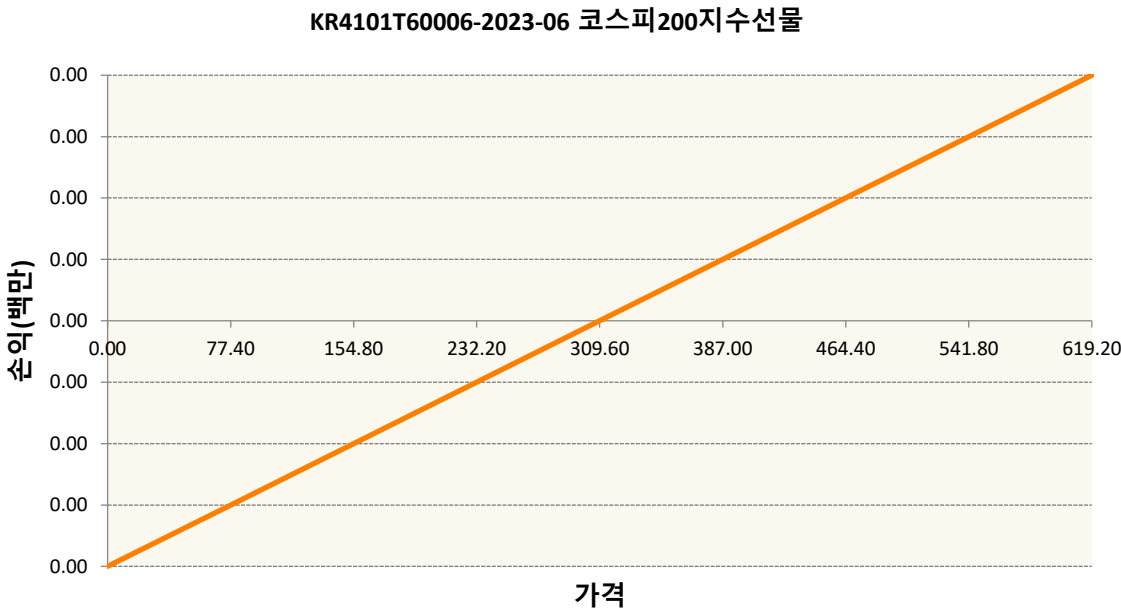
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

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	1,330	0	1,330	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101T60006			2023-06 코스피200지수선물				105
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-105	-105	-105	-105	-105	-105	-105
-5.33%	-70	-70	-70	-70	-70	-70	-70
-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%	70	70	70	70	70	70	70
8.00%	105	105	105	105	105	105	105
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)

115

공시일	2023-03-17
기준일	2023-03-16

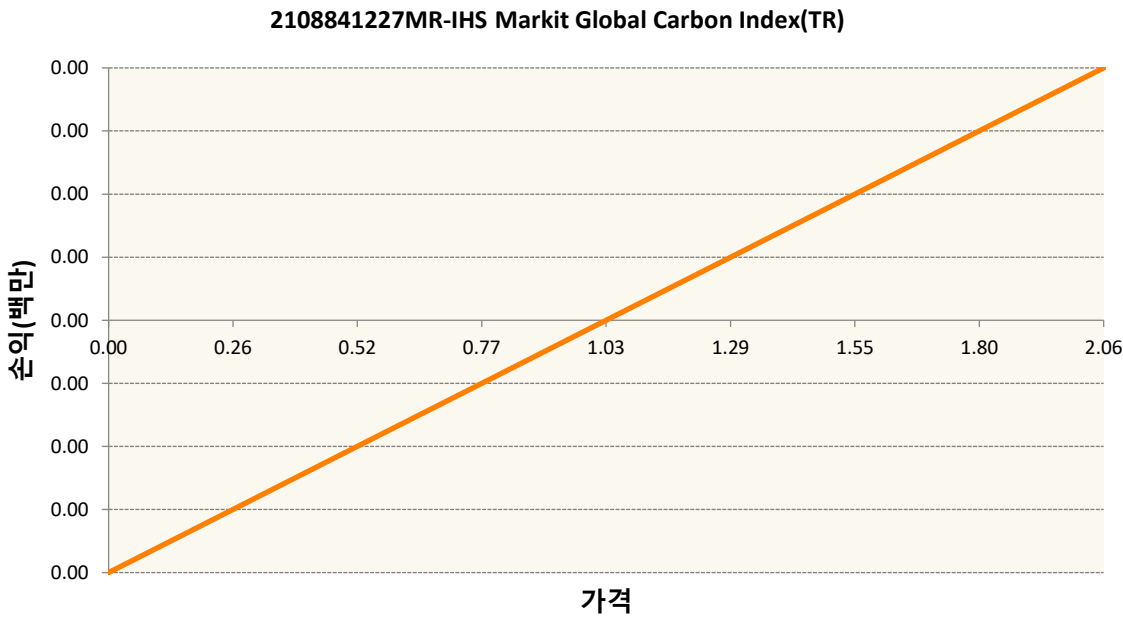
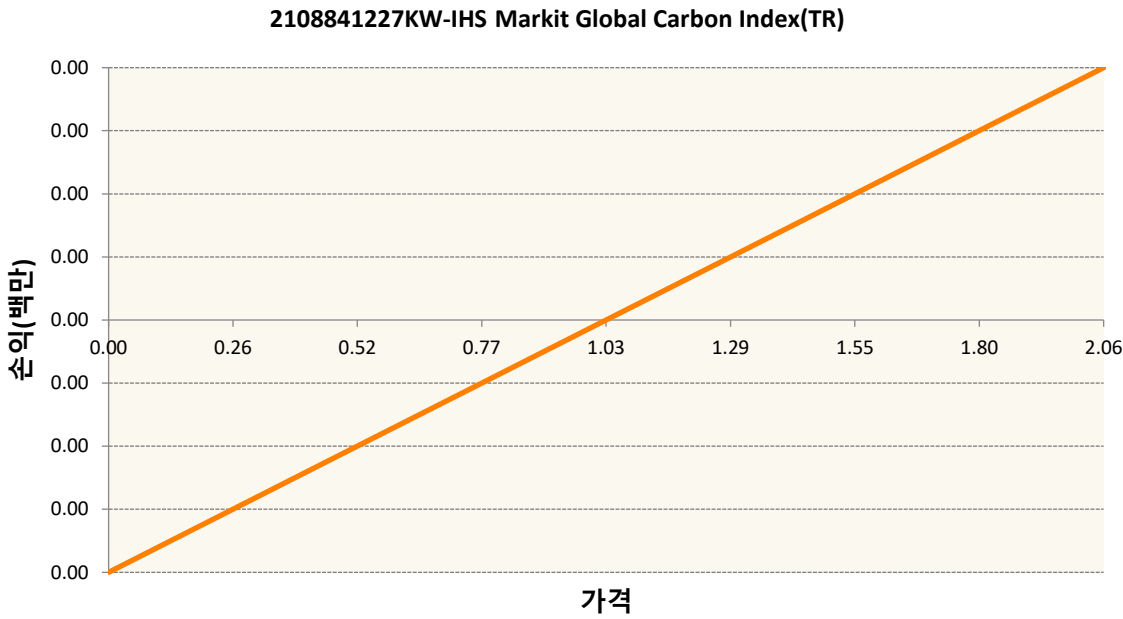
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

