

공시일	2023-03-22
기준일	2023-03-21

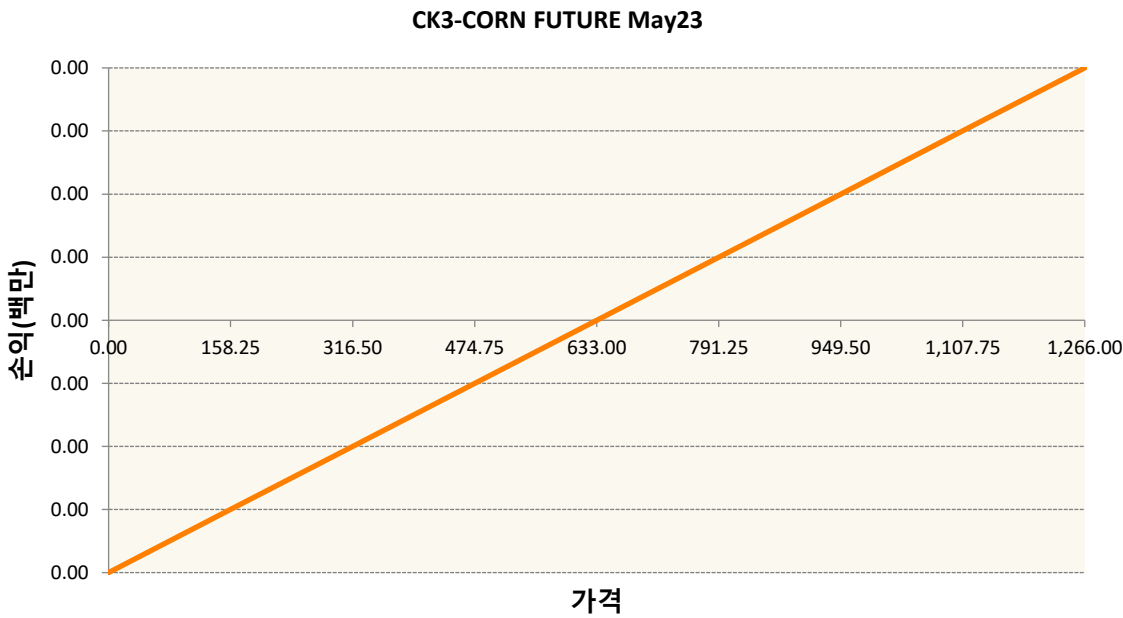
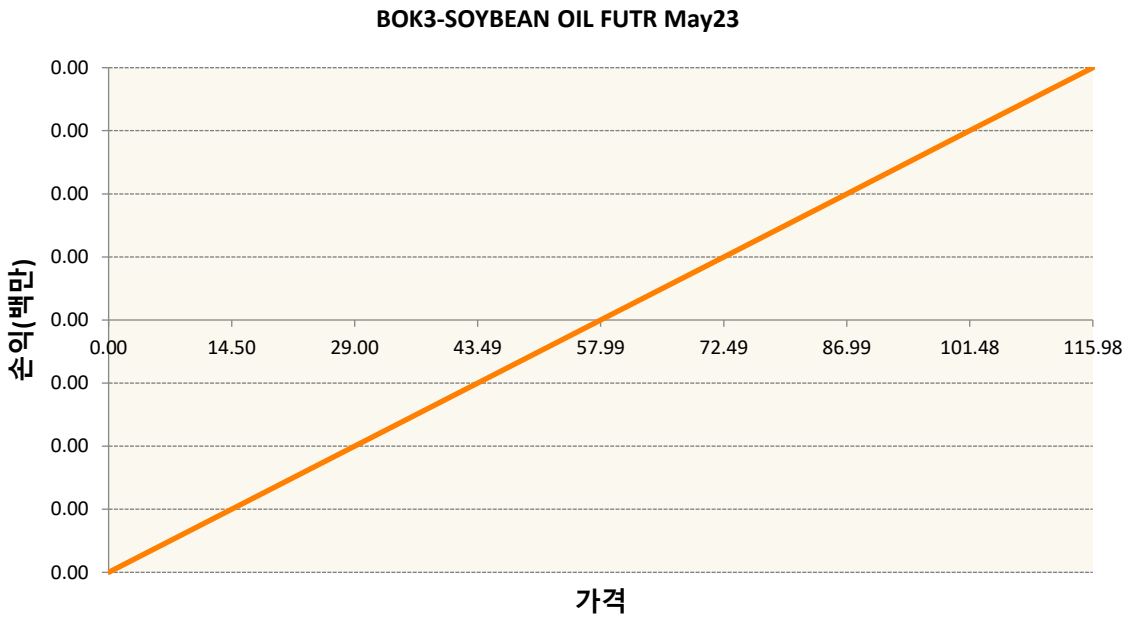
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

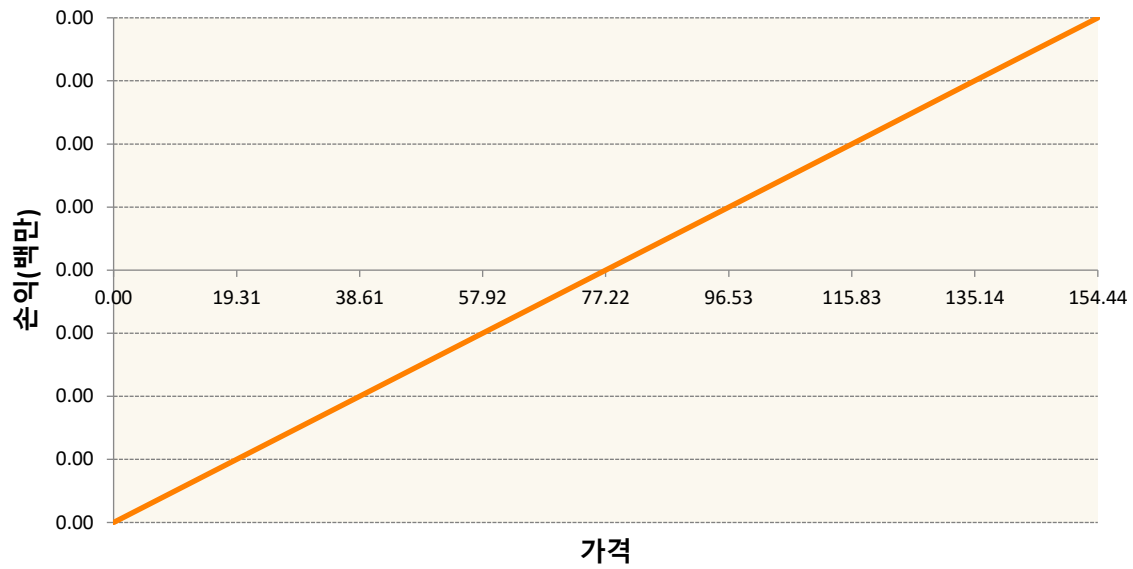
(단위:USD 백만)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,568	523	5,044	

