

공시일	2023-03-23
기준일	2023-03-22

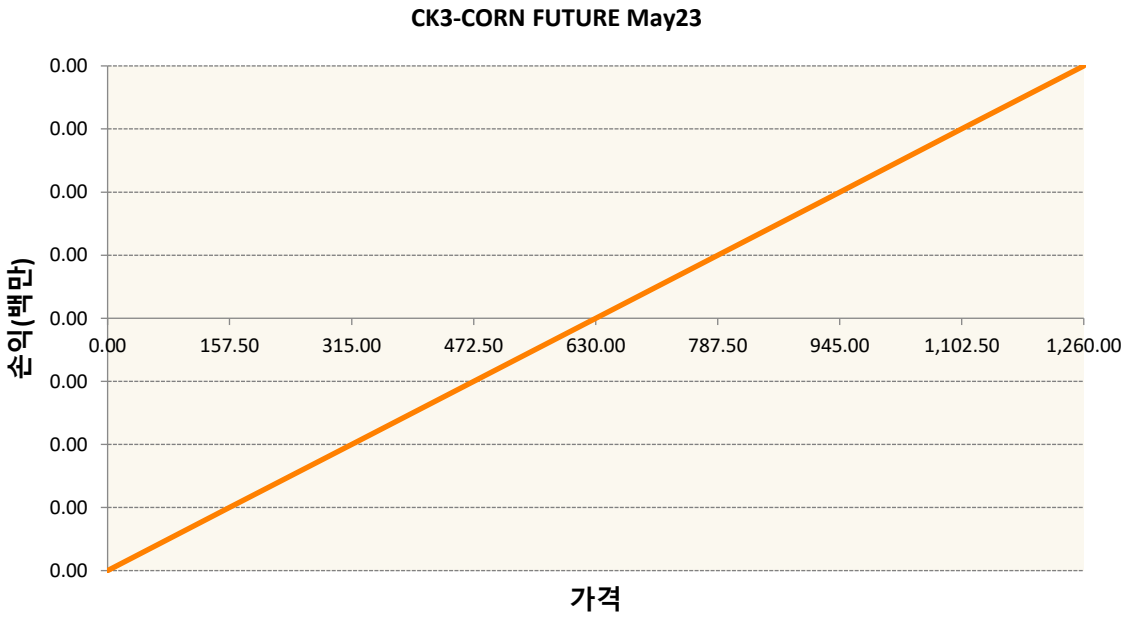
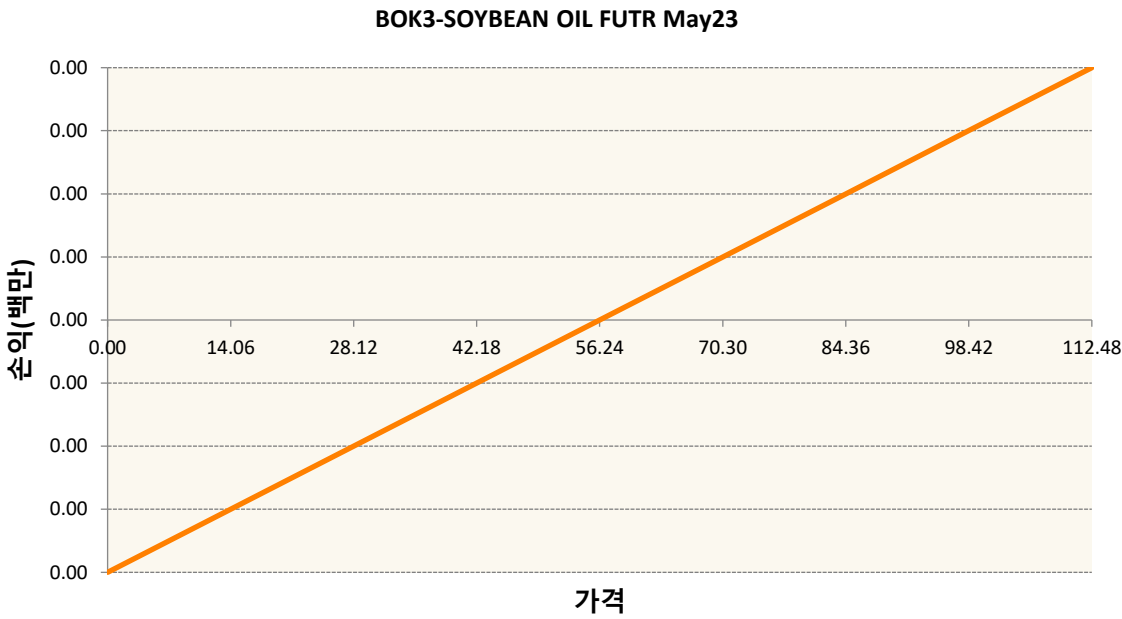
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

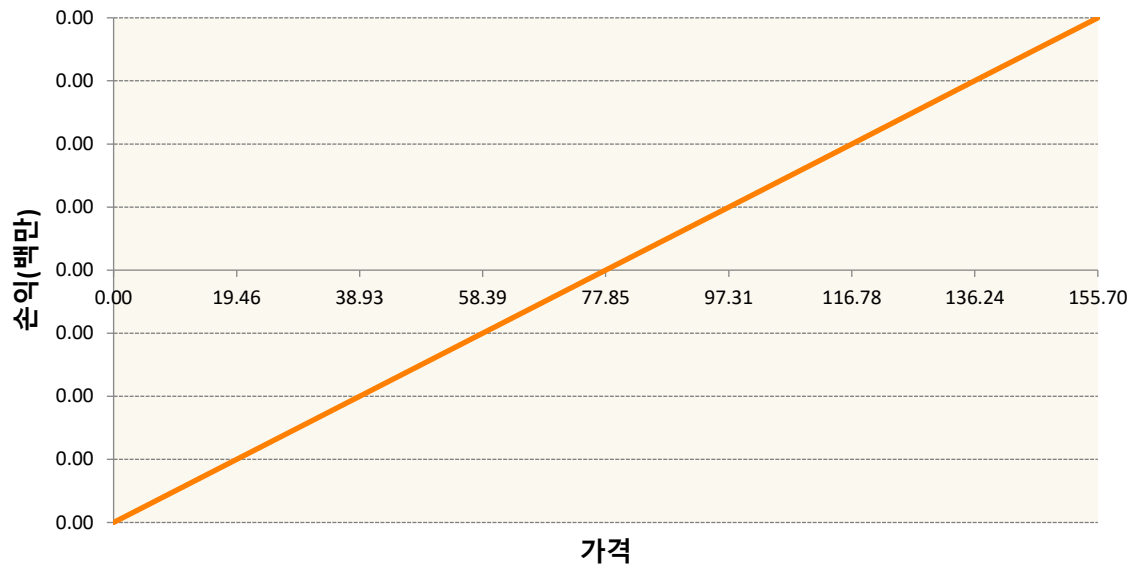
(단위:USD 백만)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,444	522	4,922	

