

공시일	2023-04-11
기준일	2023-04-10

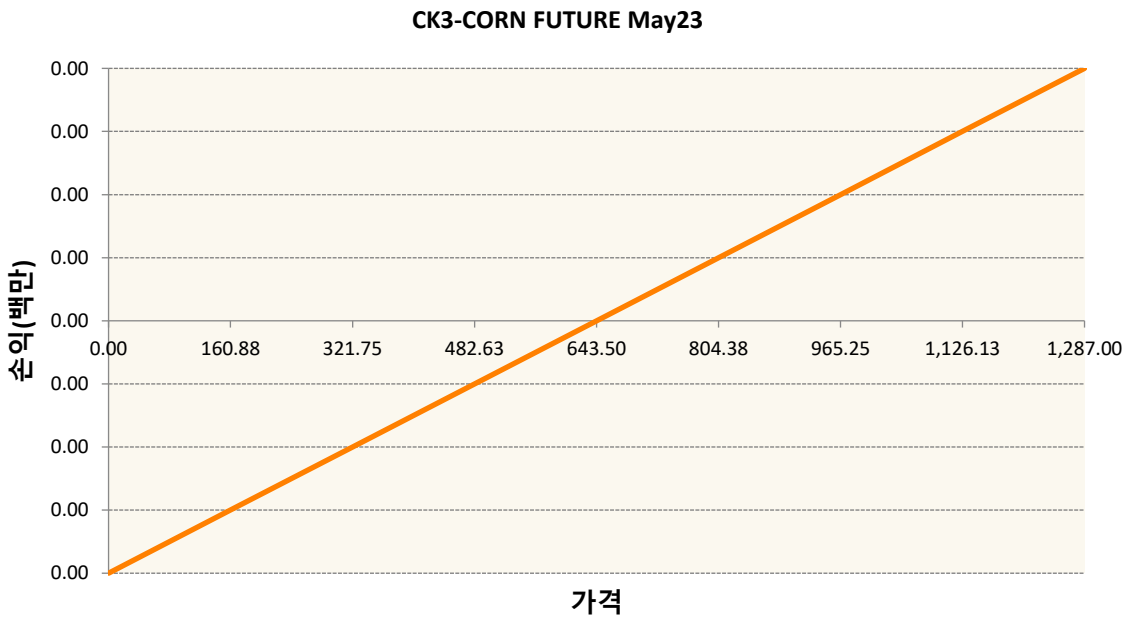
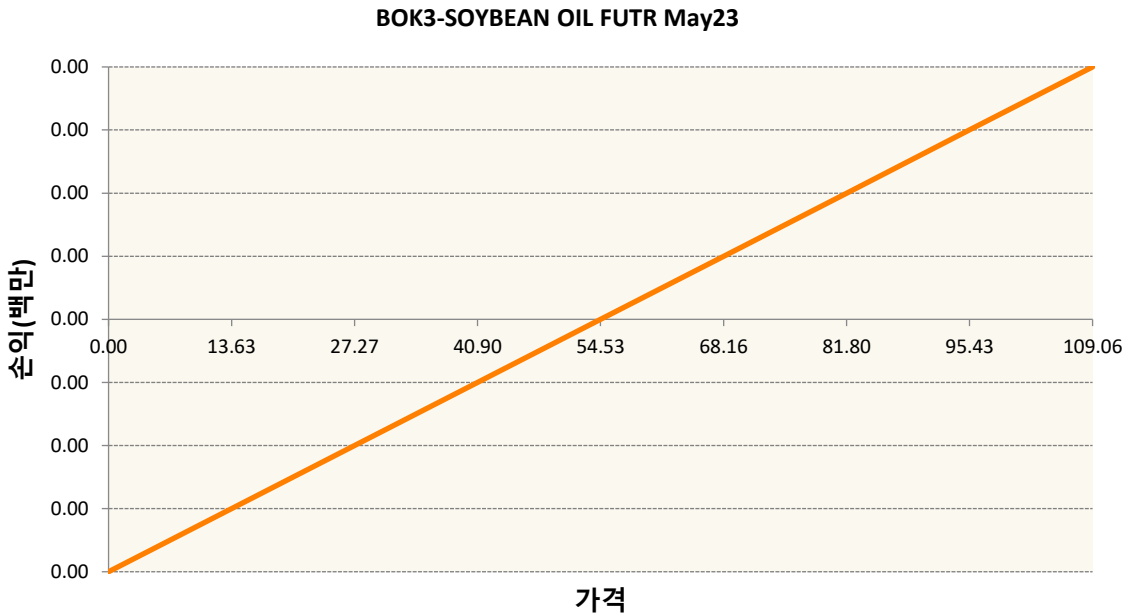
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

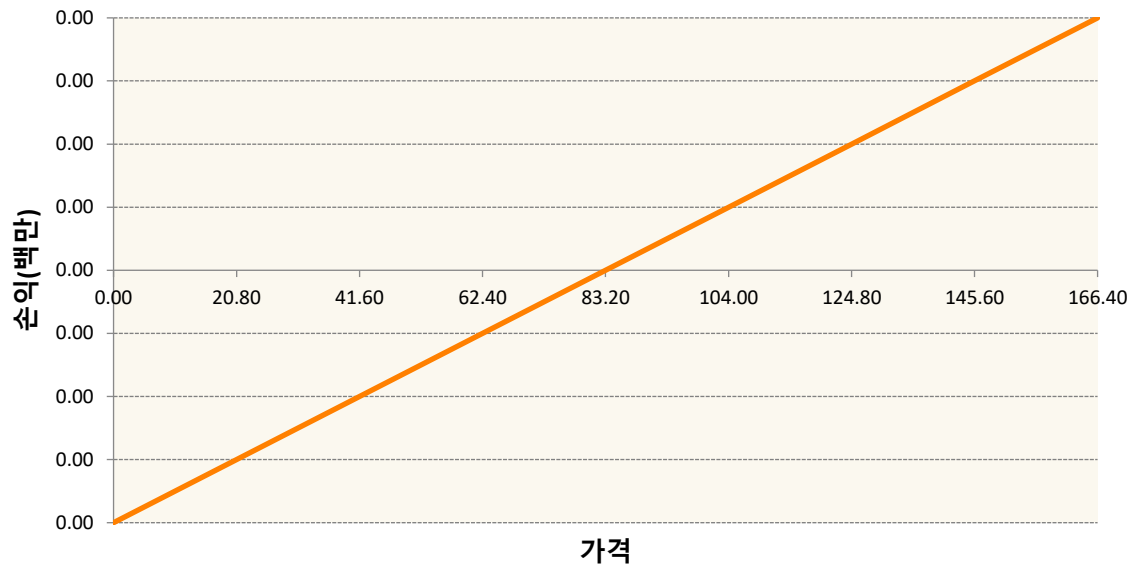
(단위:USD 백만)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,622	791	4,830	