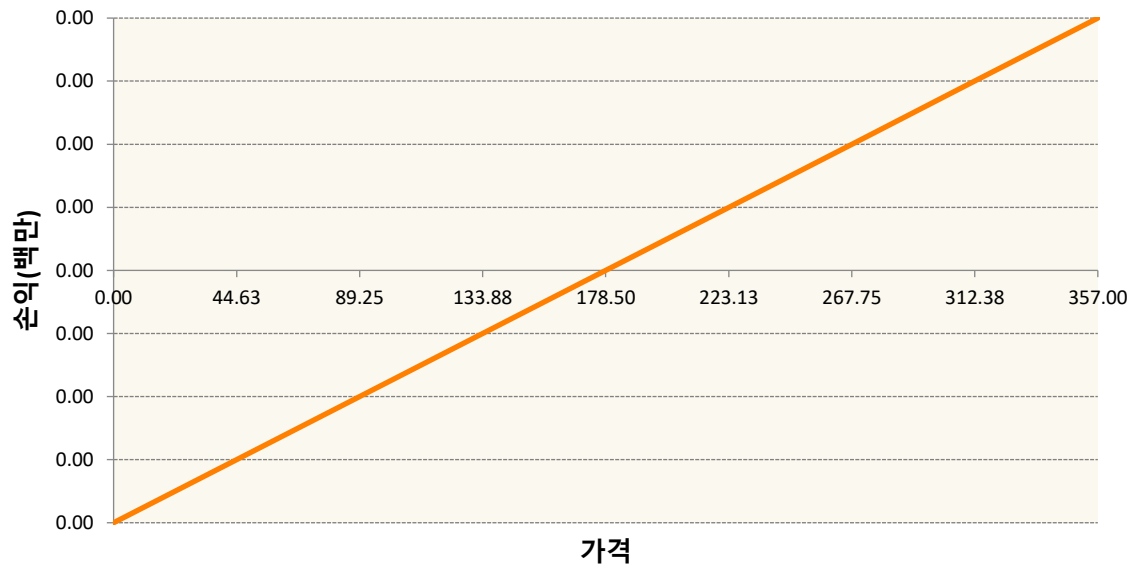
2. 만기시점의 손익구조



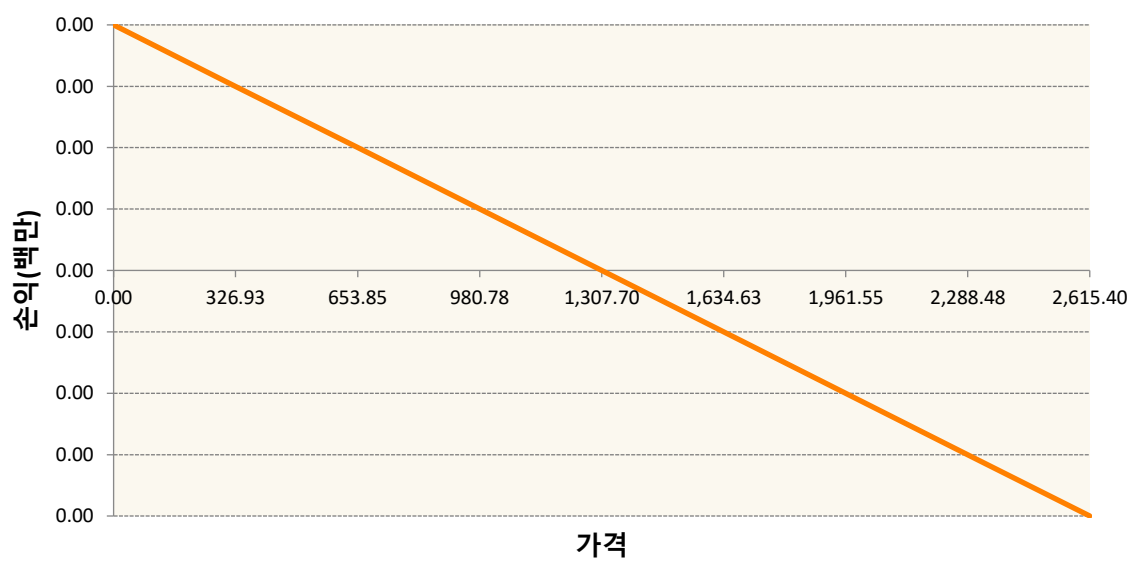
CTK3-COTTON NO.2 FUTR May23



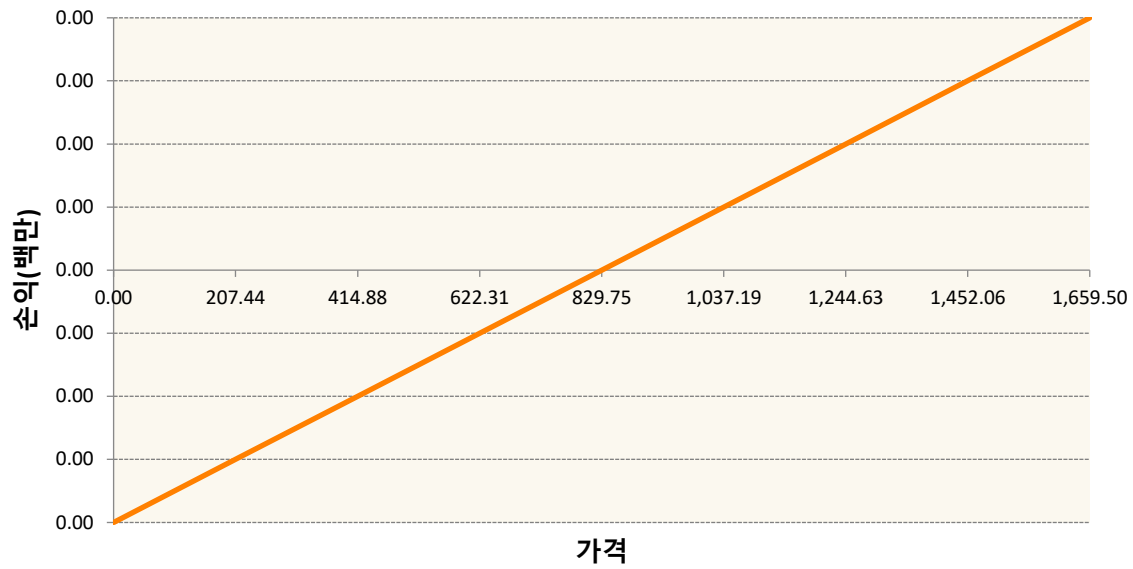
KCK3-COFFEE 'C' FUTURE May23



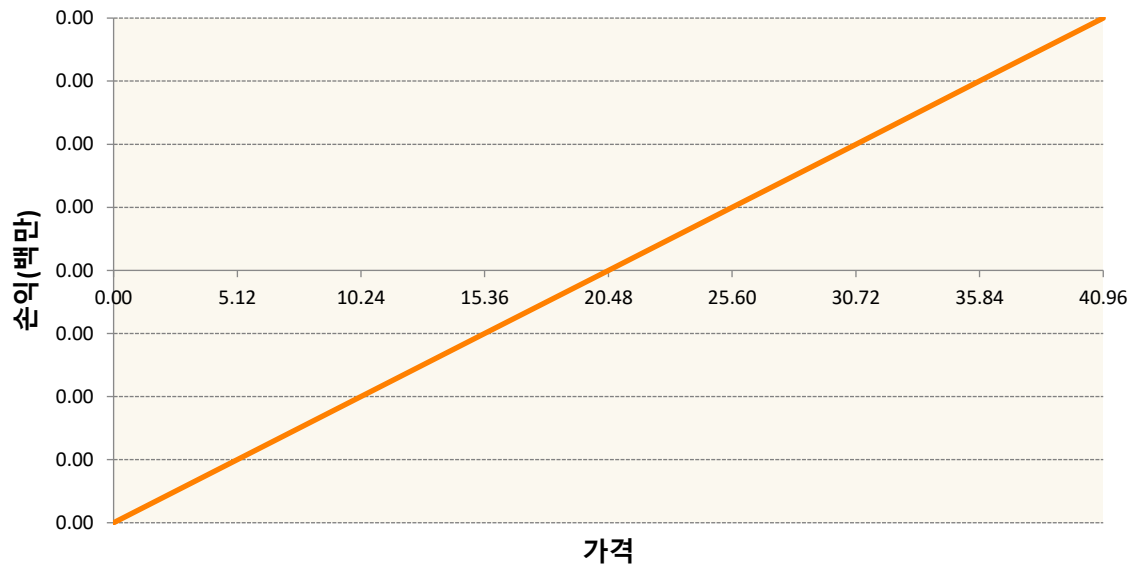
KR4175T40002-2023-04 달러선물



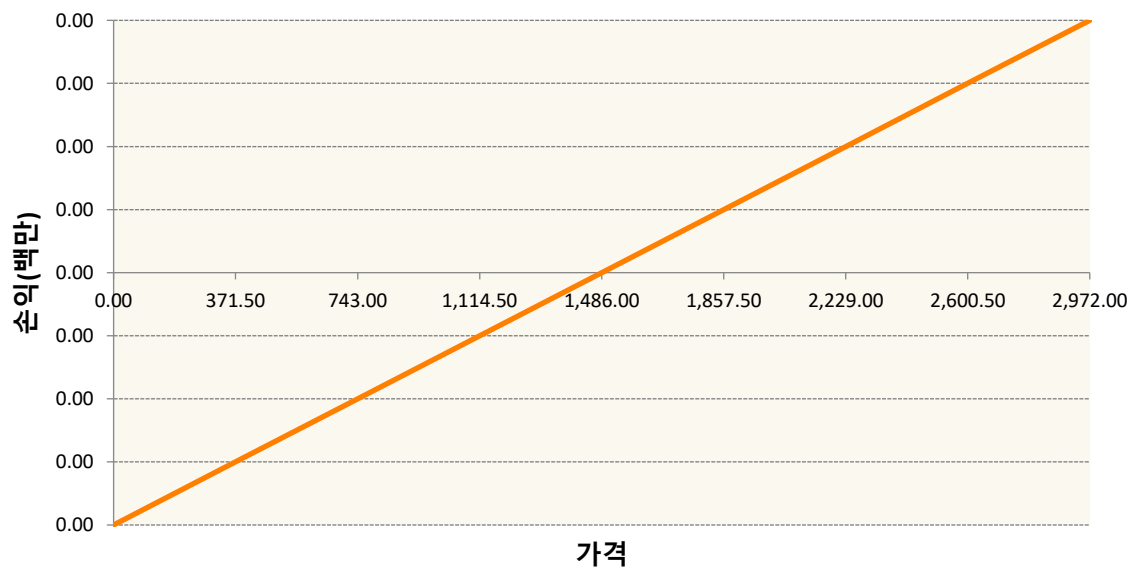
KWK3-KC HRW WHEAT FUT May23



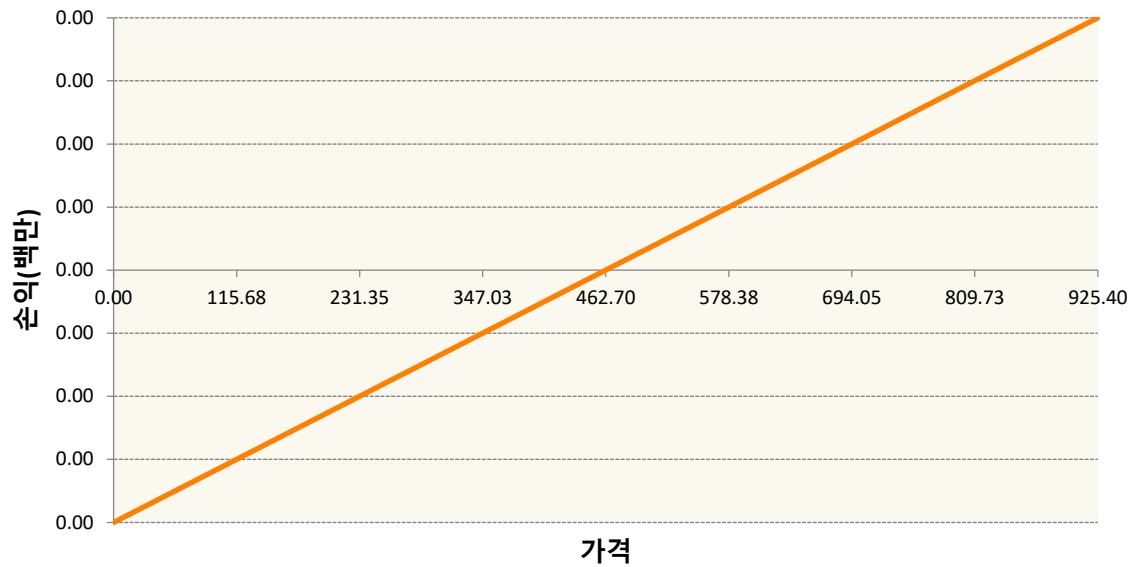
SBK3-Sugar #11 (WORLD) May23



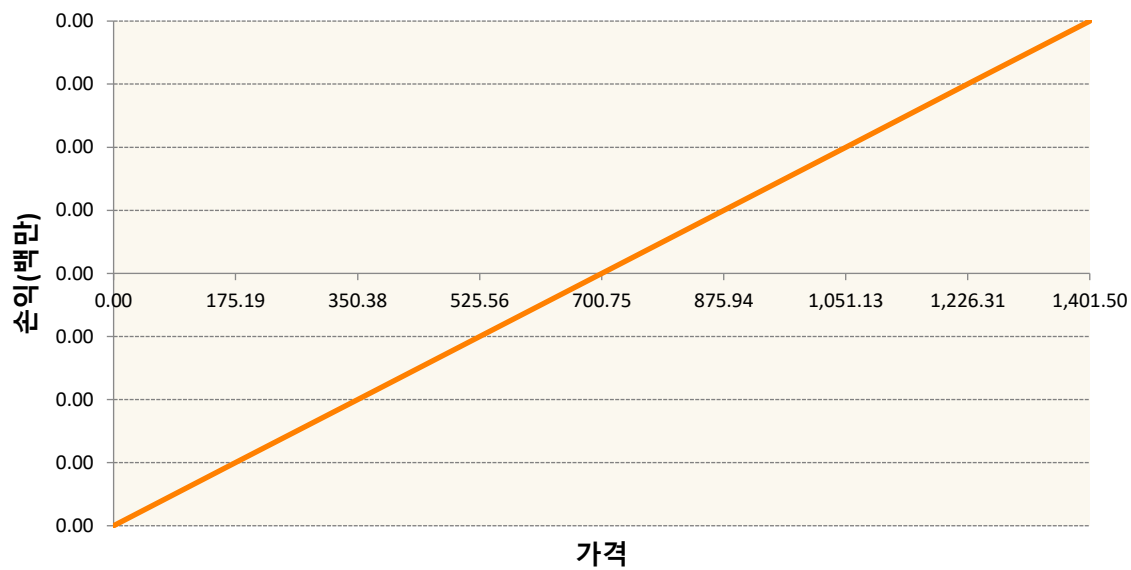
SK3-SOYBEAN FUTURE May23



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	2023-03-22
기준일	2023-03-21

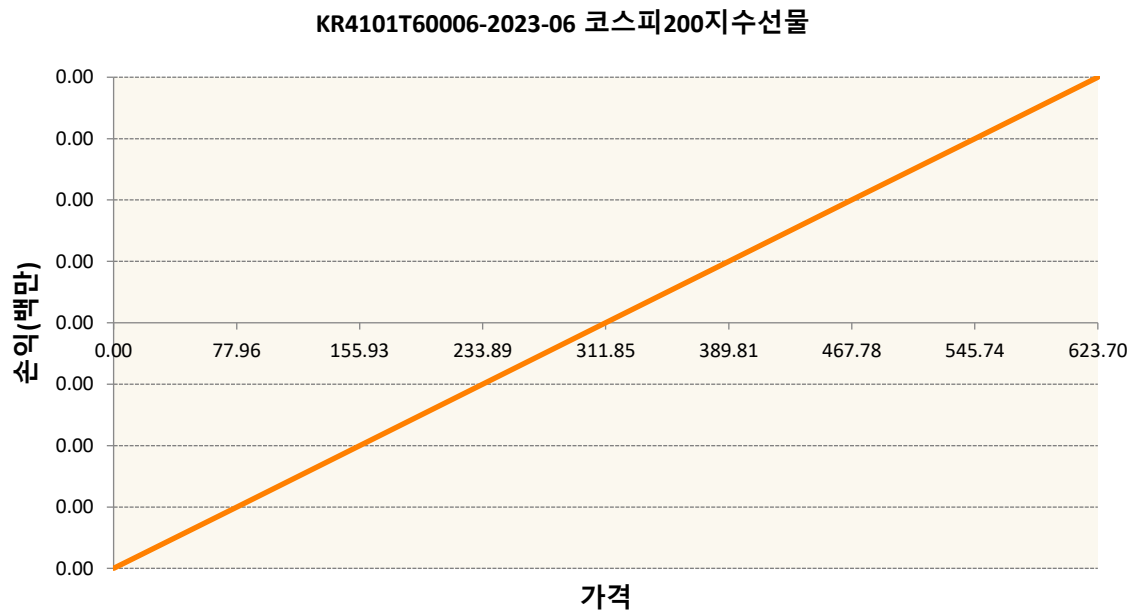
스마트인덱스모

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	2,651	0	2,651	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101T60006		2023-06 코스피200지수선물					211
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-211	-211	-211	-211	-211	-211	-211
-5.33%	-141	-141	-141	-141	-141	-141	-141
-2.67%	-70	-70	-70	-70	-70	-70	-70
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	70	70	70	70	70	70	70
5.33%	141	141	141	141	141	141	141
8.00%	211	211	211	211	211	211	211

공시일	2023-03-22
기준일	2023-03-21

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	359
-----------------------------	-----

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

	466
--	-----

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2023-03-22
기준일	2023-03-21

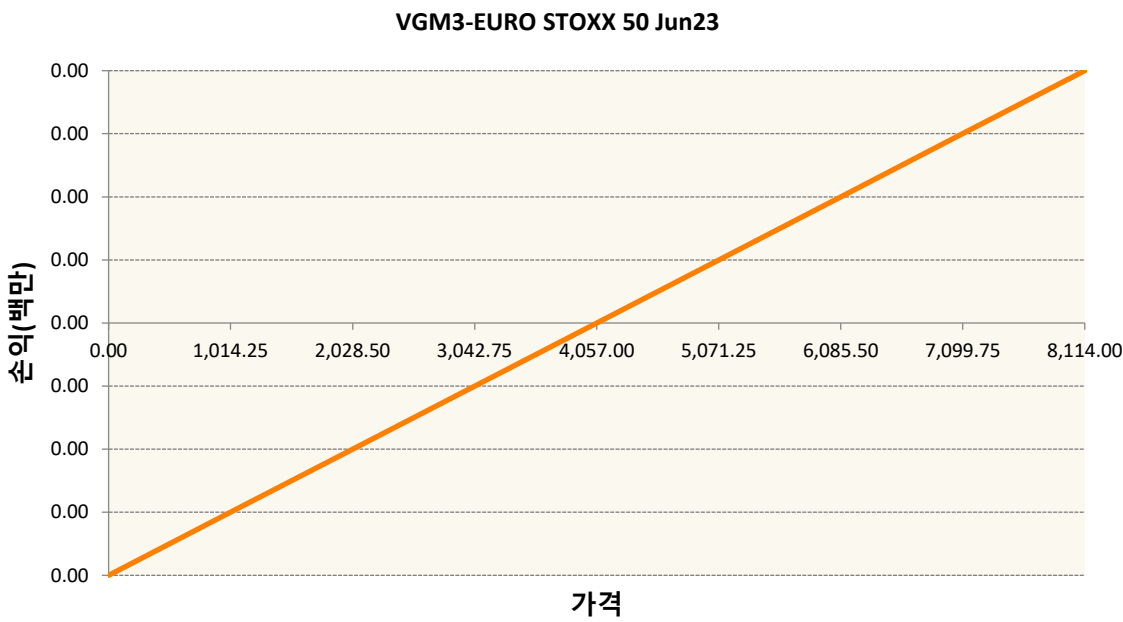
유로인덱스모(주식-파생형)