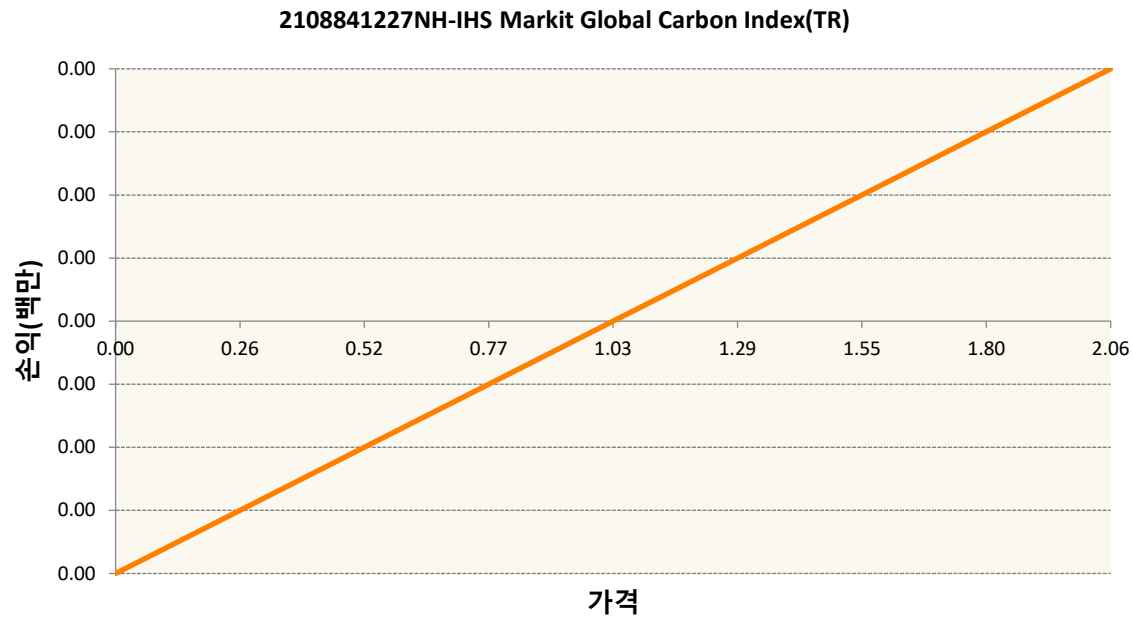
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	25,076	0	25,076	

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108841227IHS Markit Global Carbon Index(TR)		1,698
2108841227IHS Markit Global Carbon Index(TR)		200
2108841227IHS Markit Global Carbon Index(TR)		100