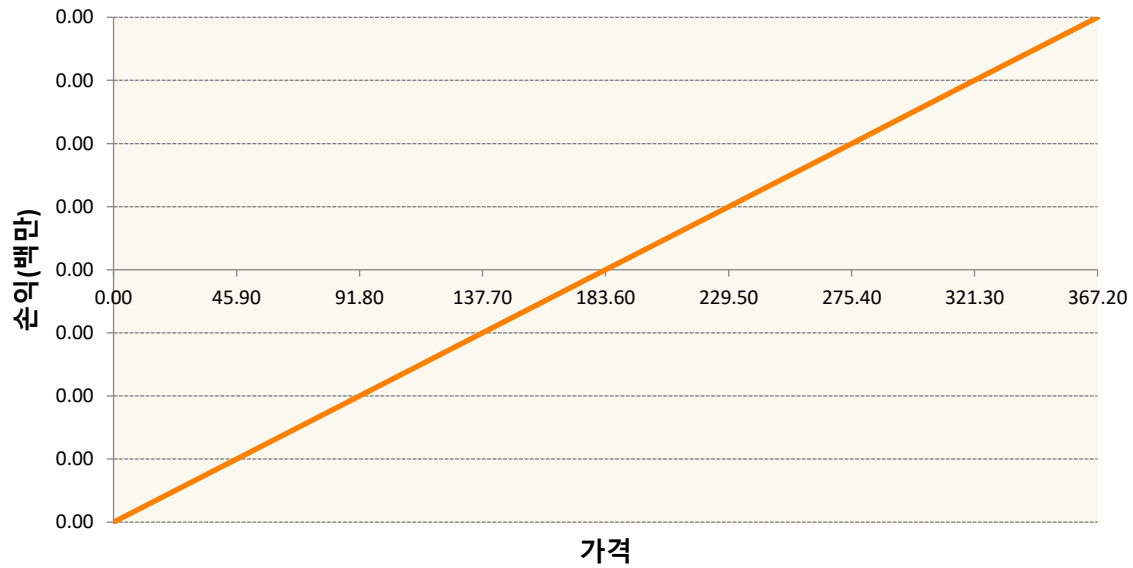
2. 만기시점의 손익구조



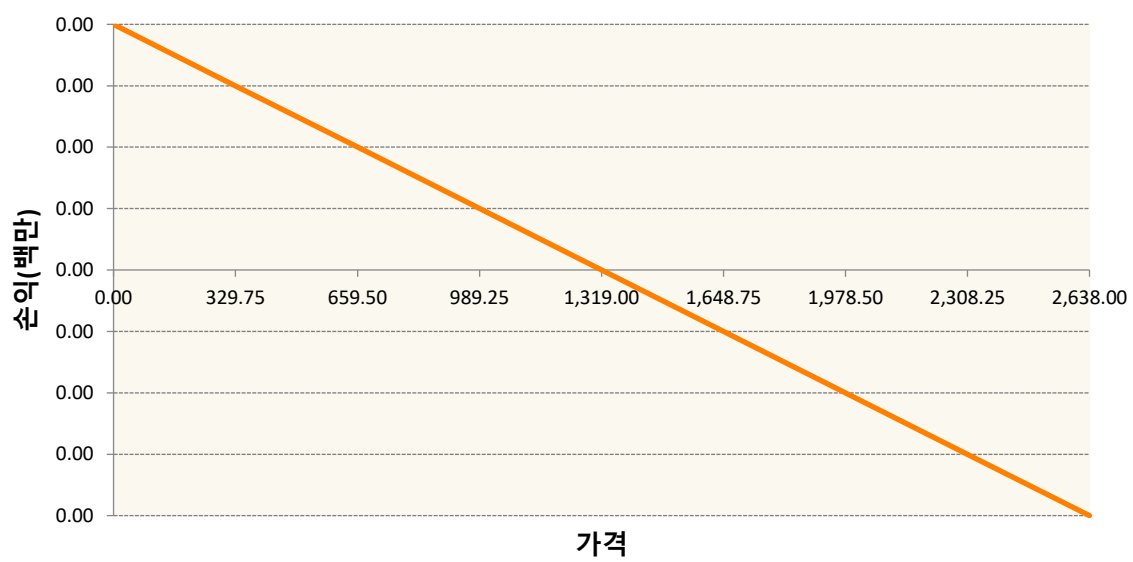
CTK3-COTTON NO.2 FUTR May23



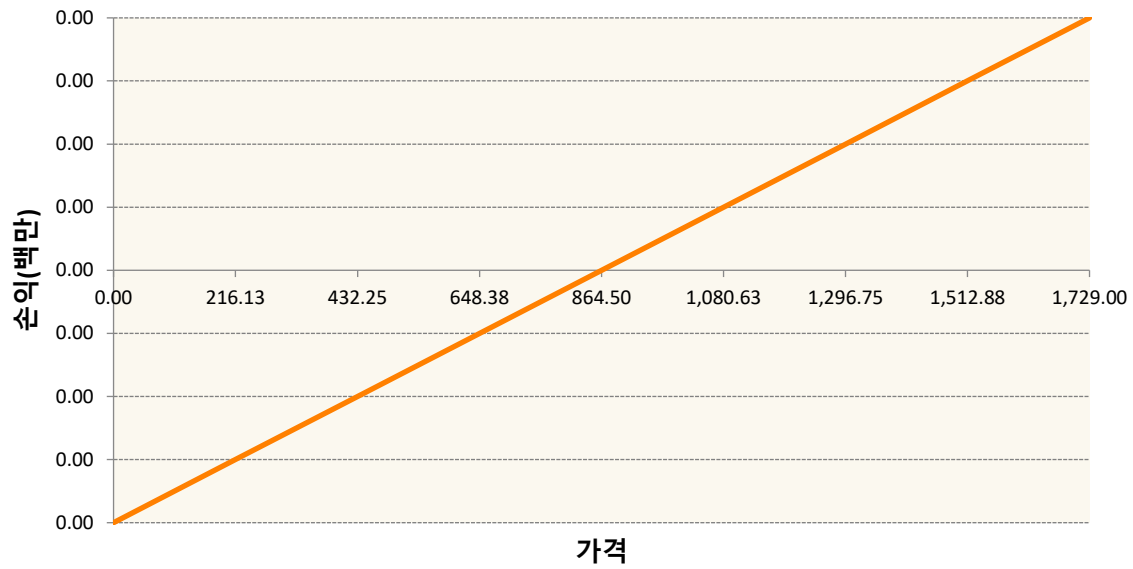
KCK3-COFFEE 'C' FUTURE May23



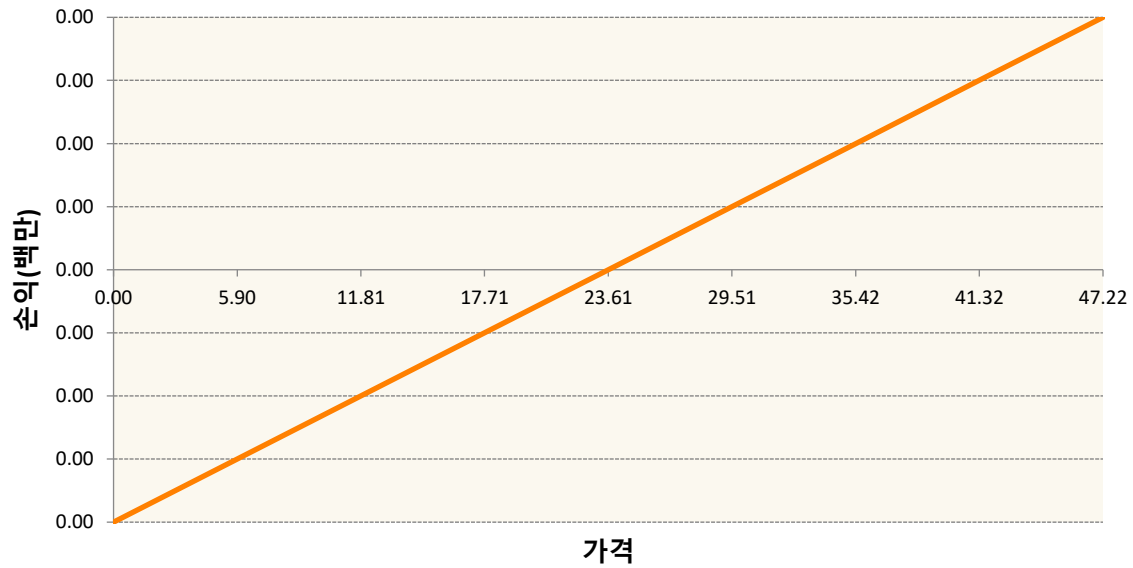
KR4175T40002-2023-04 달러선물



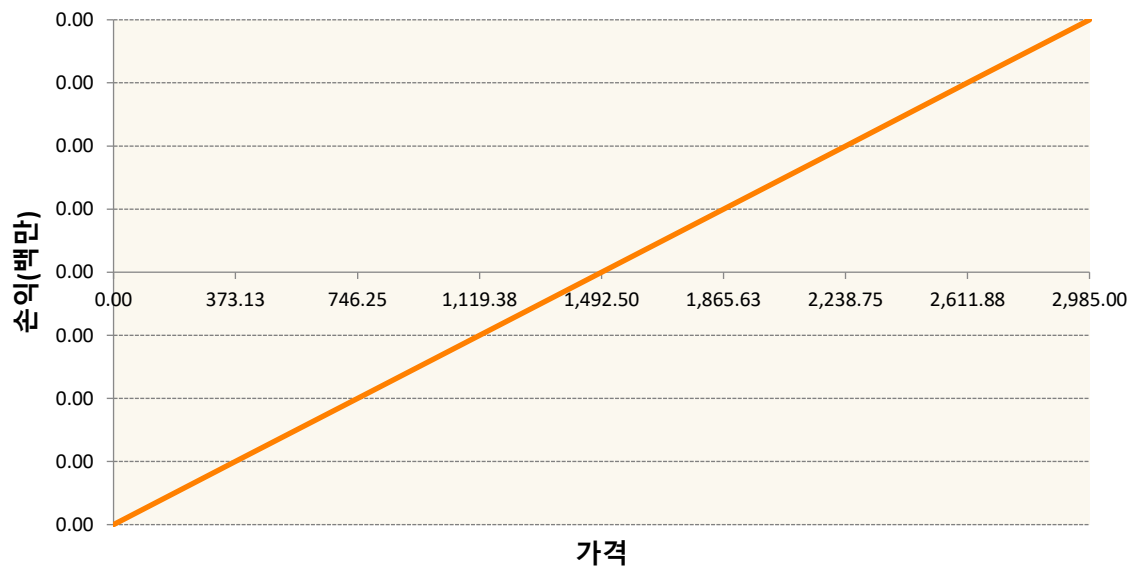
KWK3-KC HRW WHEAT FUT May23



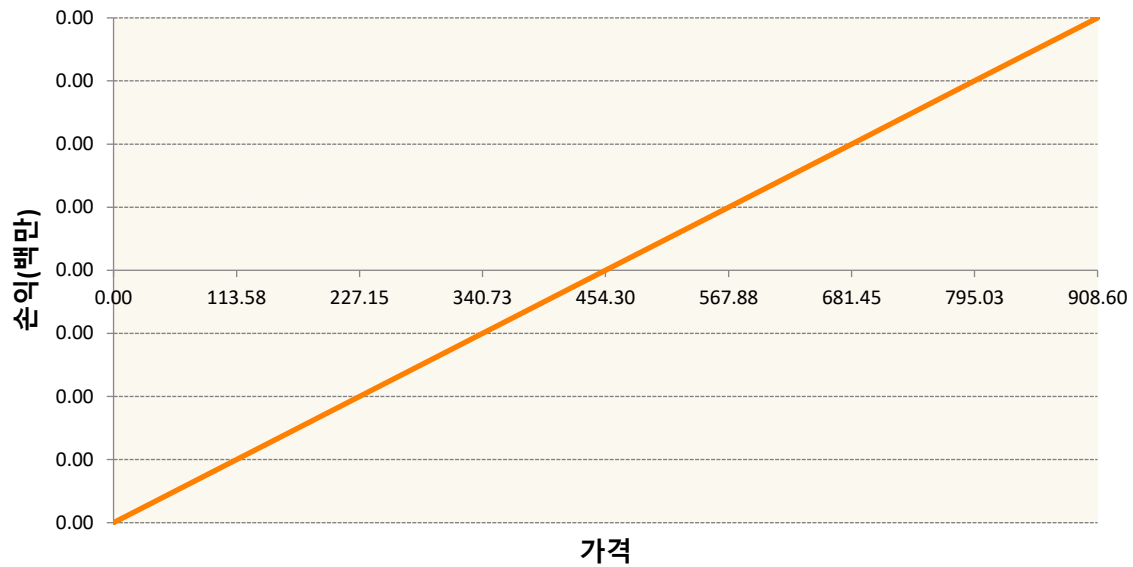
SBK3-Sugar #11 (WORLD) May23



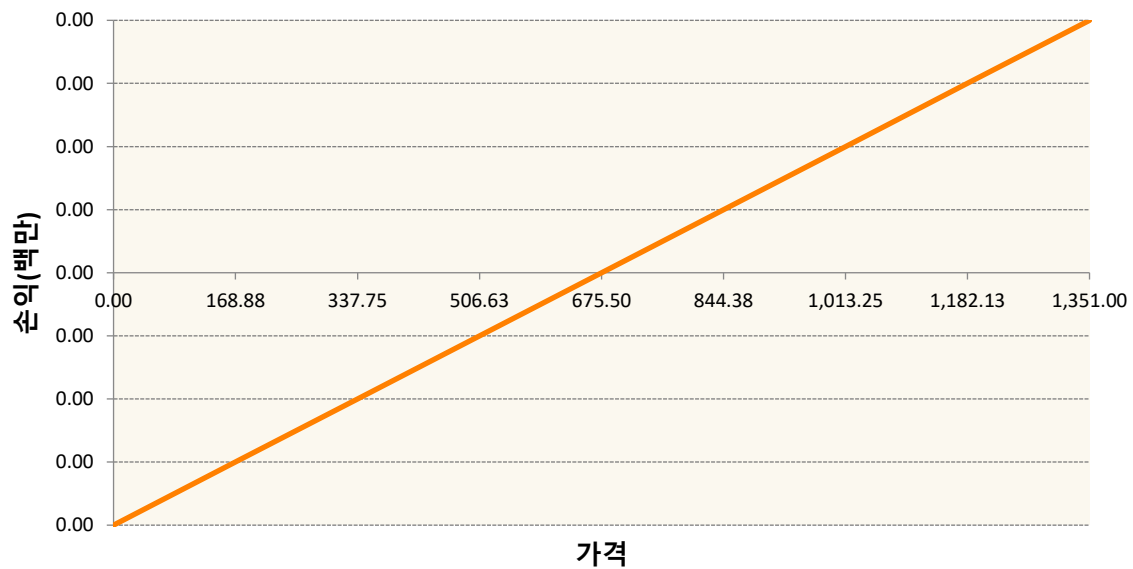
SK3-SOYBEAN FUTURE May23



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	2023-04-11
기준일	2023-04-10

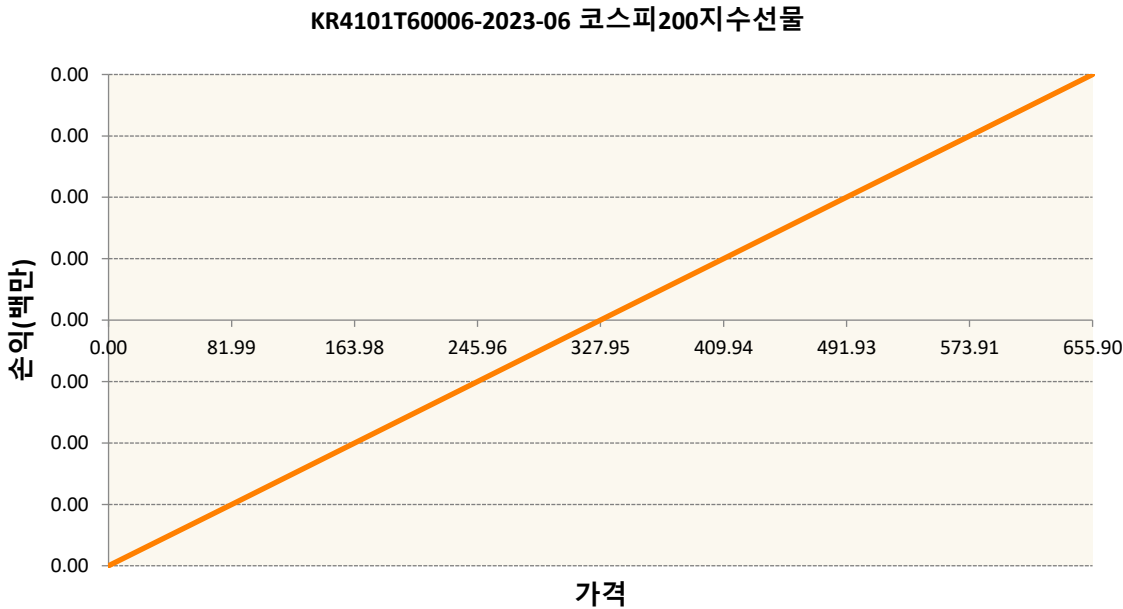
스마트인덱스모

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	164	-164	장내
누계	유가증권	선물	2,952	0	2,952	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101T60006		2023-06 코스피200지수선물					235
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-235	-235	-235	-235	-235	-235	-235
-5.33%	-157	-157	-157	-157	-157	-157	-157
-2.67%	-78	-78	-78	-78	-78	-78	-78
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	78	78	78	78	78	78	78
5.33%	157	157	157	157	157	157	157
8.00%	235	235	235	235	235	235	235

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

(단위:백만원)

256

공시일	2023-04-11
기준일	2023-04-10

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	378
-----------------------------	-----

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

657

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2023-04-11
기준일	2023-04-10

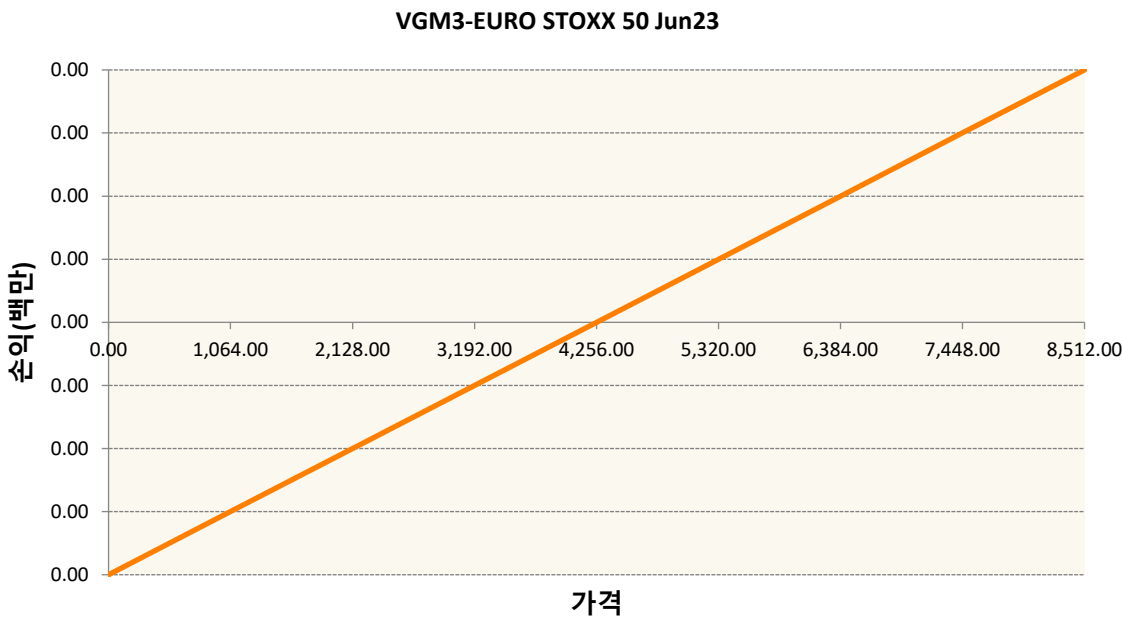
유로인덱스모(주식-파생형)

