

공시일	2023-03-20
기준일	2023-03-17

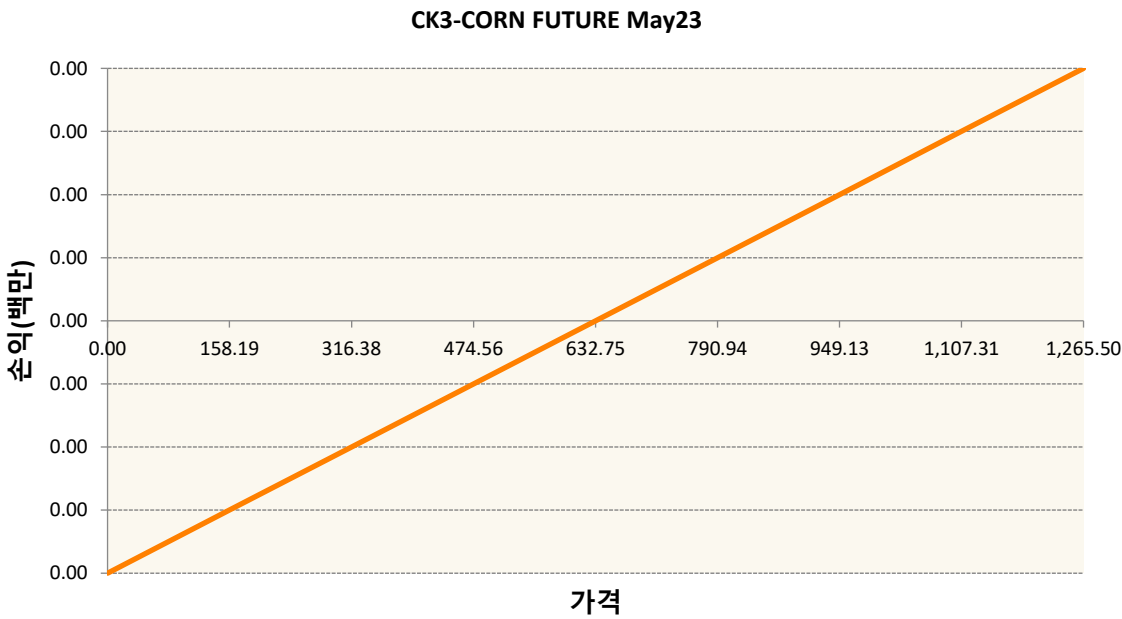
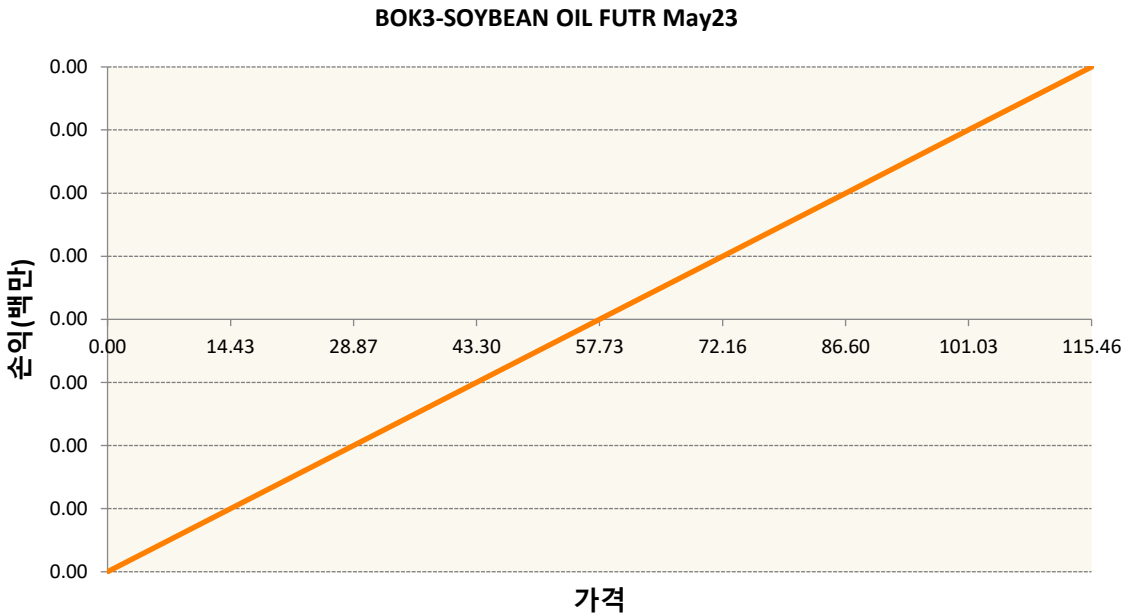
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

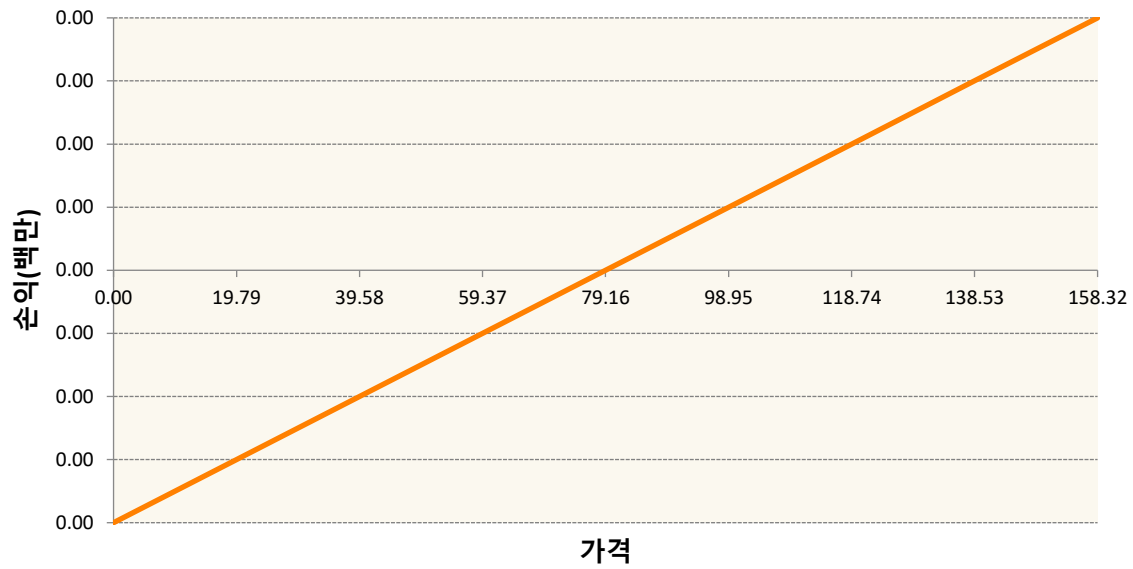
(단위:USD 백만)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,602	521	5,081	