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)		(단위:백만원)
		3,806

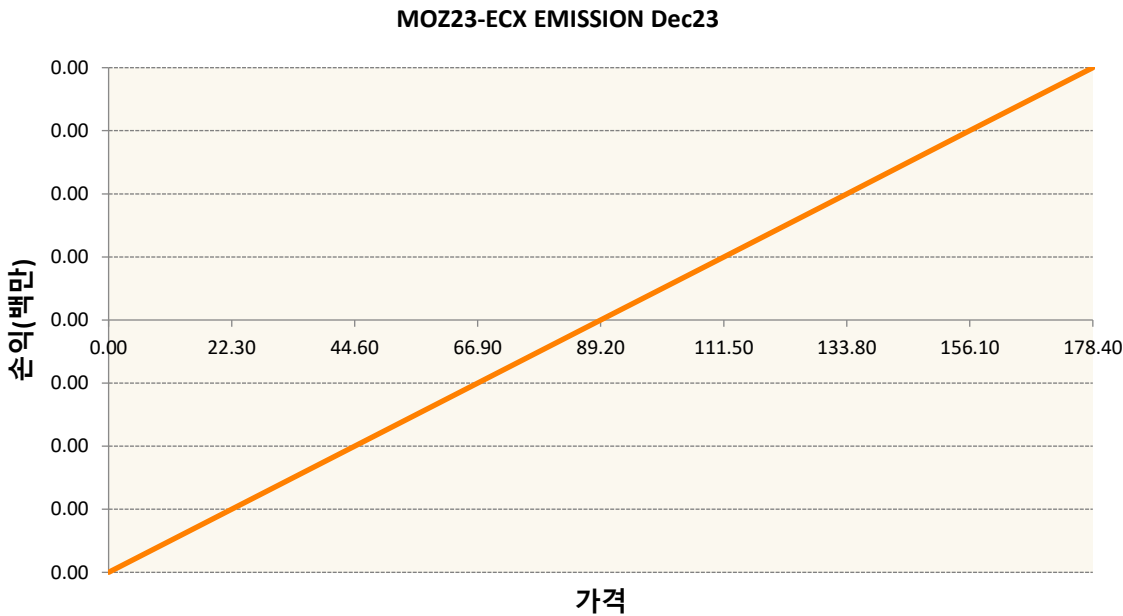
공시일	2023-03-17
기준일	2023-03-16

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	9,226	0	9,226	
누계	통화	선도	1,097	4,216	-3,119	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
FXW213D2Q KRW/EUR 31-03-23E		145
FXW213D2Q KRW/EUR 31-03-23E		145
FXW213D36I EUR/KRW 31-03-23E		45
FXW213D39I KRW/EUR 31-03-23E		48
FXW213D3F(EUR/KRW 31-03-23E		43
MOZ23 ECX EMISSION Dec23		738

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	2,227

공시일	2023-03-17
기준일	2023-03-16

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)

SWCSI00000 신한CSI Index 221222 (NH)	7
SWCSI00000 신한CSI Index 221222 (키움)	7
SWCSI00000 신한CSI Index 221222 (미래)	7
SWCSI00000 신한CSI Index 221222 (메리츠)	7

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

(단위:백만원)

51

공시일	2023-03-17
기준일	2023-03-16

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)	9
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 230116(메리츠)	13
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 230116(미래)	10
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 230116(키움)	9

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) (단위:백만원)
50

공시일	2023-03-17
기준일	2023-03-16

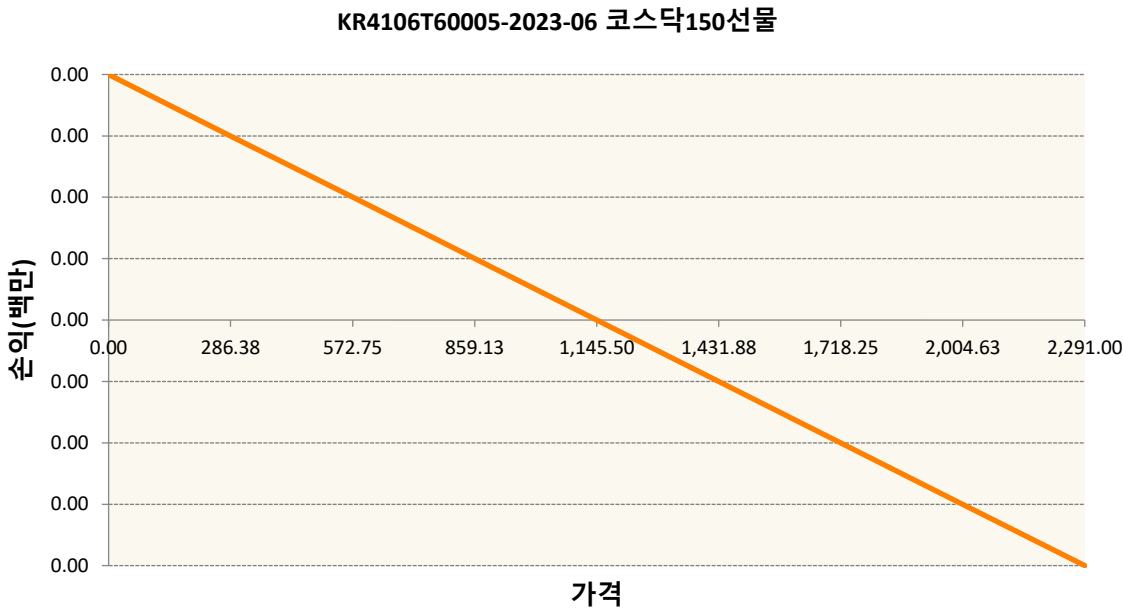
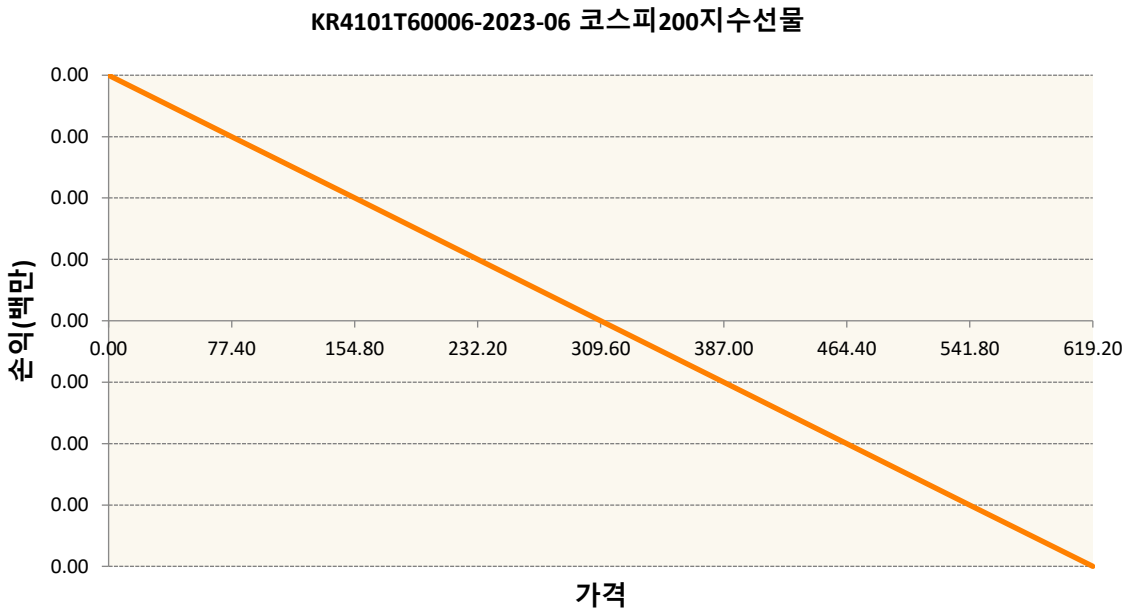
에쿼티알파일반사모혼합자산

