

공시일	2023-03-28
기준일	2023-03-27

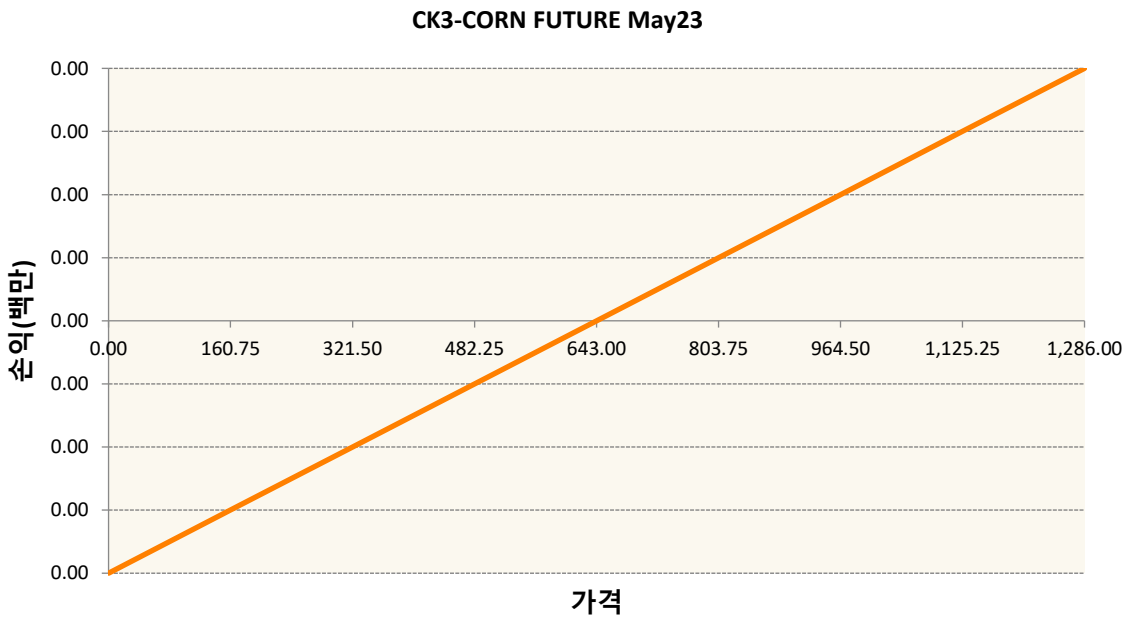
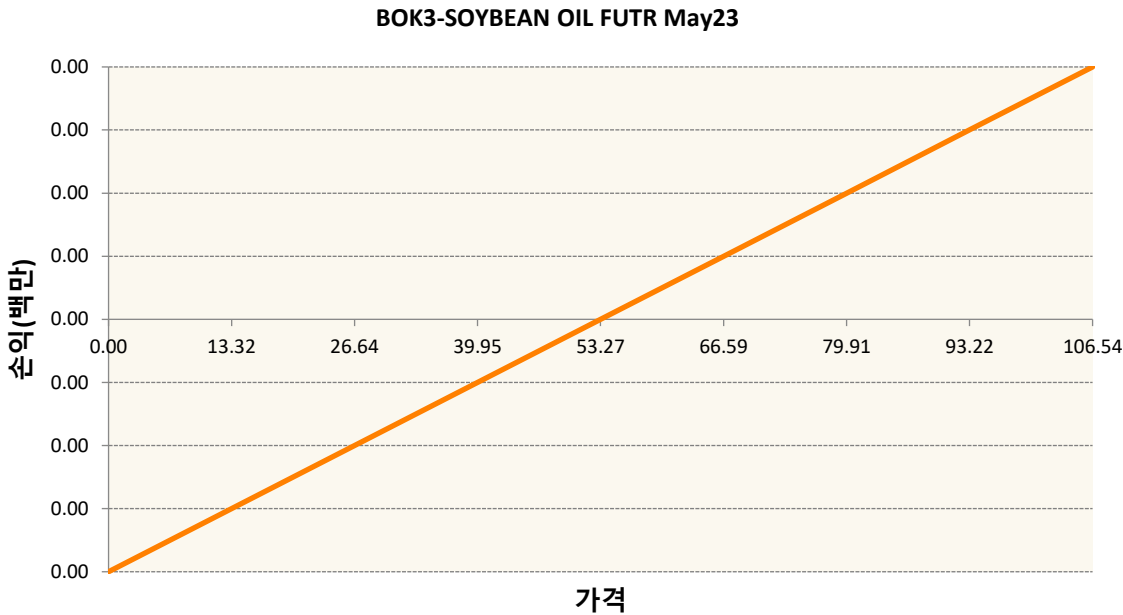
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

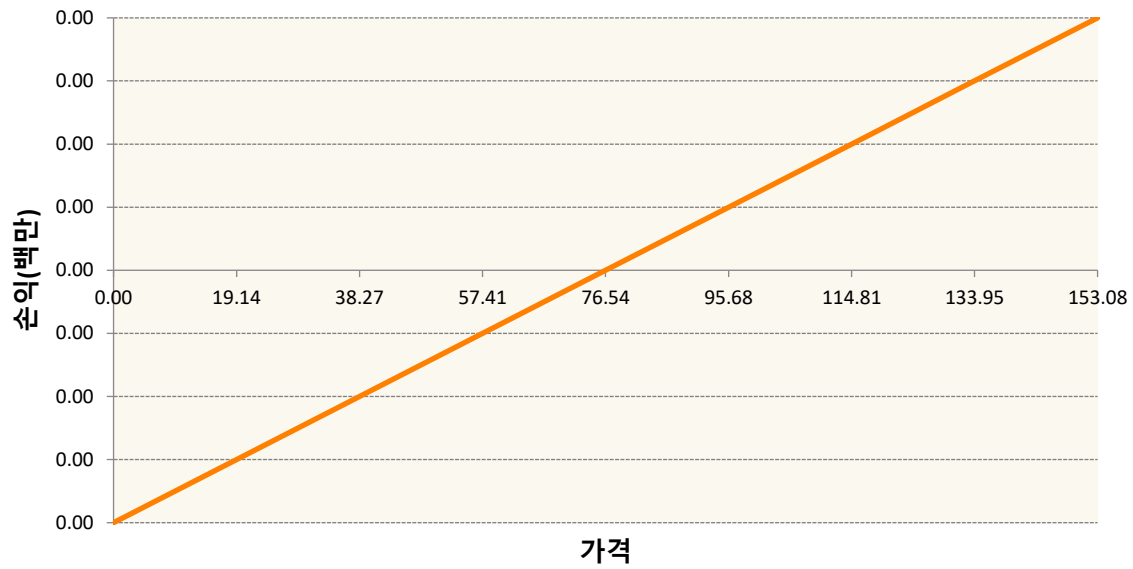
(단위:USD 백만)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,533	520	5,013	

