

공시일	2023-03-27
기준일	2023-03-24

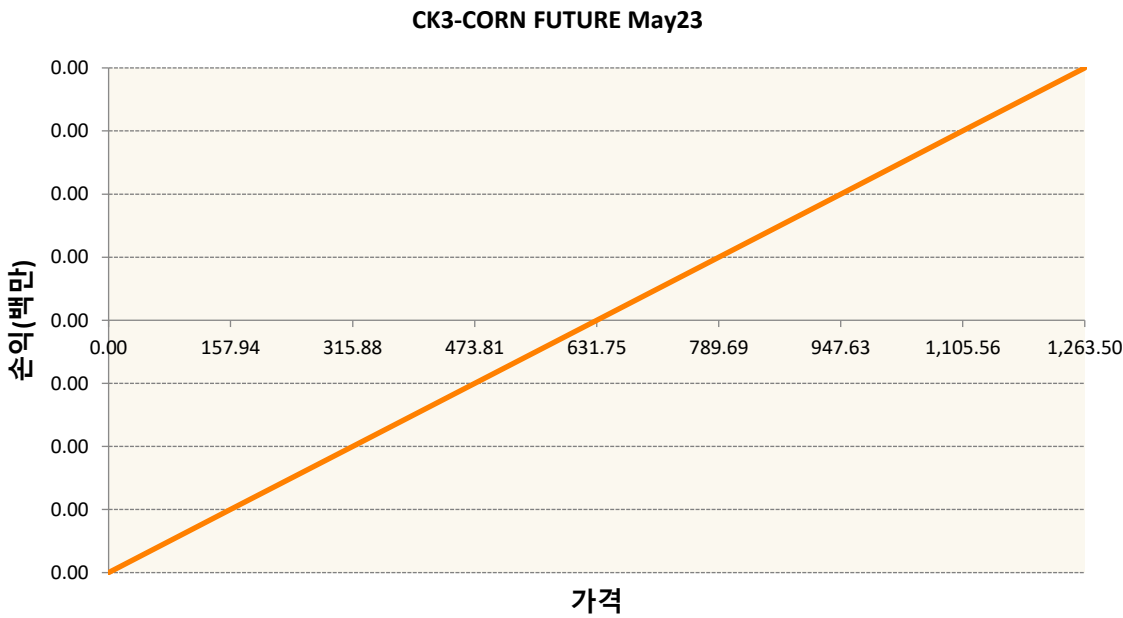
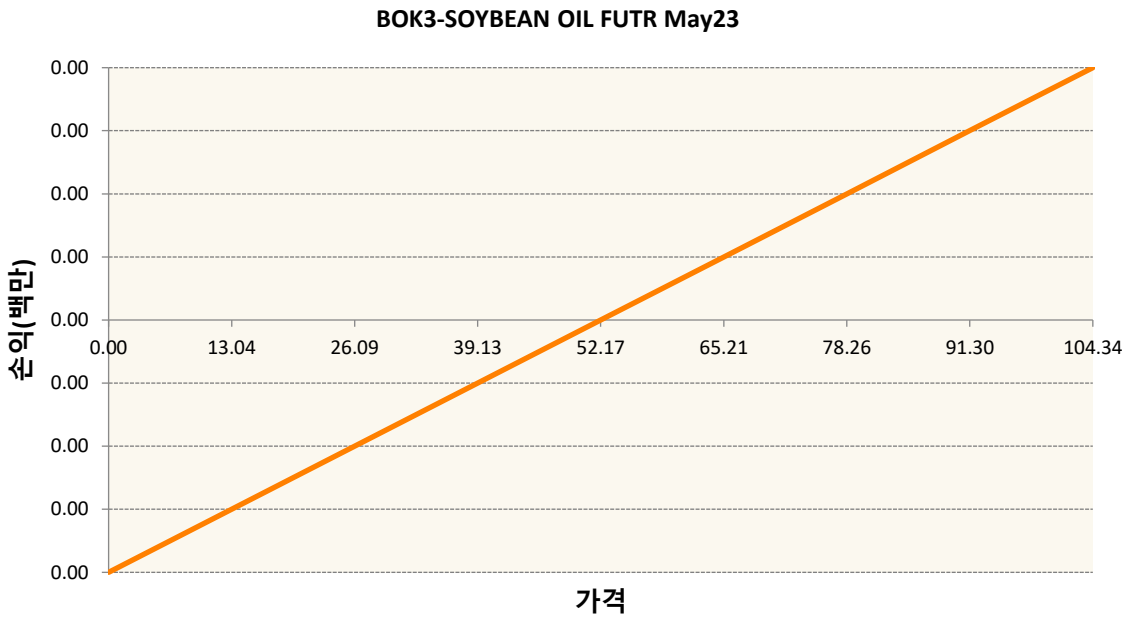
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

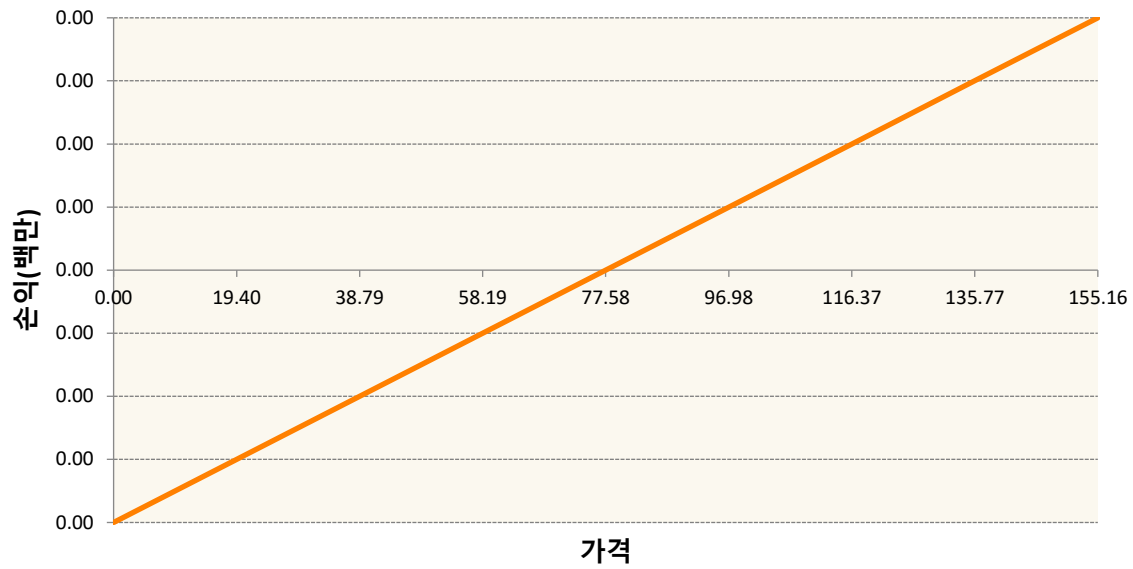
(단위:USD 백만)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,447	516	4,930	

