

공시일	2023-03-31
기준일	2023-03-30

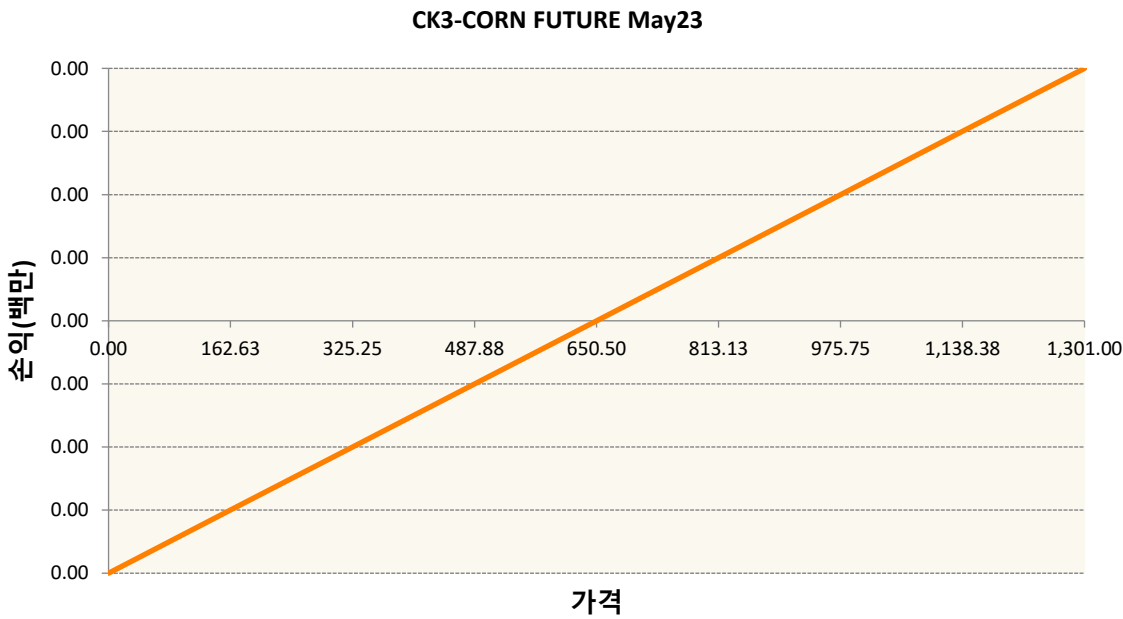
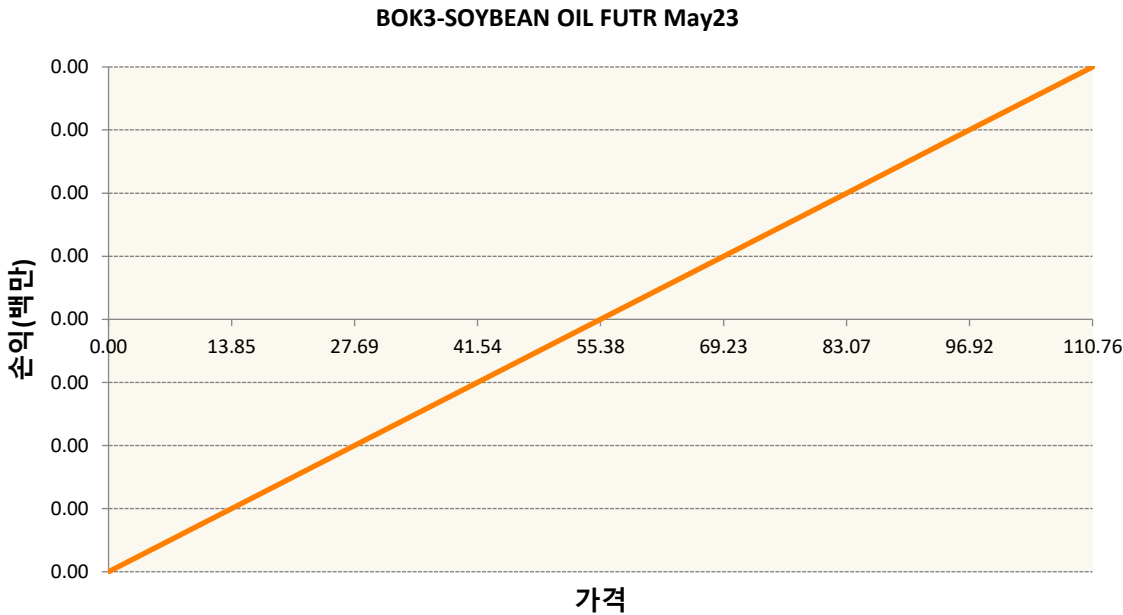
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

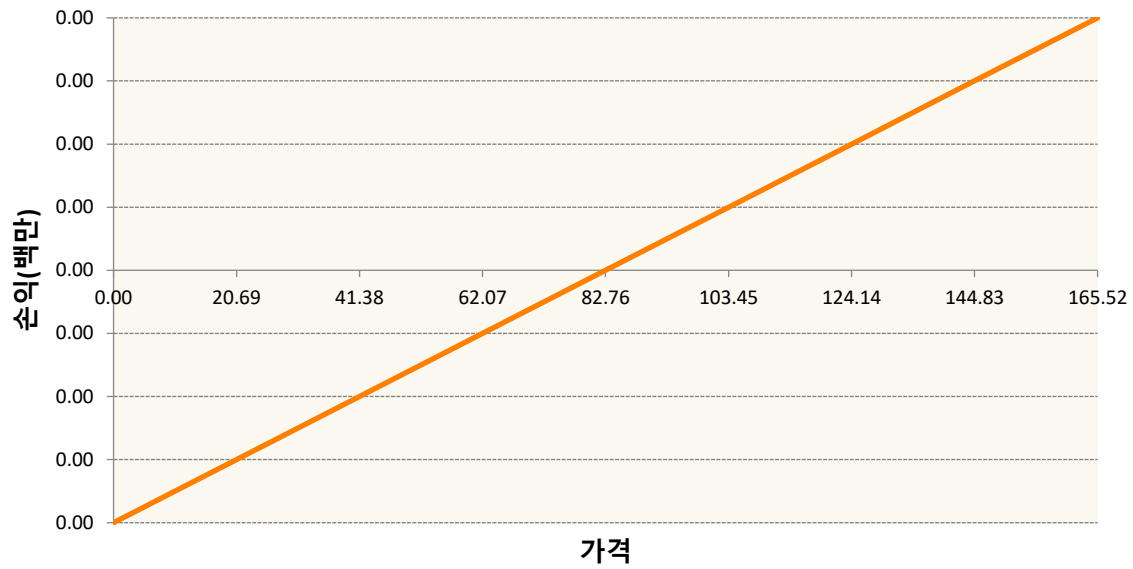
(단위:USD 백만)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,649	519	5,130	