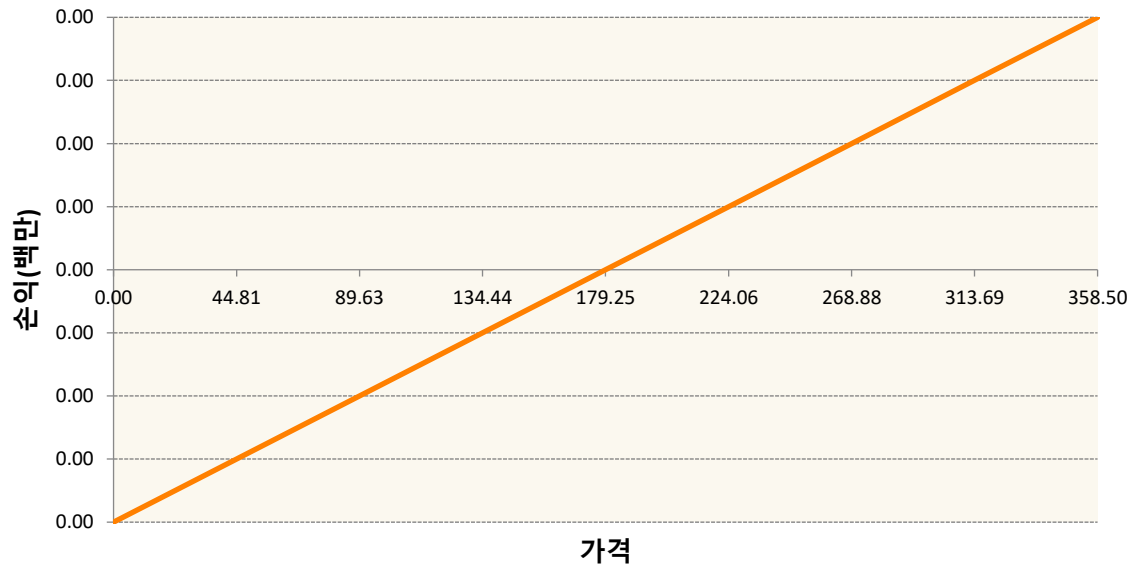
2. 만기시점의 손익구조



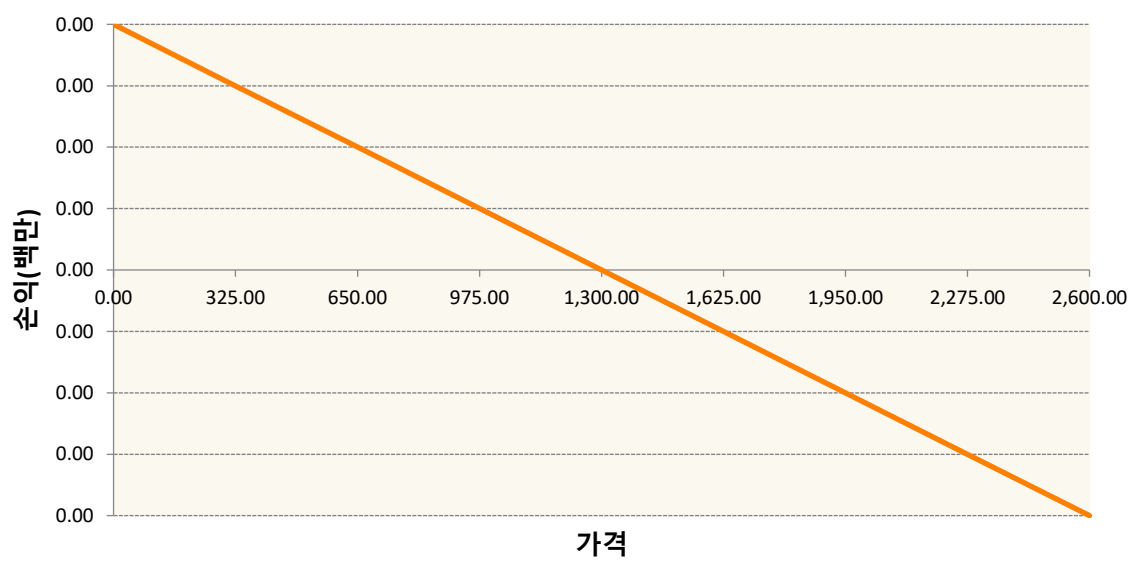
CTK3-COTTON NO.2 FUTR May23



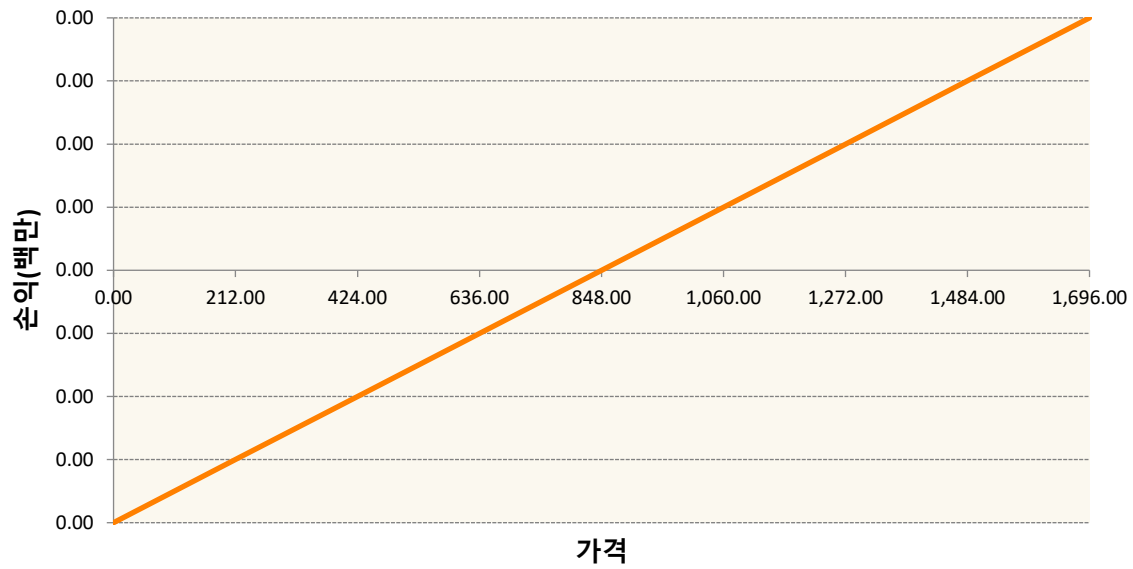
KCK3-COFFEE 'C' FUTURE May23



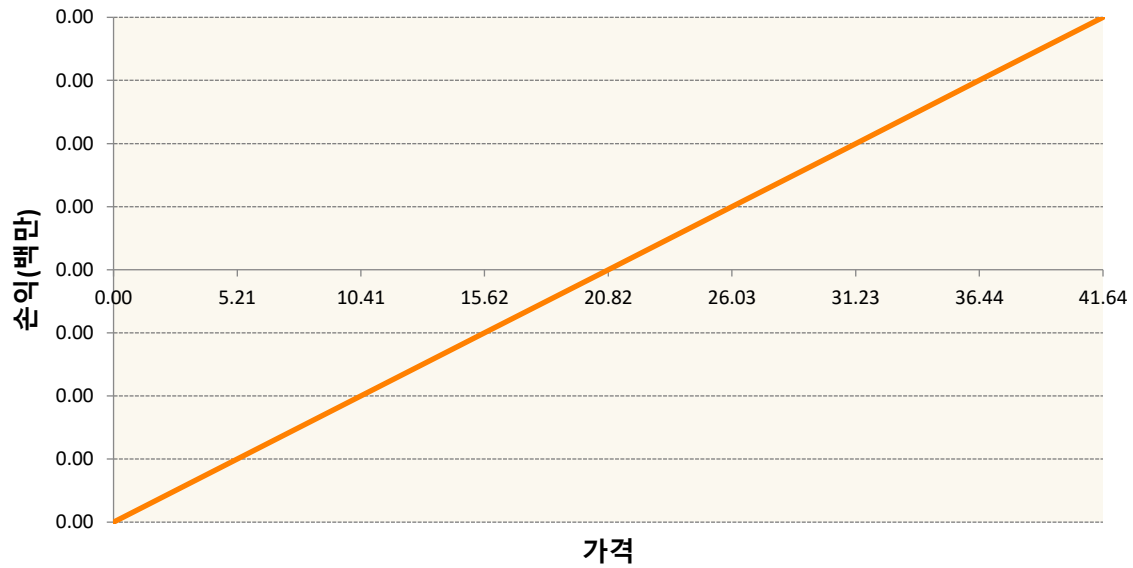
KR4175T40002-2023-04 달러선물



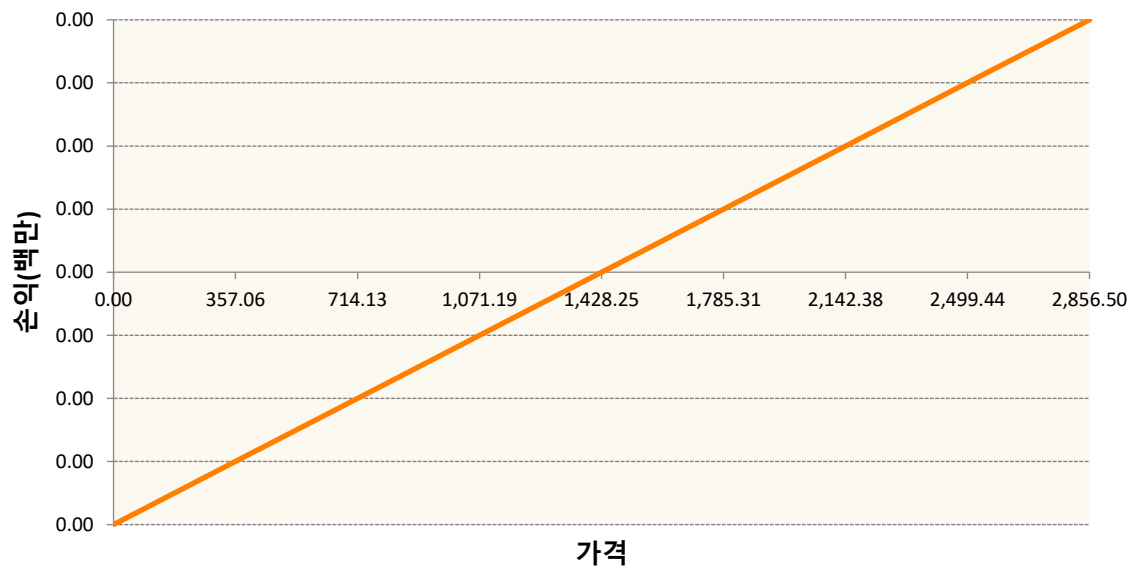
KWK3-KC HRW WHEAT FUT May23



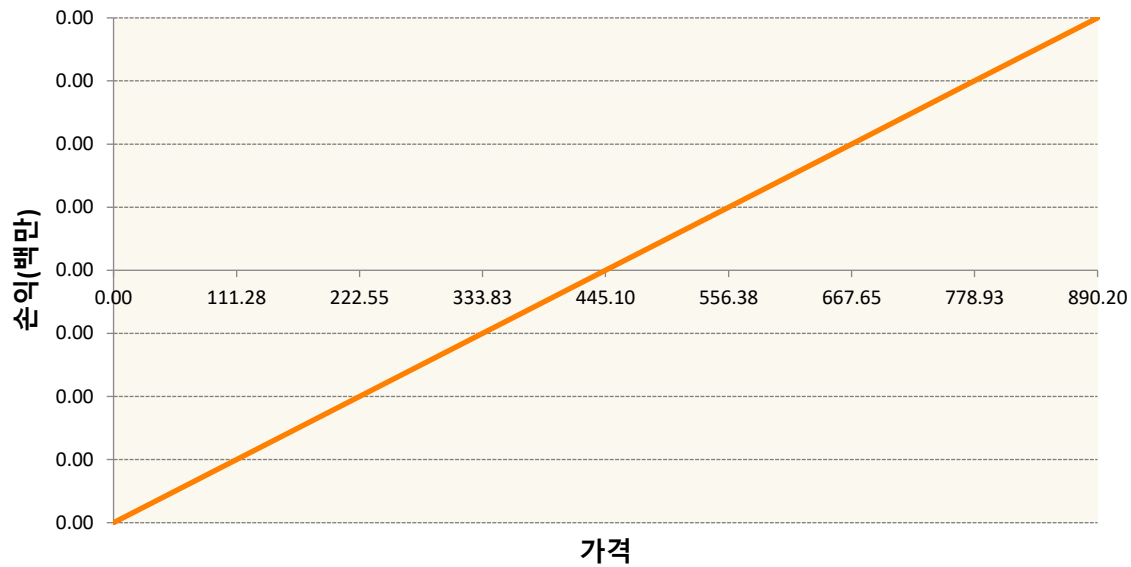
SBK3-Sugar #11 (WORLD) May23



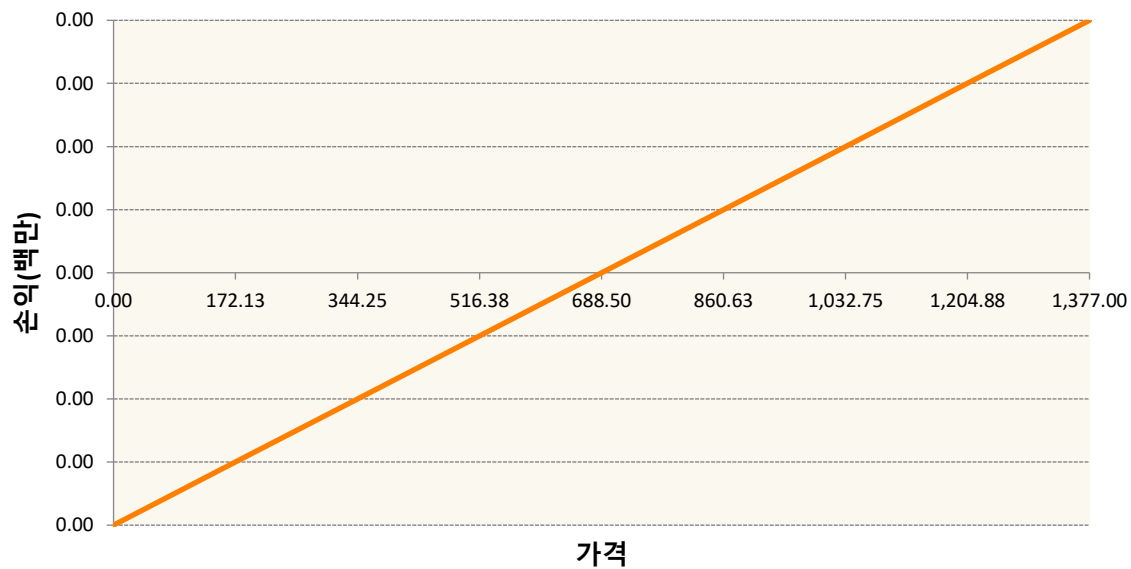
SK3-SOYBEAN FUTURE May23



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	2023-03-28
기준일	2023-03-27

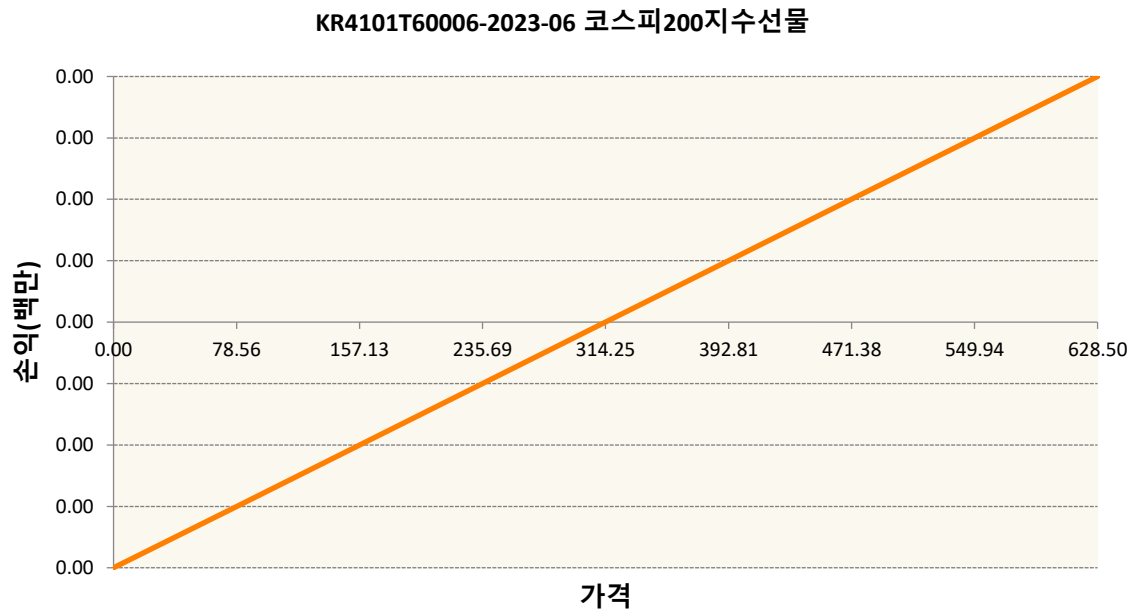
스마트인덱스모

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	2,671	0	2,671	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101T60006		2023-06 코스피200지수선물					213
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-213	-213	-213	-213	-213	-213	-213
-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%	213	213	213	213	213	213	213

공시일	2023-03-28
기준일	2023-03-27

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	370
-----------------------------	-----

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

481

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2023-03-28
기준일	2023-03-27

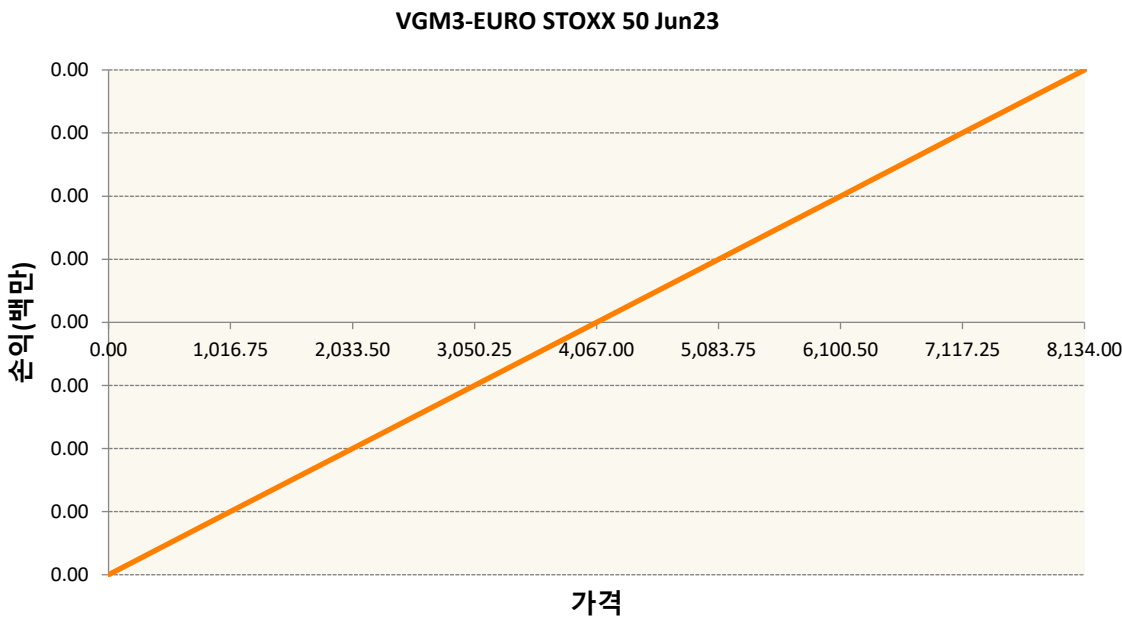
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	453	0	453	