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	356	0	356	
누계	통화	선도	0	36	-36	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
FXW213D46(KRW/EUR 12-04-23E			3
VGM3	EURO STOXX 50 Jun23		29

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	52

공시일	2023-04-11
기준일	2023-04-10

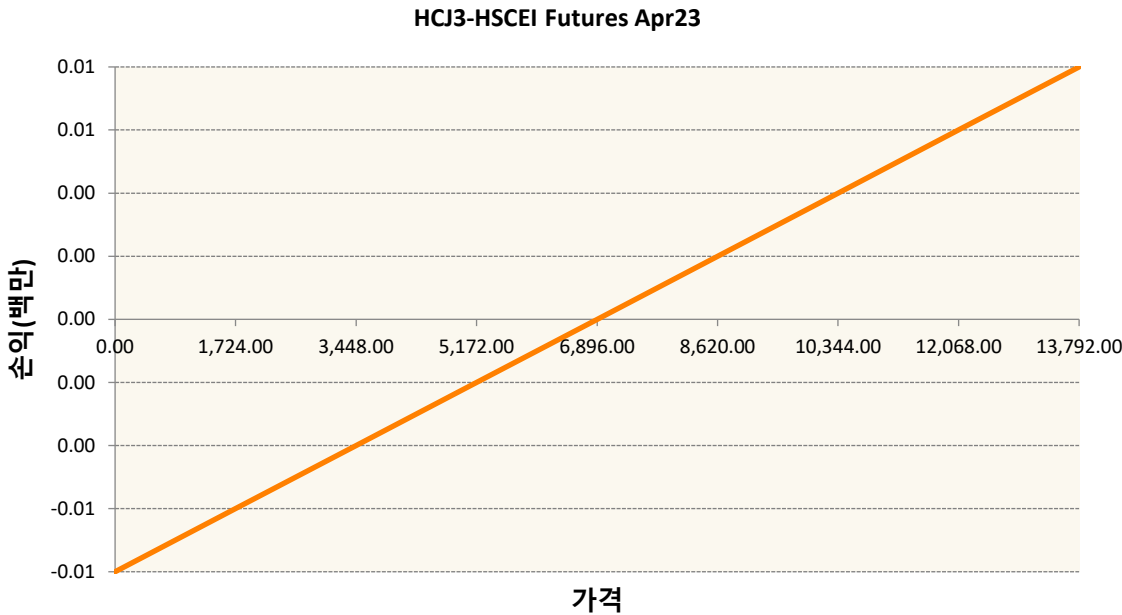
차이나인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,031	0	1,031	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCI3	HSCEI Futures Apr23	82
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

143

공시일	2023-04-11
기준일	2023-04-10

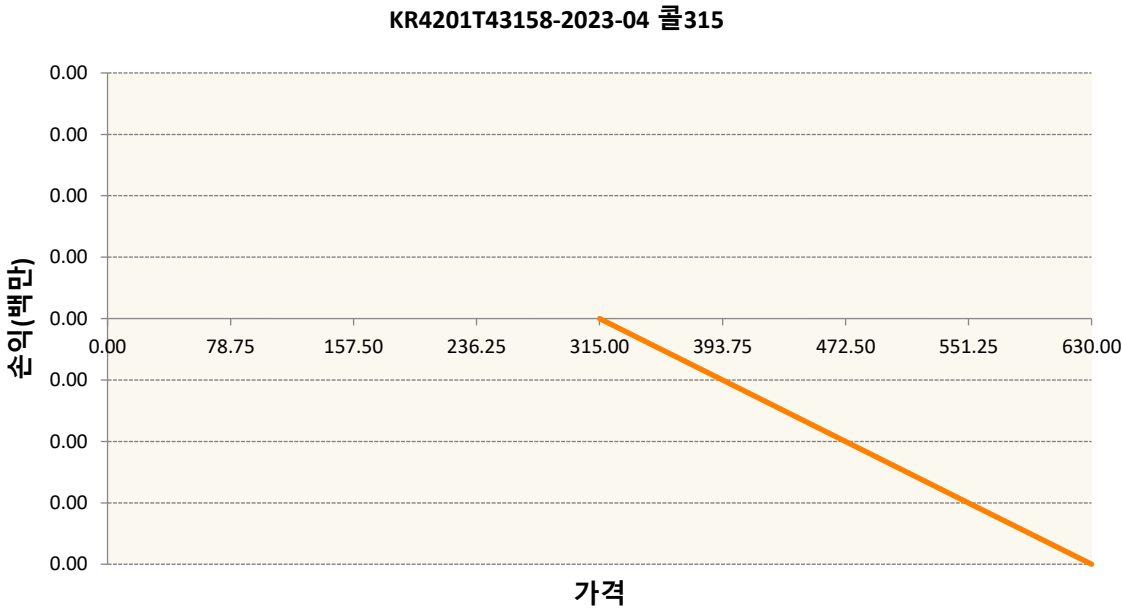
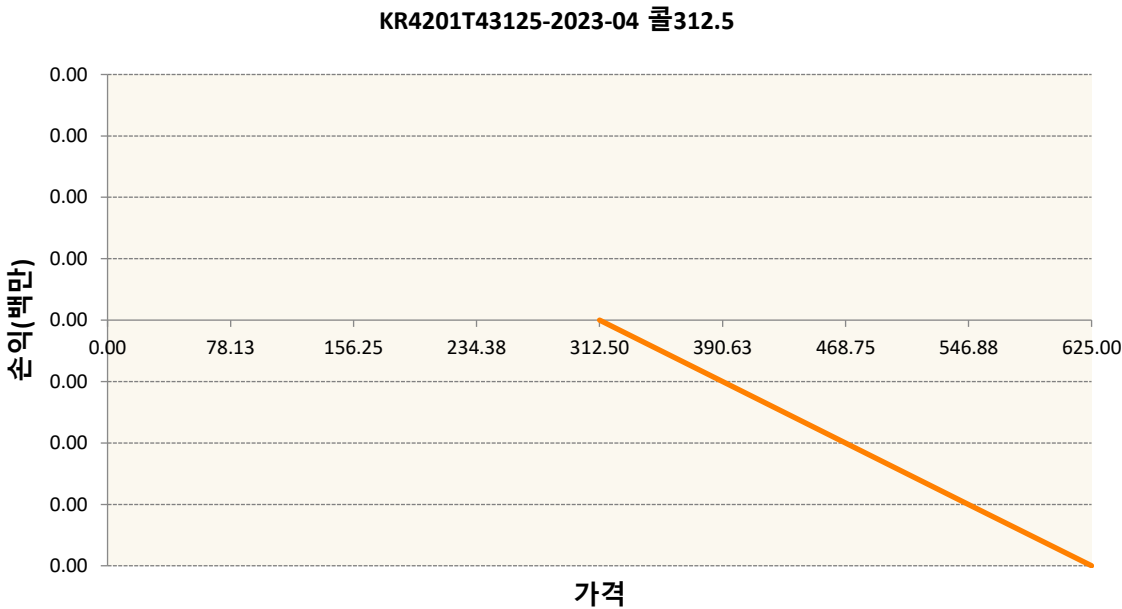
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

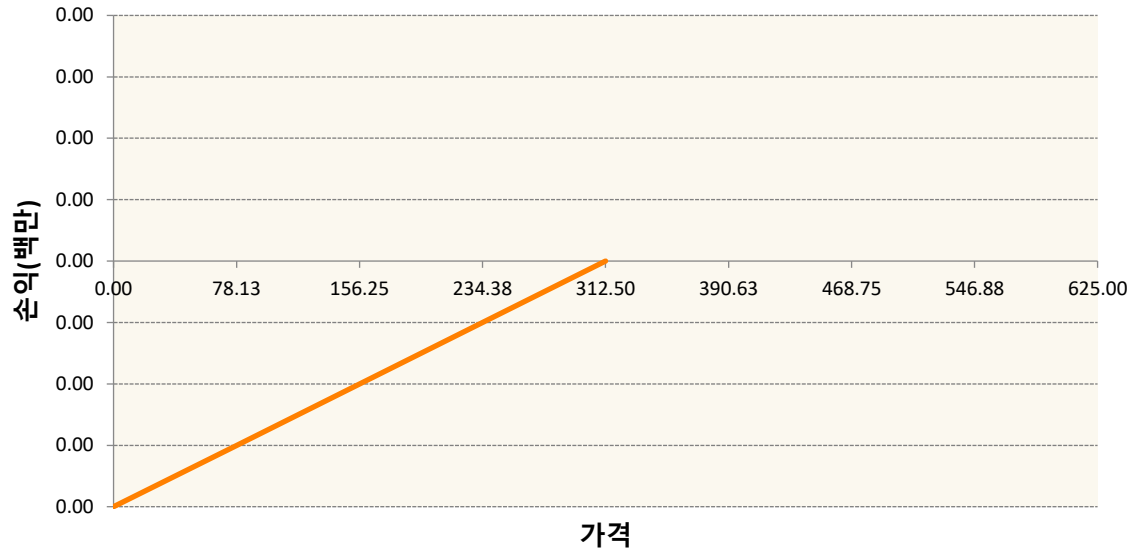
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	604	0	604	장내
누계	유가증권	옵션	0	54,485	-54,485	장내

2. 만기시점의 손익구조



KR4301T43123-2023-04 풋312.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201T43125 2023-04 콜312.5								934
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	505	504	502	499	496	492	488	
-5.33%	469	461	452	443	435	426	417	
-2.67%	295	288	280	273	264	256	248	
0%	5	4	2	0	-3	-6	-10	
2.67%	-308	-308	-308	-308	-308	-309	-310	
5.33%	-621	-621	-621	-621	-621	-621	-621	
8.00%	-934	-934	-934	-934	-934	-934	-934	
KR4201T43158 2023-04 콜315								2,762
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	1,233	1,232	1,231	1,229	1,226	1,222	1,217	
-5.33%	1,198	1,185	1,169	1,153	1,135	1,117	1,097	
-2.67%	835	812	790	766	743	719	695	
0%	15	11	6	0	-8	-17	-28	
2.67%	-909	-909	-909	-909	-910	-911	-913	
5.33%	-1,835	-1,835	-1,835	-1,835	-1,835	-1,835	-1,835	
8.00%	-2,762	-2,762	-2,762	-2,762	-2,762	-2,762	-2,762	
KR4301T43123 2023-04 풋312.5								389
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-374	-375	-377	-379	-382	-385	-389	
-5.33%	-136	-143	-150	-158	-165	-173	-181	
-2.67%	-16	-22	-28	-35	-42	-49	-56	
0%	4	3	2	0	-2	-5	-8	

2.67%	5	5	5	5	4	4	3
5.33%	5	5	5	5	5	5	5
8.00%	5	5	5	5	5	5	5

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

(단위:백만원)