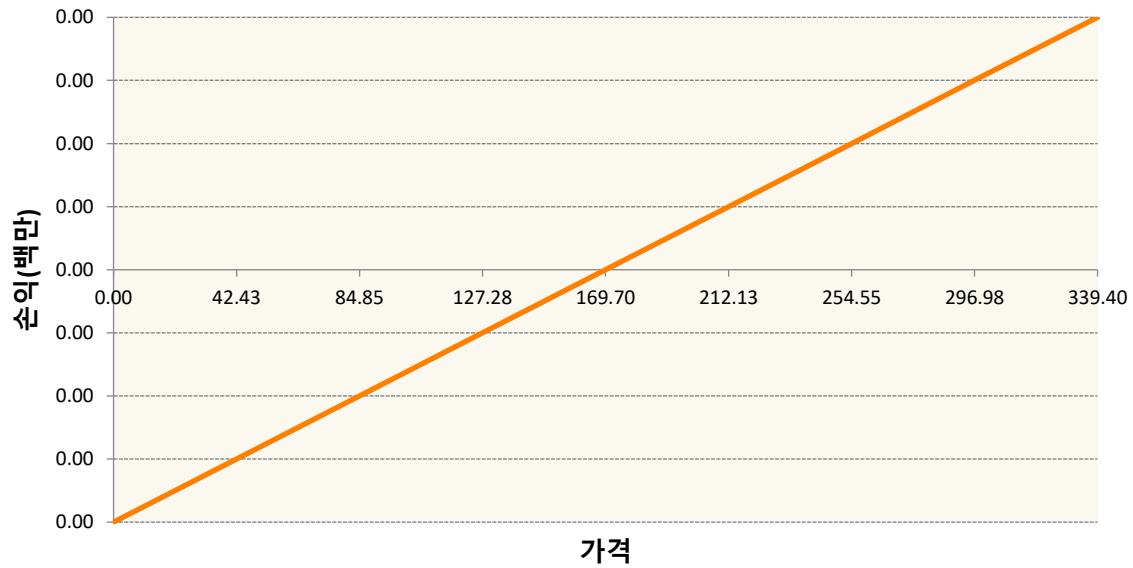
2. 만기시점의 손익구조



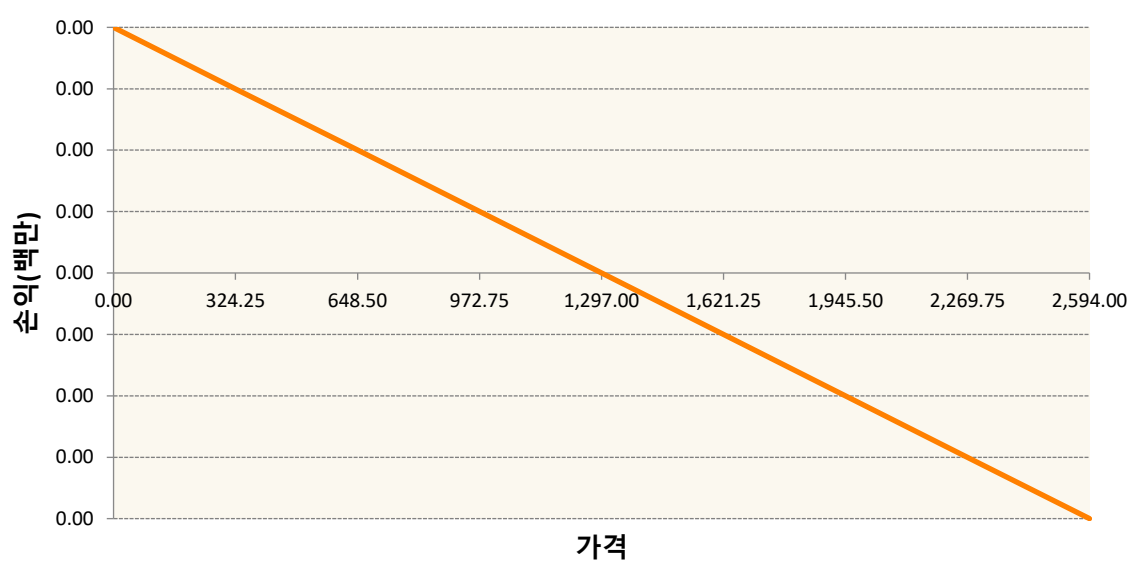
CTK3-COTTON NO.2 FUTR May23



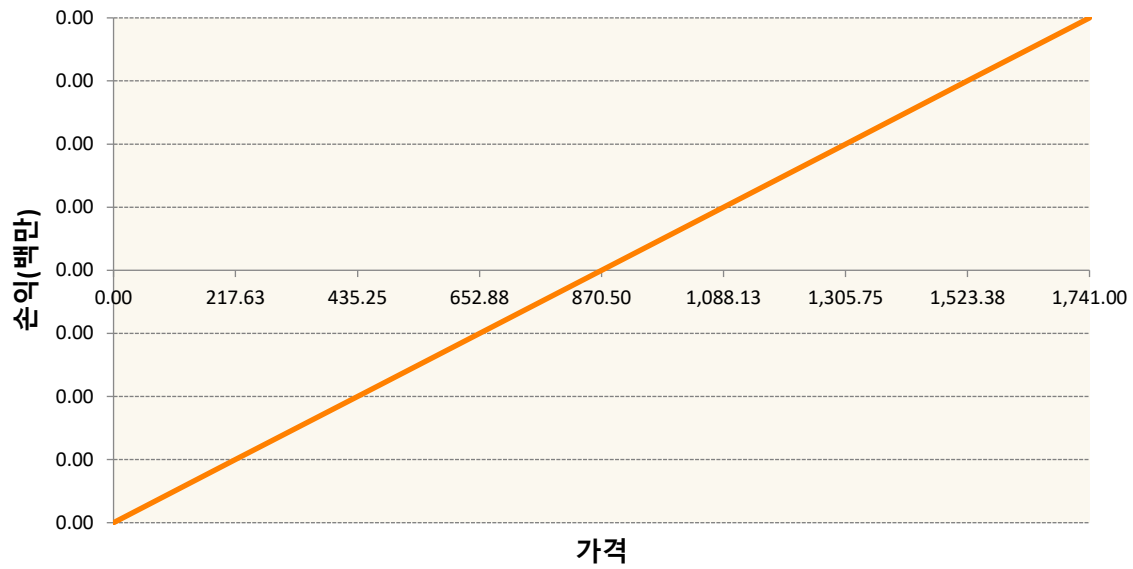
KCK3-COFFEE 'C' FUTURE May23



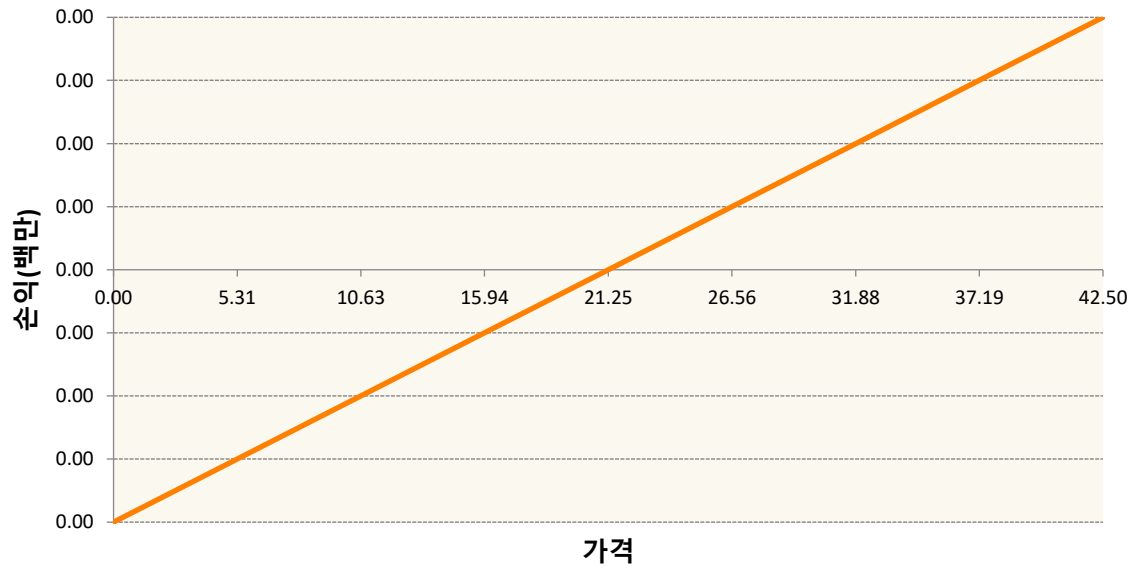
KR4175T40002-2023-04 달러선물



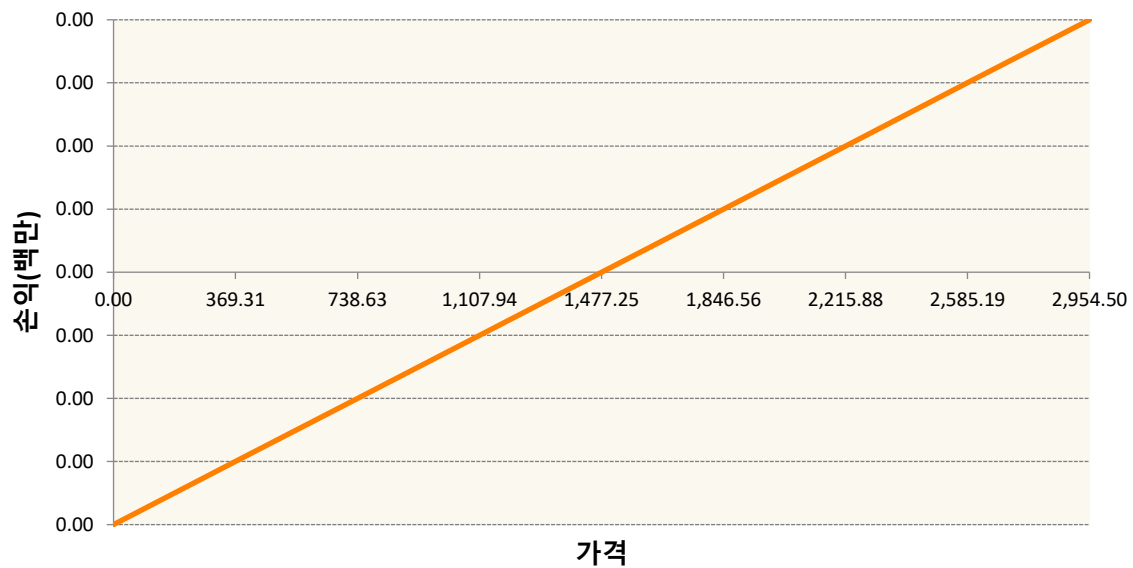
KWK3-KC HRW WHEAT FUT May23



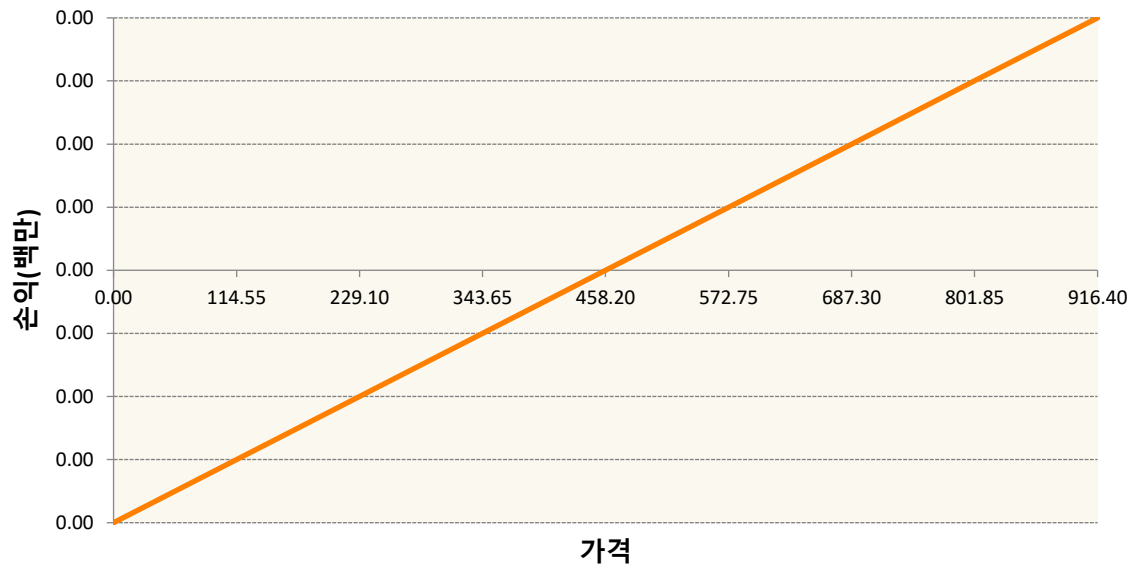
SBK3-Sugar #11 (WORLD) May23



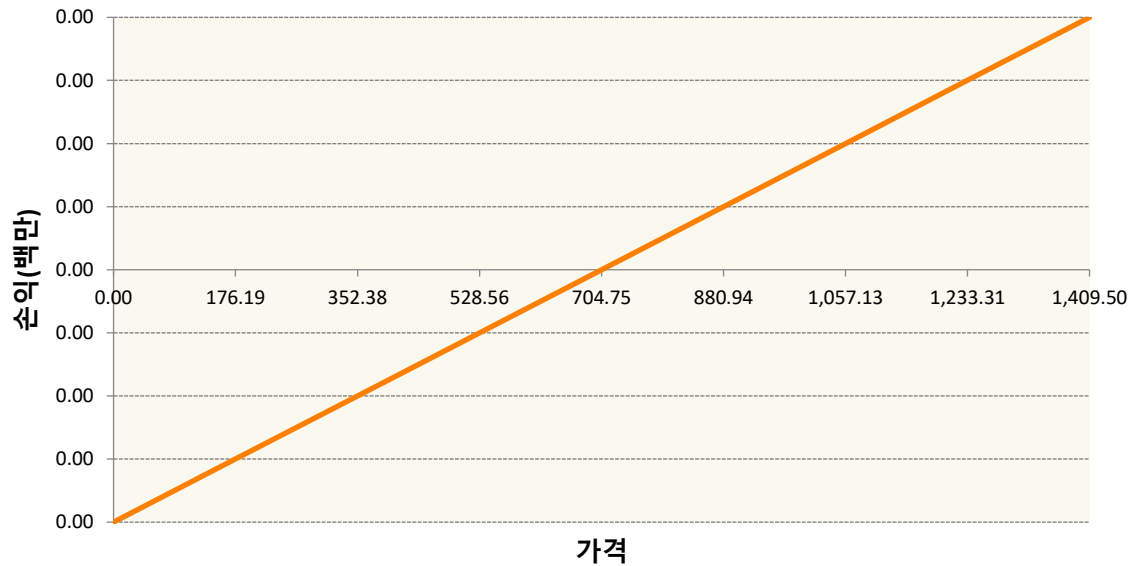
SK3-SOYBEAN FUTURE May23



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	2023-03-31
기준일	2023-03-30

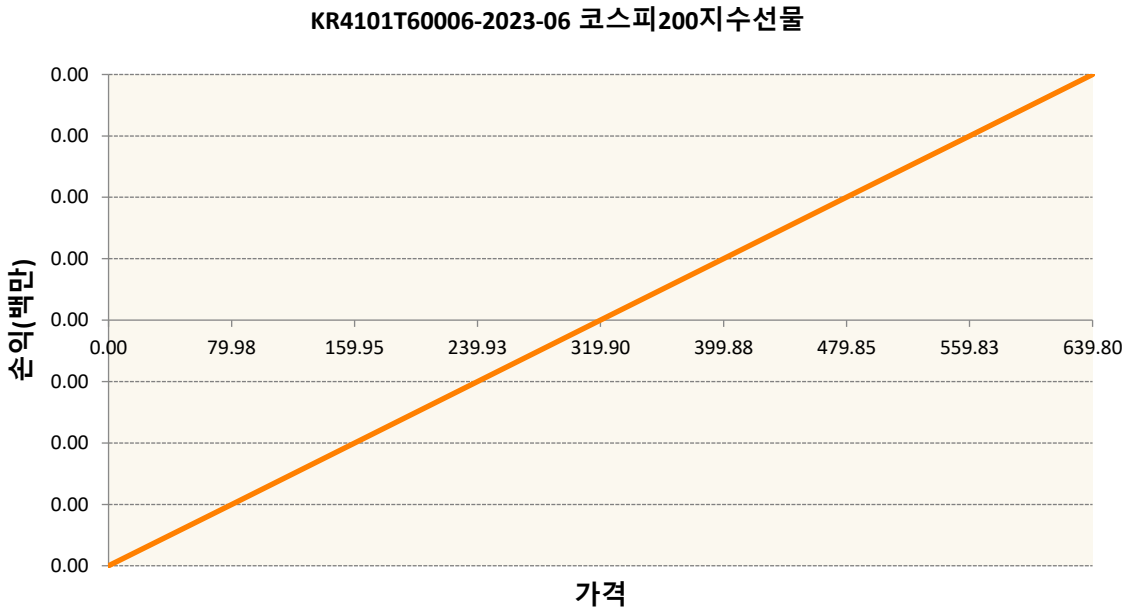
스마트인덱스모

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	2,719	0	2,719	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101T60006		2023-06 코스피200지수선물					216
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-216	-216	-216	-216	-216	-216	-216
-5.33%	-144	-144	-144	-144	-144	-144	-144
-2.67%	-72	-72	-72	-72	-72	-72	-72
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	72	72	72	72	72	72	72
5.33%	144	144	144	144	144	144	144
8.00%	216	216	216	216	216	216	216

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

(단위:백만원)

233

공시일	2023-03-31
기준일	2023-03-30

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	365
-----------------------------	-----

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

473

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2023-03-31
기준일	2023-03-30

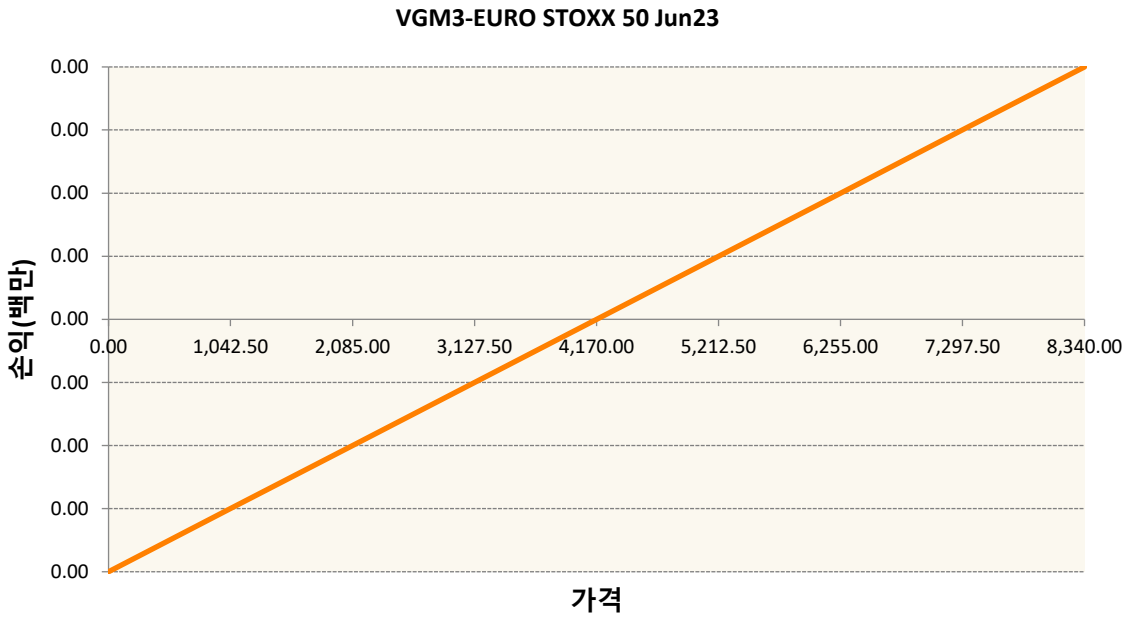
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	465	0	465	