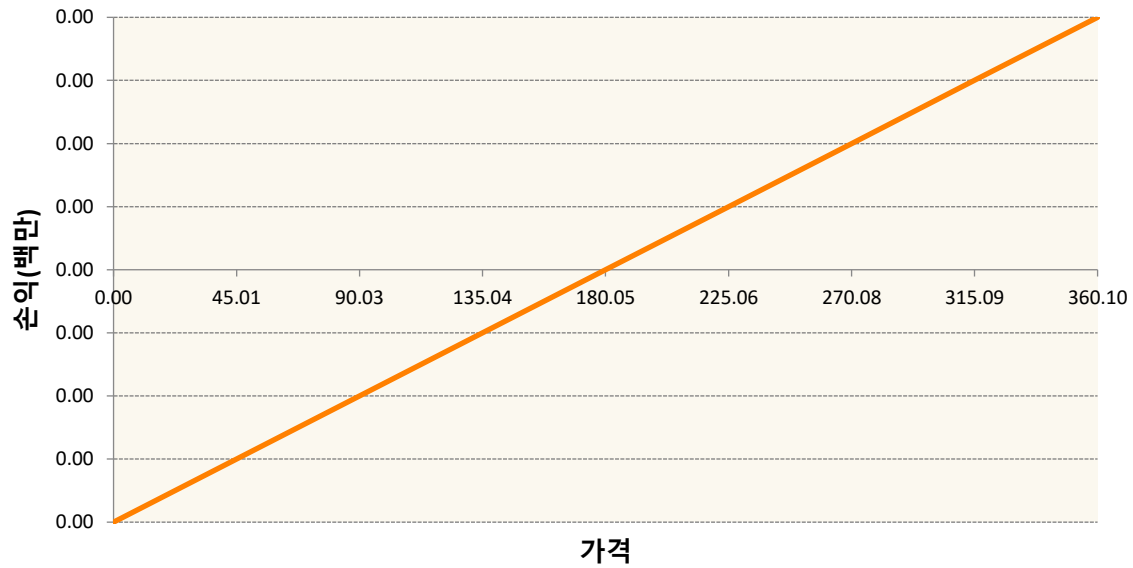
2. 만기시점의 손익구조



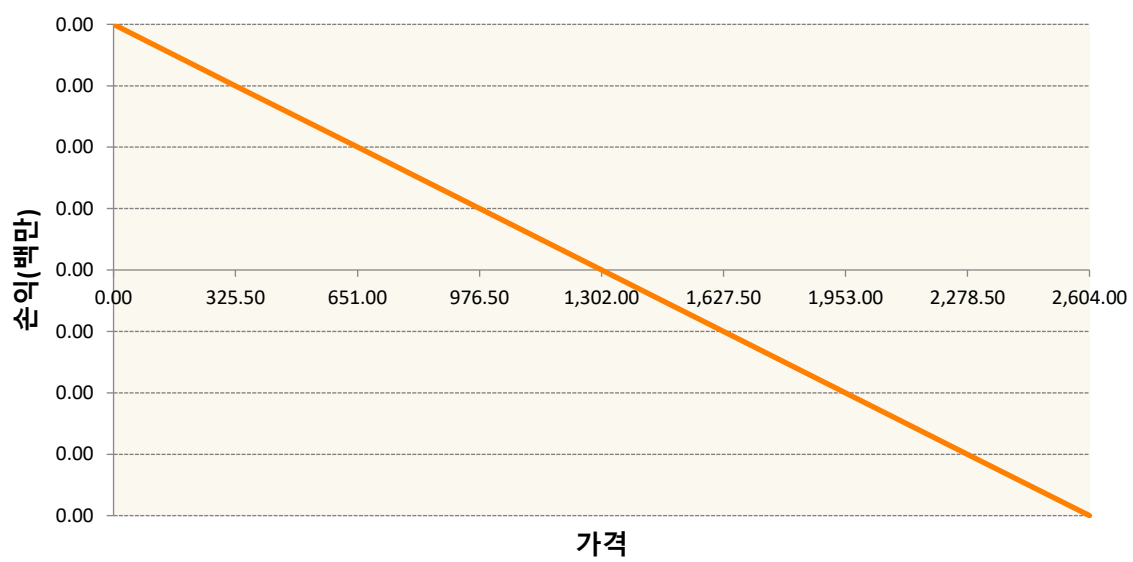
CTK3-COTTON NO.2 FUTR May23



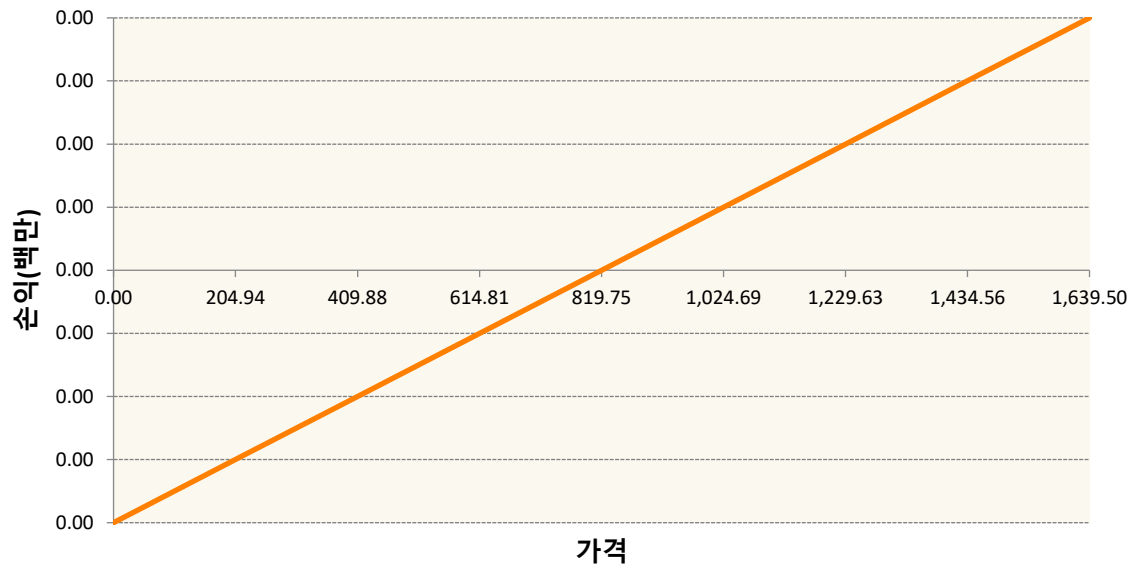
KCK3-COFFEE 'C' FUTURE May23



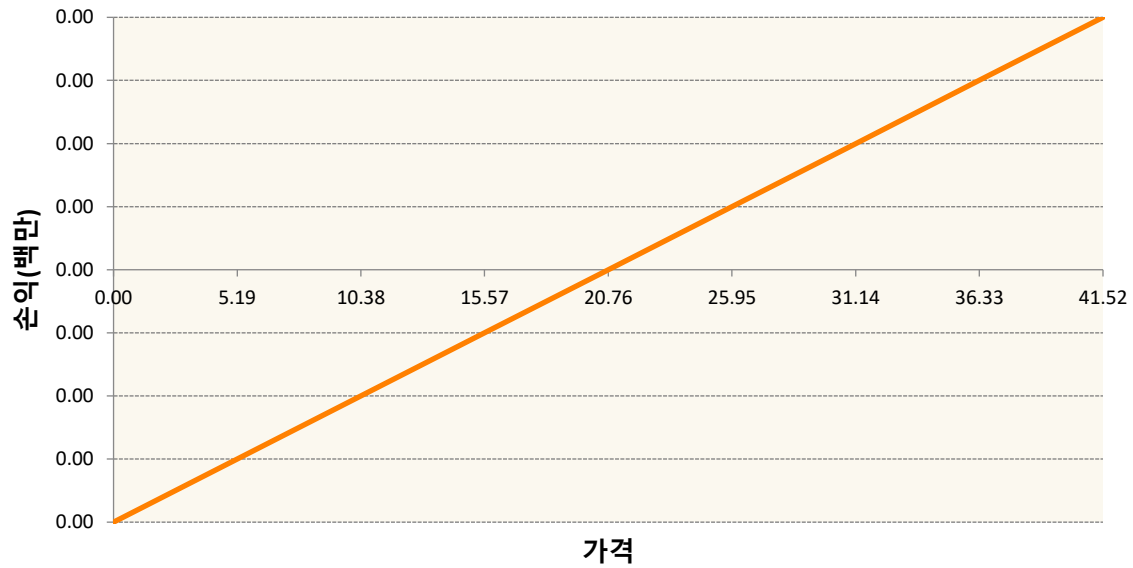
KR4175T40002-2023-04 달러선물



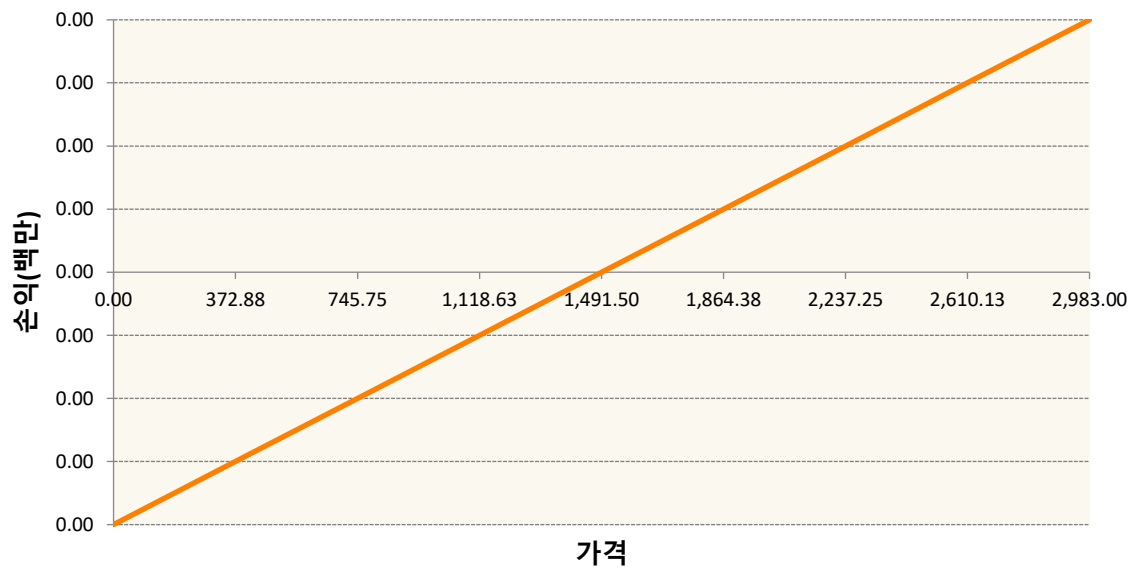
KWK3-KC HRW WHEAT FUT May23



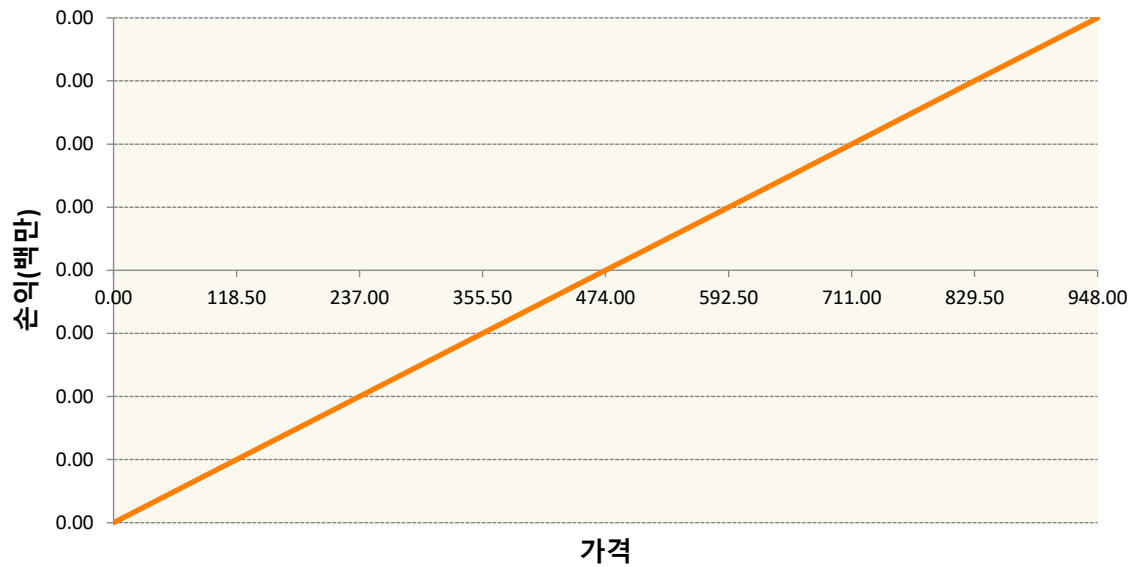
SBK3-Sugar #11 (WORLD) May23



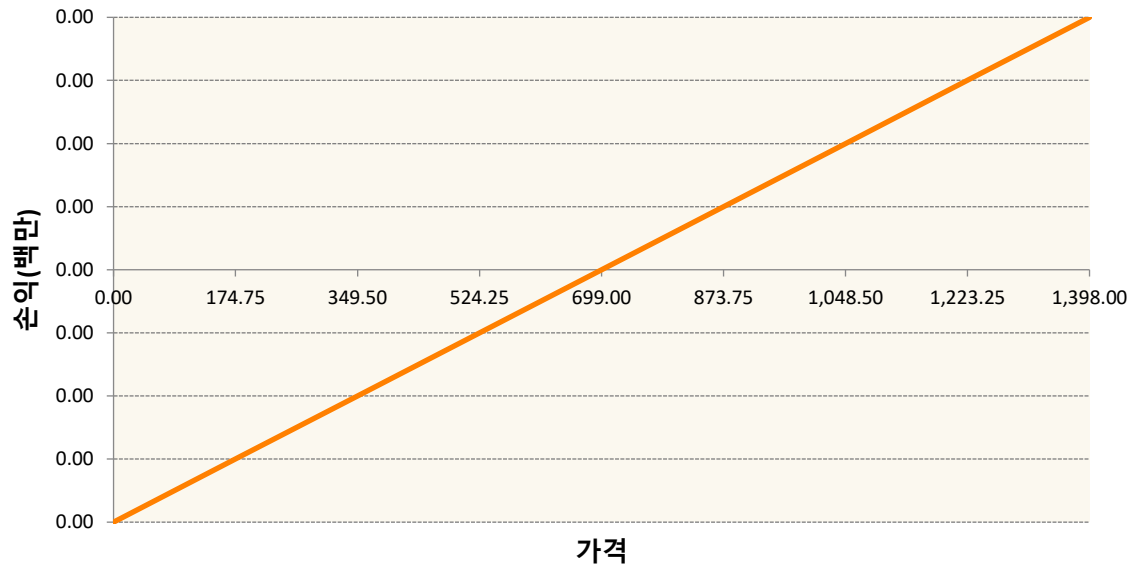
SK3-SOYBEAN FUTURE May23



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	2023-03-20
기준일	2023-03-17

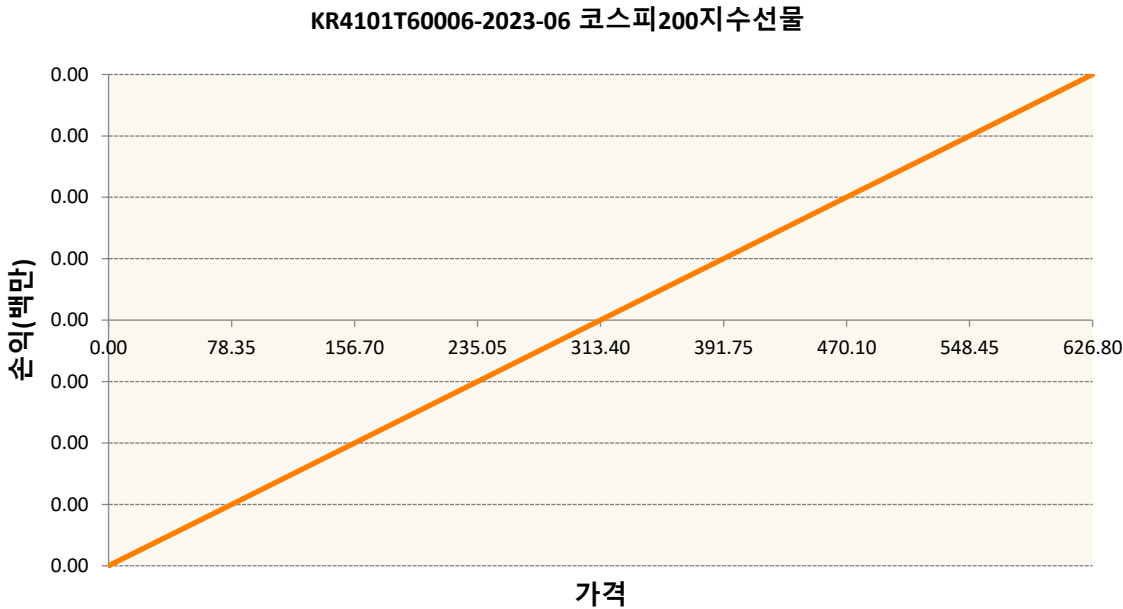
스마트인덱스모

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	2,664	0	2,664	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101T60006			2023-06 코스피200지수선물				212
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-212	-212	-212	-212	-212	-212	-212
-5.33%	-141	-141	-141	-141	-141	-141	-141
-2.67%	-71	-71	-71	-71	-71	-71	-71
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	71	71	71	71	71	71	71
5.33%	141	141	141	141	141	141	141
8.00%	212	212	212	212	212	212	212

공시일	2023-03-20
기준일	2023-03-17

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	357
-----------------------------	-----