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	2023-03-28
기준일	2023-03-27

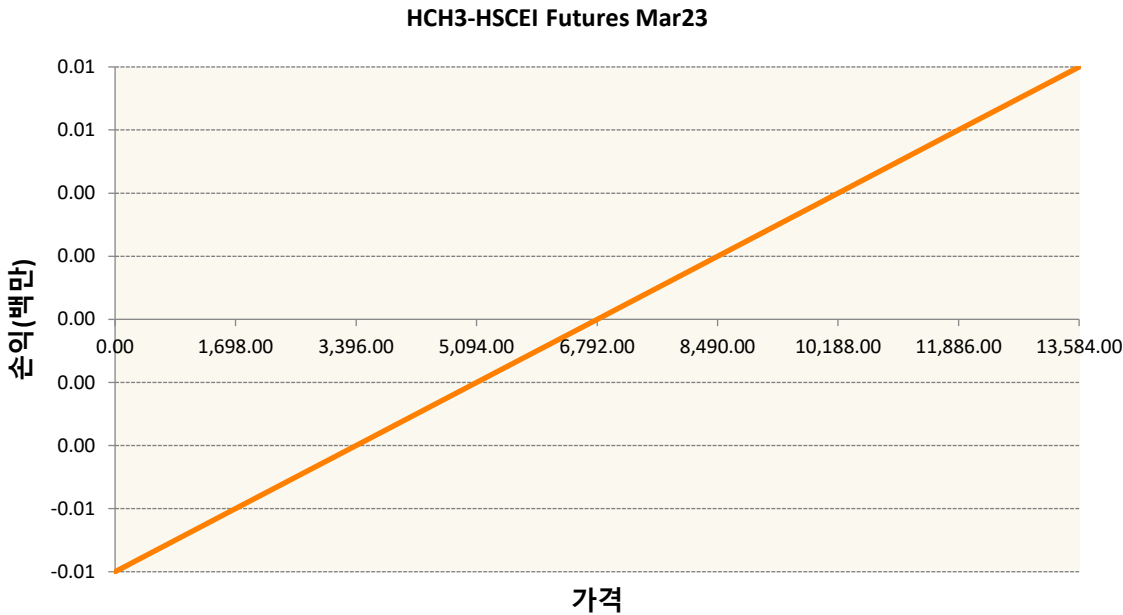
차이나인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,184	0	1,184	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

127

공시일	2023-03-28
기준일	2023-03-27

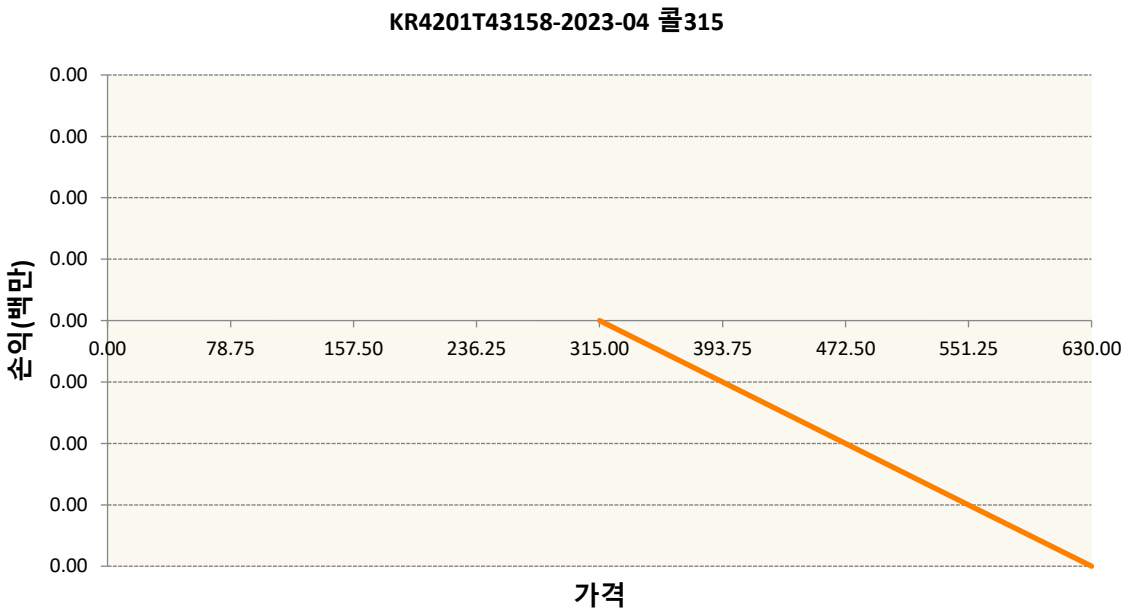
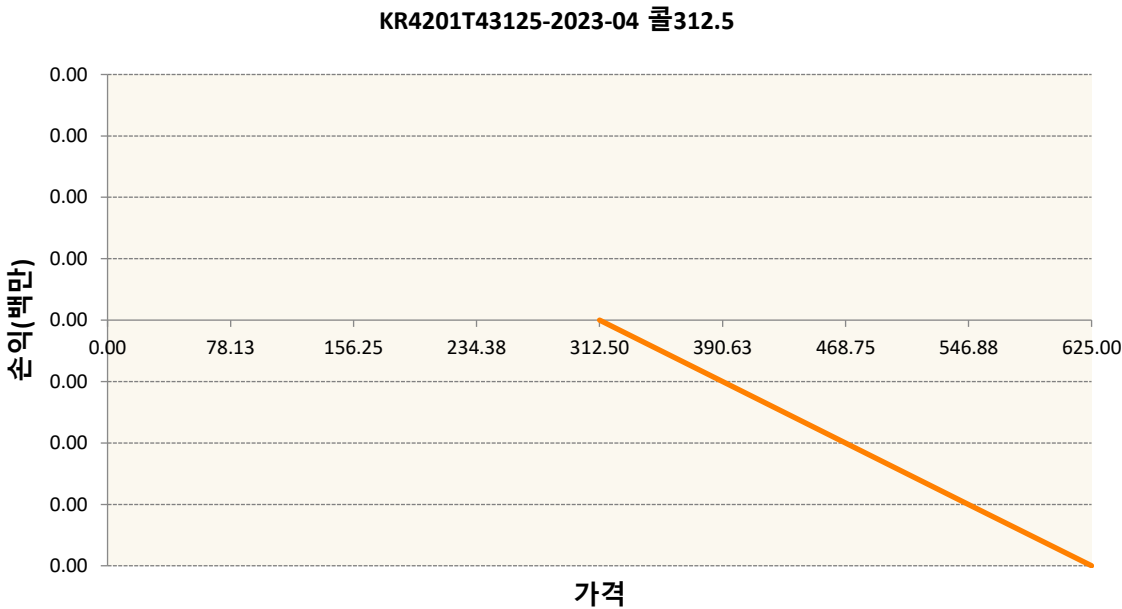
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

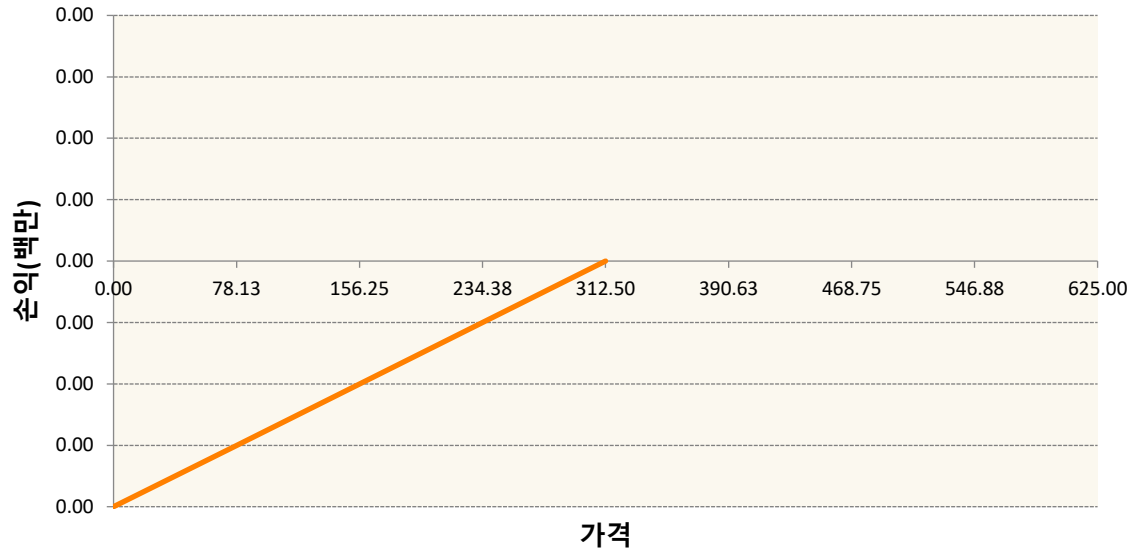
(단위:백만원)

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				721
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	264	260	255	248	240	231	221
-5.33%	245	234	222	209	195	180	165
-2.67%	187	169	150	131	111	92	72
0%	65	43	22	0	-22	-43	-65
2.67%	-131	-149	-167	-187	-206	-226	-246
5.33%	-384	-395	-407	-421	-436	-451	-468
8.00%	-670	-674	-681	-689	-698	-709	-721
KR4201T43158			2023-04 콜315				2,036
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	640	633	622	607	590	568	544
-5.33%	605	582	554	523	488	450	410
-2.67%	481	435	386	336	283	230	176
0%	186	124	62	0	-62	-124	-186
2.67%	-330	-387	-445	-504	-564	-624	-684
5.33%	-1,040	-1,077	-1,118	-1,162	-1,209	-1,258	-1,309
8.00%	-1,867	-1,885	-1,908	-1,934	-1,965	-1,999	-2,036
KR4301T43123			2023-04 풋312.5				588
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-551	-554	-559	-564	-571	-579	-588
-5.33%	-309	-318	-328	-339	-351	-364	-377
-2.67%	-99	-115	-131	-147	-164	-180	-197
0%	55	37	18	0	-18	-37	-55

2.67%	147	132	116	100	83	66	49
5.33%	191	181	171	159	147	133	120
8.00%	206	202	197	190	182	173	163

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

(단위:백만원)

3,327

공시일	2023-03-28
기준일	2023-03-27

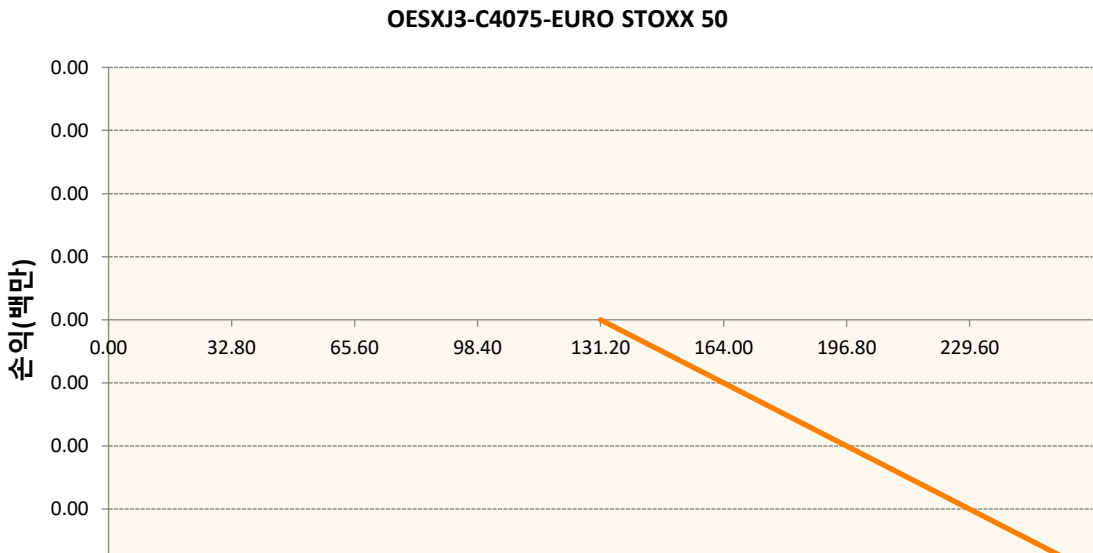
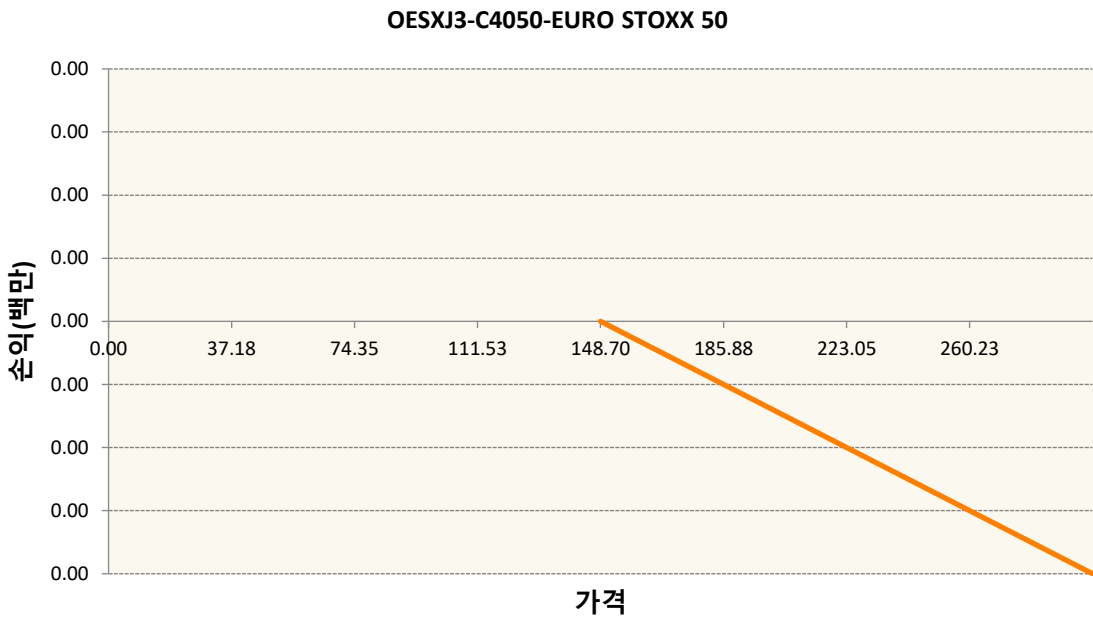
유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

