

공시일	2023-04-17
기준일	2023-04-14

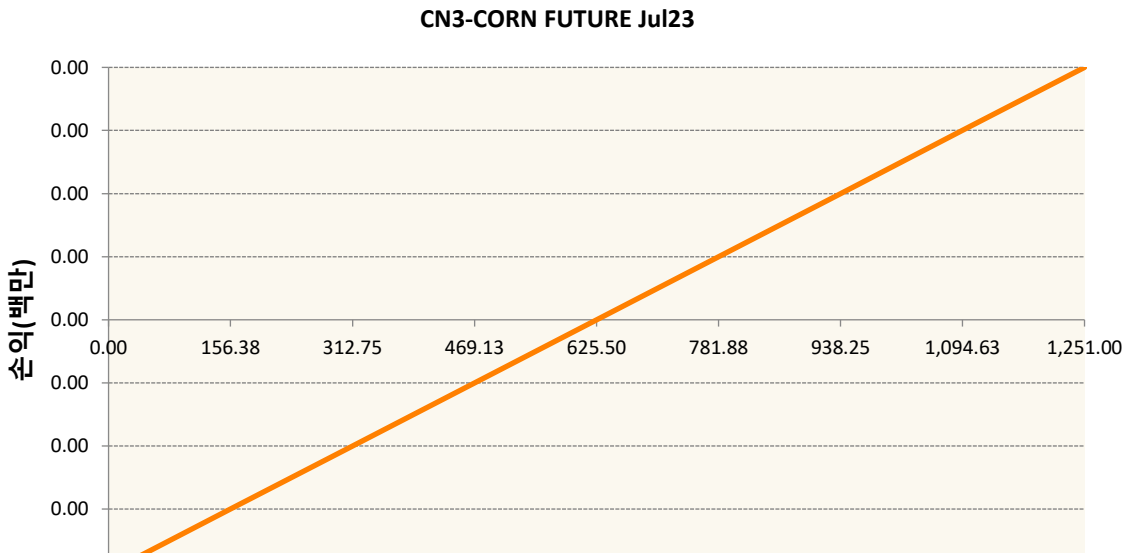
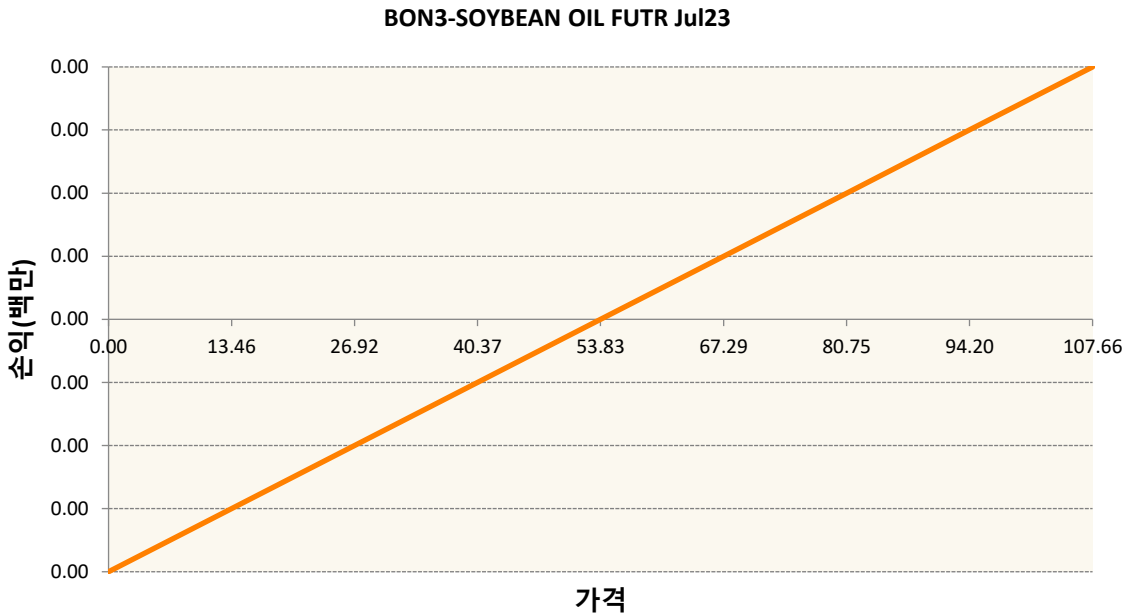
포커스농산물모(채권-파생형)

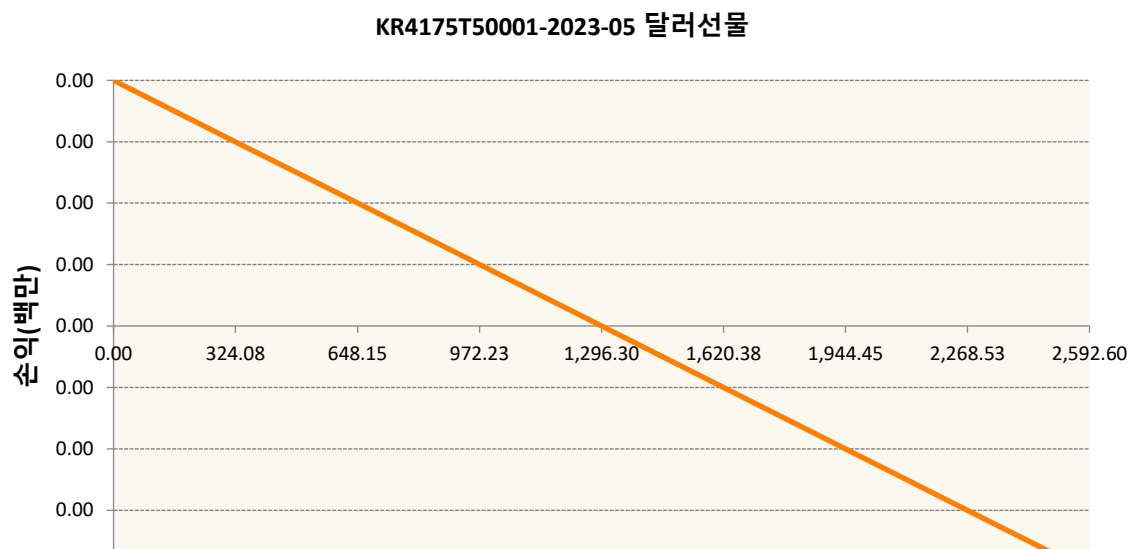
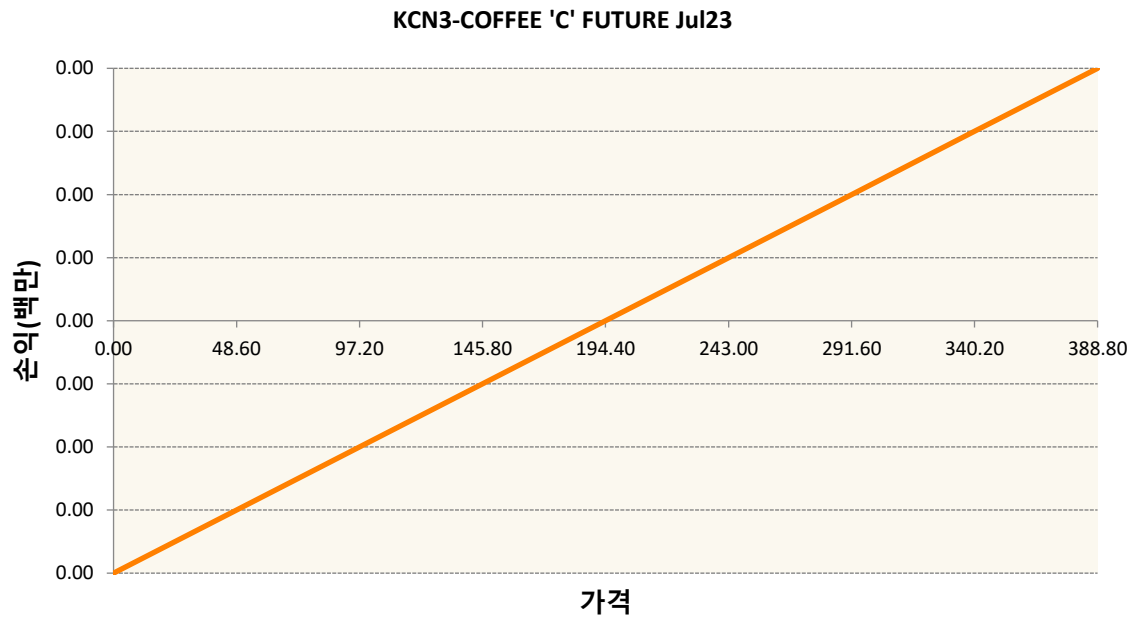
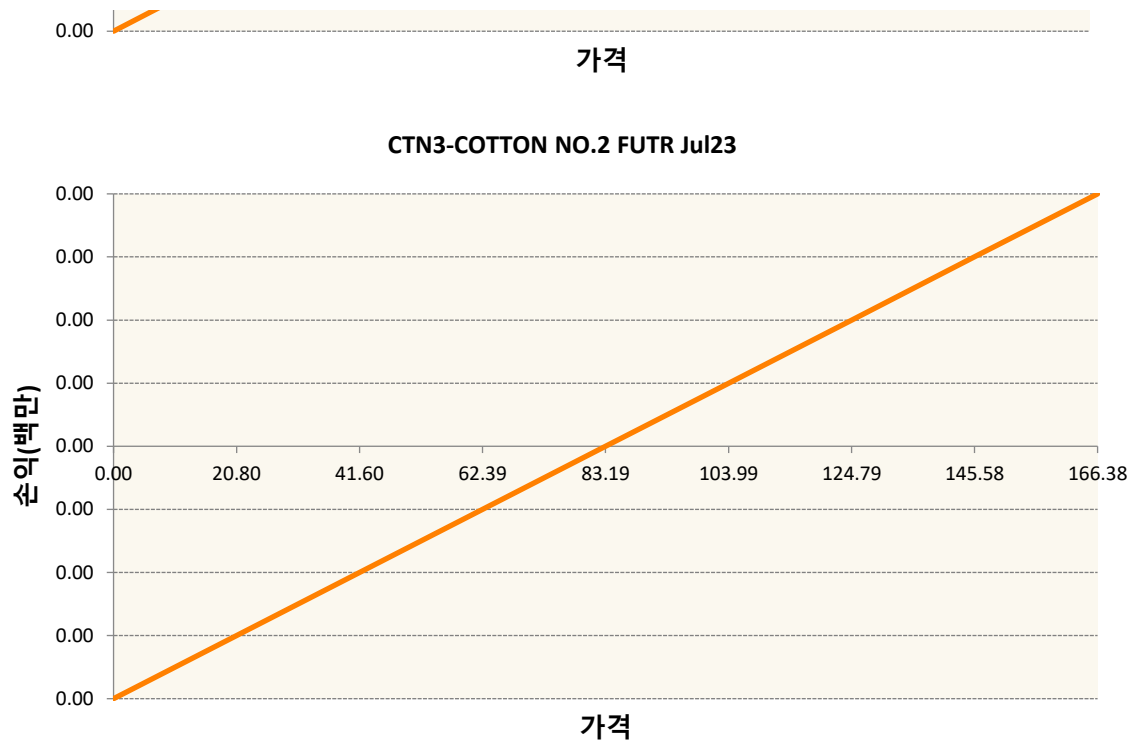
1. 계약금액