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

464

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2023-03-20
기준일	2023-03-17

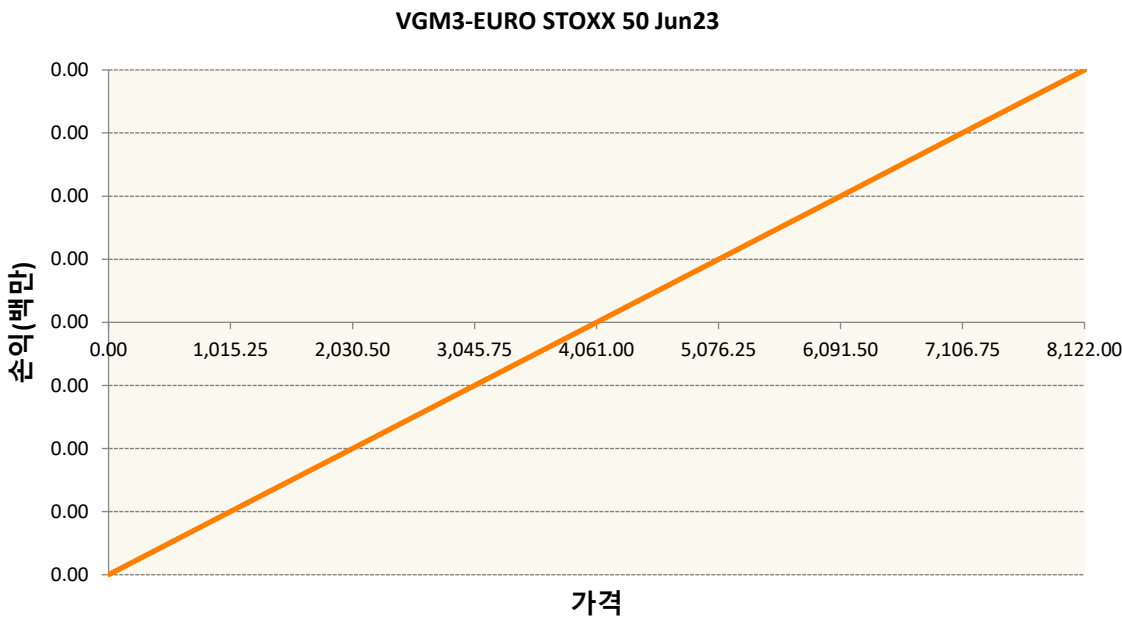
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	452	0	452	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM3	EURO STOXX 50 Jun23	36
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

39

공시일	2023-03-20
기준일	2023-03-17

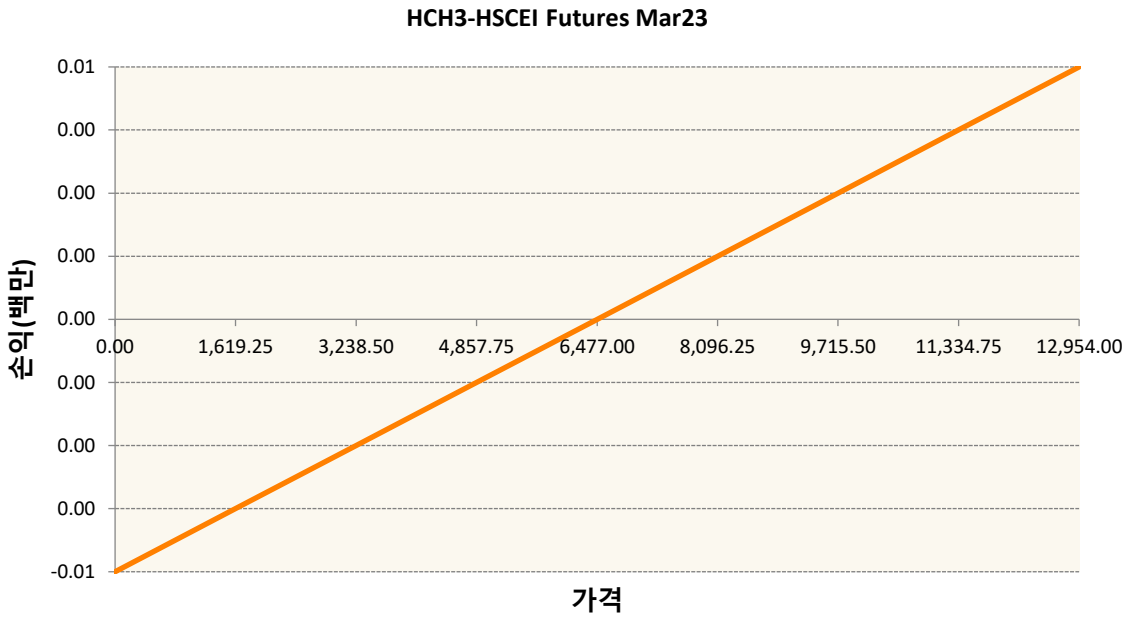
차이나인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,077	0	1,077	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

116

공시일	2023-03-20
기준일	2023-03-17

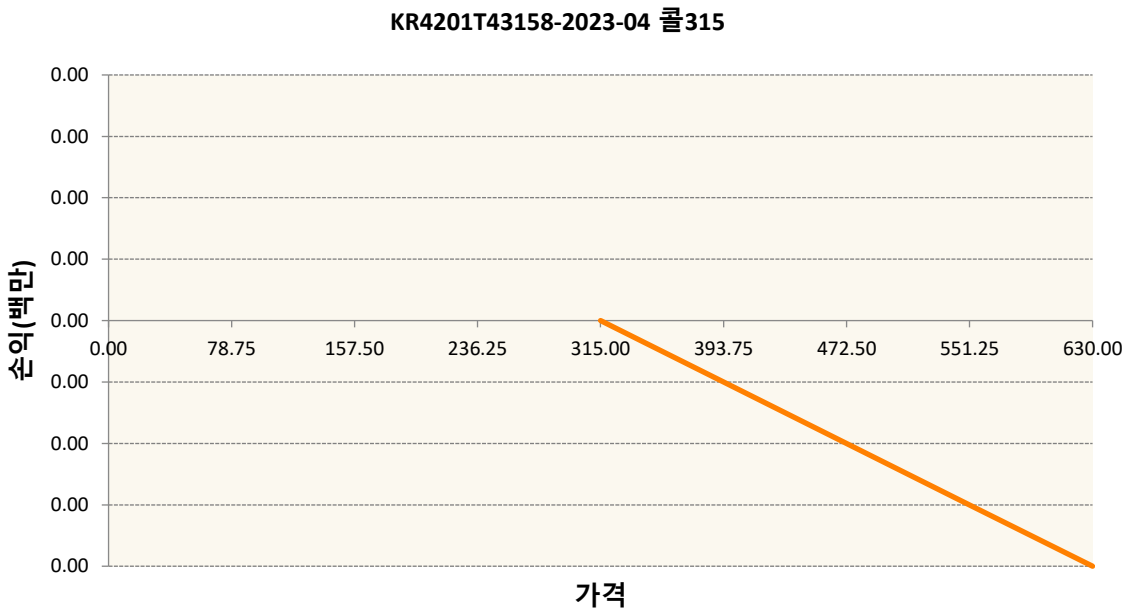
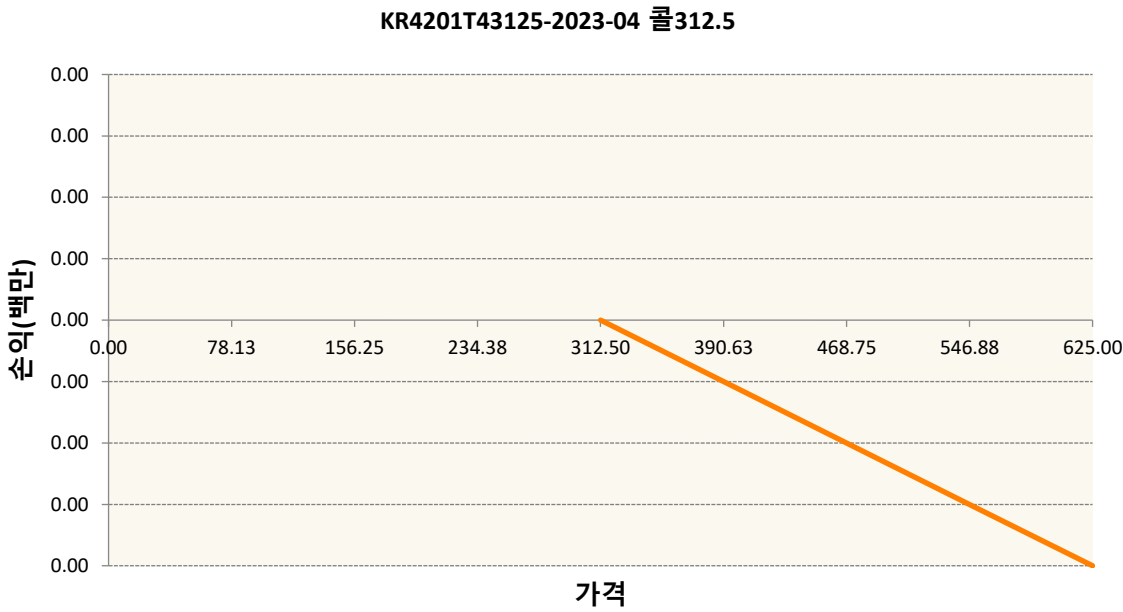
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

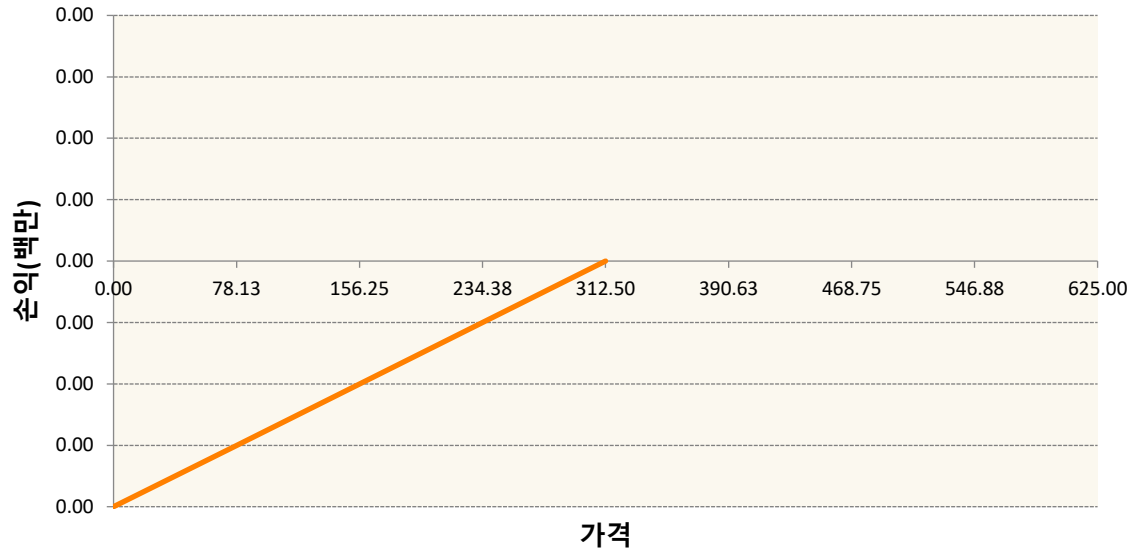
(단위:백만원)

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				698
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	305	296	286	274	261	246	230
-5.33%	274	258	240	221	202	181	160
-2.67%	204	181	157	132	108	83	58
0%	80	53	27	0	-27	-53	-80
2.67%	-103	-128	-152	-178	-203	-229	-255
5.33%	-338	-356	-375	-396	-417	-439	-462
8.00%	-608	-618	-631	-646	-662	-680	-698
KR4201T43158			2023-04 콜315				1,981
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	775	757	733	704	670	633	592
-5.33%	708	669	625	576	525	470	413
-2.67%	545	482	417	351	282	213	142
0%	232	155	77	0	-77	-155	-233
2.67%	-259	-334	-410	-486	-562	-639	-717
5.33%	-914	-972	-1,034	-1,099	-1,165	-1,234	-1,304
8.00%	-1,688	-1,725	-1,768	-1,816	-1,867	-1,923	-1,981
KR4301T43123			2023-04 풋312.5				577
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-514	-521	-530	-540	-551	-564	-577
-5.33%	-283	-296	-311	-327	-344	-361	-379
-2.67%	-84	-104	-124	-145	-166	-187	-208
0%	68	45	23	0	-23	-45	-68

2.67%	170	149	128	107	85	63	41
5.33%	228	213	197	179	161	142	123
8.00%	257	247	236	224	210	195	180

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

(단위:백만원)