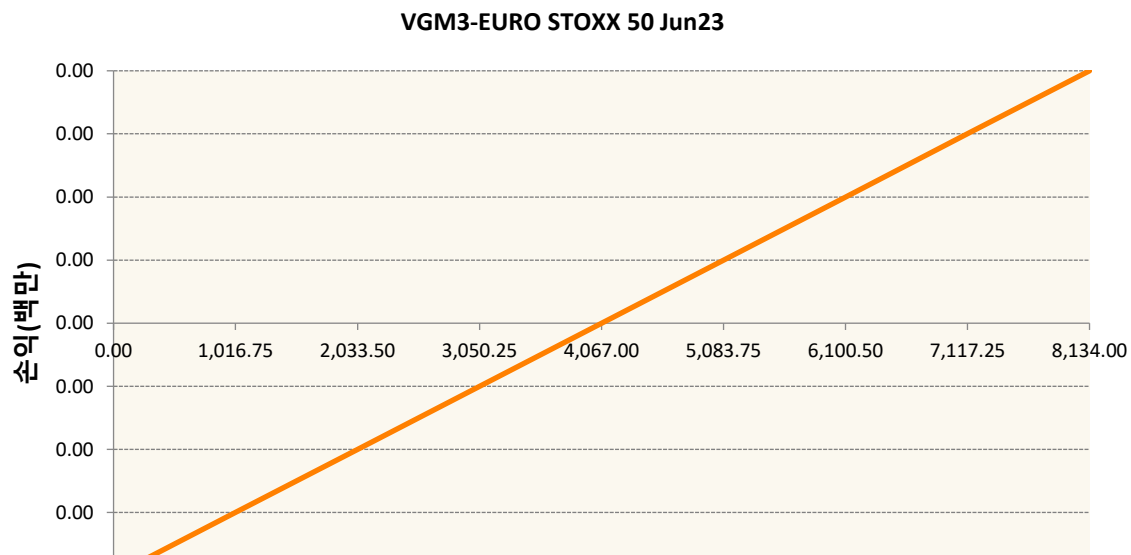
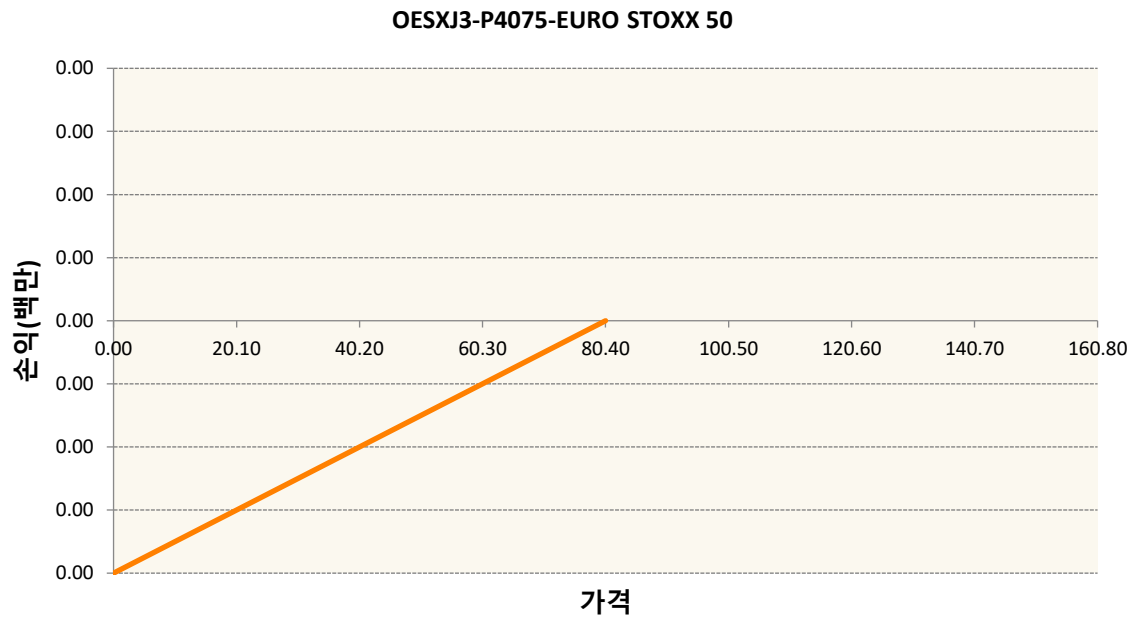
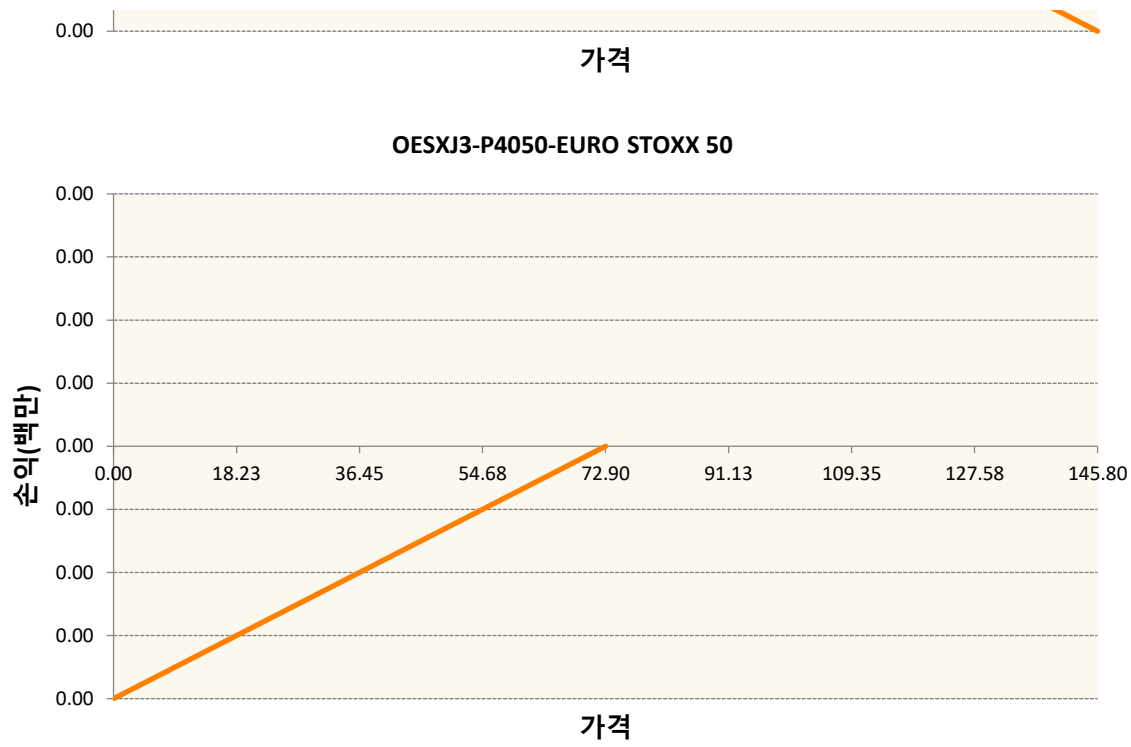
1. 계약금액

(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	906	0	906	
누계	유가증권	옵션	0	91	-91	장내
누계	통화	선도	0	1,680	-1,680	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	2
OESXJ3-C40! EURO STOXX 50	3
OESXJ3-P40! EURO STOXX 50	1
OESXJ3-P40! EURO STOXX 50	2
VGM3 EURO STOXX 50 Jun23	73

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

(단위:백만원)

191

공시일	2023-03-28
기준일	2023-03-27

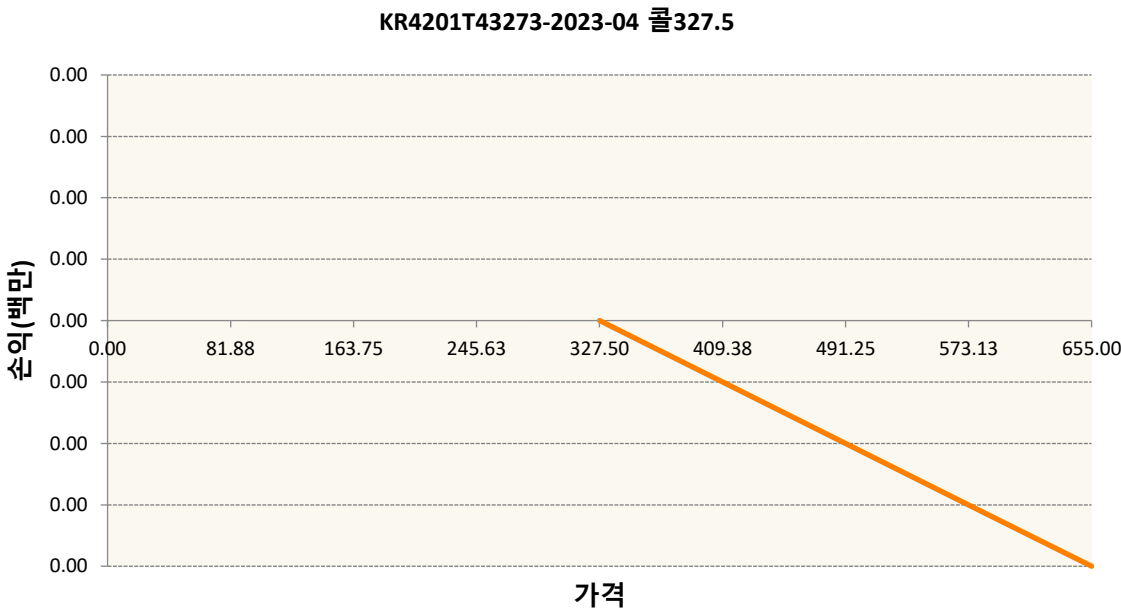
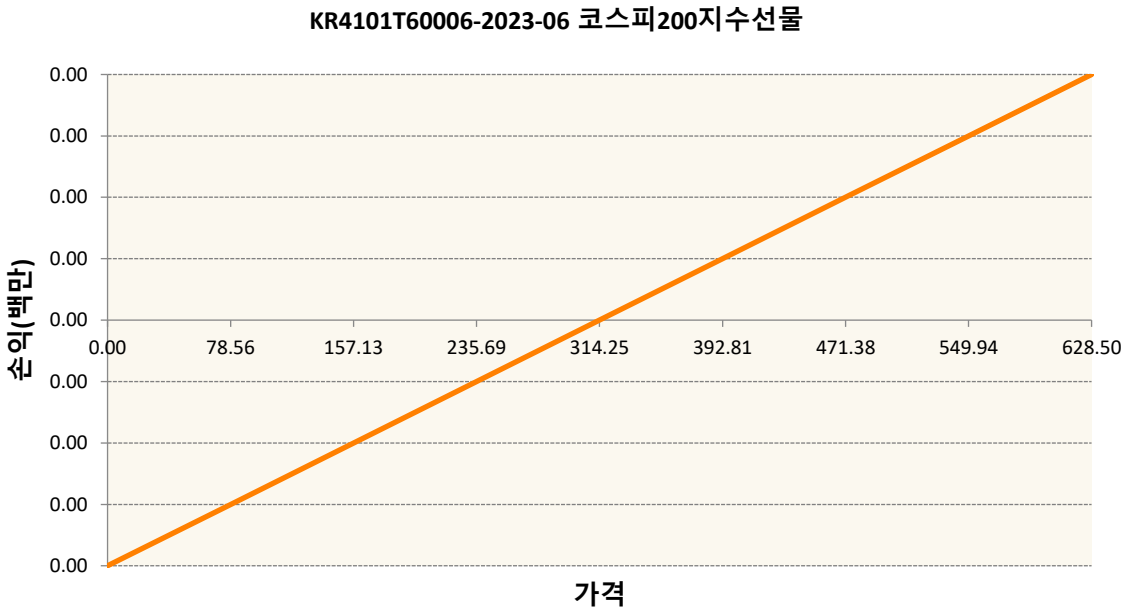
리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

1. 계약금액

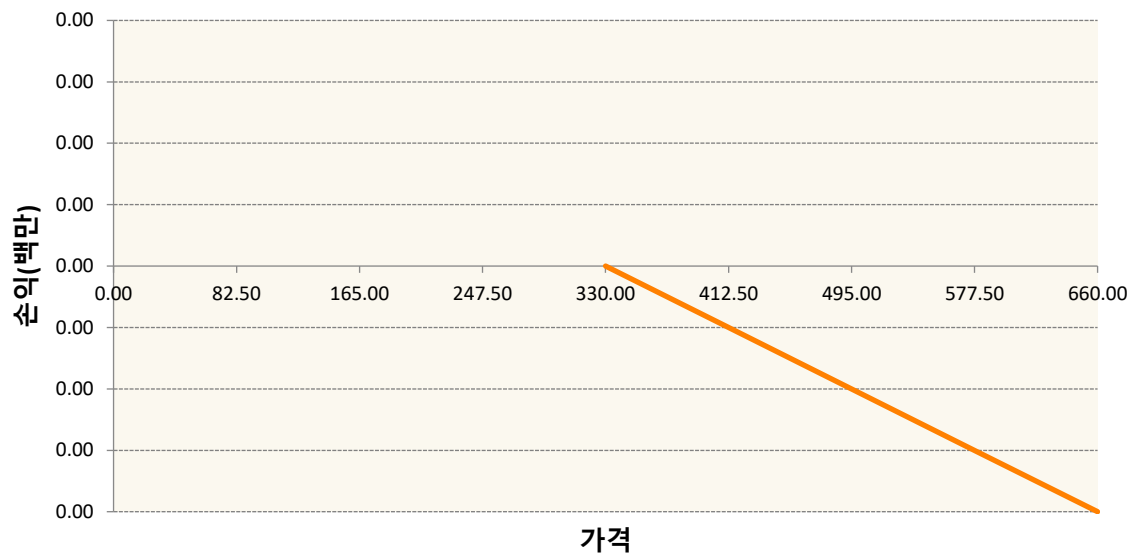
(단위:백만원)