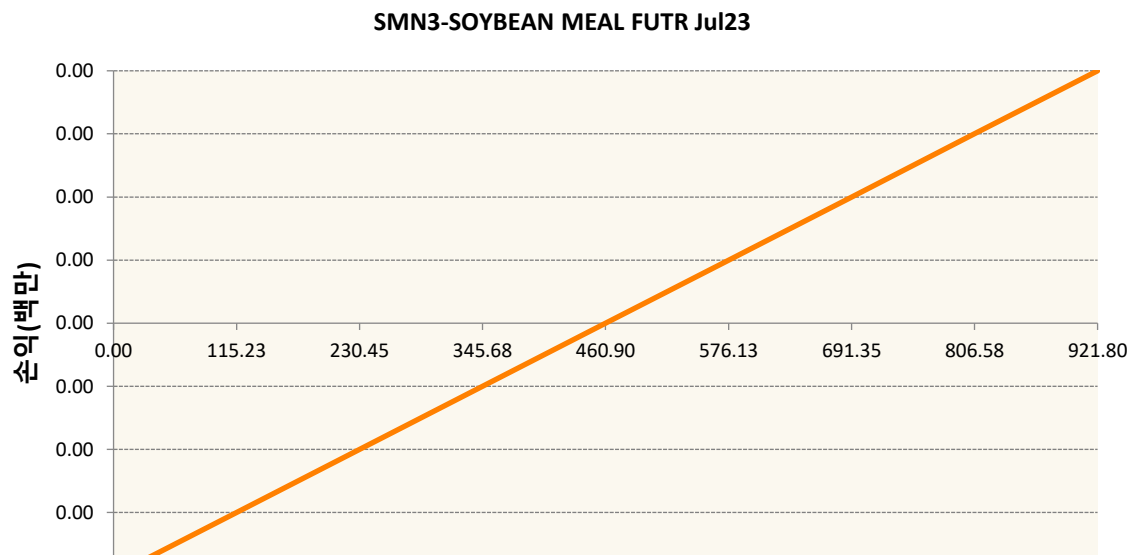
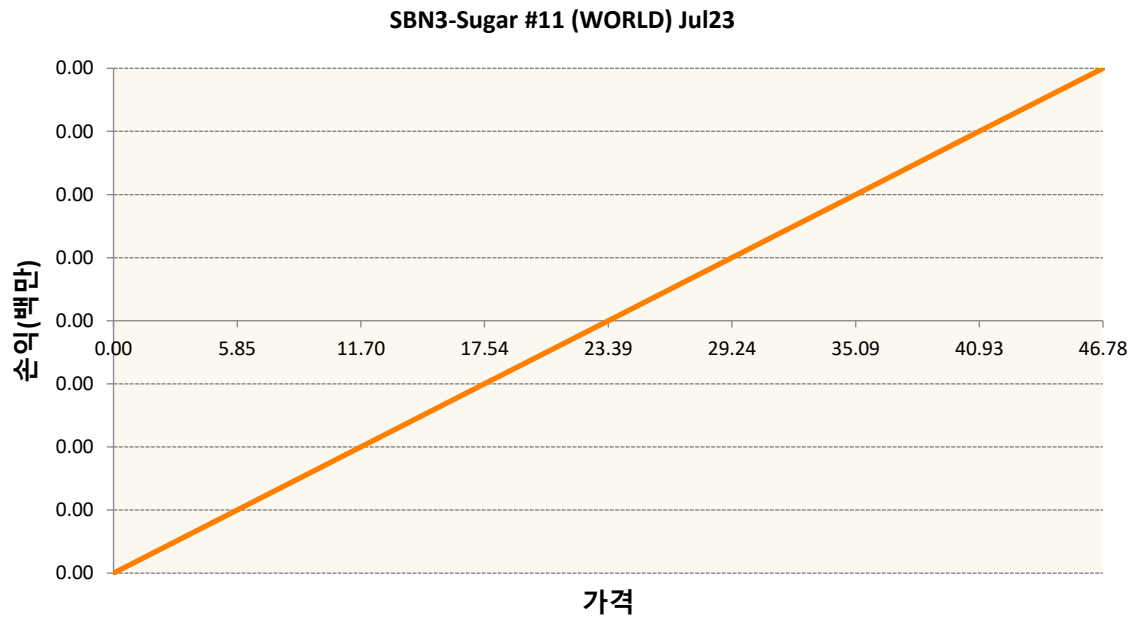
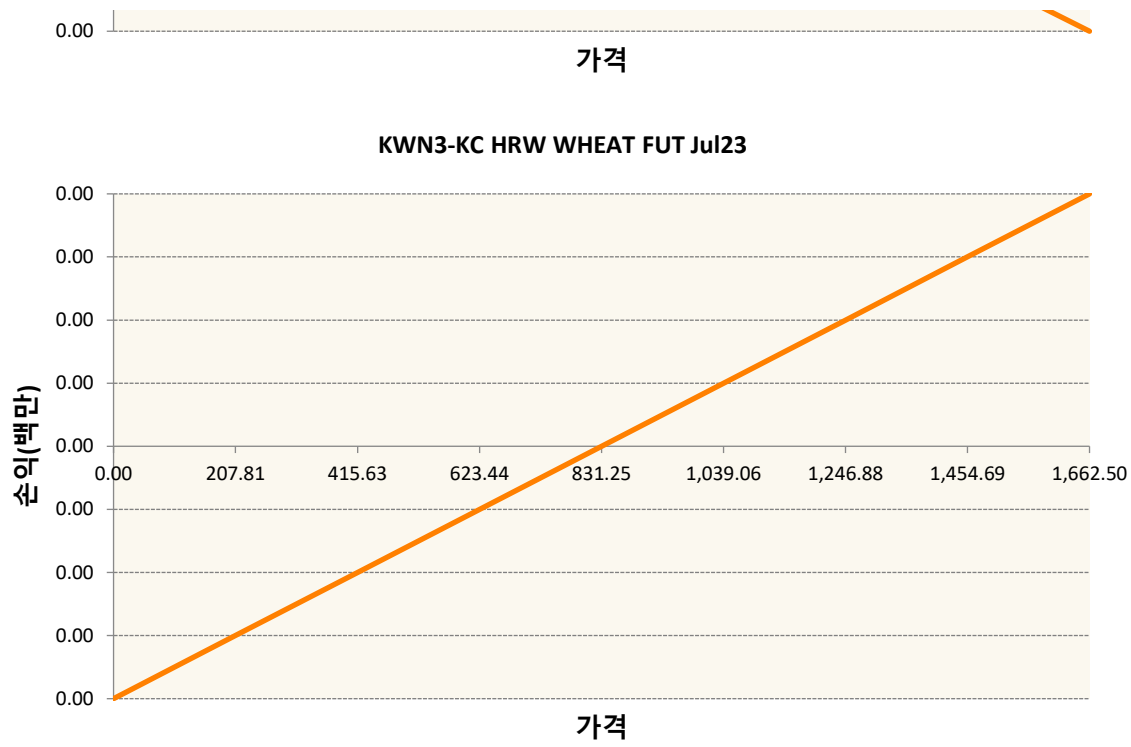
(단위:USD 백만)

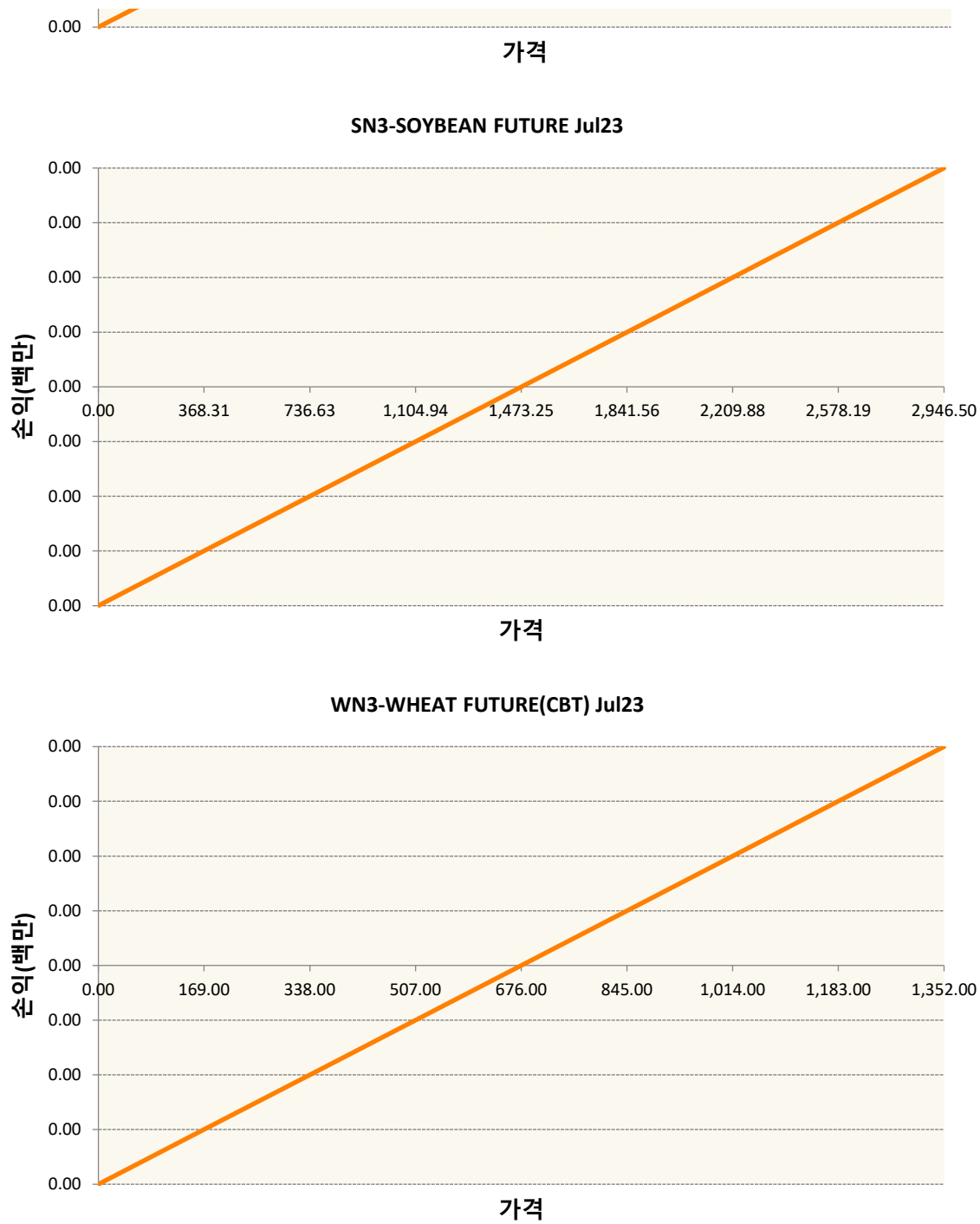
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규			0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	519	-519	장내
누계			327	0	327	
누계	유가증권	선물	5,415	0	5,415	
누계	통화	선물	0	519	-519	장내

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	2023-04-17
기준일	2023-04-14

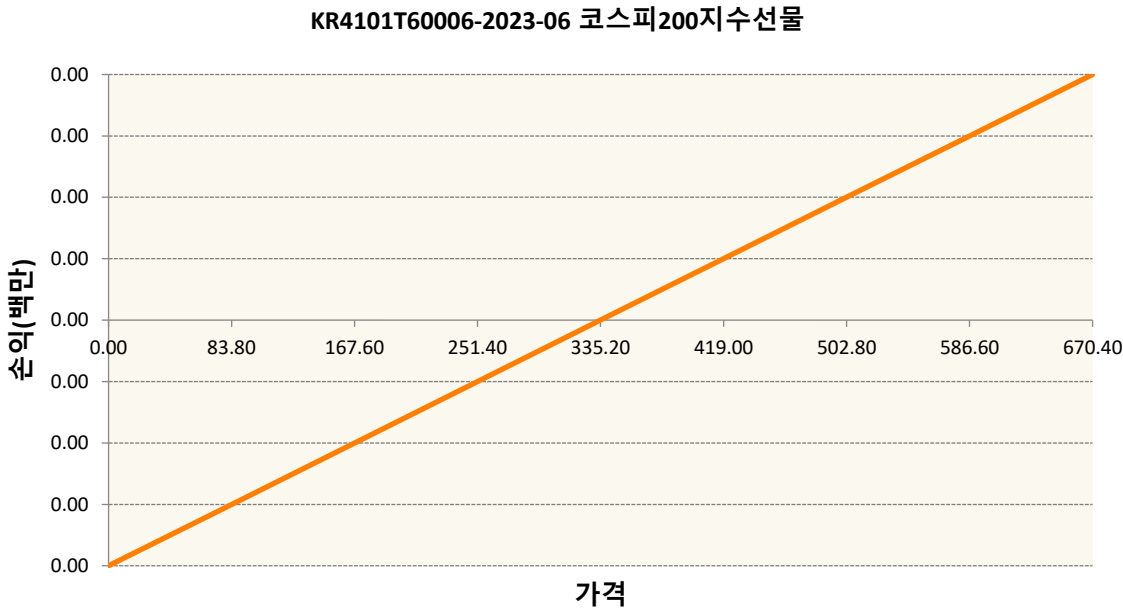
스마트인덱스모

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	251	-251	장내
누계	유가증권	선물	2,346	0	2,346	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101T60006			2023-06 코스피200지수선물				187
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-187	-187	-187	-187	-187	-187	-187
-5.33%	-125	-125	-125	-125	-125	-125	-125
-2.67%	-62	-62	-62	-62	-62	-62	-62
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	62	62	62	62	62	62	62
5.33%	125	125	125	125	125	125	125
8.00%	187	187	187	187	187	187	187

공시일	2023-04-17
기준일	2023-04-14

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

374

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

649

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2023-04-17
기준일	2023-04-14

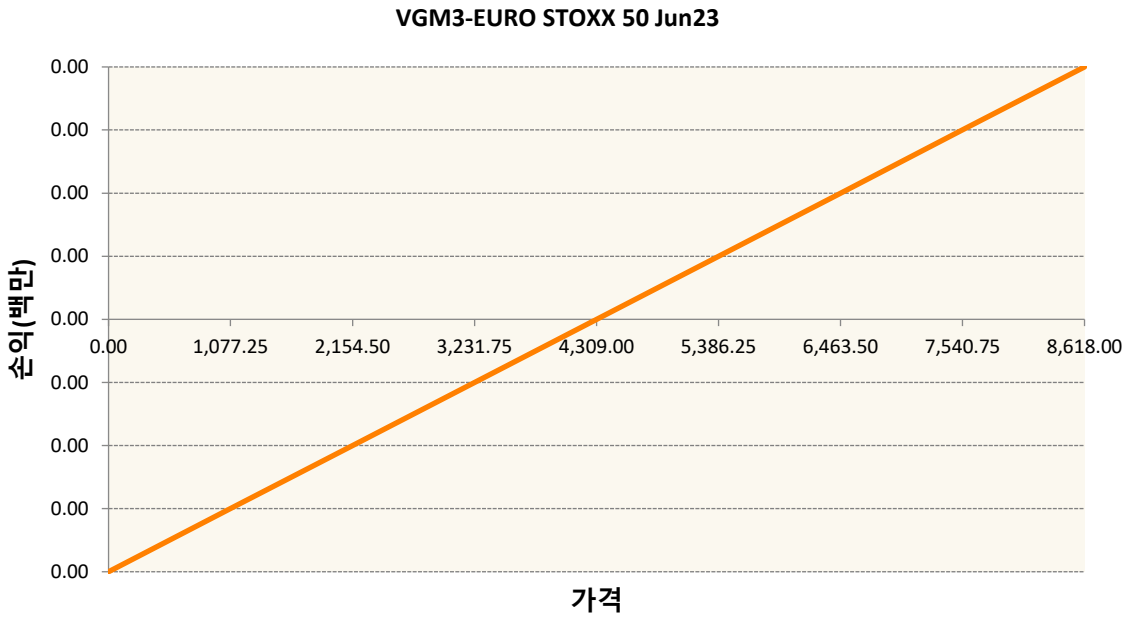
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	361	0	361	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM3	EURO STOXX 50 Jun23	29
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