1. 계약금액

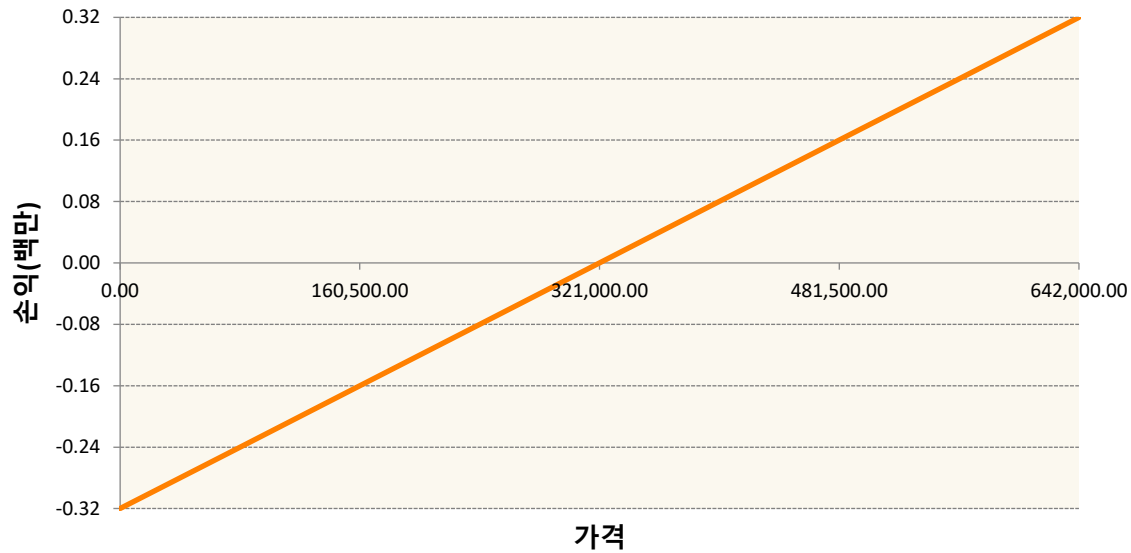
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	321	3,768	-3,447	장내
누계	유가증권	스왑	0	0	0	장외

2. 만기시점의 손익구조



KR4113T40003-2023-04 POSCO홀딩스개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101T600 2023-06 코스피200지수선물	155
KR4106T600 2023-06 코스닥150선물	147
KR4113T400 2023-04 POSCO홀딩스개별선물	26
KRS0004054 SWAP_MICROSOFT CP_0221	0.24
KRS0004054 SWAP_FIRST TRUST ECL_0221	1
KRS0004099 SWAP_MICRON TECH_0308	1

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

(단위:백만원)