3,082

공시일	2023-03-20
기준일	2023-03-17

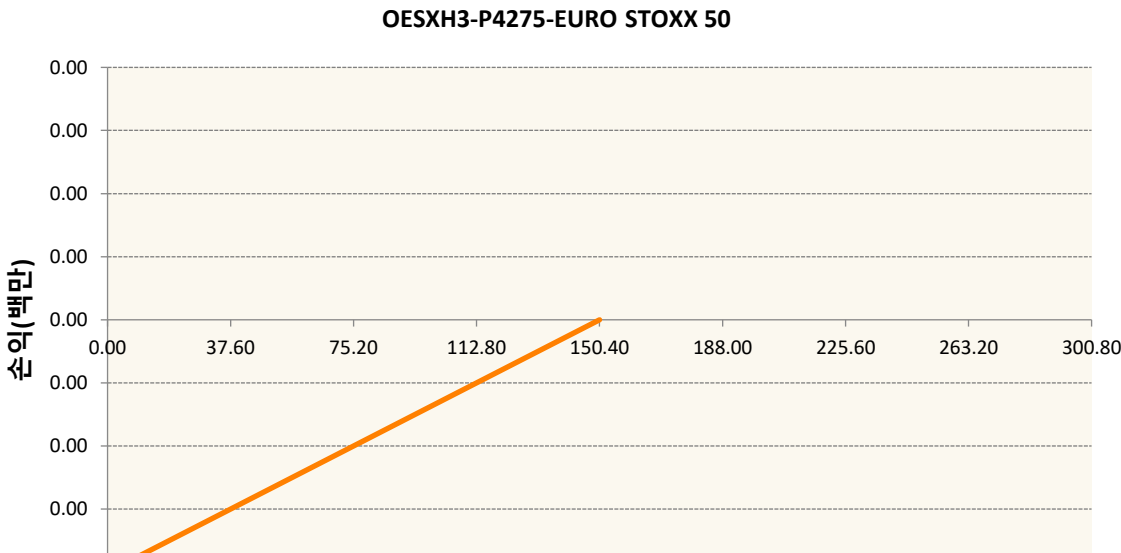
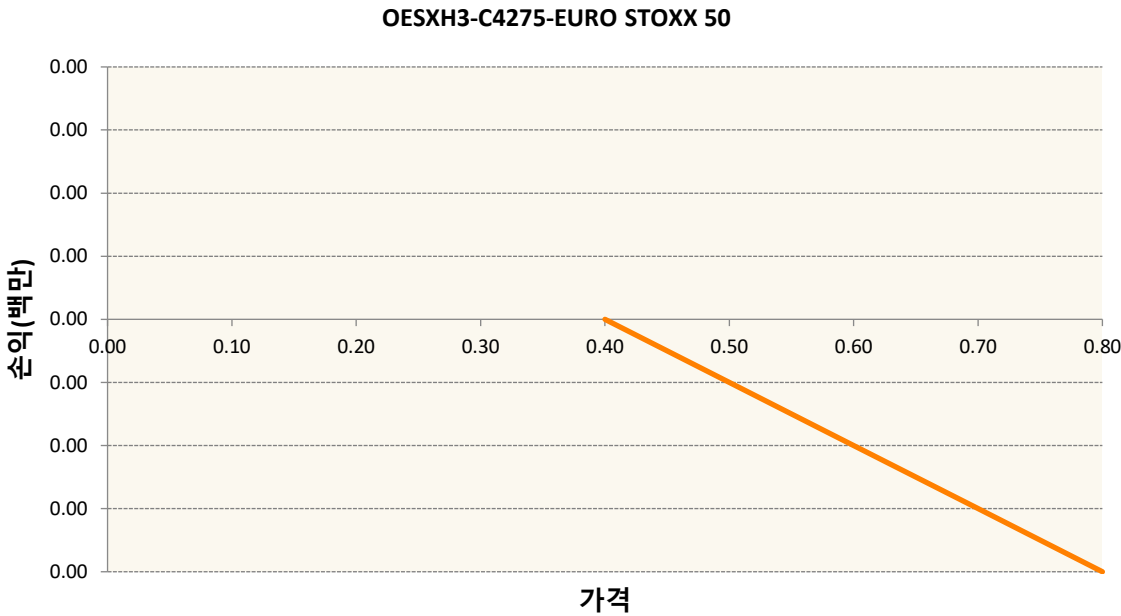
유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

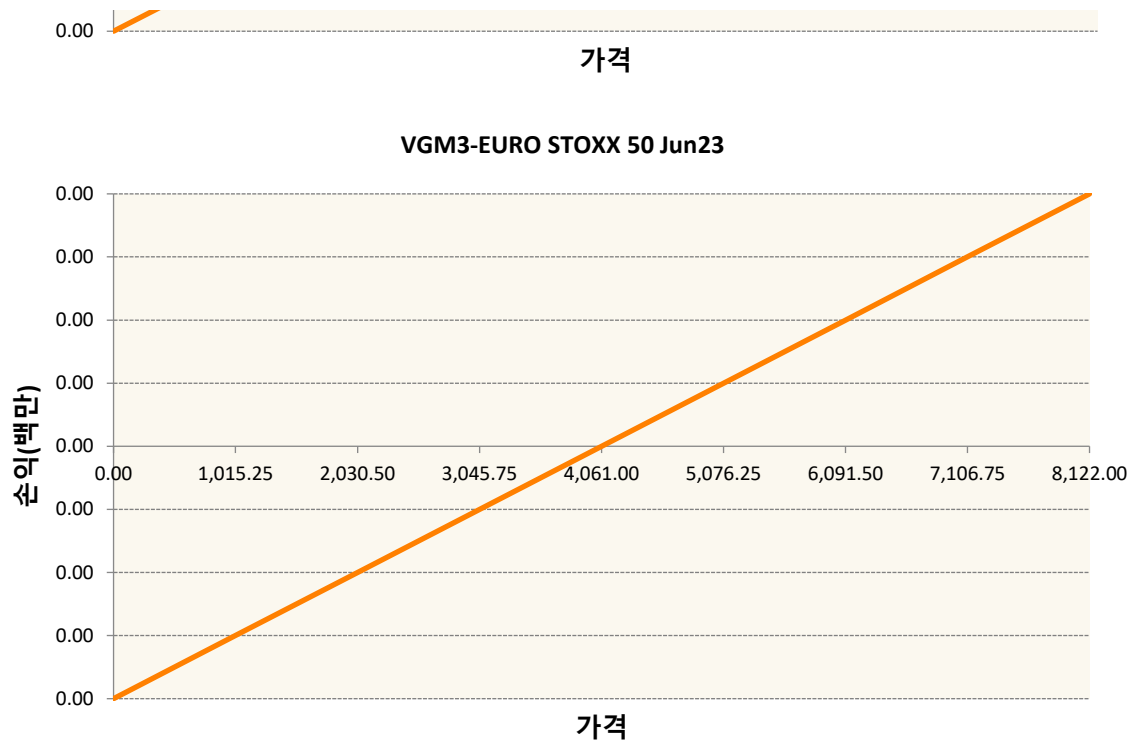
1. 계약금액

(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	905	0	905	
누계	유가증권	옵션	0	59	-59	장내
누계	통화	선도	139	1,803	-1,664	장외

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213CCM KRW/EUR 24-03-23E	55
FXW213D1R KRW/EUR 28-04-23E	44
FXW213D2N KRW/EUR 26-05-23E	44
FXW213D3G EUR/KRW 24-03-23E	11
OESXH3-C42 EURO STOXX 50	0.01
OESXH3-P42 EURO STOXX 50	5
VGM3 EURO STOXX 50 Jun23	72

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

(단위:백만원)

203

공시일	2023-03-20
기준일	2023-03-17

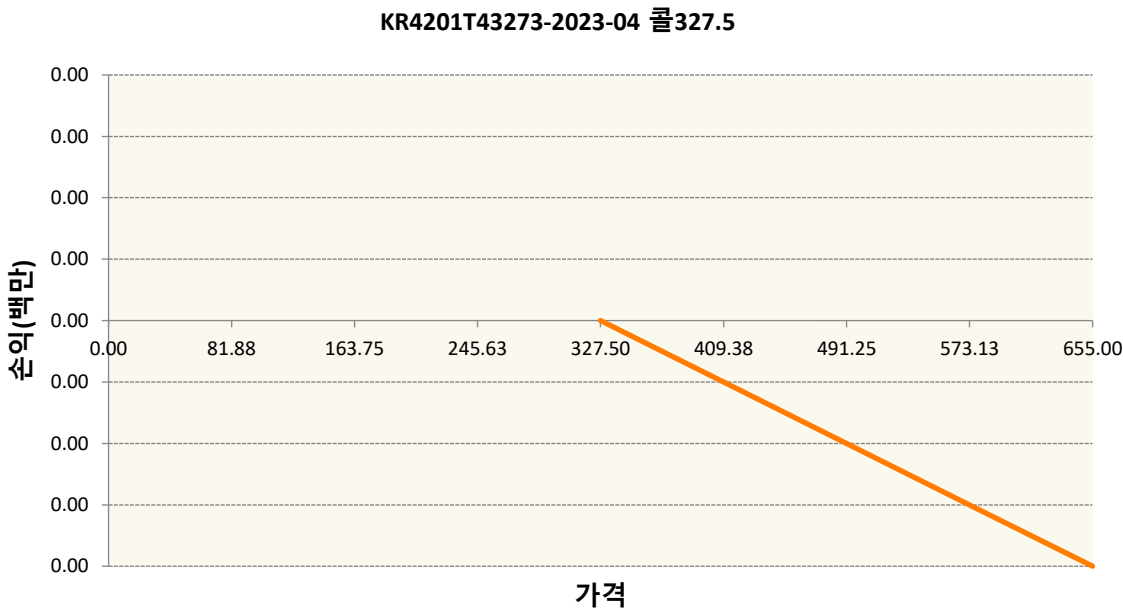
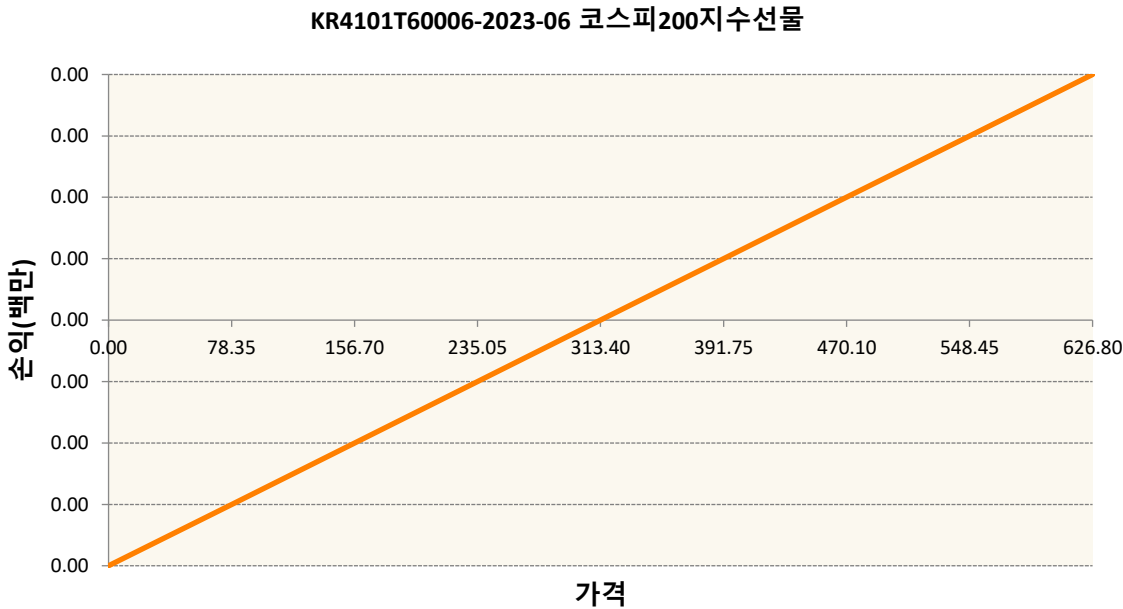
리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

1. 계약금액

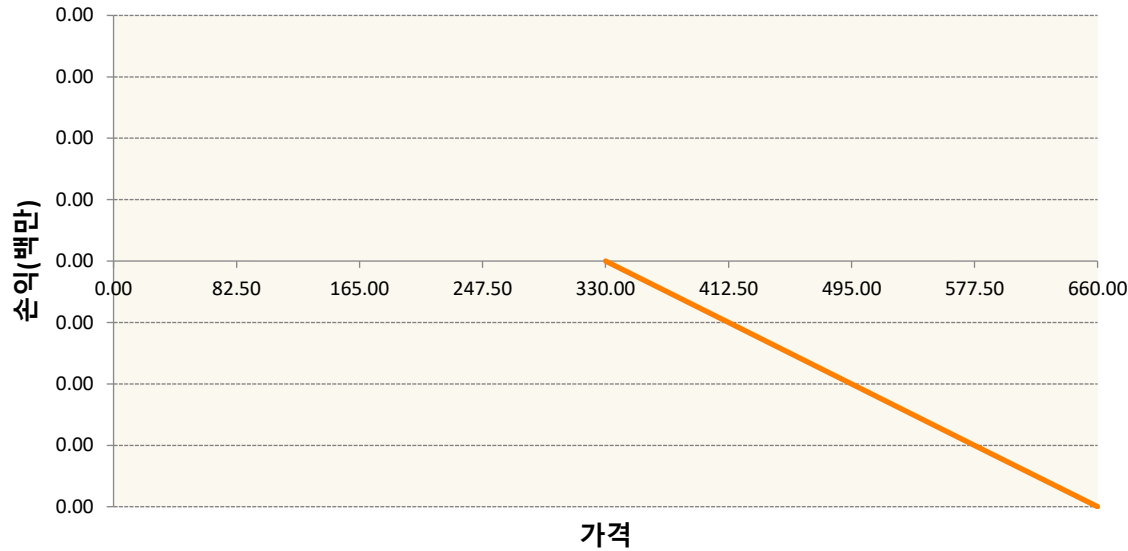
(단위:백만원)