4,381

공시일	2023-04-11
기준일	2023-04-10

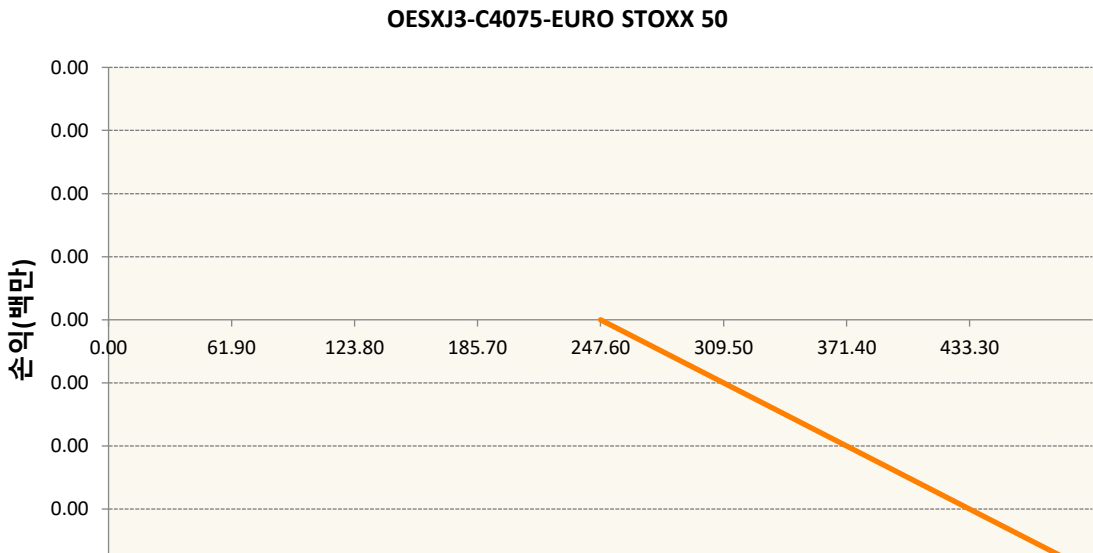
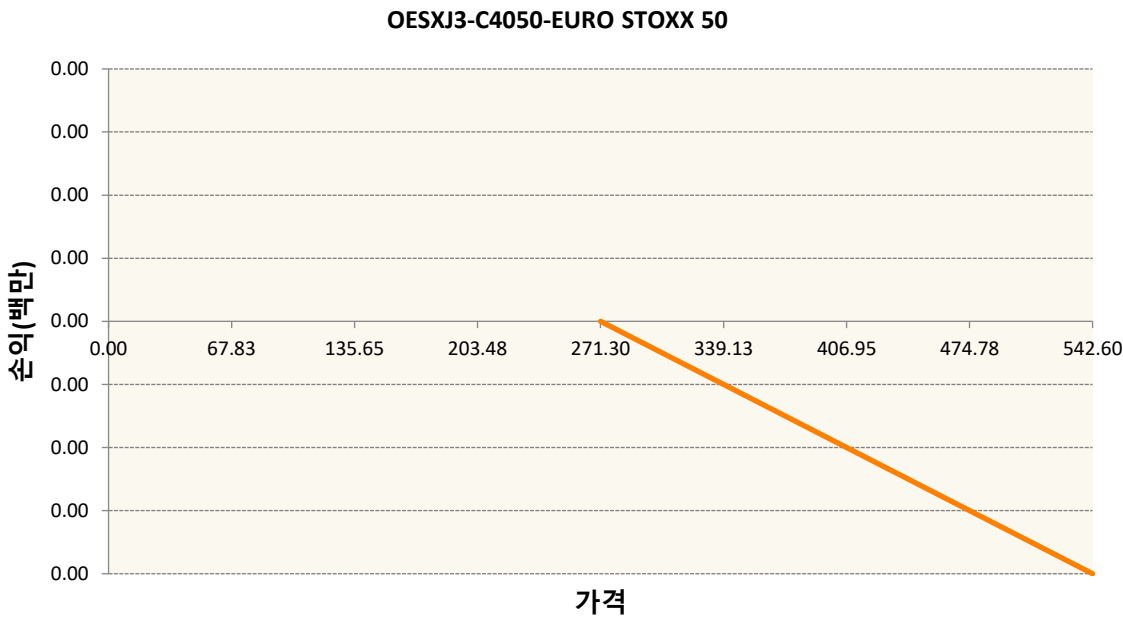
유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

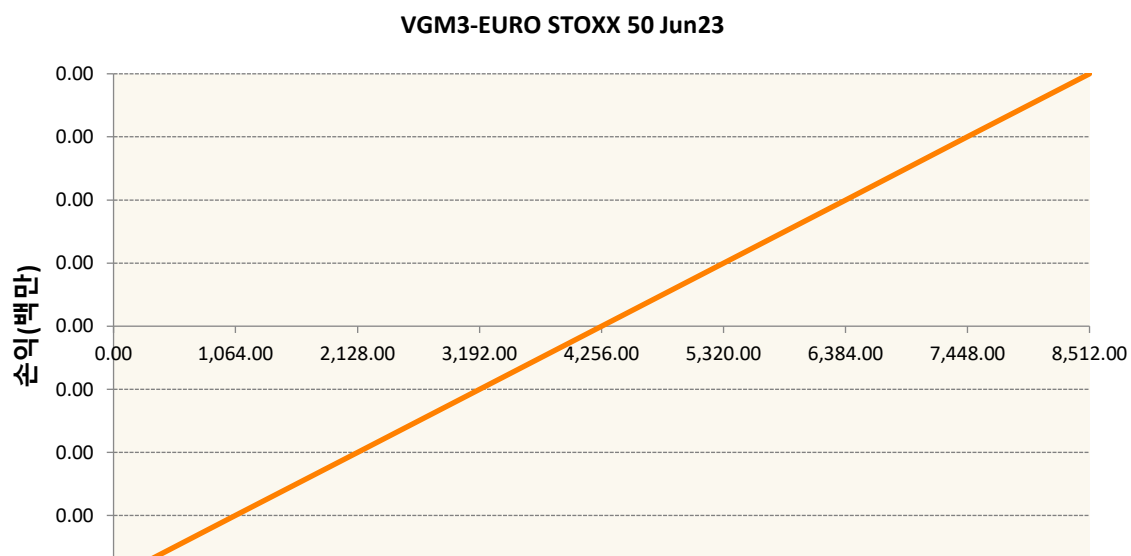
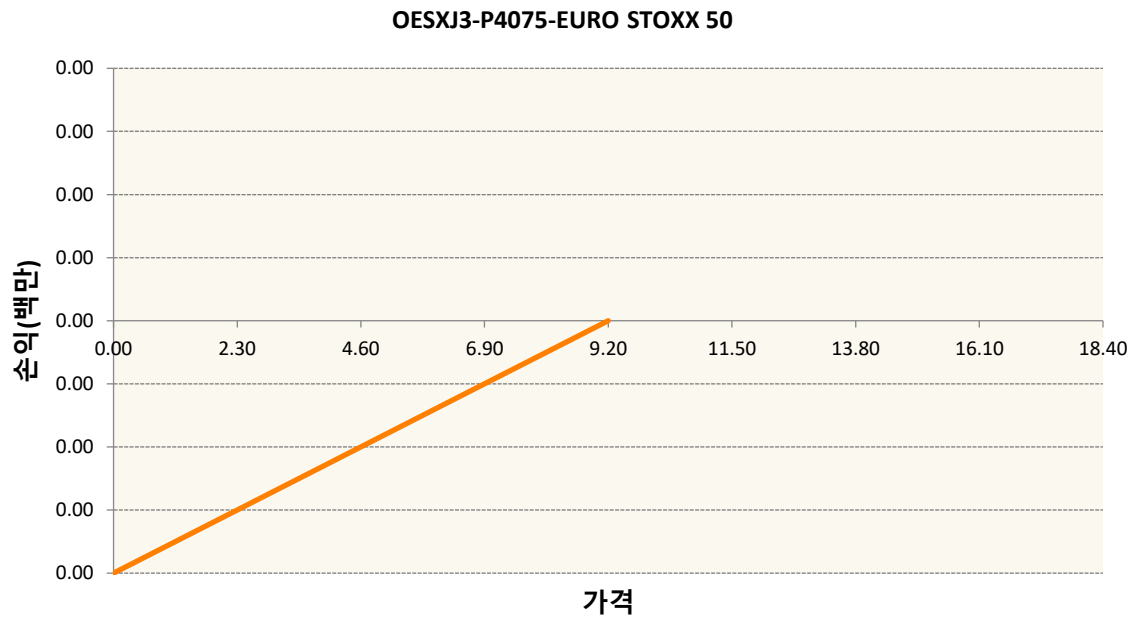
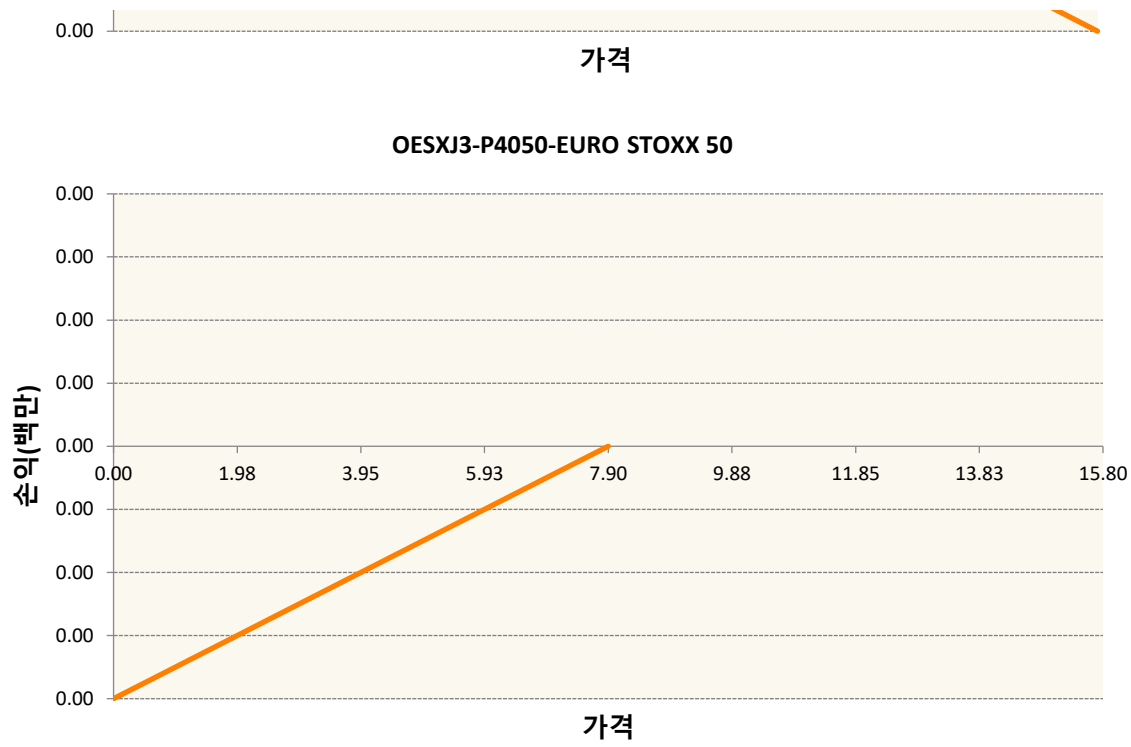
1. 계약금액

(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	950	0	950	
누계	유가증권	옵션	0	114	-114	장내
누계	통화	선도	0	1,726	-1,726	장외

2. 만기시점의 손익구조





0.00

가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213D1R KRW/EUR 28-04-23E	46
FXW213D2N KRW/EUR 26-05-23E	46
FXW213D3N KRW/EUR 28-04-23E	46
OESXJ3-C40! EURO STOXX 50	4
OESXJ3-C40! EURO STOXX 50	5
OESXJ3-P40! EURO STOXX 50	0.09
OESXJ3-P40! EURO STOXX 50	0.16
VGM3 EURO STOXX 50 Jun23	76

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

(단위:백만원)

257

공시일	2023-04-11
기준일	2023-04-10

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

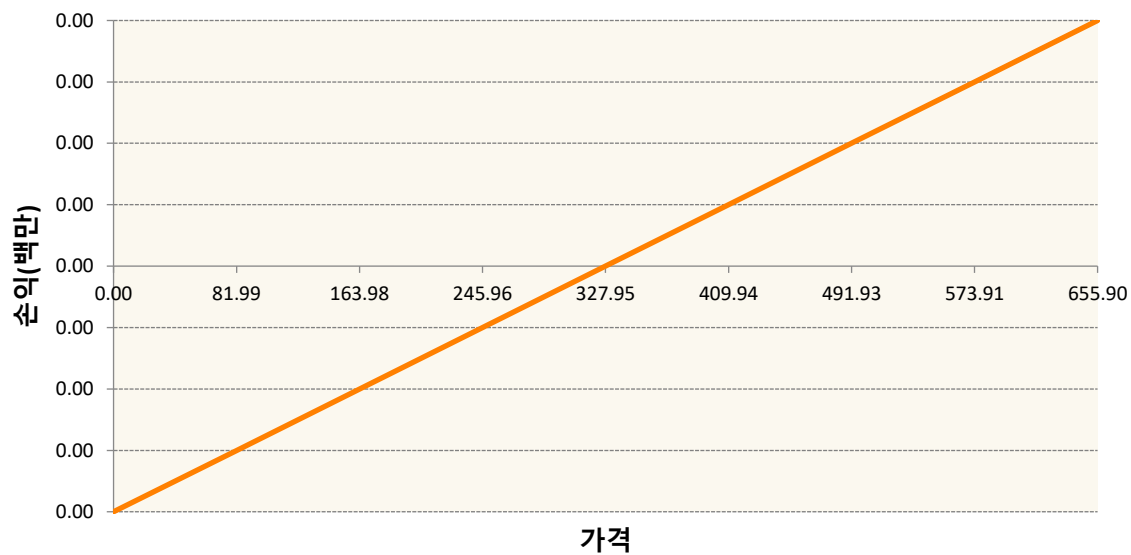
1. 계약금액

(단위:백만원)