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	2023-03-22
기준일	2023-03-21

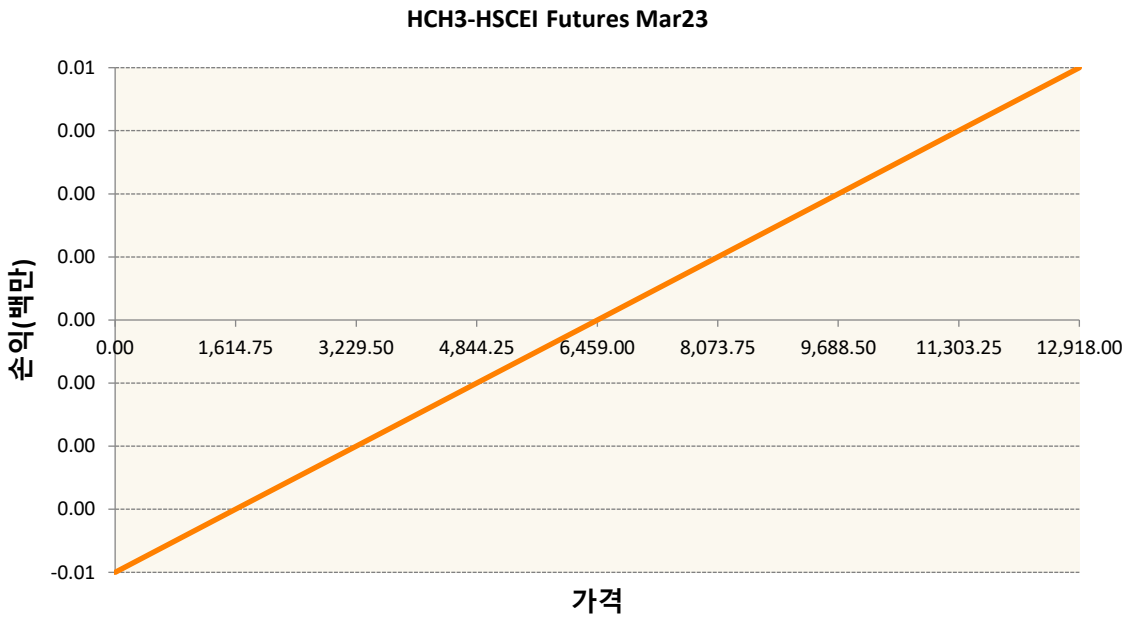
차이나인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,019	0	1,019	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCH3	HSCEI Futures Mar23	82
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

110

공시일	2023-03-22
기준일	2023-03-21

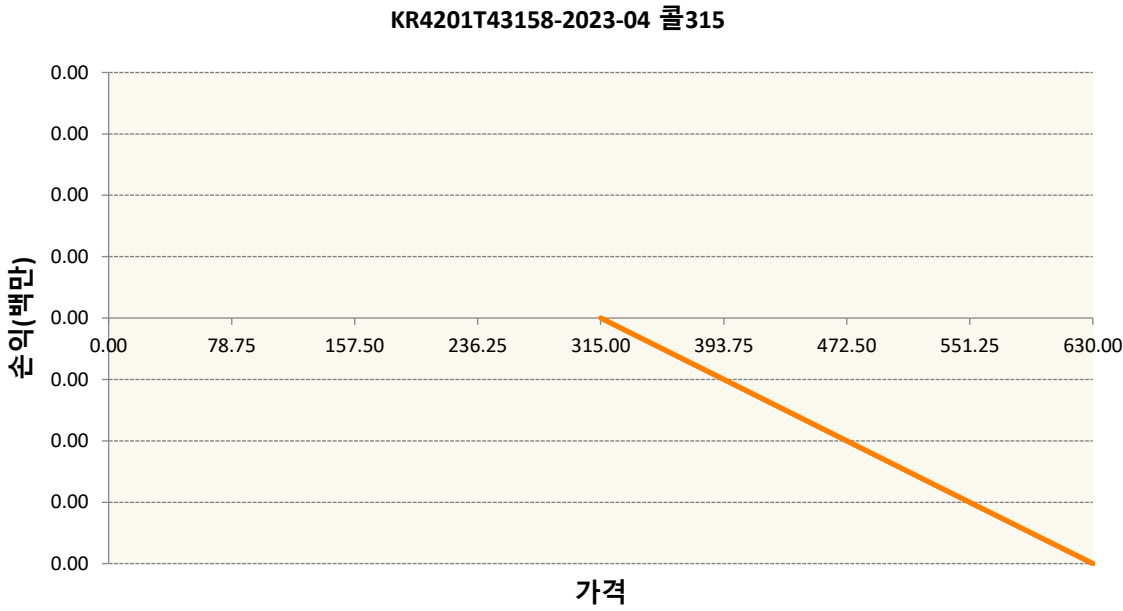
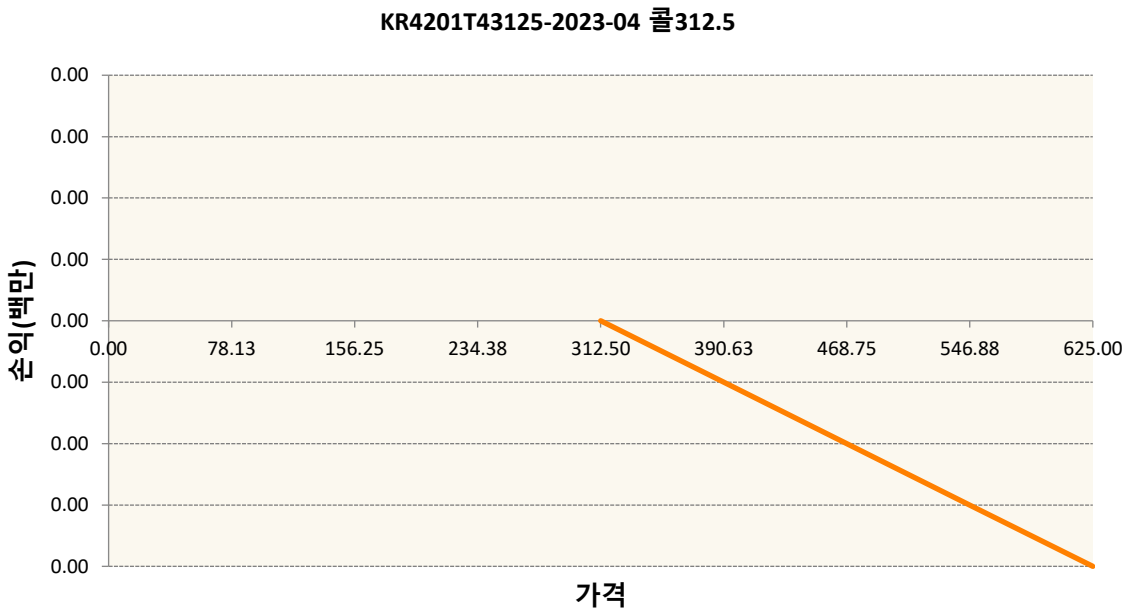
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

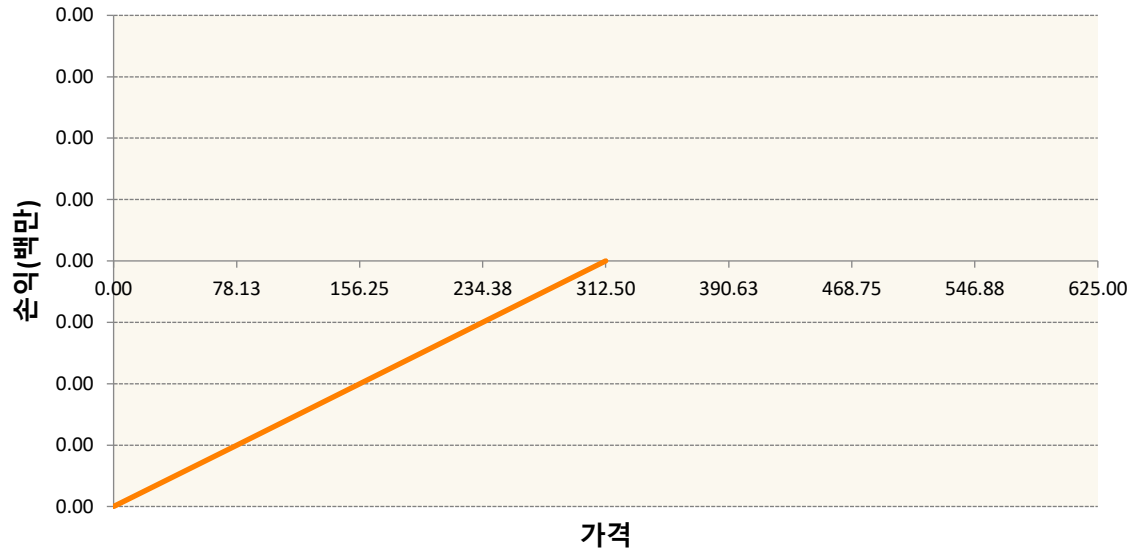
(단위:백만원)

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								675
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	265	259	251	241	230	218	205	
-5.33%	242	229	214	198	181	163	144	
-2.67%	185	165	143	121	98	75	52	
0%	76	51	25	0	-25	-51	-76	
2.67%	-94	-118	-143	-168	-192	-217	-242	
5.33%	-320	-338	-358	-378	-399	-421	-444	
8.00%	-585	-596	-609	-624	-640	-657	-675	
KR4201T43158 2023-04 콜315								1,905
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	660	647	630	608	581	551	517	
-5.33%	613	583	547	507	463	415	366	
-2.67%	485	431	374	315	253	190	126	
0%	216	145	73	0	-73	-146	-219	
2.67%	-233	-306	-380	-454	-528	-602	-676	
5.33%	-858	-917	-978	-1,042	-1,108	-1,175	-1,243	
8.00%	-1,615	-1,653	-1,695	-1,743	-1,794	-1,848	-1,905	
KR4301T43123 2023-04 풋312.5								595
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-544	-549	-556	-564	-573	-583	-595	
-5.33%	-307	-318	-330	-344	-359	-374	-390	
-2.67%	-99	-117	-135	-154	-173	-192	-212	
0%	65	43	22	0	-22	-43	-65	

2.67%	176	156	135	114	93	72	50
5.33%	240	225	209	191	173	155	136
8.00%	272	262	251	239	225	211	195

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

(단위:백만원)

3,002

공시일	2023-03-22
기준일	2023-03-21

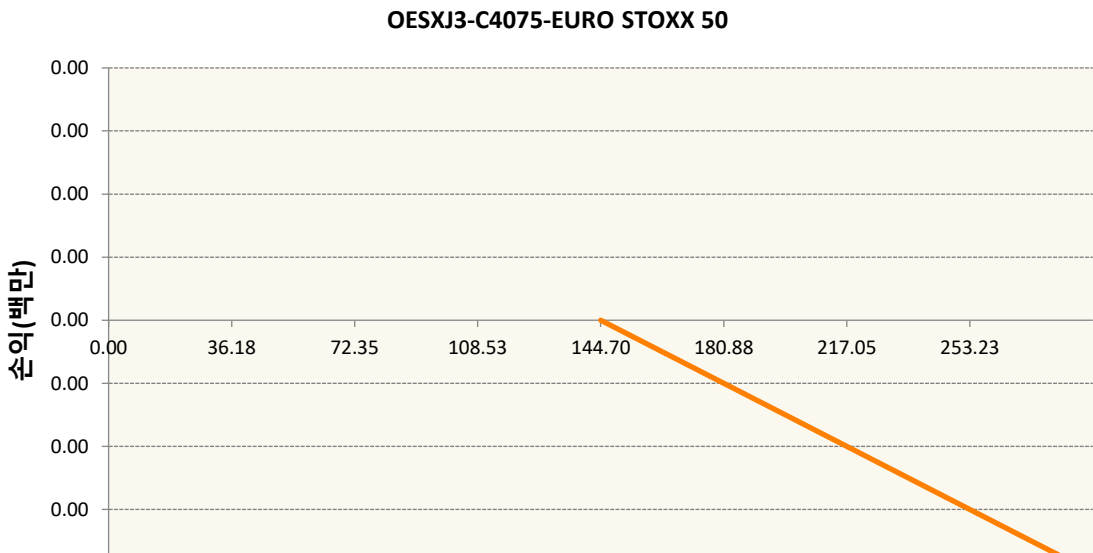
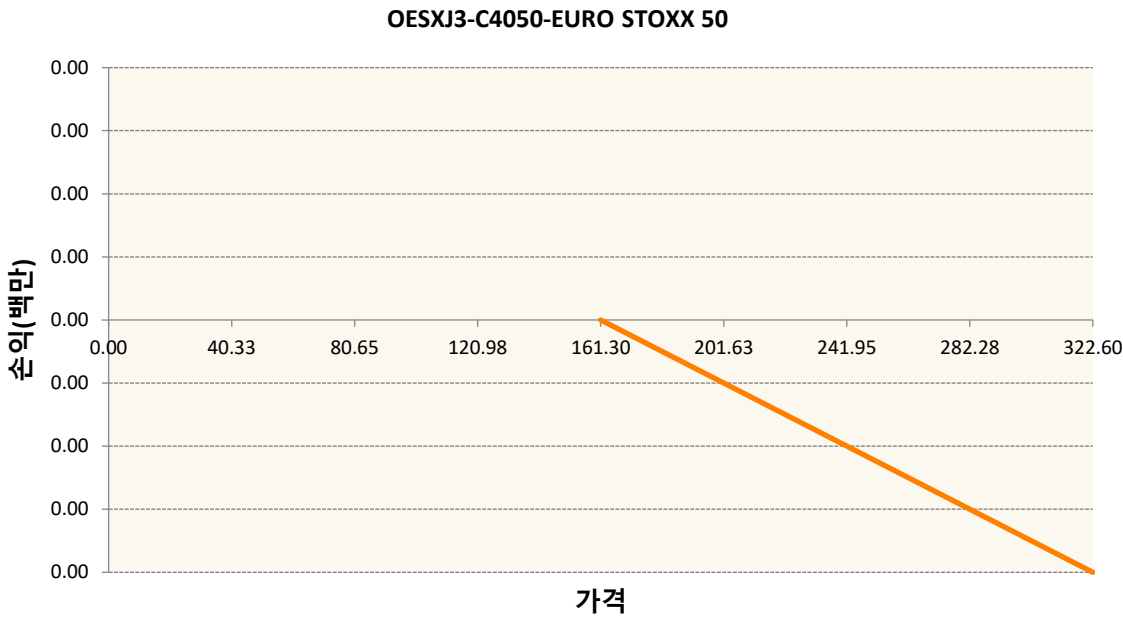
유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