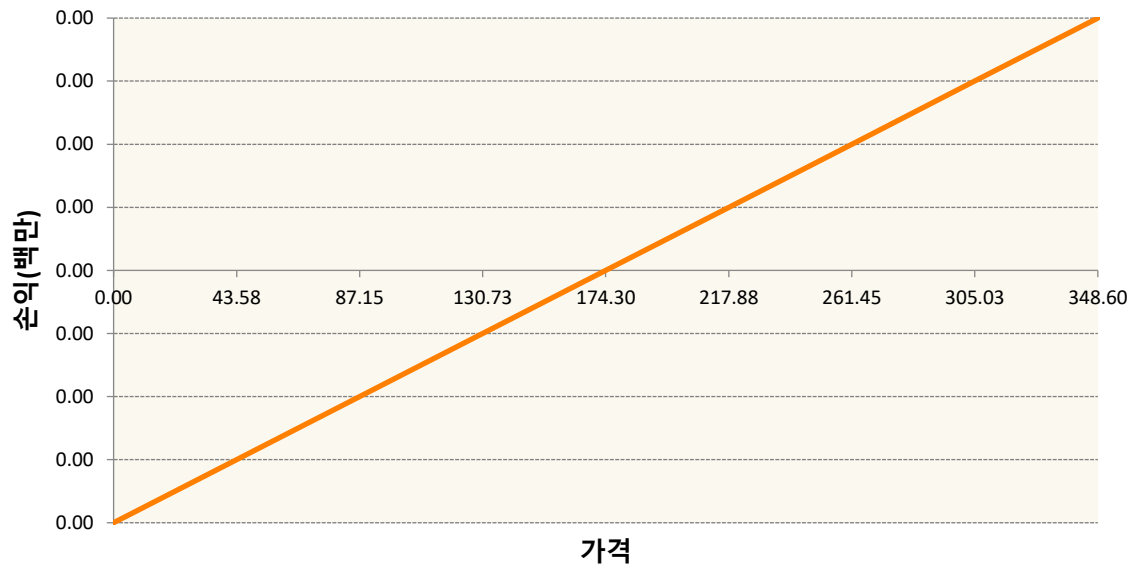
2. 만기시점의 손익구조



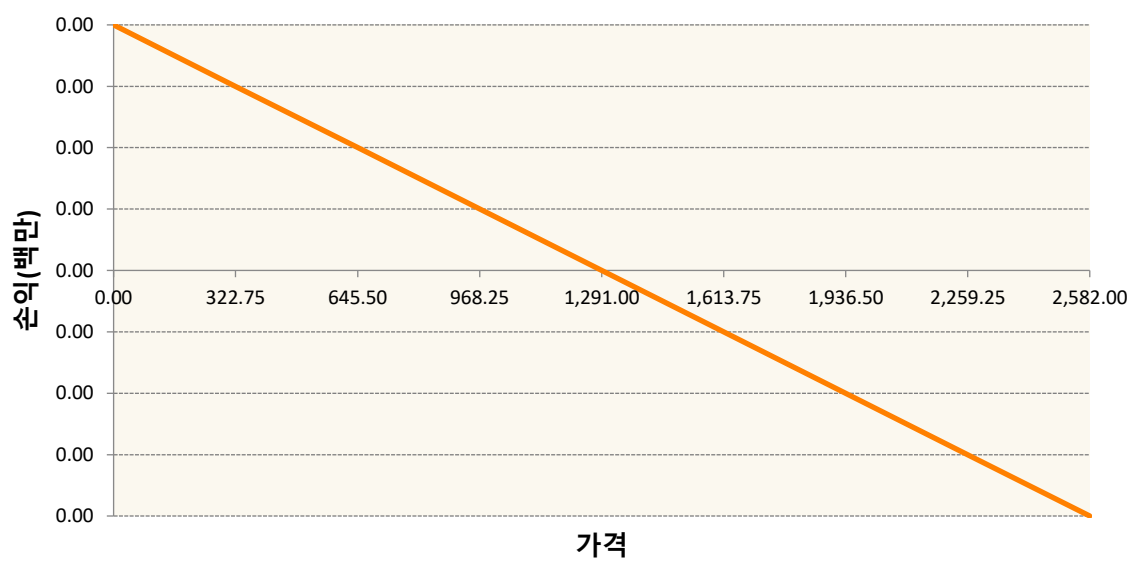
CTK3-COTTON NO.2 FUTR May23



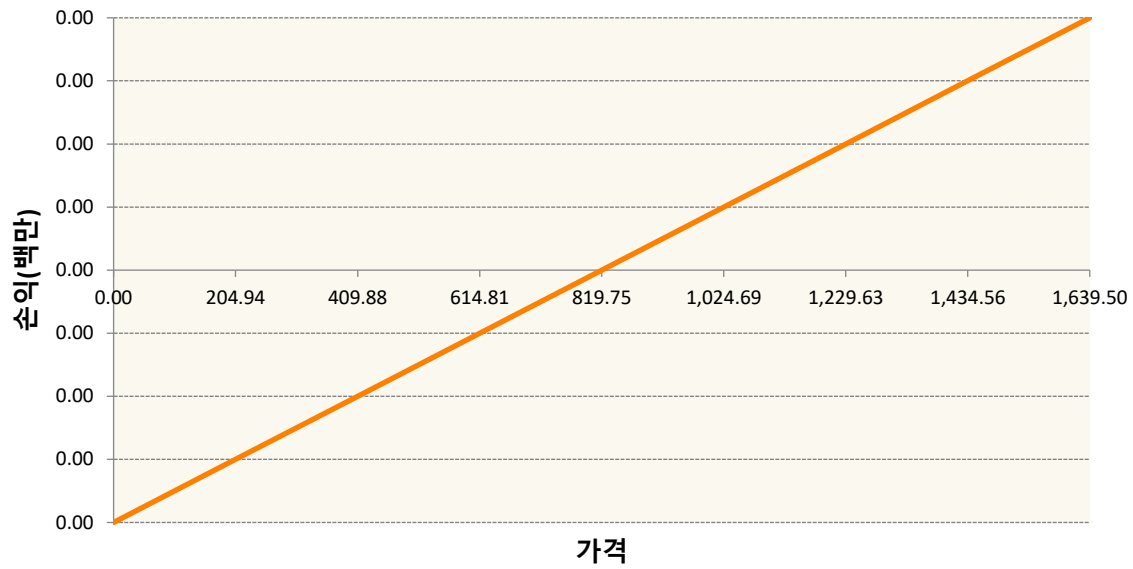
KCK3-COFFEE 'C' FUTURE May23



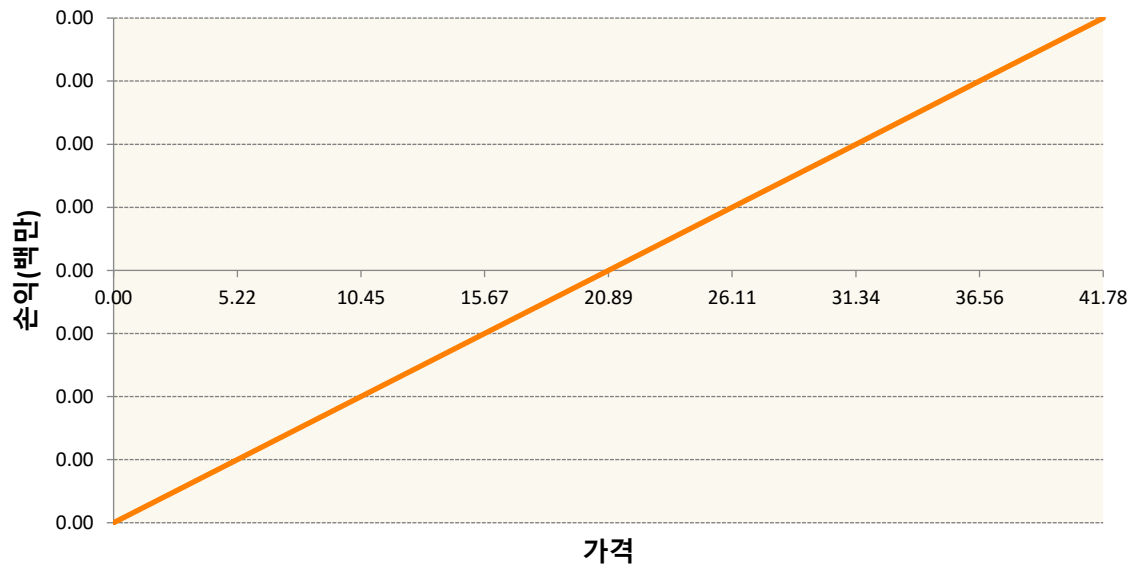
KR4175T40002-2023-04 달러선물



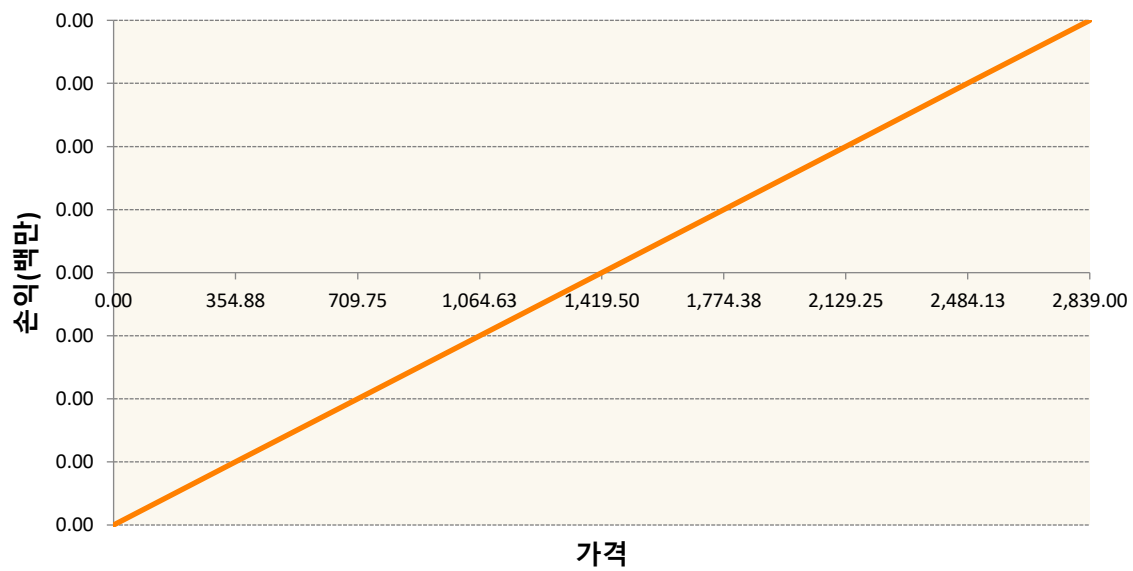
KWK3-KC HRW WHEAT FUT May23



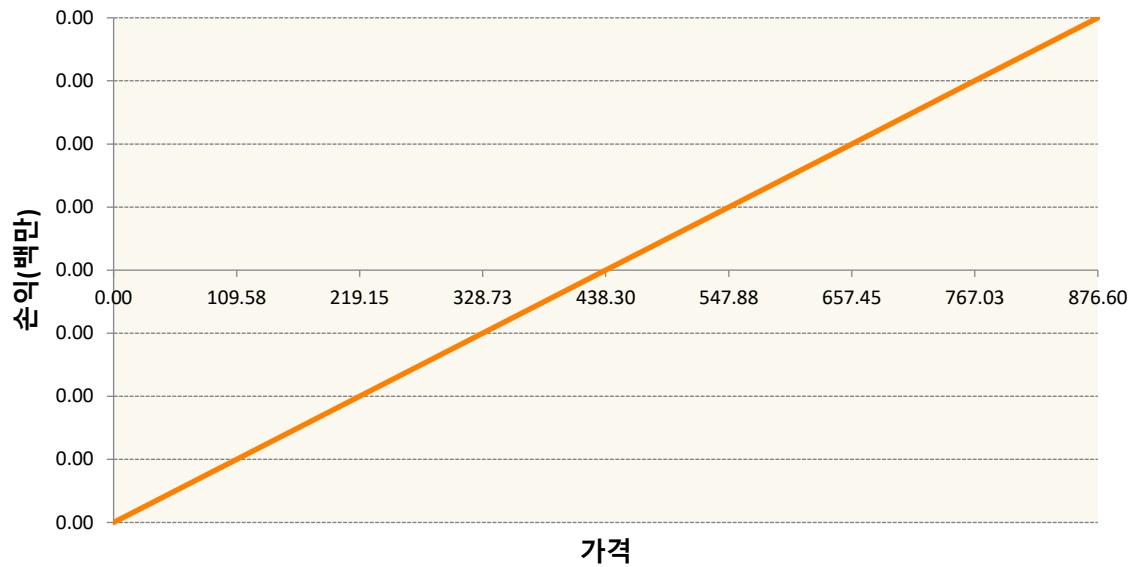
SBK3-Sugar #11 (WORLD) May23



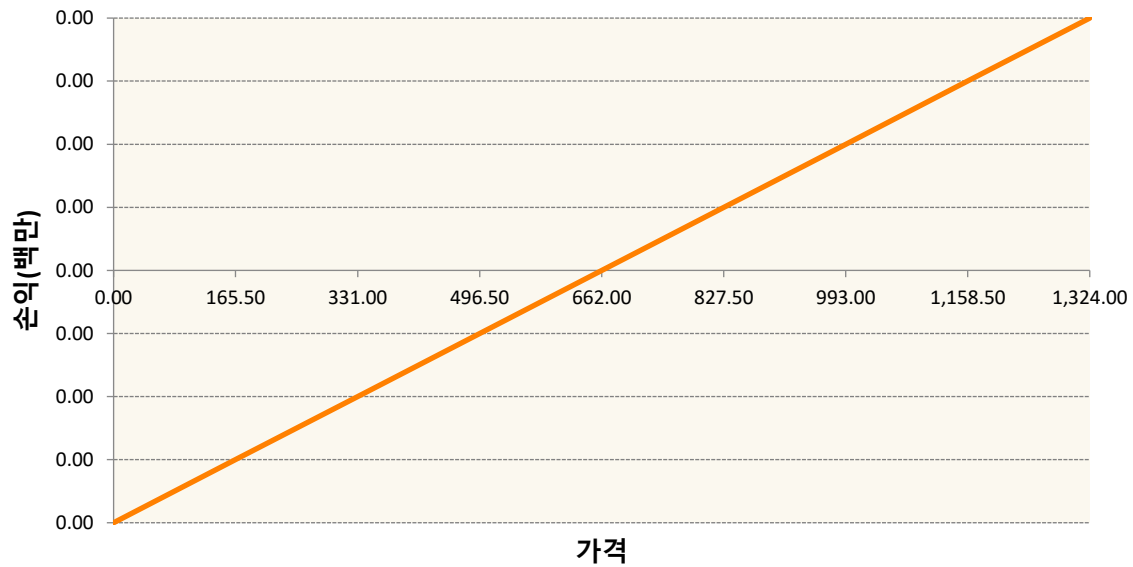
SK3-SOYBEAN FUTURE May23



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	2023-03-27
기준일	2023-03-24

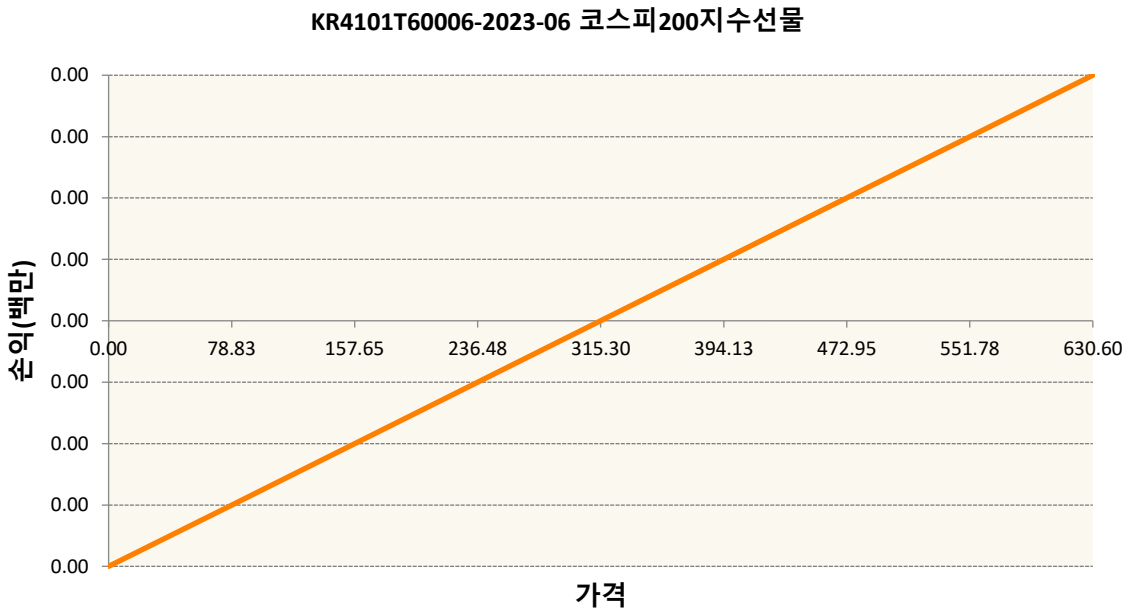
스마트인덱스모

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	2,680	0	2,680	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	2023-03-27
기준일	2023-03-24

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	371
-----------------------------	-----

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

484

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2023-03-27
기준일	2023-03-24

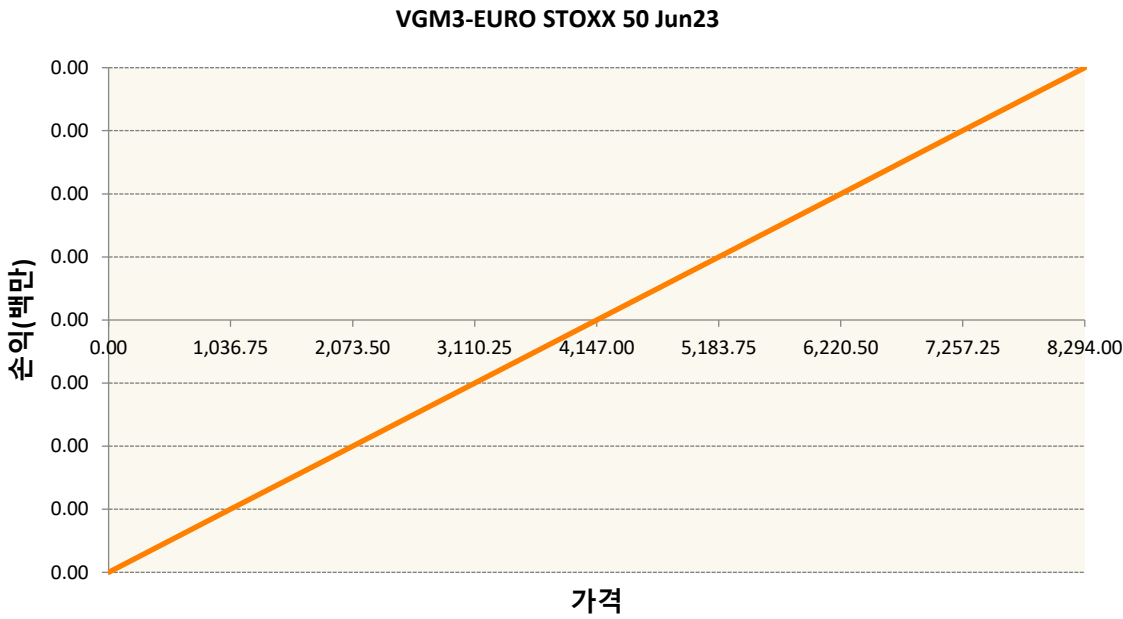
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	462	0	462	