50

공시일	2023-04-17
기준일	2023-04-14

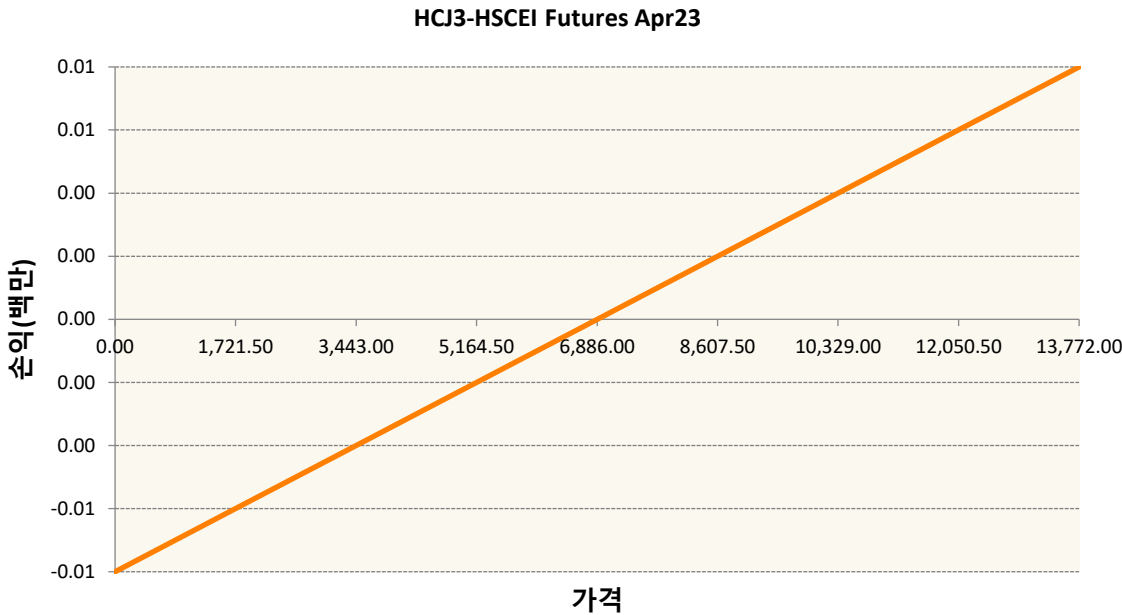
차이나인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	972	0	972	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCJ3	HSCEI Futures Apr23	78
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

135

공시일	2023-04-17
기준일	2023-04-14

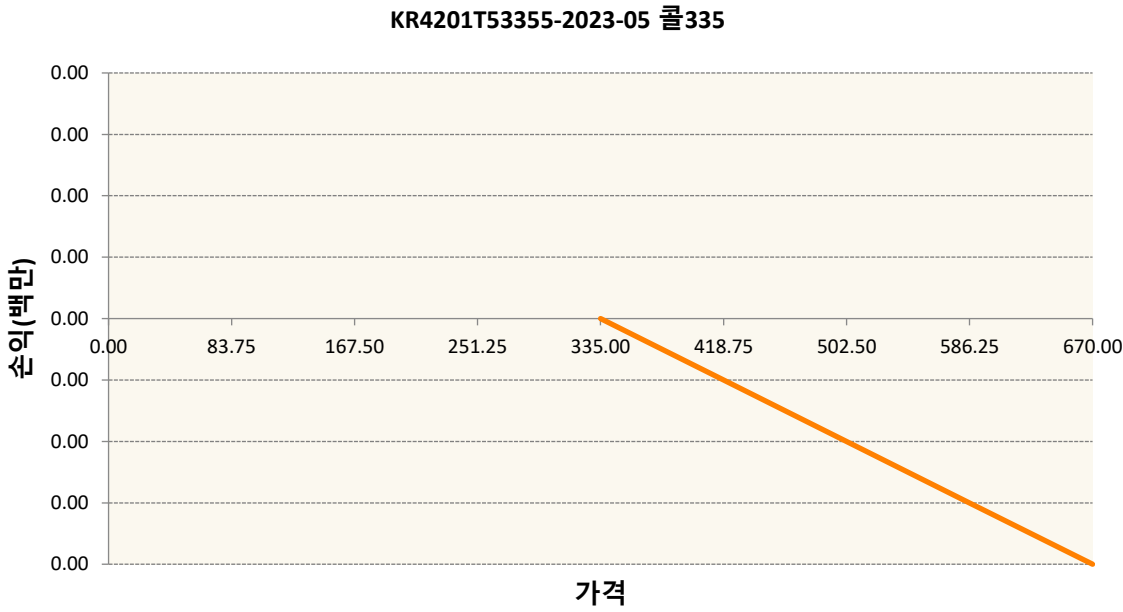
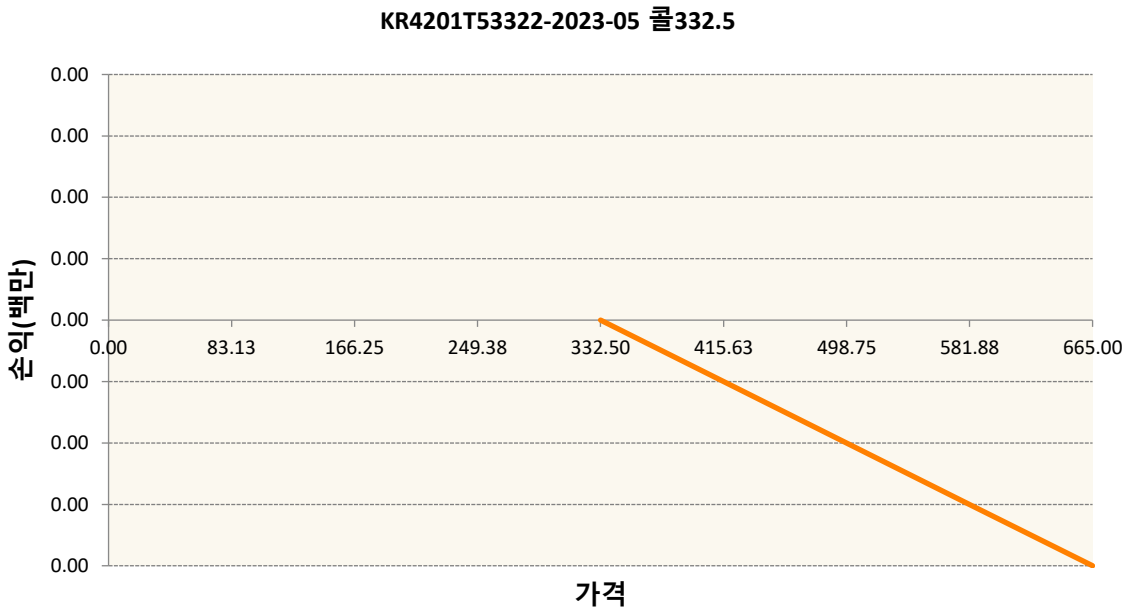
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	56,886	-56,886	장내
누계	유가증권	옵션	0	55,876	-55,876	장내

2. 만기시점의 손익구조



The graph illustrates the relationship between price (가격) and profit (이익) in millions of won. The x-axis represents price, ranging from 0.00 to 665.00 with major ticks every 83.13 units. The y-axis represents profit, ranging from 0.00 to 0.00. A single orange line is plotted, starting at (0, 0) and ending at (332.50, 0.00). This indicates that the profit is zero for all prices shown on the x-axis.

가격 (Price)	이익 (Profit)
0.00	0.00
83.13	0.00
166.25	0.00
249.38	0.00
332.50	0.00
415.63	0.00
498.75	0.00
581.88	0.00
665.00	0.00

가격	손익 (백만)
0.00	0.00
335.00	0.00
670.00	0.00

(단위:백만원)

KR4201T53322							2023-05 콜332.5		2,329	
기초자산의 변동성										
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%			
-8.00%	1,023	997	965	928	887	842	793			
-5.33%	918	867	812	754	692	629	563			
-2.67%	677	603	528	452	376	299	221			
0%	245	163	82	0	-82	-163	-245			
2.67%	-390	-460	-532	-606	-681	-758	-835			
5.33%	-1,189	-1,236	-1,289	-1,346	-1,407	-1,470	-1,536			
8.00%	-2,091	-2,117	-2,149	-2,187	-2,230	-2,278	-2,329			
KR4201T53355							2023-05 콜335		597	
기초자산의 변동성										

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	240	234	227	219	209	198	186
-5.33%	218	207	194	179	164	148	132
-2.67%	166	147	128	109	89	69	49
0%	66	44	22	0	-22	-44	-66
2.67%	-89	-109	-129	-150	-171	-192	-214
5.33%	-290	-305	-321	-338	-355	-373	-392
8.00%	-524	-533	-543	-555	-568	-582	-597
KR4301T53320 2023-05 풋332.5							341

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-305	-309	-314	-320	-326	-333	-341
-5.33%	-166	-174	-183	-192	-202	-212	-222
-2.67%	-48	-60	-72	-84	-96	-108	-121
0%	39	26	13	0	-13	-26	-39
2.67%	94	83	71	60	48	36	24
5.33%	123	116	107	98	89	79	68
8.00%	136	132	127	121	114	107	98

KR4301T53353 2023-05 풋335							203
---	--	--	--	--	--	--	-----

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-185	-187	-190	-192	-196	-199	-203
-5.33%	-104	-108	-112	-117	-122	-127	-133
-2.67%	-33	-39	-45	-52	-59	-65	-72
0%	22	15	7	0	-7	-15	-22
2.67%	59	52	45	38	31	24	16
5.33%	79	74	69	63	57	51	45
8.00%	89	86	82	79	74	69	64

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

(단위:백만원)

3,375

공시일	2023-04-17
기준일	2023-04-14

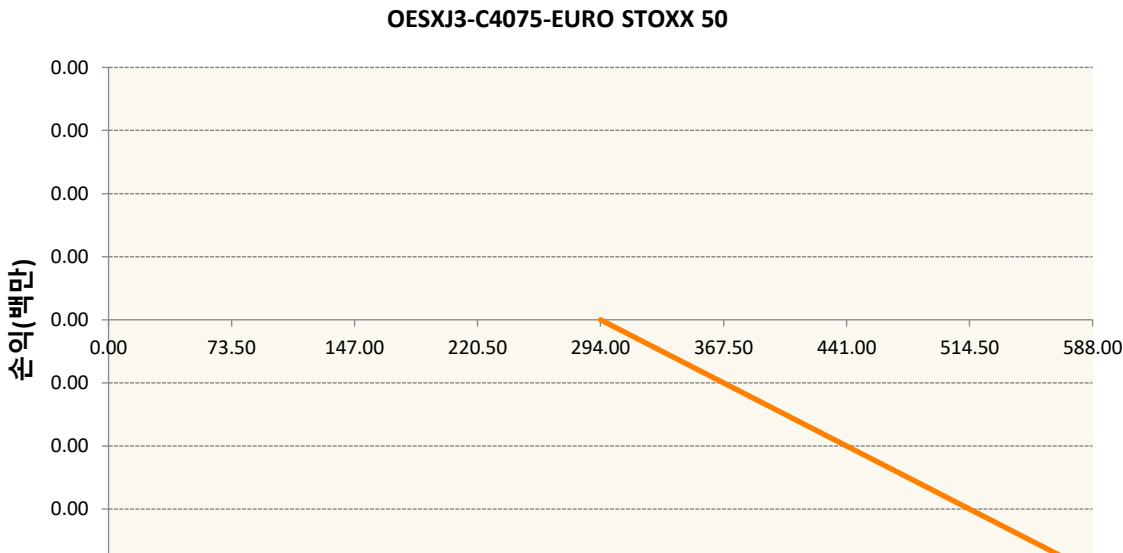
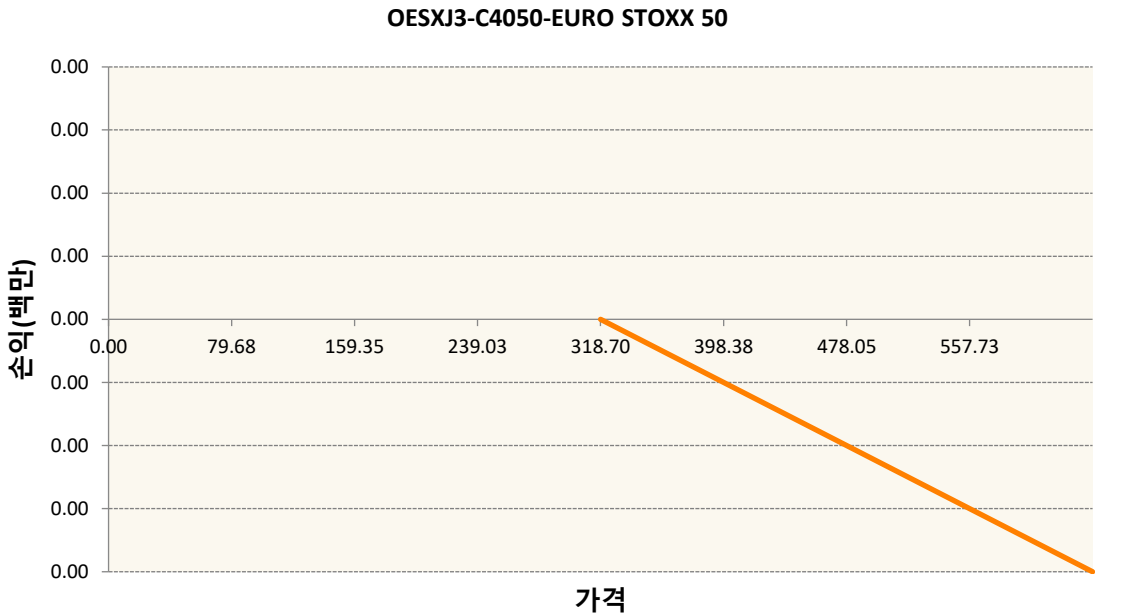
유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