471

공시일	2023-03-17
기준일	2023-03-16

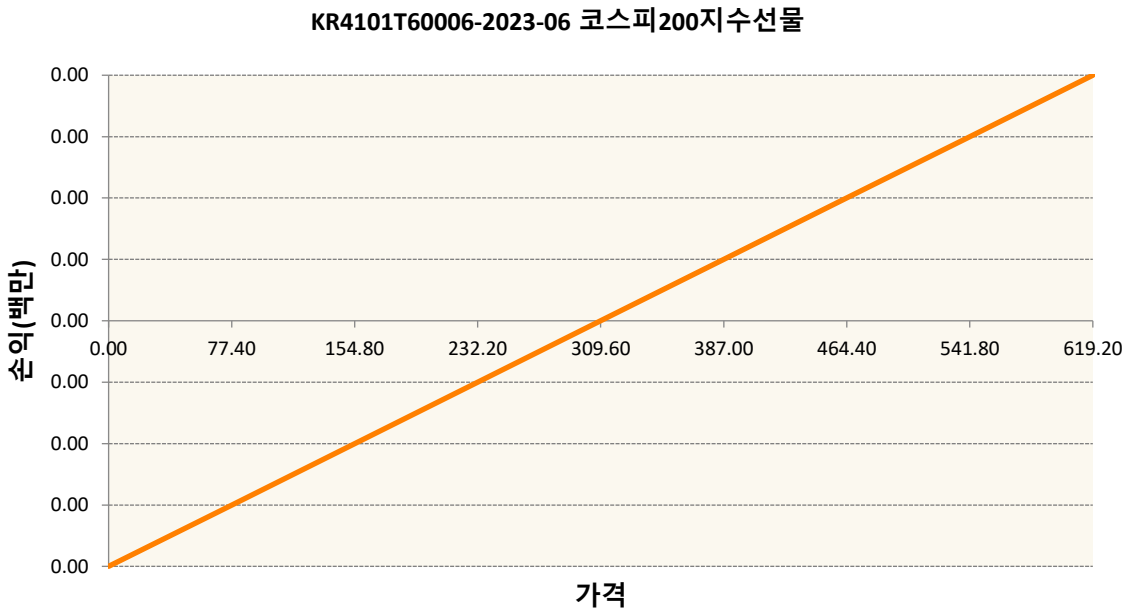
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

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	2,941	0	2,941	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101T60006		2023-06 코스피200지수선물					234
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-234	-234	-234	-234	-234	-234	-234
-5.33%	-156	-156	-156	-156	-156	-156	-156
-2.67%	-78	-78	-78	-78	-78	-78	-78
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	78	78	78	78	78	78	78
5.33%	156	156	156	156	156	156	156
8.00%	234	234	234	234	234	234	234

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

(단위:백만원)

253

공시일	2023-03-17
기준일	2023-03-16

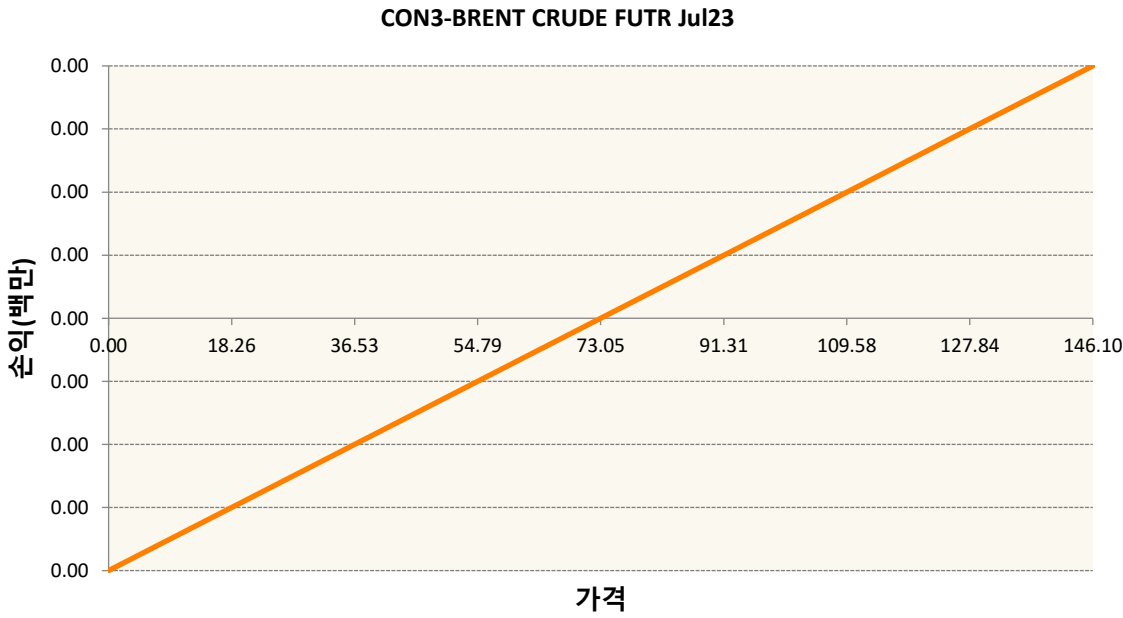
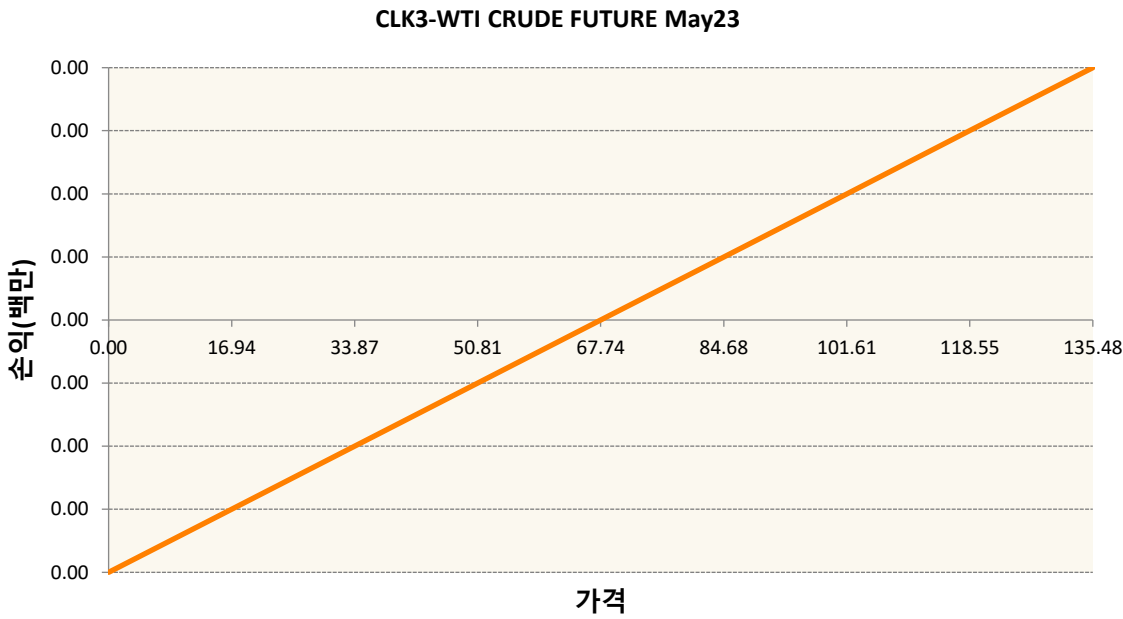
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