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	2023-03-27
기준일	2023-03-24

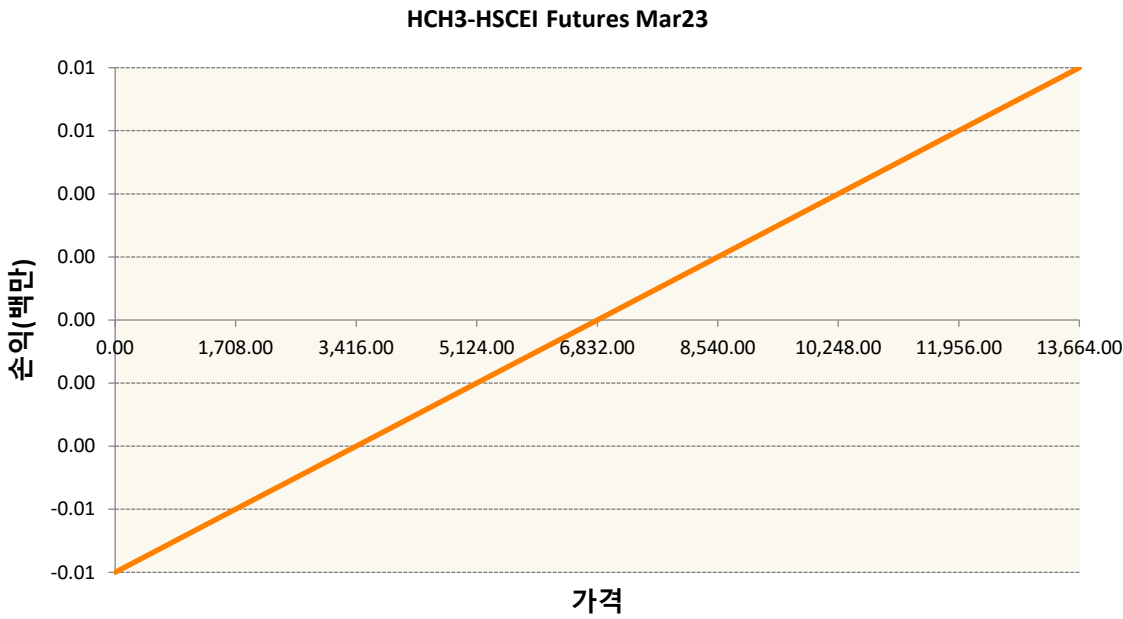
차이나인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,191	0	1,191	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCH3	HSCEI Futures Mar23	95
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

128

공시일	2023-03-27
기준일	2023-03-24

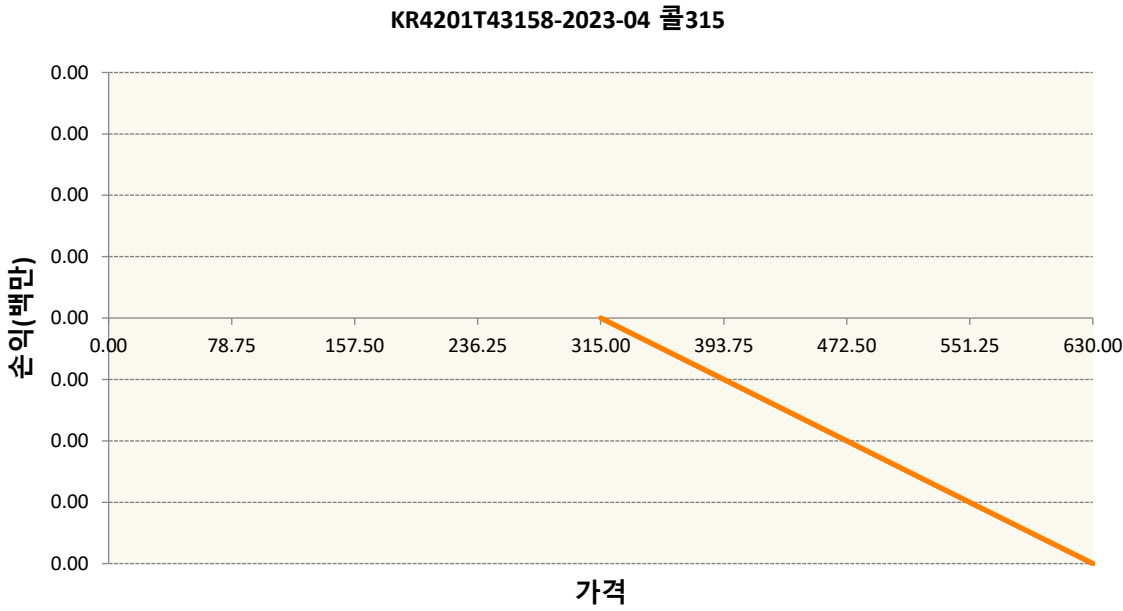
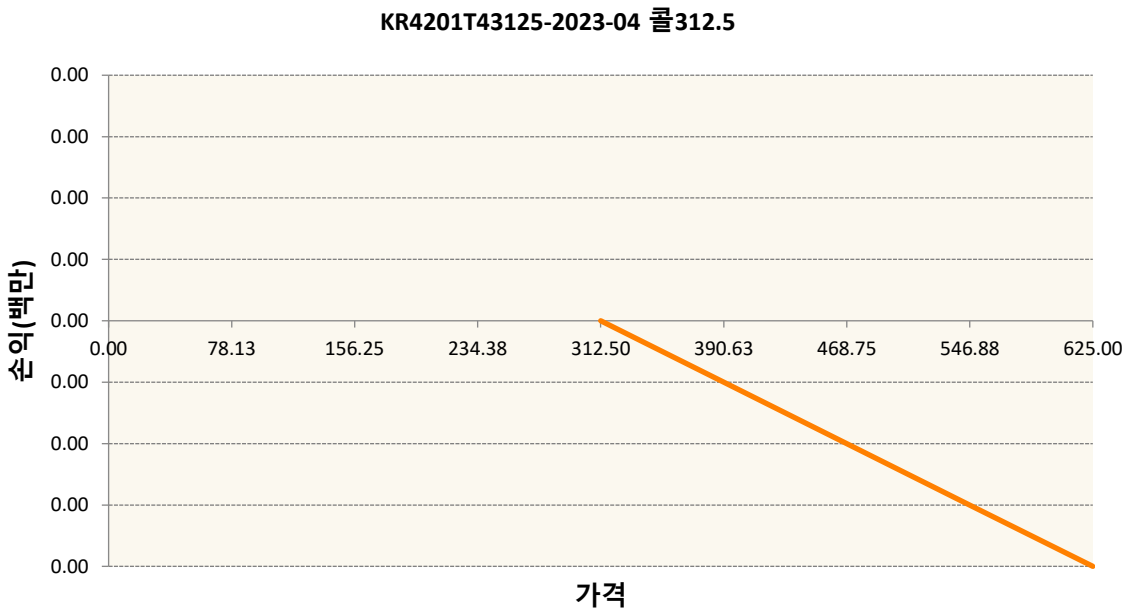
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

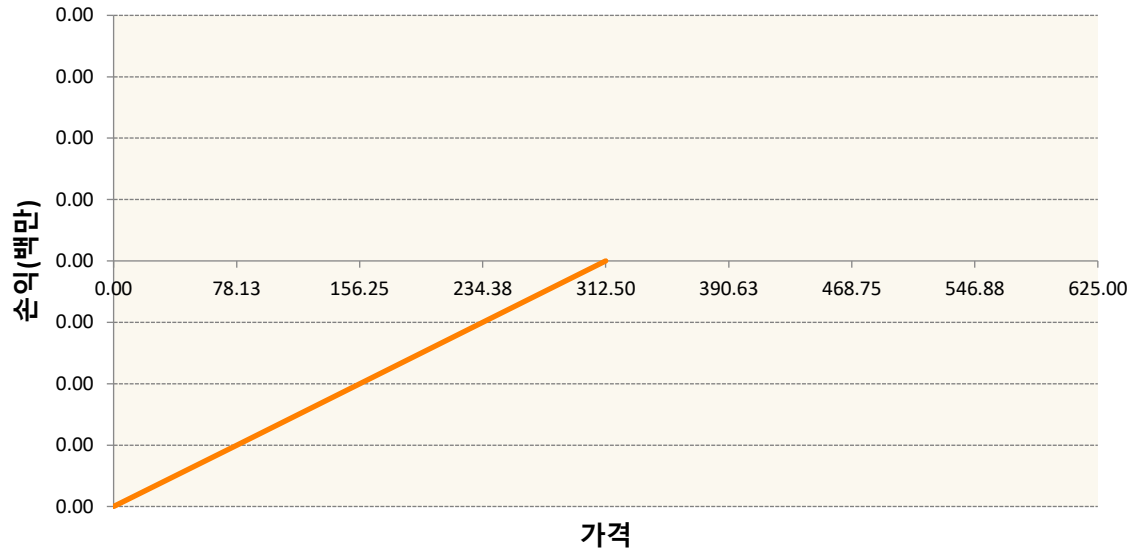
(단위:백만원)

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								736
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	310	304	295	286	275	262	249	
-5.33%	281	267	251	235	218	200	181	
-2.67%	208	186	165	143	121	99	76	
0%	70	47	23	0	-23	-47	-70	
2.67%	-135	-154	-174	-194	-215	-236	-258	
5.33%	-391	-403	-417	-432	-448	-465	-482	
8.00%	-678	-683	-691	-700	-711	-723	-736	
KR4201T43158 2023-04 콜315								2,090
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	775	761	743	721	694	664	631	
-5.33%	715	682	645	603	559	512	463	
-2.67%	549	492	434	375	314	252	190	
0%	204	136	68	0	-68	-136	-204	
2.67%	-346	-406	-468	-531	-595	-660	-725	
5.33%	-1,069	-1,109	-1,154	-1,202	-1,253	-1,306	-1,361	
8.00%	-1,900	-1,920	-1,946	-1,976	-2,011	-2,049	-2,090	
KR4301T43123 2023-04 풋312.5								567
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-515	-521	-528	-536	-545	-556	-567	
-5.33%	-281	-293	-306	-319	-334	-349	-365	
-2.67%	-83	-101	-120	-138	-157	-176	-195	
0%	59	40	20	0	-20	-40	-60	

2.67%	145	129	112	95	77	59	40
5.33%	187	177	165	153	139	125	109
8.00%	203	198	192	184	175	165	154

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

(단위:백만원)

3,343

공시일	2023-03-27
기준일	2023-03-24

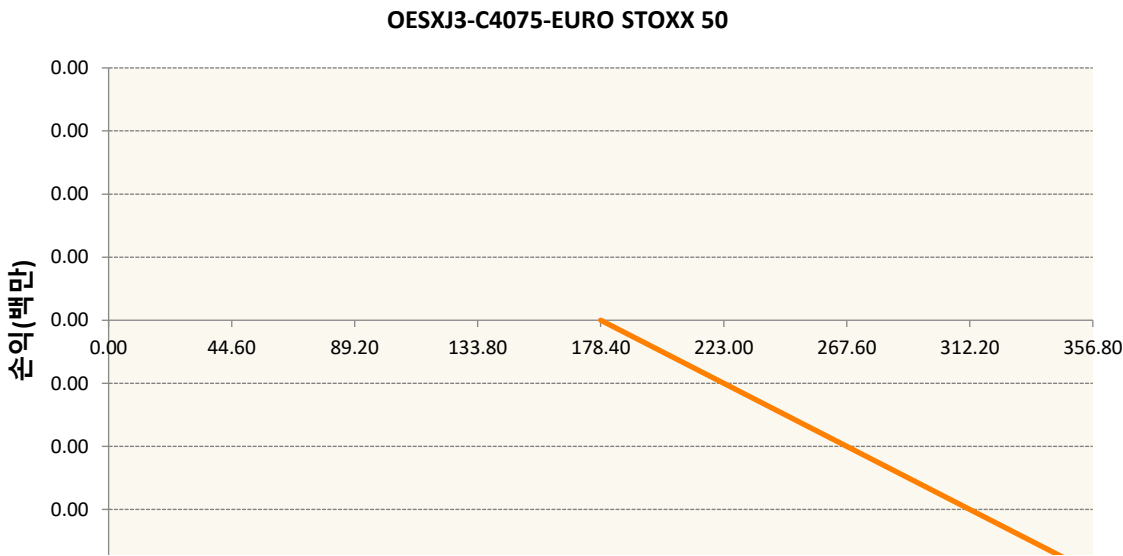
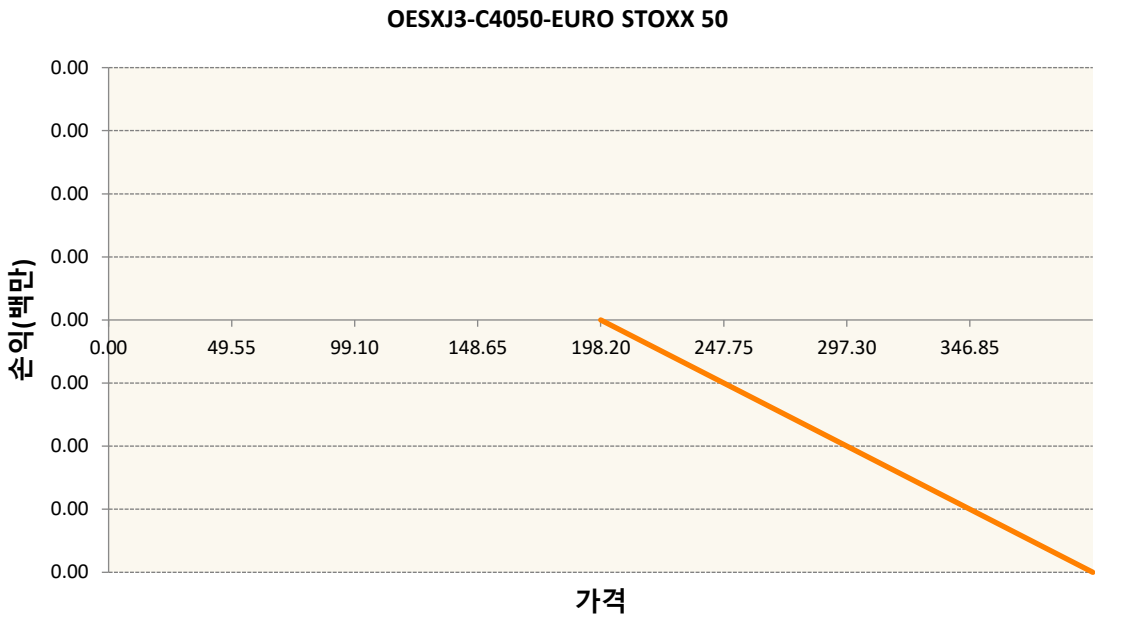
유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