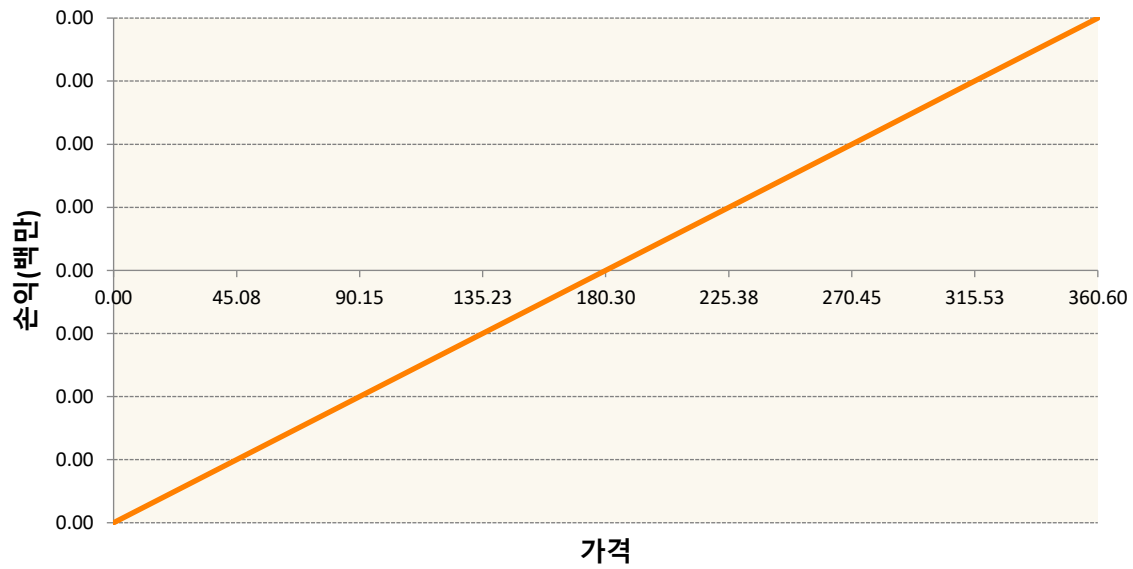
2. 만기시점의 손익구조



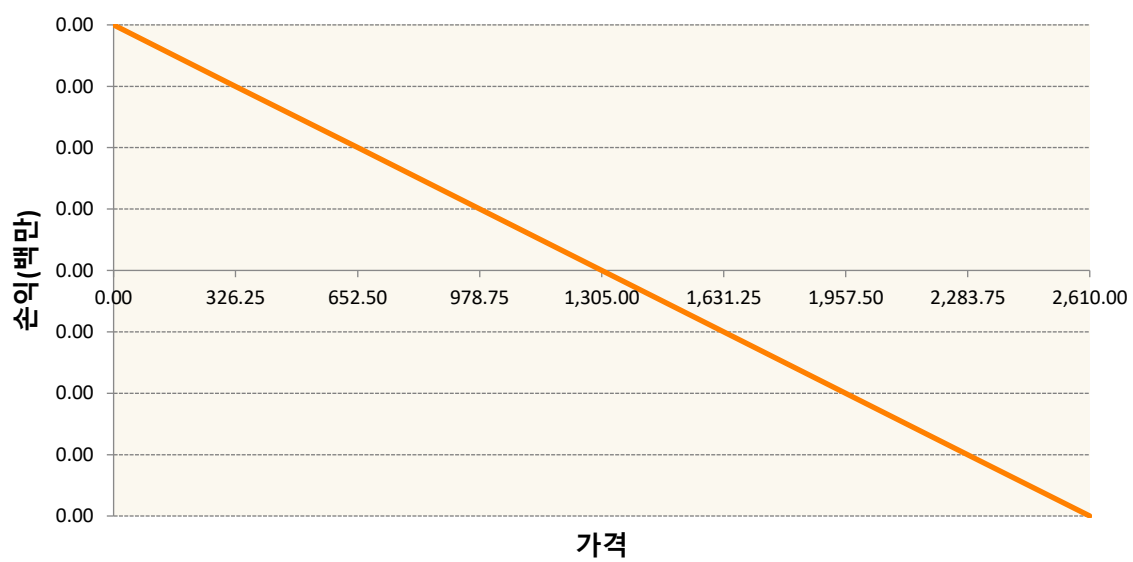
CTK3-COTTON NO.2 FUTR May23



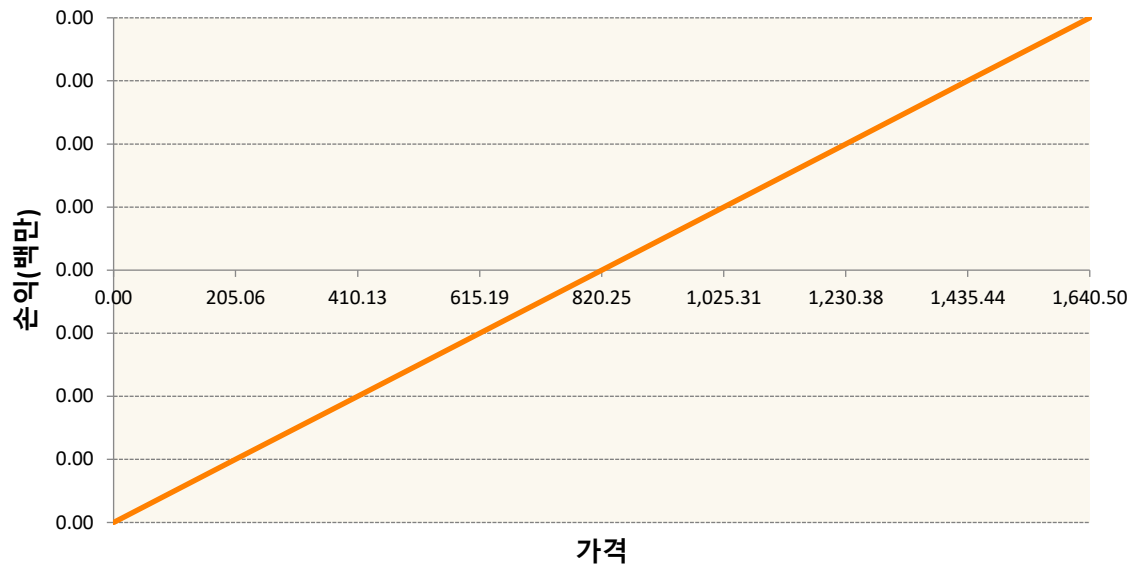
KCK3-COFFEE 'C' FUTURE May23



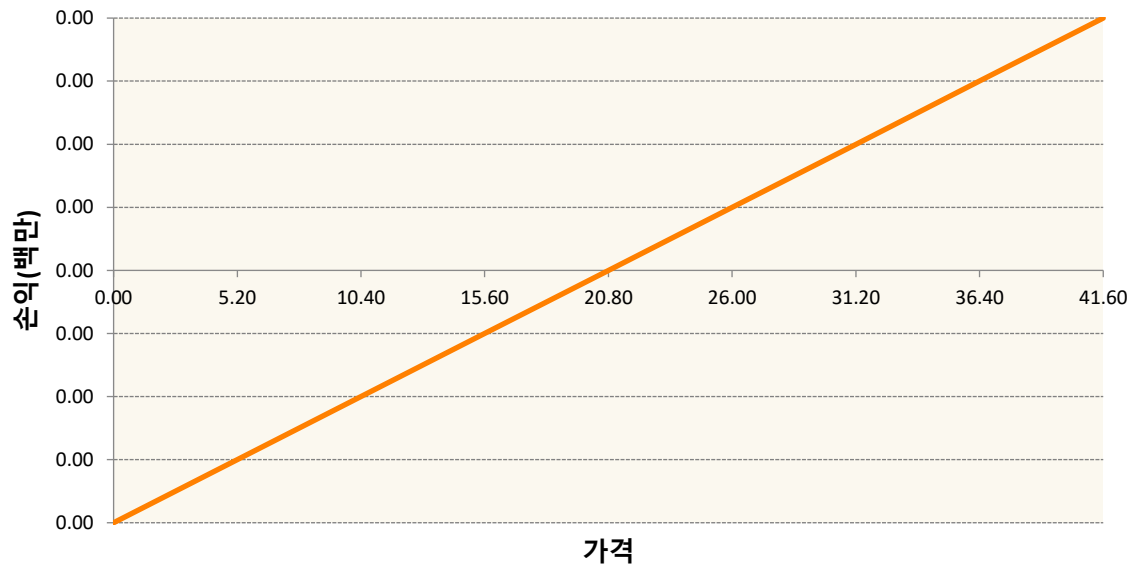
KR4175T40002-2023-04 달러선물



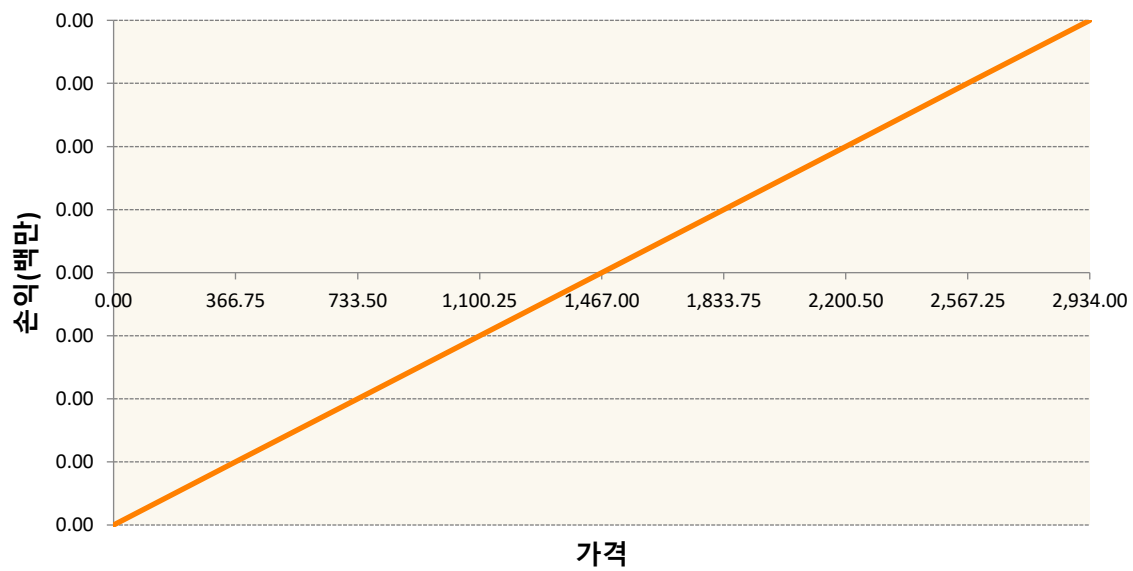
KWK3-KC HRW WHEAT FUT May23



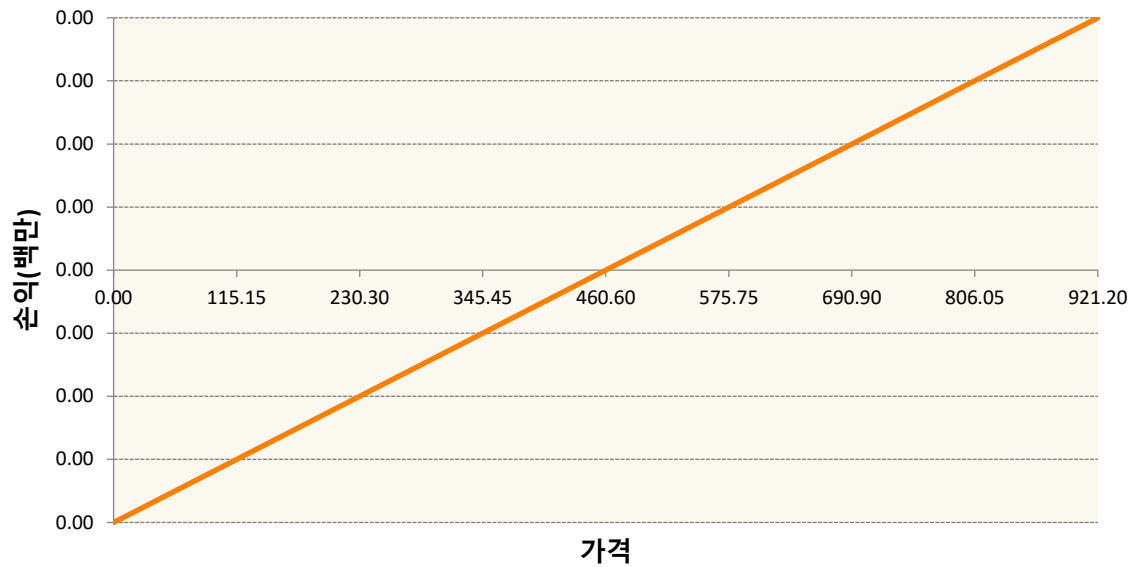
SBK3-Sugar #11 (WORLD) May23



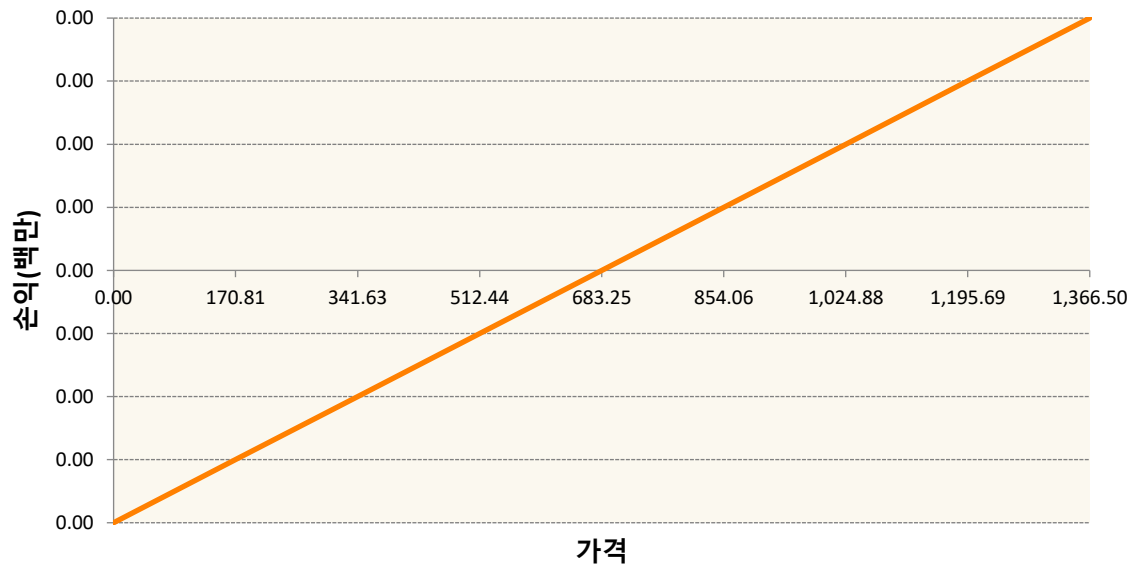
SK3-SOYBEAN FUTURE May23



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	2023-03-23
기준일	2023-03-22

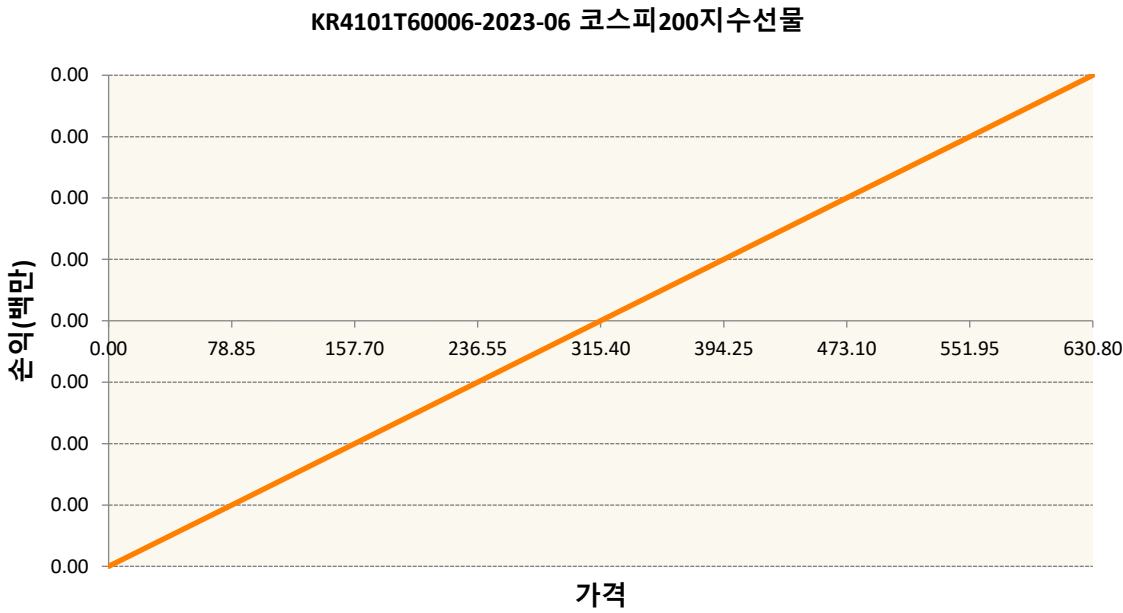
스마트인덱스모

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	2,681	0	2,681	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101T60006		2023-06 코스피200지수선물					214
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-214	-214	-214	-214	-214	-214	-214
-5.33%	-142	-142	-142	-142	-142	-142	-142
-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%	142	142	142	142	142	142	142
8.00%	214	214	214	214	214	214	214

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

(단위:백만원)

230

공시일	2023-03-23
기준일	2023-03-22

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

364

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

474

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2023-03-23
기준일	2023-03-22

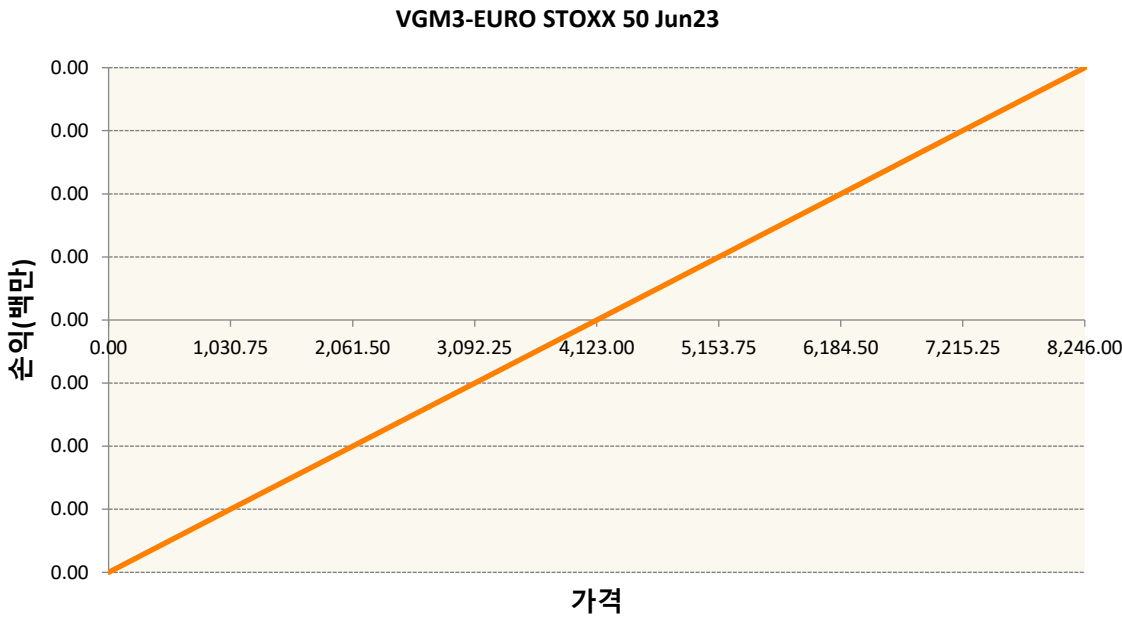
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	460	0	460	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM3	EURO STOXX 50 Jun23	37
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