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	2023-03-31
기준일	2023-03-30

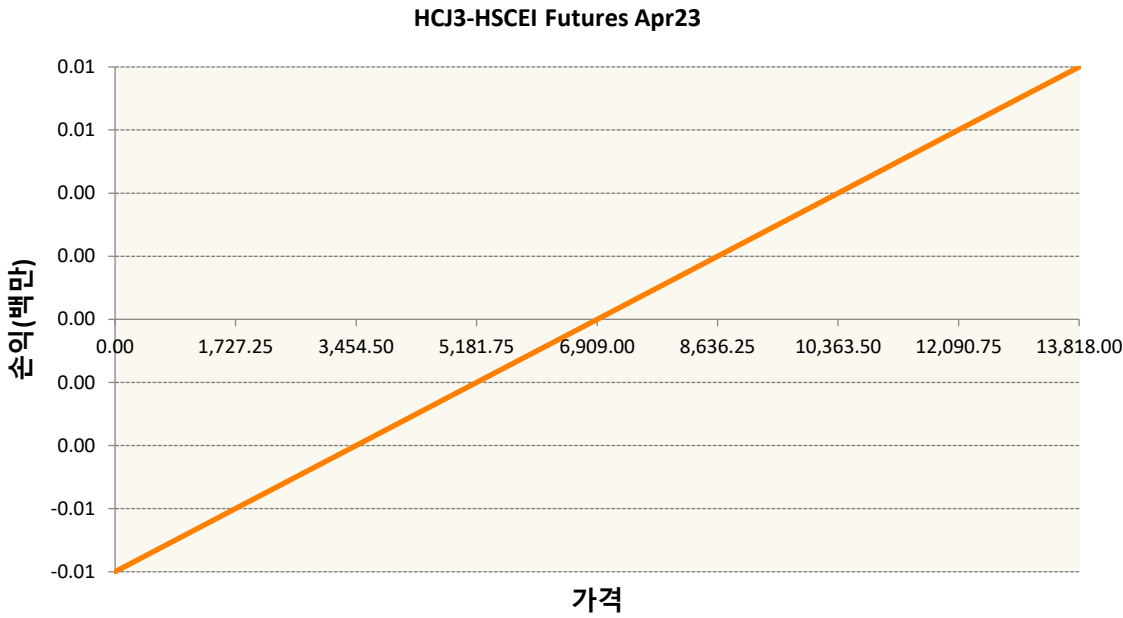
차이나인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,089	0	1,089	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCI3	HSCEI Futures Apr23	87
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

117

공시일	2023-03-31
기준일	2023-03-30

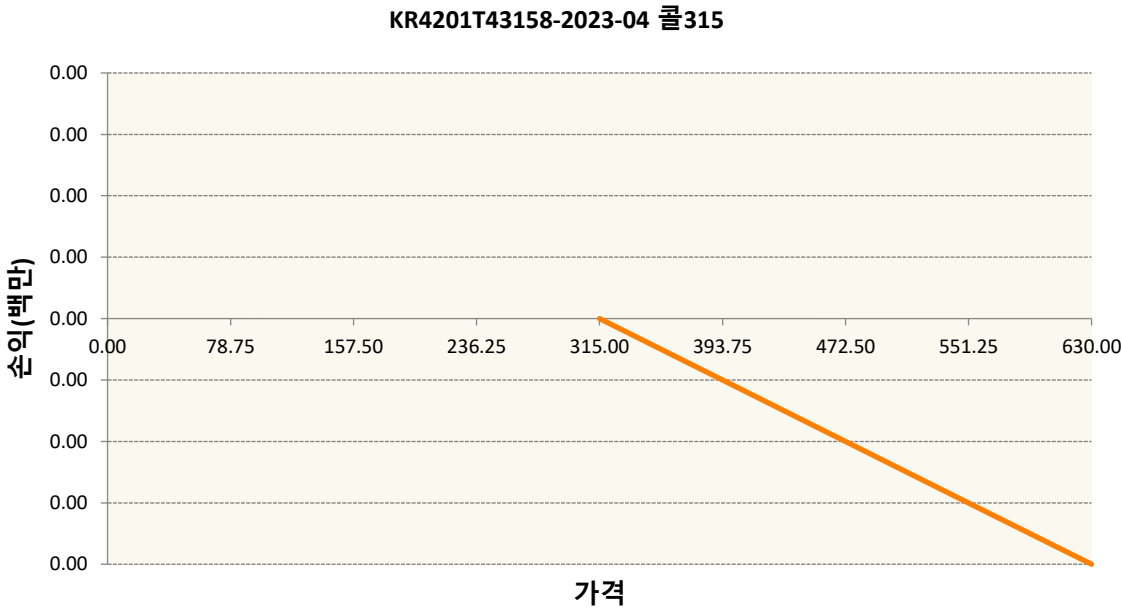
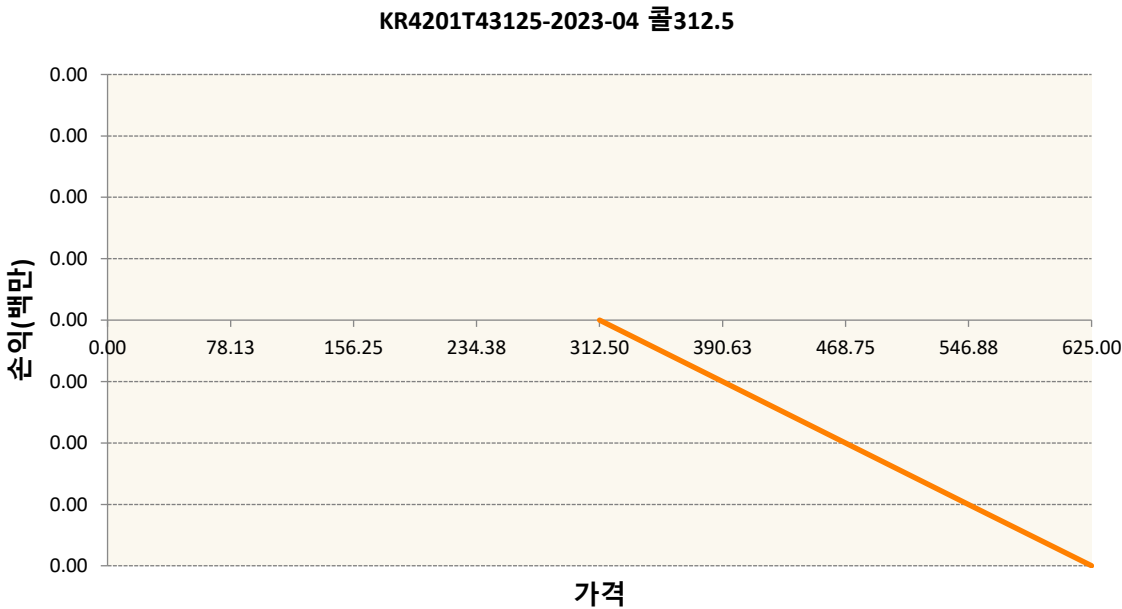
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

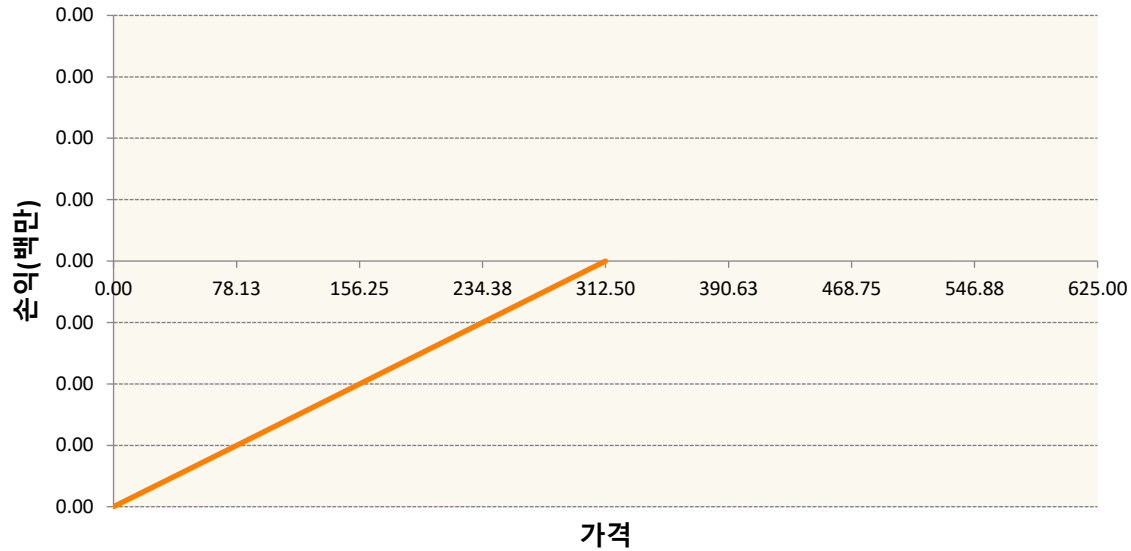
(단위:백만원)

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						809
		기초자산의 변동성						
가격		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	342	337	331	324	315	306	296	
-5.33%	312	300	287	273	258	243	228	
-2.67%	224	206	188	169	150	132	113	
0%	53	35	18	0	-18	-36	-54	
2.67%	-194	-205	-216	-229	-242	-257	-271	
5.33%	-484	-488	-493	-500	-508	-517	-527	
8.00%	-789	-790	-792	-794	-798	-803	-809	
KR4201T43158		2023-04 콜315						2,317
		기초자산의 변동성						
가격		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	836	828	816	801	783	761	737	
-5.33%	782	755	725	691	655	617	578	
-2.67%	591	542	492	441	390	339	287	
0%	160	107	54	0	-54	-108	-162	
2.67%	-519	-554	-592	-633	-676	-720	-766	
5.33%	-1,353	-1,368	-1,387	-1,410	-1,436	-1,466	-1,498	
8.00%	-2,249	-2,253	-2,260	-2,270	-2,283	-2,299	-2,317	
KR4301T43123		2023-04 풋312.5						537
		기초자산의 변동성						
가격		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-498	-502	-507	-513	-520	-528	-537	
-5.33%	-260	-271	-282	-294	-306	-319	-332	
-2.67%	-72	-88	-103	-119	-135	-151	-167	
0%	45	30	15	0	-15	-31	-46	

2.67%	98	89	79	68	57	45	32
5.33%	115	111	106	101	94	86	78
8.00%	118	117	116	113	110	106	101

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

(단위:백만원)

3,842

공시일	2023-03-31
기준일	2023-03-30

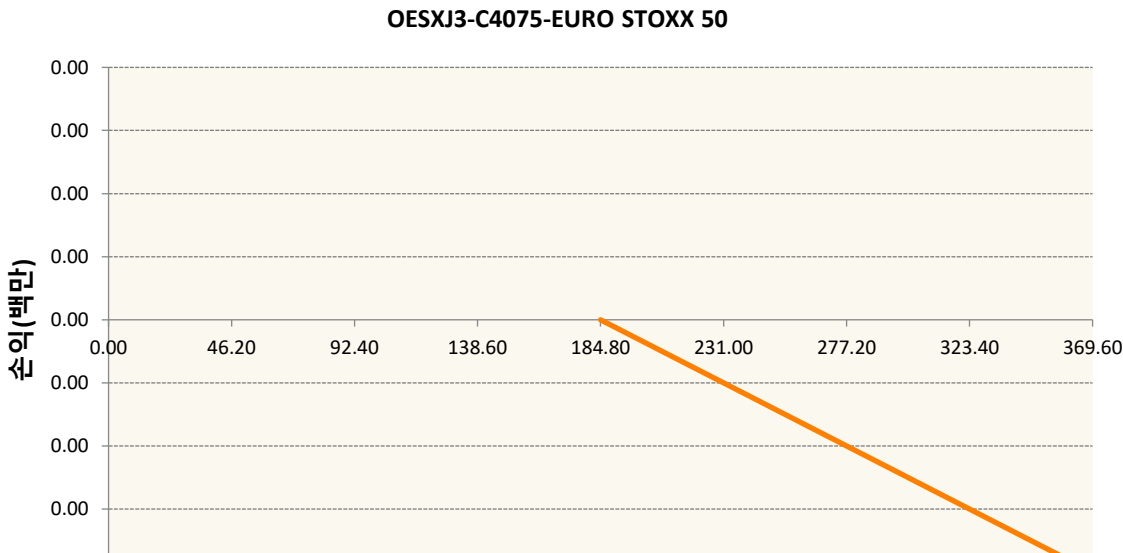
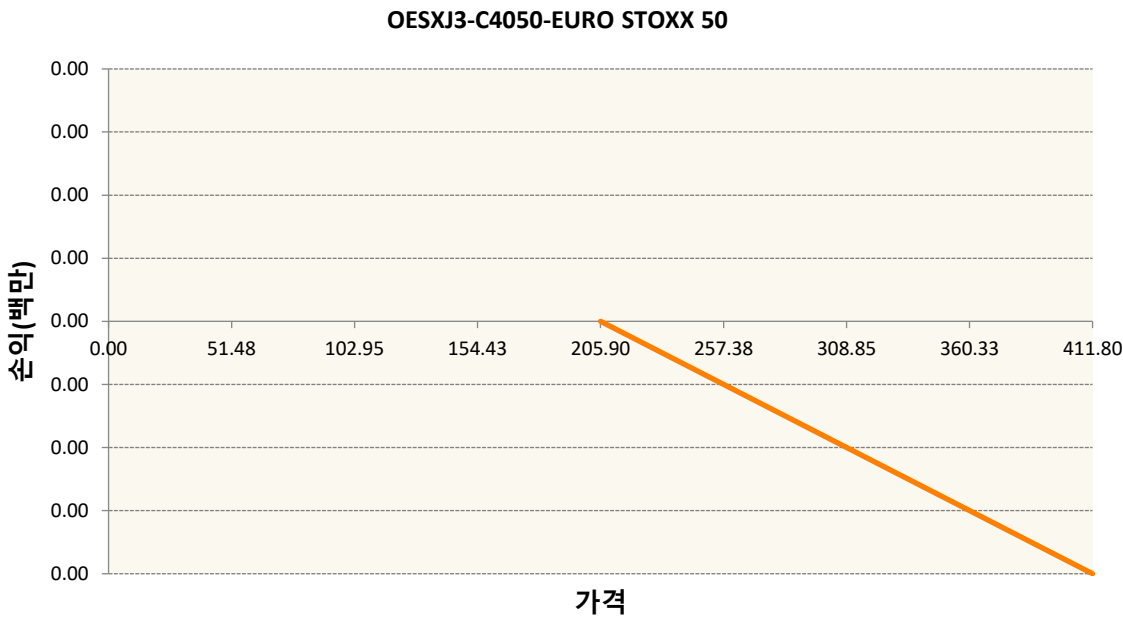
유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