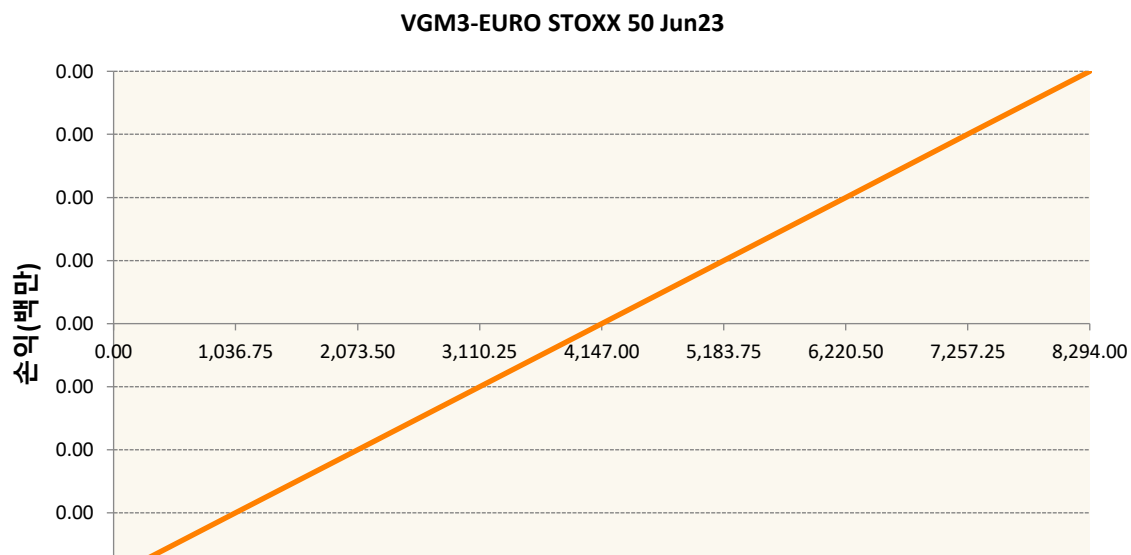
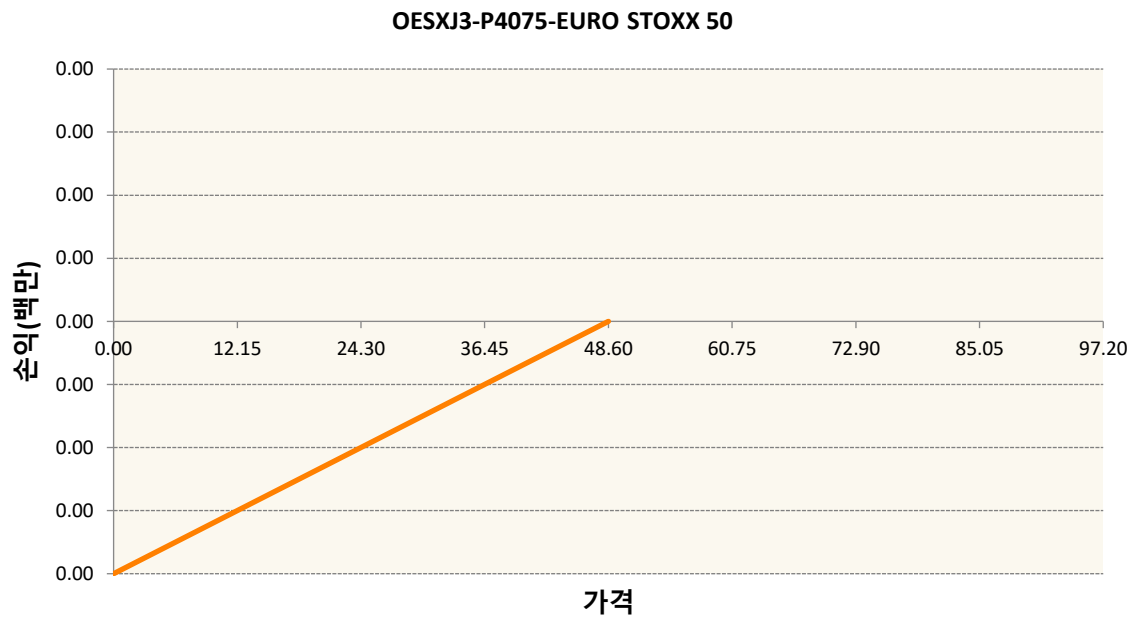
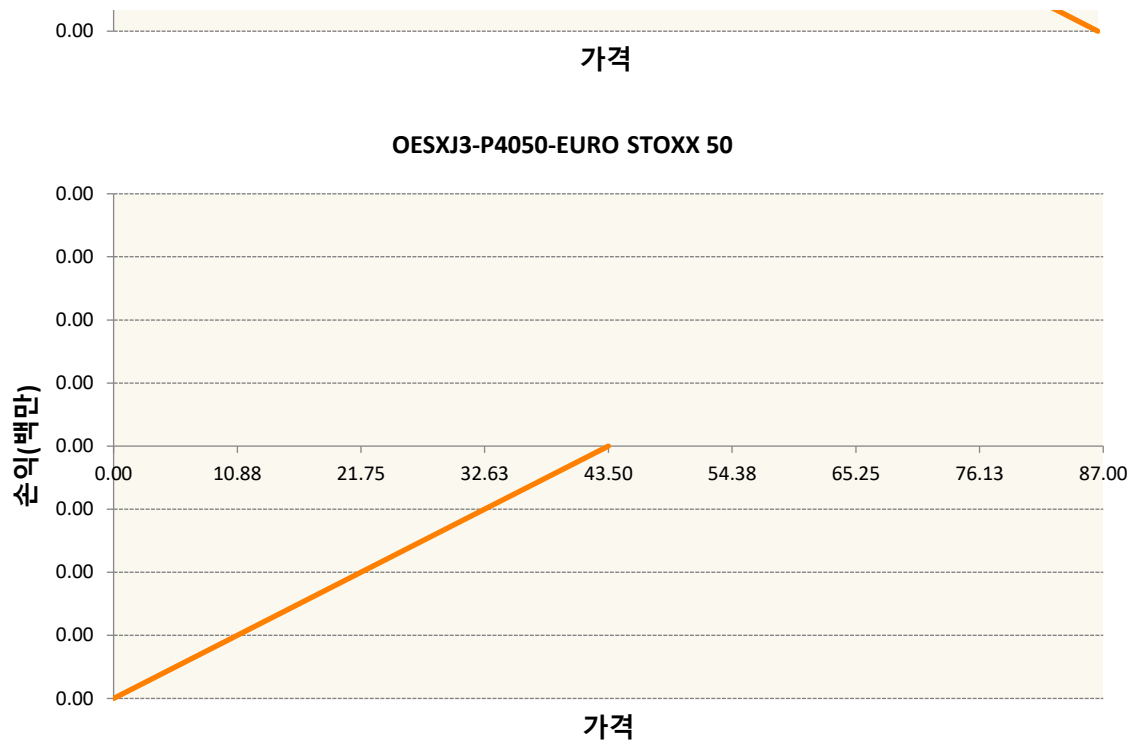
1. 계약금액

(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	924	0	924	
누계	유가증권	옵션	0	98	-98	장내
누계	통화	선도	0	1,682	-1,682	장외

2. 만기시점의 손익구조





0.00

가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213D1R KRW/EUR 28-04-23E	45
FXW213D2N KRW/EUR 26-05-23E	45
FXW213D3N KRW/EUR 28-04-23E	45
OESXJ3-C40! EURO STOXX 50	3
OESXJ3-C40! EURO STOXX 50	4
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)

193

공시일	2023-03-27
기준일	2023-03-24

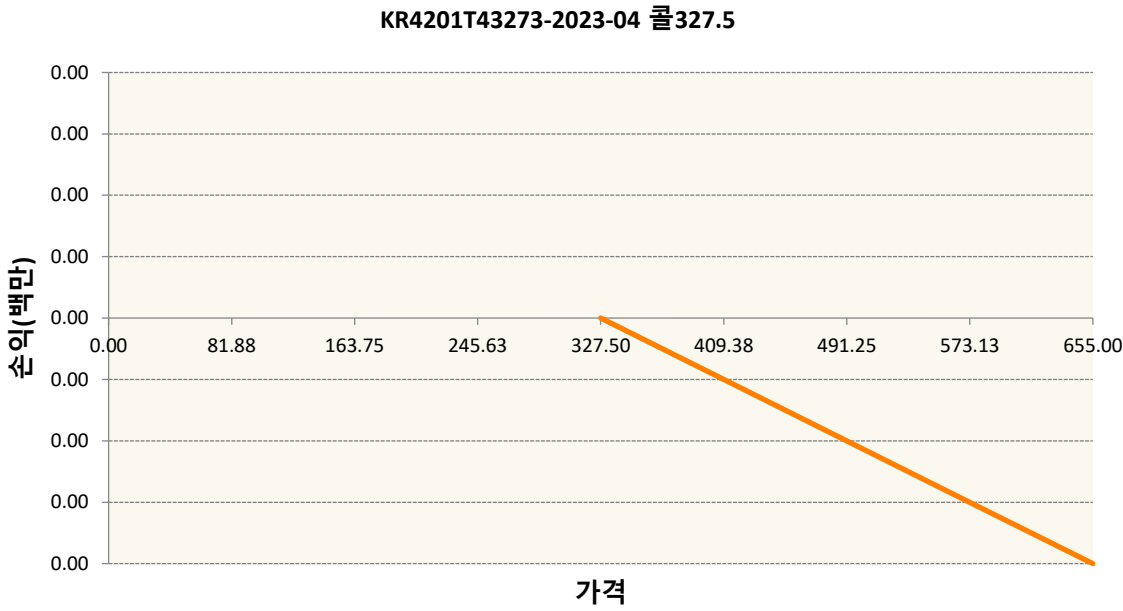
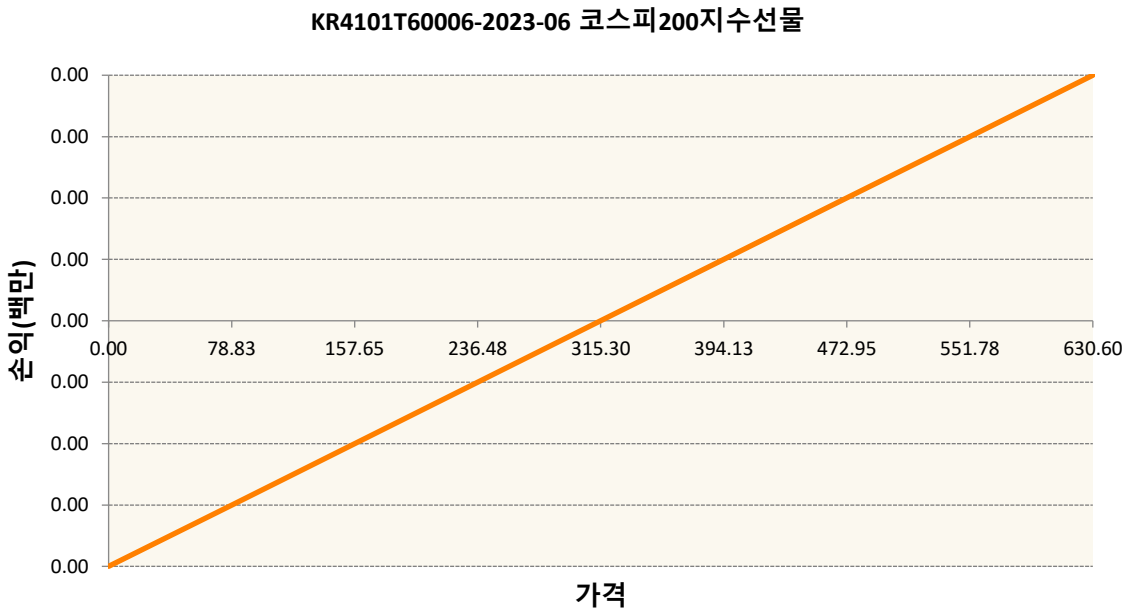
리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

1. 계약금액

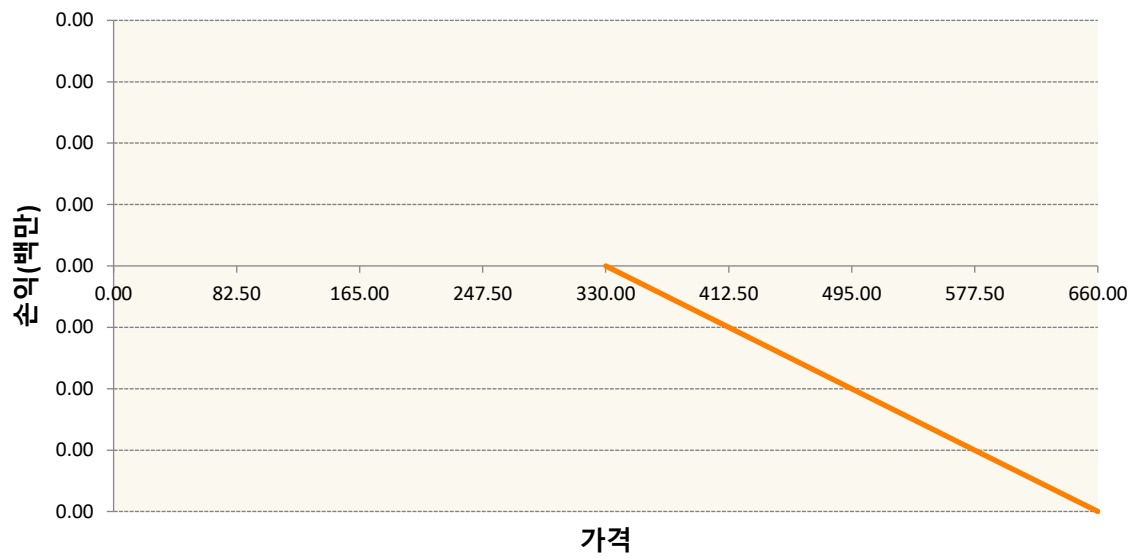
(단위:백만원)