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	392	0	392	장내
누계	유가증권	옵션	157	3,874	-3,718	장내

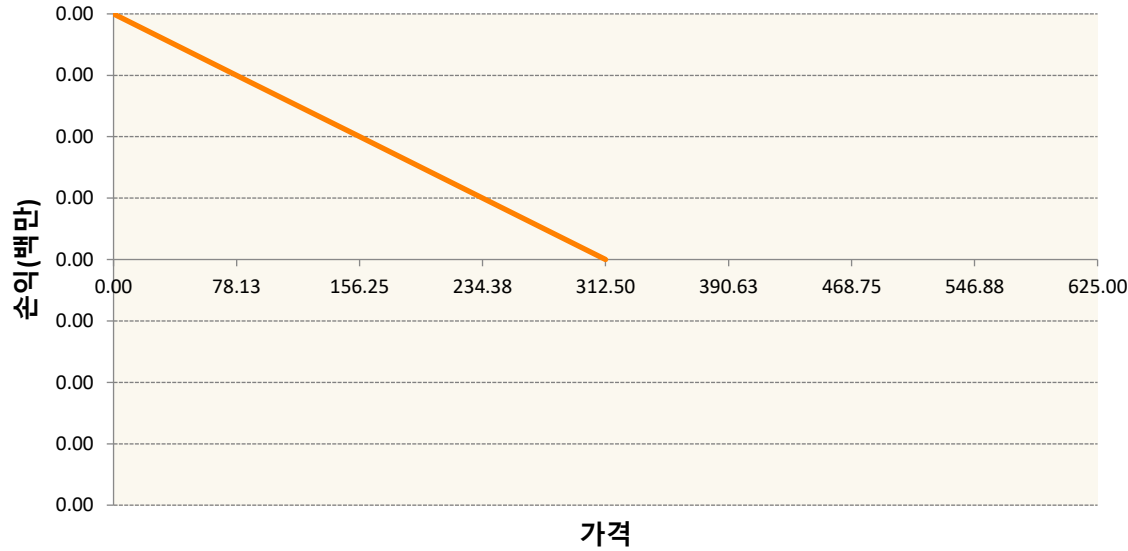
2. 만기시점의 손익구조



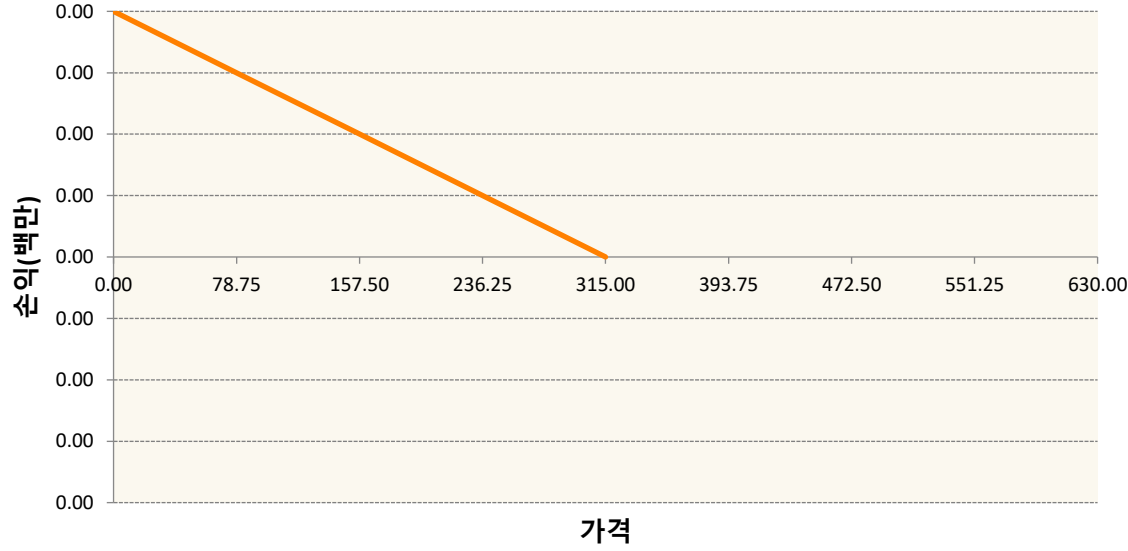
KR4201T43307-2023-04 콜330



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					17
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	4	4	4	4	4	3	3
-5.33%	4	4	4	3	3	3	2
-2.67%	3	3	3	2	2	1	0
0%	2	1	1	0	-1	-2	-2
2.67%	-1	-2	-3	-3	-4	-5	-6
5.33%	-5	-6	-7	-8	-9	-10	-11
8.00%	-12	-13	-14	-15	-16	-16	-17
KR4201T43307		2023-04 콜330					135
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	28	28	27	27	25	24	22
-5.33%	27	26	25	23	21	18	15
-2.67%	24	22	19	15	11	7	2
0%	15	11	6	0	-6	-12	-18
2.67%	-4	-11	-18	-25	-32	-40	-47
5.33%	-38	-46	-54	-62	-70	-78	-86
8.00%	-89	-96	-104	-112	-119	-127	-135
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	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	-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	5	5	5	5	5
-5.33%	3	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%	-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)

160

공시일	2023-03-20
기준일	2023-03-17

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	6,680	0	6,680	

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	2023-03-20
기준일	2023-03-17

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	5,333	0	5,333	

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	2023-03-20
기준일	2023-03-17

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	18,929	0	18,929	
누계	통화	선도	0	19,566	-19,566	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
FXW213CCSI(KRW/USD 28-03-23E		552
FXW213D1SI(KRW/USD 28-04-23E		311
FXW213D2Q(KRW/USD 31-05-23E		702
IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	886

공시일	2023-03-20
기준일	2023-03-17

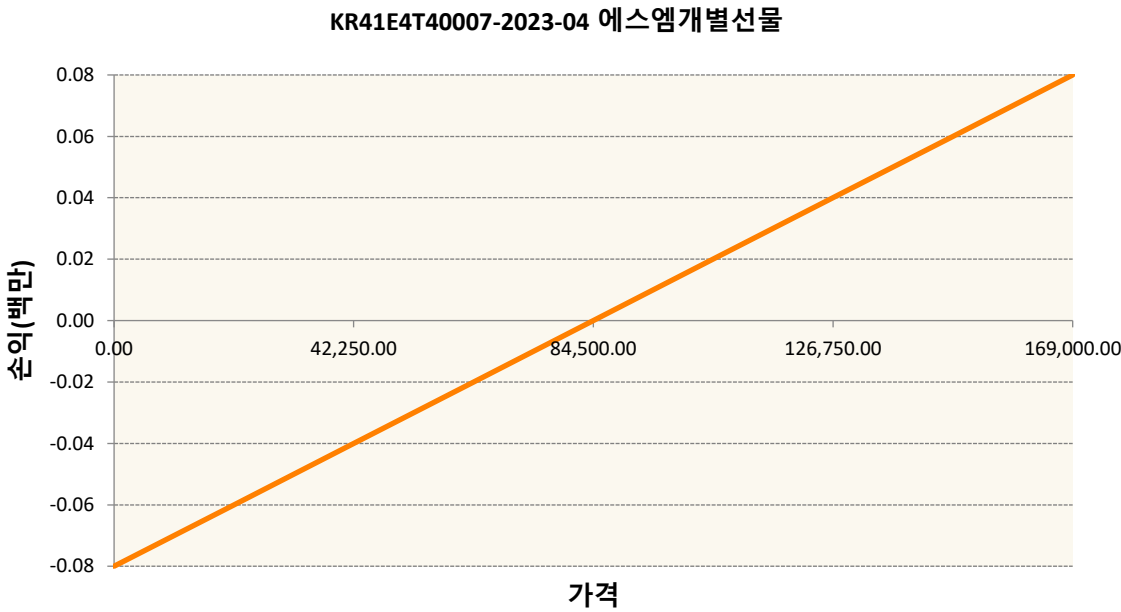
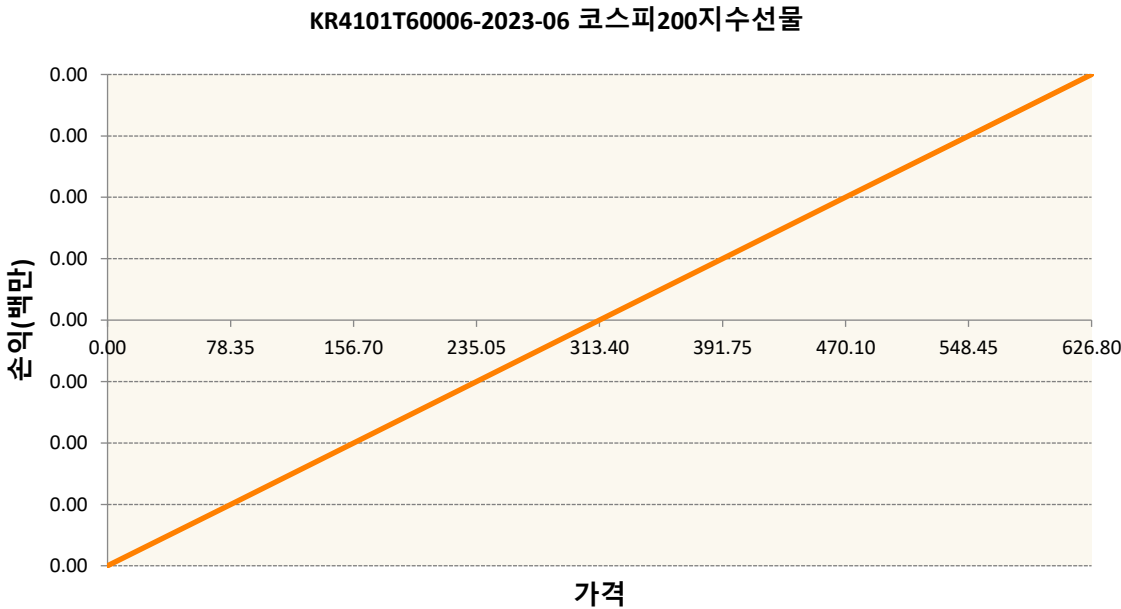
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

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	1,346	0	1,346	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 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	2023-03-20
기준일	2023-03-17