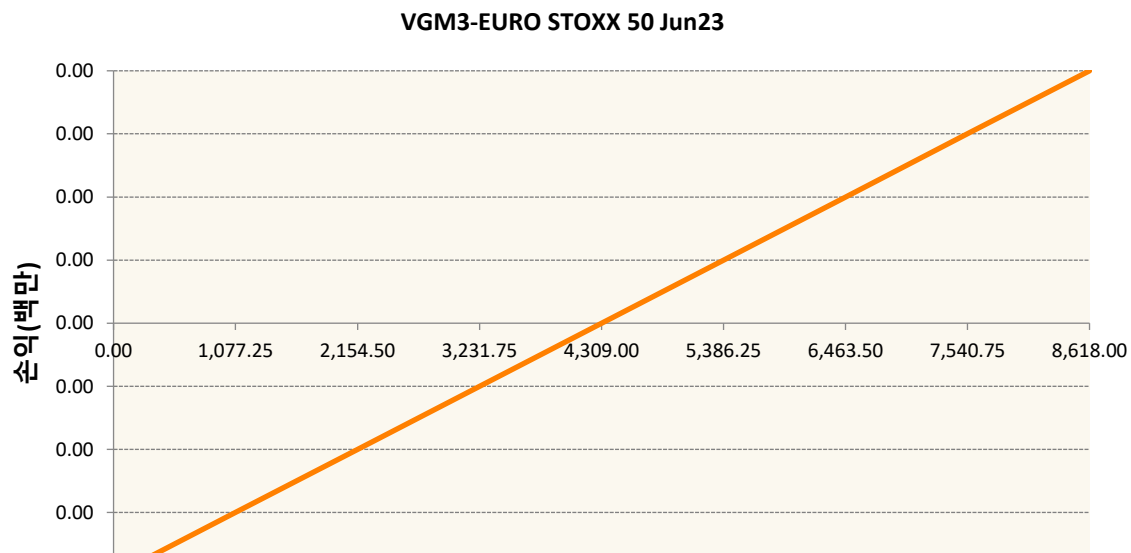
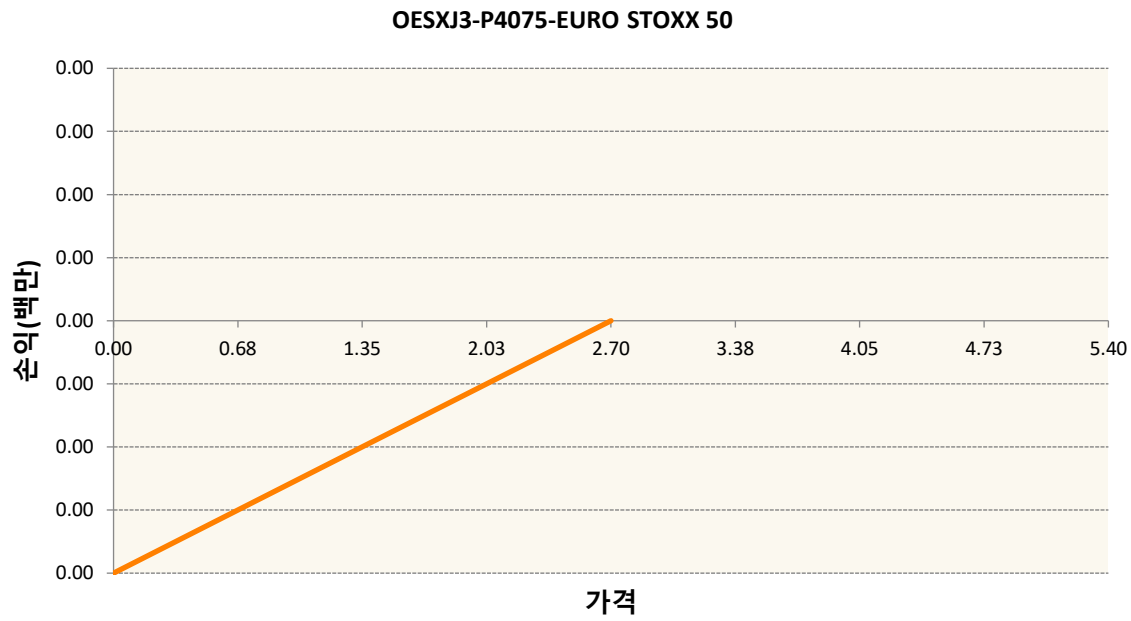
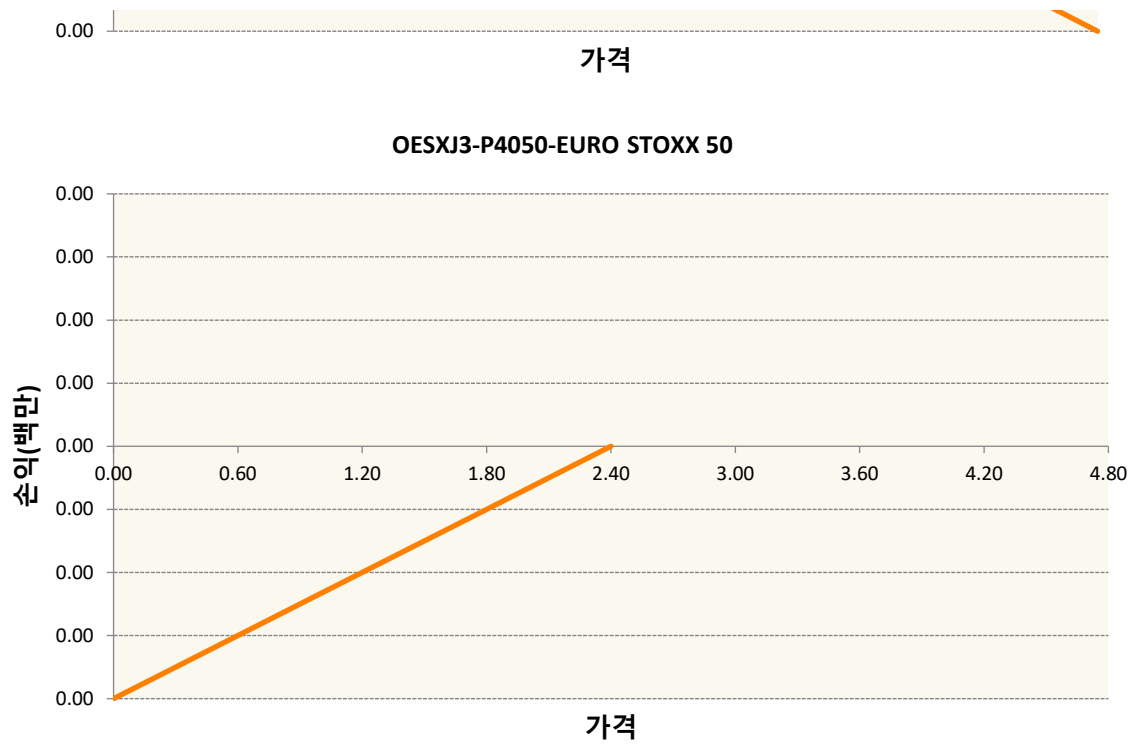
1. 계약금액

(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	963	0	963	
누계	유가증권	옵션	0	66	-66	장내
누계	통화	선도	1,049	1,725	-676	장외

2. 만기시점의 손익구조





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
FXW213D4B EUR/KRW 28-04-23E		12
FXW213D4C EUR/KRW 28-04-23E		72
OESXJ3-C40 EURO STOXX 50		2
OESXJ3-C40 EURO STOXX 50		3
OESXJ3-P40 EURO STOXX 50		0.02
OESXJ3-P40 EURO STOXX 50		0.04
VGM3 EURO STOXX 50 Jun23		77

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	318

공시일	2023-04-17
기준일	2023-04-14

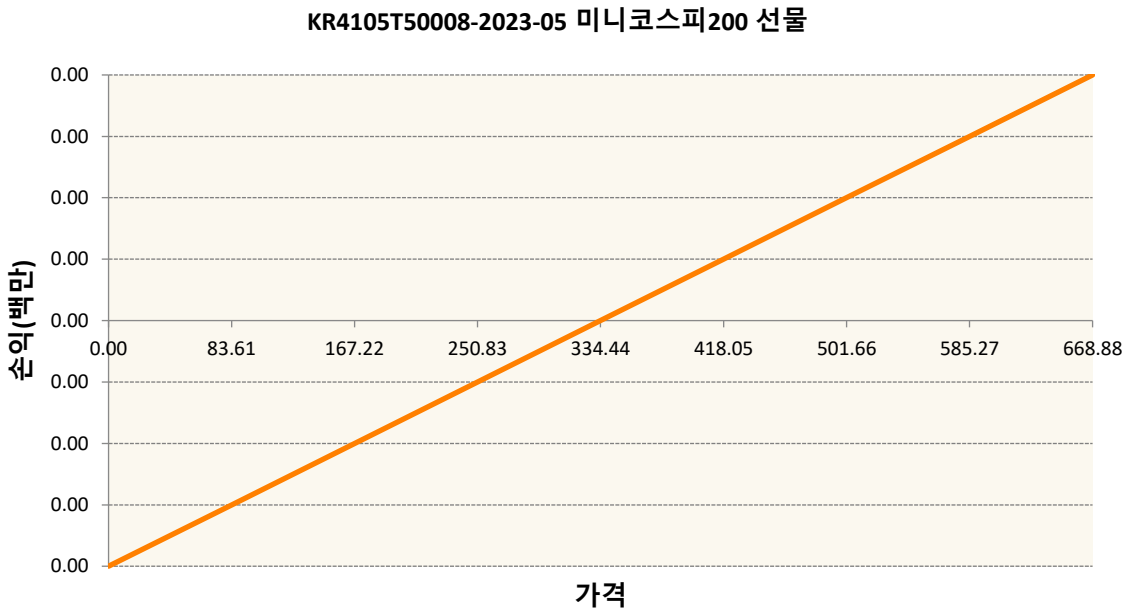
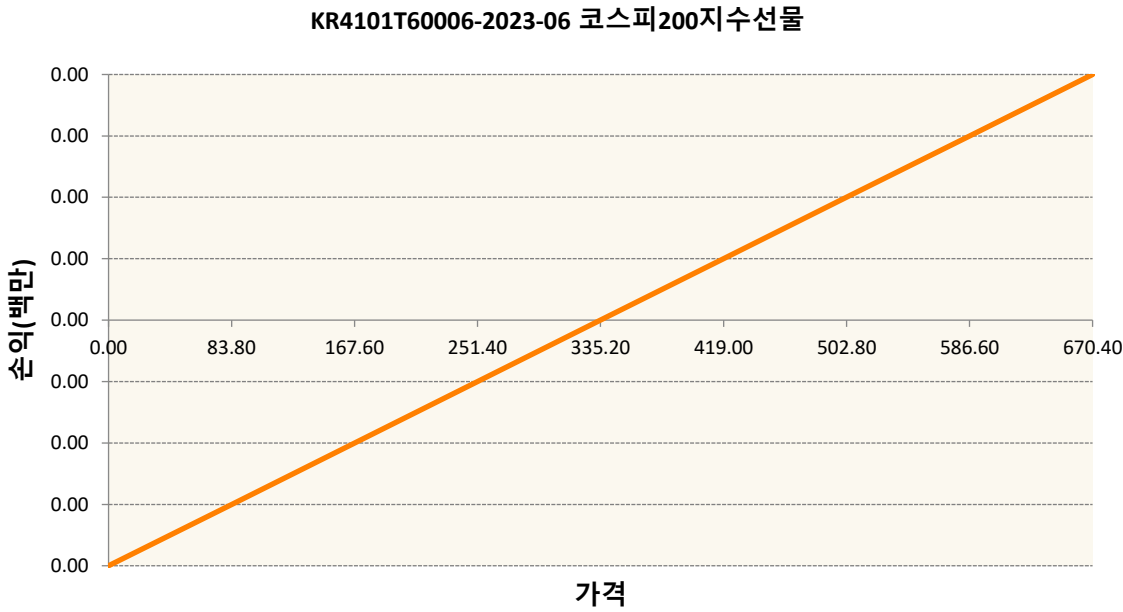
리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