40

공시일	2023-03-23
기준일	2023-03-22

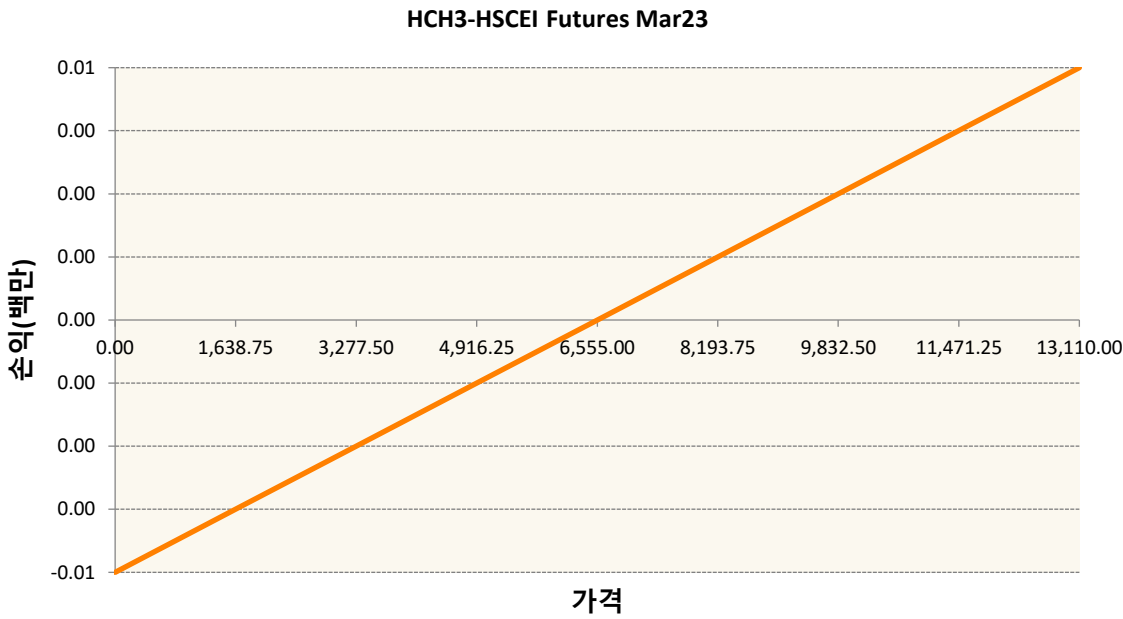
차이나인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,035	0	1,035	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCH3	HSCEI Futures Mar23	83
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

111

공시일	2023-03-23
기준일	2023-03-22

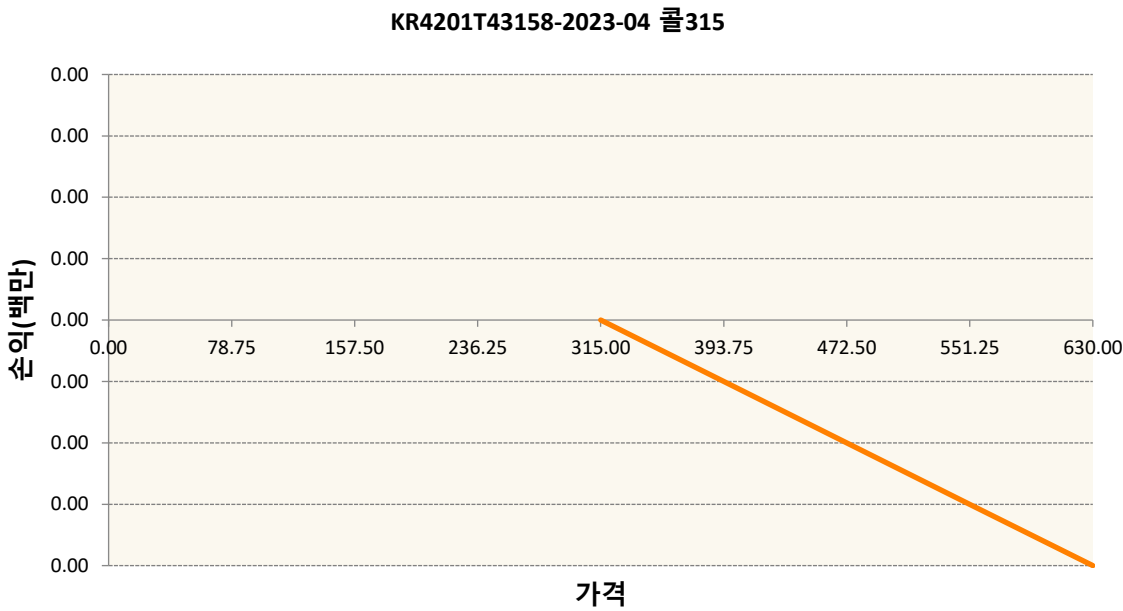
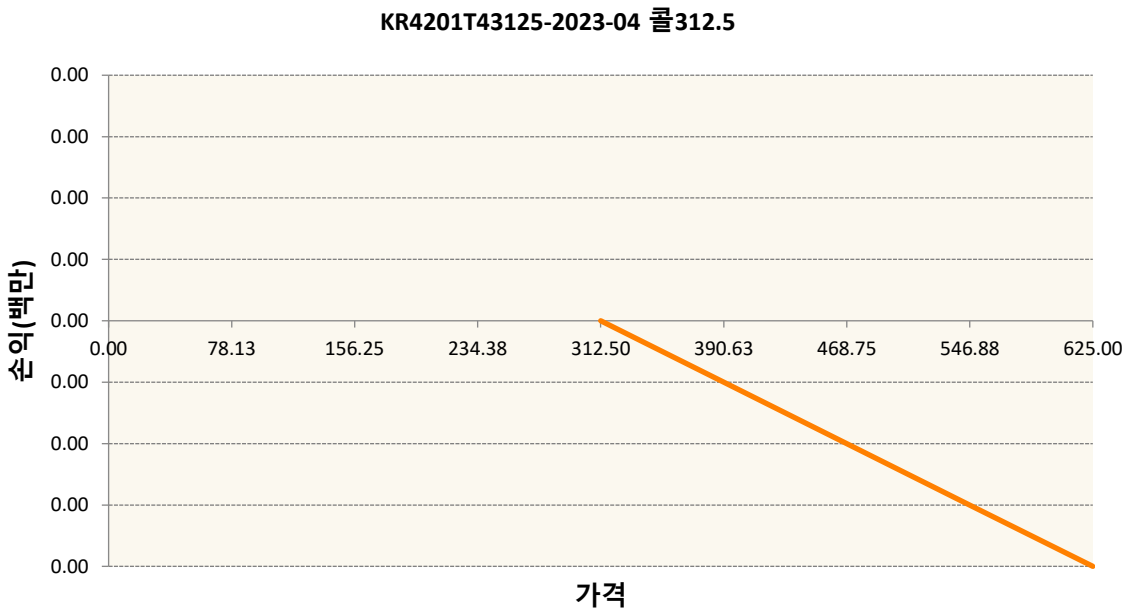
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

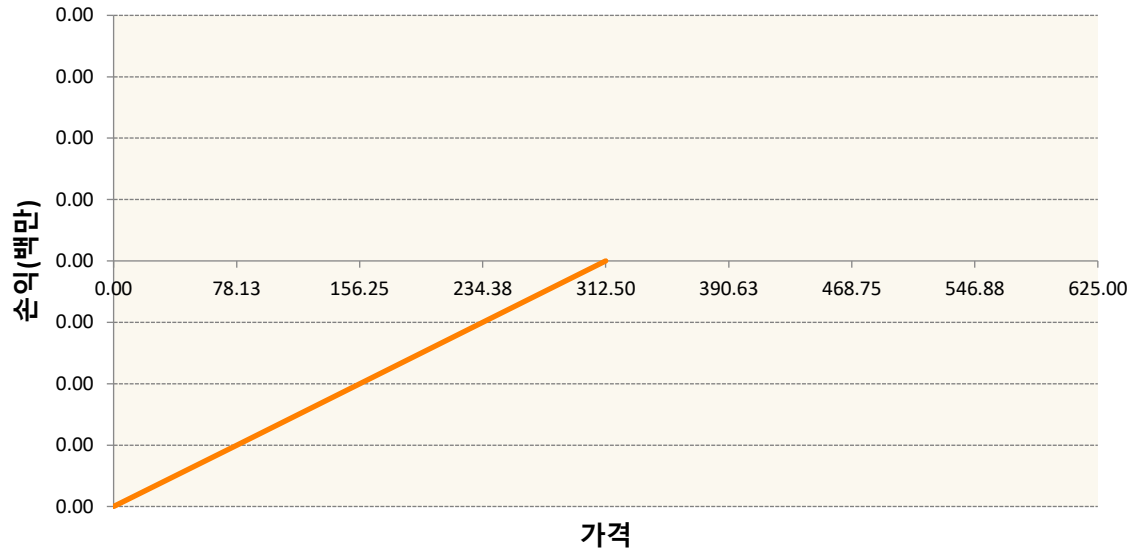
(단위:백만원)

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				730
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	320	312	303	292	279	265	251
-5.33%	287	272	255	237	219	199	179
-2.67%	211	189	166	143	119	96	72
0%	74	49	25	0	-25	-49	-74
2.67%	-127	-148	-169	-191	-214	-237	-260
5.33%	-379	-393	-408	-425	-442	-461	-480
8.00%	-662	-669	-678	-689	-701	-715	-730
KR4201T43158			2023-04 콜315				2,074
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	808	791	769	743	713	679	641
-5.33%	740	702	660	615	566	515	461
-2.67%	563	503	441	377	312	247	181
0%	216	144	72	0	-72	-144	-216
2.67%	-326	-391	-458	-525	-593	-663	-732
5.33%	-1,035	-1,081	-1,130	-1,183	-1,239	-1,297	-1,357
8.00%	-1,853	-1,878	-1,908	-1,944	-1,984	-2,027	-2,074
KR4301T43123			2023-04 풋312.5				565
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-506	-513	-521	-530	-541	-553	-565
-5.33%	-275	-288	-302	-317	-333	-349	-366
-2.67%	-80	-99	-118	-138	-158	-178	-198
0%	63	42	21	0	-21	-42	-63

2.67%	151	134	115	97	78	58	39
5.33%	197	185	172	158	143	127	111
8.00%	216	210	202	193	183	171	158

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

3,277

공시일	2023-03-23
기준일	2023-03-22

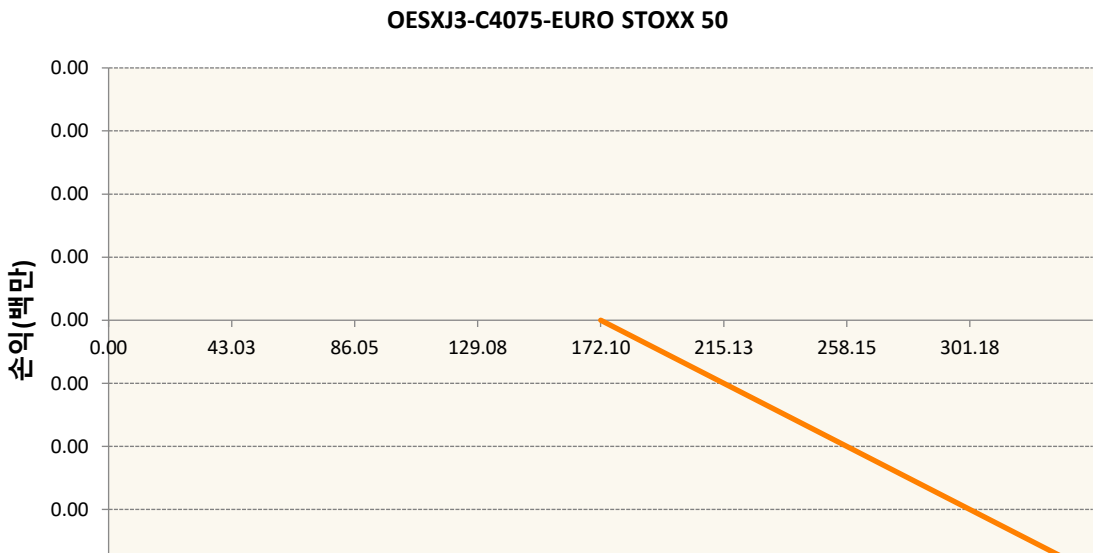
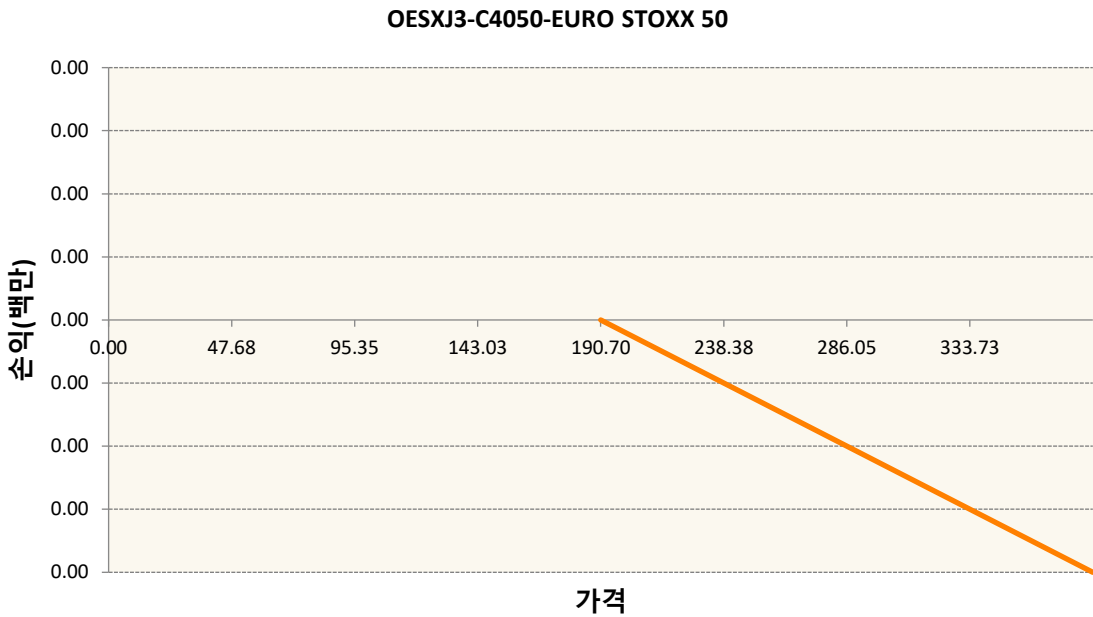
유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