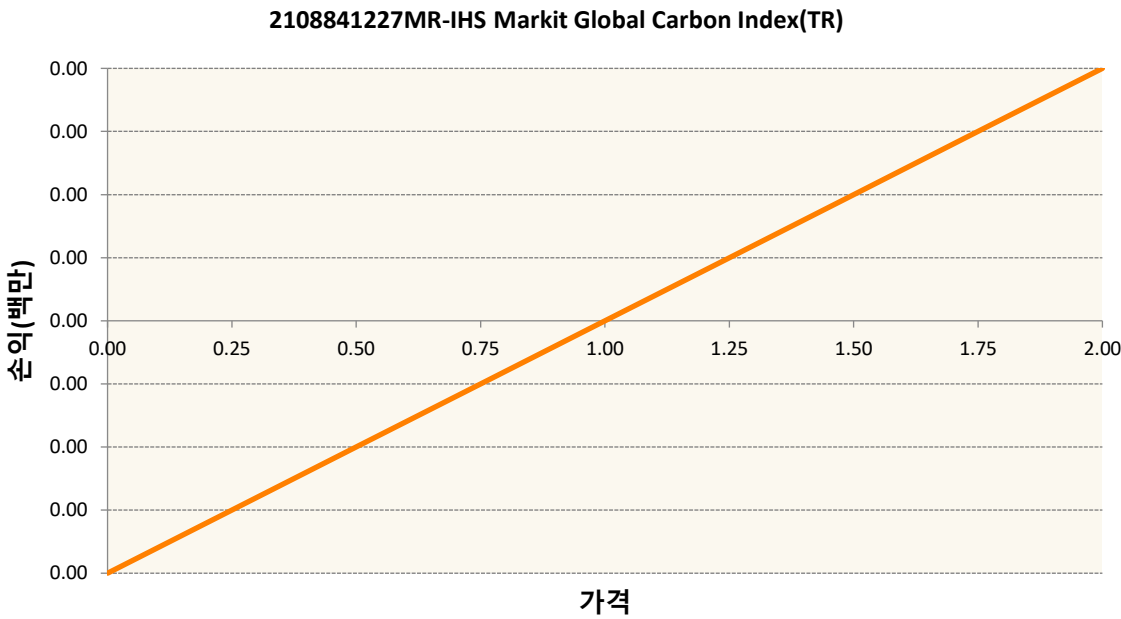
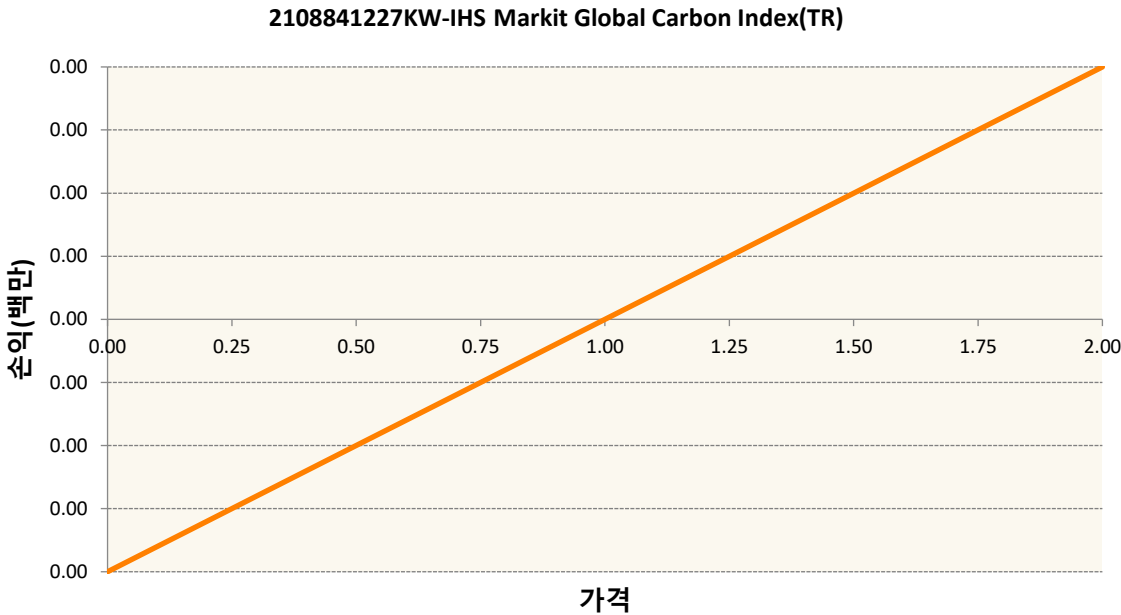
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

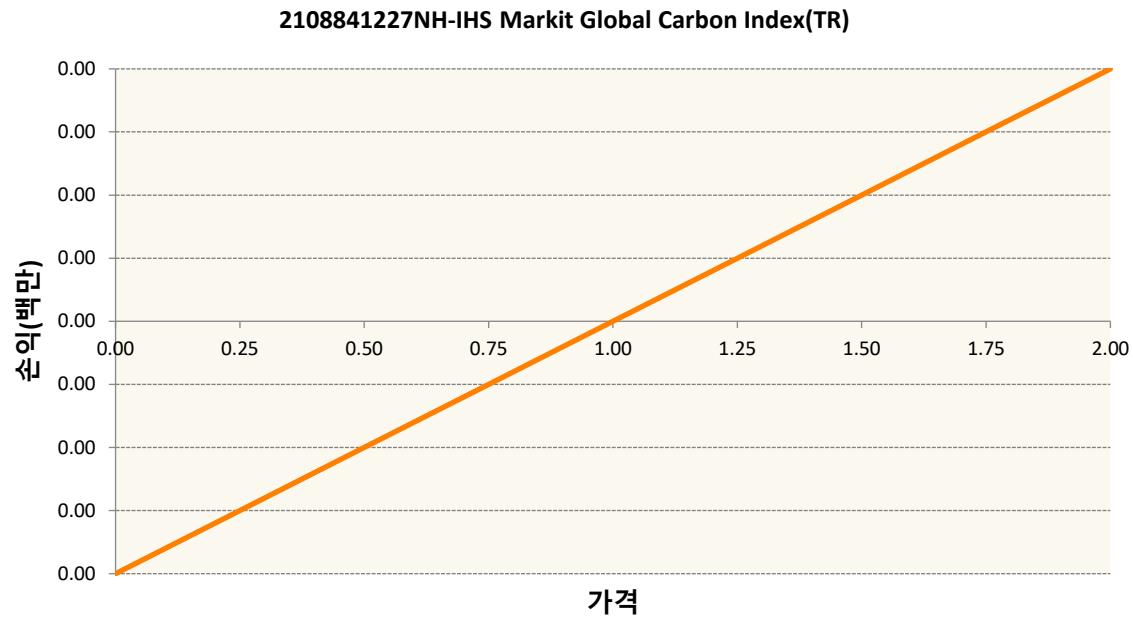
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	24,346	0	24,346	

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108841227IHS Markit Global Carbon Index(TR)		1,664
2108841227IHS Markit Global Carbon Index(TR)		196
2108841227IHS Markit Global Carbon Index(TR)		98

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)		(단위:백만원)
		3,730

공시일	2023-03-20
기준일	2023-03-17

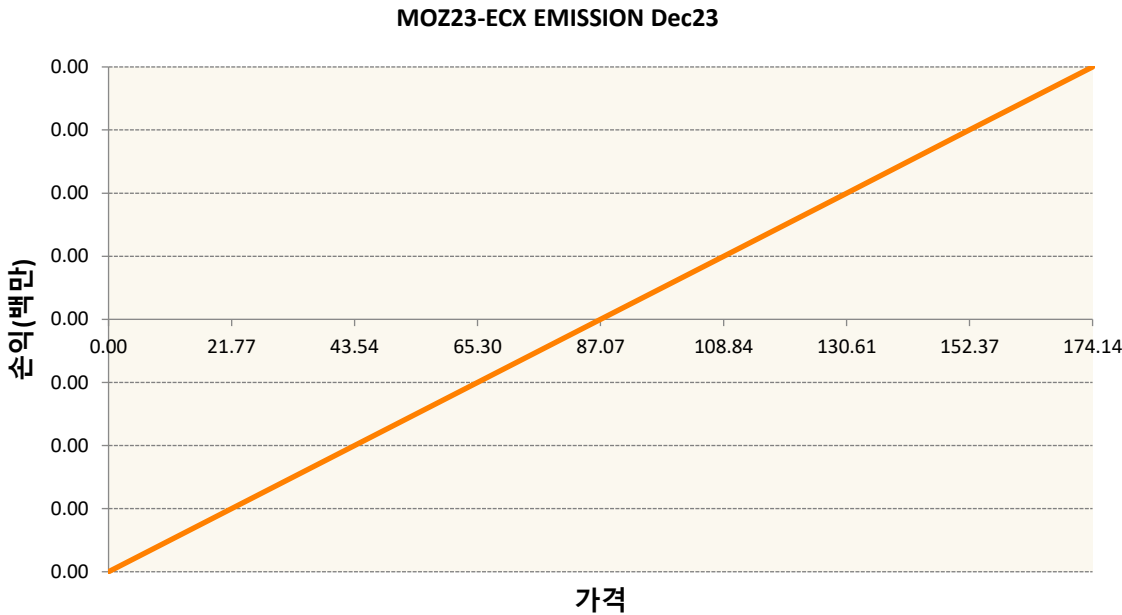
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	9,000	0	9,000	
누계	통화	선도	1,676	4,198	-2,522	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213D2Q KRW/EUR 31-03-23E	144
FXW213D2Q KRW/EUR 31-03-23E	144
FXW213D36(EUR/KRW 31-03-23E	44
FXW213D39(KRW/EUR 31-03-23E	47
FXW213D3F(EUR/KRW 31-03-23E	43
FXW213D3H EUR/KRW 31-03-23E	47
MOZ23 ECX EMISSION Dec23	720

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

(단위:백만원)

2,217

공시일	2023-03-20
기준일	2023-03-17

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)	3
SWCSI00000 신한CSI Index 221222 (키움)	3
SWCSI00000 신한CSI Index 221222 (미래)	3
SWCSI00000 신한CSI Index 221222 (메리츠)	3

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

(단위:백만원)

19

공시일	2023-03-20
기준일	2023-03-17

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	2023-03-20
기준일	2023-03-17

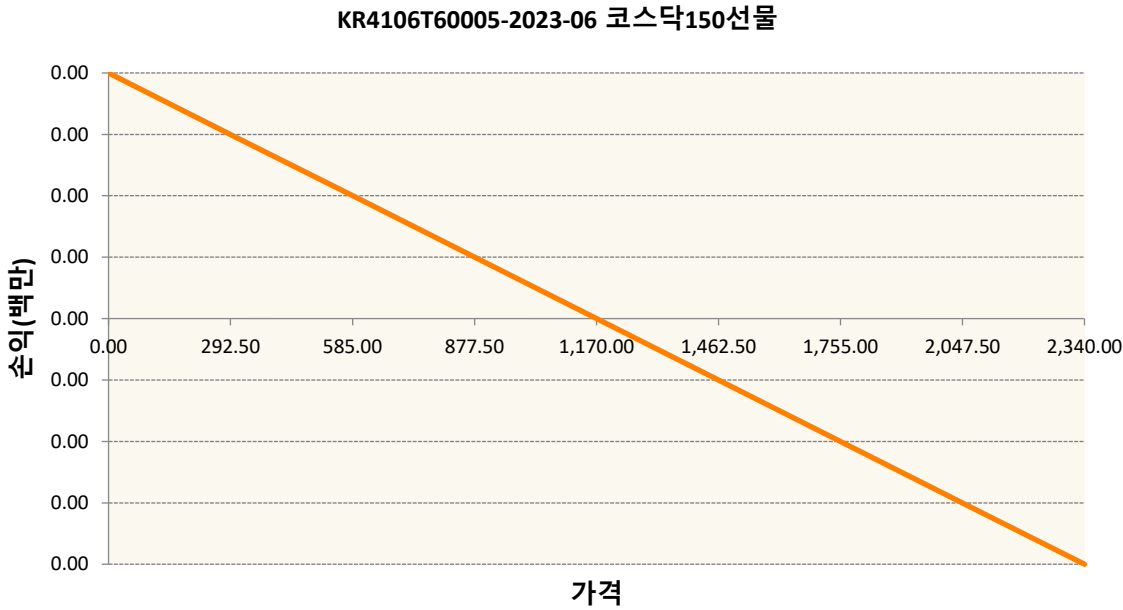
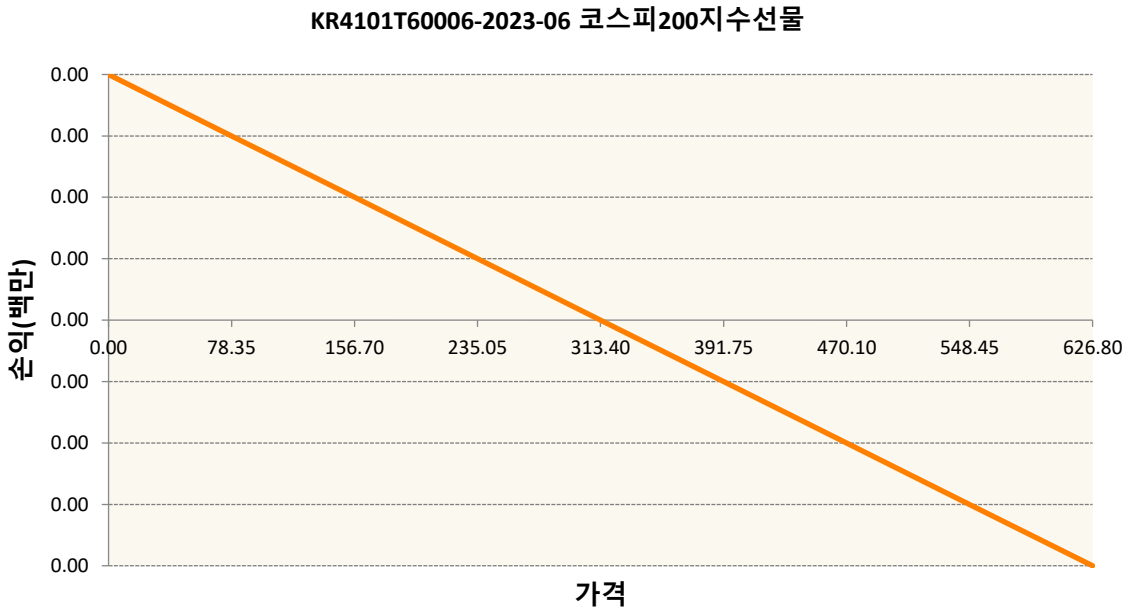
에쿼티알파일반사모혼합자산