1. 계약금액

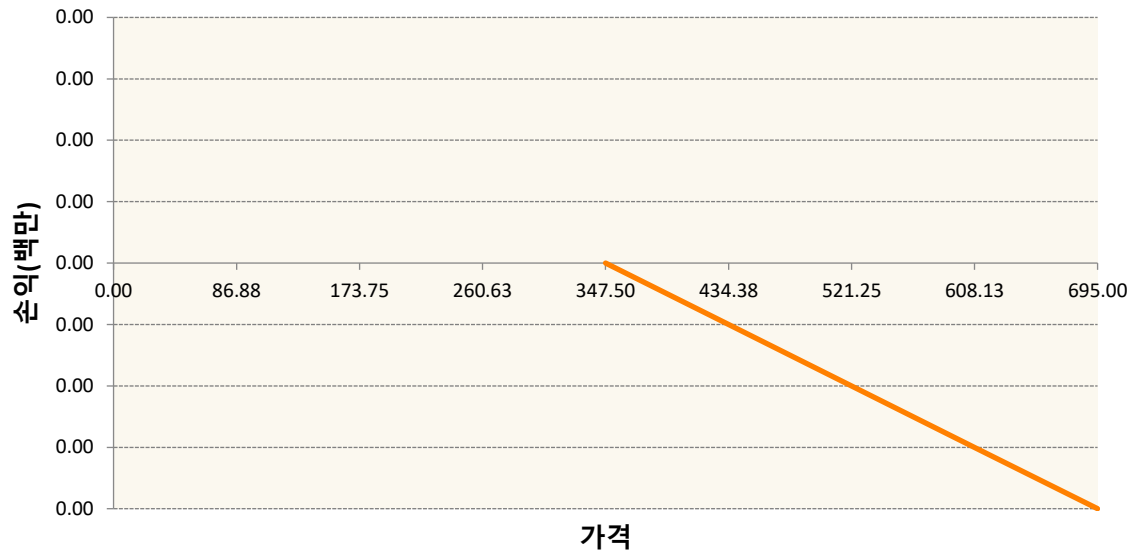
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	167	0	167	장내
신규	유가증권	옵션	2,420	2,368	52	장내
누계	유가증권	선물	586	0	586	장내
누계	유가증권	옵션	167	4,109	-3,943	장내

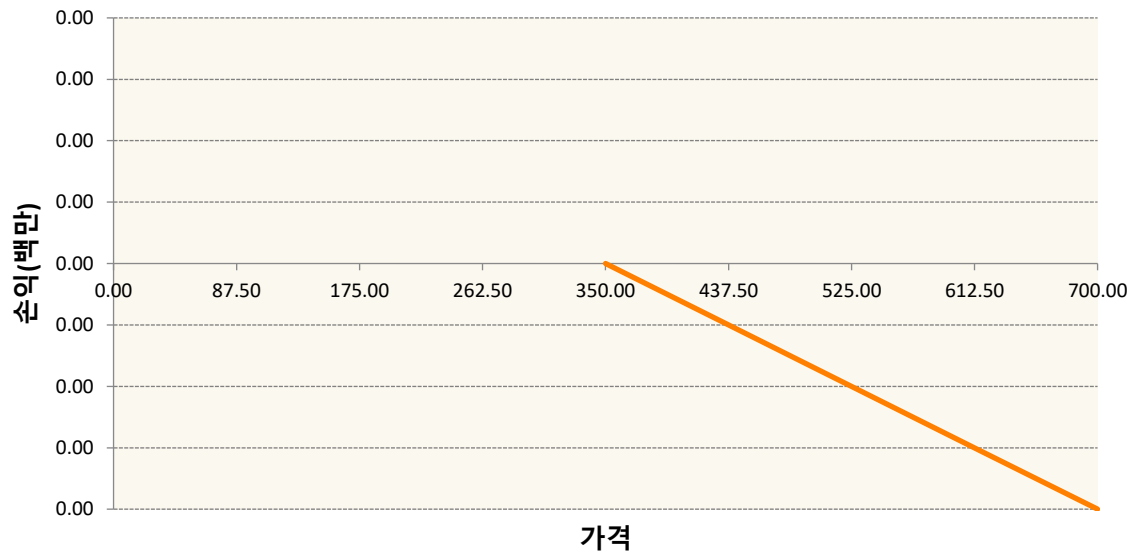
2. 만기시점의 손익구조



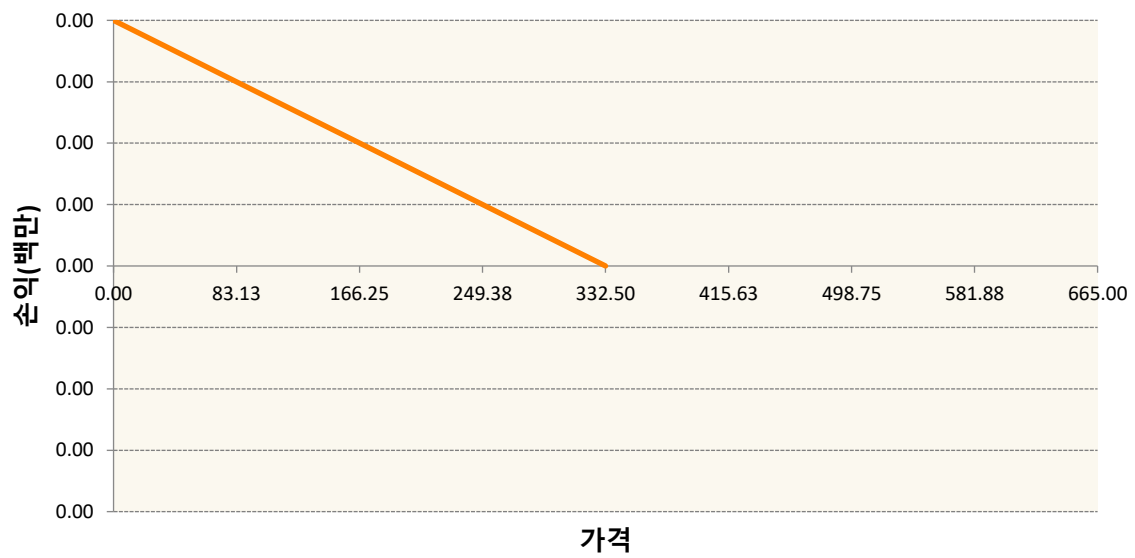
KR4201T53470-2023-05 콜347.5



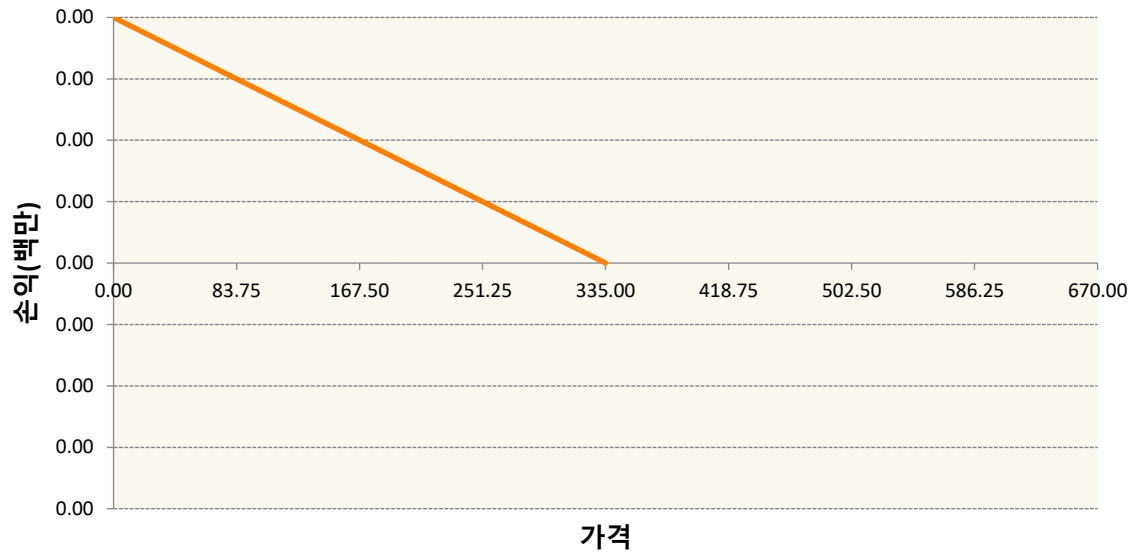
KR4201T53504-2023-05 콜350



KR4301T53320-2023-05 풋332.5



KR4301T53353-2023-05 풋335



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
KR4105T50008		2023-05 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
KR4201T53470		2023-05 콜347.5					20
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	5	5	5	4	4	4	4
-5.33%	5	4	4	4	3	3	3
-2.67%	4	4	3	2	2	1	1
0%	2	2	1	0	-1	-2	-2

2.67%	-1	-2	-3	-4	-5	-6	-7
5.33%	-7	-8	-9	-10	-11	-12	-13
8.00%	-15	-15	-16	-17	-18	-19	-20

KR4201T53504

2023-05 콜350

154

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	34	34	33	32	31	29	27
-5.33%	33	32	30	28	25	22	18
-2.67%	29	26	22	18	14	9	4
0%	17	12	6	0	-6	-13	-20
2.67%	-7	-15	-22	-30	-38	-45	-53
5.33%	-49	-57	-65	-74	-82	-90	-98
8.00%	-109	-116	-124	-131	-139	-146	-154

KR4301T53320

2023-05 풋332.5

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	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

KR4301T53353

2023-05 풋335

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

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

(단위:백만원)

187

공시일	2023-04-17
기준일	2023-04-14

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	6,702	0	6,702	

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	2023-04-17
기준일	2023-04-14

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	5,316	0	5,316	

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	2023-04-17
기준일	2023-04-14

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	18,565	0	18,565	
누계	통화	선도	649	18,931	-18,282	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)

3,475

공시일	2023-04-17
기준일	2023-04-14

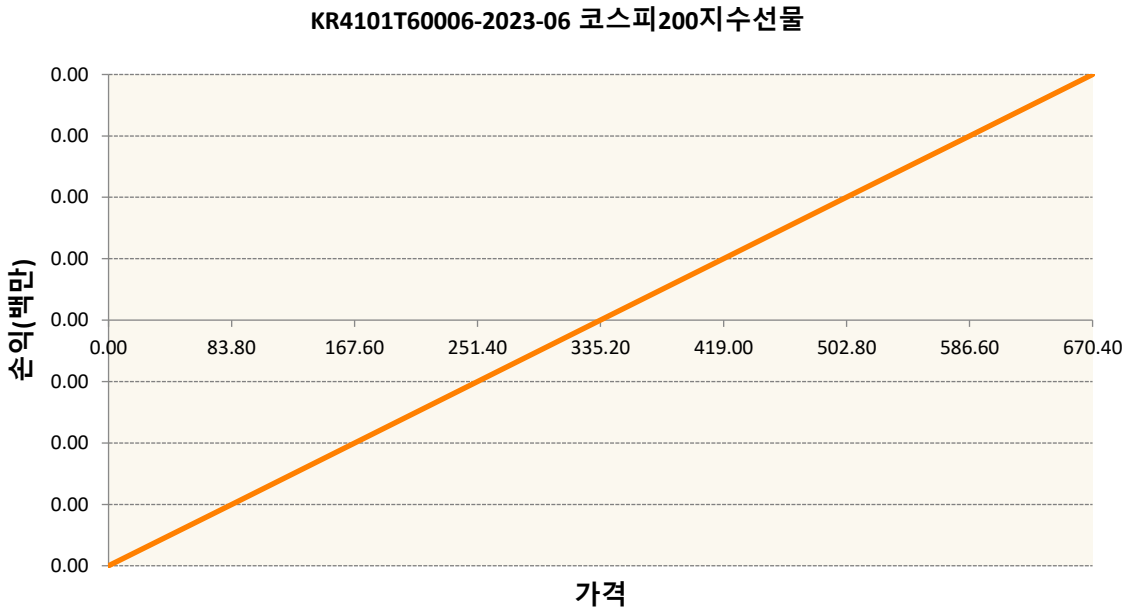
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	84	-84	장내
누계	유가증권	선물	1,006	0	1,006	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101T60006			2023-06 코스피200지수선물				80
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-80	-80	-80	-80	-80	-80	-80
-5.33%	-53	-53	-53	-53	-53	-53	-53
-2.67%	-27	-27	-27	-27	-27	-27	-27
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	27	27	27	27	27	27	27
5.33%	53	53	53	53	53	53	53
8.00%	80	80	80	80	80	80	80