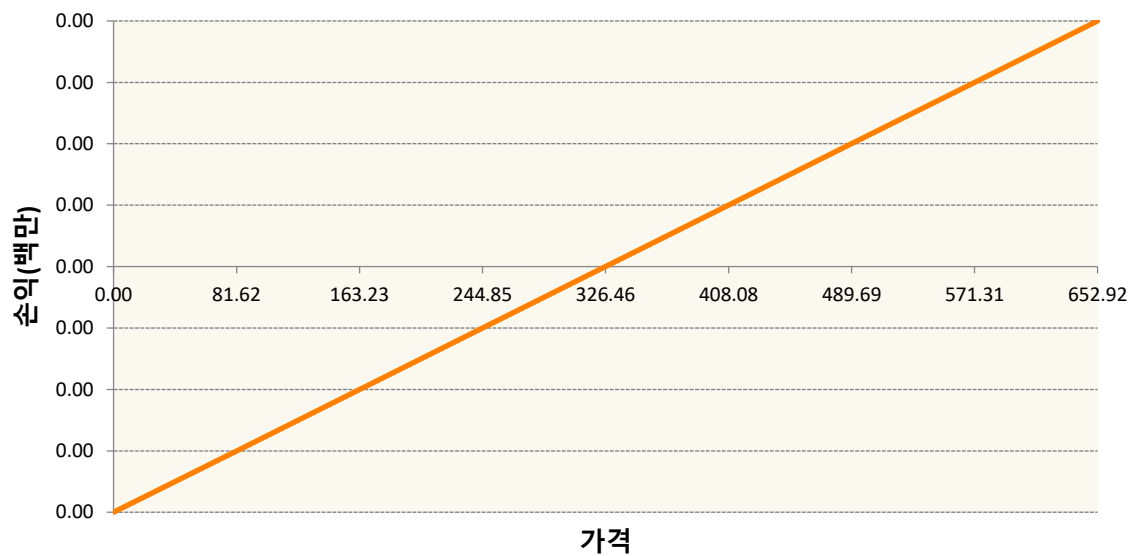
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	245	0	245	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,063	0	1,063	장내
누계	유가증권	옵션	157	3,874	-3,718	장내

2. 만기시점의 손익구조

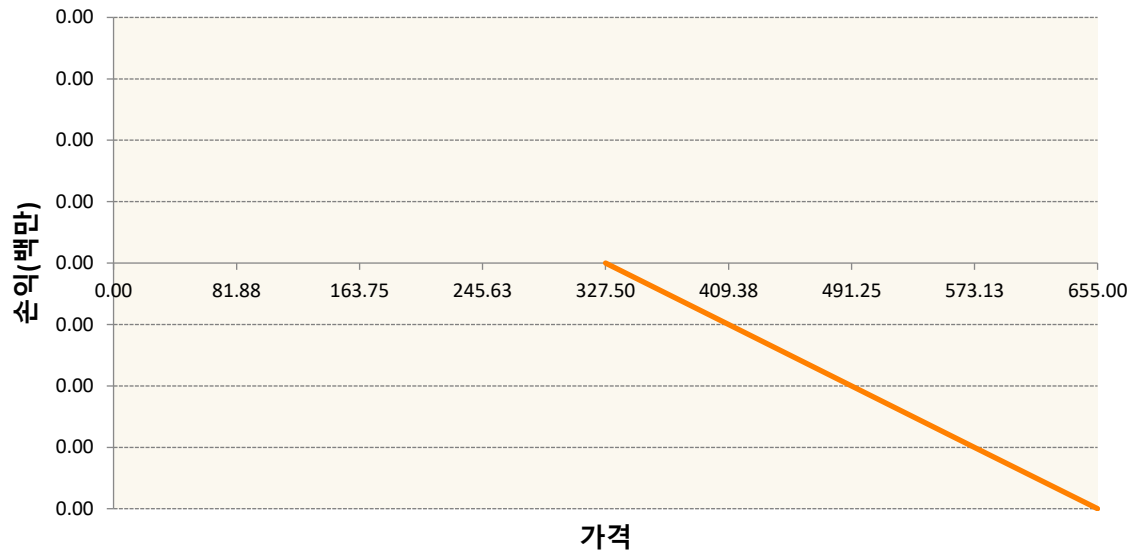
KR4101T60006-2023-06 코스피200지수선물



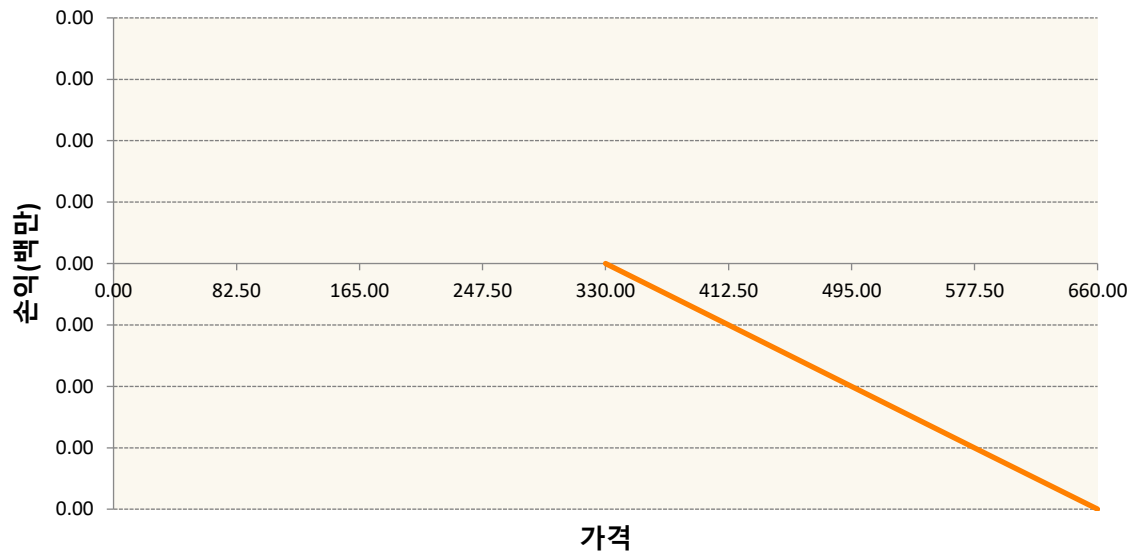
KR4105T40009-2023-04 미니코스피200 선물



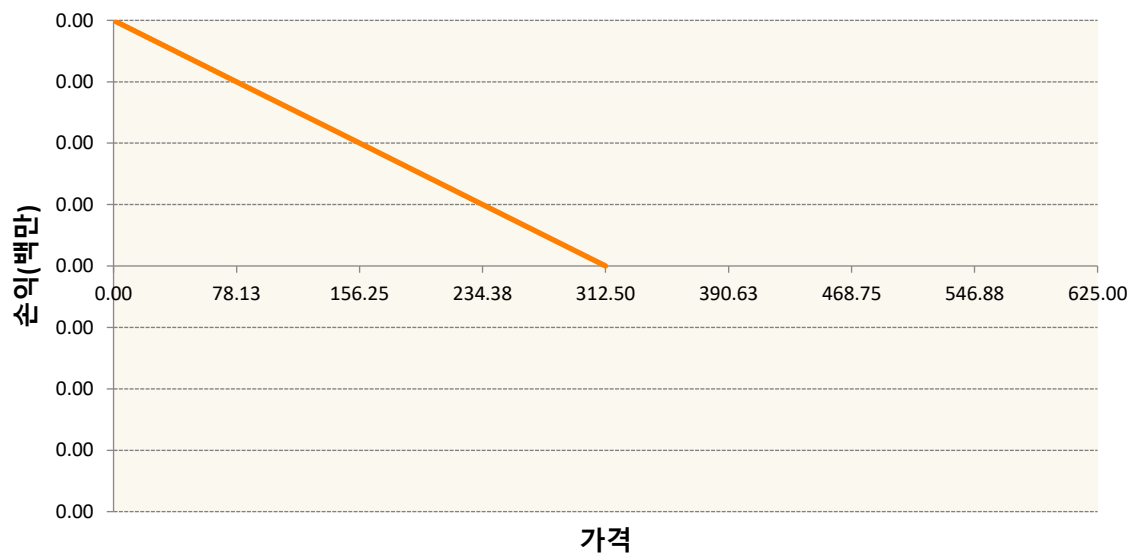
KR4201T43273-2023-04 콜327.5



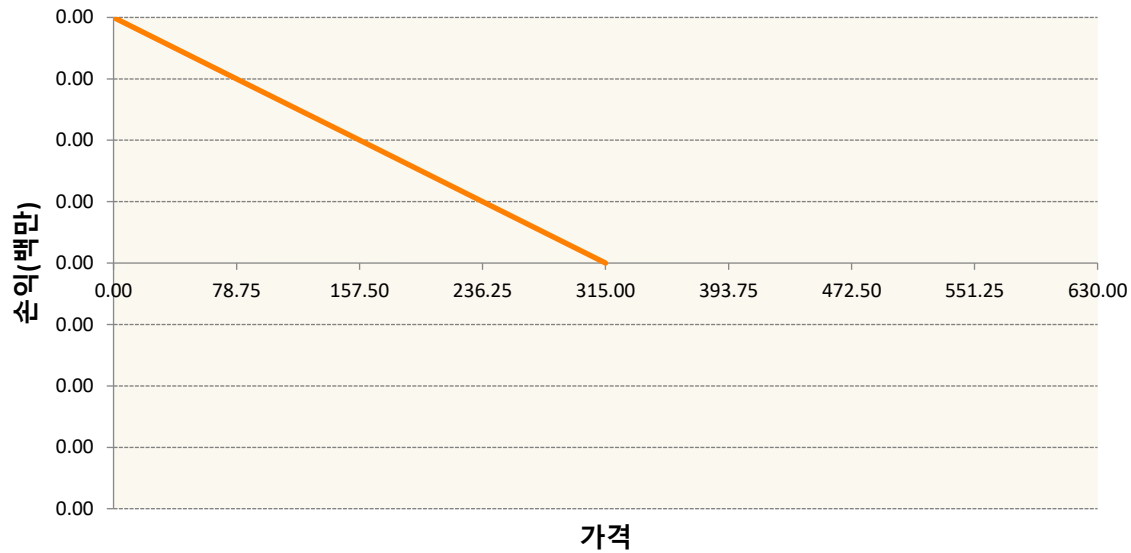
KR4201T43307-2023-04 콜330



KR4301T43123-2023-04 풋312.5



KR4301T43156-2023-04 풋315



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101T60006		2023-06 코스피200지수선물					33
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-33	-33	-33	-33	-33	-33	-33
-5.33%	-22	-22	-22	-22	-22	-22	-22
-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%	22	22	22	22	22	22	22
8.00%	33	33	33	33	33	33	33
KR4105T40009		2023-04 미니코스피200 선물					10
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-10	-10	-10	-10	-10	-10	-10
-5.33%	-7	-7	-7	-7	-7	-7	-7
-2.67%	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-3
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	3	3	3	3	3	3	3
5.33%	7	7	7	7	7	7	7
8.00%	10	10	10	10	10	10	10
KR4201T43273		2023-04 콜327.5					28
	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%	4	4	4	4	4	3	3
-2.67%	3	3	3	3	3	3	2
0%	1	1	0	0	0	-1	-1

2.67%	-6	-7	-7	-7	-7	-8	-8
5.33%	-17	-17	-17	-17	-17	-17	-17
8.00%	-28	-28	-28	-28	-28	-28	-28

KR4201T43307

2023-04 콜330

221

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	16	16	16	16	16	16	16
-5.33%	16	16	16	16	15	15	15
-2.67%	15	15	15	14	13	13	12
0%	7	4	2	0	-2	-5	-7
2.67%	-44	-46	-48	-50	-52	-54	-56
5.33%	-130	-130	-130	-131	-131	-132	-133
8.00%	-221	-221	-221	-221	-221	-221	-221

KR4301T43123

2023-04 풋312.5

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%	1	1	1	1	1	1	1
-2.67%	0	0	0	0	0	0	0
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	0	0	0	0	0	0	0
5.33%	0	0	0	0	0	0	0
8.00%	0	0	0	0	0	0	0

KR4301T43156

2023-04 풋315

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	2	2
-2.67%	0	0	0	0	0	0	1
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	0	0	0	0	0	0	0
5.33%	0	0	0	0	0	0	0
8.00%	0	0	0	0	0	0	0

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

(단위:백만원)

335

공시일	2023-04-11
기준일	2023-04-10

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	2023-04-11
기준일	2023-04-10

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	5,350	0	5,350	

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	2023-04-11
기준일	2023-04-10

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	18,683	0	18,683	
누계	통화	선도	660	19,235	-18,575	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
FXW213D1S(KRW/USD 28-04-23E		315
FXW213D2Q KRW/USD 31-05-23E		712
FXW213D3Q KRW/USD 28-06-23E		512
FXW213D3W USD/KRW 28-04-23E		53
IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	3,515