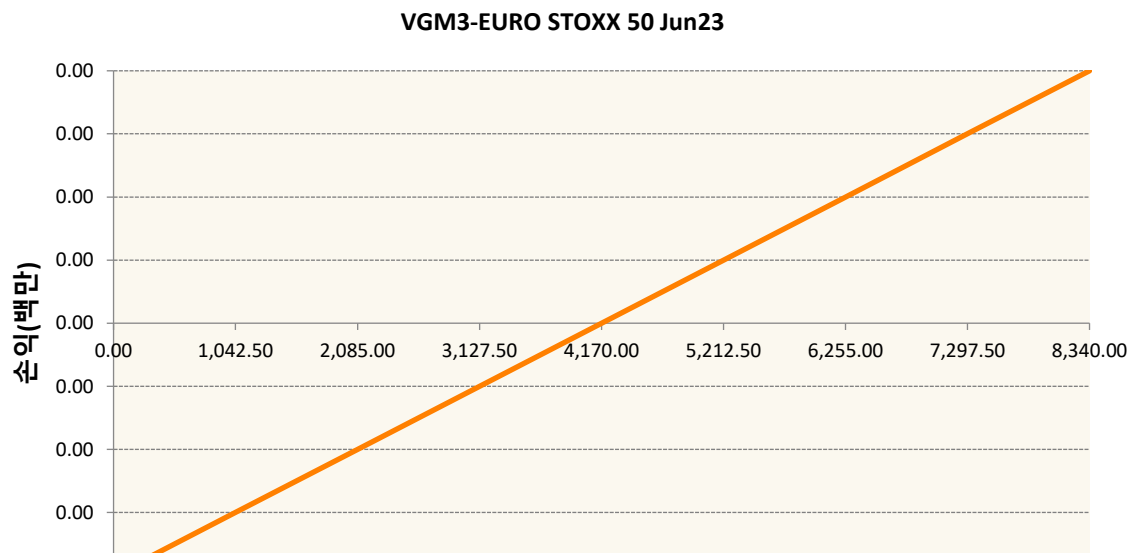
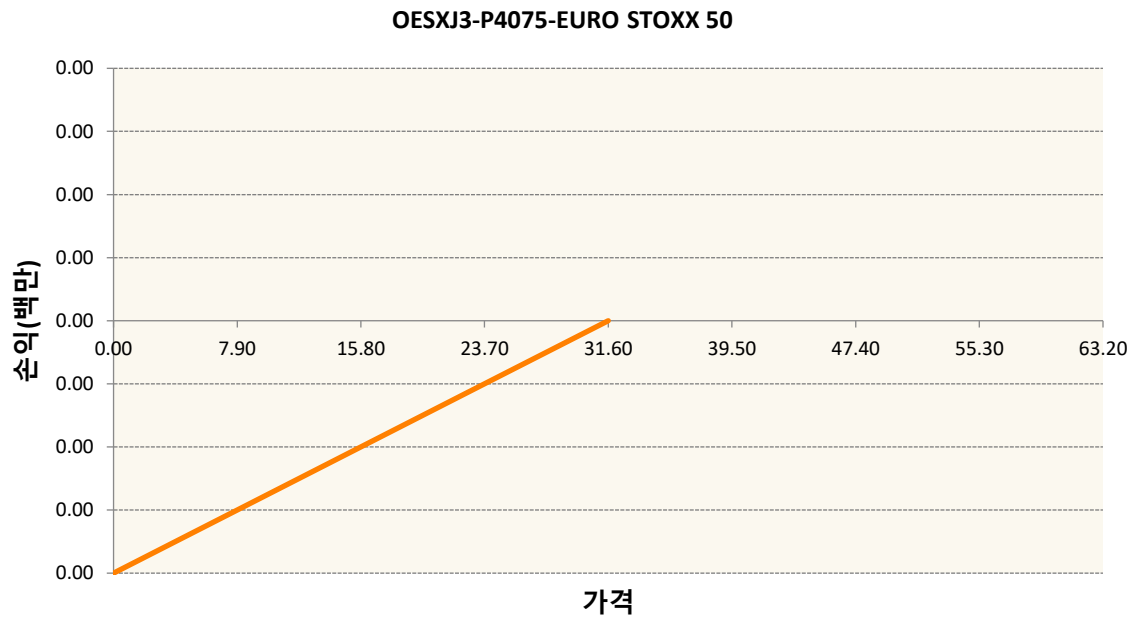
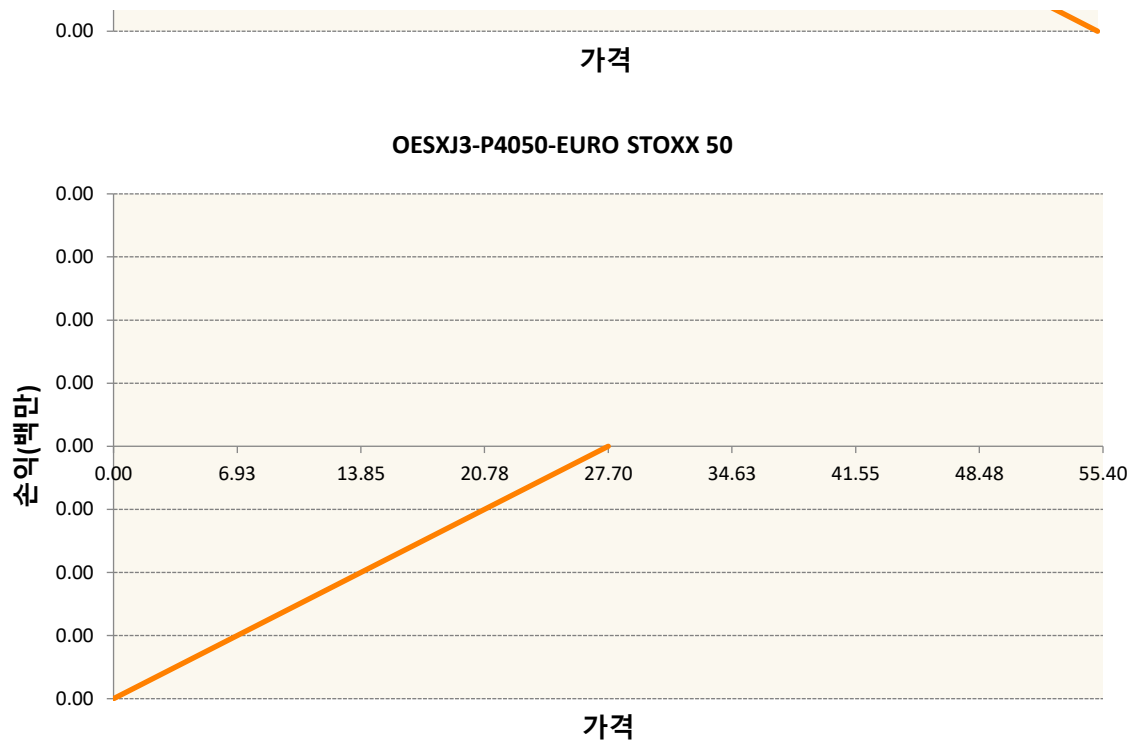
1. 계약금액

(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	930	0	930	
누계	유가증권	옵션	0	94	-94	장내
누계	통화	선도	0	1,690	-1,690	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	0.37
OESXJ3-P40! EURO STOXX 50	1
VGM3 EURO STOXX 50 Jun23	74

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

(단위:백만원)

194

공시일	2023-03-31
기준일	2023-03-30

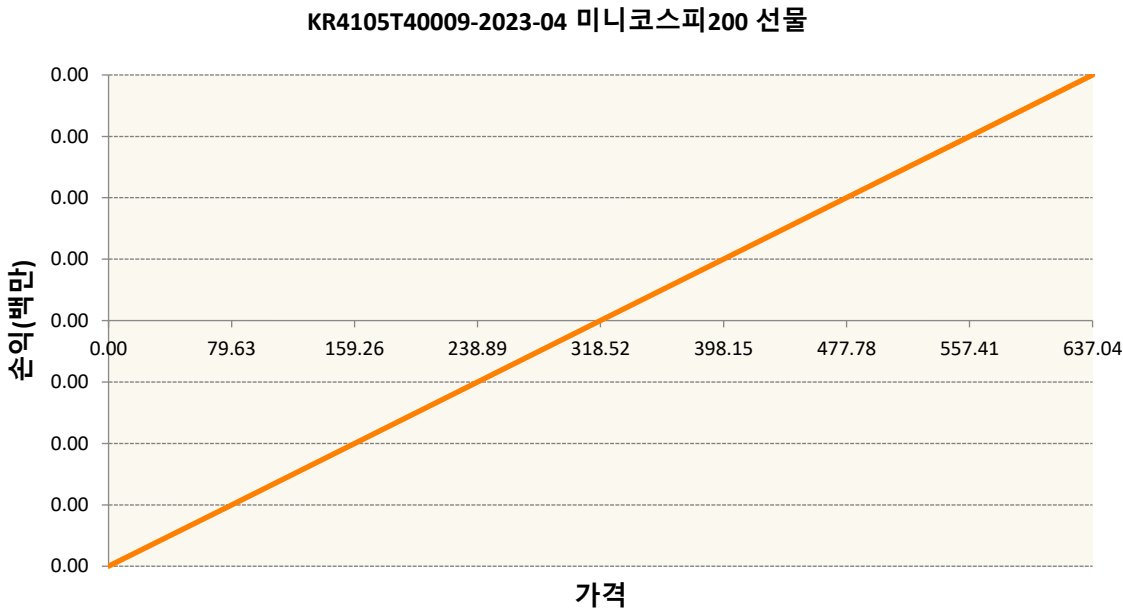
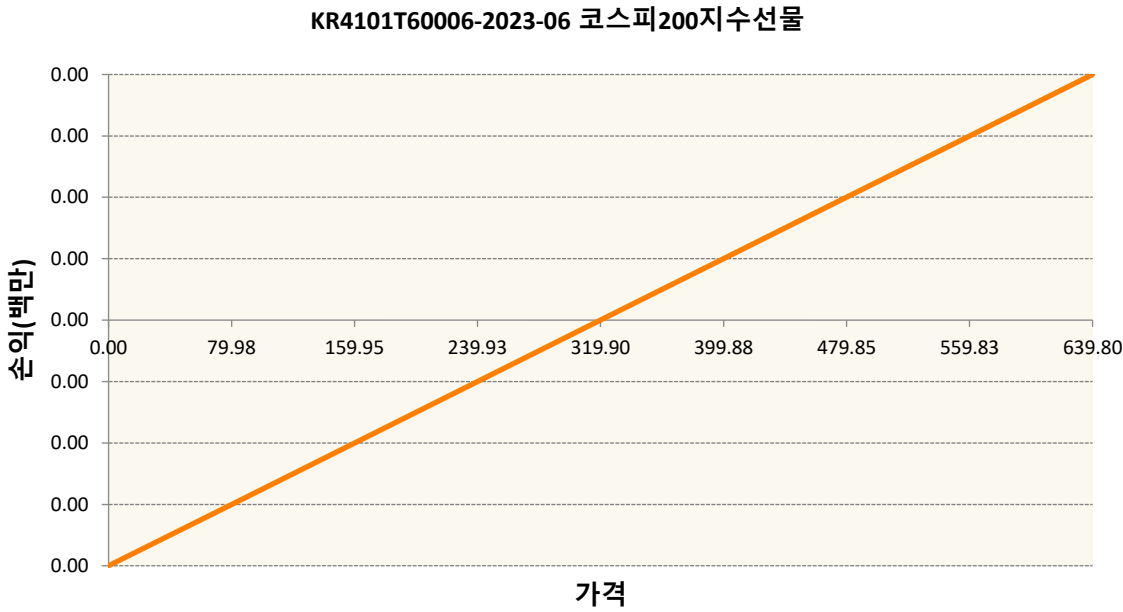
리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

1. 계약금액

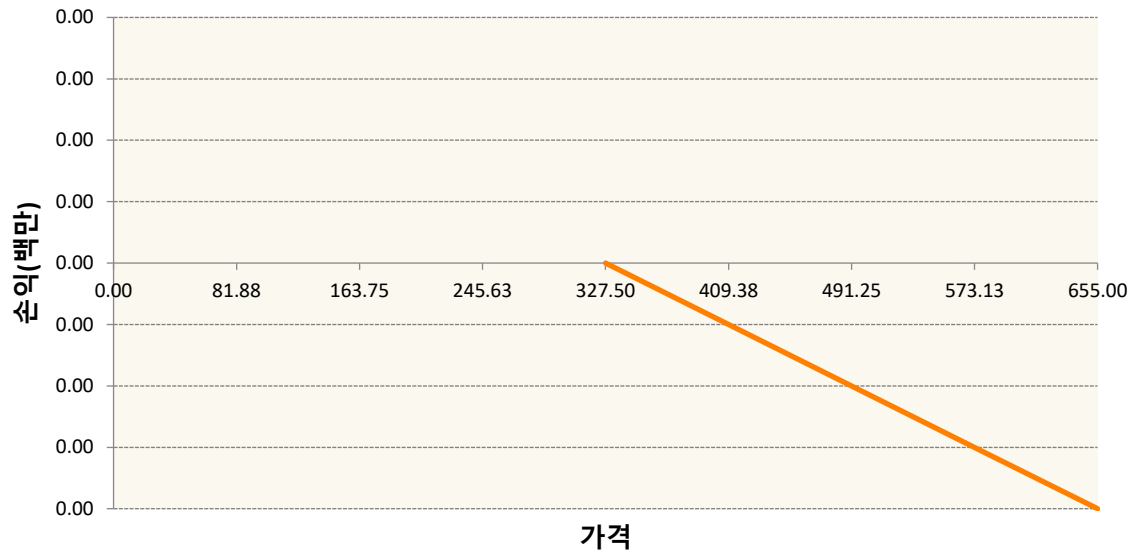
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	159	0	159	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	559	0	559	장내
누계	유가증권	옵션	157	3,874	-3,718	장내