공시일	2023-04-17
기준일	2023-04-14

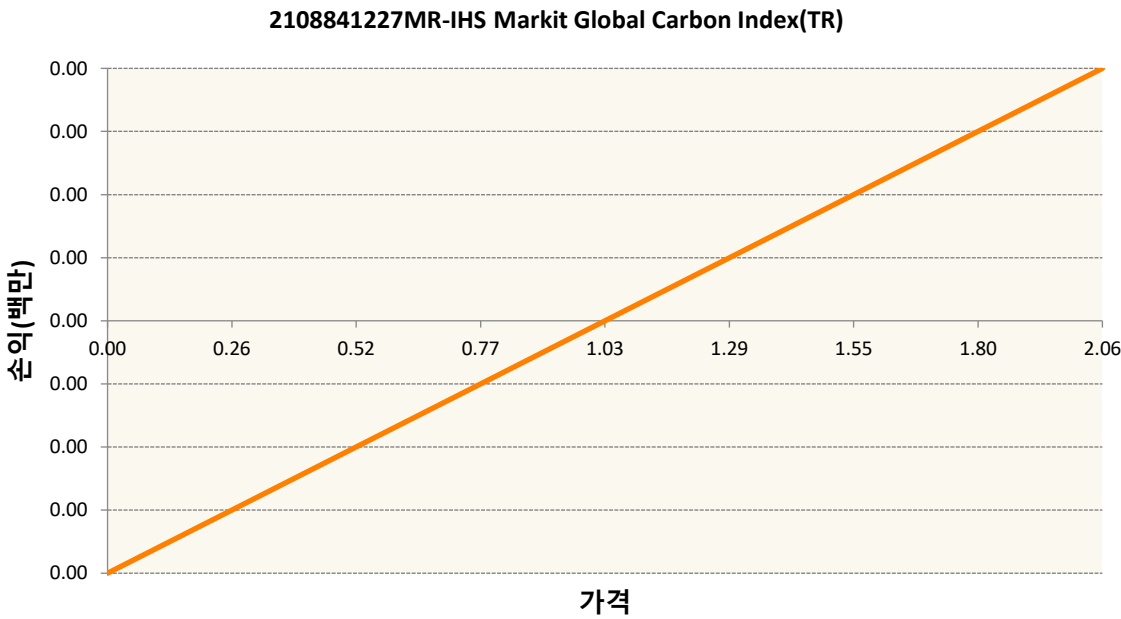
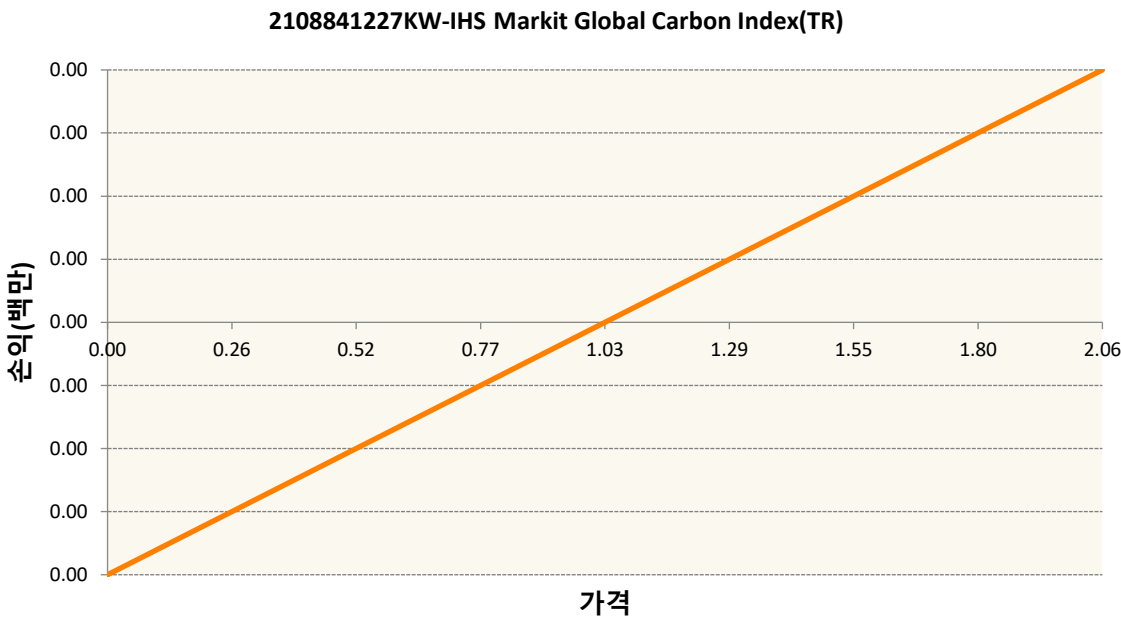
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

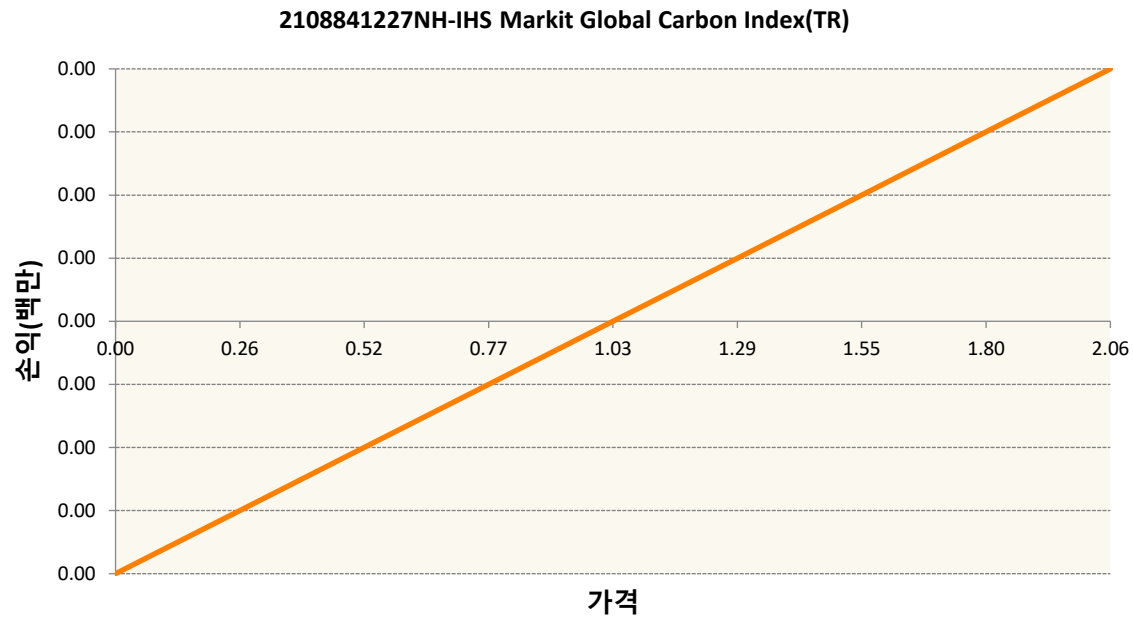
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	26,558	0	26,558	

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108841227IHS Markit Global Carbon Index(TR)		1,811
2108841227IHS Markit Global Carbon Index(TR)		213
2108841227IHS Markit Global Carbon Index(TR)		107

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)		(단위:백만원)
		3,693

공시일 2023-04-17

기준일 2023-04-14

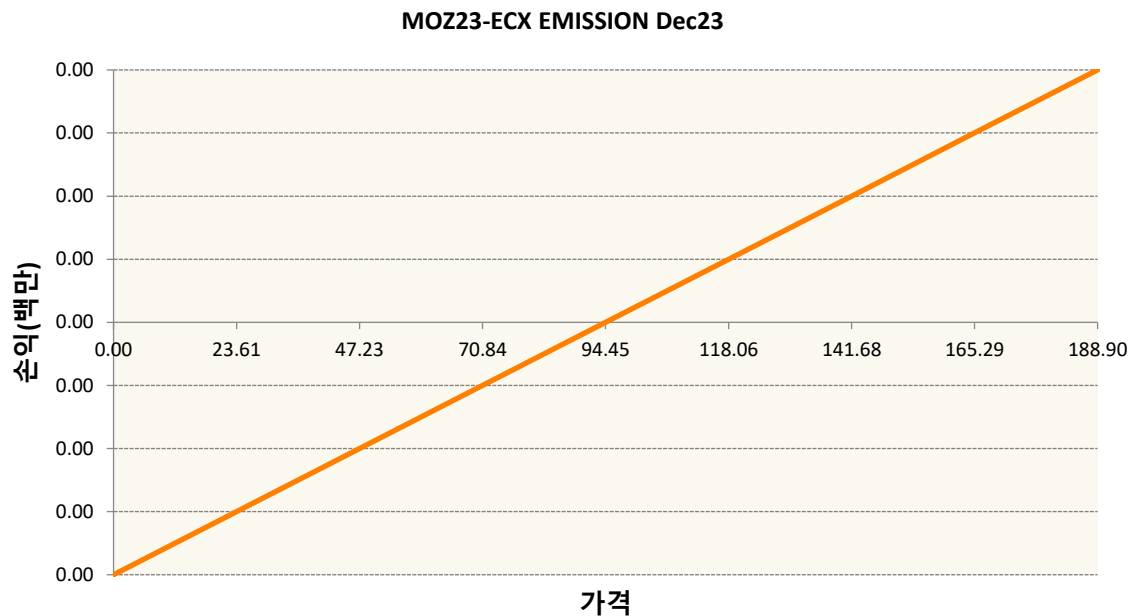
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	9,437	0	9,437	
누계	통화	선도	0	3,060	-3,060	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	63
FXW213D44I KRW/EUR 28-04-23E	55
MOZ23 ECX EMISSION Dec23	755

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

(단위:백만원)

1,501

공시일	2023-04-17
기준일	2023-04-14

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)	1
SWCSI00000 신한CSI Index 221222 (미래)	1
SWCSI00000 신한CSI Index 221222 (메리츠)	1

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

(단위:백만원)

7

공시일	2023-04-17
기준일	2023-04-14

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)	7
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 230116(메리츠)	10
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 230116(미래)	8
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 230116(키움)	7

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

(단위:백만원)

55

공시일	2023-04-17
기준일	2023-04-14

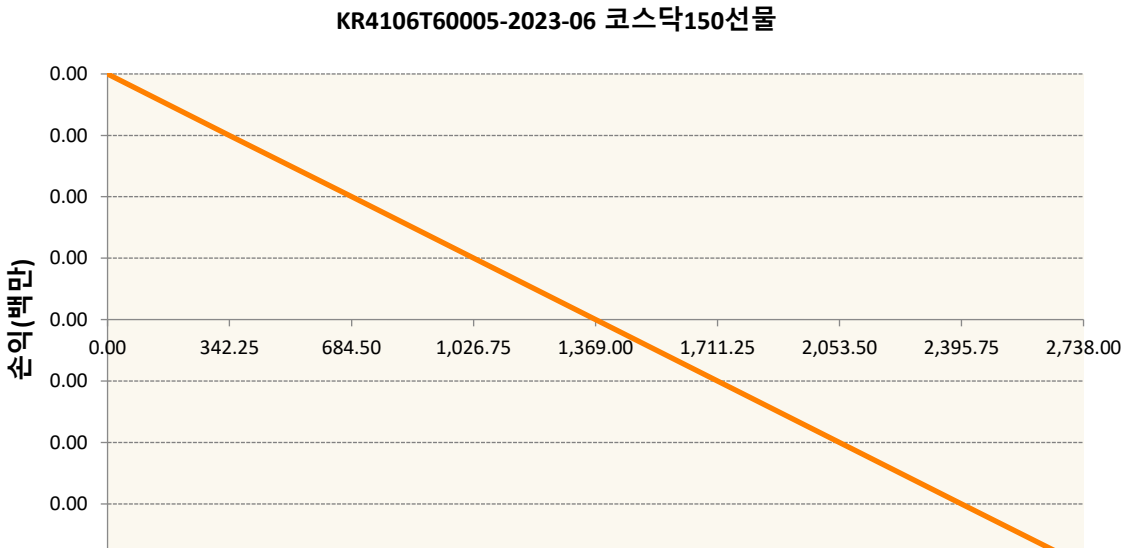
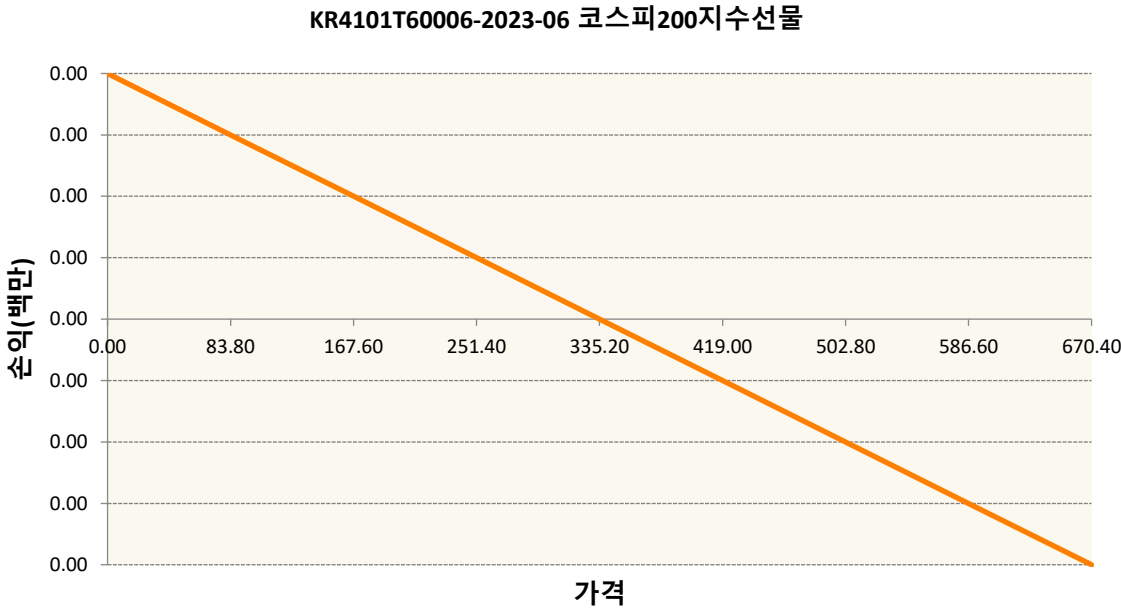
에퀴티알파일반사모혼합자산