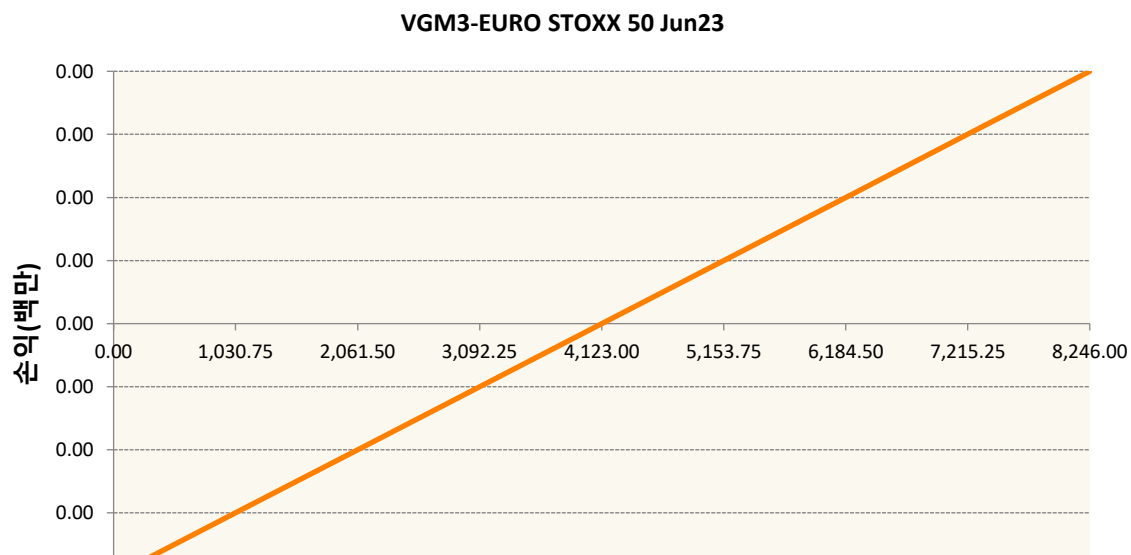
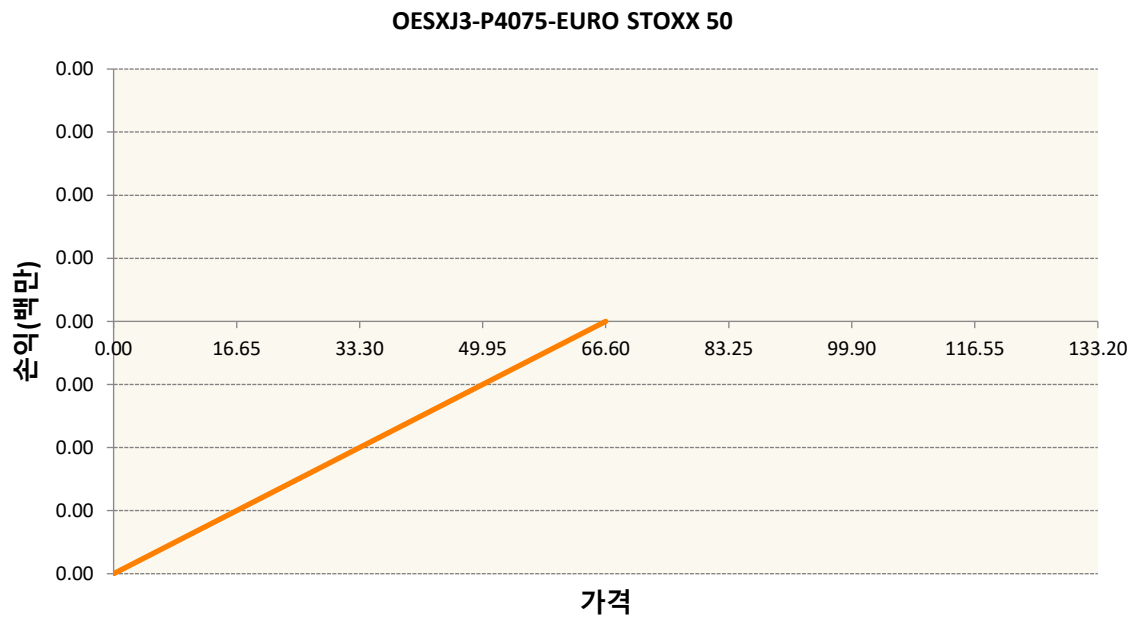
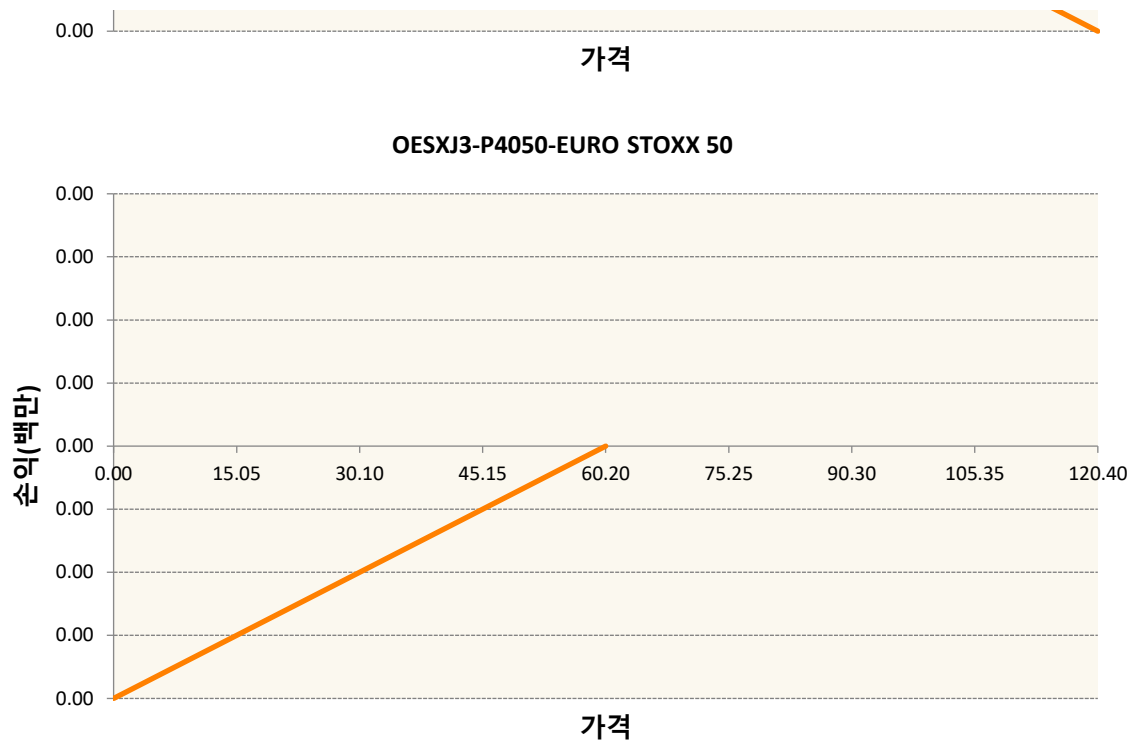
1. 계약금액

(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	919	0	919	
누계	유가증권	옵션	0	103	-103	장내
누계	통화	선도	141	2,394	-2,253	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
FXW213D3N KRW/EUR 28-04-23E		45
OESXJ3-C40! EURO STOXX 50		3
OESXJ3-C40! EURO STOXX 50		3
OESXJ3-P40! EURO STOXX 50		1
OESXJ3-P40! EURO STOXX 50		1
VGM3 EURO STOXX 50 Jun23		74

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	244

공시일	2023-03-23
기준일	2023-03-22

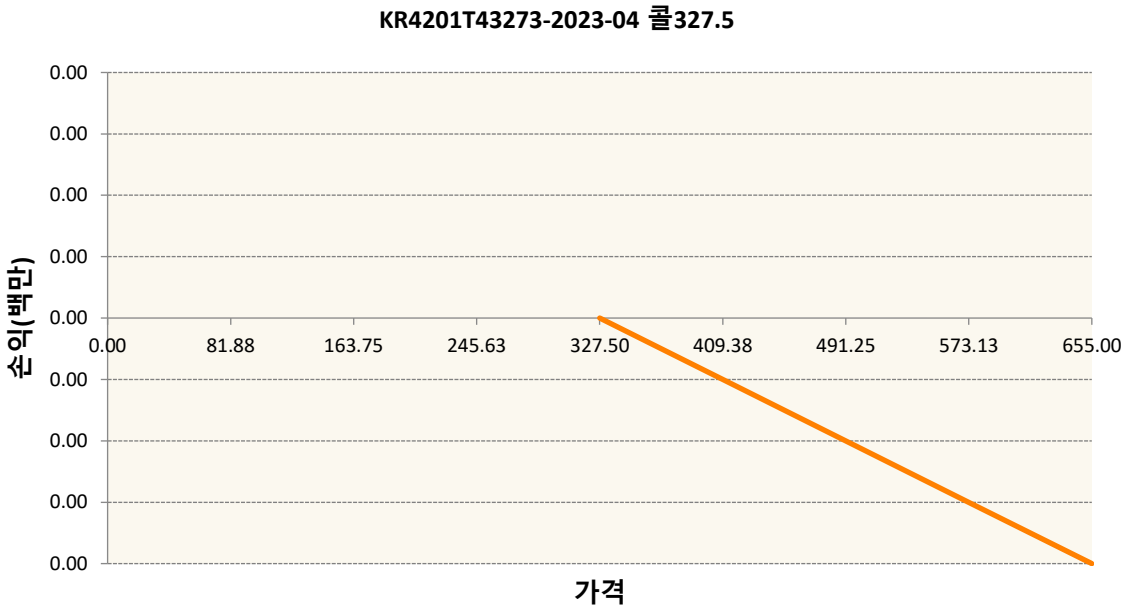
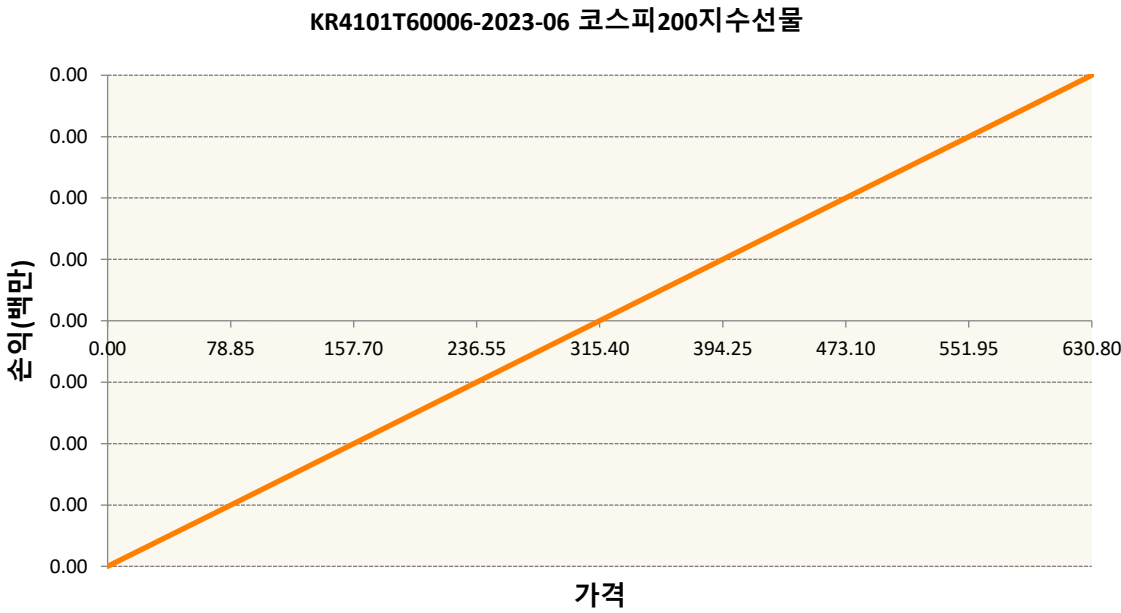
리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