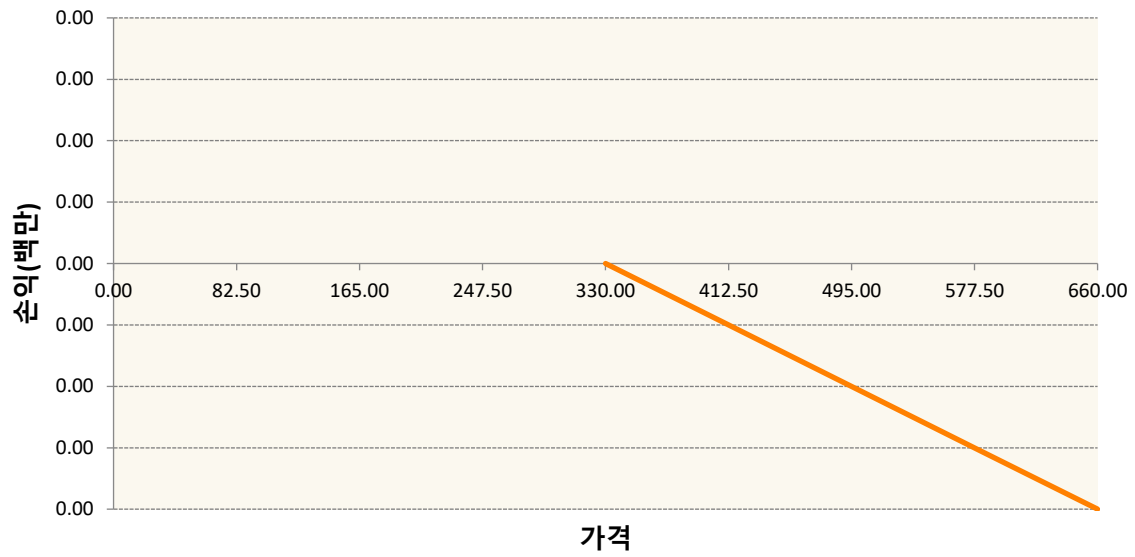
2. 만기시점의 손익구조



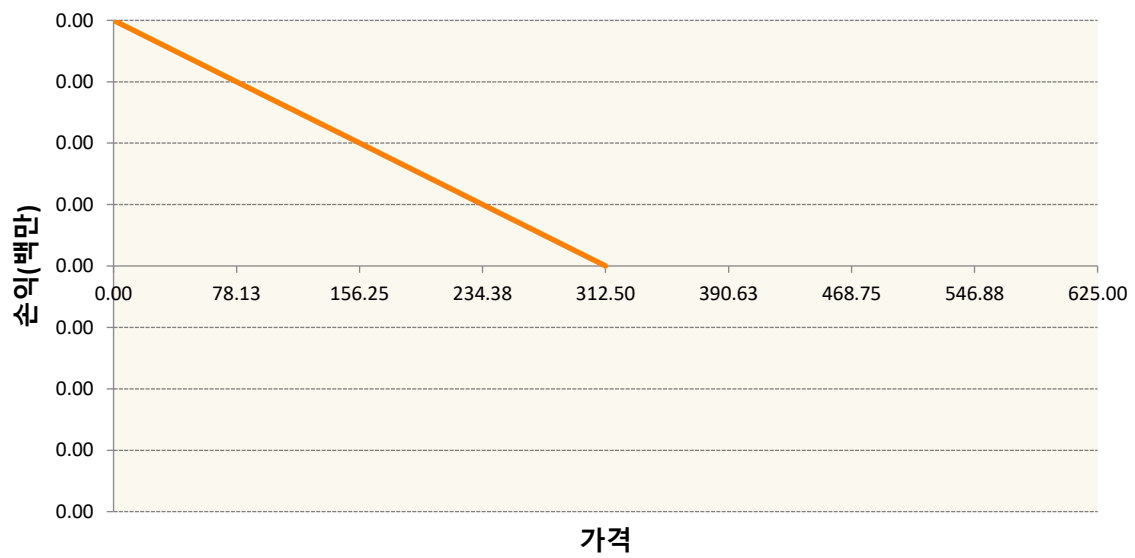
KR4201T43273-2023-04 콜327.5



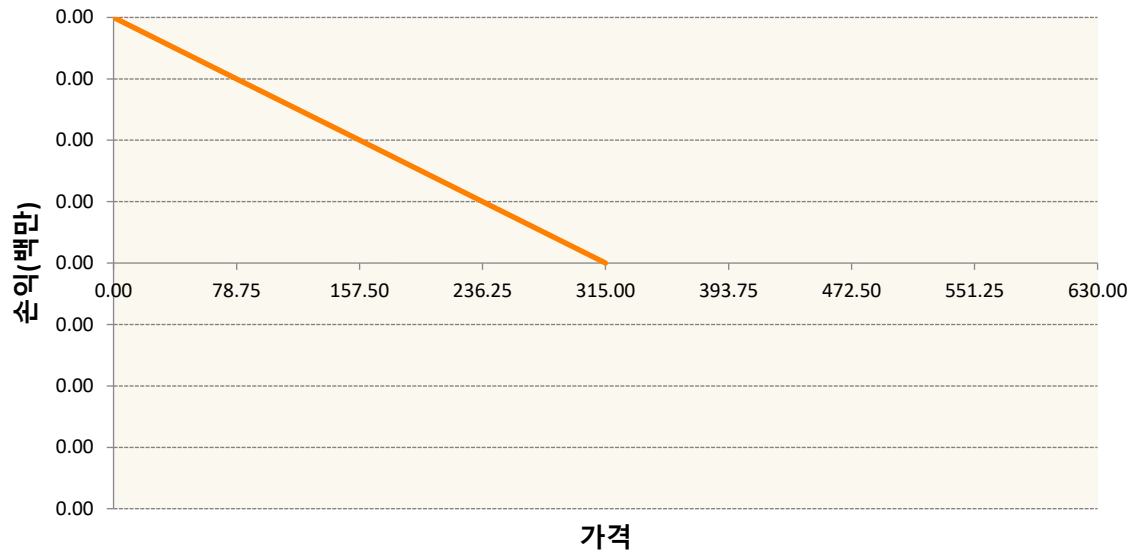
KR4201T43307-2023-04 콜330



KR4301T43123-2023-04 풋312.5



KR4301T43156-2023-04 풋315



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101T60006		2023-06 코스피200지수선물					32
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-32	-32	-32	-32	-32	-32	-32
-5.33%	-21	-21	-21	-21	-21	-21	-21
-2.67%	-11	-11	-11	-11	-11	-11	-11
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	11	11	11	11	11	11	11
5.33%	21	21	21	21	21	21	21
8.00%	32	32	32	32	32	32	32
KR4105T40009		2023-04 미니코스피200 선물					3
	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%	-2	-2	-2	-2	-2	-2	-2
-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%	2	2	2	2	2	2	2
8.00%	3	3	3	3	3	3	3
KR4201T43273		2023-04 콜327.5					20
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	4	4	4	3	3	3	3
-5.33%	3	3	3	3	3	3	3
-2.67%	3	3	3	2	2	1	1
0%	2	1	1	0	-1	-1	-2

2.67%	-2	-3	-3	-4	-5	-5	-6
5.33%	-9	-9	-10	-10	-11	-12	-12
8.00%	-17	-18	-18	-19	-19	-19	-20
KR4201T43307 2023-04 콜330							154
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	21	21	21	21	21	20	20
-5.33%	21	21	20	20	19	17	16
-2.67%	19	18	16	14	12	9	6
0%	11	8	4	0	-4	-9	-13
2.67%	-13	-18	-24	-29	-34	-40	-45
5.33%	-61	-66	-71	-76	-82	-87	-93
8.00%	-130	-133	-137	-141	-145	-149	-154
KR4301T43123 2023-04 풋312.5							4
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	4	4	4	4	4	4	4
-5.33%	2	2	2	2	2	3	3
-2.67%	1	1	1	1	1	1	1
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-1	-1	-1	-1	0	0	0
5.33%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1
8.00%	-1	-1	-1	-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	4	4	5	5	5	5
-5.33%	2	2	3	3	3	3	3
-2.67%	1	1	1	1	1	1	1
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-1	-1	-1	-1	-1	0	0
5.33%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1
8.00%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1

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

(단위:백만원)

192

공시일	2023-03-31
기준일	2023-03-30

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	6,640	0	6,640	

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	2023-03-31
기준일	2023-03-30

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	5,273	0	5,273	

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	2023-03-31
기준일	2023-03-30

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	18,814	0	18,814	
누계	통화	선도	650	18,933	-18,283	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213D1S(KRW/USD 28-04-23E	310
FXW213D2Q KRW/USD 31-05-23E	700
FXW213D3Q KRW/USD 28-06-23E	504
FXW213D3W USD/KRW 28-04-23E	52
IE00BD8RGM75	

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

893

공시일	2023-03-31
기준일	2023-03-30

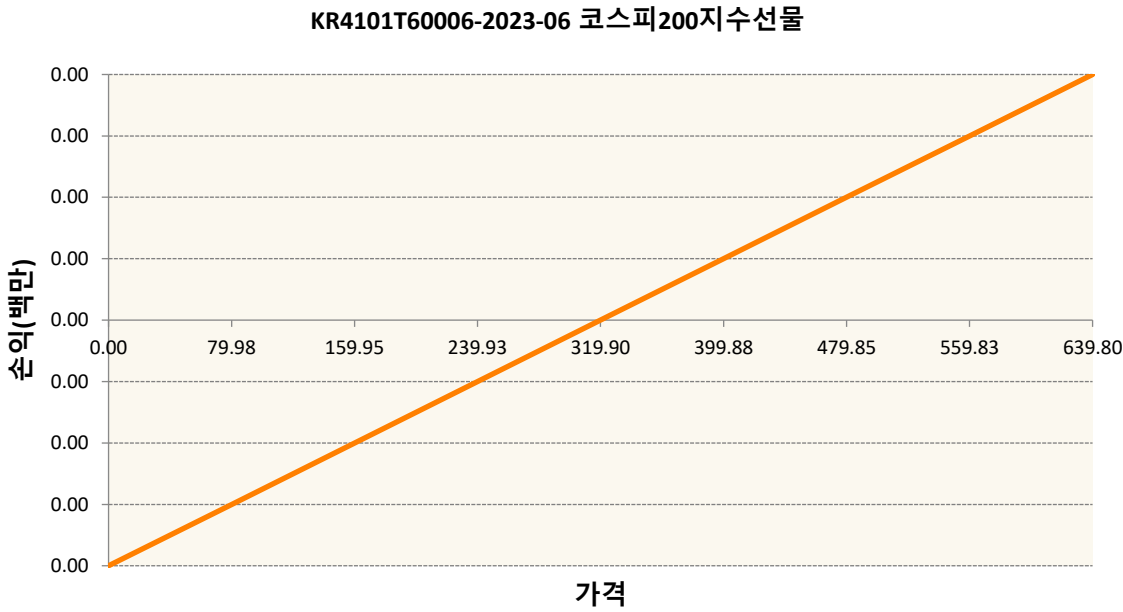
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

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	1,360	0	1,360	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101T60006			2023-06 코스피200지수선물				108
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-108	-108	-108	-108	-108	-108	-108
-5.33%	-72	-72	-72	-72	-72	-72	-72
-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%	72	72	72	72	72	72	72
8.00%	108	108	108	108	108	108	108