1. 계약금액

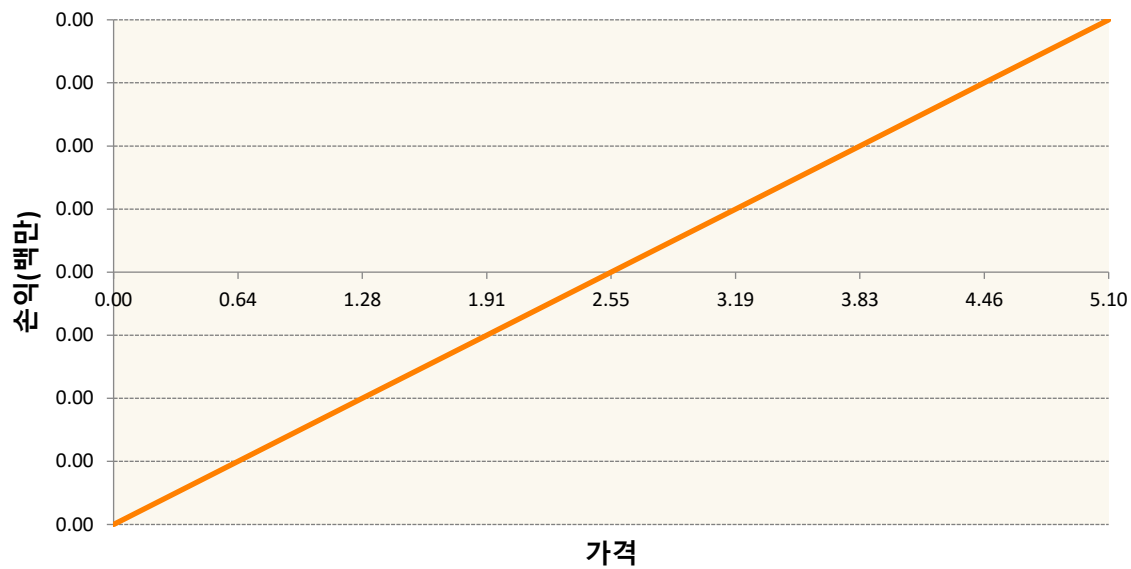
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,525	197	1,329	