1. 계약금액

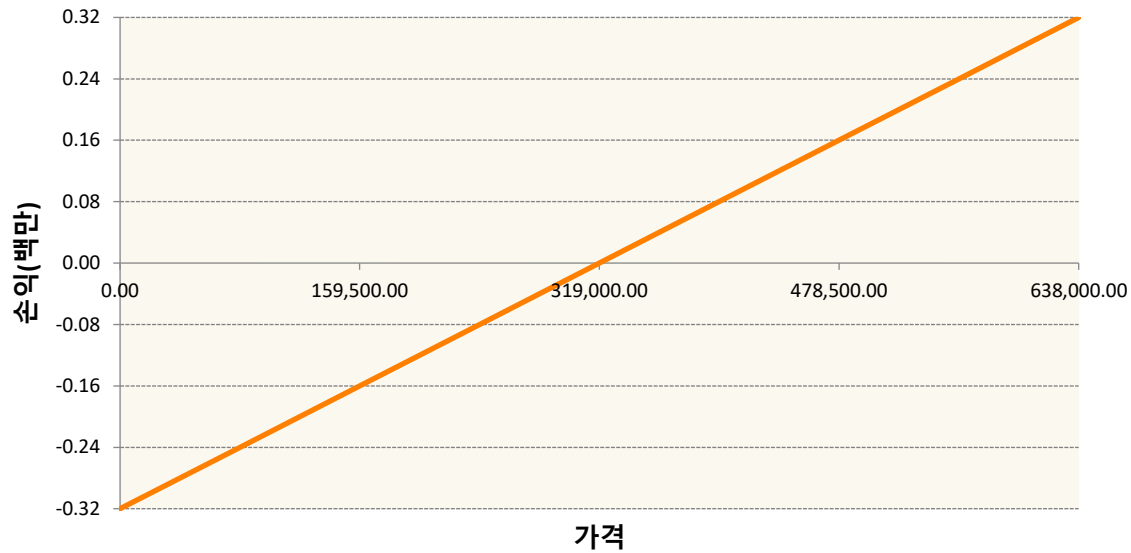
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	823	391	432	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	361	3,030	-2,668	장내
누계	유가증권	스왑	0	0	0	장외

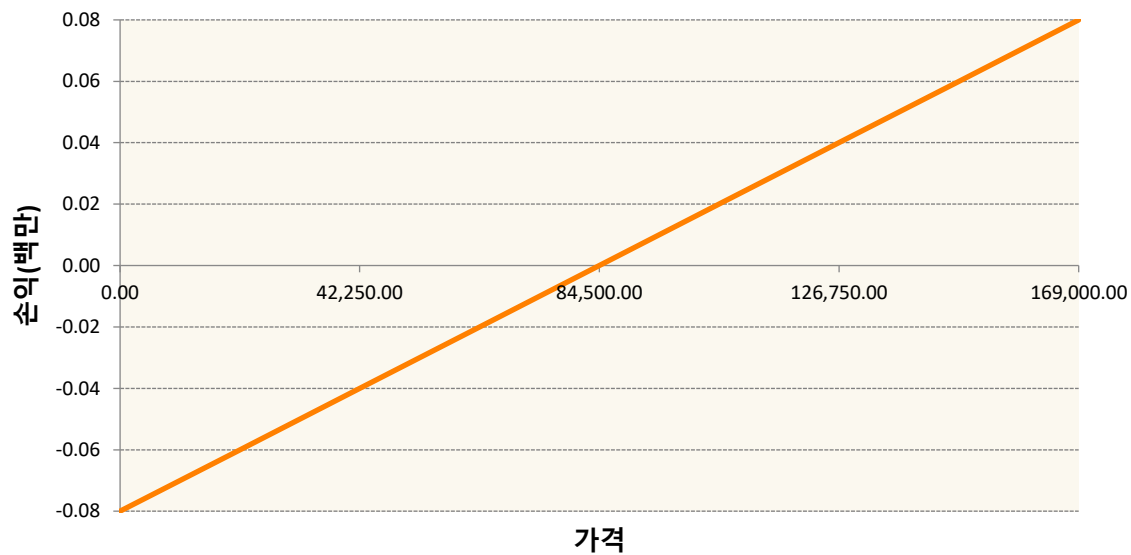
2. 만기시점의 손익구조



KR4113T40003-2023-04 POSCO홀딩스개별선물



KR41E4T40007-2023-04 에스엠개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101T600 2023-06 코스피200지수선물	125
KR4106T600 2023-06 코스닥150선물	117
KR4113T400 2023-04 POSCO홀딩스개별선물	26
KR41E4T400 2023-04 에스엠개별선물	3
KRS0004054 SWAP_MICROSOFT CP_0221	1
KRS0004054 SWAP_FIRST TRUST ECL_0221	0.35
KRS0004099 SWAP_MICRON TECH_0308	0.24

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

(단위:백만원)

399

공시일	2023-03-20
기준일	2023-03-17

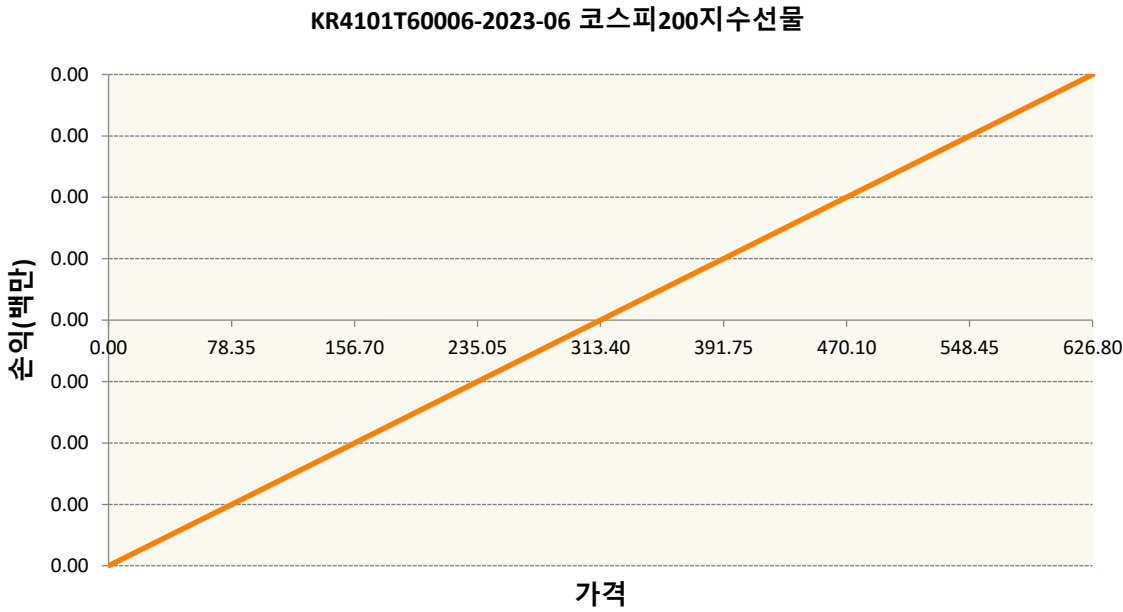
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

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	2,977	0	2,977	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101T60006			2023-06 코스피200지수선물				237
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-237	-237	-237	-237	-237	-237	-237
-5.33%	-158	-158	-158	-158	-158	-158	-158
-2.67%	-79	-79	-79	-79	-79	-79	-79
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	79	79	79	79	79	79	79
5.33%	158	158	158	158	158	158	158
8.00%	237	237	237	237	237	237	237

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

(단위:백만원)

255

공시일	2023-03-20
기준일	2023-03-17

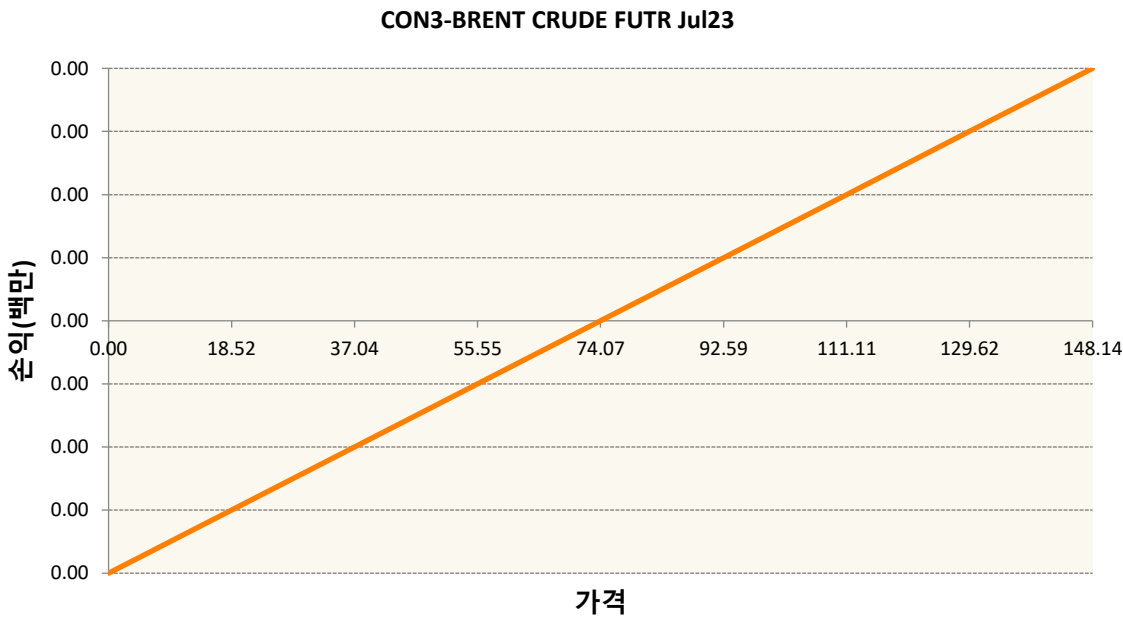
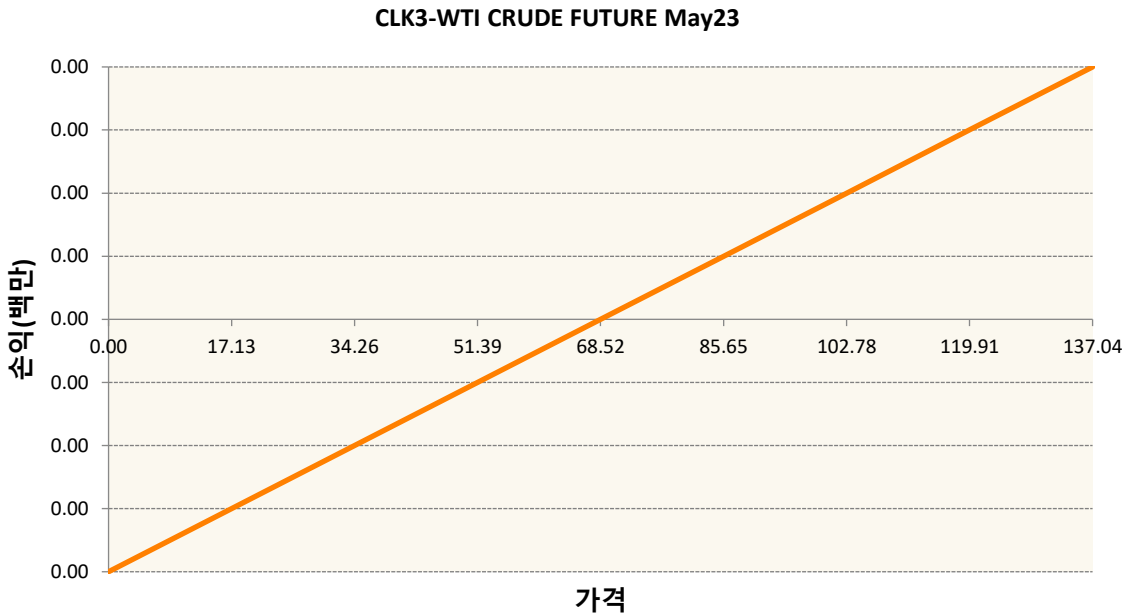
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