공시일	2023-03-31
기준일	2023-03-30

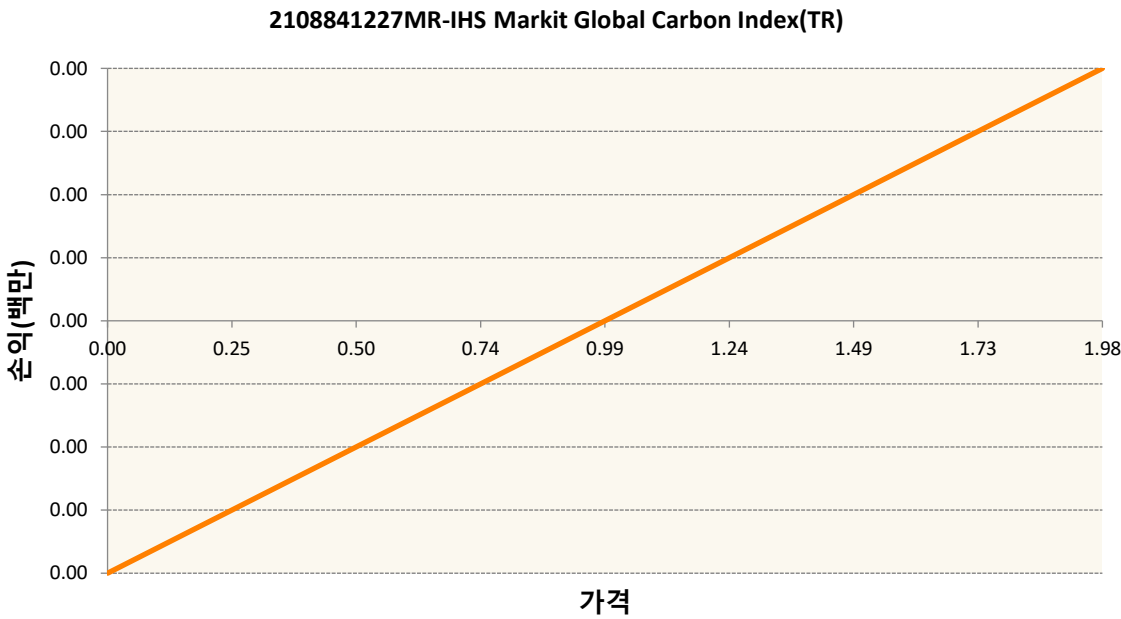
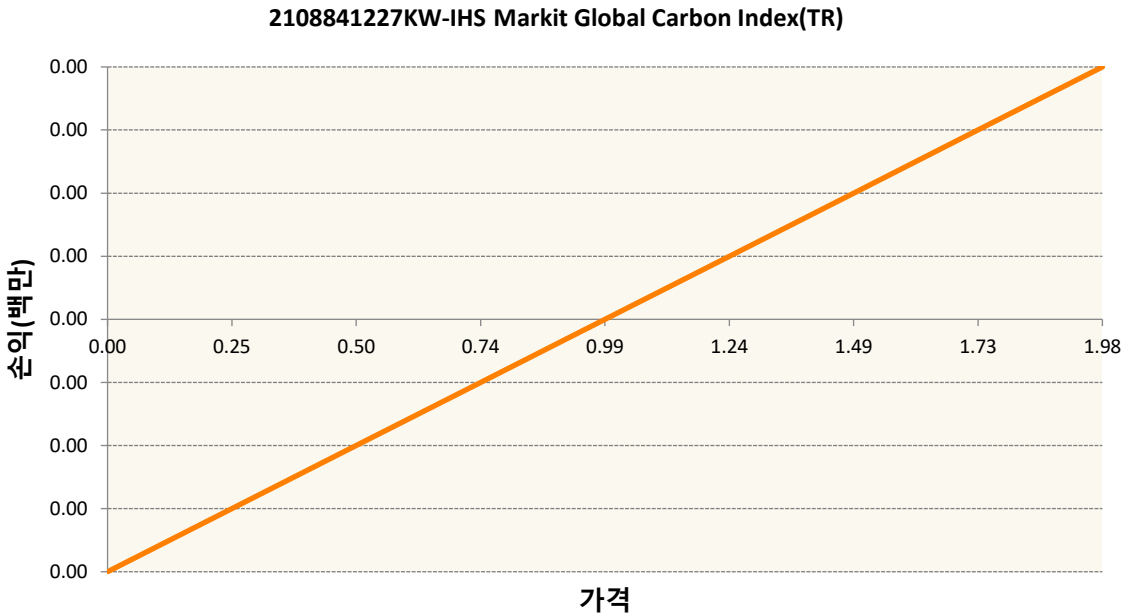
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

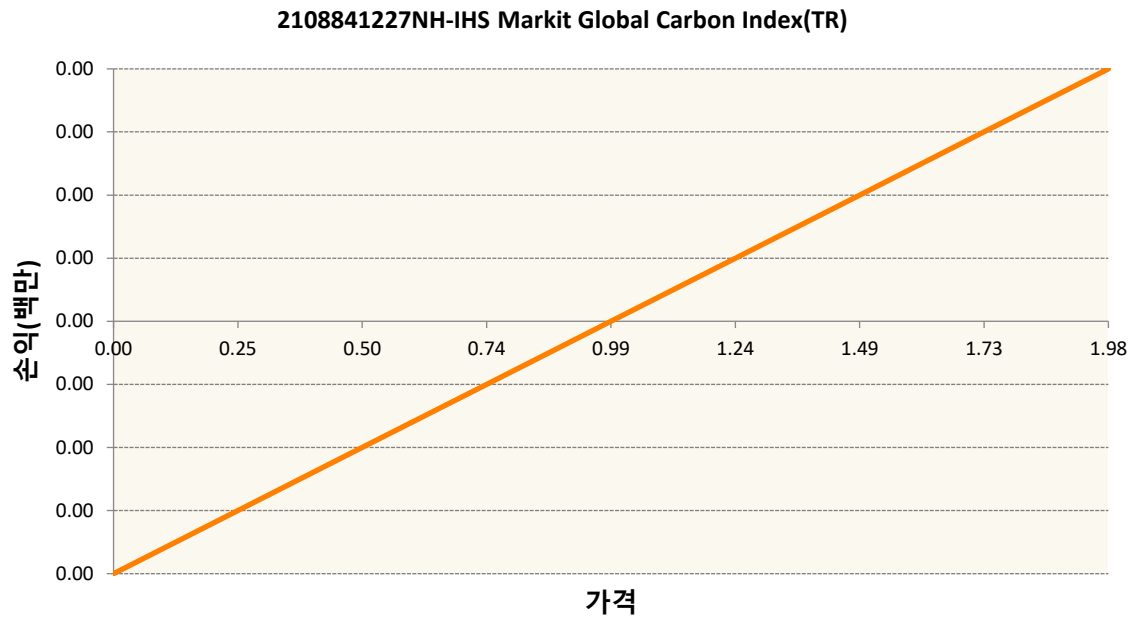
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	25,526	0	25,526	

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108841227IHS Markit Global Carbon Index(TR)		1,731
2108841227IHS Markit Global Carbon Index(TR)		204
2108841227IHS Markit Global Carbon Index(TR)		102

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)		(단위:백만원)
		3,860

공시일	2023-03-31
기준일	2023-03-30

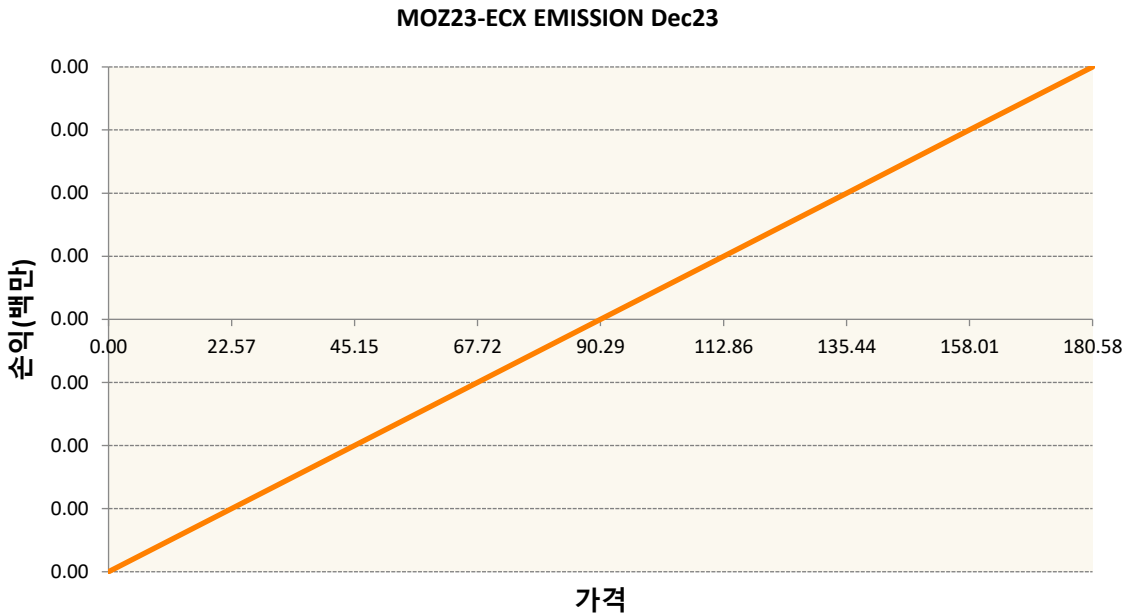
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	9,231	0	9,231	
누계	통화	선도	2,222	7,170	-4,948	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	44
FXW213D3H EUR/KRW 31-03-23E	47
FXW213D3Q KRW/EUR 31-03-23E	47
FXW213D3T(EUR/KRW 31-03-23E	42
FXW213D3W KRW/EUR 28-04-23E	62
FXW213D3W KRW/EUR 28-04-23E	62
FXW213D3W KRW/EUR 28-04-23E	62
MOZ23 ECX EMISSION Dec23	738

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

(단위:백만원)

2,488

공시일	2023-03-31
기준일	2023-03-30

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	9,237	0	9,237	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI00000 신한CSI Index 221222 (NH)	1
SWCSI00000 신한CSI Index 221222 (키움)	0.03
SWCSI00000 신한CSI Index 221222 (미래)	0.03
SWCSI00000 신한CSI Index 221222 (메리츠)	0.03

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

(단위:백만원)

1

공시일	2023-03-31
기준일	2023-03-30

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	9,595	0	9,595	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 230116(NH)	0.24
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 230116(메리츠)	0.34
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 230116(미래)	0.29
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 230116(키움)	0.24

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

(단위:백만원)

1

공시일	2023-03-31
기준일	2023-03-30

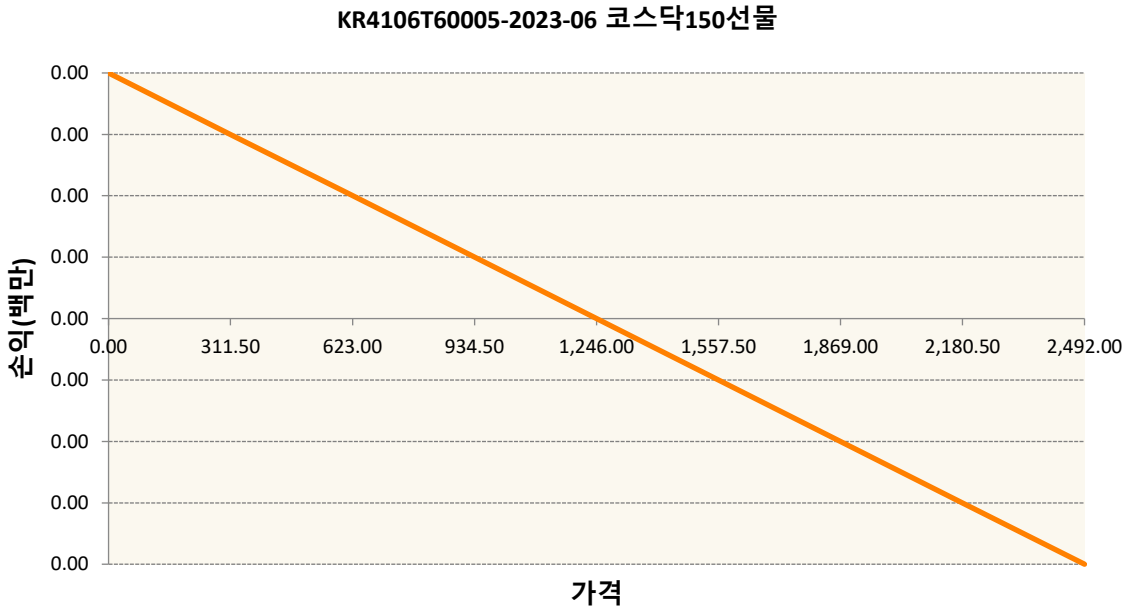
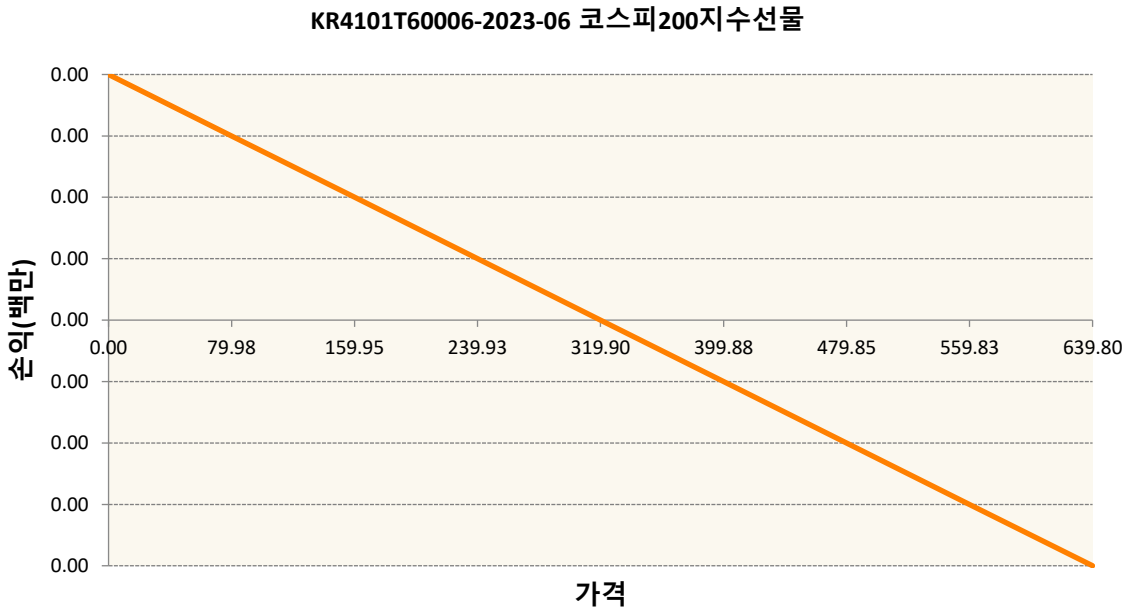
에퀴티알파일반사모혼합자산