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	393	0	393	장내
누계	유가증권	옵션	157	3,874	-3,718	장내

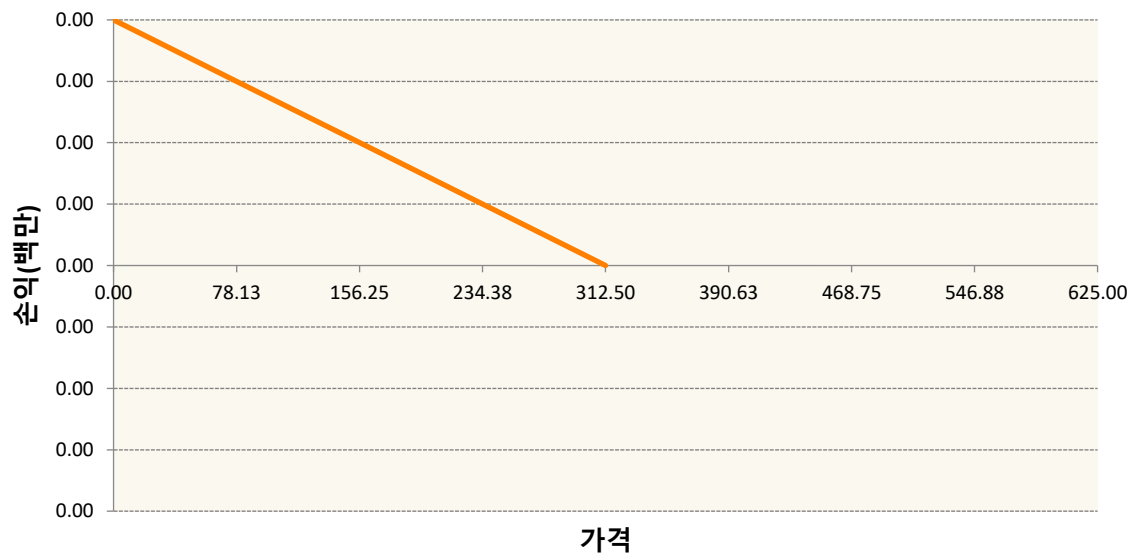
2. 만기시점의 손익구조



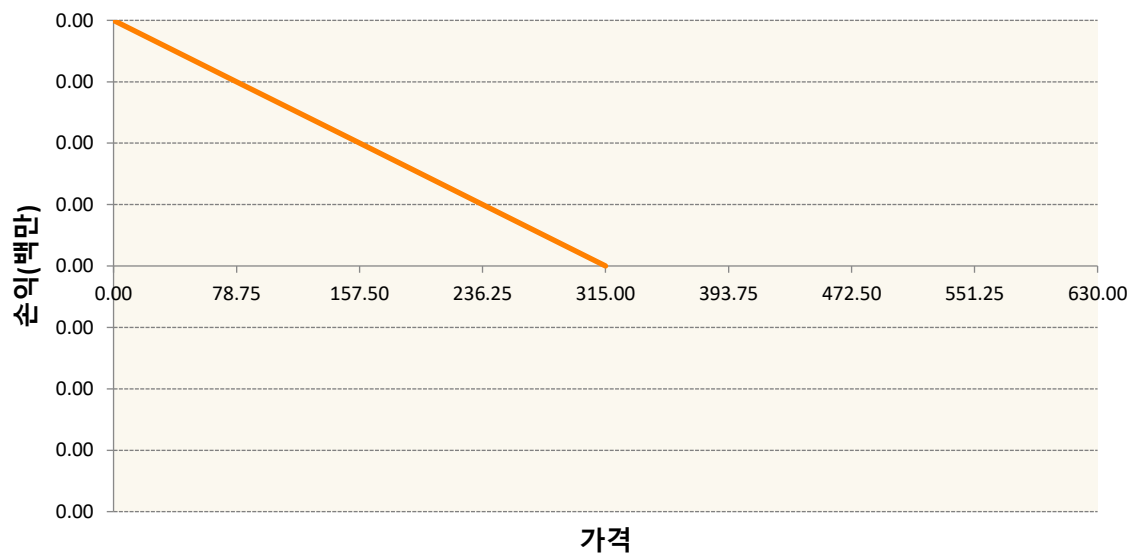
KR4201T43307-2023-04 콜330



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%	3	3	3	3	3	3	2
-5.33%	3	3	3	2	2	2	2
-2.67%	2	2	2	2	1	1	0
0%	2	1	1	0	-1	-1	-2
2.67%	-1	-2	-2	-3	-4	-5	-5
5.33%	-6	-6	-7	-8	-9	-10	-10
8.00%	-13	-13	-14	-15	-15	-16	-17
KR4201T43307			2023-04 콜330				128
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	17	17	17	17	16	16	15
-5.33%	17	17	16	15	14	13	11
-2.67%	16	14	13	11	8	6	3
0%	10	7	4	0	-4	-8	-13
2.67%	-6	-11	-16	-22	-27	-33	-39
5.33%	-39	-45	-52	-58	-64	-71	-77
8.00%	-93	-98	-104	-110	-116	-122	-128
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	5	5	5	5	5
-5.33%	2	3	3	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	-1	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%	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%	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	-2

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

(단위:백만원)

152

공시일	2023-03-28
기준일	2023-03-27

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	6,623	0	6,623	

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	2023-03-28
기준일	2023-03-27

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	5,260	0	5,260	

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	2023-03-28
기준일	2023-03-27

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	18,765	0	18,765	
누계	통화	선도	586	25,867	-25,282	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
FXW213D3L(USD/KRW 28-03-23E	47
FXW213D3Q(KRW/USD 28-06-23E	505
IE00BD8RGM75	

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

1,208

공시일	2023-03-28
기준일	2023-03-27

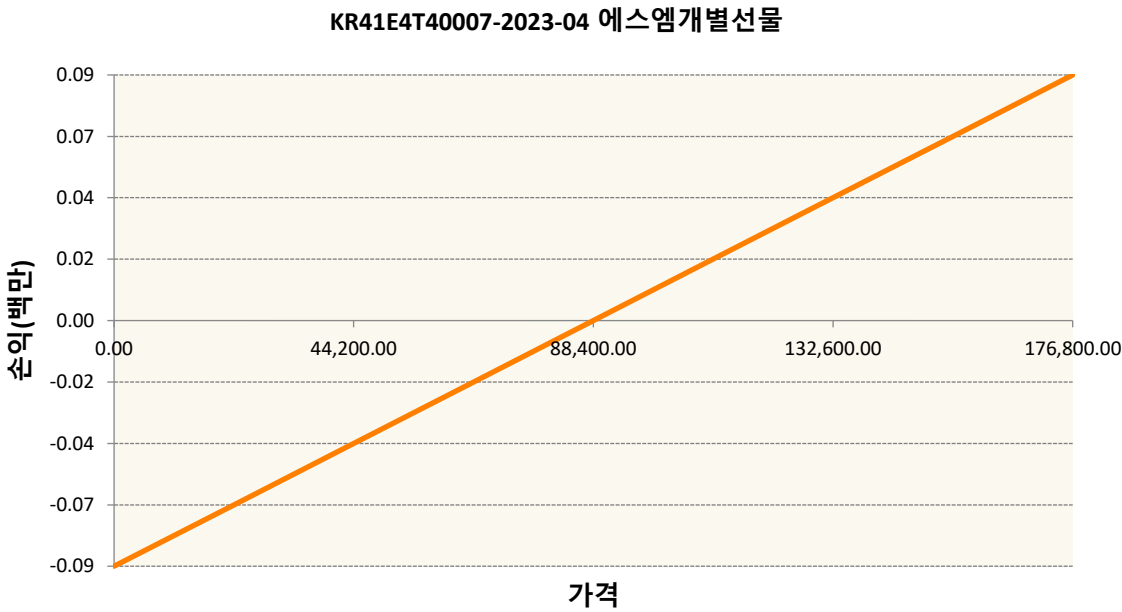
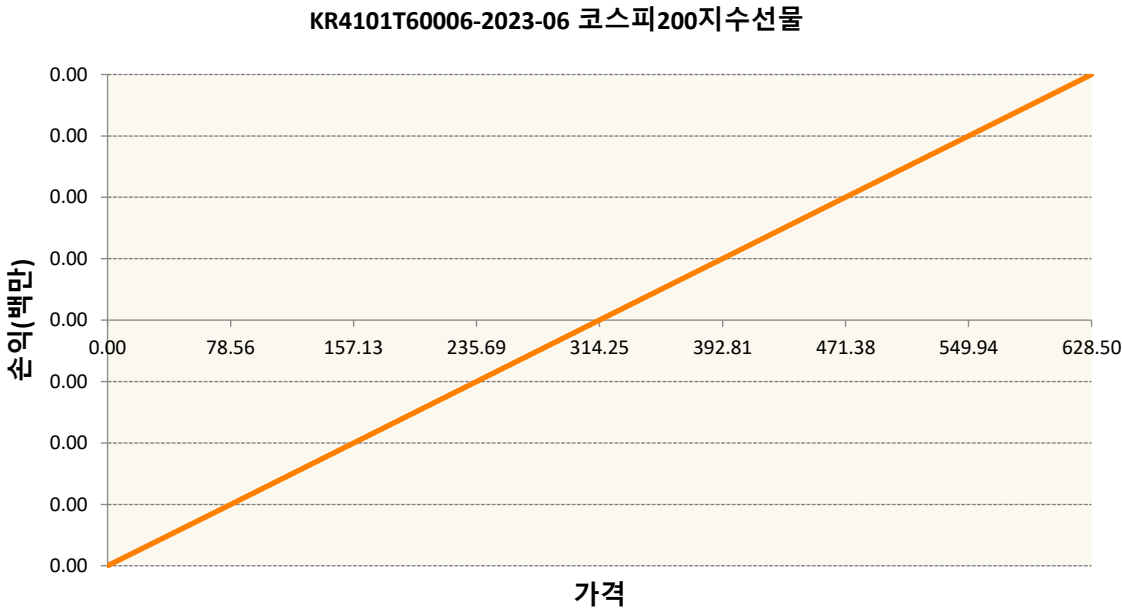
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

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	1,351	0	1,351	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

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

115

공시일	2023-03-28
기준일	2023-03-27

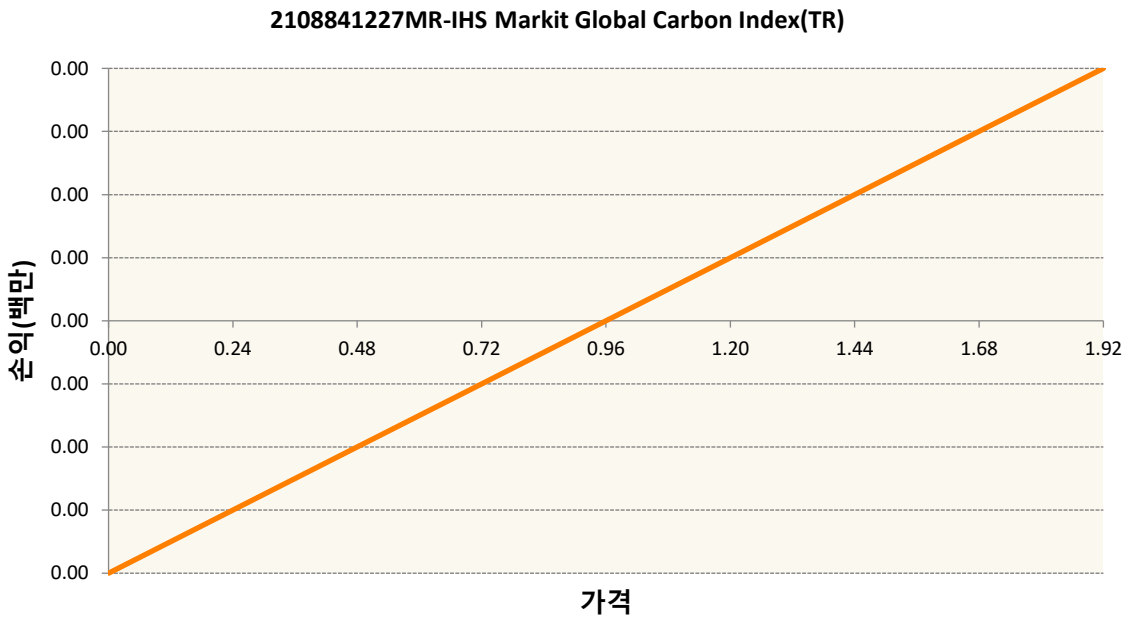
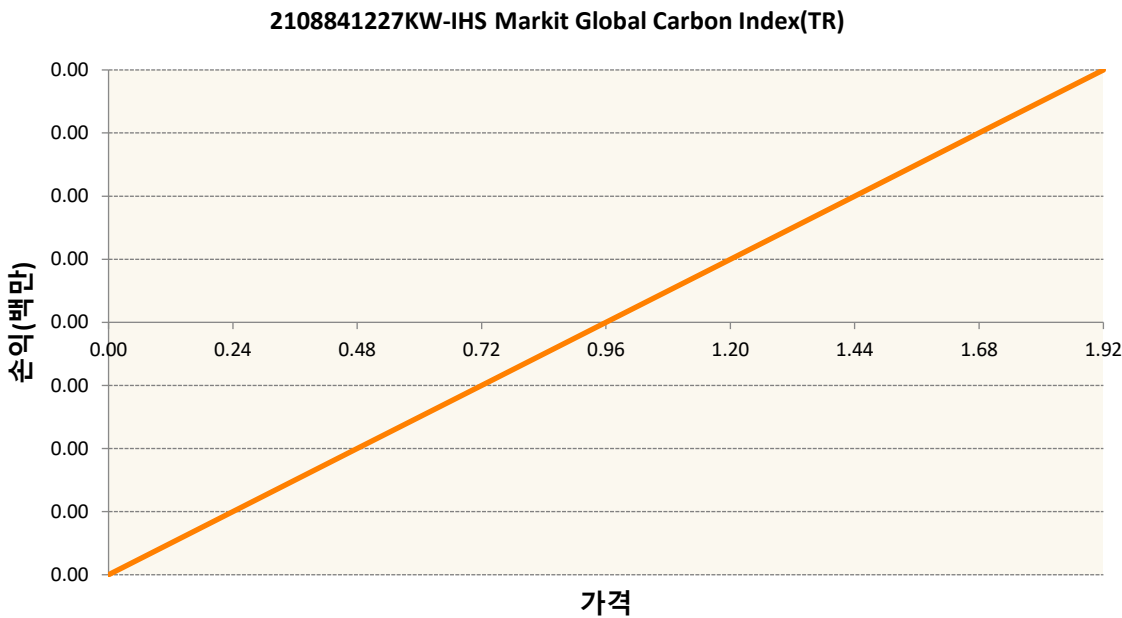
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