공시일	2023-04-11
기준일	2023-04-10

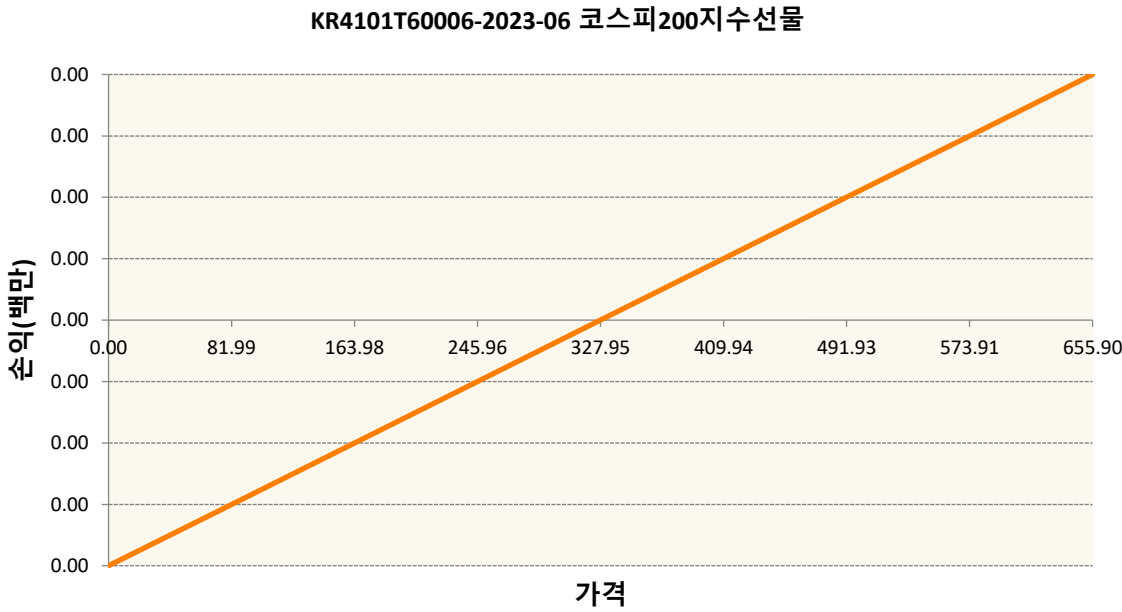
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	82	-82	장내
누계	유가증권	선물	1,312	0	1,312	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101T60006			2023-06 코스피200지수선물				104
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-104	-104	-104	-104	-104	-104	-104
-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%	104	104	104	104	104	104	104

공시일	2023-04-11
기준일	2023-04-10

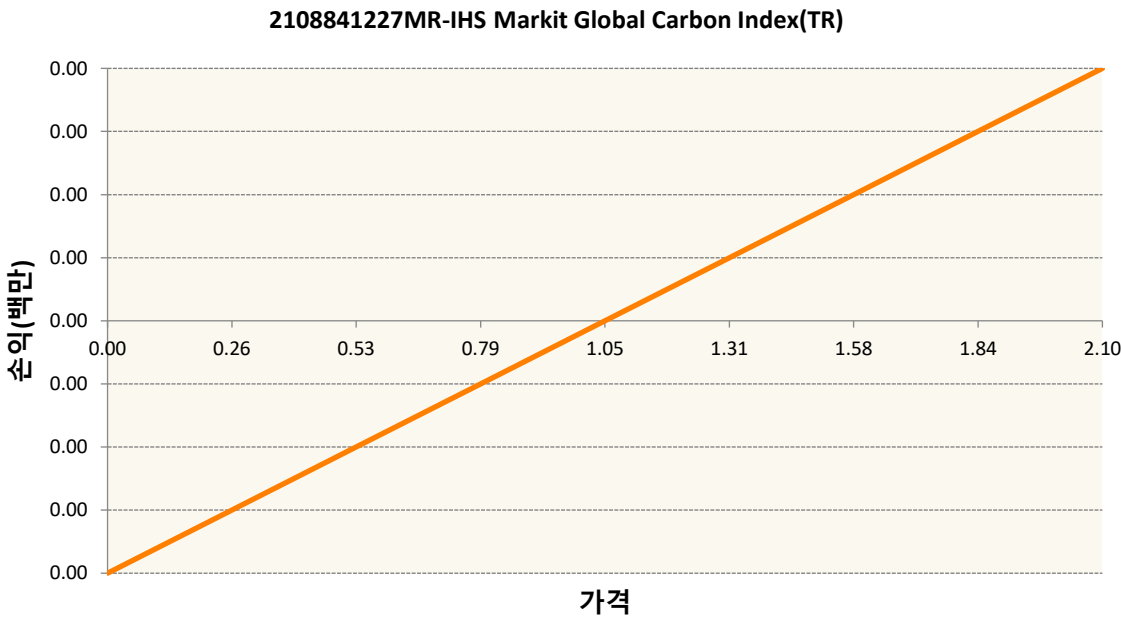
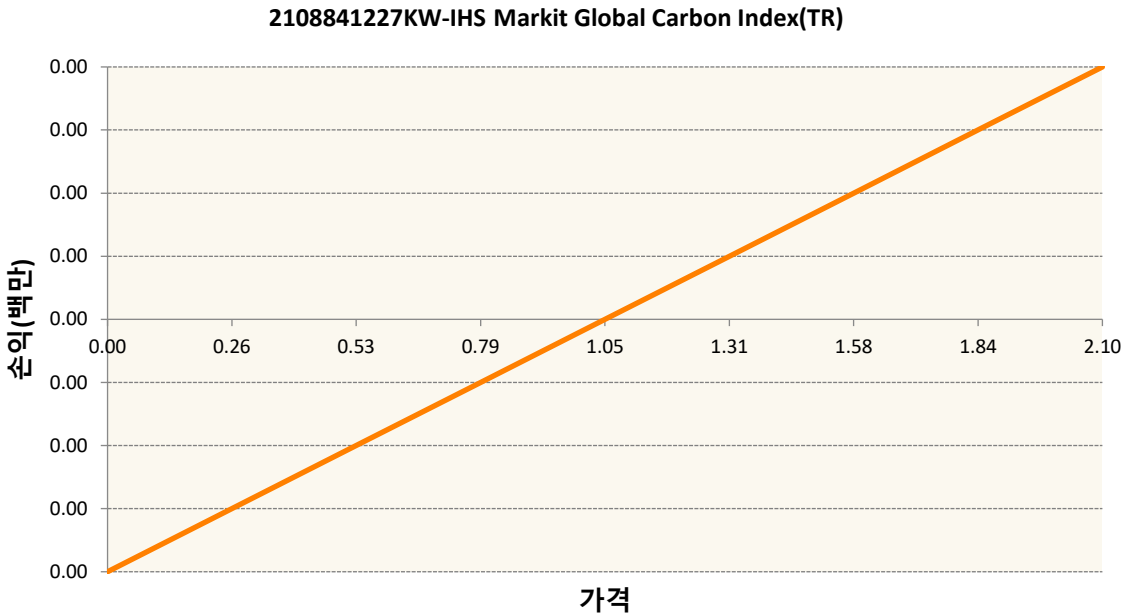
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

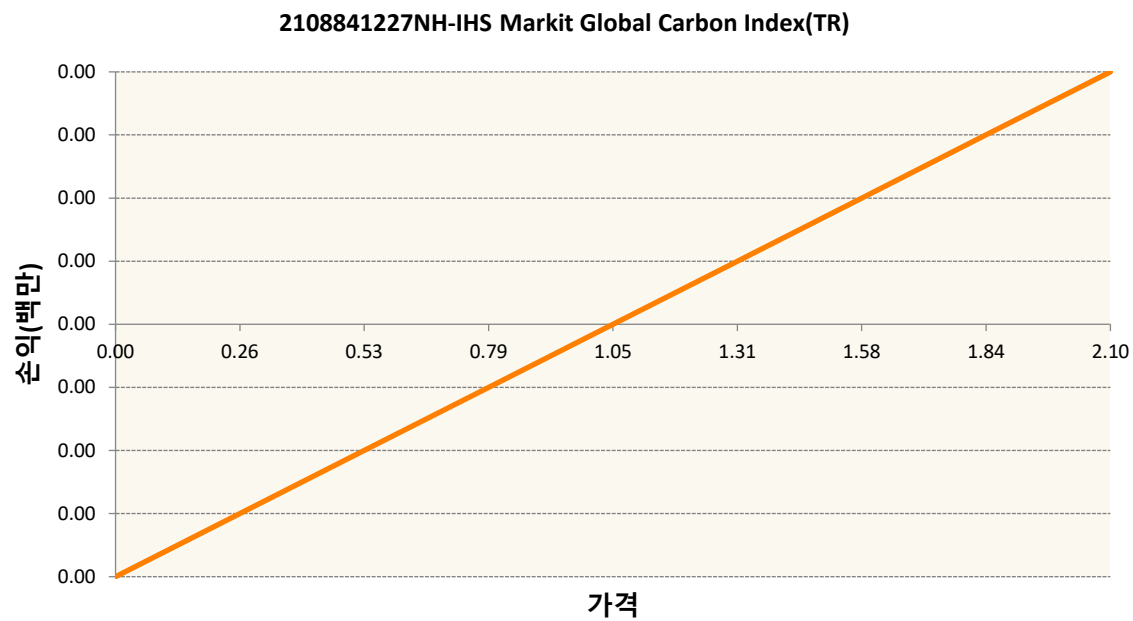
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	27,073	0	27,073	

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108841227IHS Markit Global Carbon Index(TR)		1,845
2108841227IHS Markit Global Carbon Index(TR)		217
2108841227IHS Markit Global Carbon Index(TR)		109

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)		(단위:백만원)
		3,771

공시일	2023-04-11
기준일	2023-04-10

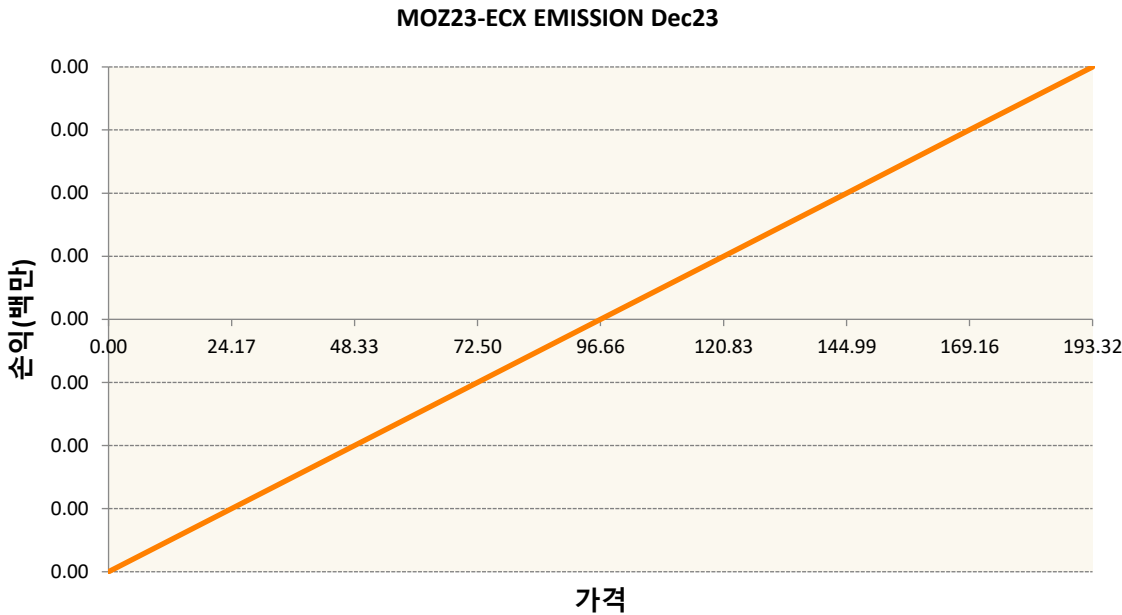
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	9,800	0	9,800	
누계	통화	선도	0	3,062	-3,062	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213D3W KRW/EUR 28-04-23E	63
FXW213D3W KRW/EUR 28-04-23E	63
FXW213D3W KRW/EUR 28-04-23E	64
FXW213D44I KRW/EUR 28-04-23E	55
MOZ23 ECX EMISSION Dec23	784

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

(단위:백만원)

1,555

공시일	2023-04-11
기준일	2023-04-10

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)	4
SWCSI00000 신한CSI Index 221222 (키움)	4
SWCSI00000 신한CSI Index 221222 (미래)	4
SWCSI00000 신한CSI Index 221222 (메리츠)	4

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

(단위:백만원)

25

공시일	2023-04-11
기준일	2023-04-10

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)	19
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 230116(메리츠)	26
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 230116(미래)	22
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 230116(키움)	19

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

(단위:백만원)