1. 계약금액

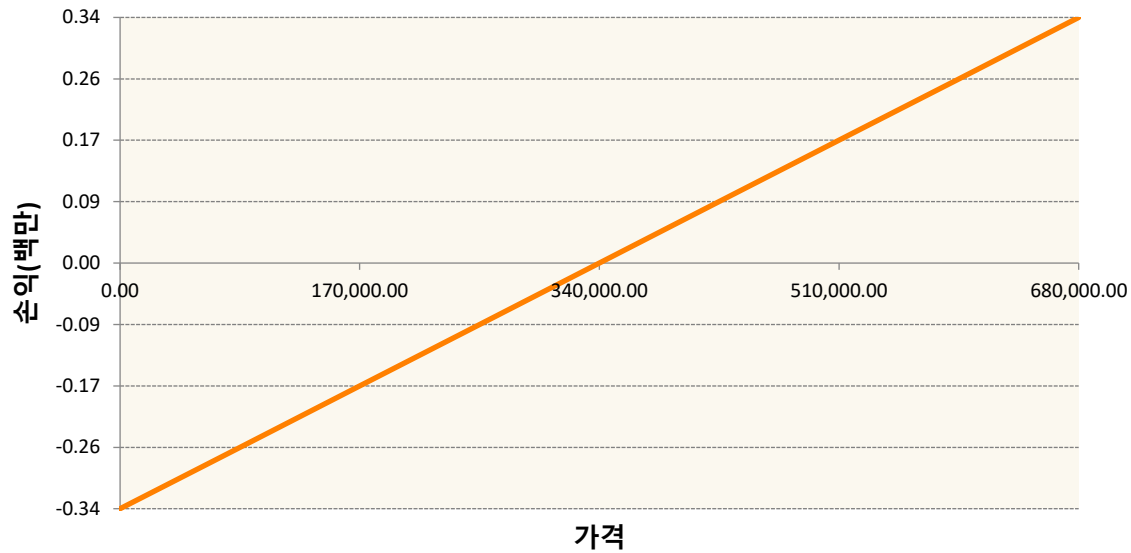
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	399	0	399	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	170	3,418	-3,248	장내
누계	유가증권	스왑	0	0	0	장외

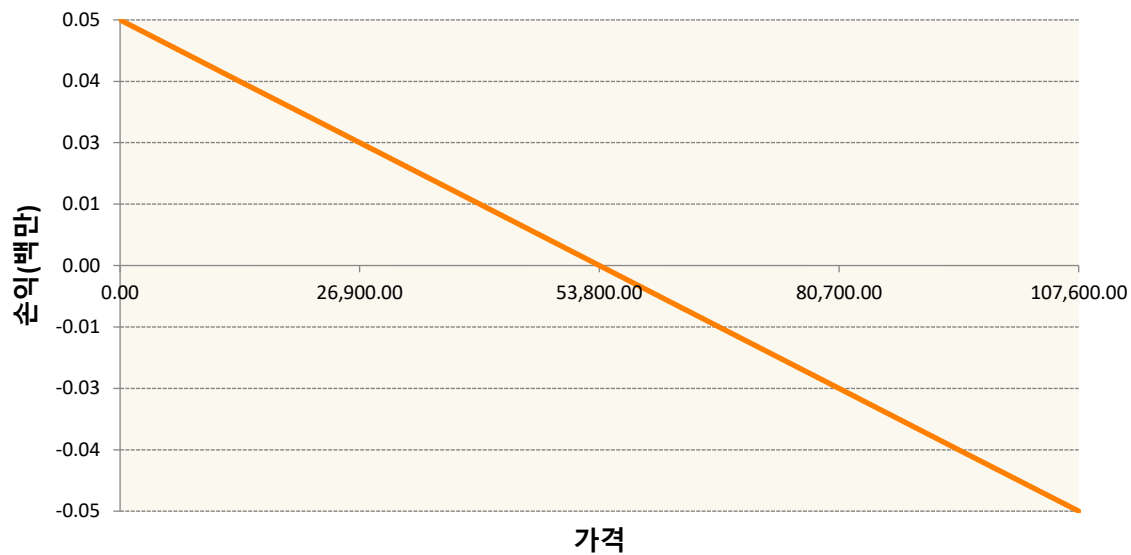
2. 만기시점의 손익구조



KR4113T40003-2023-04 POSCO홀딩스개별선물



KR41F7T40009-2023-04 카카오페이개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101T600 2023-06 코스피200지수선물	128
KR4106T600 2023-06 코스닥150선물	133
KR4113T400 2023-04 POSCO홀딩스개별선물	14
KR41F7T400 2023-04 카카오페이개별선물	13
KRS0004054 SWAP_MICROSOFT CP_0221	0.29
KRS0004054 SWAP_FIRST TRUST ECL_0221	0.13
KRS0004099 SWAP_MICRON TECH_0308	2

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

(단위:백만원)

447

공시일	2023-03-31
기준일	2023-03-30

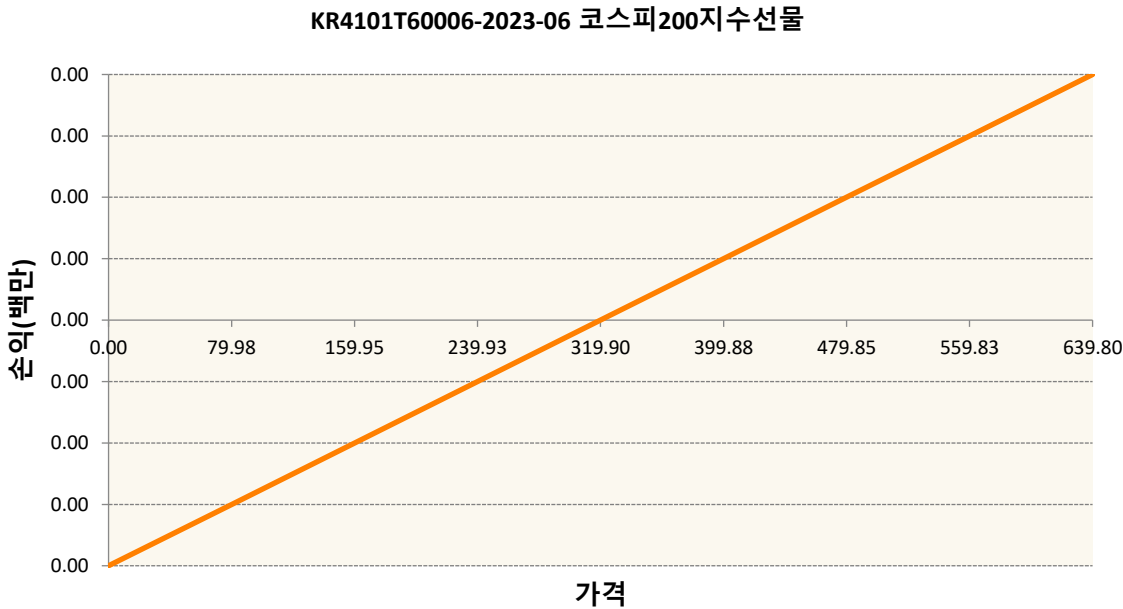
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

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	3,039	0	3,039	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101T60006			2023-06 코스피200지수선물				242
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-242	-242	-242	-242	-242	-242	-242
-5.33%	-161	-161	-161	-161	-161	-161	-161
-2.67%	-81	-81	-81	-81	-81	-81	-81
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	81	81	81	81	81	81	81
5.33%	161	161	161	161	161	161	161
8.00%	242	242	242	242	242	242	242

공시일	2023-03-31
기준일	2023-03-30

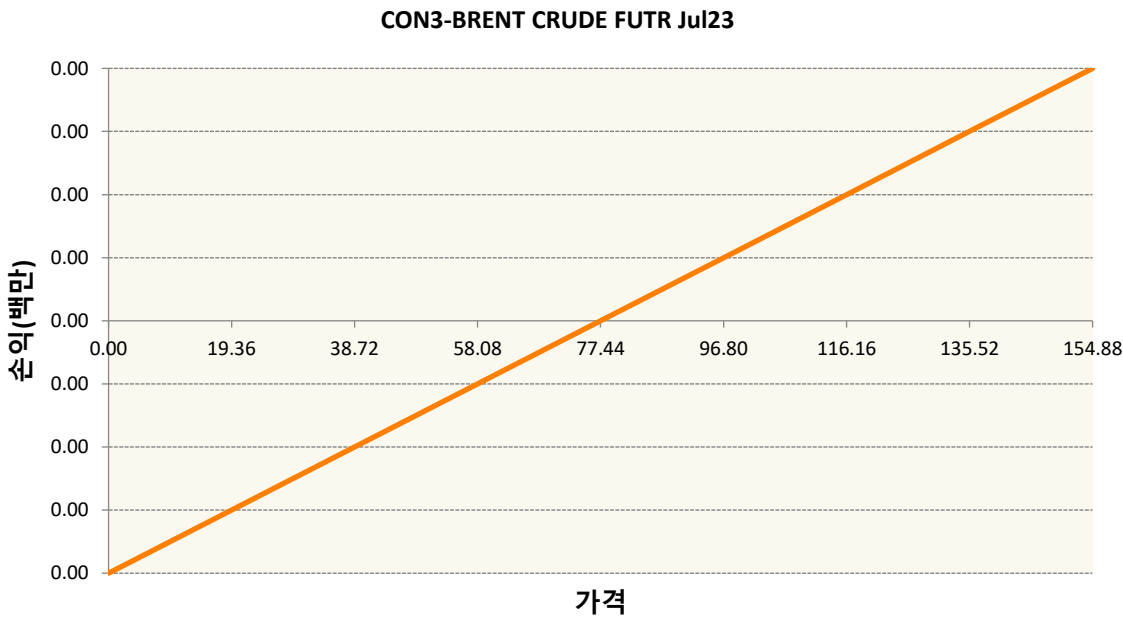
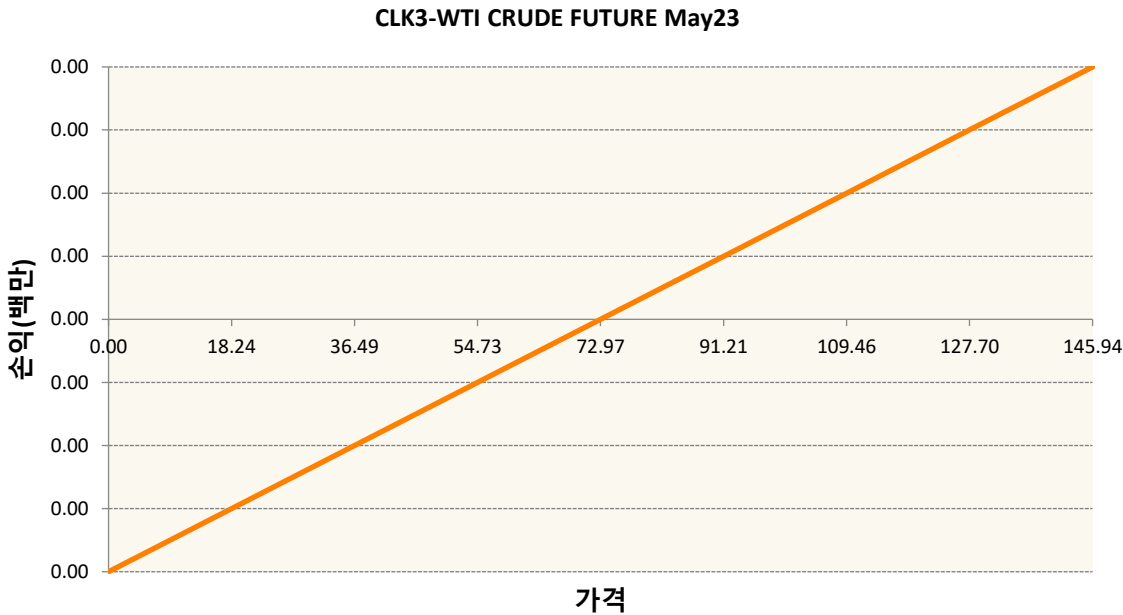
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

1. 계약금액

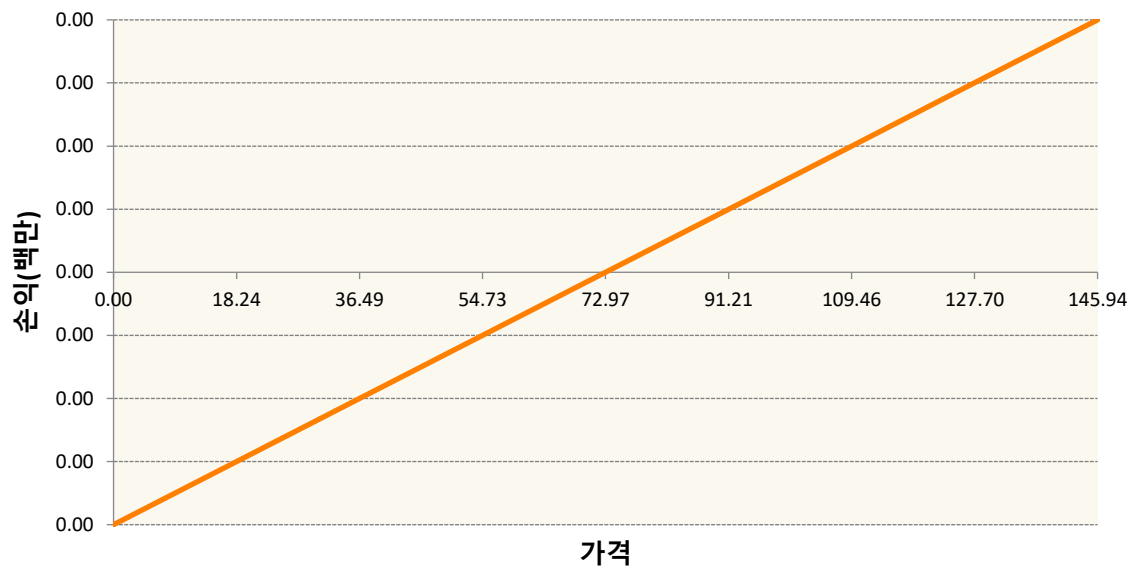
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,599	195	1,405	