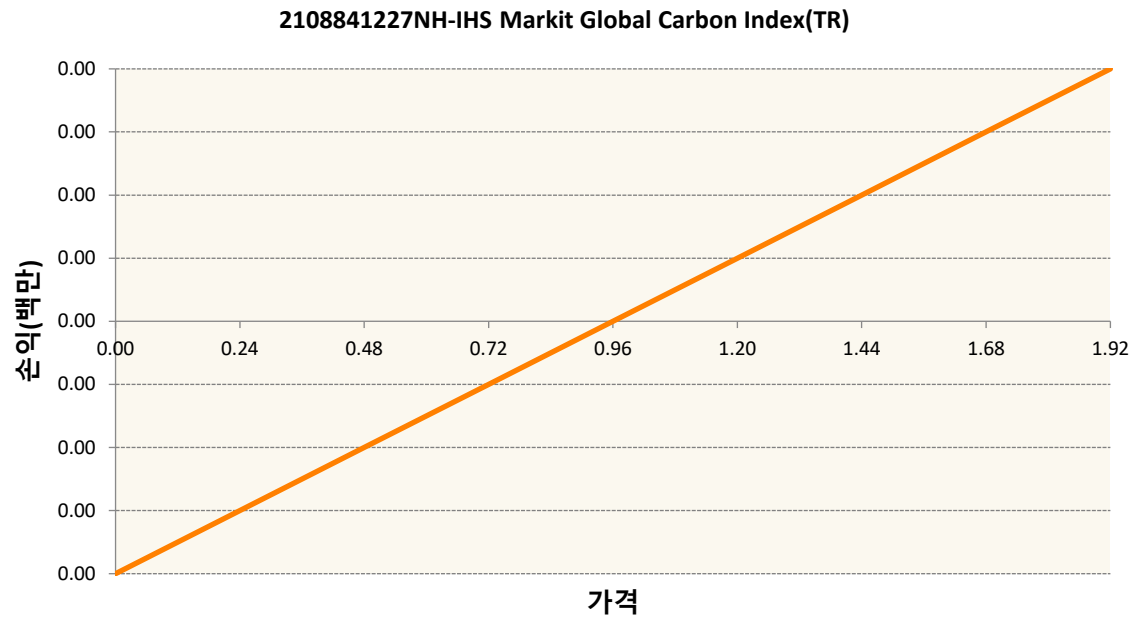
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	25,784	25,807	-23	
누계	유가증권	선물	24,753	0	24,753	

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2108841227IHS Markit Global Carbon Index(TR)

1,689

2108841227IHS Markit Global Carbon Index(TR)

199

2108841227IHS Markit Global Carbon Index(TR)

99

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

(단위:백만원)

3,783

공시일	2023-03-28
기준일	2023-03-27

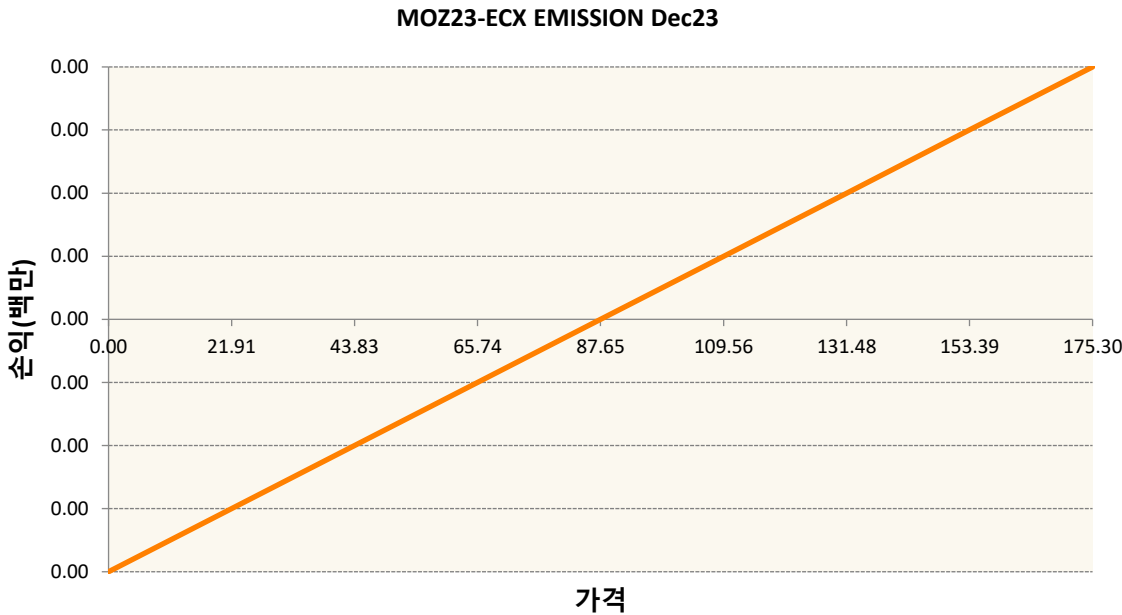
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	9,072	0	9,072	
누계	통화	선도	2,210	4,818	-2,608	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213D2Q KRW/EUR 31-03-23E	146
FXW213D2Q KRW/EUR 31-03-23E	146
FXW213D36(EUR/KRW 31-03-23E	45
FXW213D39(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
FXW213D3T(EUR/KRW 31-03-23E	41
MOZ23 ECX EMISSION Dec23	726

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

(단위:백만원)

2,307

공시일	2023-03-28
기준일	2023-03-27

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)	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)

4

공시일	2023-03-28
기준일	2023-03-27

SOL차이나육성산업엑티브상장지

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	976	0	976	장외
누계	지수	스왑	9,595	0	9,595	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 230116(NH)	0.42
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 230116(메리츠)	1
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 230116(미래)	0.49
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 230116(키움)	0.42

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

(단위:백만원)

2

공시일	2023-03-28
기준일	2023-03-27

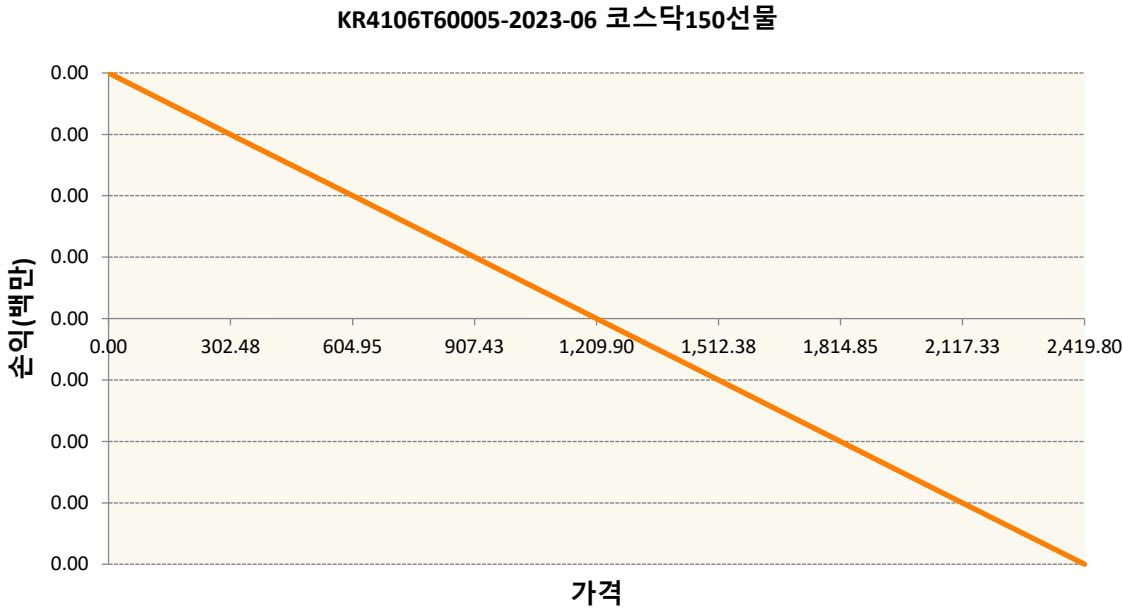
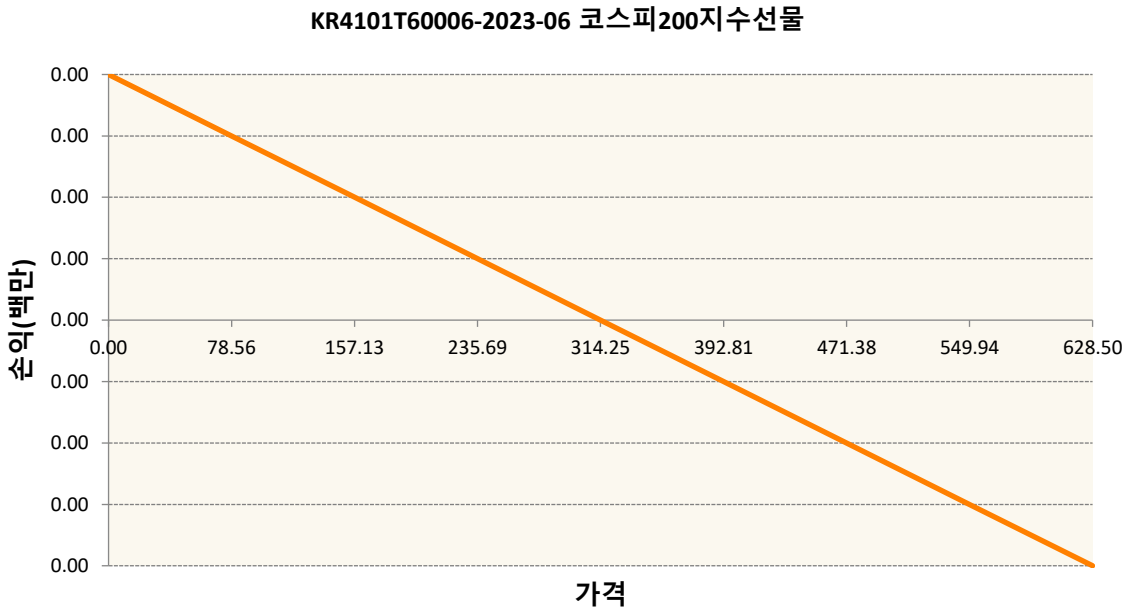
에쿼티알파일반사모혼합자산

1. 계약금액

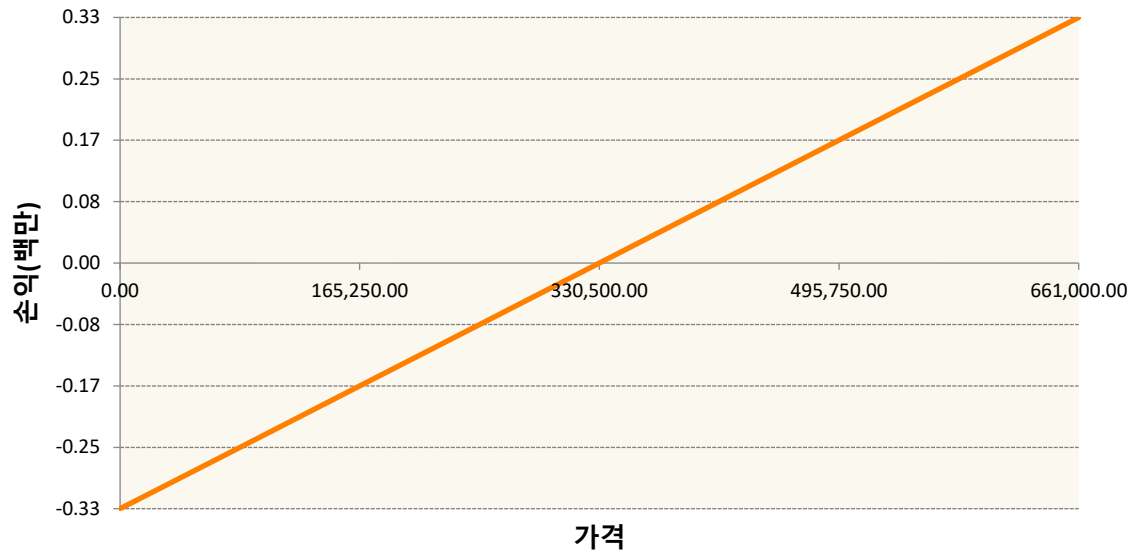
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	55	-55	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	445	3,579	-3,133	장내
누계	유가증권	스왑	0	0	0	장외