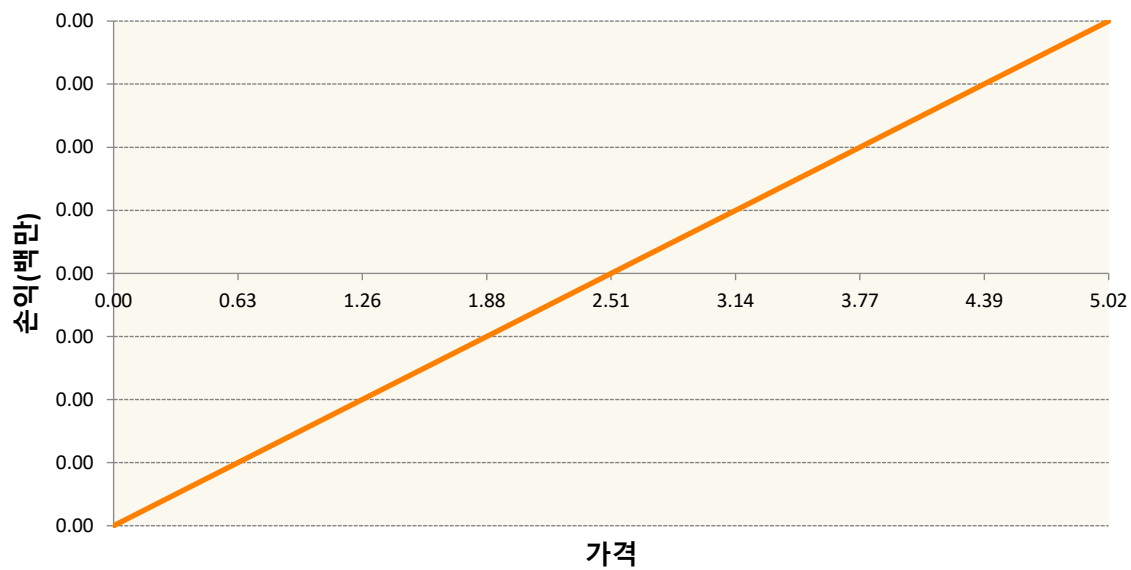
2. 만기시점의 손익구조



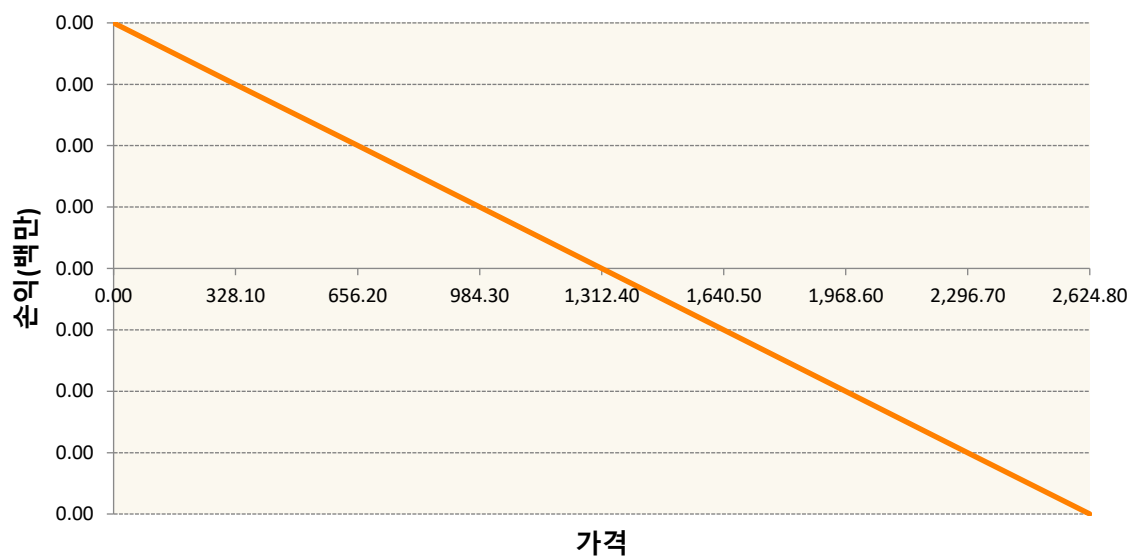
EOK3-E-MINI NATURAL GAS May23



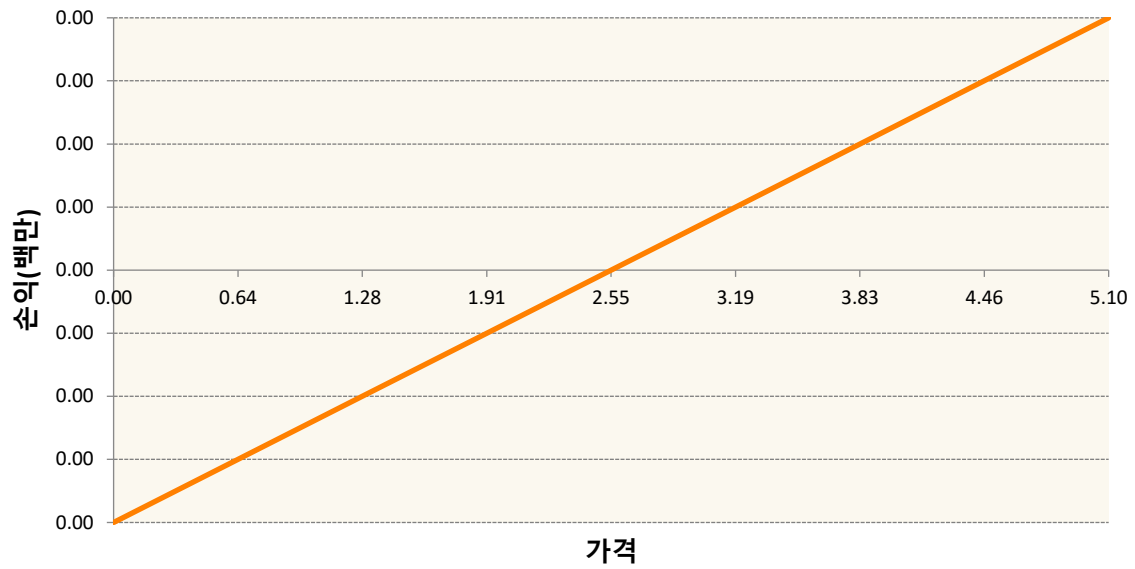
HOK3-NY Harb ULSD Fut May23



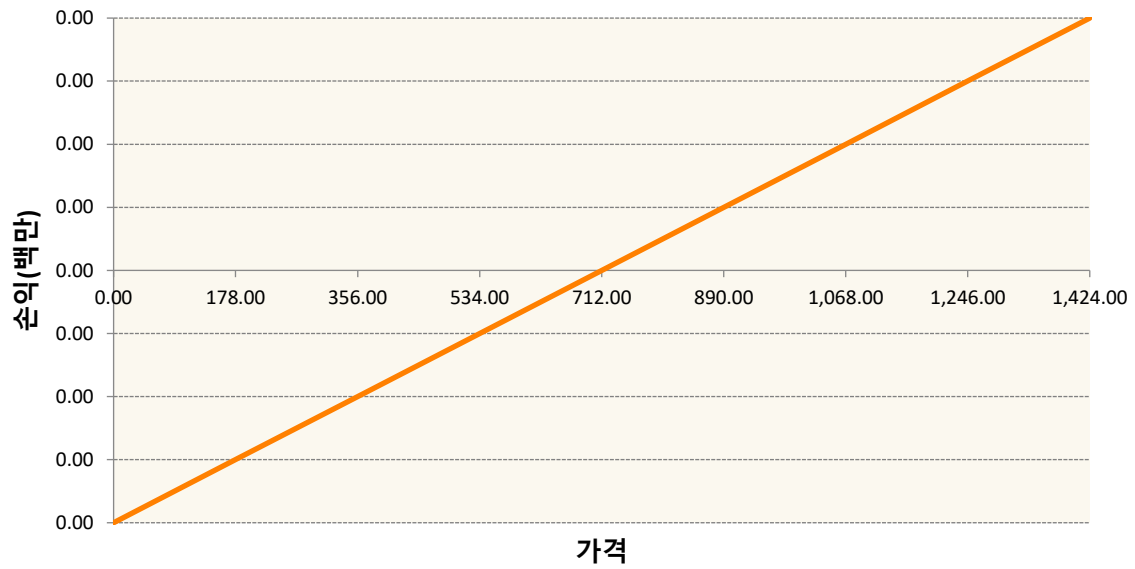
KR4175T30003-2023-03 달러선물



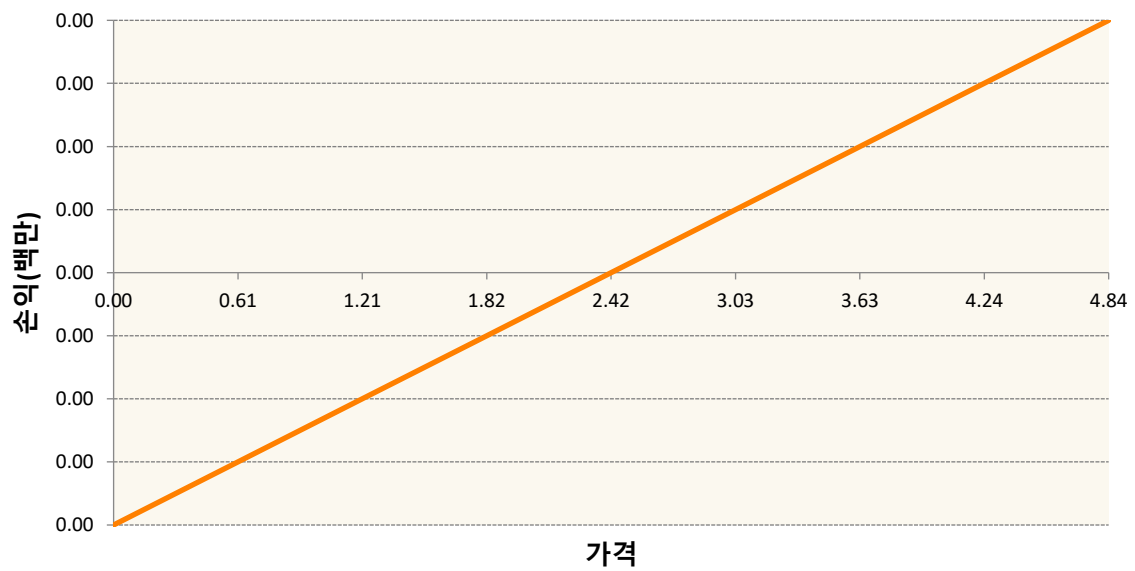
NGK23-NATURAL GAS FUTR May23



QSK3-Low Su Gasoil G May23



XBK3-GASOLINE RBOB FUT May23



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLK3	WTI CRUDE FUTURE May23	28
CON3	BRENT CRUDE FUTR Jul23	31
EOK3	E-MINI NATURAL GAS May23	2
HOK3	NY Harb ULSD Fut May23	11
KR4175T300	2023-03 달러선물	16
NGK23	NATURAL GAS FUTR May23	26
QSK3	Low Su Gasoil G May23	14
XBK3	GASOLINE RBOB FUT May23	10

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

383