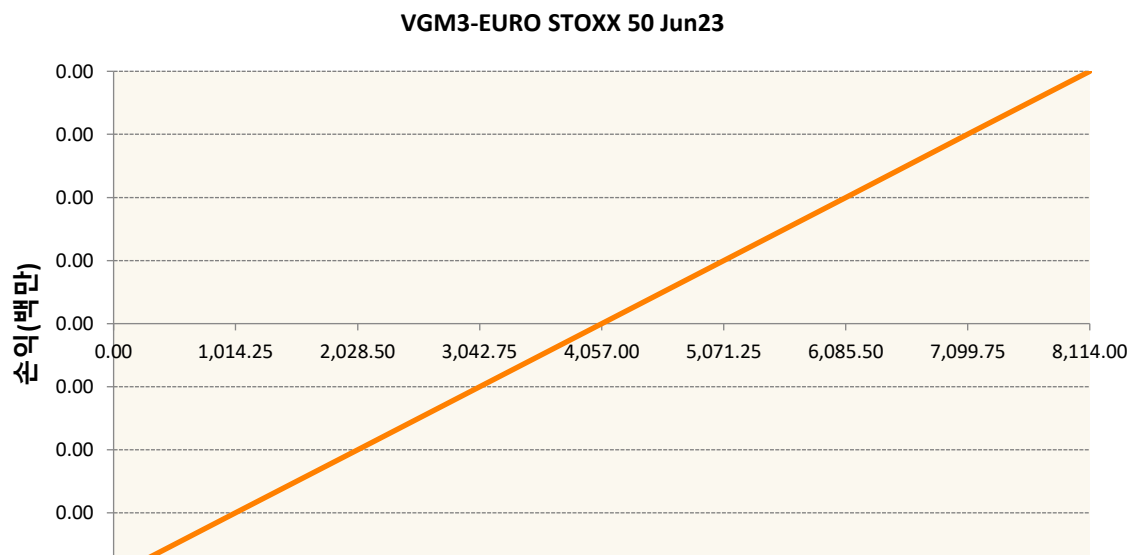
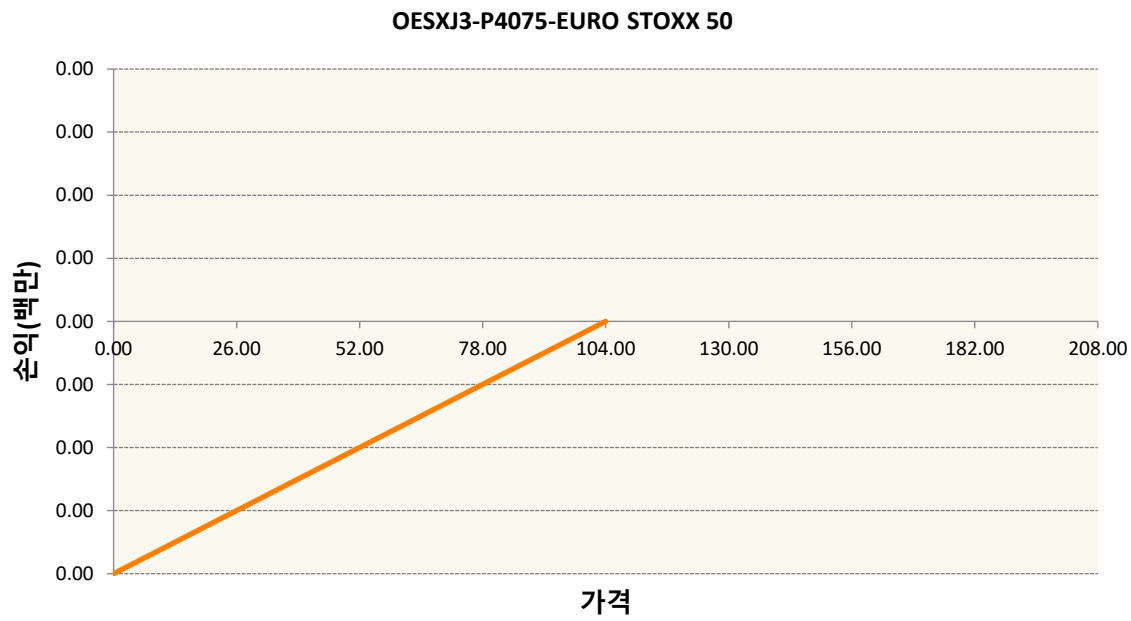
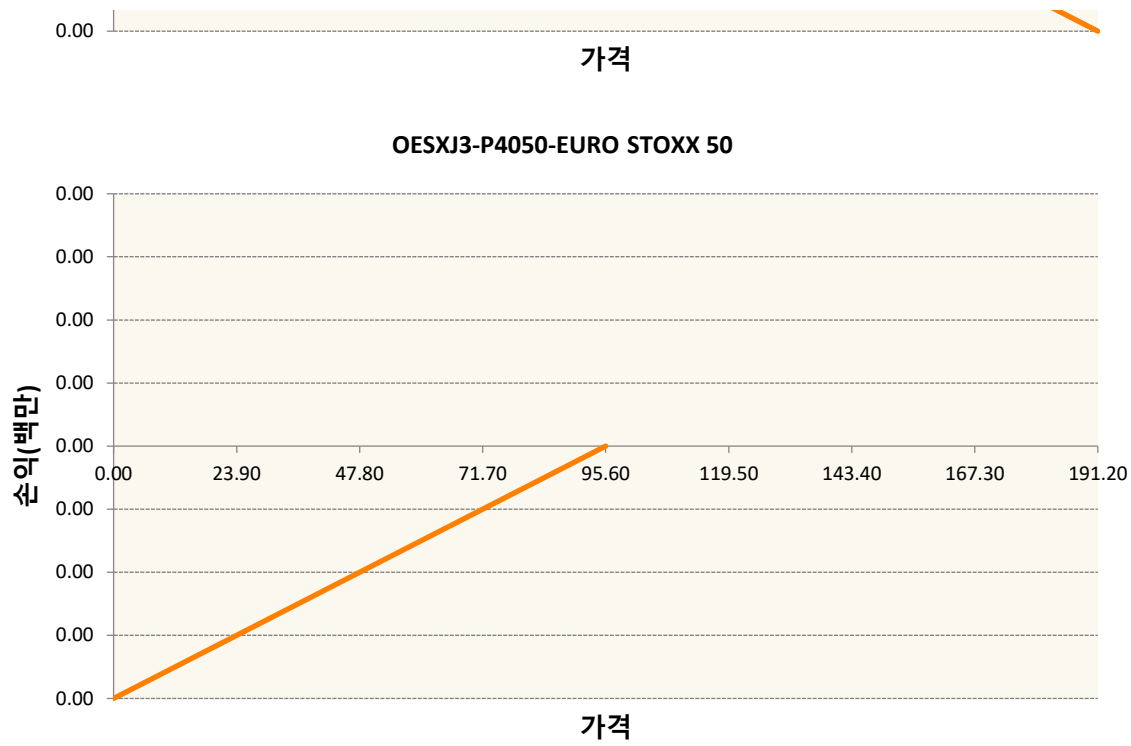
1. 계약금액

(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	904	0	904	
누계	유가증권	옵션	0	106	-106	장내
누계	통화	선도	140	1,825	-1,685	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
OESXJ3-C40 EURO STOXX 50	2
OESXJ3-C40 EURO STOXX 50	3
OESXJ3-P40 EURO STOXX 50	1
OESXJ3-P40 EURO STOXX 50	2
VGM3 EURO STOXX 50 Jun23	72

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

(단위:백만원)

208

공시일	2023-03-22
기준일	2023-03-21

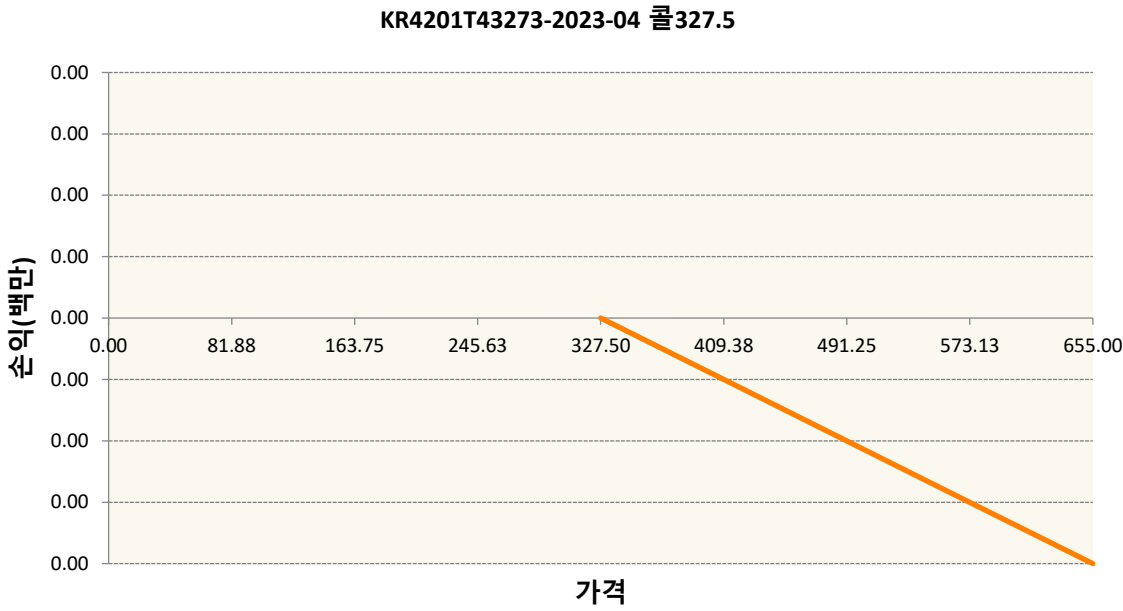
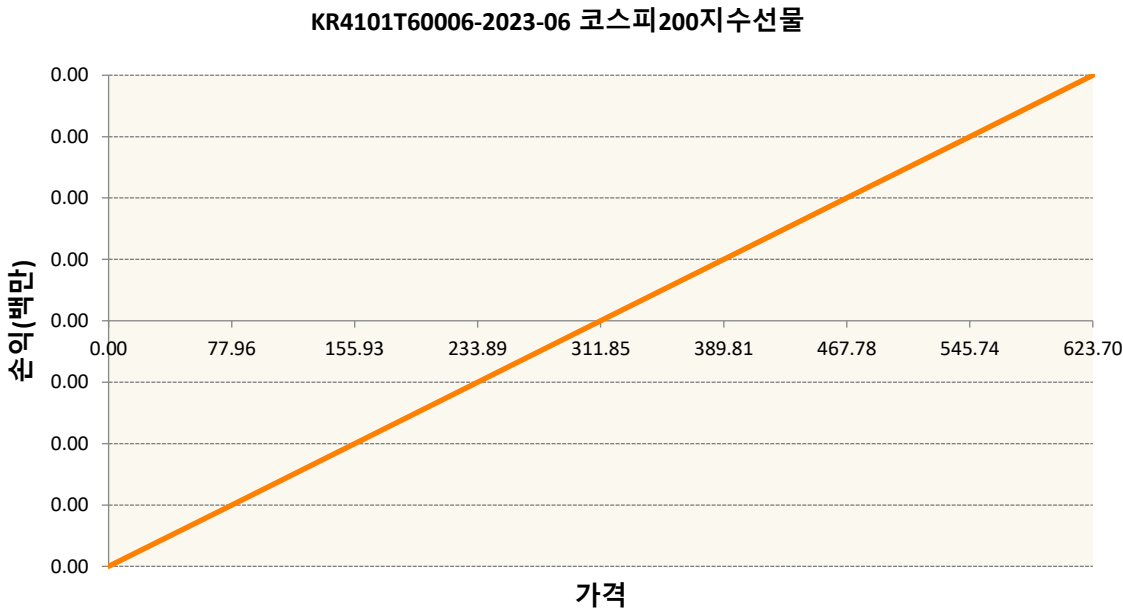
리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