149

공시일	2023-04-11
기준일	2023-04-10

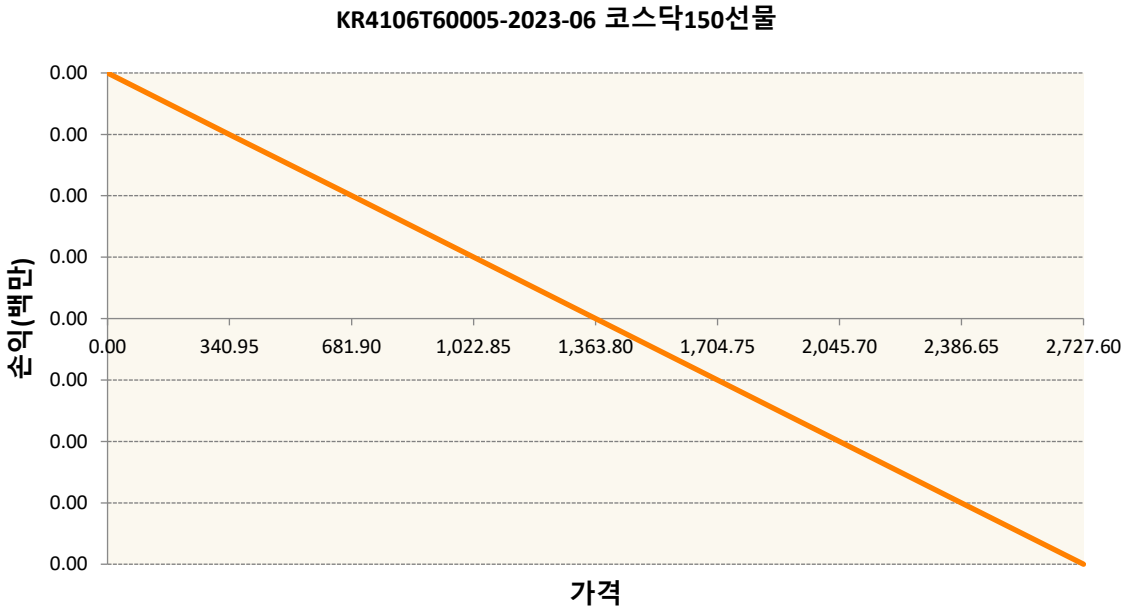
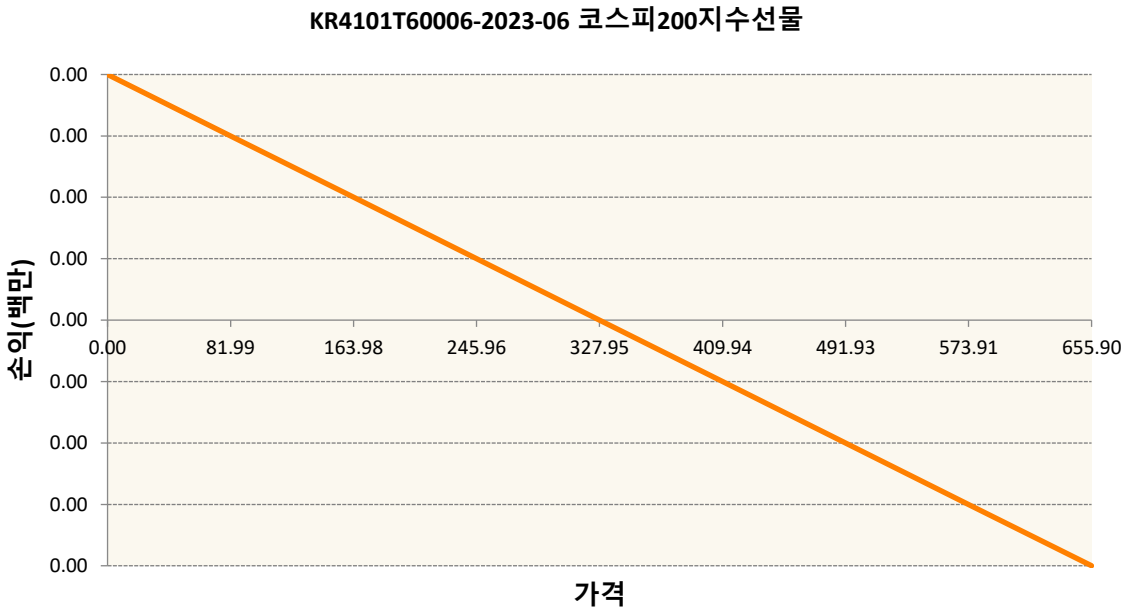
에쿼티알파일반사모혼합자산

1. 계약금액

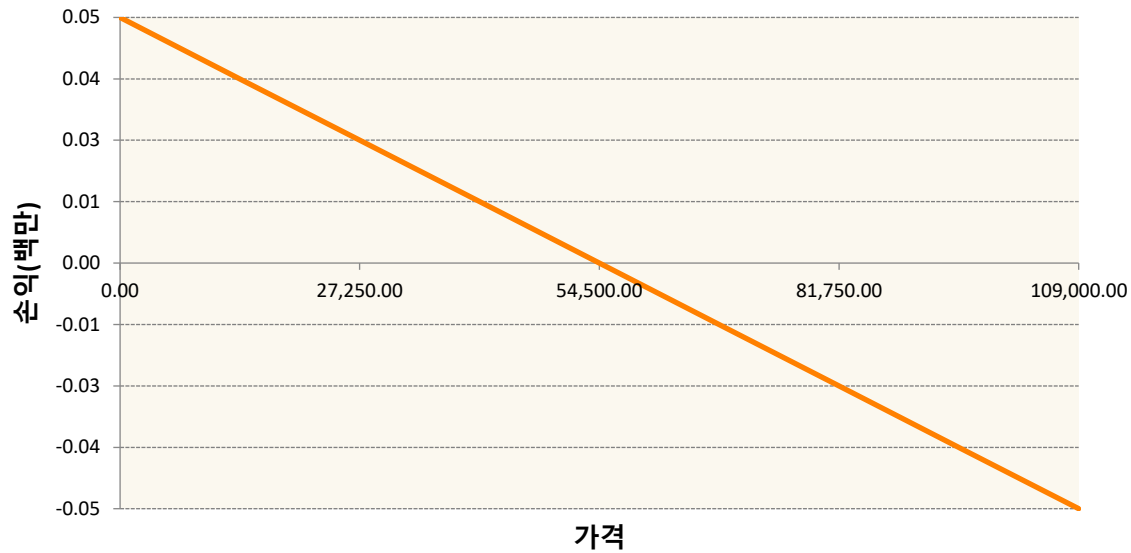
(단위:백만원)

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	0	3,167	-3,167	장내
누계	유가증권	스왑	0	0	0	장외

2. 만기시점의 손익구조



KR41F7T40009-2023-04 카카오페이개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101T600 2023-06 코스피200지수선물	131
KR4106T600 2023-06 코스닥150선물	109
KR41F7T400 2023-04 카카오페이개별선물	13
KRS0004054 SWAP_MICROSOFT CP_0221	1
KRS0004054 SWAP_FIRST TRUST ECL_0221	0.26
KRS0004099 SWAP_MICRON TECH_0308	0.27

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

(단위:백만원)

442

공시일	2023-04-11
기준일	2023-04-10

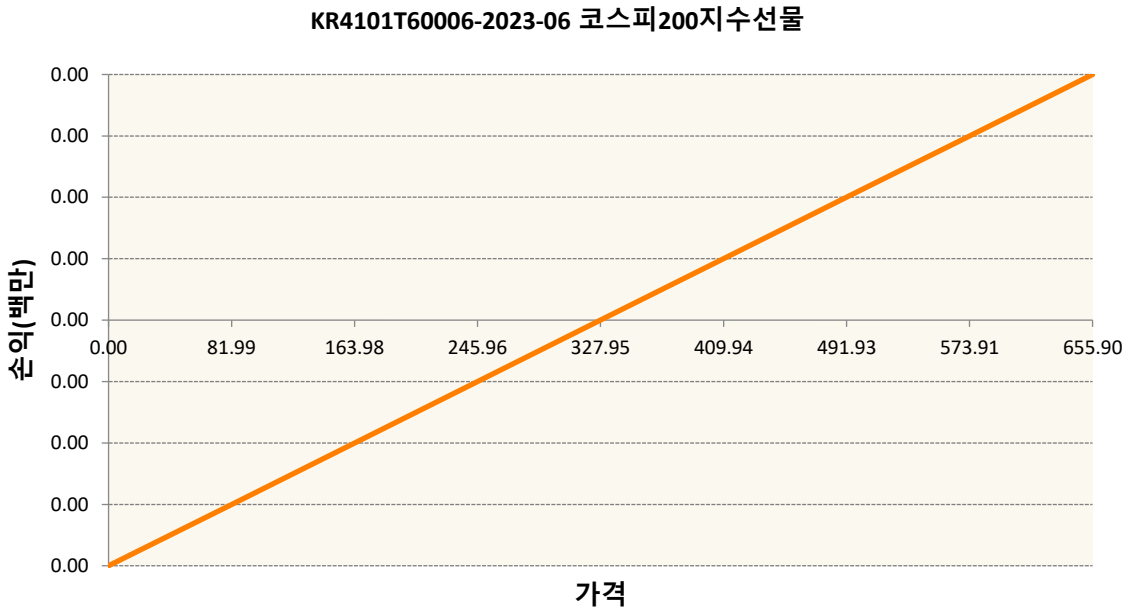
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	164	-164	장내
누계	유가증권	선물	2,952	0	2,952	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101T60006		2023-06 코스피200지수선물					235
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-235	-235	-235	-235	-235	-235	-235
-5.33%	-157	-157	-157	-157	-157	-157	-157
-2.67%	-78	-78	-78	-78	-78	-78	-78
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	78	78	78	78	78	78	78
5.33%	157	157	157	157	157	157	157
8.00%	235	235	235	235	235	235	235

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

(단위:백만원)

256

공시일	2023-04-11
기준일	2023-04-10

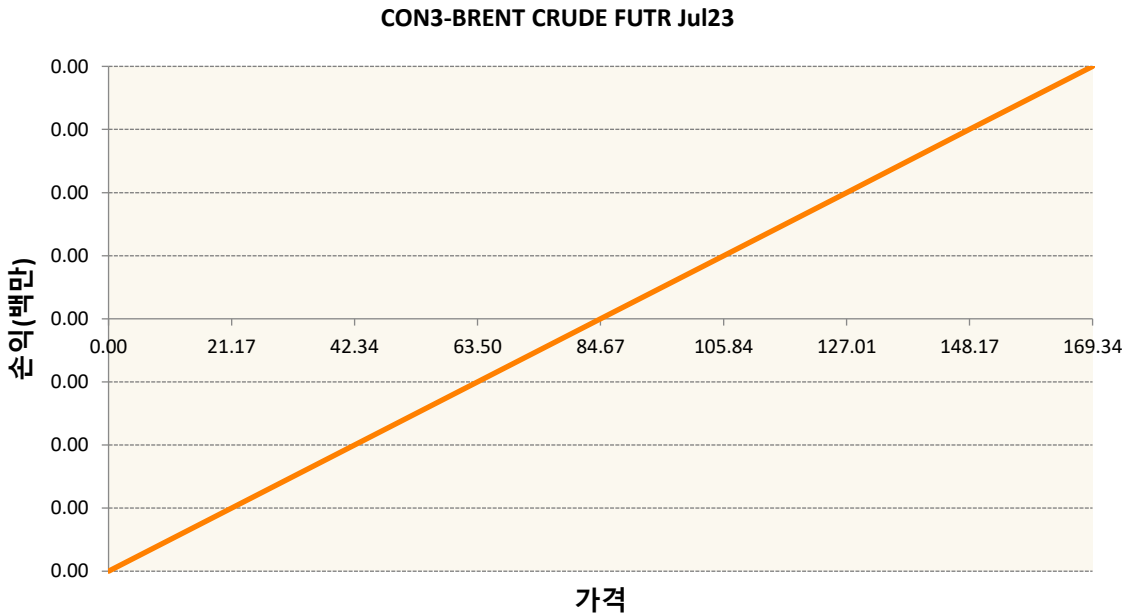
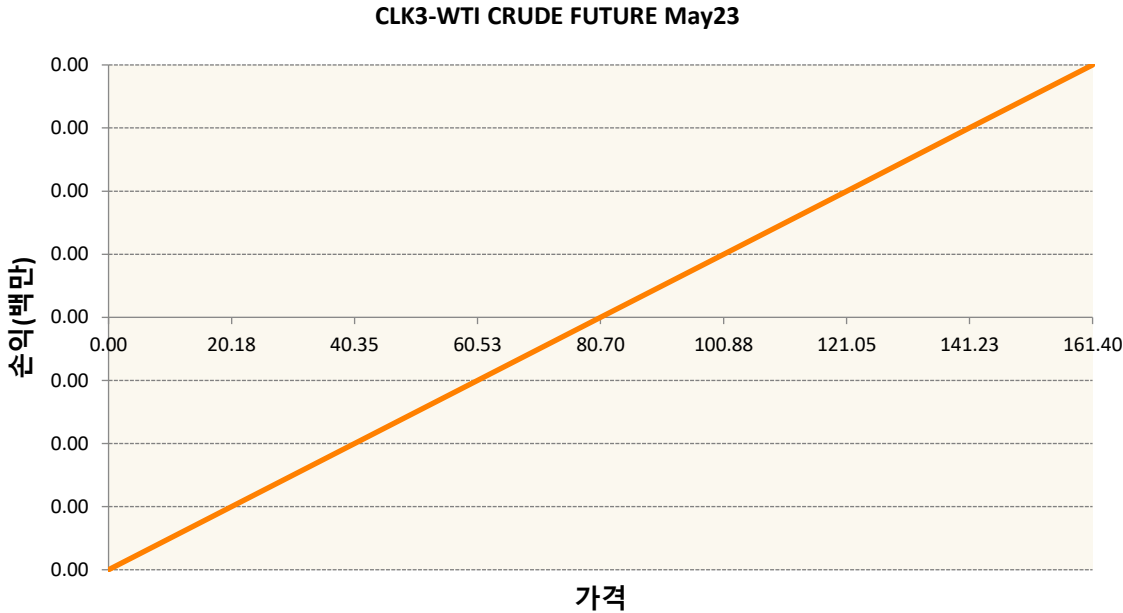
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