1. 계약금액

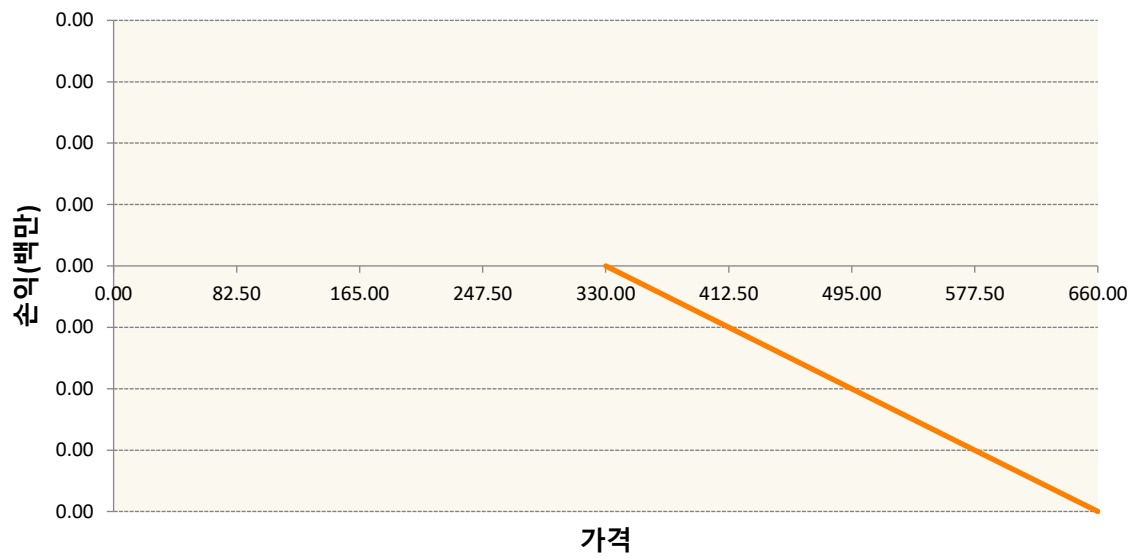
(단위:백만원)

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	394	0	394	장내
누계	유가증권	옵션	157	3,874	-3,718	장내

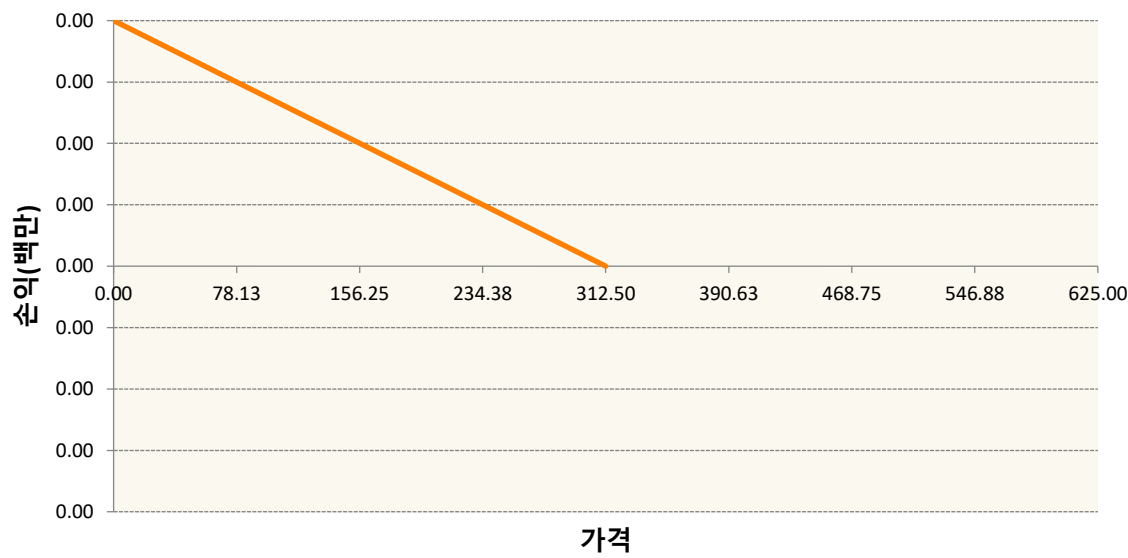
2. 만기시점의 손익구조



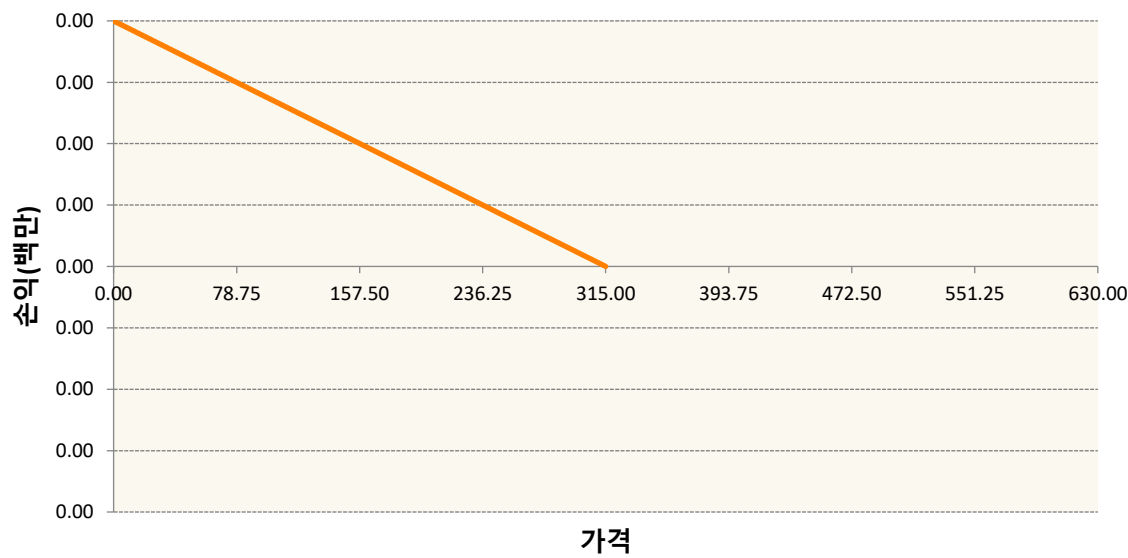
KR4201T43307-2023-04 콜330



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				18
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	4	4	4	4	4	4	3
-5.33%	4	4	4	3	3	3	2
-2.67%	3	3	3	2	2	1	1
0%	2	1	1	0	-1	-1	-2
2.67%	-1	-2	-3	-4	-5	-5	-6
5.33%	-6	-7	-8	-9	-10	-11	-12
8.00%	-14	-14	-15	-16	-17	-17	-18
KR4201T43307			2023-04 콜330				141
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	28	27	27	26	25	24	23
-5.33%	27	26	25	23	21	19	16
-2.67%	24	22	19	15	12	8	3
0%	15	10	5	0	-5	-11	-17
2.67%	-6	-13	-20	-27	-33	-40	-47
5.33%	-44	-52	-59	-67	-74	-81	-89
8.00%	-100	-107	-113	-120	-127	-134	-141
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	-1	-1	-1	-1	-1	-1
8.00%	-2	-2	-2	-2	-1	-1	-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	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	-1	-1	-1	-1
8.00%	-2	-2	-2	-2	-2	-2	-1

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

(단위:백만원)

169

공시일	2023-03-23
기준일	2023-03-22

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	6,558	0	6,558	

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	2023-03-23
기준일	2023-03-22

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	5,235	0	5,235	

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	2023-03-23
기준일	2023-03-22

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	18,583	0	18,583	
누계	통화	선도	588	19,648	-19,060	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
FXW213CCSI KRW/USD 28-03-23E		554
FXW213D1SI KRW/USD 28-04-23E		312
FXW213D2Q KRW/USD 31-05-23E		705
FXW213D3LI USD/KRW 28-03-23E		47
IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	915

공시일	2023-03-23
기준일	2023-03-22

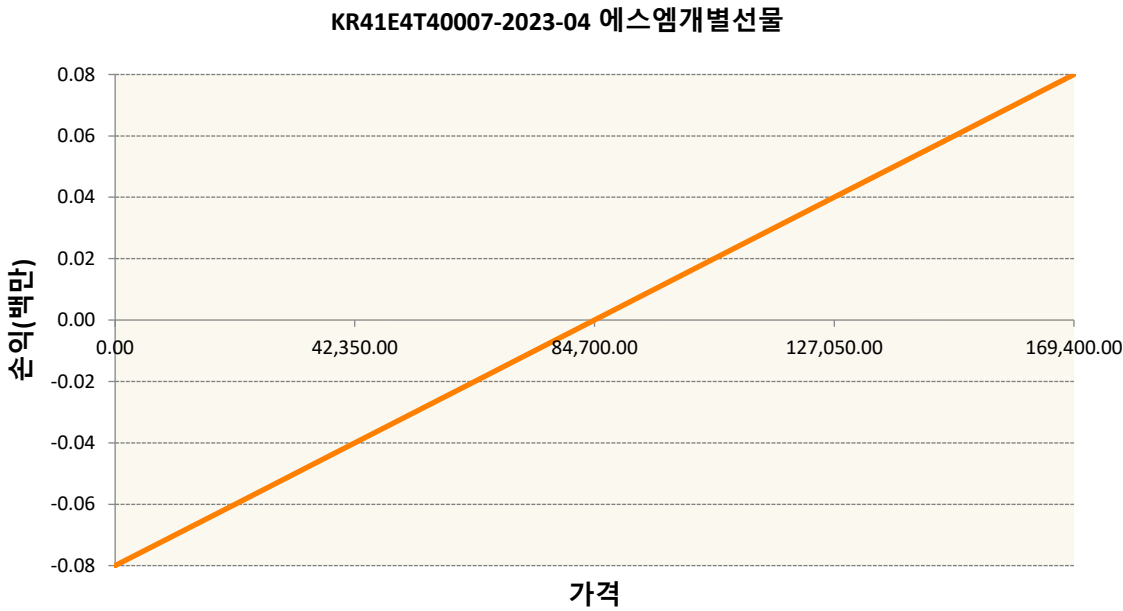
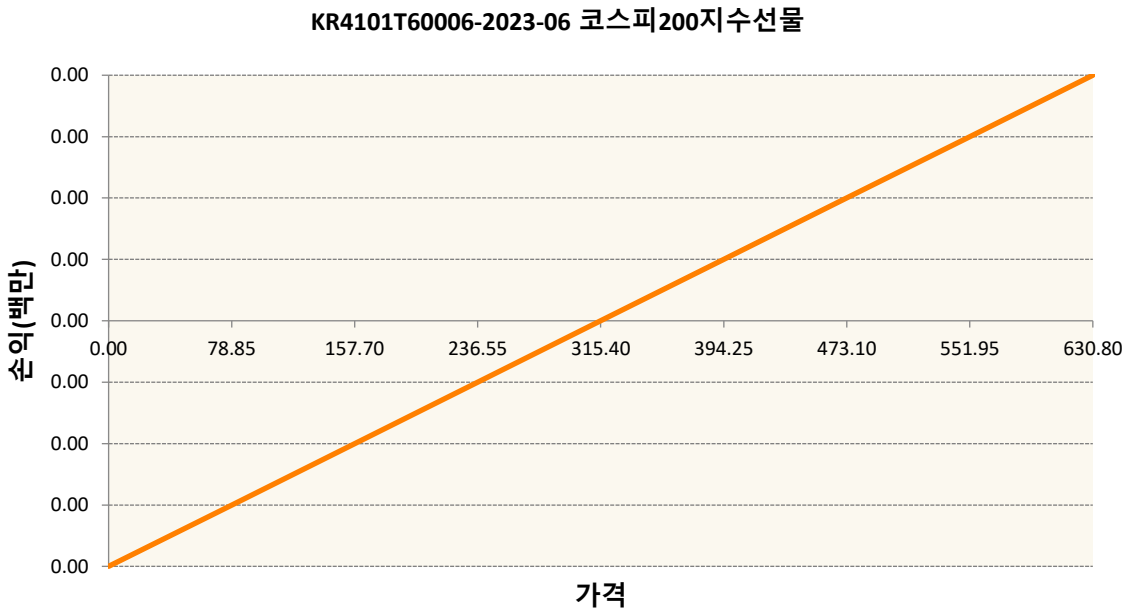
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

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	1,355	0	1,355	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101T60006		2023-06 코스피200지수선물					107
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-107	-107	-107	-107	-107	-107	-107
-5.33%	-71	-71	-71	-71	-71	-71	-71
-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%	71	71	71	71	71	71	71
8.00%	107	107	107	107	107	107	107