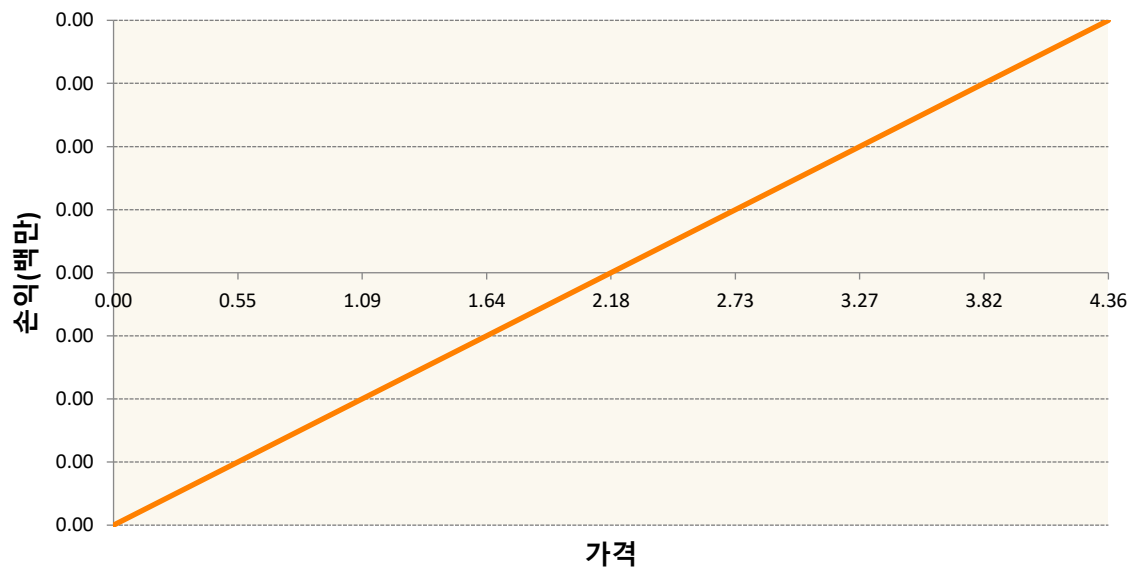
2. 만기시점의 손익구조



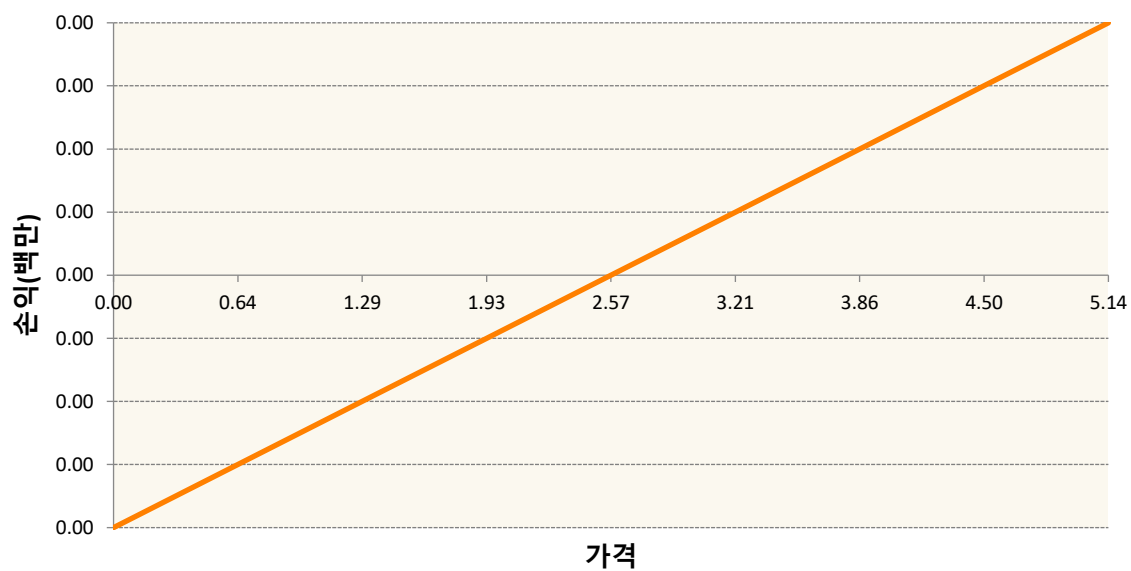
ECK3-E-mini Crude Oil May23



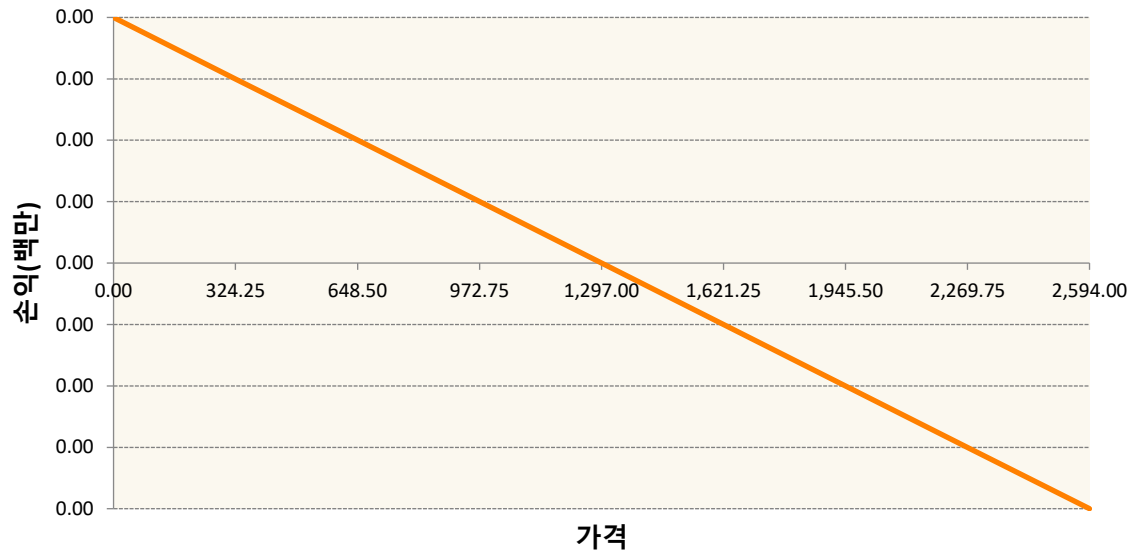
EOK3-E-MINI NATURAL GAS May23



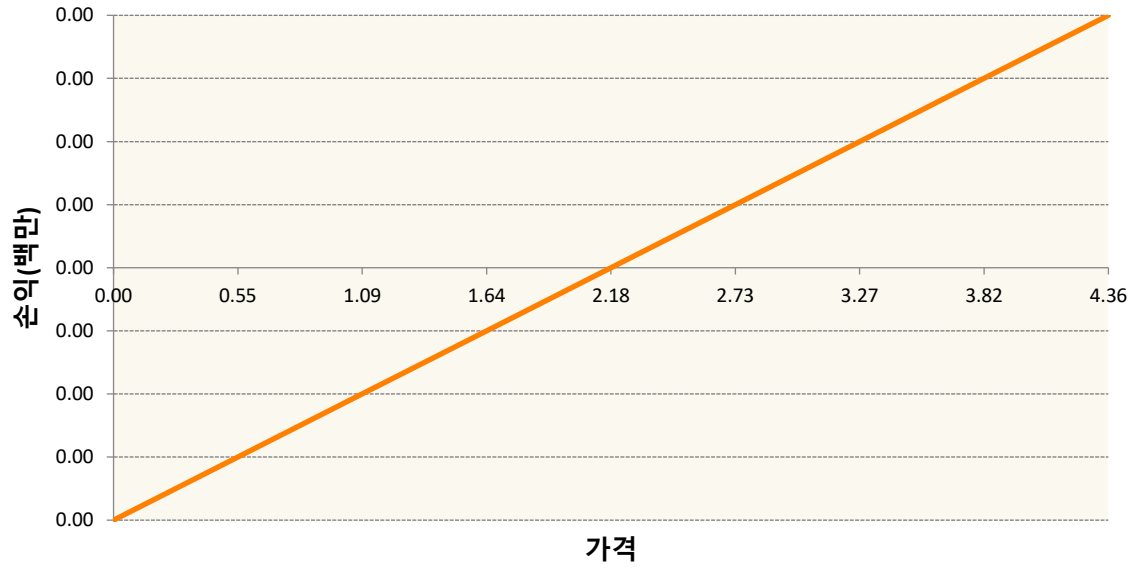
HOK3-NY Harb ULSD Fut May23



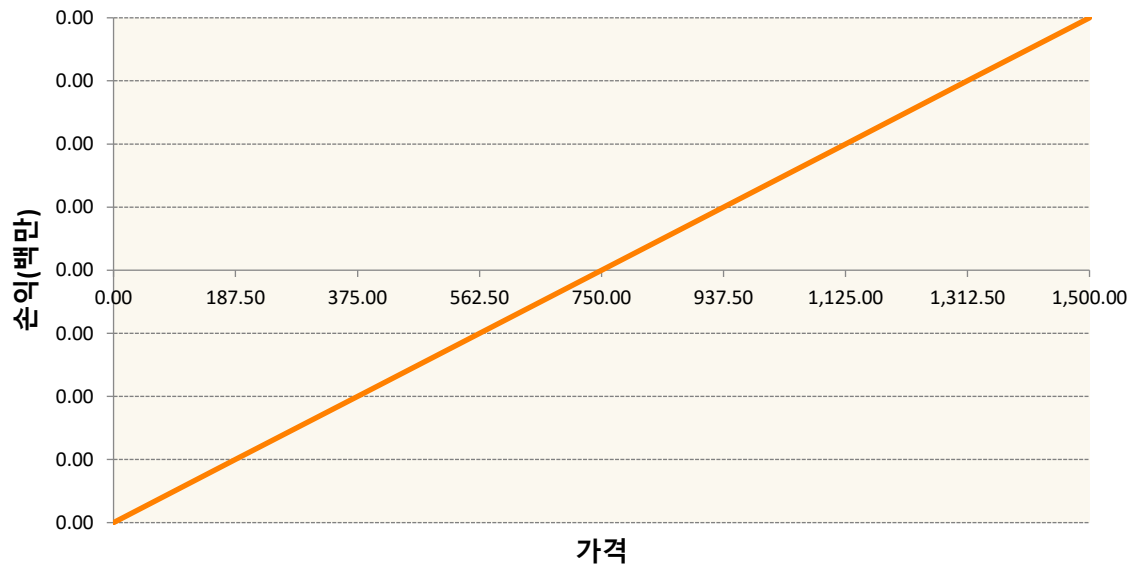
KR4175T40002-2023-04 달러선물

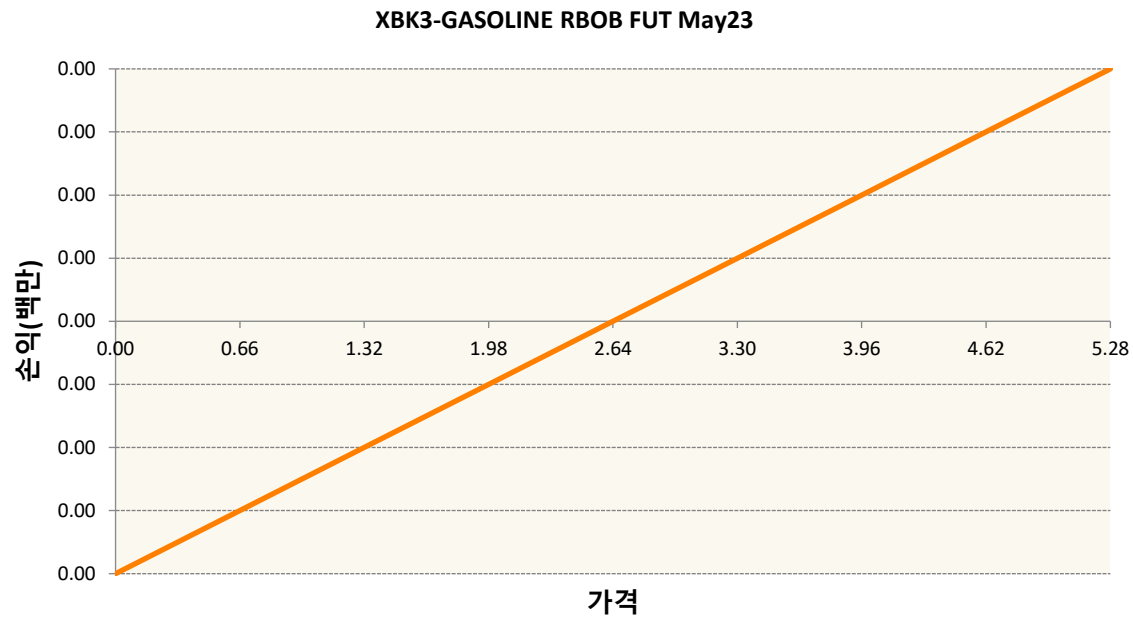


NGK23-NATURAL GAS FUTR May23



QSK3-Low Su Gasoil G May23





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
CLK3	WTI CRUDE FUTURE May23	30
CON3	BRENT CRUDE FUTR Jul23	33
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	22
QSK3	Low Su Gasoil G May23	15
XBK3	GASOLINE RBOB FUT May23	11

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