1. 계약금액

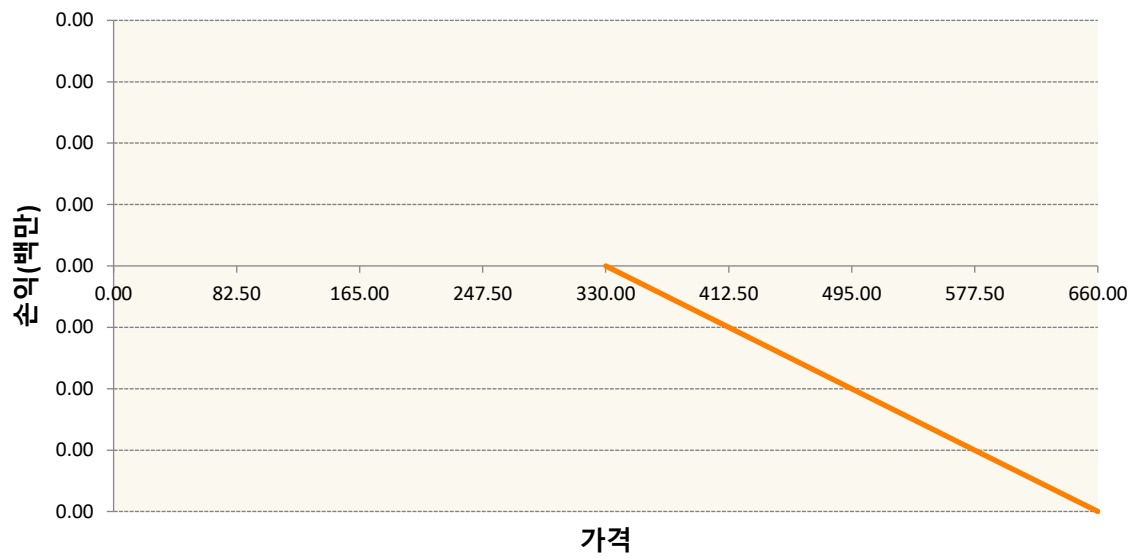
(단위:백만원)

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	390	0	390	장내
누계	유가증권	옵션	157	3,874	-3,718	장내

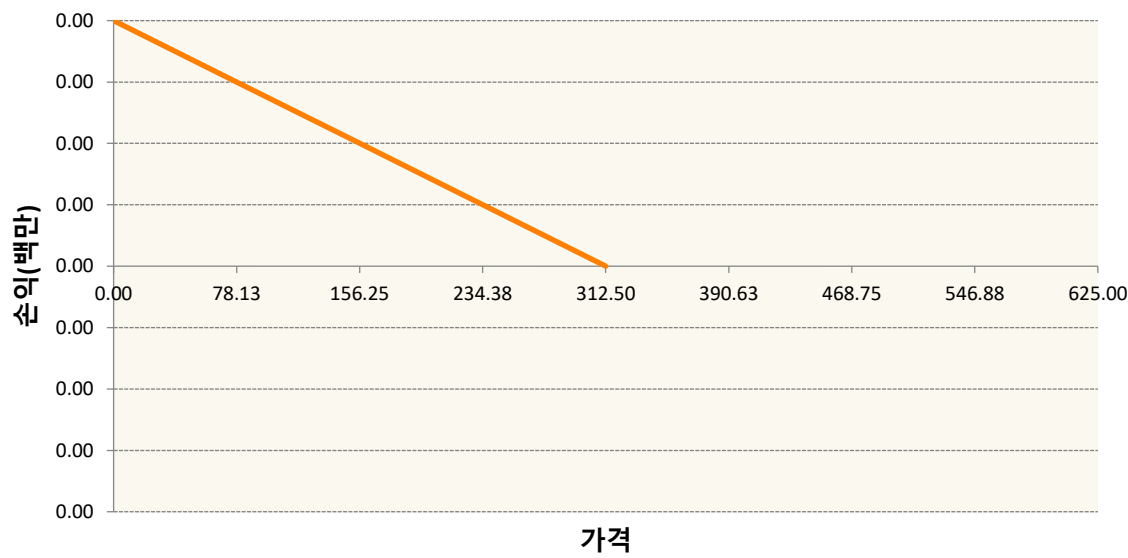
2. 만기시점의 손익구조



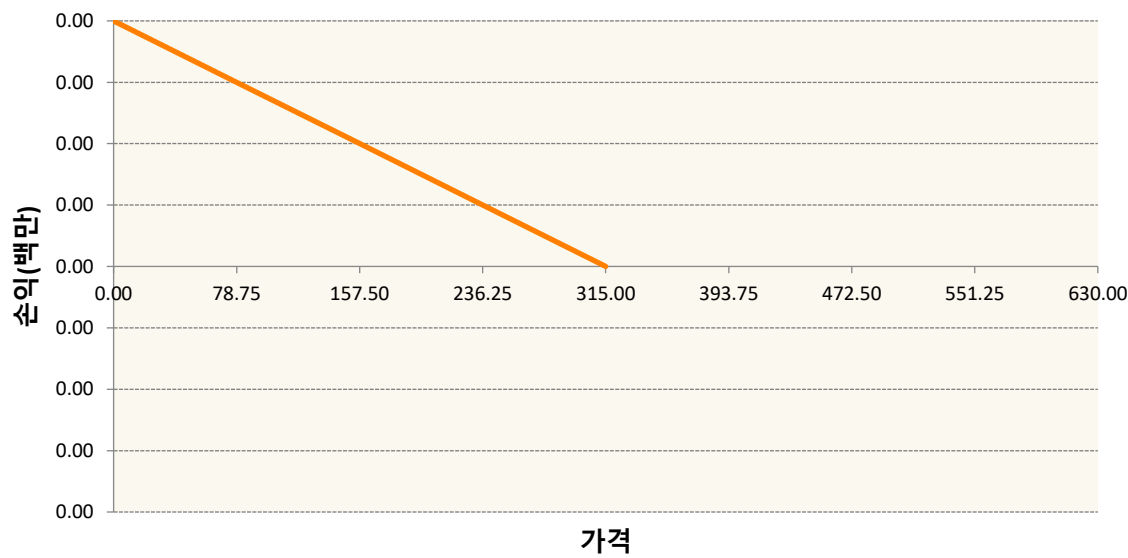
KR4201T43307-2023-04 콜330



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%	3	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%	-1	-1	-2	-3	-4	-5	-6
5.33%	-5	-6	-7	-7	-8	-9	-10
8.00%	-11	-12	-13	-13	-14	-15	-16
KR4201T43307		2023-04 콜330					124
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	22	22	21	21	20	19	17
-5.33%	21	21	20	18	16	14	12
-2.67%	19	17	15	12	9	5	1
0%	13	9	5	0	-5	-10	-16
2.67%	-3	-9	-15	-22	-28	-35	-42
5.33%	-33	-40	-48	-55	-63	-70	-78
8.00%	-80	-87	-94	-102	-109	-117	-124
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%	-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
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	1	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	-1	-1
8.00%	-2	-2	-2	-2	-2	-2	-2

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

(단위:백만원)

147

공시일	2023-03-22
기준일	2023-03-21

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	6,809	0	6,809	

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	2023-03-22
기준일	2023-03-21

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	5,435	0	5,435	

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	2023-03-22
기준일	2023-03-21

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	19,292	0	19,292	
누계	통화	선도	590	19,701	-19,111	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213CCSI KRW/USD 28-03-23E	556
FXW213D1SI KRW/USD 28-04-23E	313
FXW213D2Q KRW/USD 31-05-23E	707
FXW213D3LI USD/KRW 28-03-23E	47
IE00BD8RGM75	

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

920

공시일	2023-03-22
기준일	2023-03-21

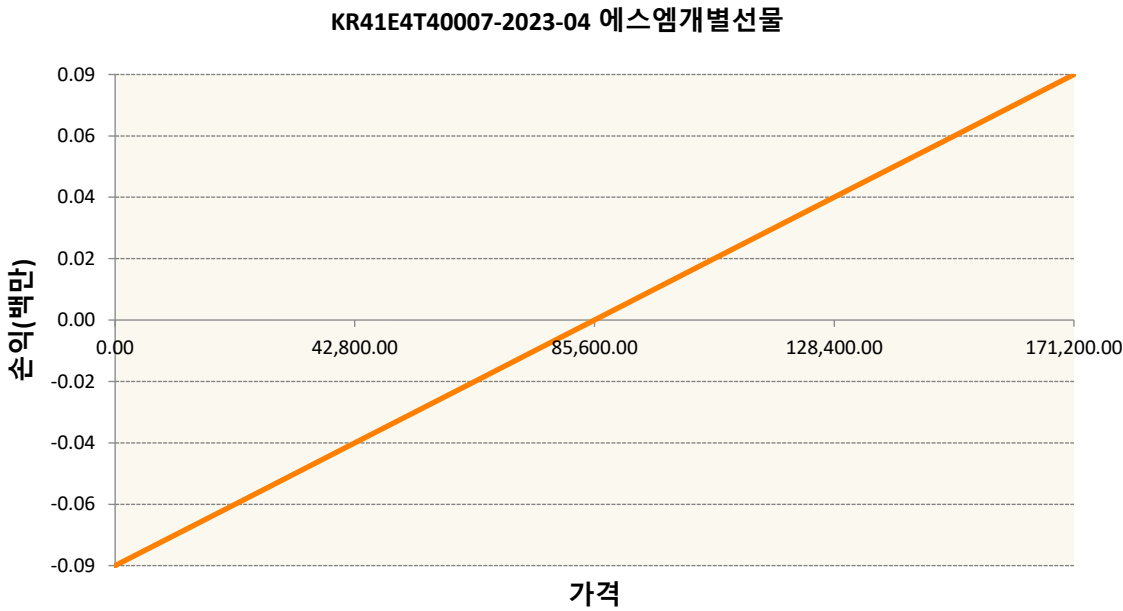
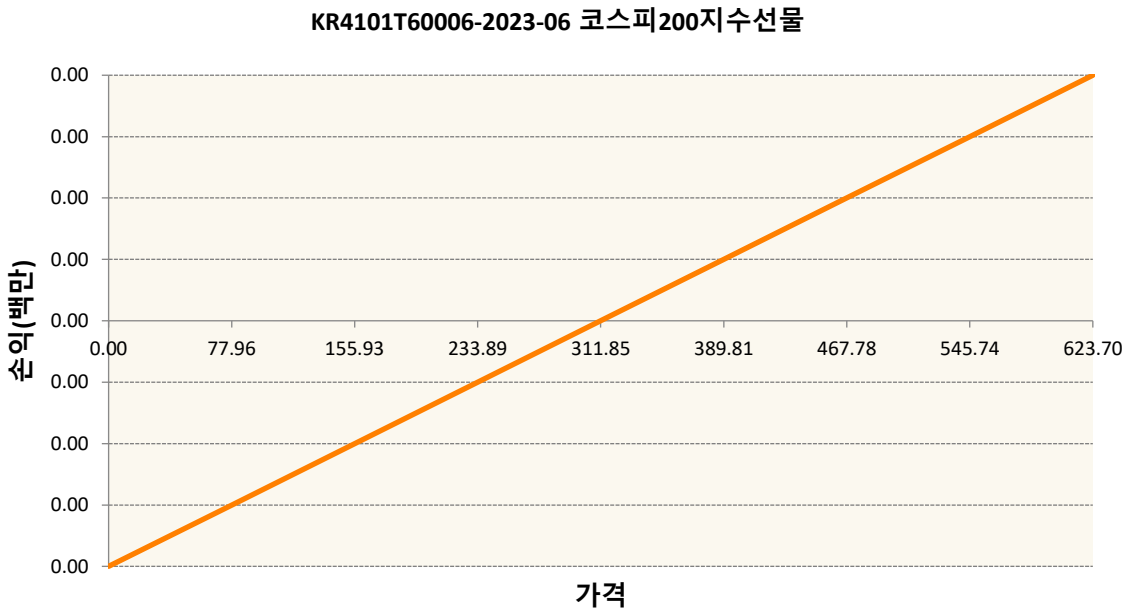
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

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	1,340	0	1,340	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%	-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%	106	106	106	106	106	106	106