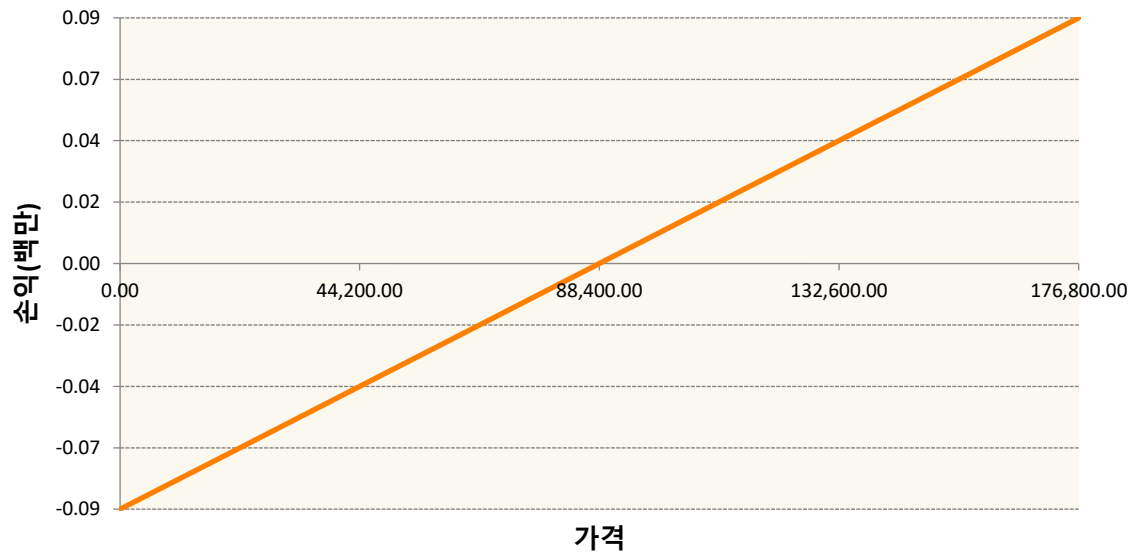
2. 만기시점의 손익구조



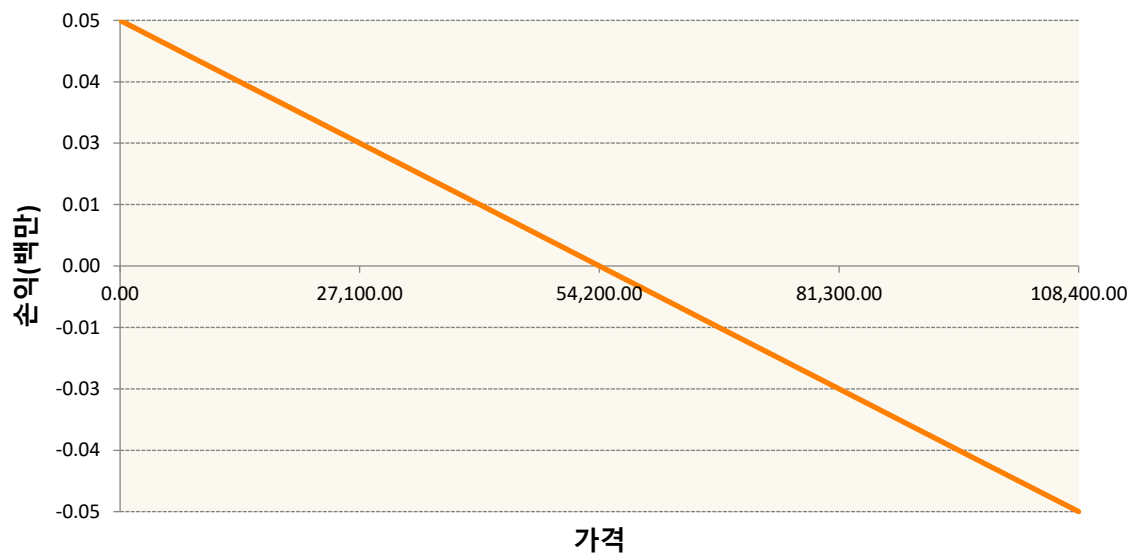
KR4113T40003-2023-04 POSCO홀딩스개별선물



KR41E4T40007-2023-04 에스엠개별선물



KR41F7T40009-2023-04 카카오페이개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101T600 2023-06 코스피200지수선물	157
KR4106T600 2023-06 코스닥150선물	116
KR4113T400 2023-04 POSCO홀딩스개별선물	26
KR41E4T400 2023-04 에스엠개별선물	9
KR41F7T400 2023-04 카카오페이개별선물	13
KRS0004054 SWAP_MICROSOFT CP_0221	0.29
KRS0004054 SWAP_FIRST TRUST ECL_0221	0.04
KRS0004099 SWAP_MICRON TECH_0308	1

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

505

공시일	2023-03-28
기준일	2023-03-27

코리아인덱스(주식-파생형)(종)

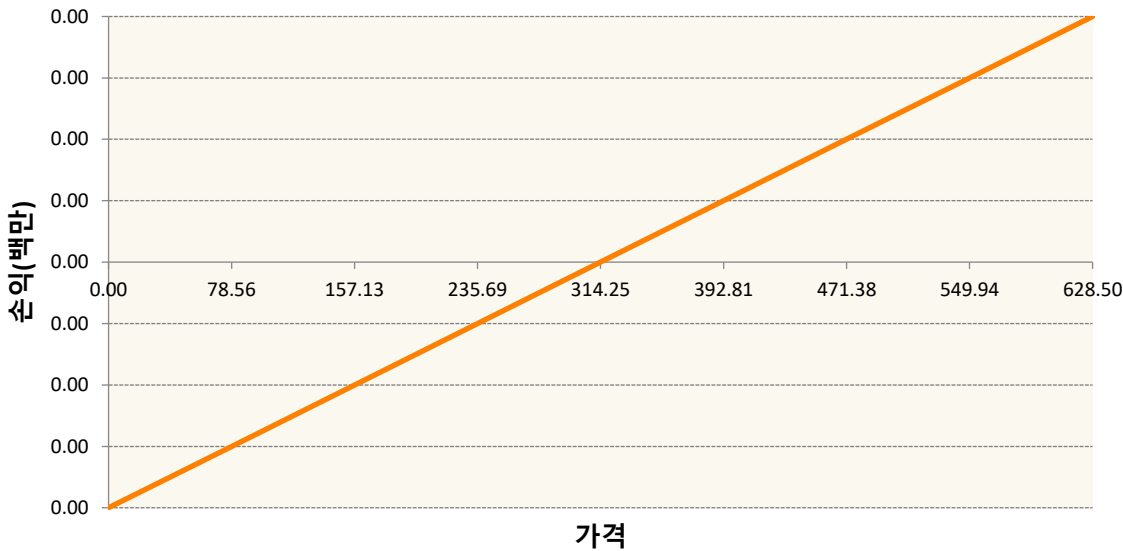
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,985	0	2,985	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101T60006-2023-06 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101T60006		2023-06 코스피200지수선물					238
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-238	-238	-238	-238	-238	-238	-238
-5.33%	-159	-159	-159	-159	-159	-159	-159
-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%	159	159	159	159	159	159	159
8.00%	238	238	238	238	238	238	238

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

(단위:백만원)

256

공시일	2023-03-28
기준일	2023-03-27

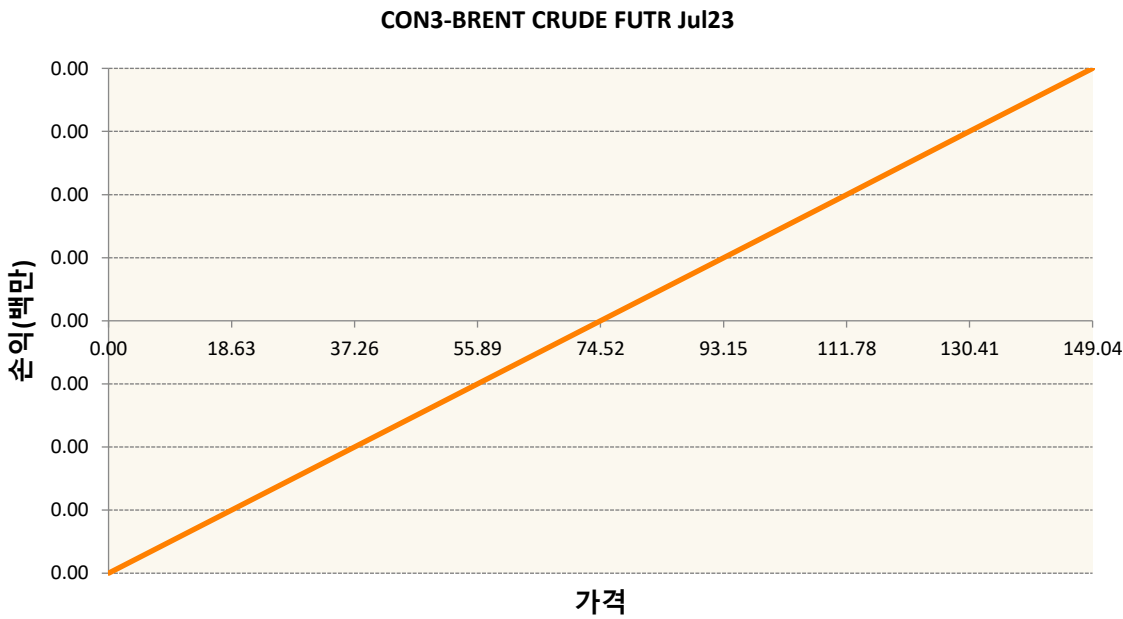
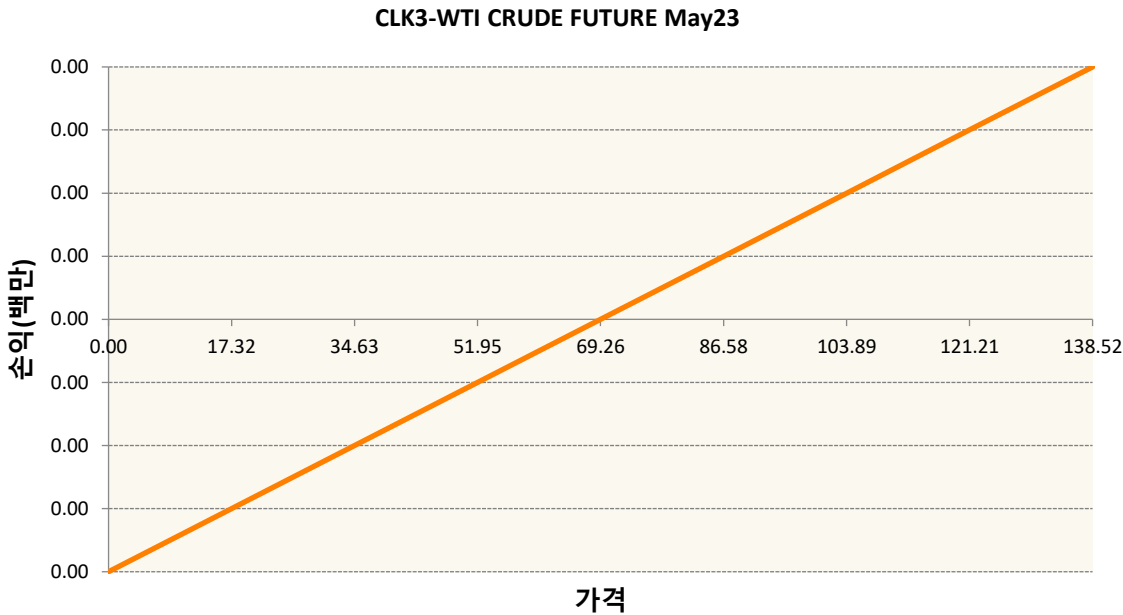
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

1. 계약금액

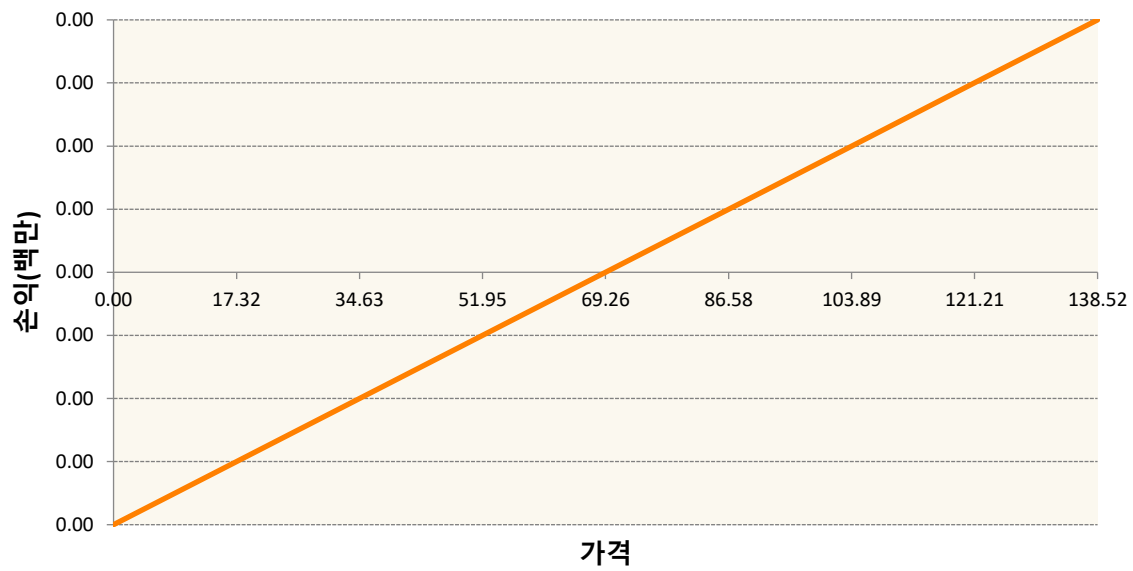
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,579	195	1,384	