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

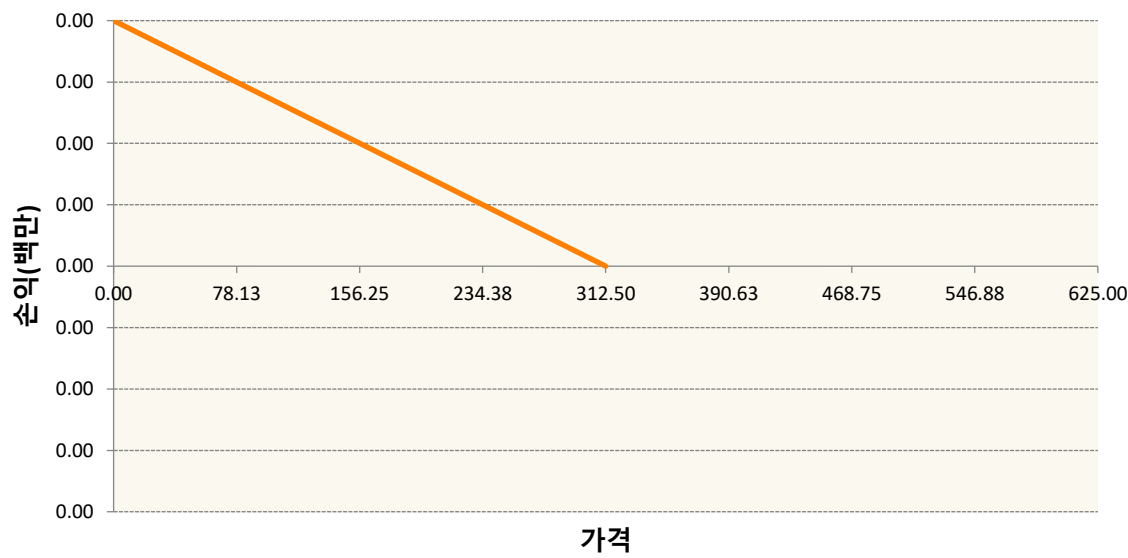
2. 만기시점의 손익구조



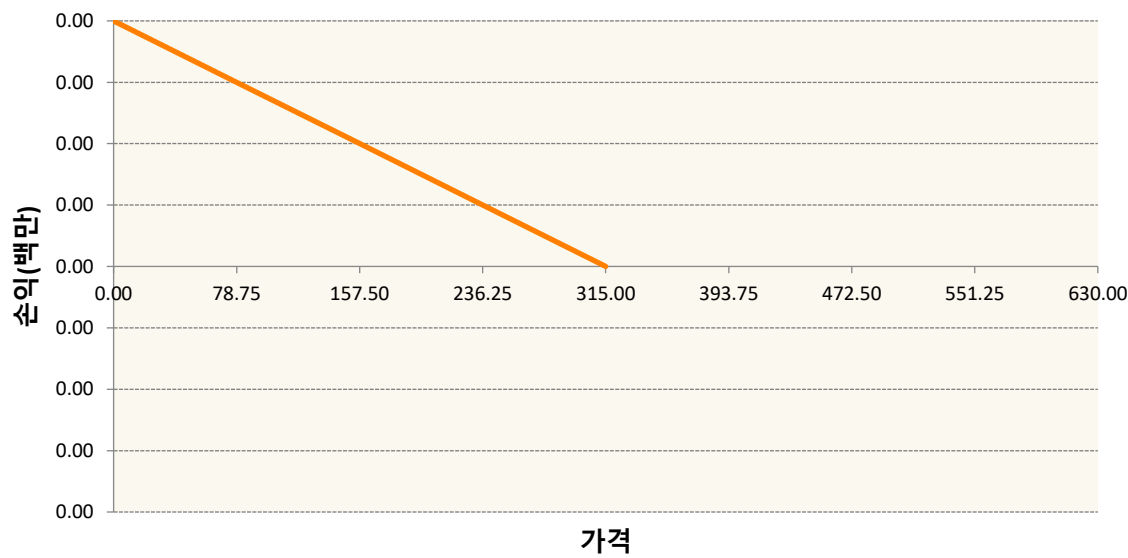
KR4201T43307-2023-04 콜330



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	3	3
-5.33%	4	4	3	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	-4	-5	-6
5.33%	-6	-7	-8	-9	-10	-11	-11
8.00%	-14	-14	-15	-16	-17	-17	-18
KR4201T43307		2023-04 콜330					139
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	25	25	24	24	23	22	21
-5.33%	24	23	22	21	19	17	15
-2.67%	22	20	17	14	11	7	4
0%	13	9	5	0	-5	-10	-16
2.67%	-7	-13	-19	-26	-32	-39	-45
5.33%	-45	-52	-59	-66	-73	-80	-87
8.00%	-102	-108	-114	-120	-126	-133	-139
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%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-1	-1	-1	-1	-1	0	0
5.33%	-2	-1	-1	-1	-1	-1	-1
8.00%	-2	-2	-2	-1	-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	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%	0	0	0	0	0	0	0
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)

167

공시일	2023-03-27
기준일	2023-03-24

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	6,676	0	6,676	

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	2023-03-27
기준일	2023-03-24

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	5,302	0	5,302	

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	2023-03-27
기준일	2023-03-24

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	18,917	0	18,917	
누계	통화	선도	582	25,724	-25,142	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
FXW213CCSI KRW/USD 28-03-23E		549
FXW213D1SI KRW/USD 28-04-23E		309
FXW213D2Q KRW/USD 31-05-23E		698
FXW213D3L(USD/KRW 28-03-23E		47
FXW213D3Q KRW/USD 28-06-23E		502
IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,203

공시일	2023-03-27
기준일	2023-03-24

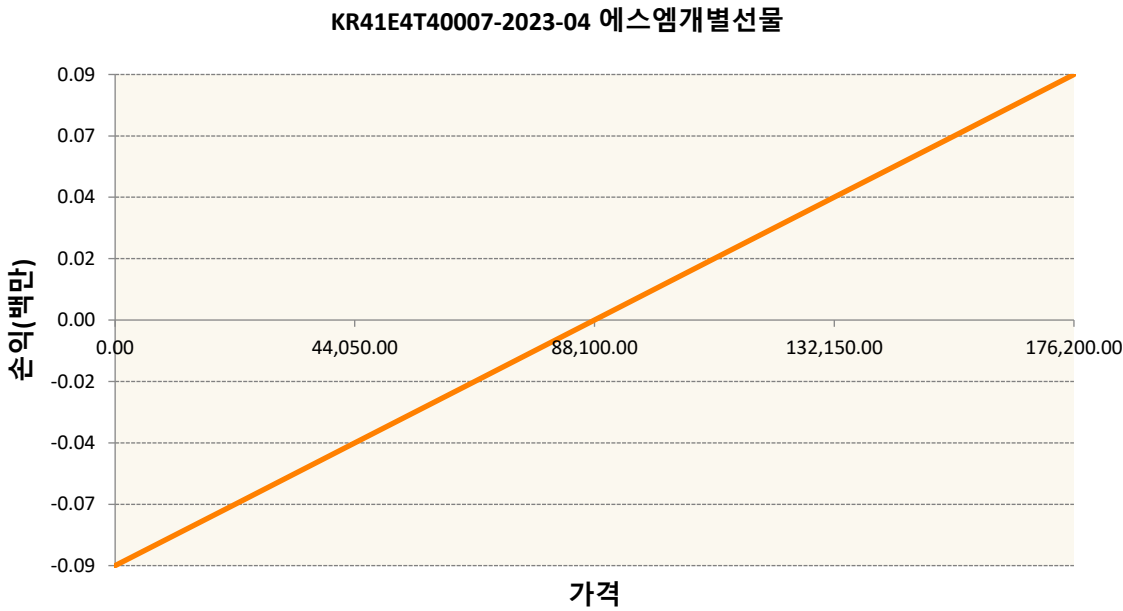
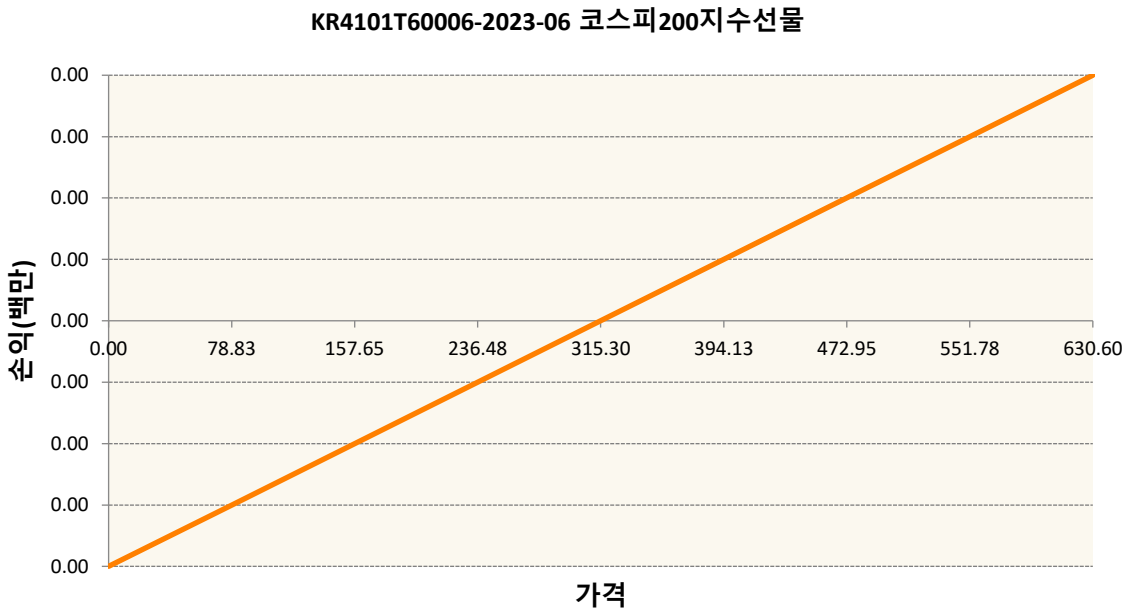
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

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	2023-03-27
기준일	2023-03-24

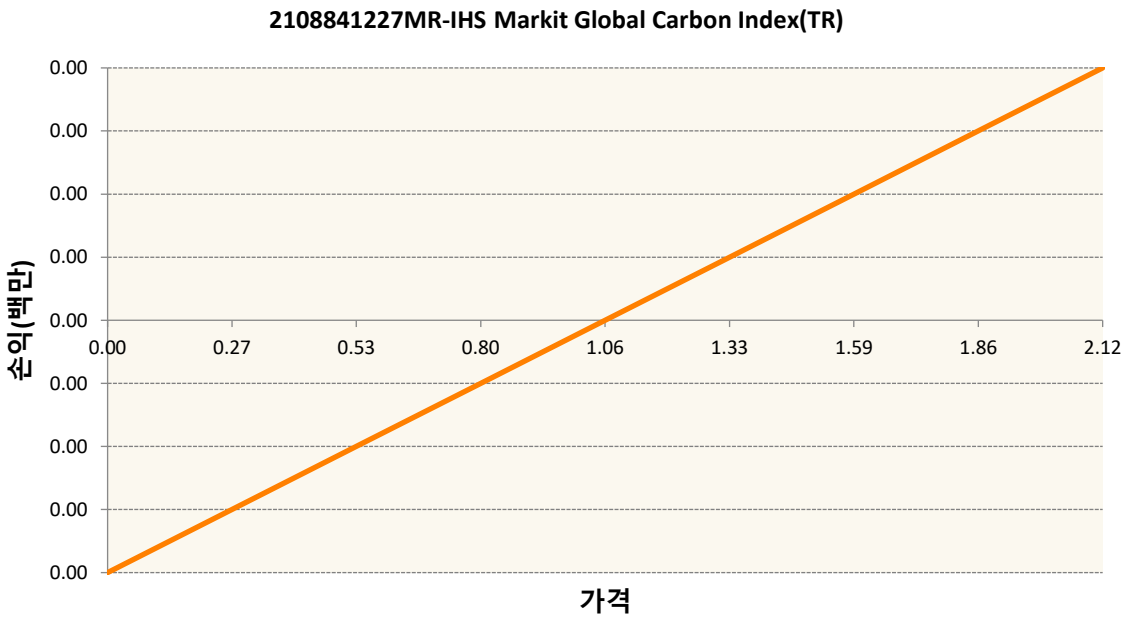
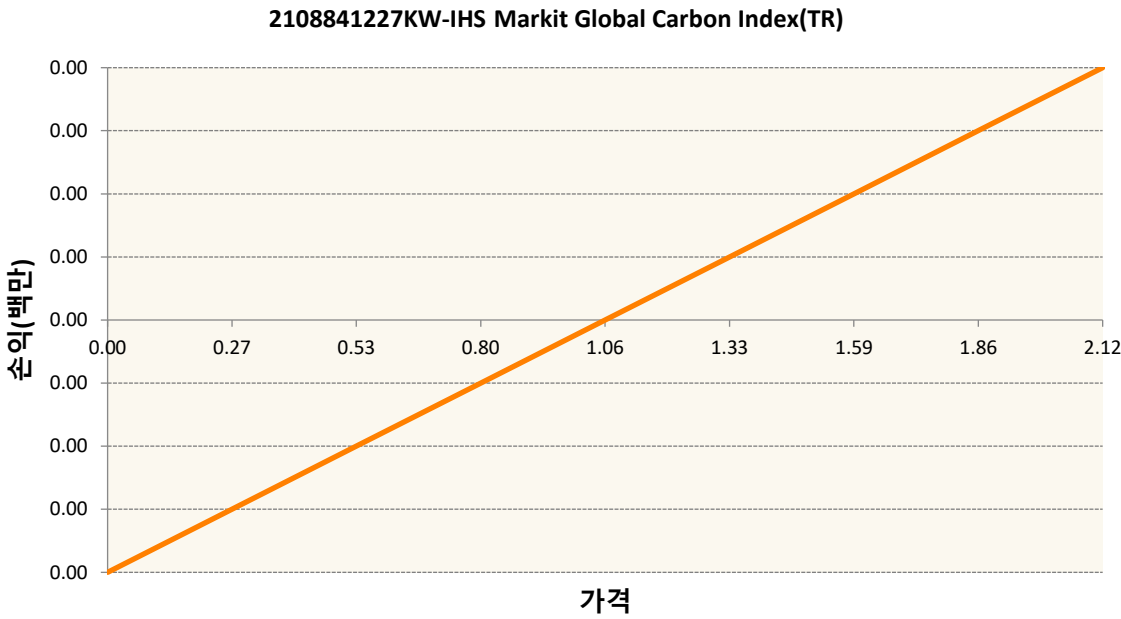
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