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

115

공시일	2023-03-23
기준일	2023-03-22

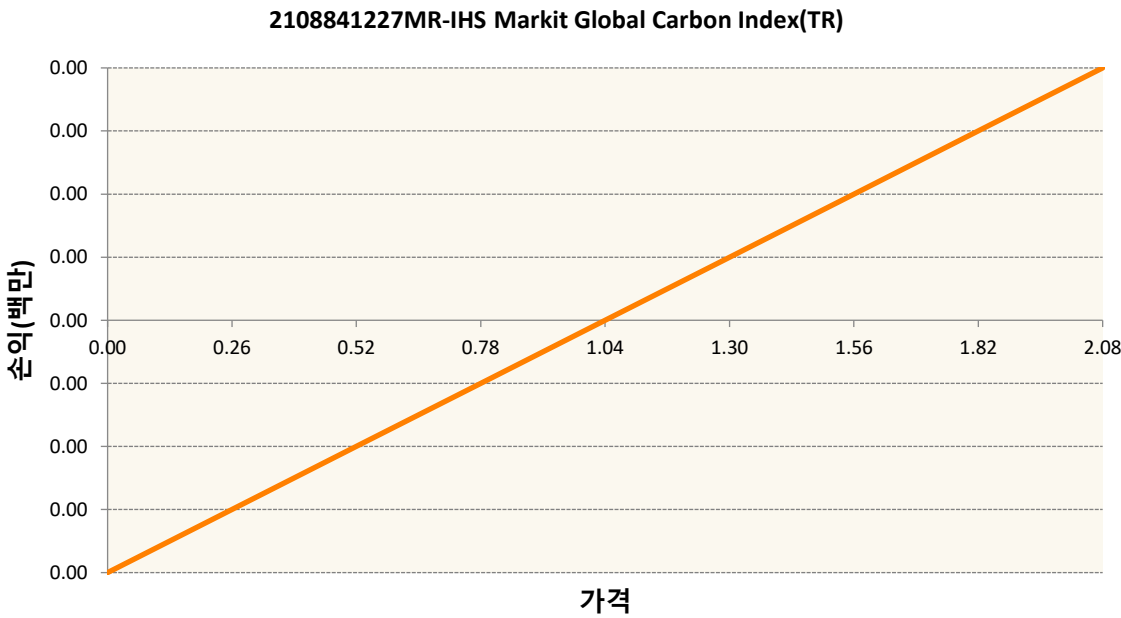
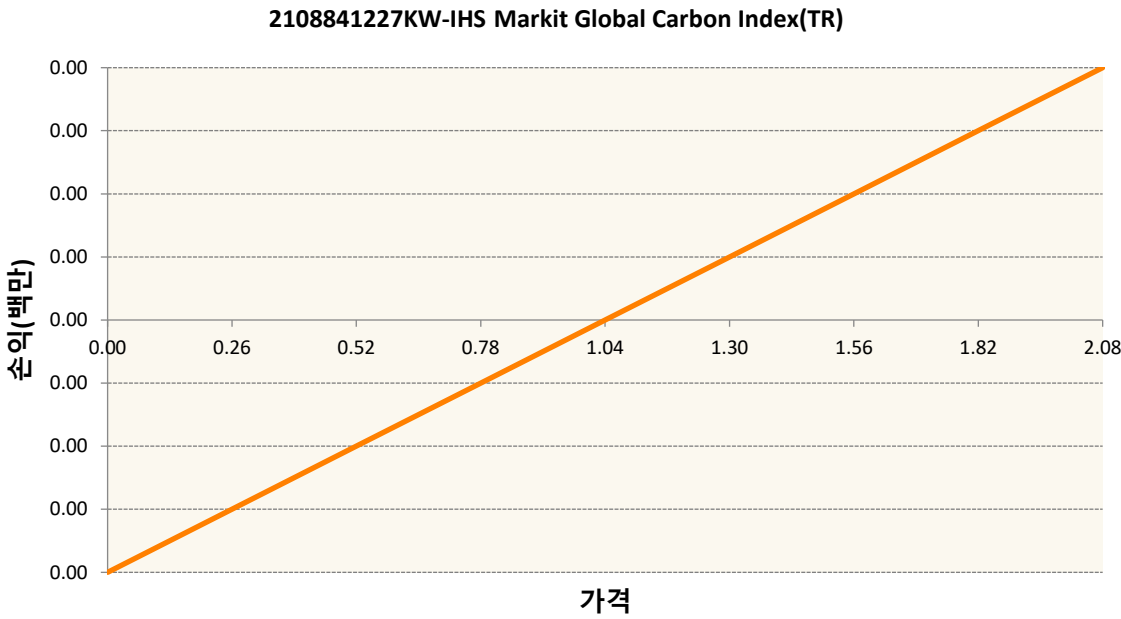
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

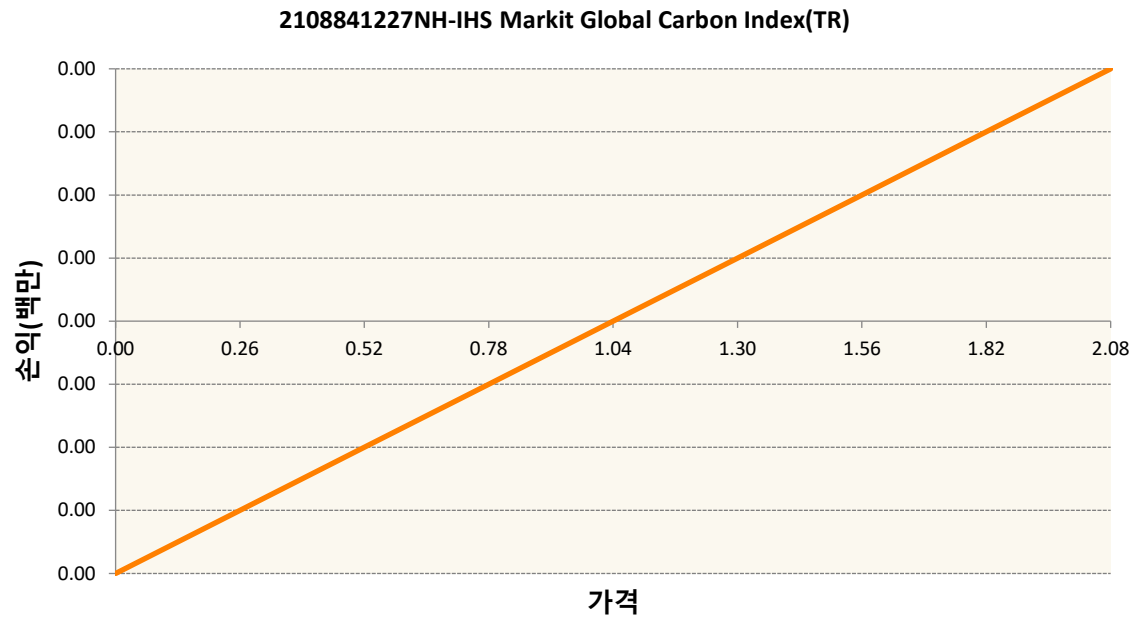
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	25,320	0	25,320	

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108841227IHS Markit Global Carbon Index(TR)		1,722
2108841227IHS Markit Global Carbon Index(TR)		203
2108841227IHS Markit Global Carbon Index(TR)		101

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)		(단위:백만원)
		3,856

공시일 2023-03-23

기준일 2023-03-22

SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

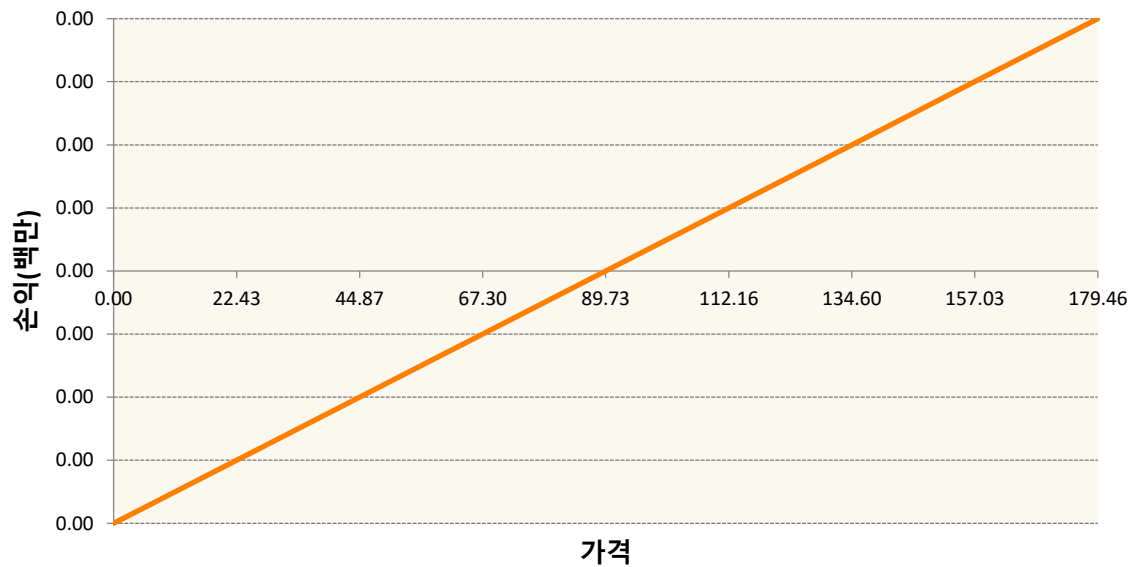
1. 계약금액

(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	9,293	0	9,293	
누계	통화	선도	1,702	4,263	-2,561	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	743

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

(단위:백만원)

2,279

공시일	2023-03-23
기준일	2023-03-22

신한SOL차이나태양광CSI증권상장

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	64	0	64	장외
누계	지수	스왑	9,383	0	9,383	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI00000 신한CSI Index 221222 (NH)	0.41
SWCSI00000 신한CSI Index 221222 (키움)	0.41
SWCSI00000 신한CSI Index 221222 (미래)	0.41
SWCSI00000 신한CSI Index 221222 (메리츠)	0.41

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

(단위:백만원)

3

공시일	2023-03-23
기준일	2023-03-22

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)
	67

공시일	2023-03-23
기준일	2023-03-22

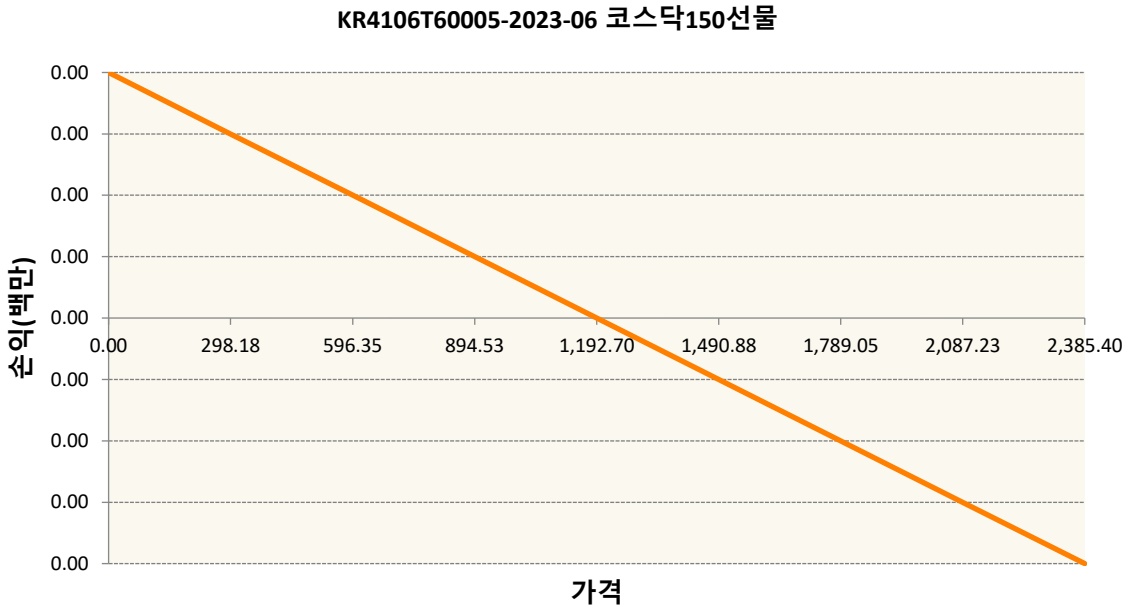
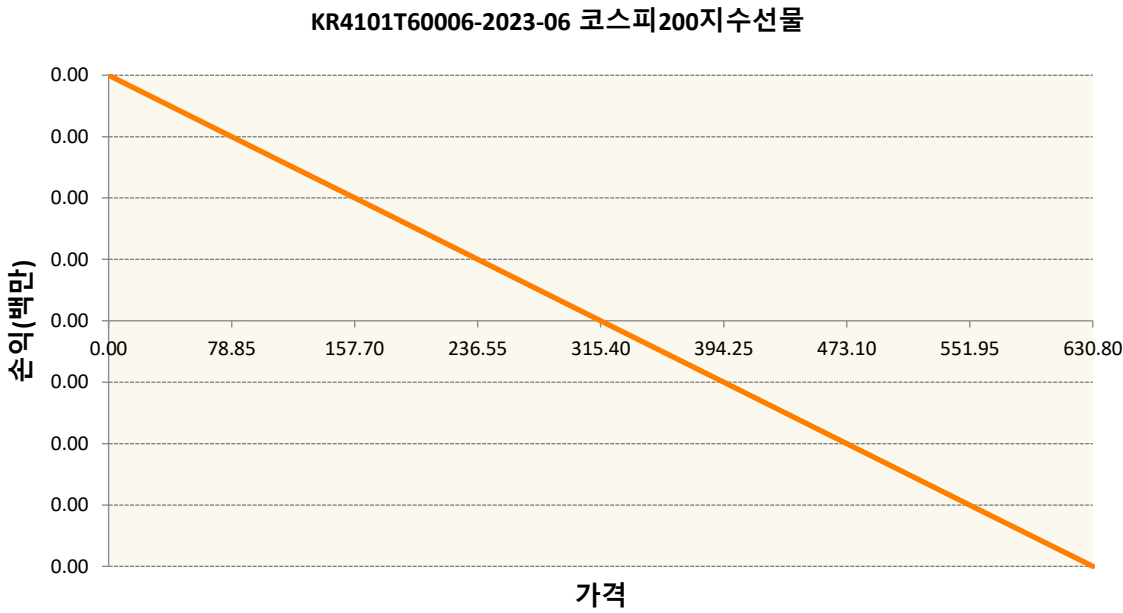
에쿼티알파일반사모혼합자산