1. 계약금액

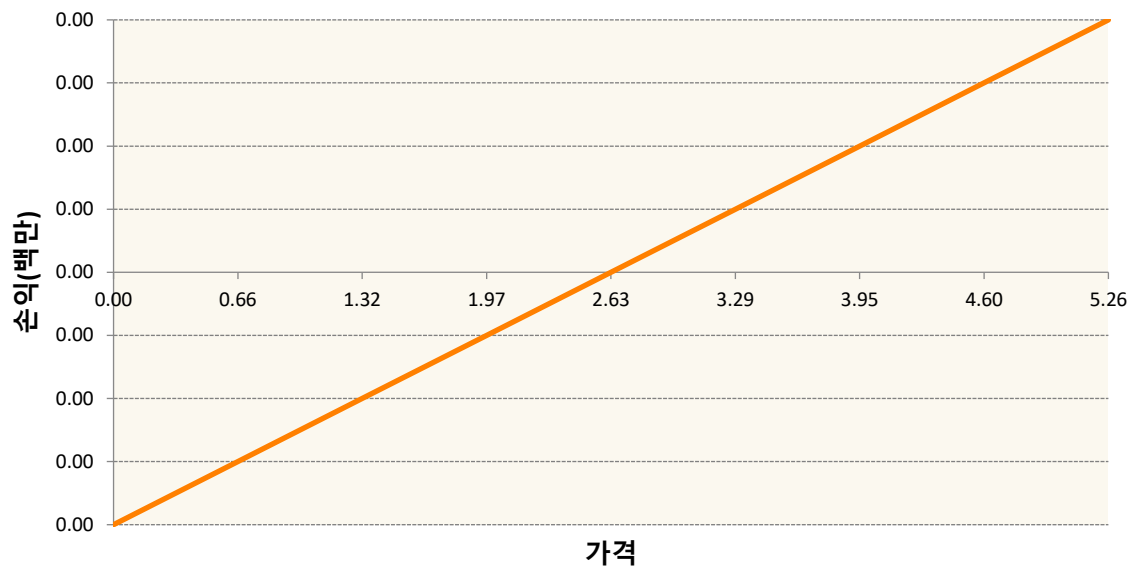
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,556	195	1,361	

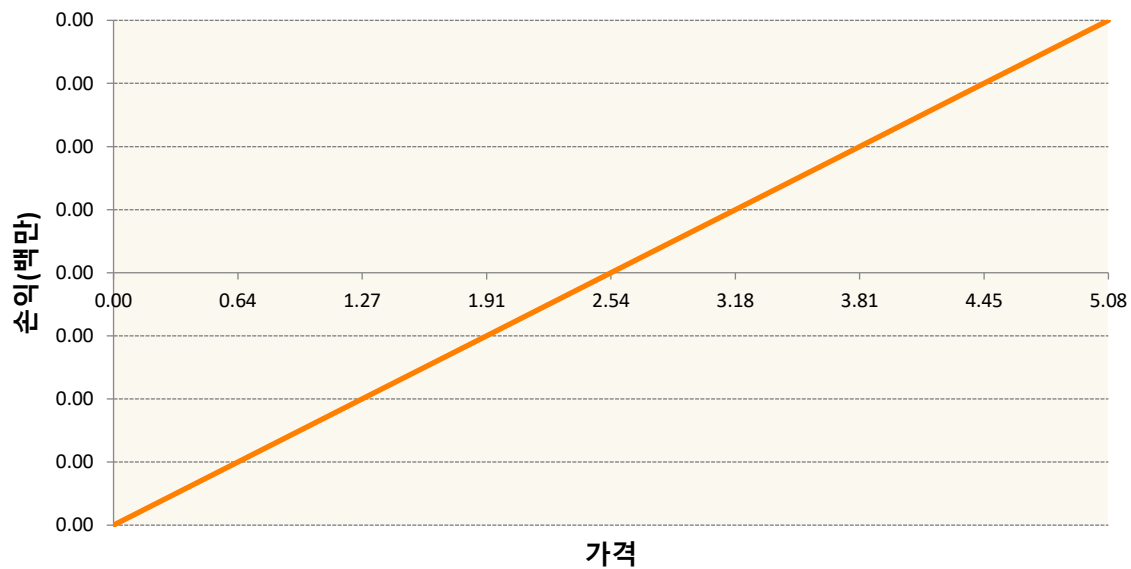
2. 만기시점의 손익구조



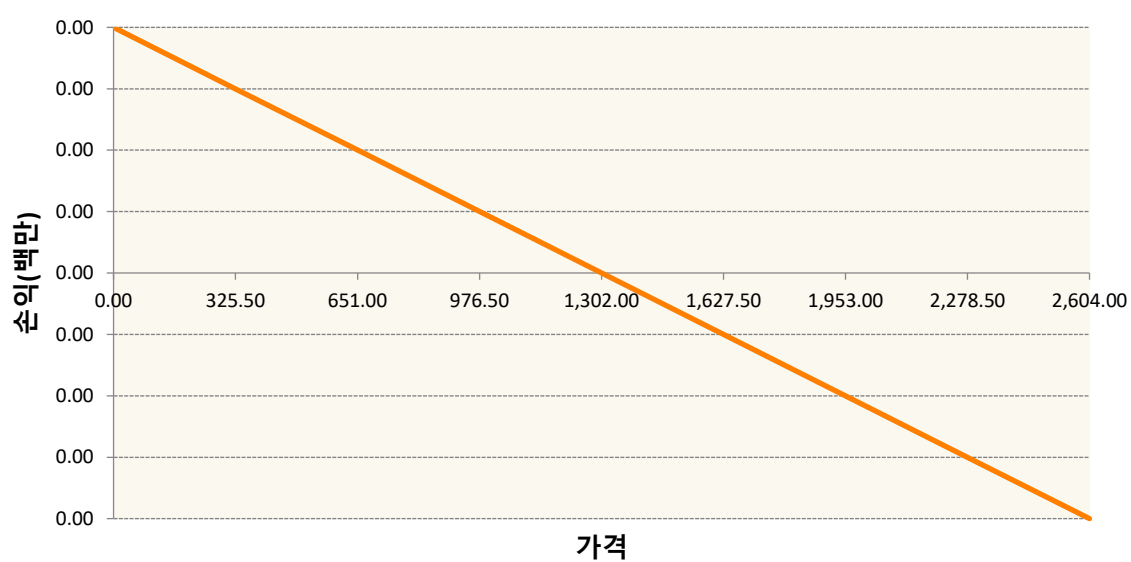
EOK3-E-MINI NATURAL GAS May23



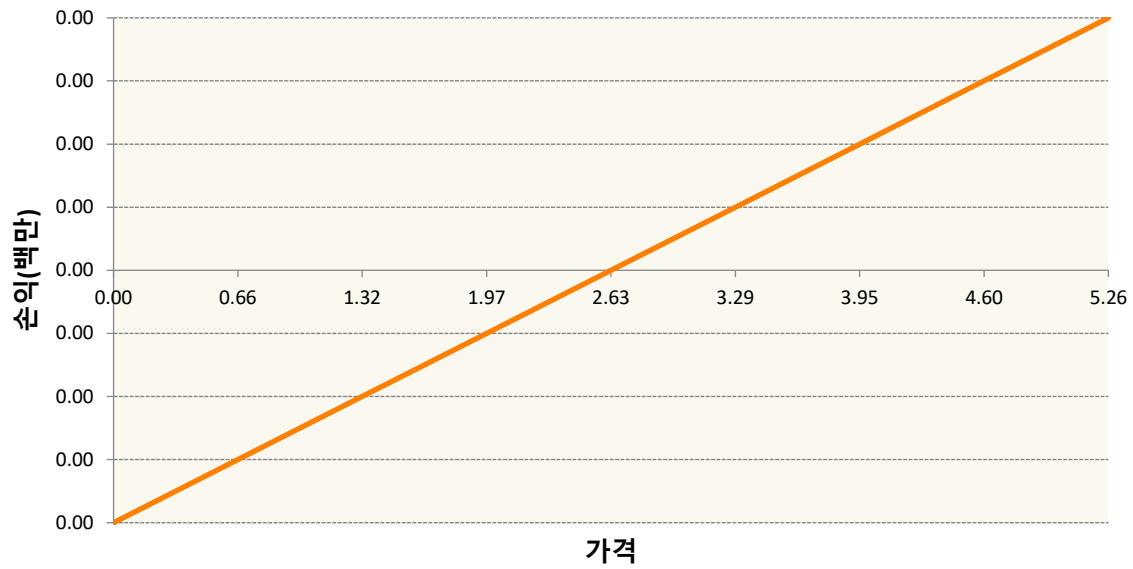
HOK3-NY Harb ULSD Fut May23



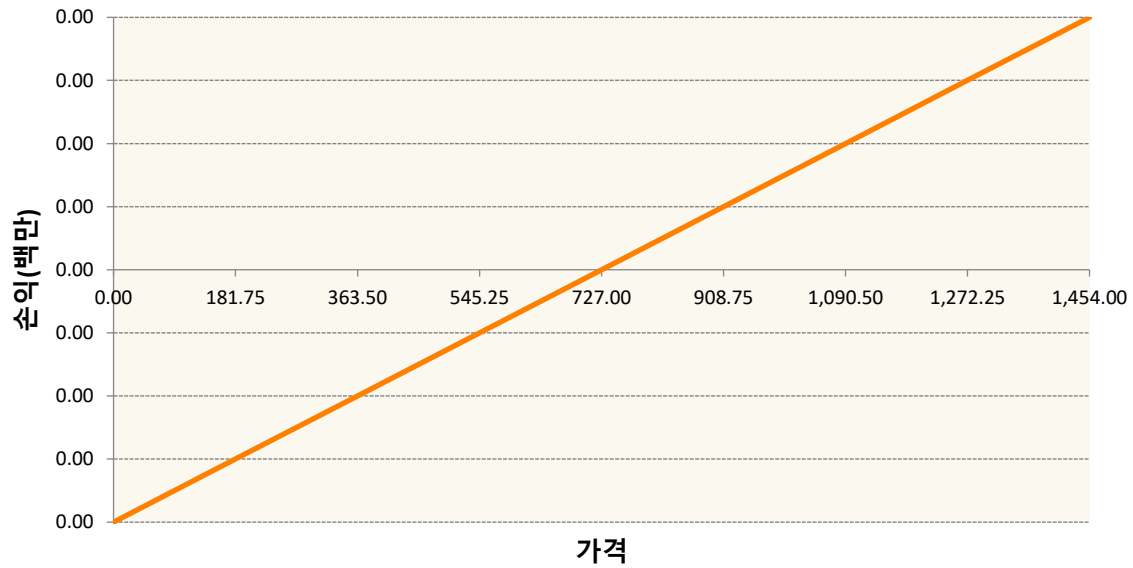
KR4175T40002-2023-04 달러선물



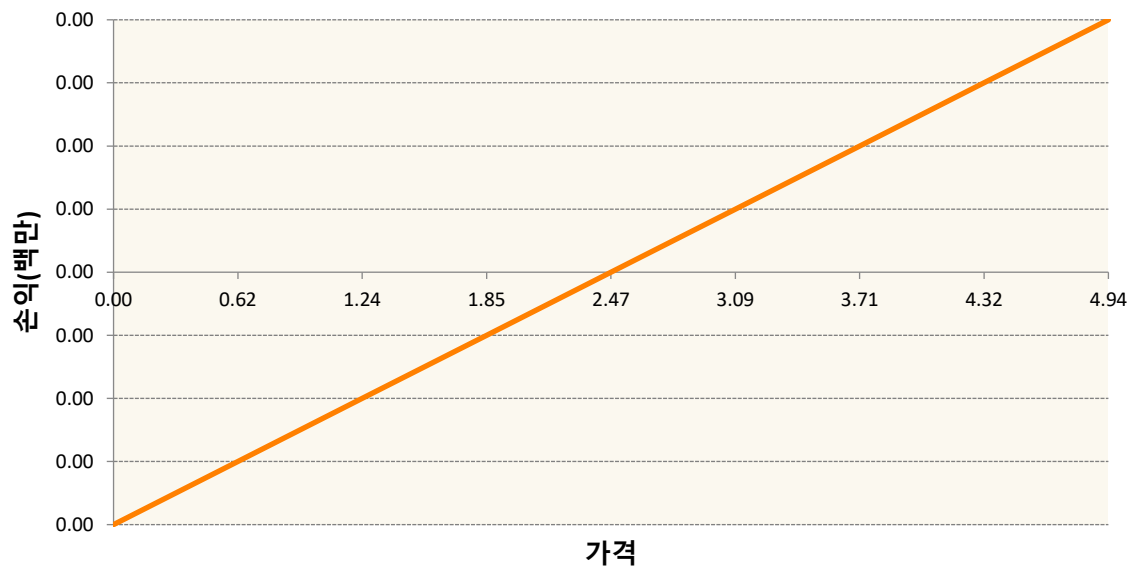
NGK23-NATURAL GAS FUTR May23



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
KR4175T400	2023-04 달러선물	16
NGK23	NATURAL GAS FUTR May23	27
QSK3	Low Su Gasoil G May23	15
XBK3	GASOLINE RBOB FUT May23	11

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

388