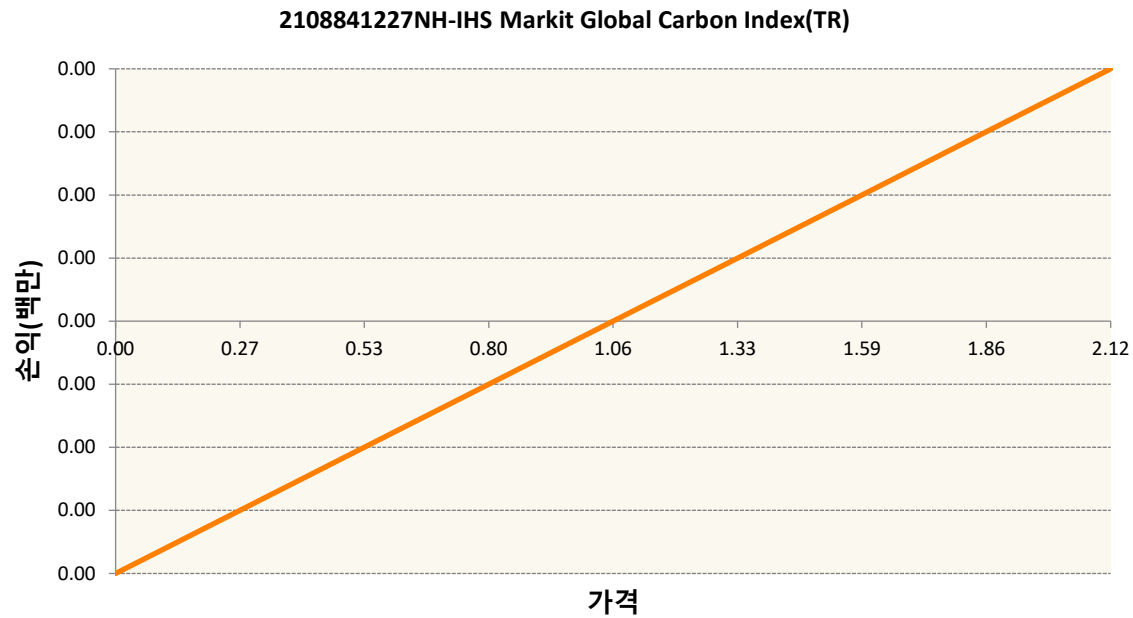
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	25,807	0	25,807	

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108841227IHS Markit Global Carbon Index(TR)		1,753
2108841227IHS Markit Global Carbon Index(TR)		206
2108841227IHS Markit Global Carbon Index(TR)		103

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)		(단위:백만원)
		3,928

공시일	2023-03-27
기준일	2023-03-24

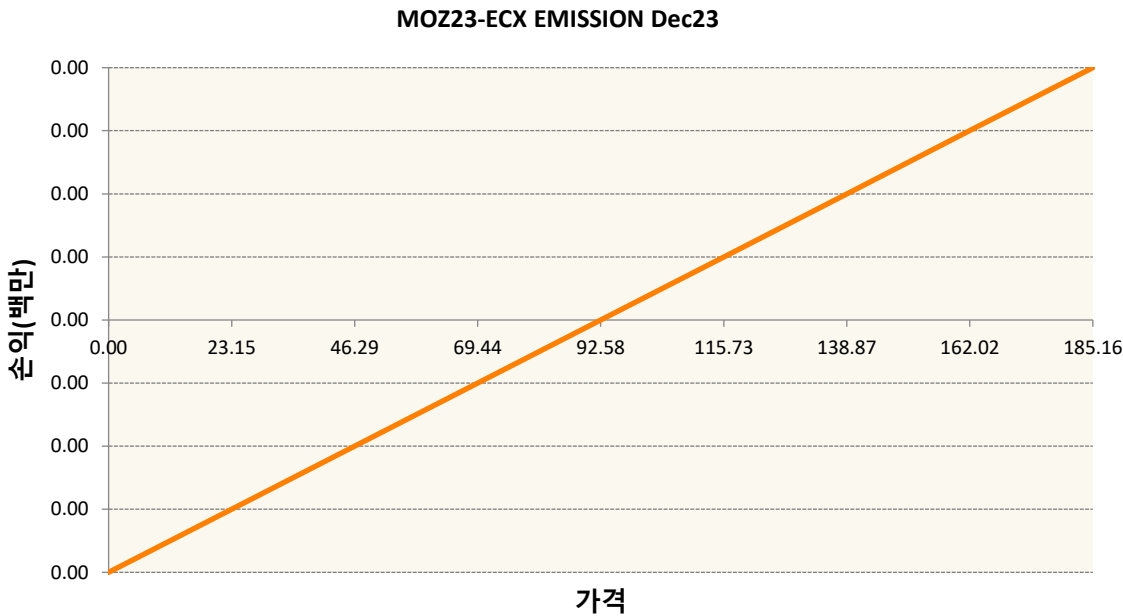
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	9,591	0	9,591	
누계	통화	선도	1,694	4,823	-3,129	장외

2. 만기시점의 손익구조



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	43
FXW213D3H EUR/KRW 31-03-23E	47
FXW213D3Q KRW/EUR 31-03-23E	46
MOZ23 ECX EMISSION Dec23	767

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

(단위:백만원)

공시일	2023-03-27
기준일	2023-03-24

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	9,383	0	9,383	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI00000 신한CSI Index 221222 (NH)	2
SWCSI00000 신한CSI Index 221222 (키움)	2
SWCSI00000 신한CSI Index 221222 (미래)	2
SWCSI00000 신한CSI Index 221222 (메리츠)	2

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

(단위:백만원)

15

공시일	2023-03-27
기준일	2023-03-24

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)	16
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 230116(메리츠)	22
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 230116(미래)	19
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 230116(키움)	16

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

(단위:백만원)

88

공시일	2023-03-27
기준일	2023-03-24

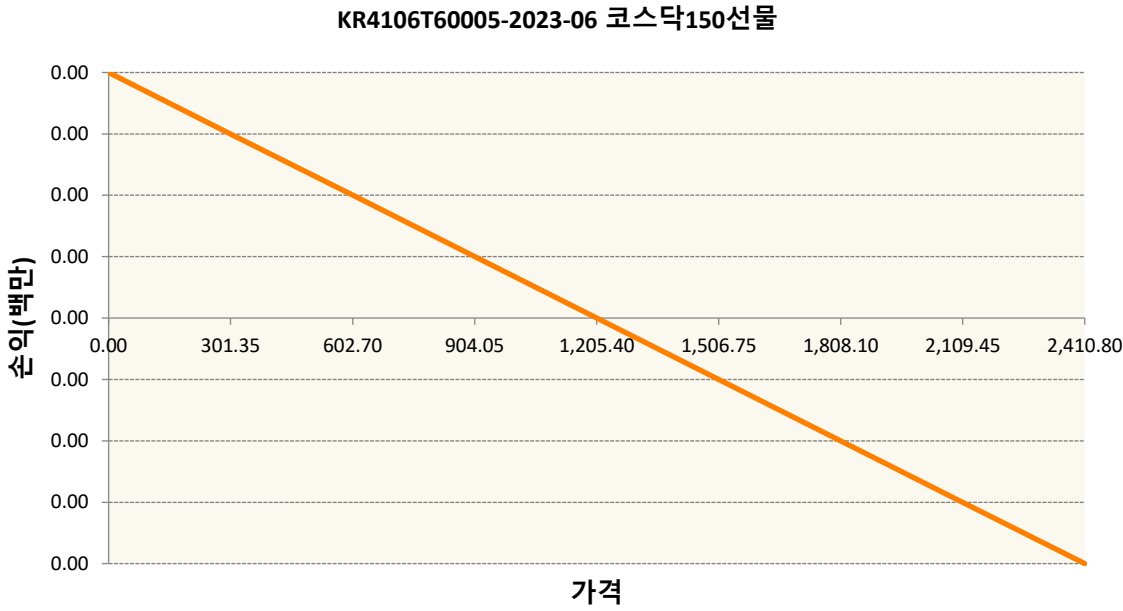
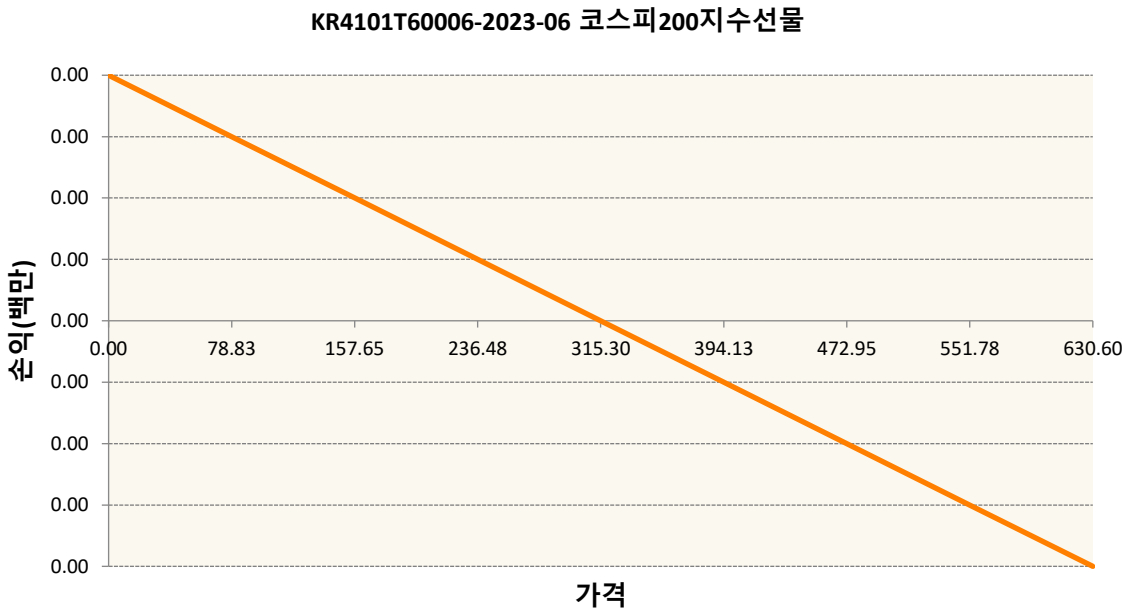
에쿼티알파일반사모혼합자산

1. 계약금액

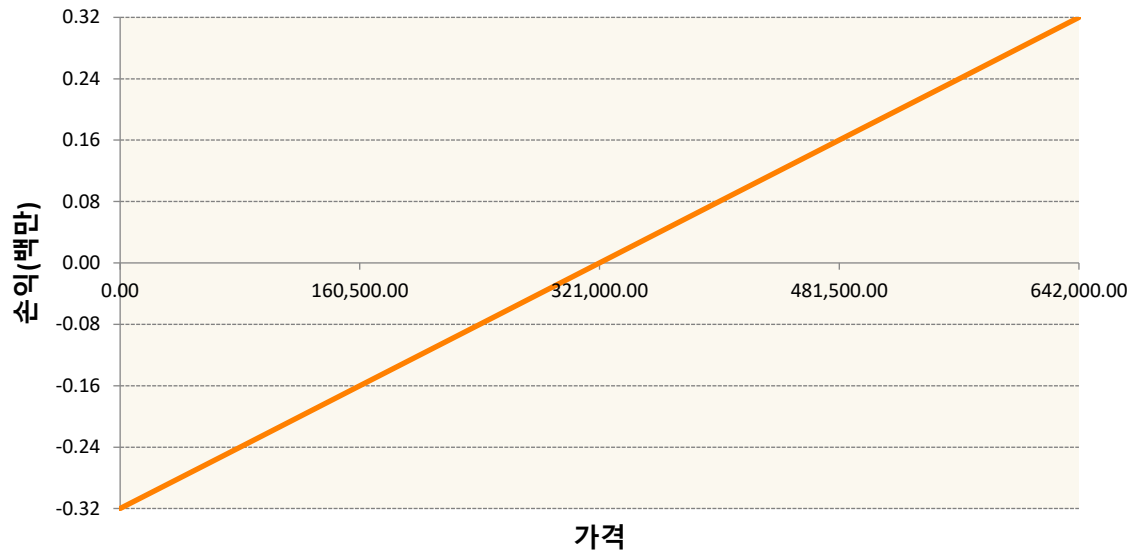
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	629	-629	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	497	3,712	-3,215	장내
누계	유가증권	스왑	0	0	0	장외