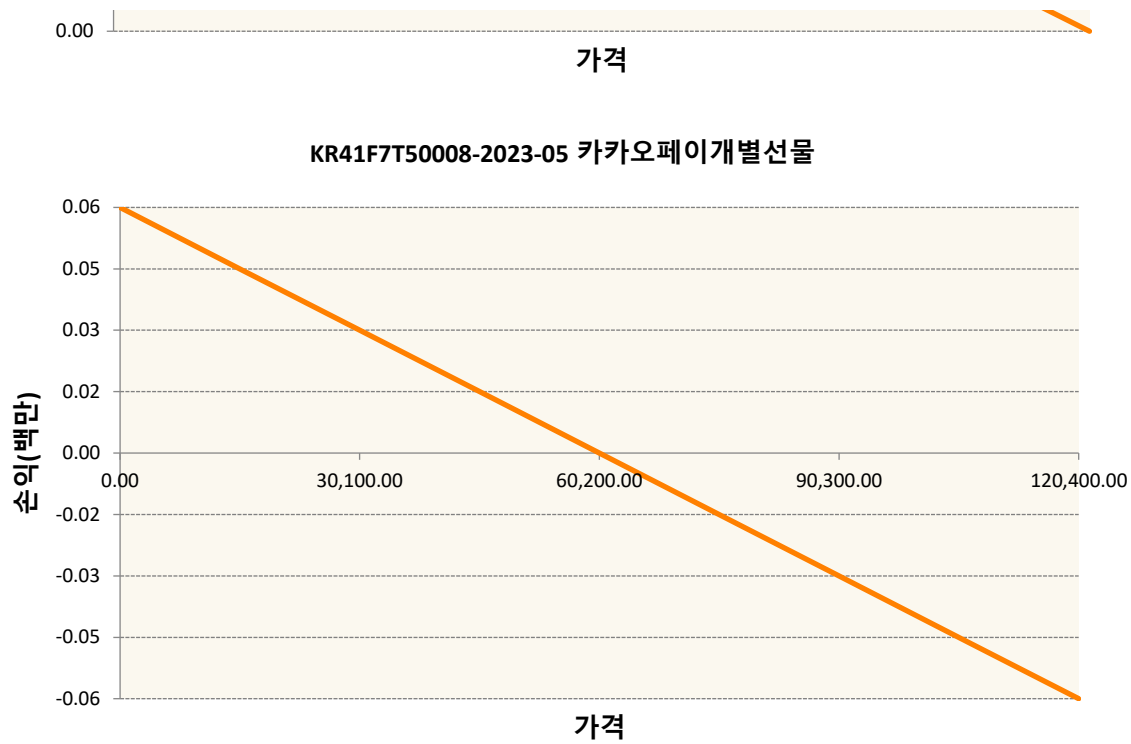
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규			0	0	0	
신규	유가증권	선물	89	0	89	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
누계			5	0	5	
누계	유가증권	선물	0	3,332	-3,332	장내
누계	유가증권	스왑	0	0	0	장외

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101T600 2023-06 코스피200지수선물	134
KR4106T600 2023-06 코스닥150선물	120
KR41F7T500 2023-05 카카오페이개별선물	12
KRS0004054 SWAP_MICROSOFT CP_0221	1
KRS0004099 SWAP_MICRON TECH_0308	2
KRS0004212 SWAP_SPDR S&P BIOTECH_0413	0.39

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

(단위:백만원)

공시일	2023-04-17
기준일	2023-04-14

코리아인덱스(주식-파생형)(종)

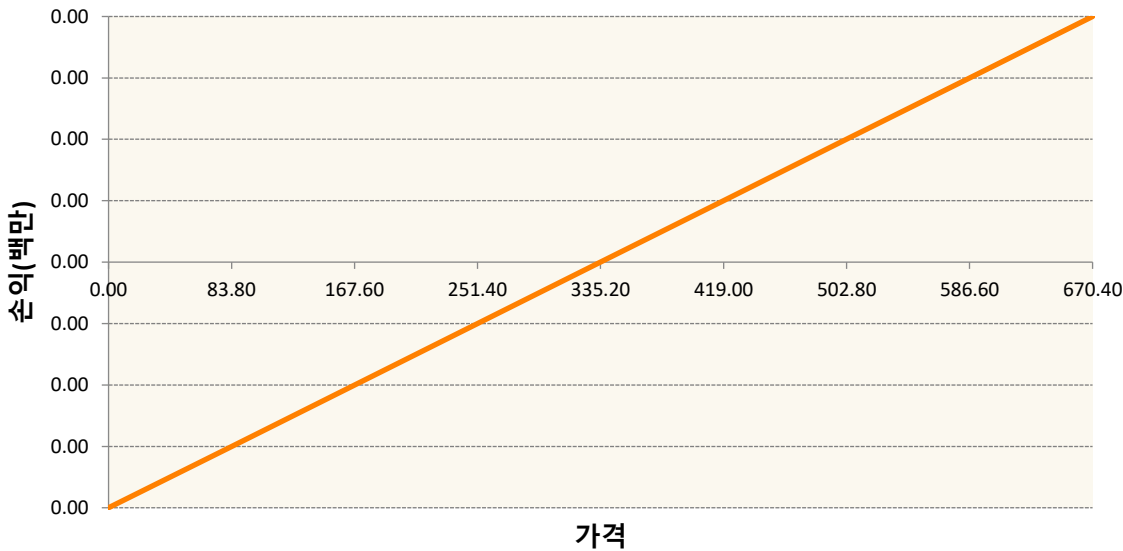
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	168	-168	장내
누계	유가증권	선물	2,263	0	2,263	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101T60006-2023-06 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101T60006		2023-06 코스피200지수선물					180
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-180	-180	-180	-180	-180	-180	-180
-5.33%	-120	-120	-120	-120	-120	-120	-120
-2.67%	-60	-60	-60	-60	-60	-60	-60
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	60	60	60	60	60	60	60
5.33%	120	120	120	120	120	120	120
8.00%	180	180	180	180	180	180	180

공시일	2023-04-17
기준일	2023-04-14

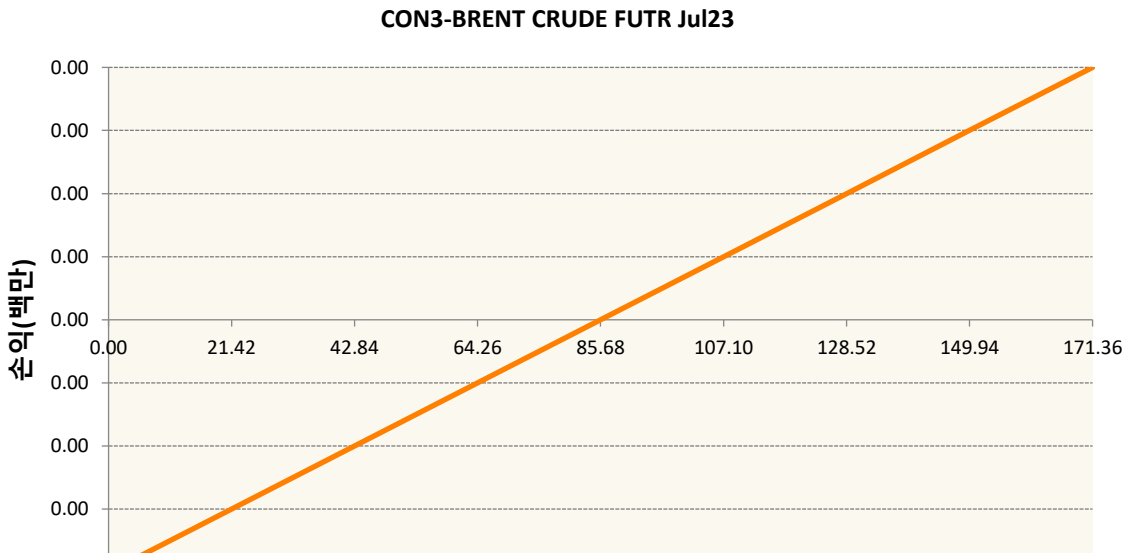
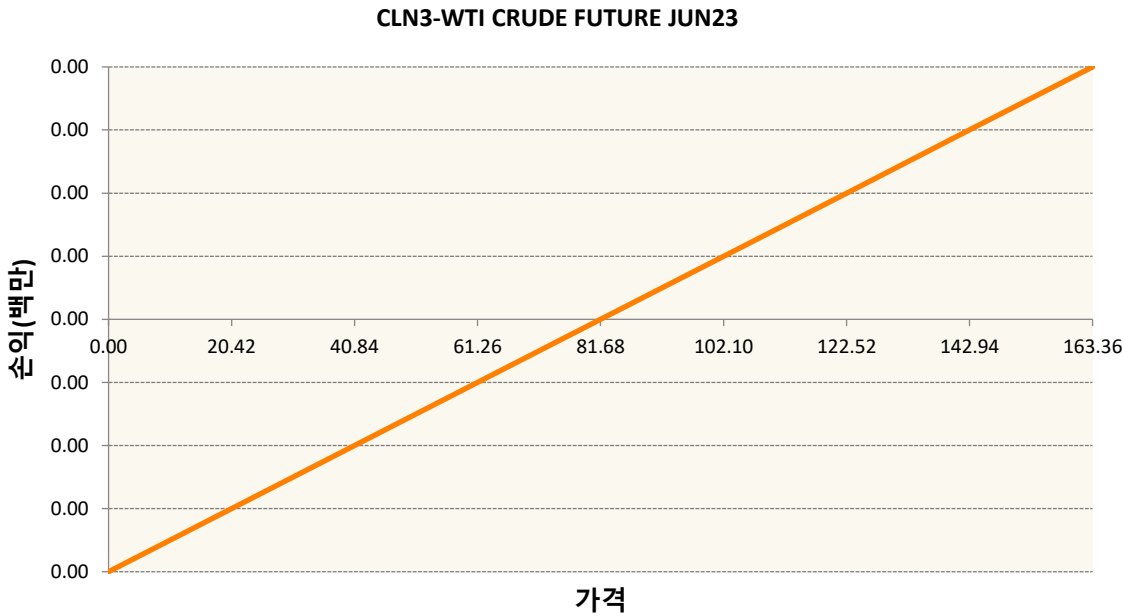
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

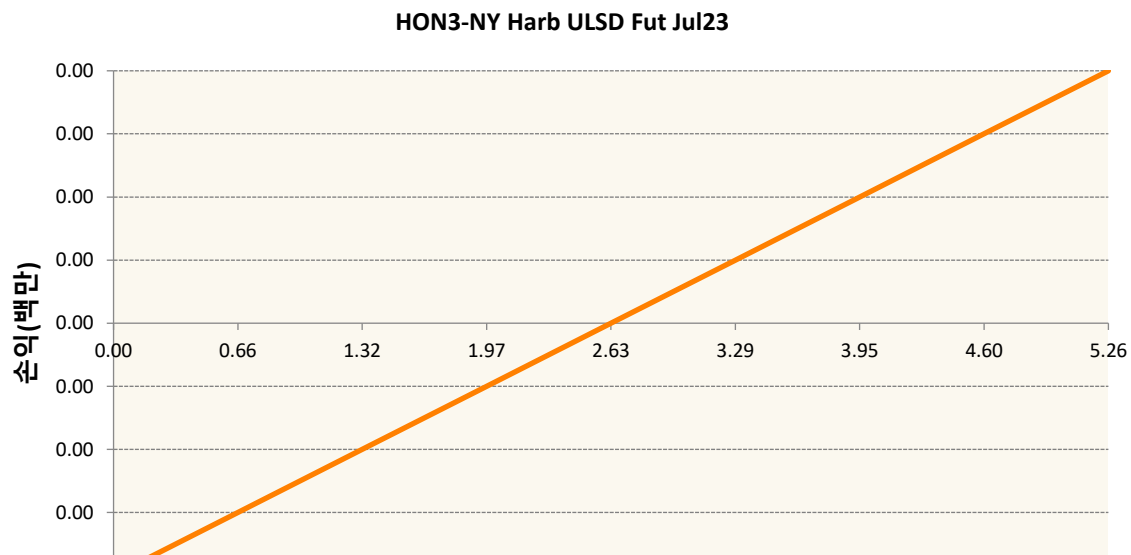
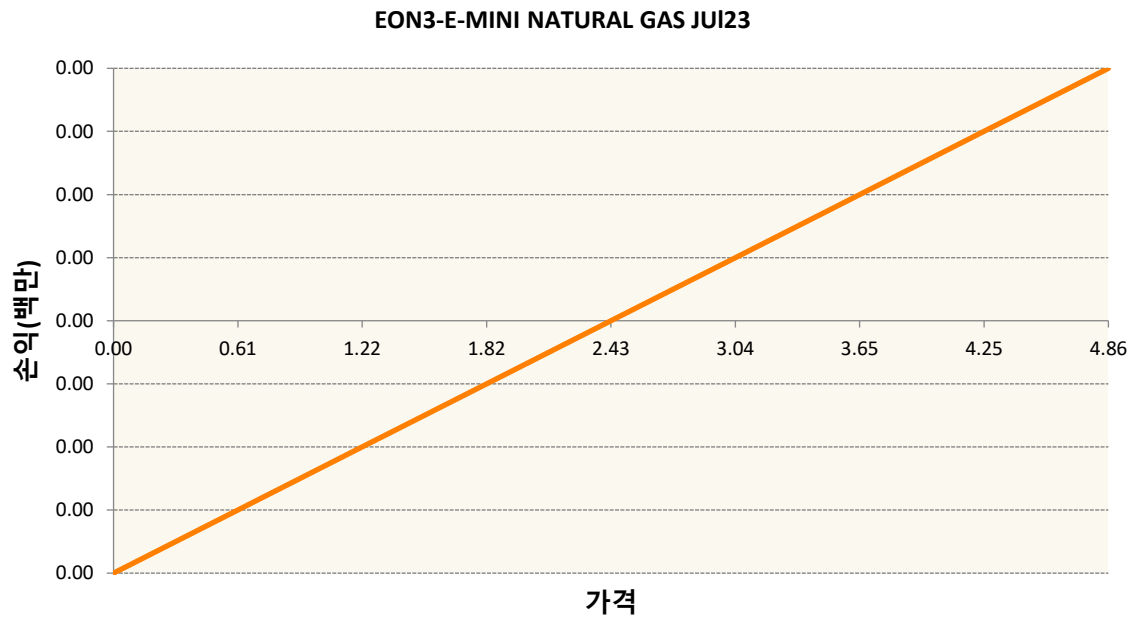
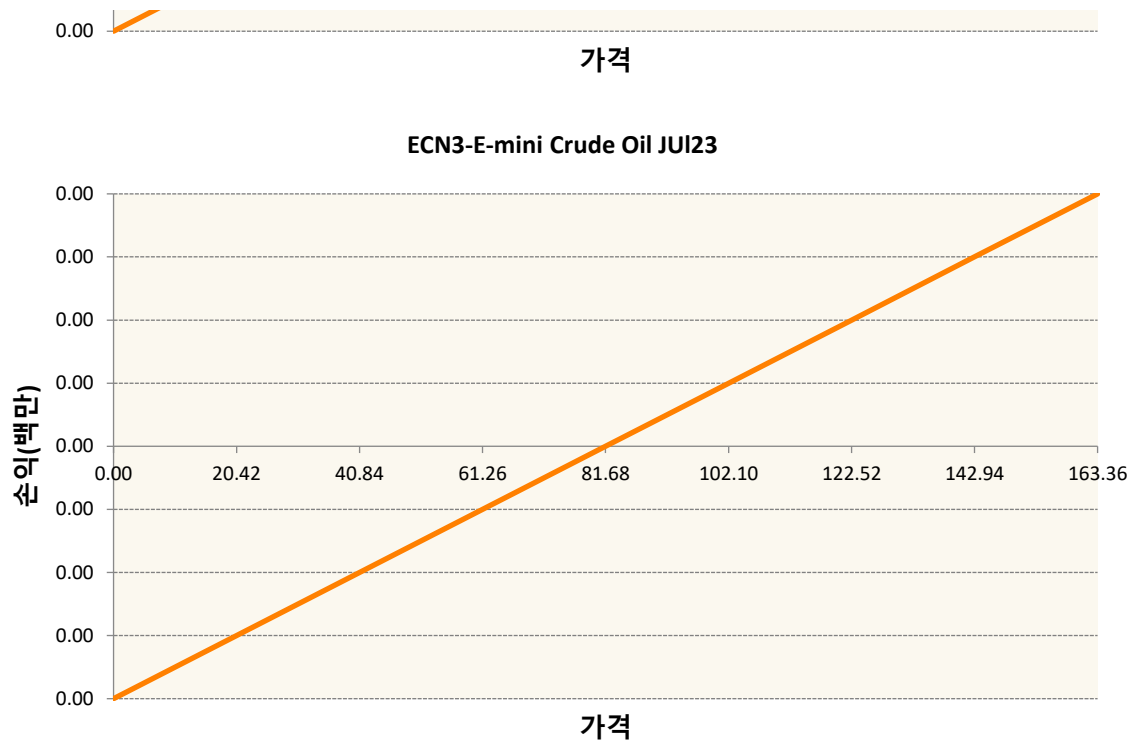
1. 계약금액