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

114

공시일	2023-03-22
기준일	2023-03-21

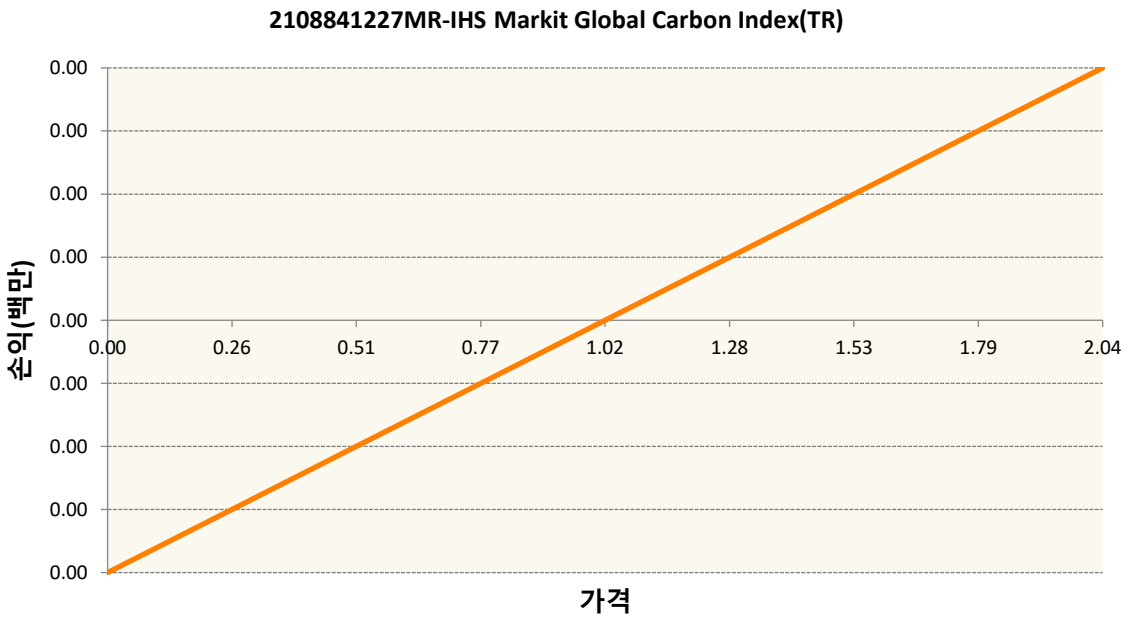
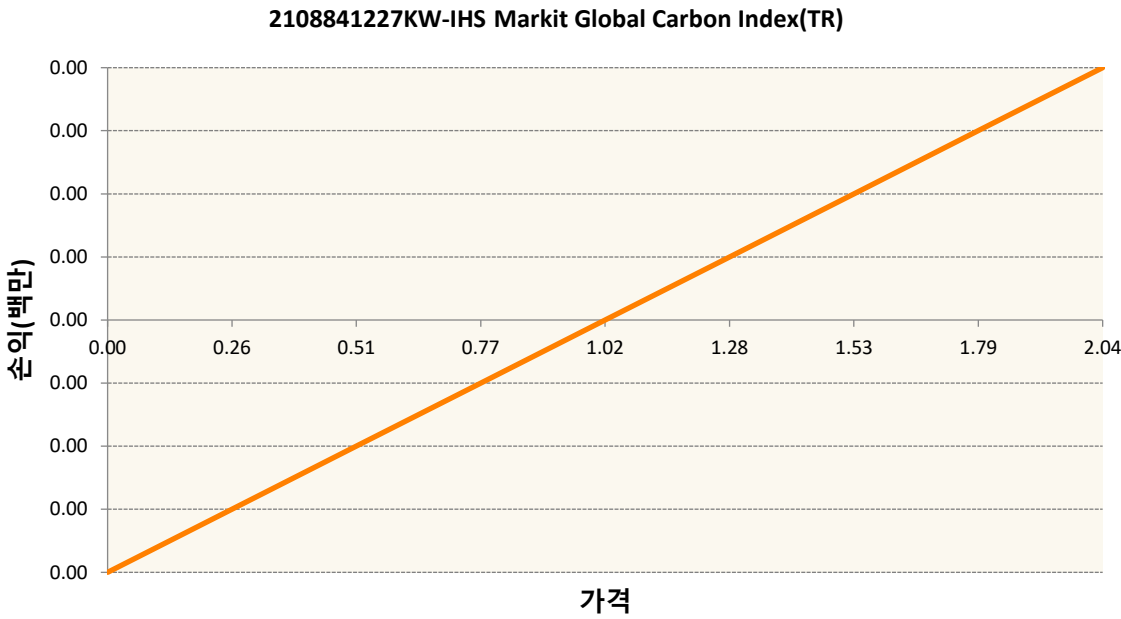
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

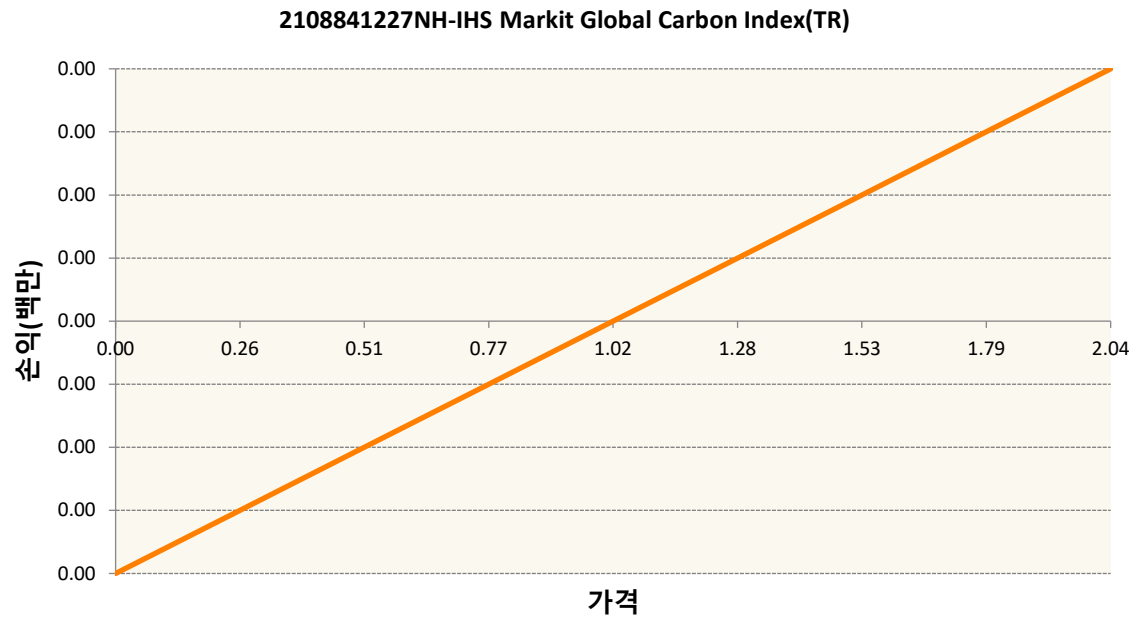
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	24,833	0	24,833	

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108841227IHS Markit Global Carbon Index(TR)		1,695
2108841227IHS Markit Global Carbon Index(TR)		199
2108841227IHS Markit Global Carbon Index(TR)		100

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)		(단위:백만원)
		3,802

공시일 2023-03-22

기준일 2023-03-21

SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

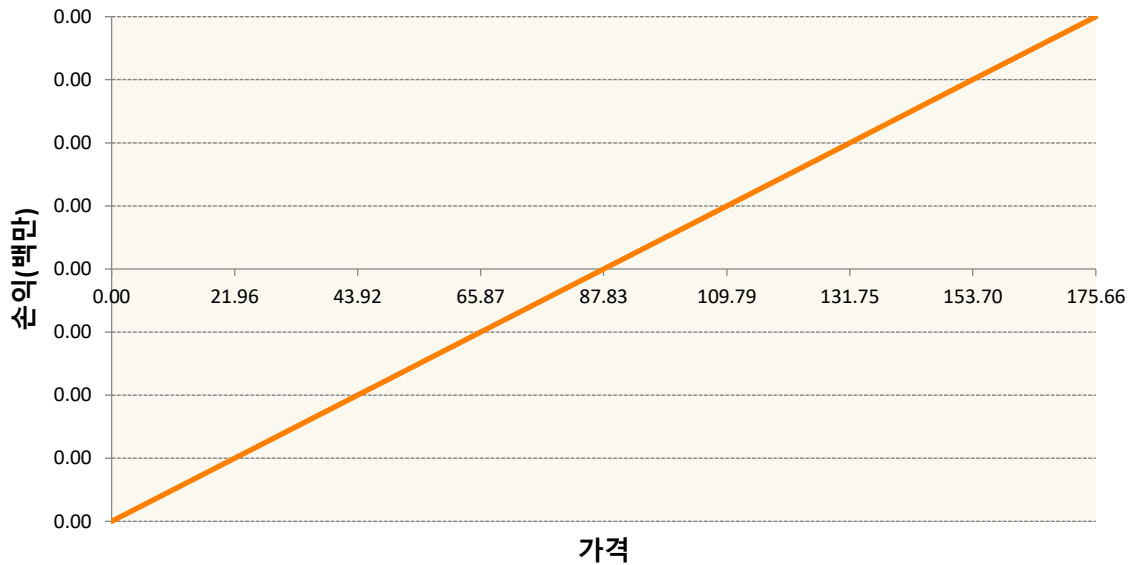
1. 계약금액

(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	9,090	0	9,090	
누계	통화	선도	1,697	4,250	-2,554	장외

2. 만기시점의 손익구조

MOZ23-ECX EMISSION Dec23



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213D2Q KRW/EUR 31-03-23E	146
FXW213D2Q KRW/EUR 31-03-23E	146
FXW213D36I EUR/KRW 31-03-23E	45
FXW213D39I KRW/EUR 31-03-23E	48
FXW213D3F(EUR/KRW 31-03-23E	44
FXW213D3H EUR/KRW 31-03-23E	47
MOZ23 ECX EMISSION Dec23	727

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

(단위:백만원)

2,238

공시일	2023-03-22
기준일	2023-03-21

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)	1
SWCSI00000 신한CSI Index 221222 (키움)	1
SWCSI00000 신한CSI Index 221222 (미래)	1
SWCSI00000 신한CSI Index 221222 (메리츠)	1

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

(단위:백만원)

8

공시일	2023-03-22
기준일	2023-03-21

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)	12
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 230116(메리츠)	17
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 230116(미래)	14
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 230116(키움)	12

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

(단위:백만원)

66

공시일	2023-03-22
기준일	2023-03-21

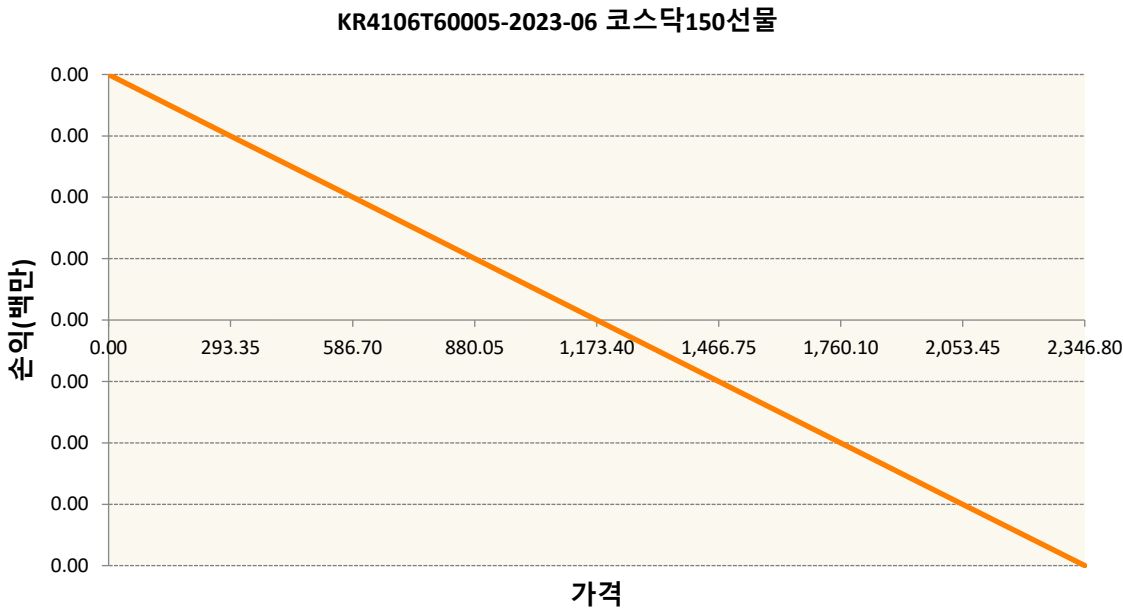
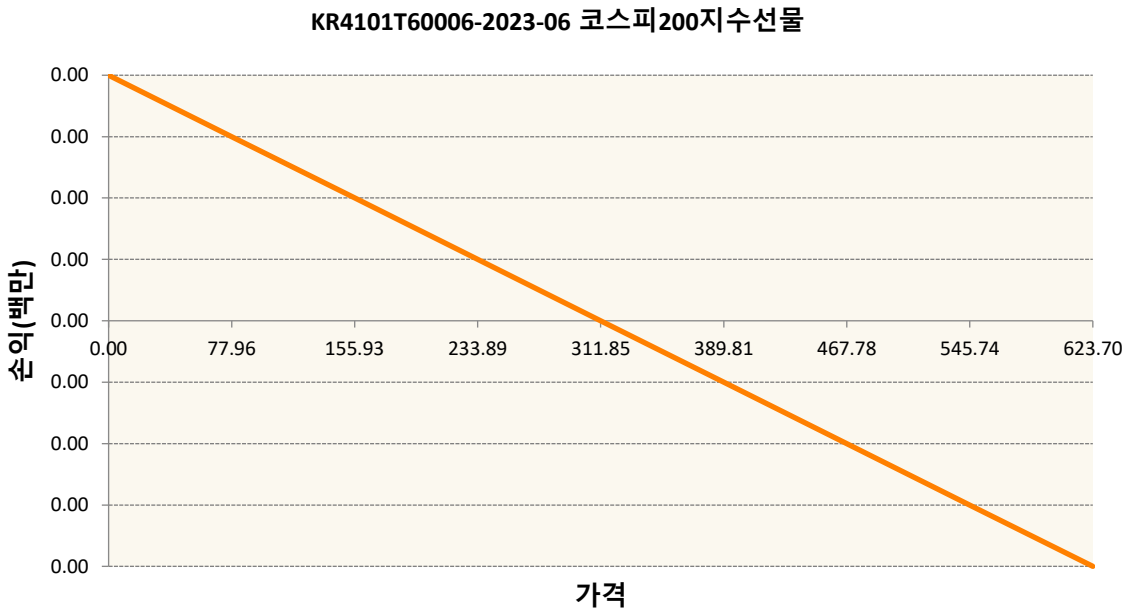
에퀴티알파일반사모혼합자산