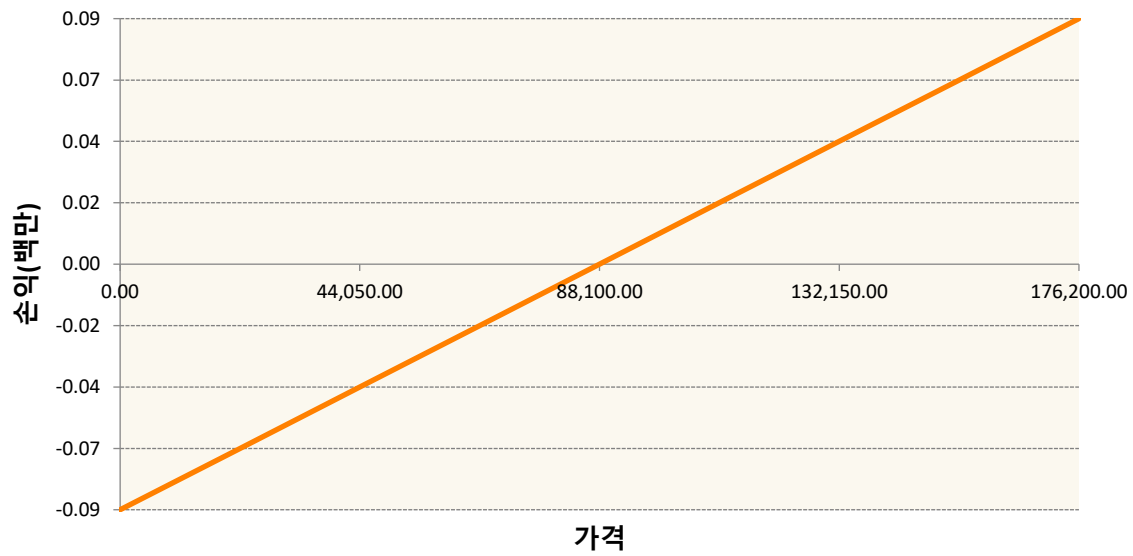
2. 만기시점의 손익구조



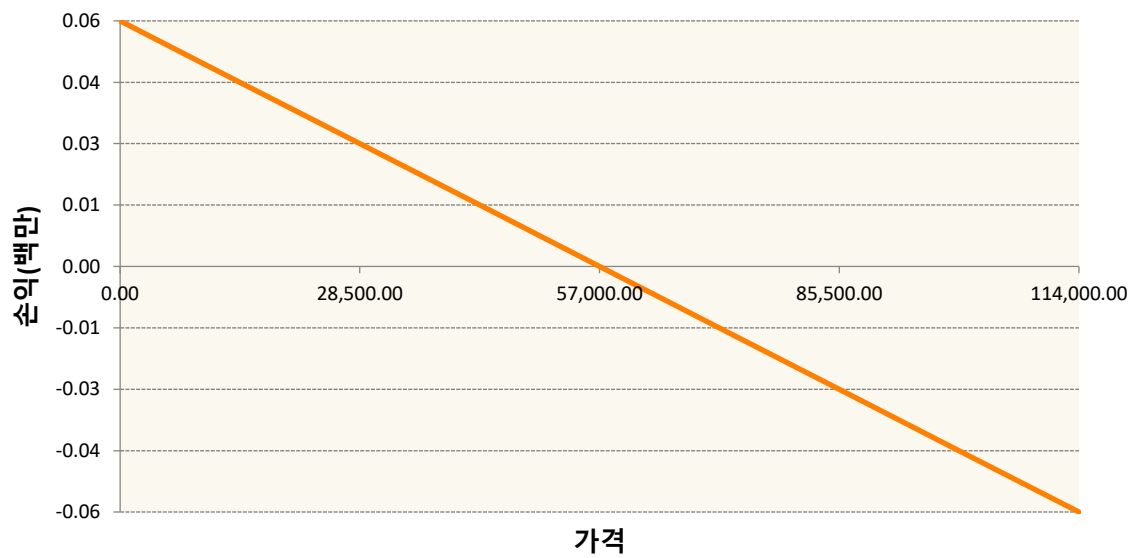
KR4113T40003-2023-04 POSCO홀딩스개별선물



KR41E4T40007-2023-04 에스엠개별선물



KR41F7T40009-2023-04 카카오페이개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
KR4101T600	2023-06 코스피200지수선물	158
KR4106T600	2023-06 코스닥150선물	130
KR4113T400	2023-04 POSCO홀딩스개별선물	26
KR41E4T400	2023-04 에스엠개별선물	14
KR41F7T400	2023-04 카카오페이개별선물	9
KRS0004054	SWAP_MICROSOFT CP_0221	0.19
KRS0004054	SWAP_FIRST TRUST ECL_0221	0.09
KRS0004099	SWAP_MICRON TECH_0308	1

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	530

공시일	2023-03-27
기준일	2023-03-24

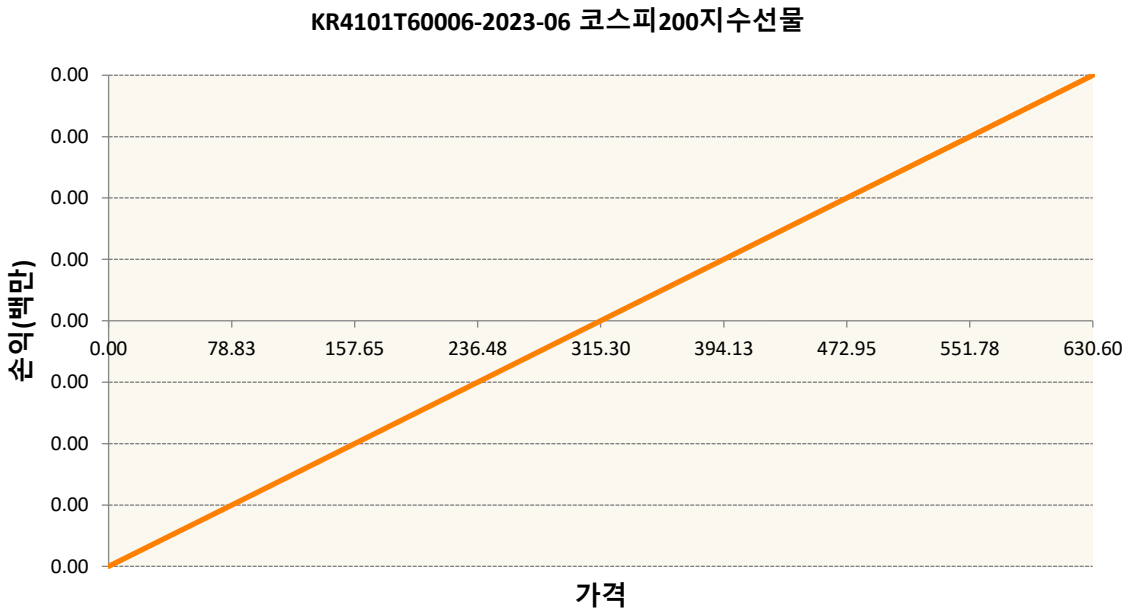
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

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	2,995	0	2,995	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	2023-03-27
기준일	2023-03-24

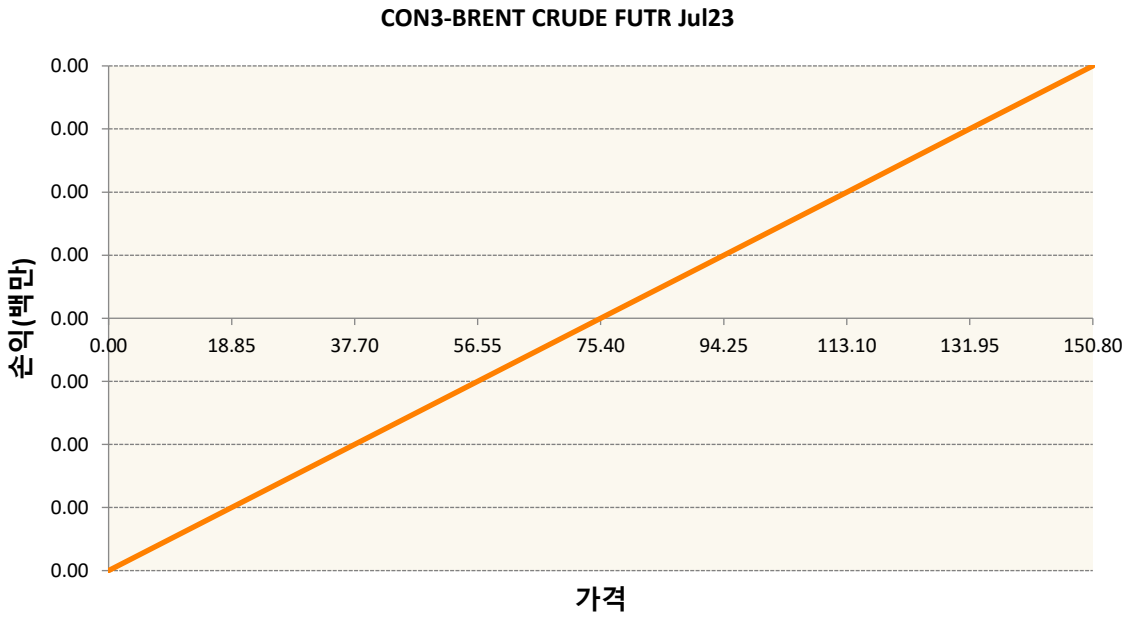
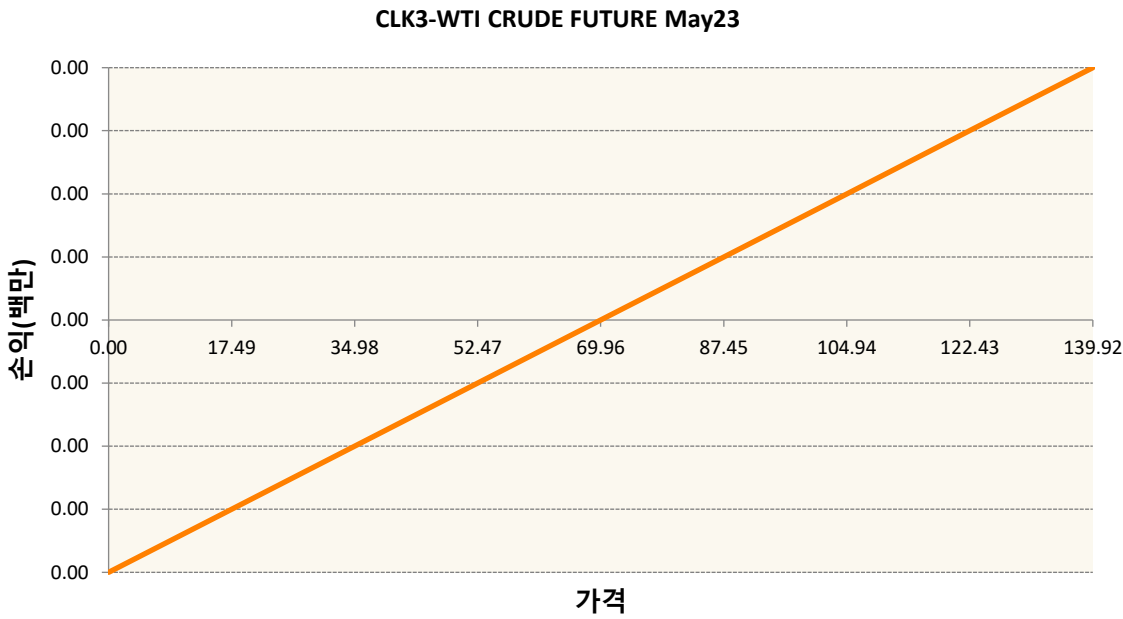
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

1. 계약금액

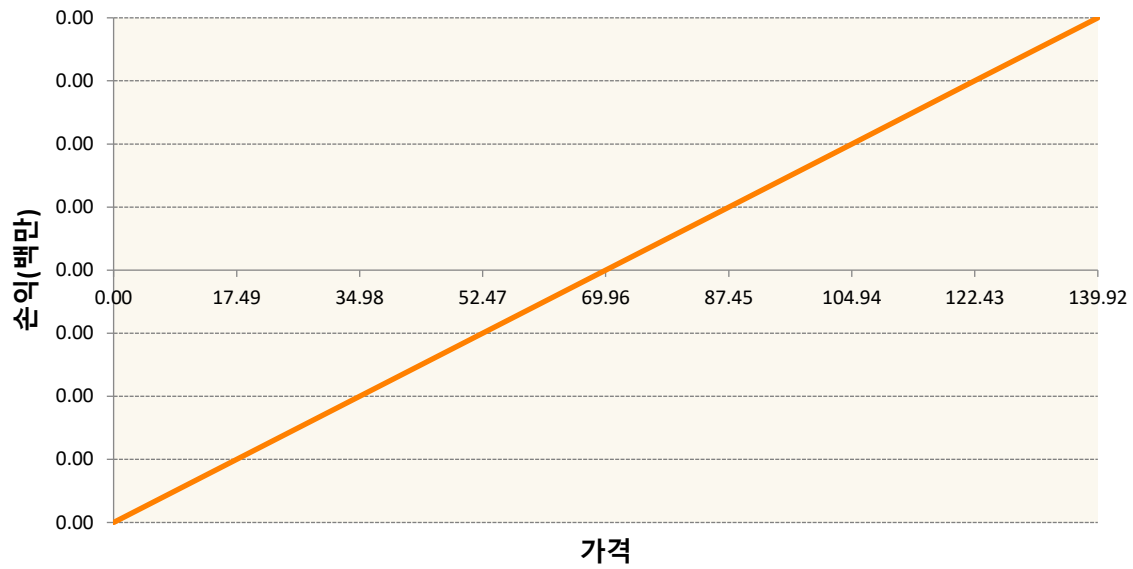
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,583	194	1,389	