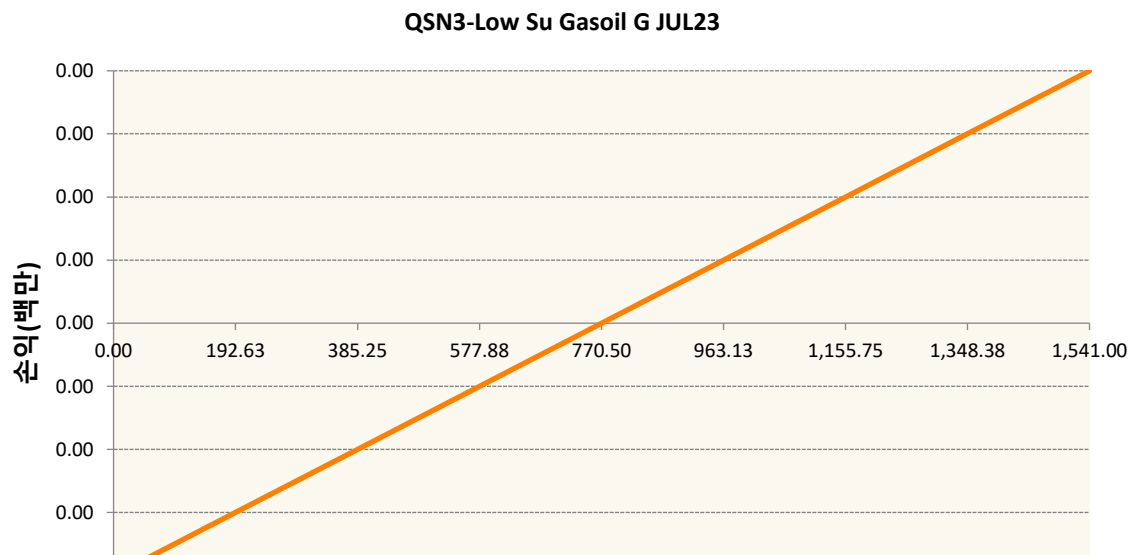
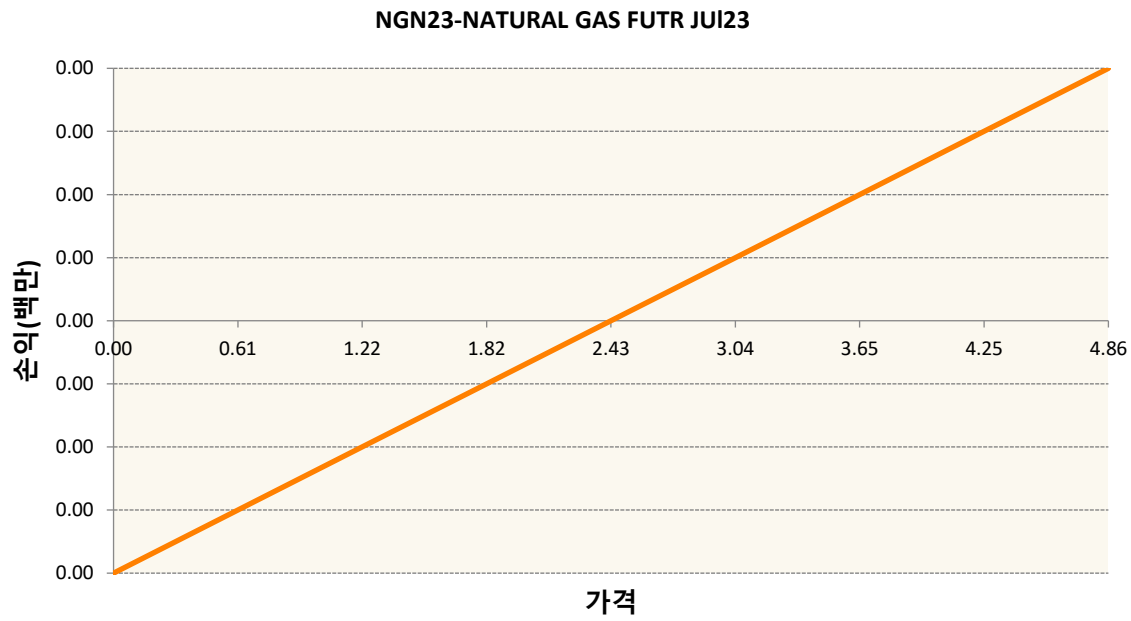
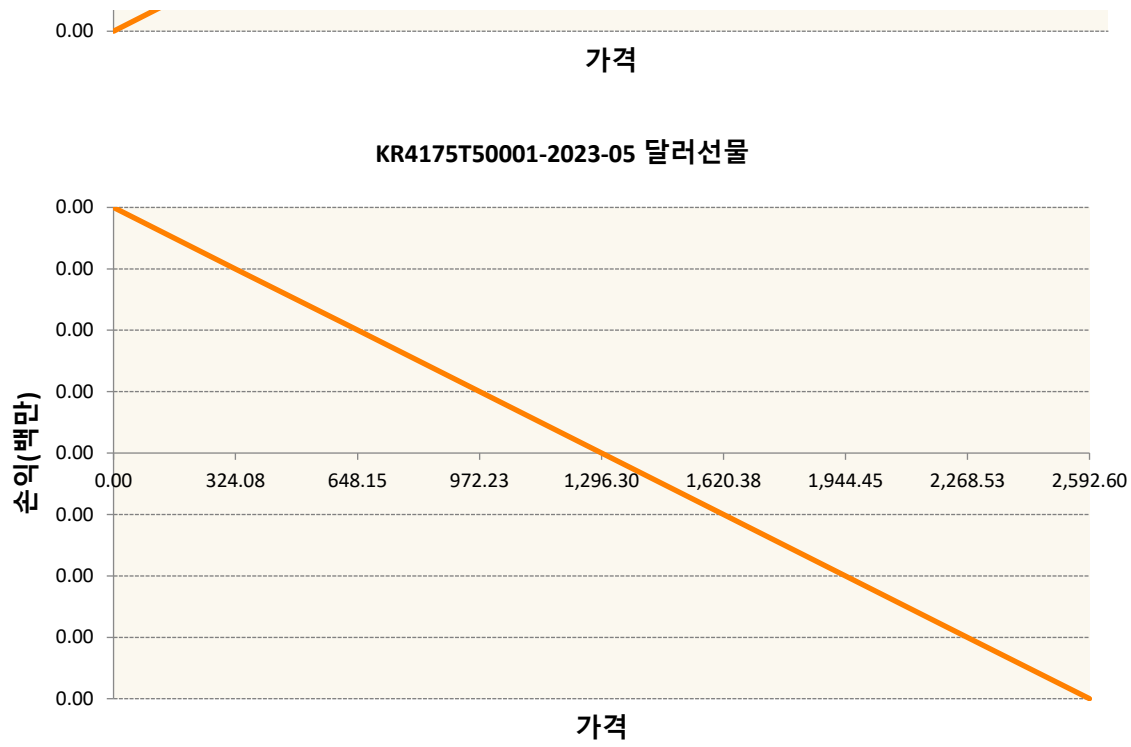
(단위:백만원)

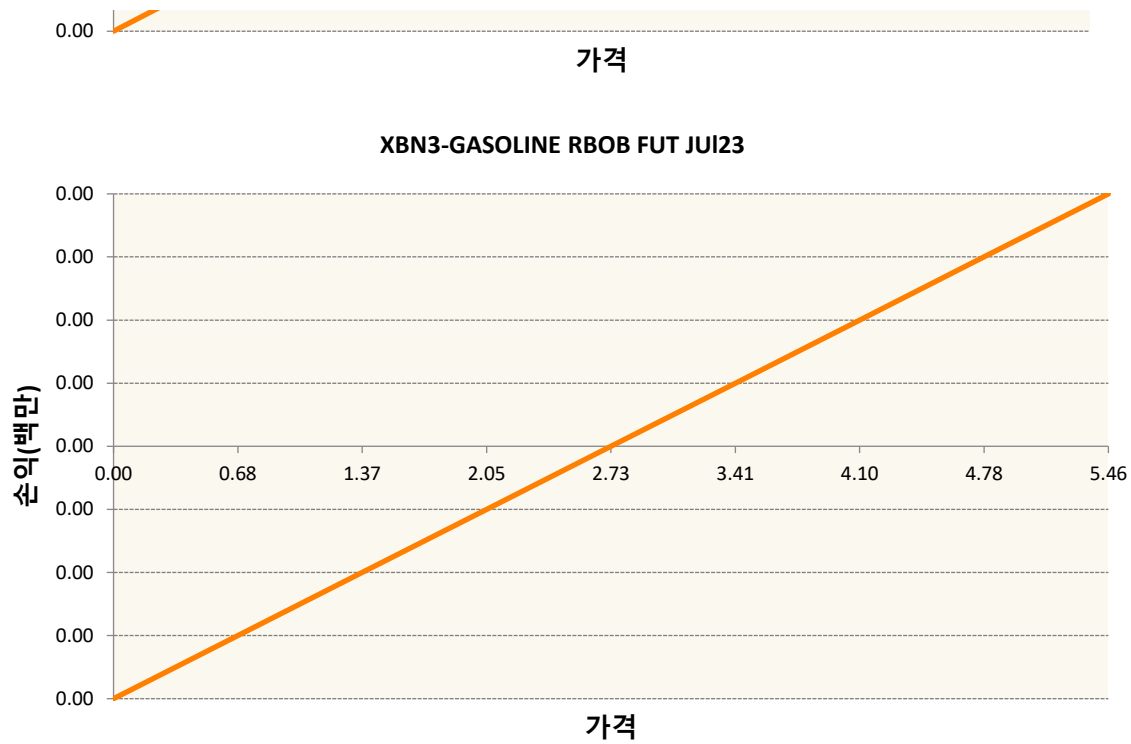
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규			0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	195	-195	장내
누계			567	0	567	
누계	유가증권	선물	919	0	919	
누계	통화	선물	0	194	-194	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
CLN3	WTI CRUDE FUTURE JUN23		26
CON3	BRENT CRUDE FUTR Jul23		36
ECN3	E-mini Crude Oil JUL23		4
EON3	E-MINI NATURAL GAS JUL23		1
HON3	NY Harb ULSD Fut Jul23		12
KR4175T500	2023-05 달러선물		16
NGN23	NATURAL GAS FUTR JUL23		20
QSN3	Low Su Gasoil G JUL23		8
XBN3	GASOLINE RBOB FUT JUL23		12

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)		(단위:백만원)
		233