1. 계약금액

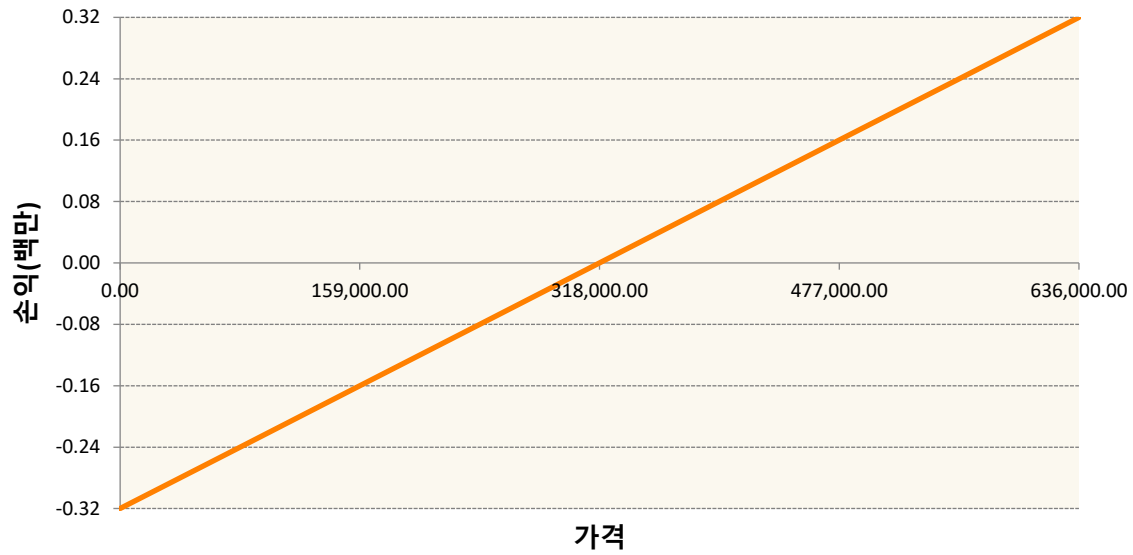
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	391	477	-87	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	429	3,172	-2,743	장내
누계	유가증권	스왑	0	0	0	장외

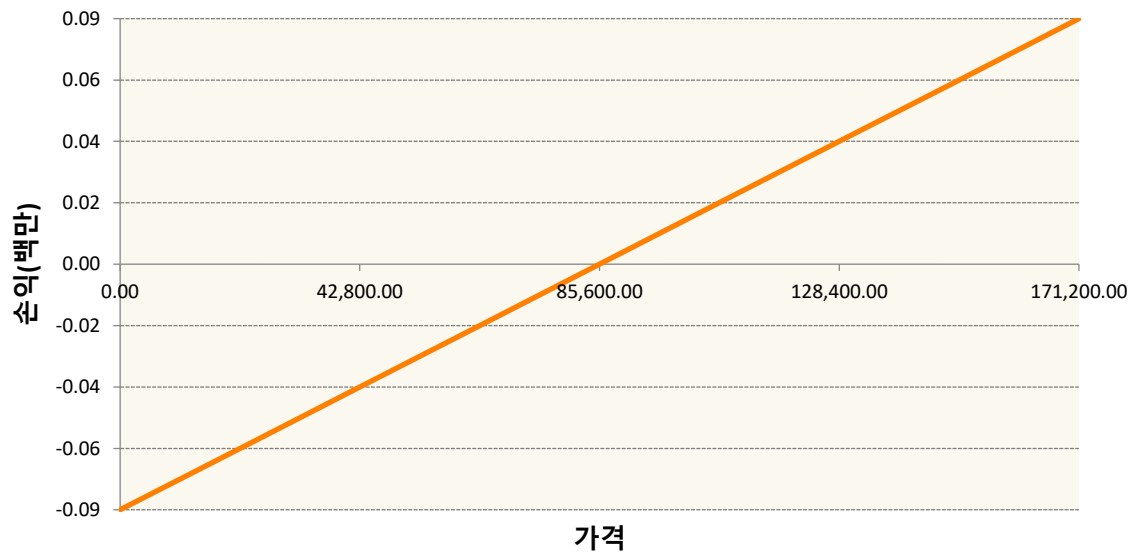
2. 만기시점의 손익구조



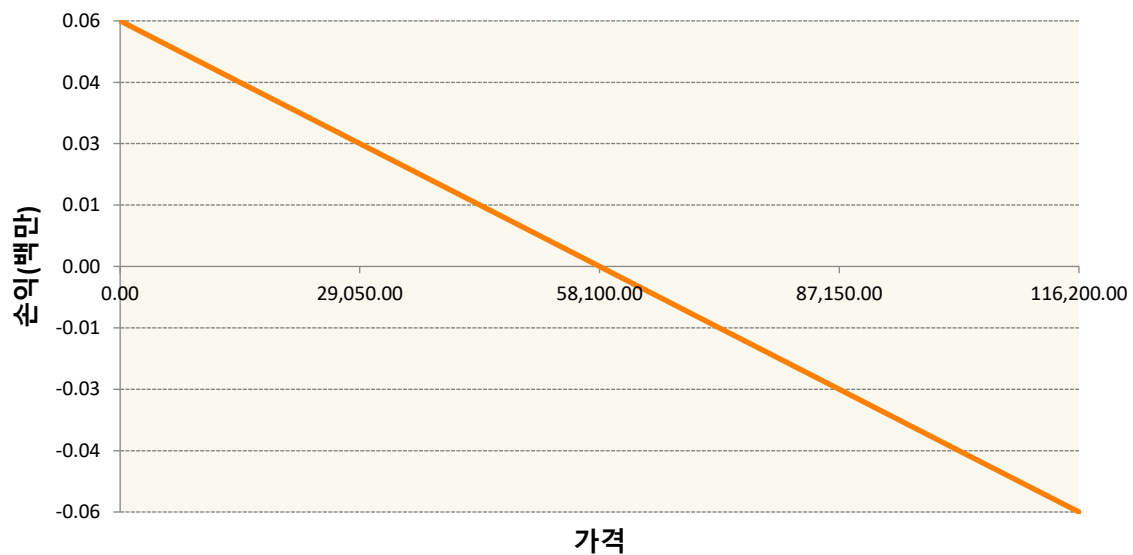
KR4113T40003-2023-04 POSCO홀딩스개별선물



KR41E4T40007-2023-04 에스엠개별선물



KR41F7T40009-2023-04 카카오페이개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
KR4101T600	2023-06 코스피200지수선물	125
KR4106T600	2023-06 코스닥150선물	122
KR4113T400	2023-04 POSCO홀딩스개별선물	25
KR41E4T400	2023-04 에스엠개별선물	9
KR41F7T400	2023-04 카카오페이개별선물	7
KRS0004054	SWAP_MICROSOFT CP_0221	0
KRS0004054	SWAP_FIRST TRUST ECL_0221	0
KRS0004099	SWAP_MICRON TECH_0308	0

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	449

공시일	2023-03-22
기준일	2023-03-21

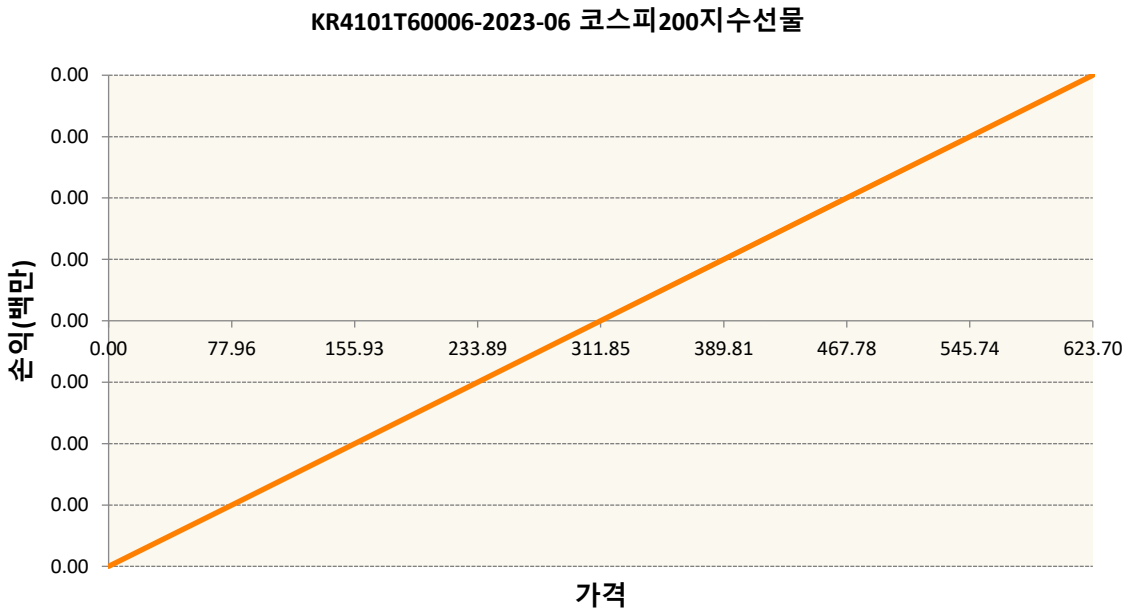
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

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	2,963	0	2,963	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101T60006		2023-06 코스피200지수선물					236
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-236	-236	-236	-236	-236	-236	-236
-5.33%	-157	-157	-157	-157	-157	-157	-157
-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%	157	157	157	157	157	157	157
8.00%	236	236	236	236	236	236	236

공시일	2023-03-22
기준일	2023-03-21

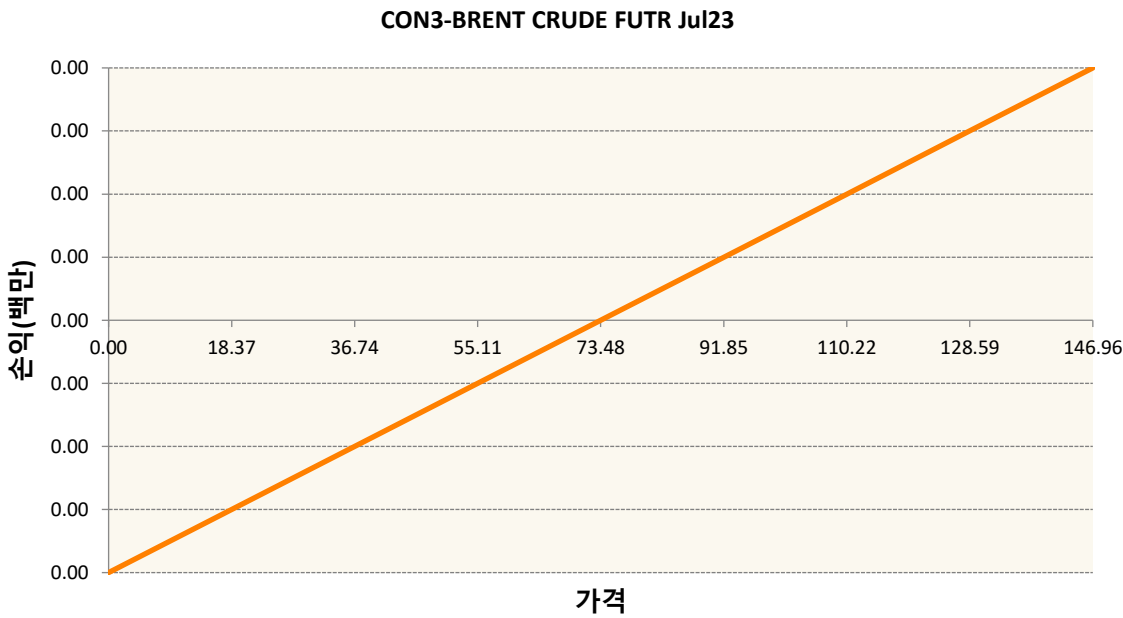
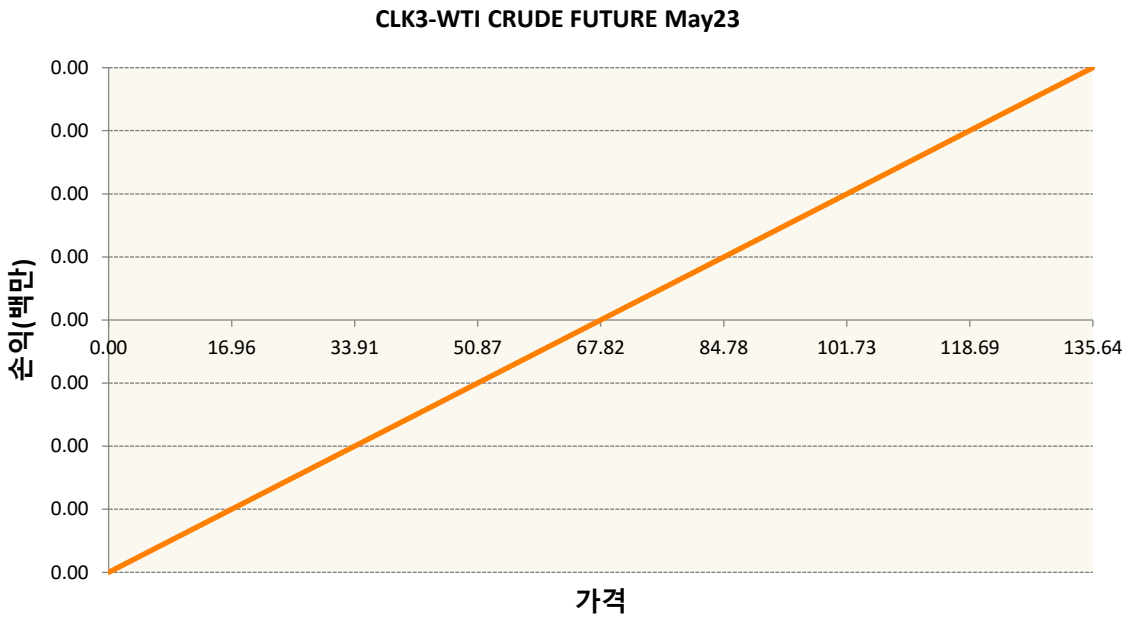
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