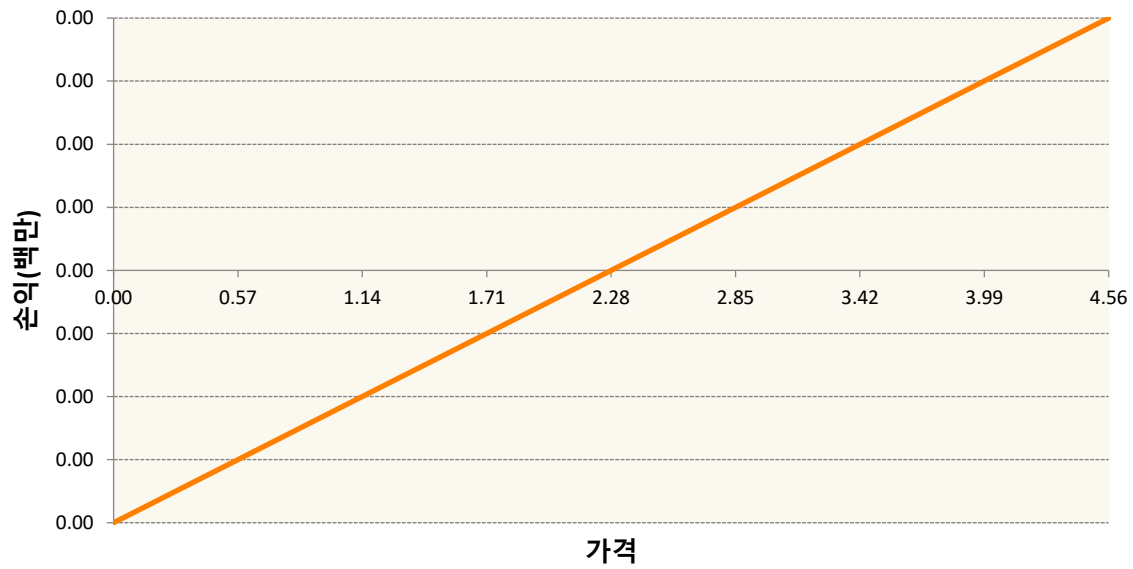
2. 만기시점의 손익구조



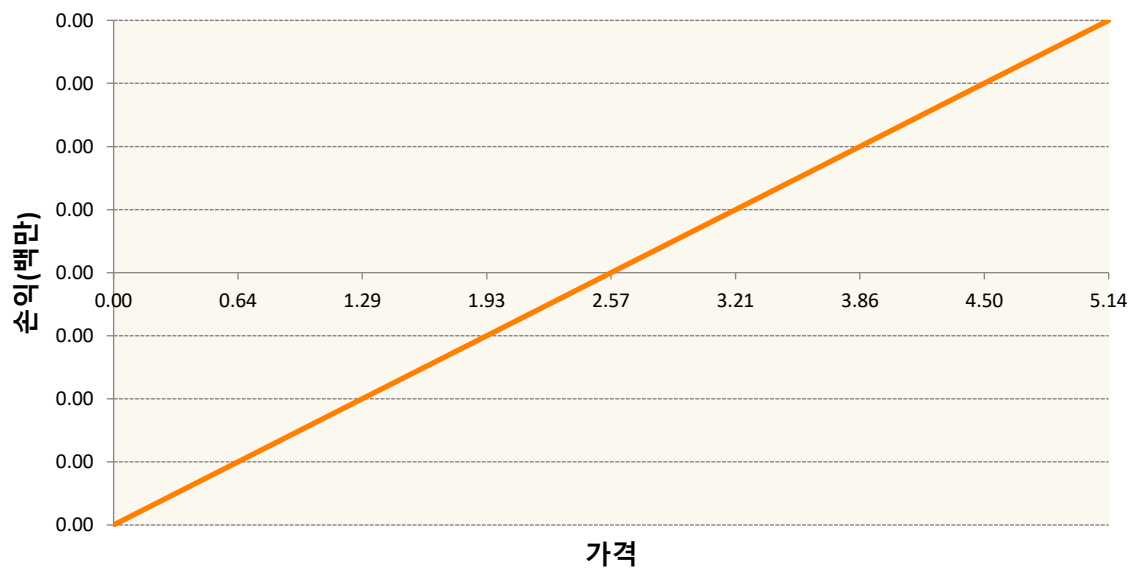
ECK3-E-mini Crude Oil May23



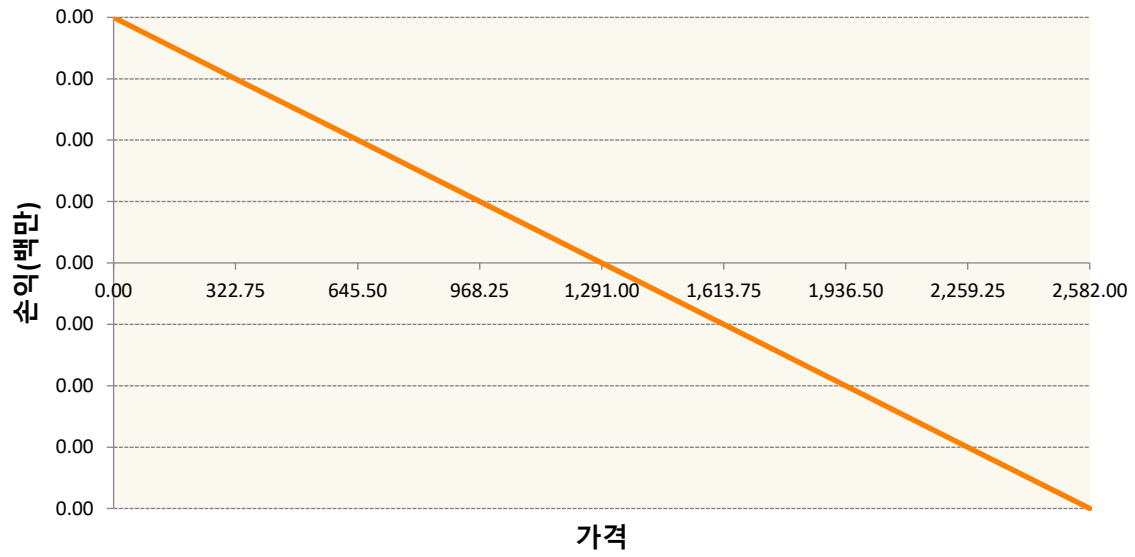
EOK3-E-MINI NATURAL GAS May23



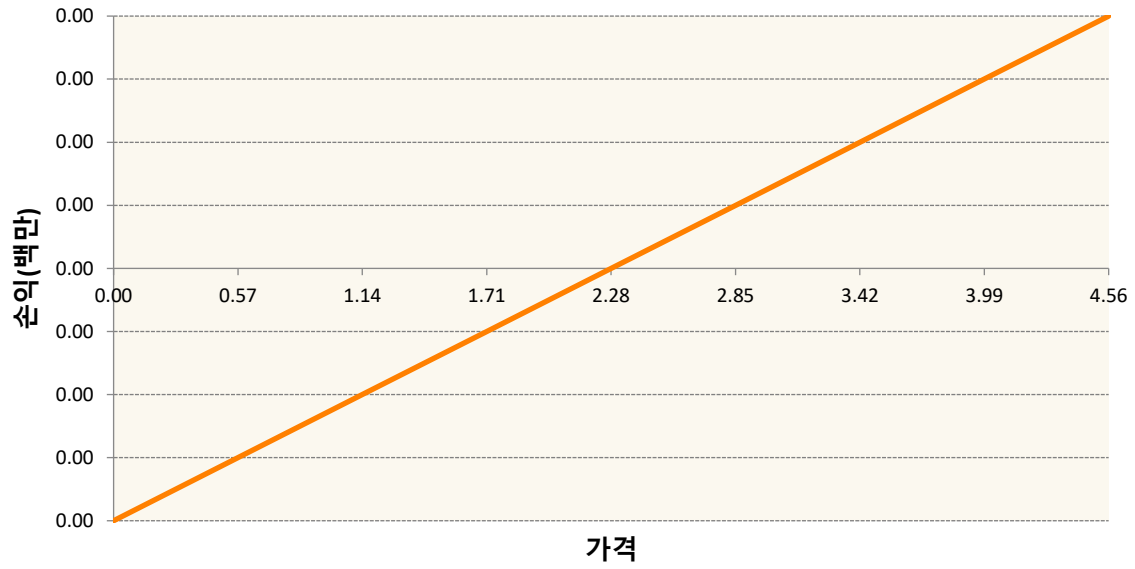
HOK3-NY Harb ULSD Fut May23



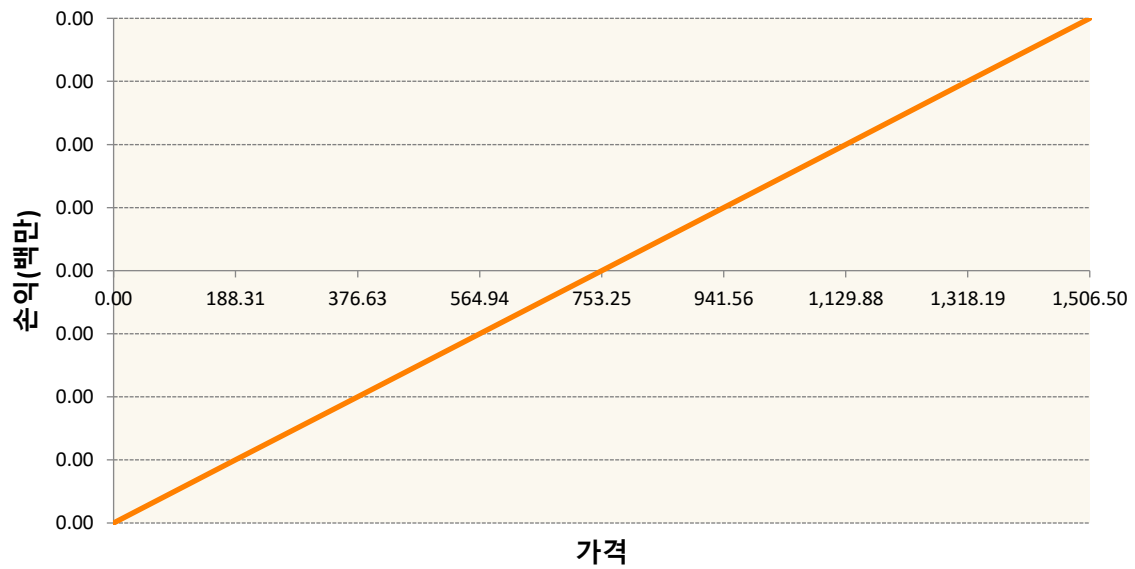
KR4175T40002-2023-04 달러선물

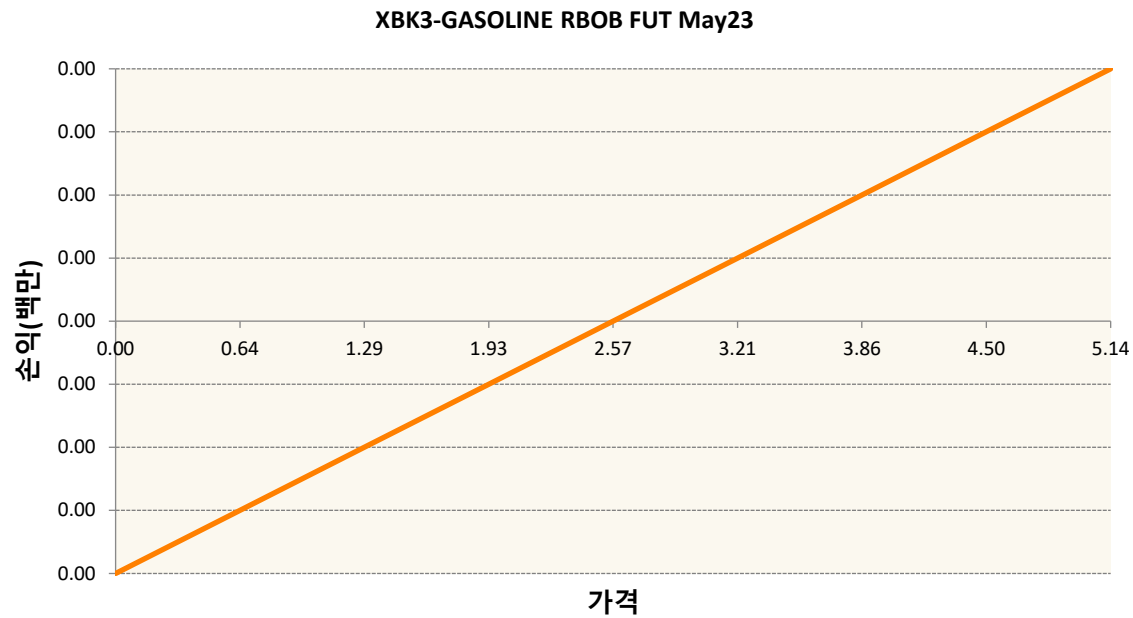


NGK23-NATURAL GAS FUTR May23



QSK3-Low Su Gasoil G May23





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
CLK3	WTI CRUDE FUTURE May23		29
CON3	BRENT CRUDE FUTR Jul23		32
ECK3	E-mini Crude Oil May23		4
EOK3	E-MINI NATURAL GAS May23		2
HOK3	NY Harb ULSD Fut May23		11
KR4175T400	2023-04 달러선물		15
NGK23	NATURAL GAS FUTR May23		23
QSK3	Low Su Gasoil G May23		15
XBK3	GASOLINE RBOB FUT May23		11

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	382