1. 계약금액

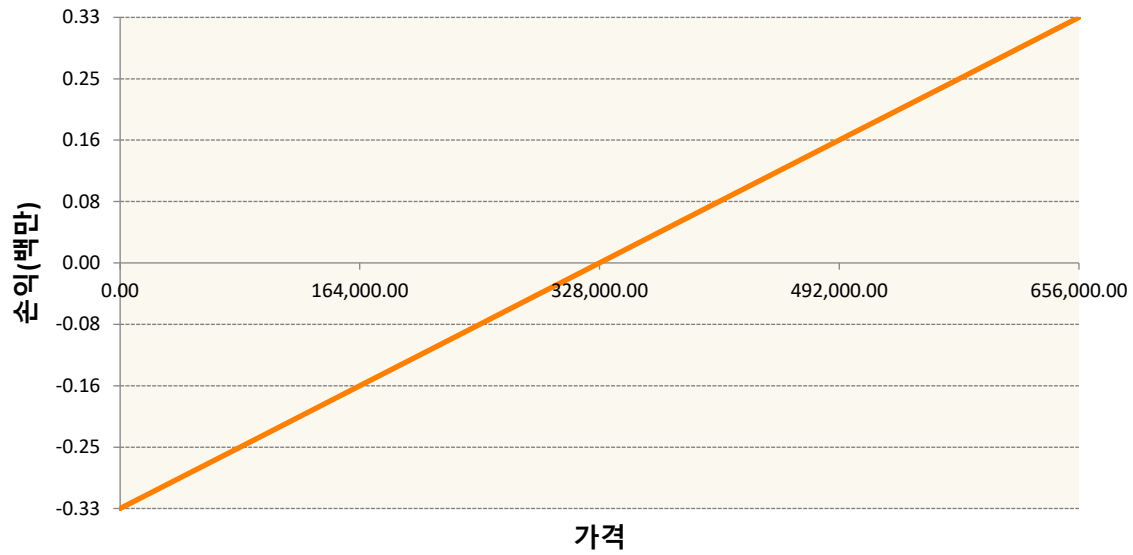
(단위:백만원)

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	438	2,846	-2,408	장내
누계	유가증권	스왑	0	0	0	장외

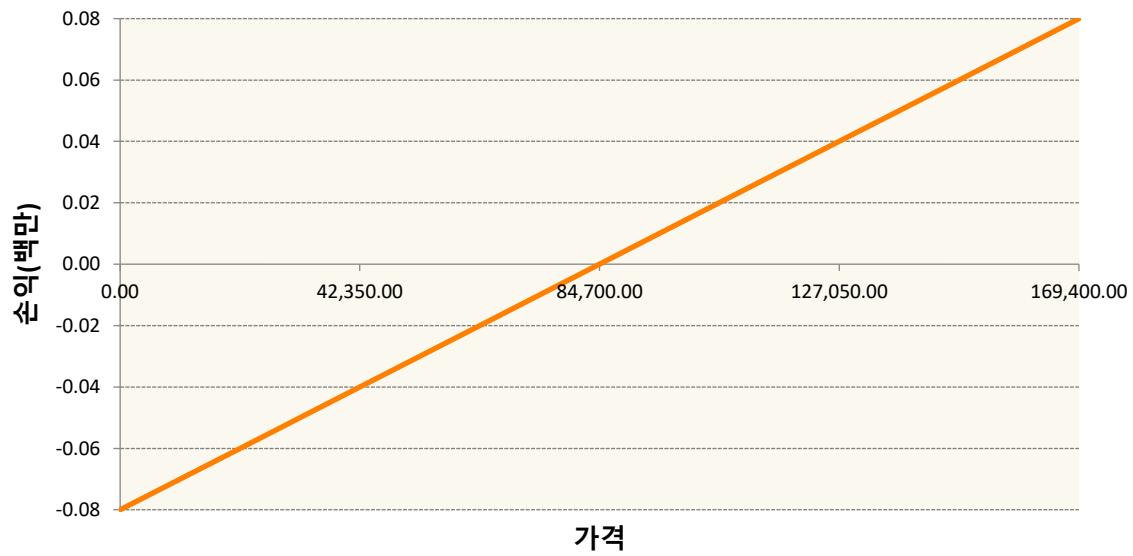
2. 만기시점의 손익구조



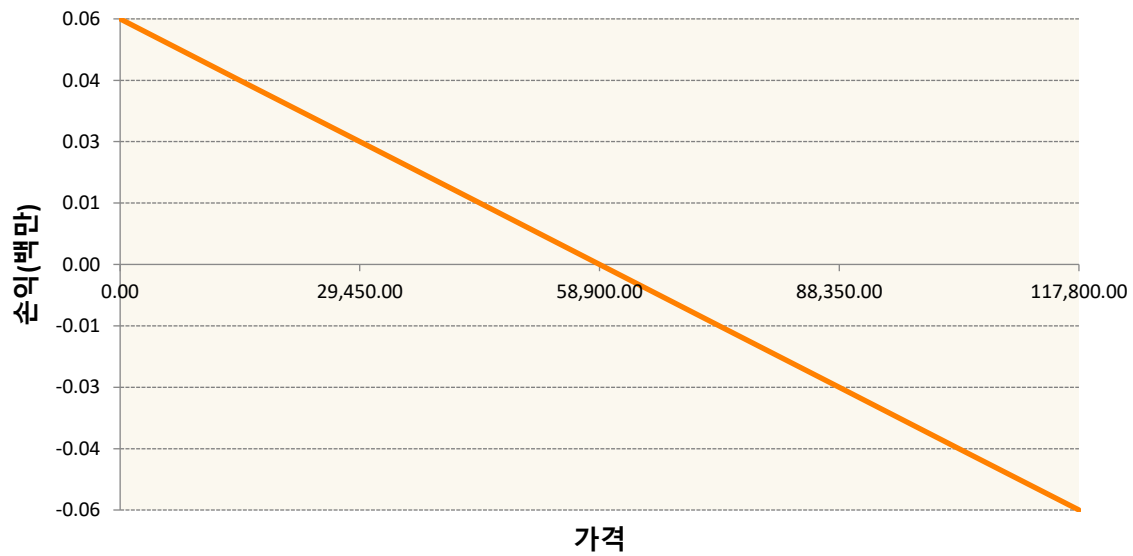
KR4113T40003-2023-04 POSCO홀딩스개별선물



KR41E4T40007-2023-04 에스엠개별선물



KR41F7T40009-2023-04 카카오페이개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
KR4101T600	2023-06 코스피200지수선물	126
KR4106T600	2023-06 코스닥150선물	94
KR4113T400	2023-04 POSCO홀딩스개별선물	26
KR41E4T400	2023-04 에스엠개별선물	9
KR41F7T400	2023-04 카카오페이개별선물	7
KRS0004054	SWAP_MICROSOFT CP_0221	0.06
KRS0004054	SWAP_FIRST TRUST ECL_0221	0.18
KRS0004099	SWAP_MICRON TECH_0308	0.36

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	407

공시일	2023-03-23
기준일	2023-03-22

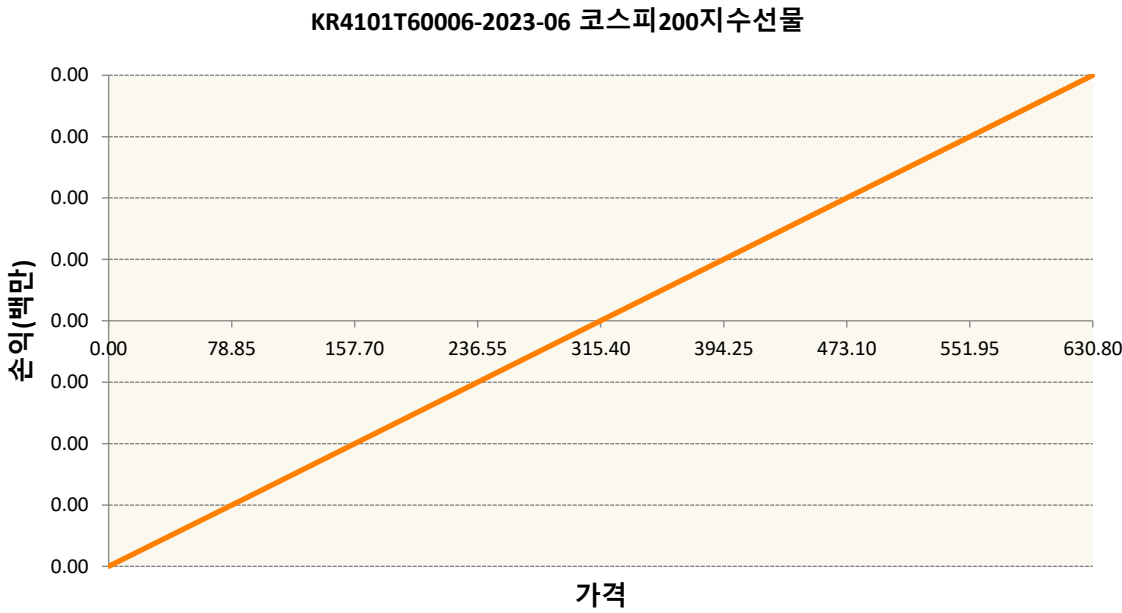
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

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	2,996	0	2,996	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101T60006		2023-06 코스피200지수선물					239
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-239	-239	-239	-239	-239	-239	-239
-5.33%	-159	-159	-159	-159	-159	-159	-159
-2.67%	-80	-80	-80	-80	-80	-80	-80
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	80	80	80	80	80	80	80
5.33%	159	159	159	159	159	159	159
8.00%	239	239	239	239	239	239	239

공시일	2023-03-23
기준일	2023-03-22

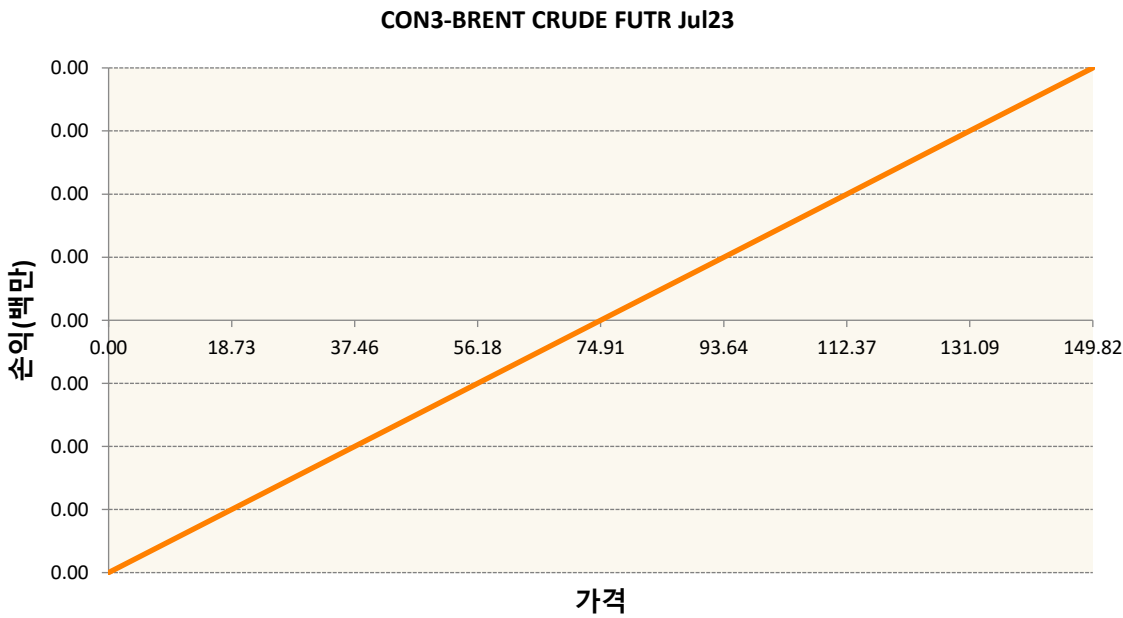
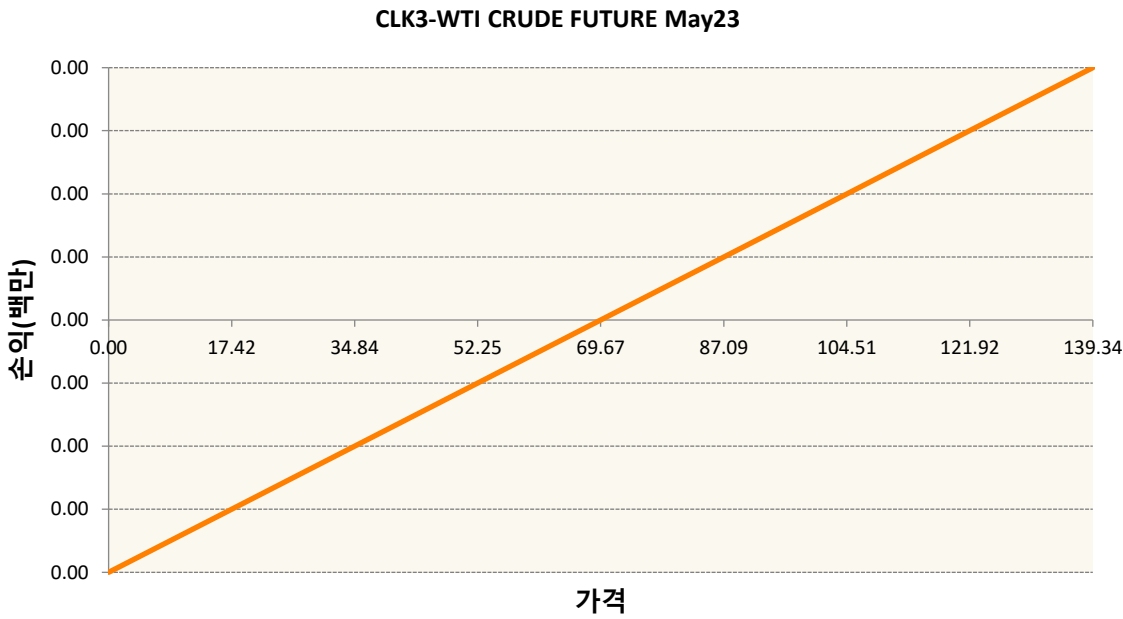
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