1. 계약금액

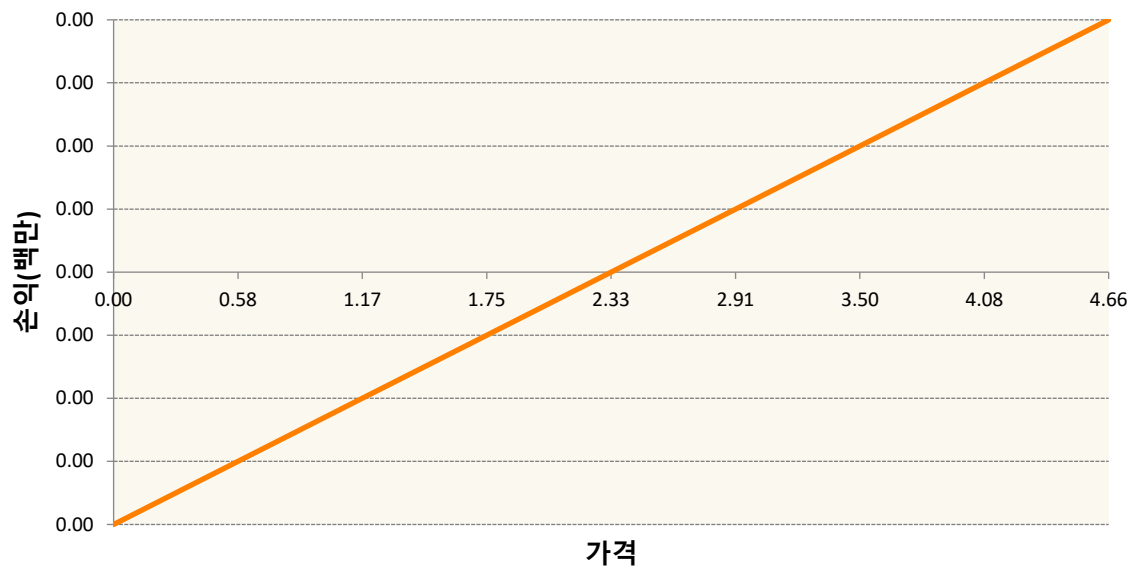
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,512	196	1,316	

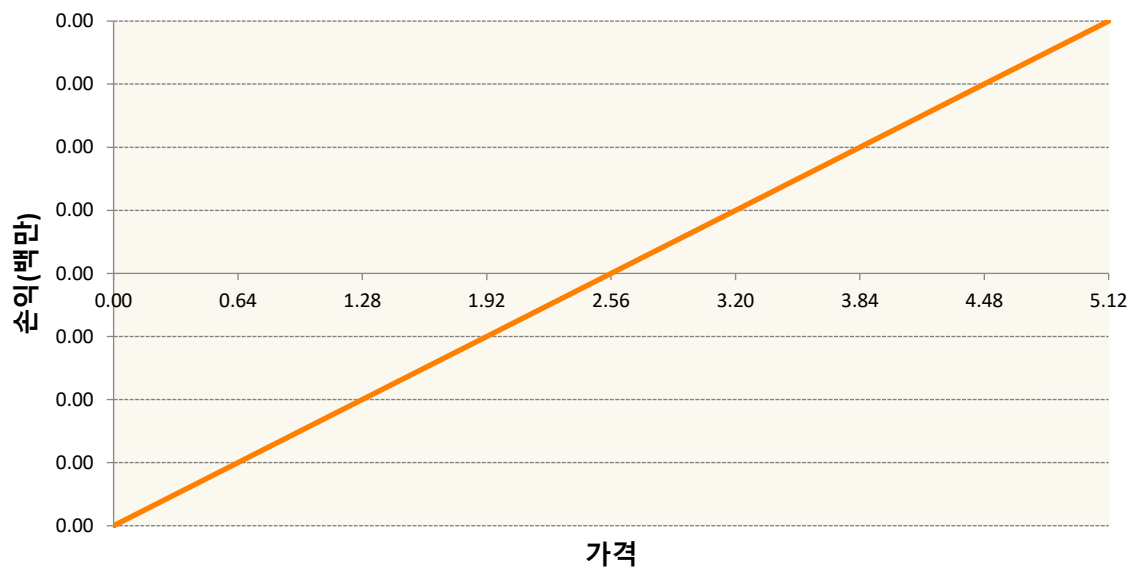
2. 만기시점의 손익구조



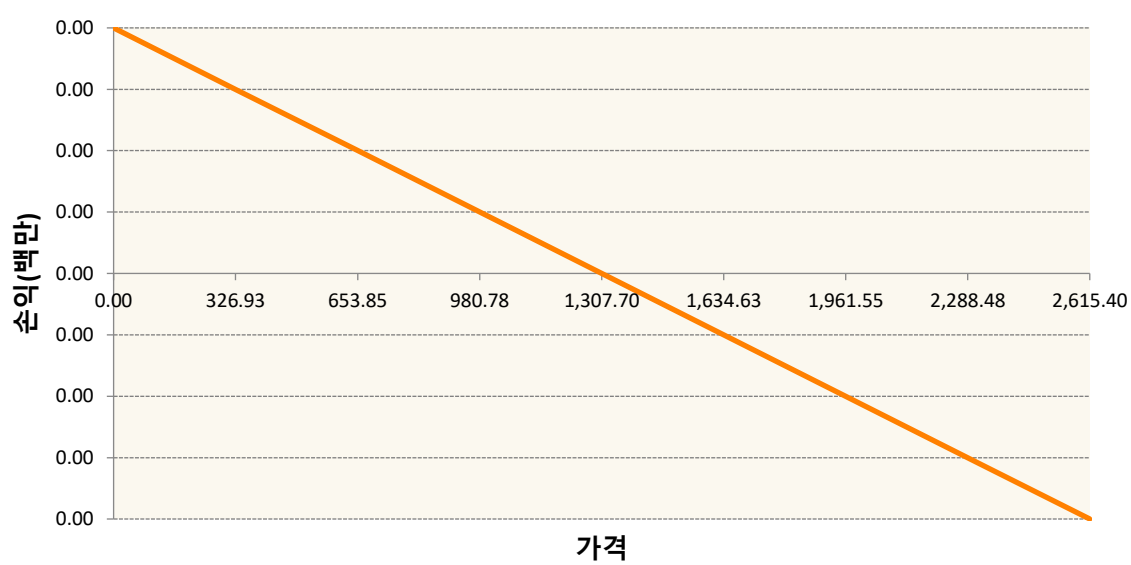
EOK3-E-MINI NATURAL GAS May23



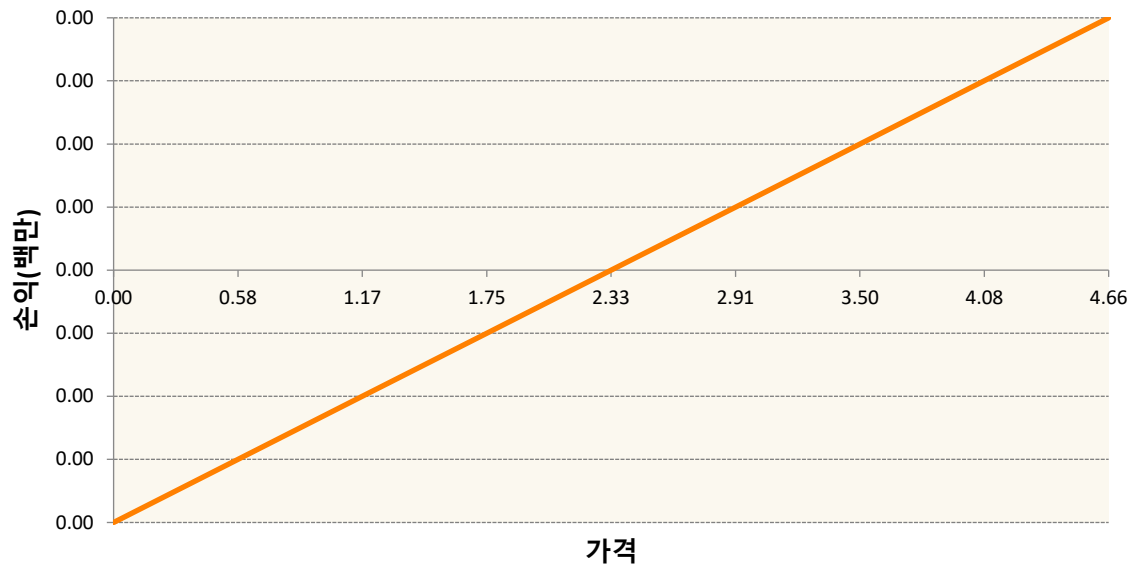
HOK3-NY Harb ULSD Fut May23



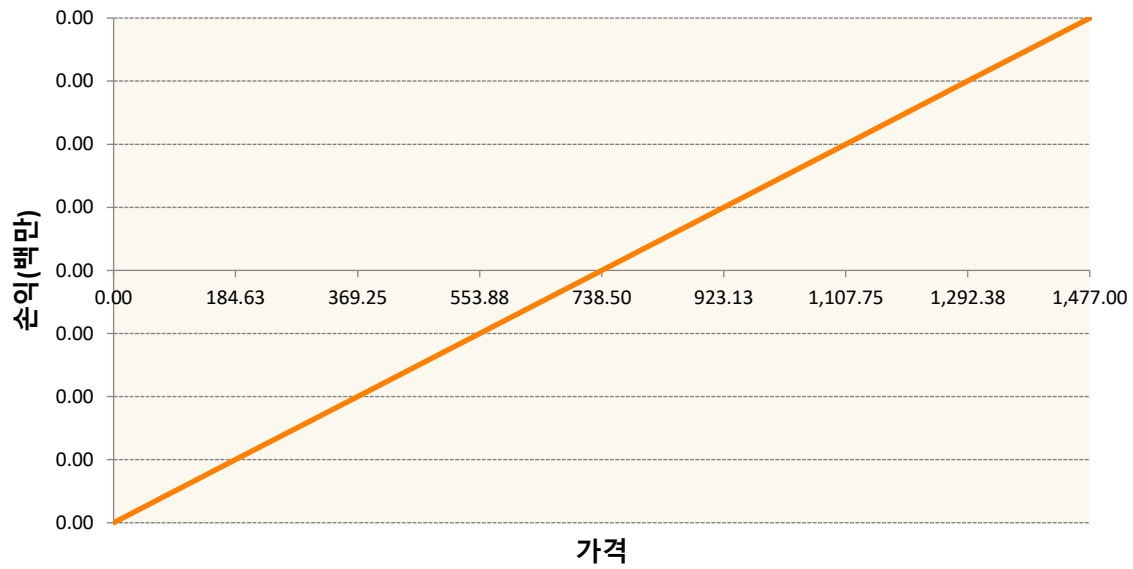
KR4175T40002-2023-04 달러선물



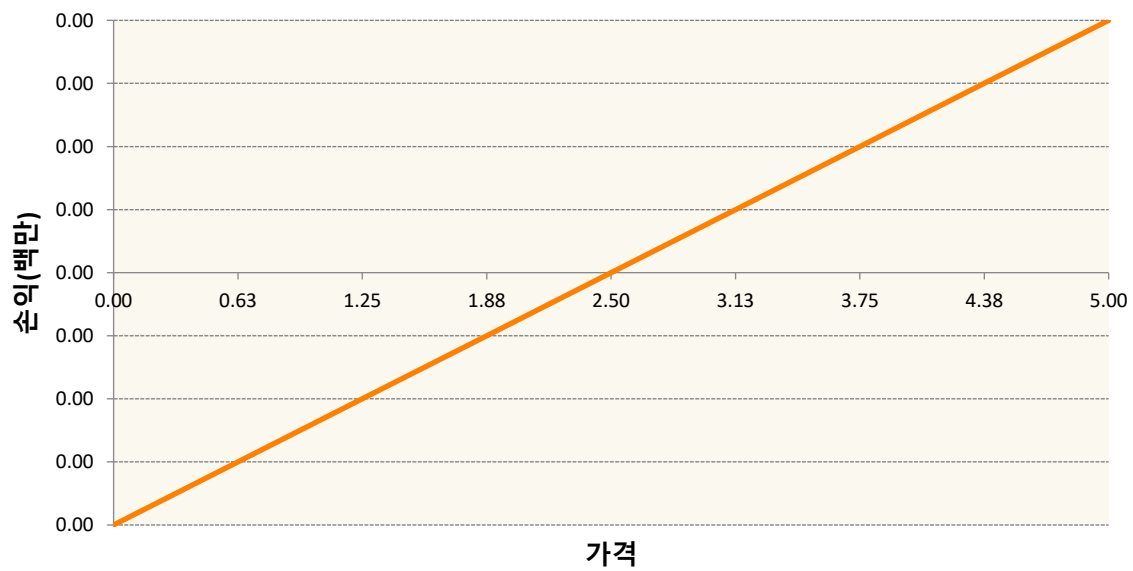
NGK23-NATURAL GAS FUTR May23



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	24
QSK3	Low Su Gasoil G May23	15
XBK3	GASOLINE RBOB FUT May23	11

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

371