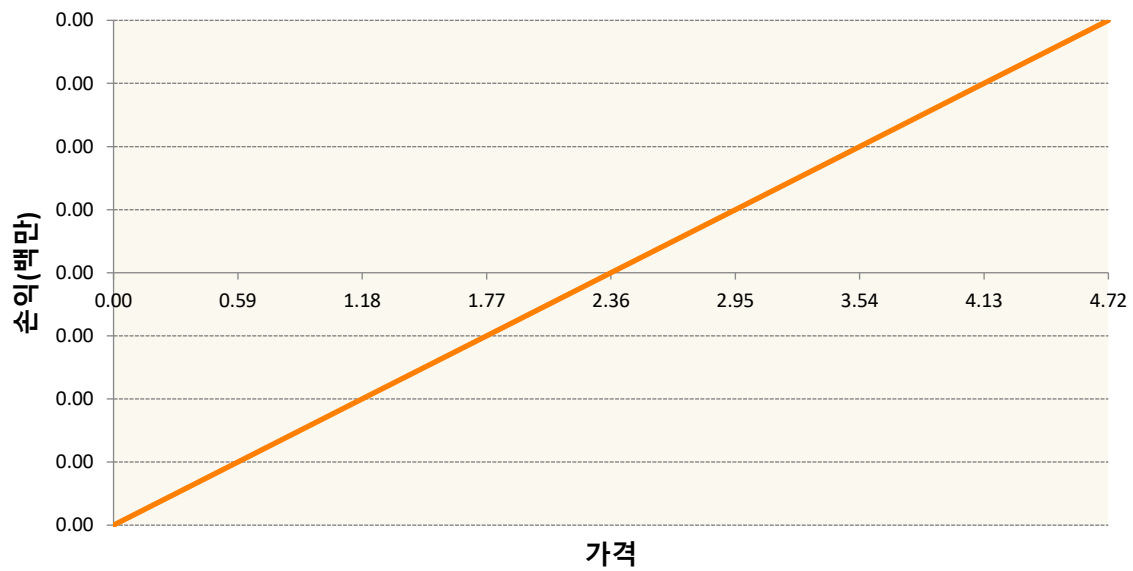
2. 만기시점의 손익구조



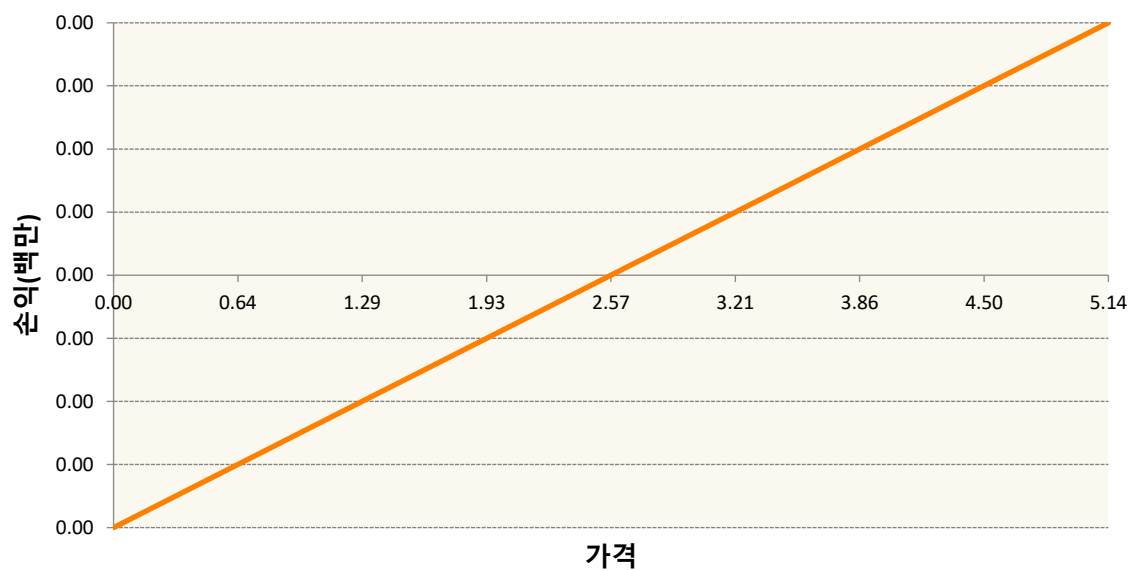
ECK3-E-mini Crude Oil May23



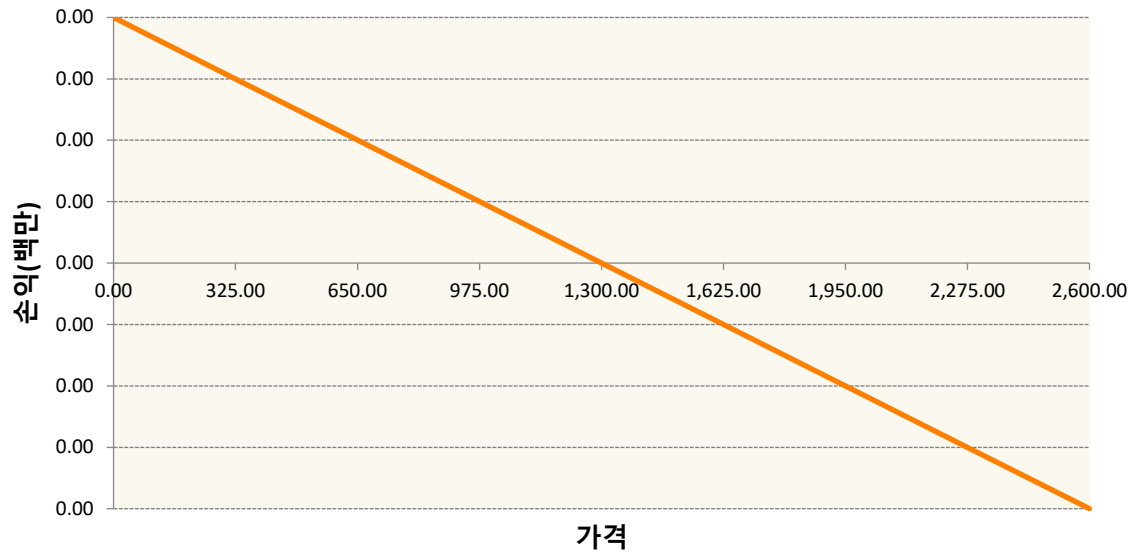
EOK3-E-MINI NATURAL GAS May23



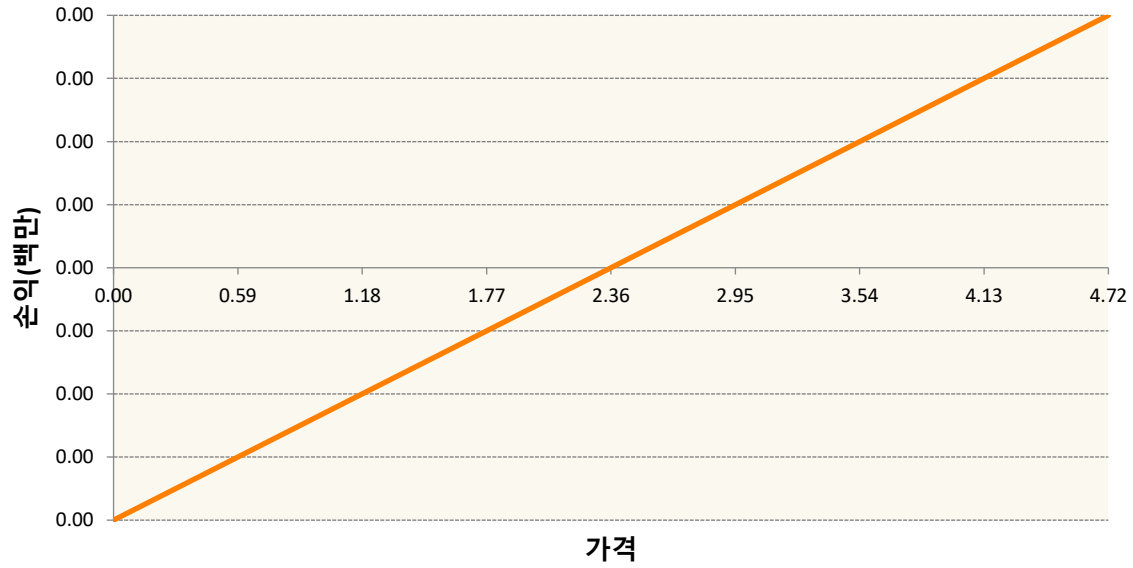
HOK3-NY Harb ULSD Fut May23



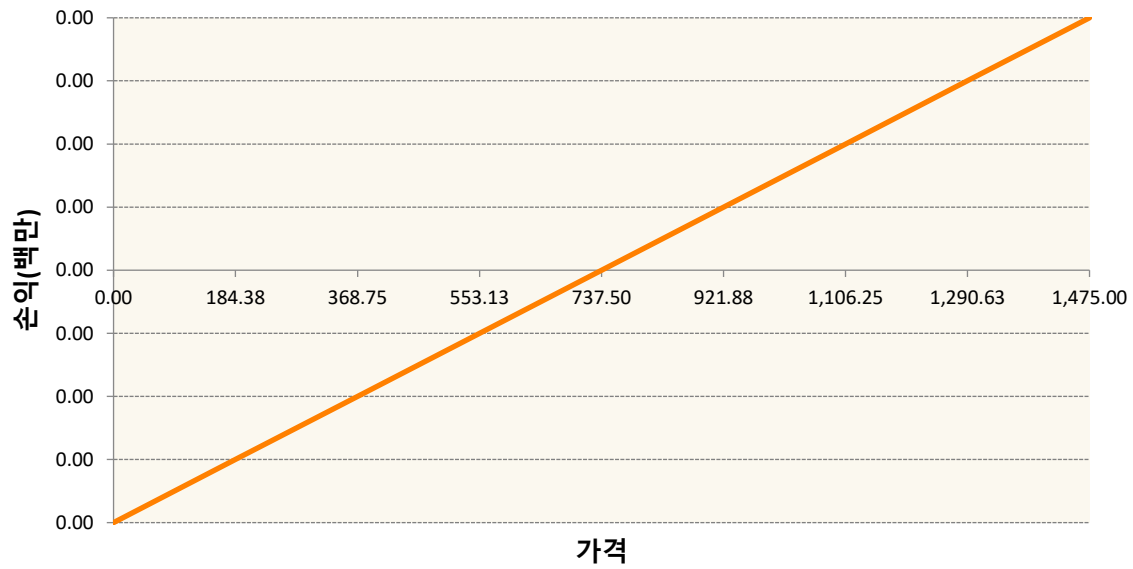
KR4175T40002-2023-04 달러선물

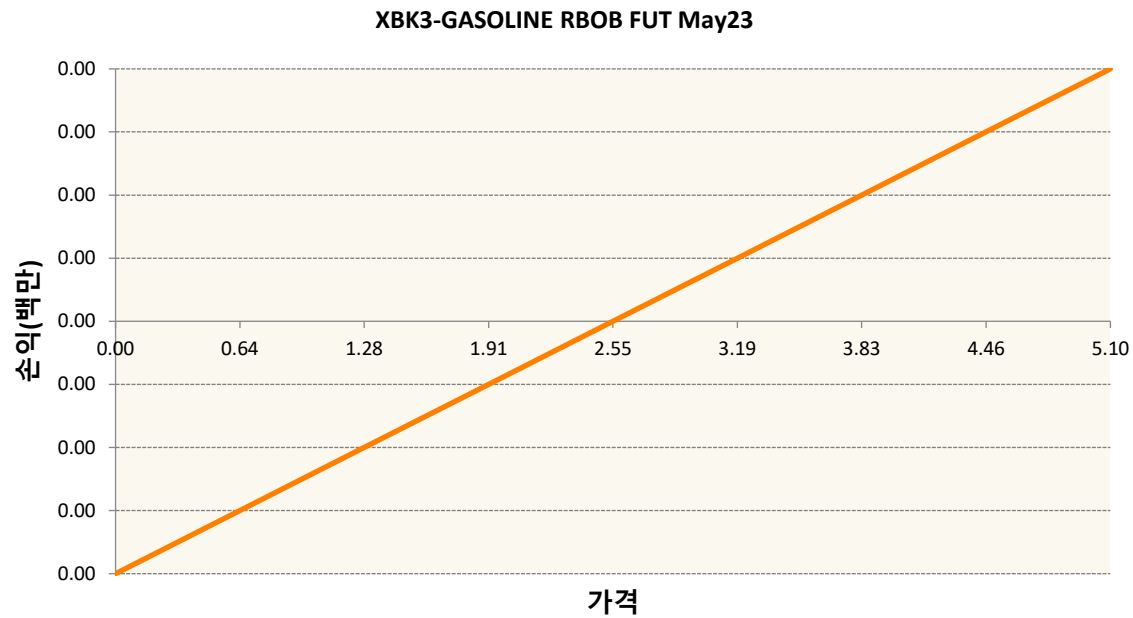


NGK23-NATURAL GAS FUTR May23



QSK3-Low Su Gasoil G May23





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
CLK3	WTI CRUDE FUTURE May23	28
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	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)
	383