1. 계약금액

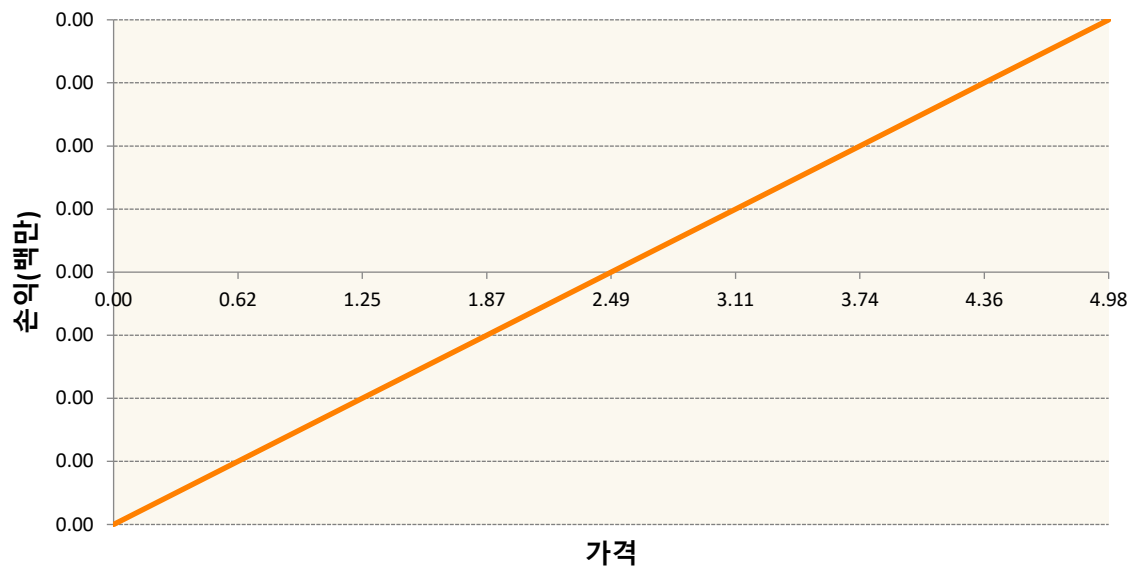
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,554	196	1,358	

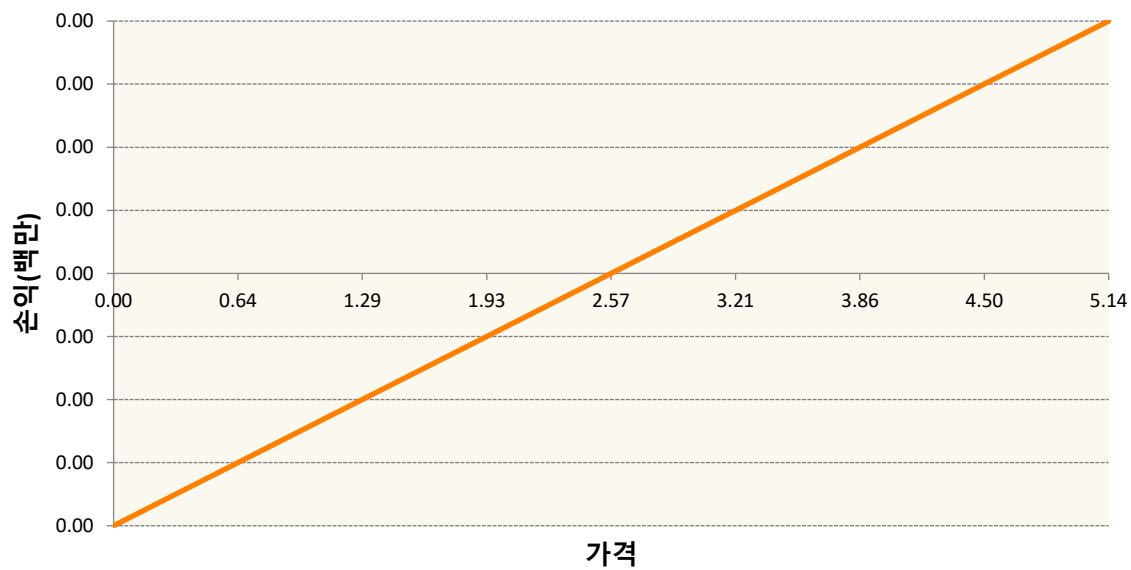
2. 만기시점의 손익구조



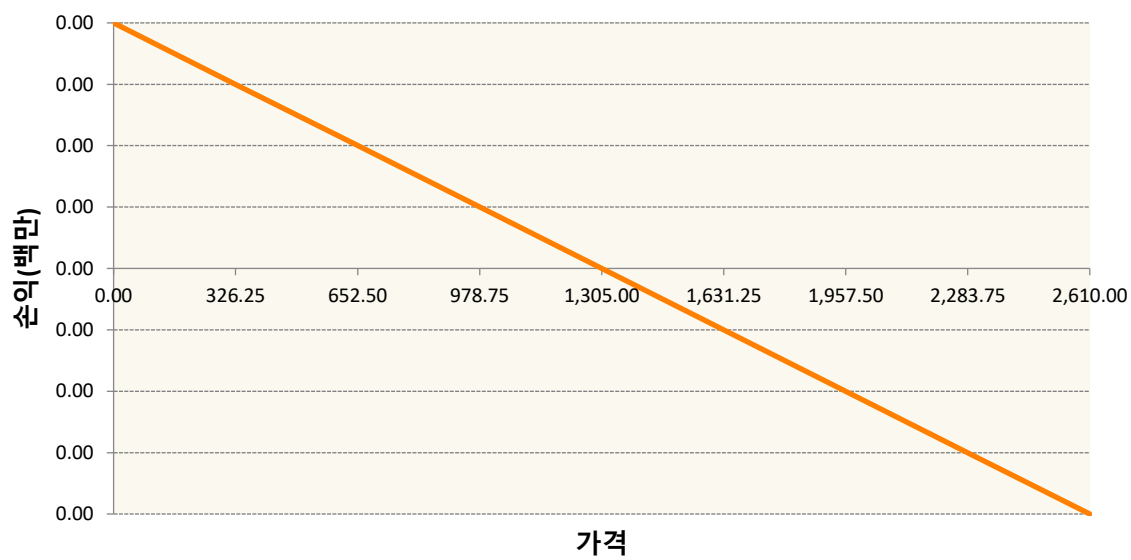
EOK3-E-MINI NATURAL GAS May23



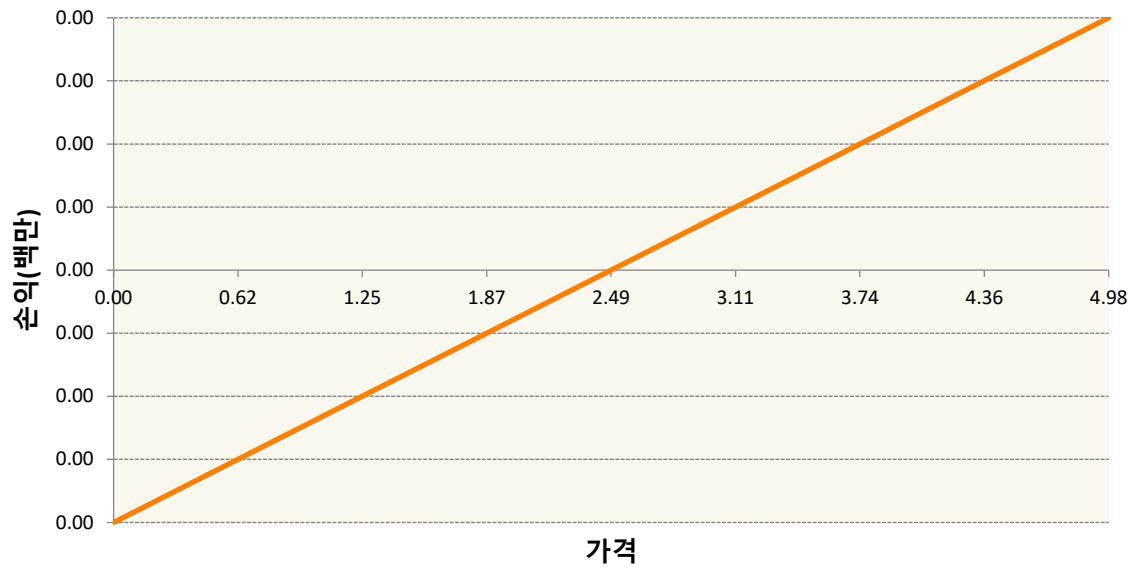
HOK3-NY Harb ULSD Fut May23



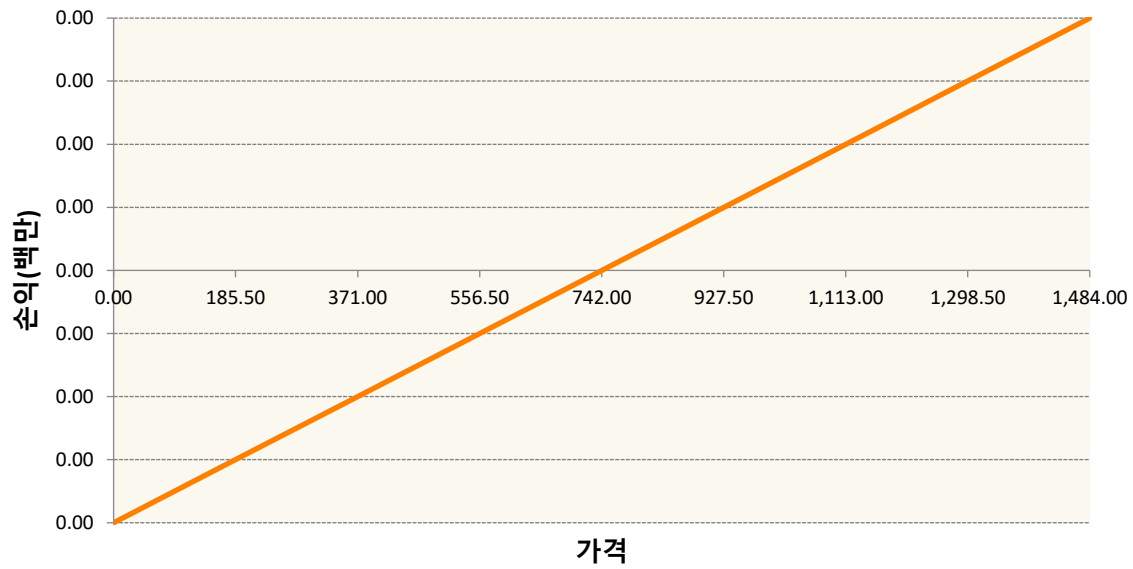
KR4175T40002-2023-04 달러선물



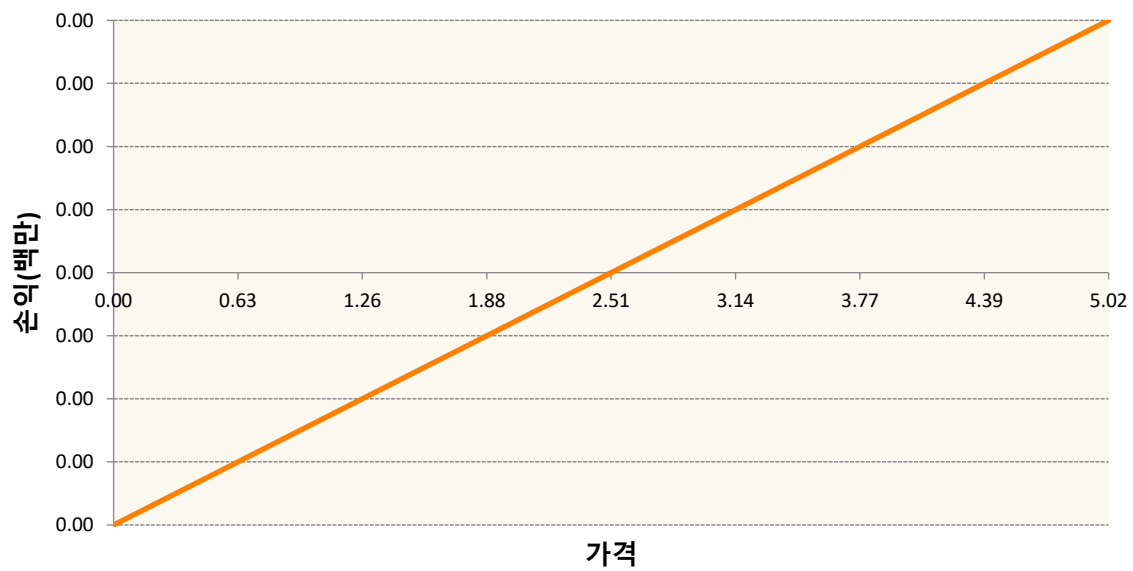
NGK23-NATURAL GAS FUTR May23



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	32
EOK3	E-MINI NATURAL GAS May23	2
HOK3	NY Harb ULSD Fut May23	11
KR4175T400	2023-04 달러선물	16
NGK23	NATURAL GAS FUTR May23	25
QSK3	Low Su Gasoil G May23	15
XBK3	GASOLINE RBOB FUT May23	11

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

383