1. 계약금액

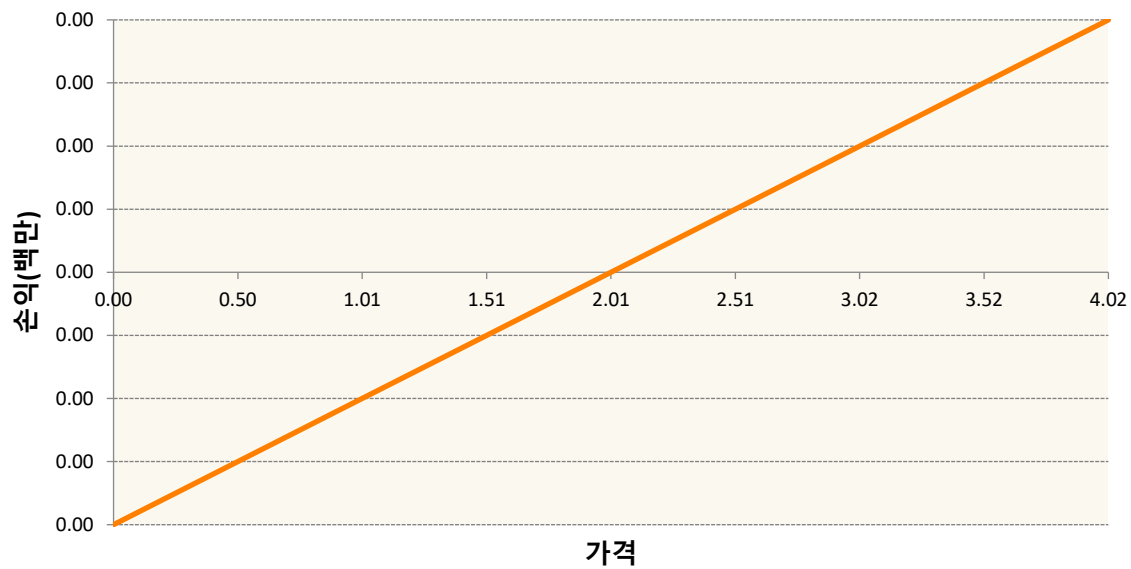
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,488	251	1,238	

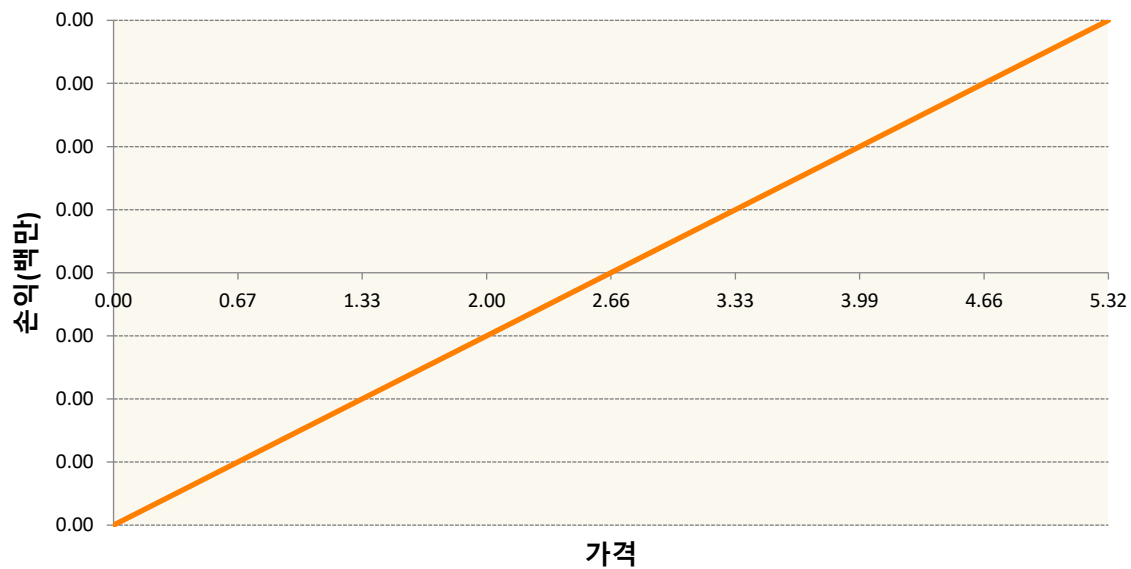
2. 만기시점의 손익구조



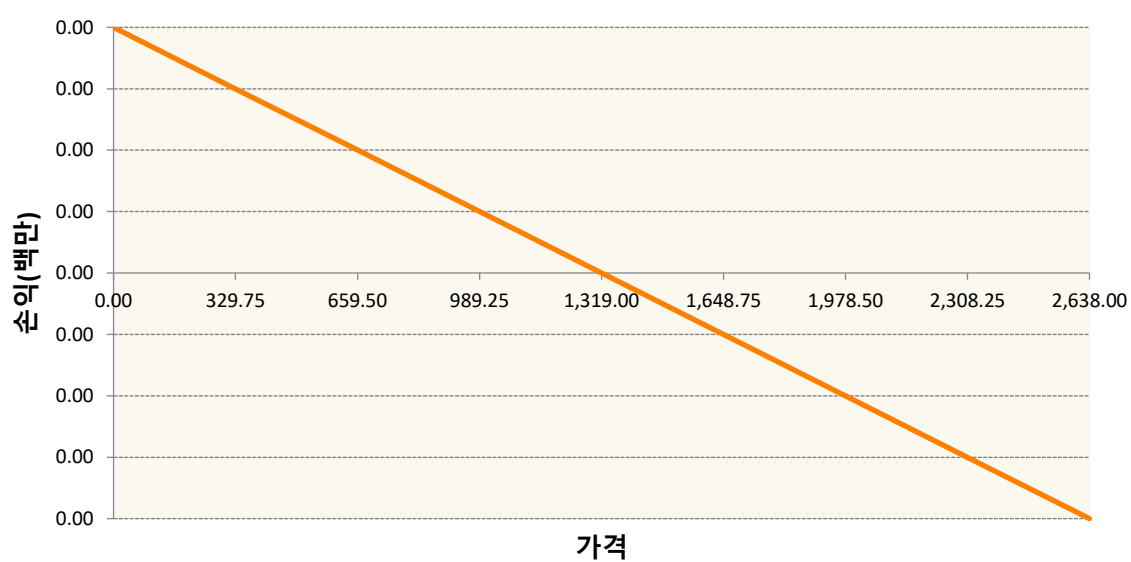
EOK3-E-MINI NATURAL GAS May23



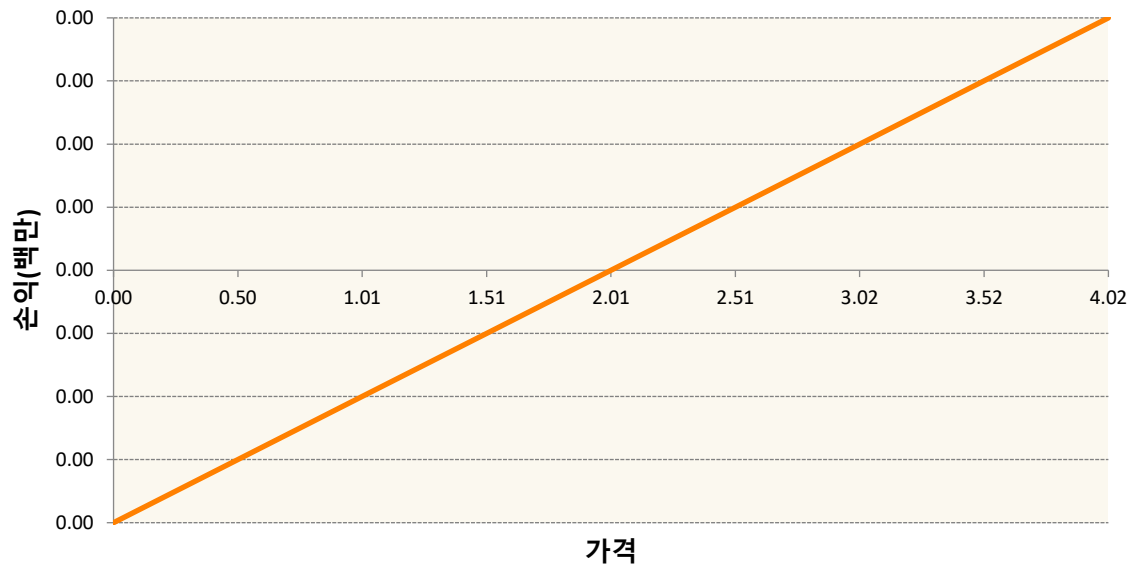
HOK3-NY Harb ULSD Fut May23



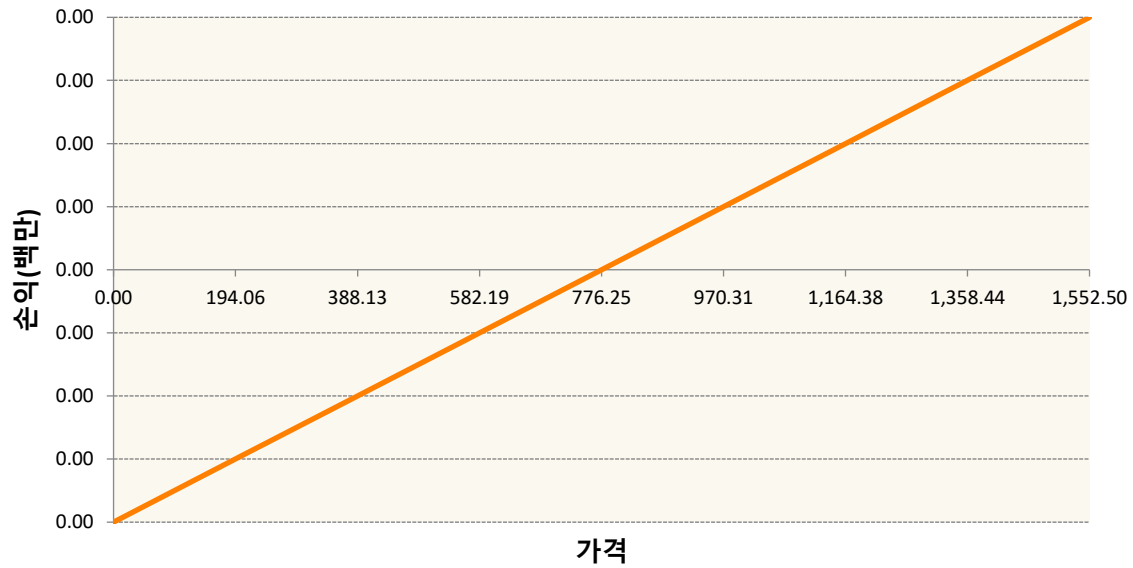
KR4175T40002-2023-04 달러선물



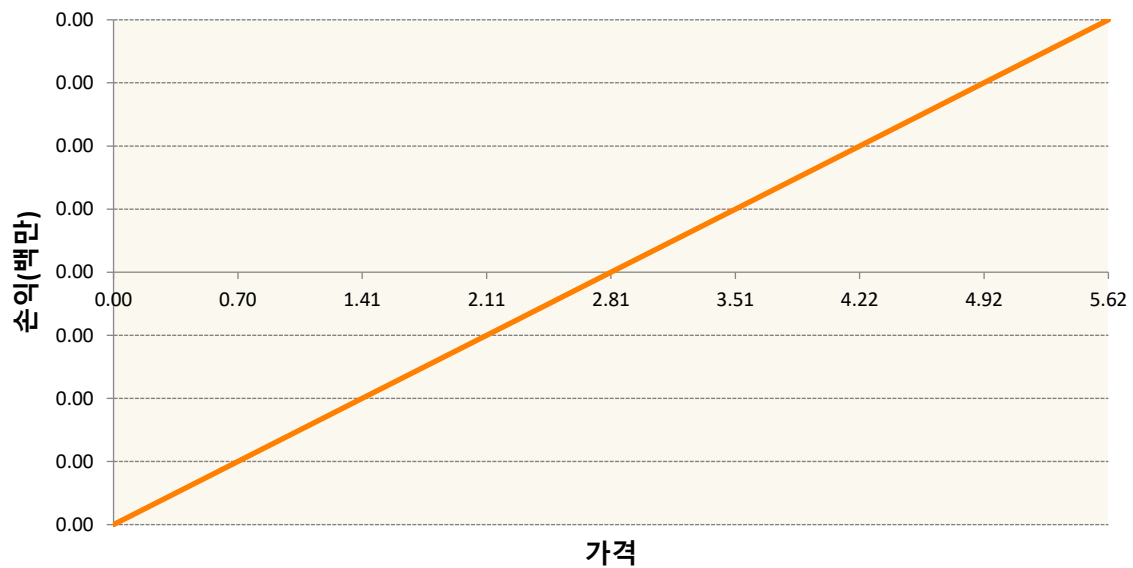
NGK23-NATURAL GAS FUTR May23



QSK3-Low Su Gasoil G May23



XBK3-GASOLINE RBOB FUT May23



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLK3	WTI CRUDE FUTURE May23	33
CON3	BRENT CRUDE FUTR Jul23	36
EOK3	E-MINI NATURAL GAS May23	1
HOK3	NY Harb ULSD Fut May23	11
KR4175T400	2023-04 달러선물	20
NGK23	NATURAL GAS FUTR May23	18
QSK3	Low Su Gasoil G May23	8
XBK3	GASOLINE RBOB FUT May23	12

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

242