

공시일	2023-04-20
기준일	2023-04-19

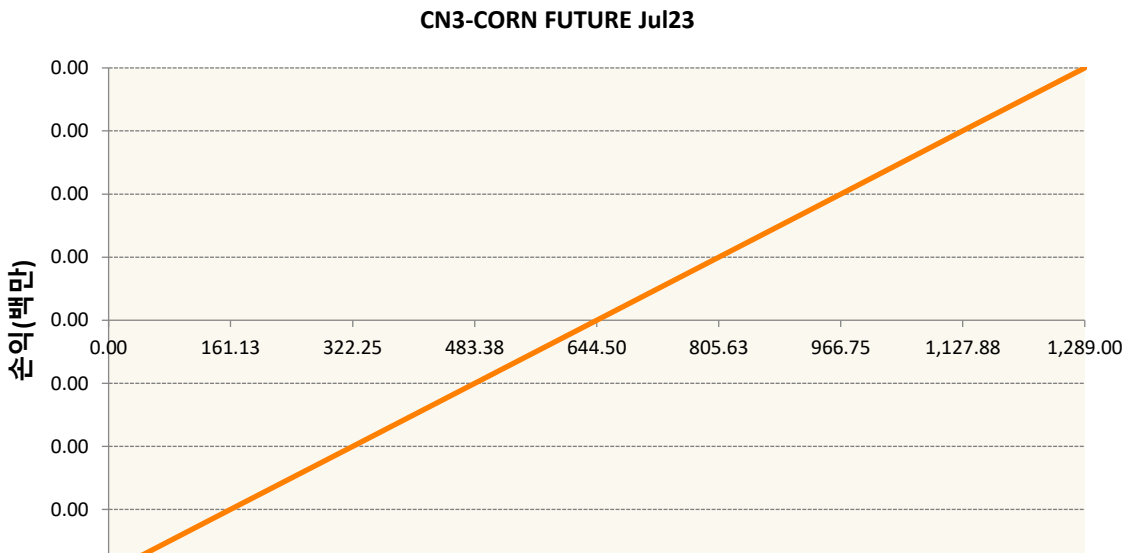
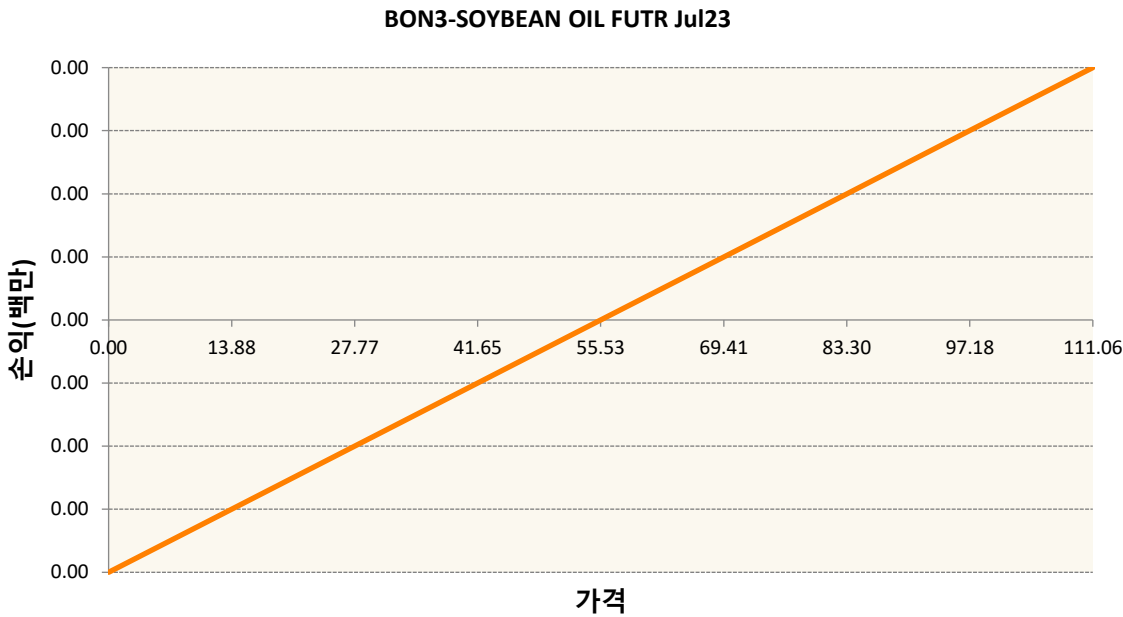
포커스농산물모(채권-파생형)

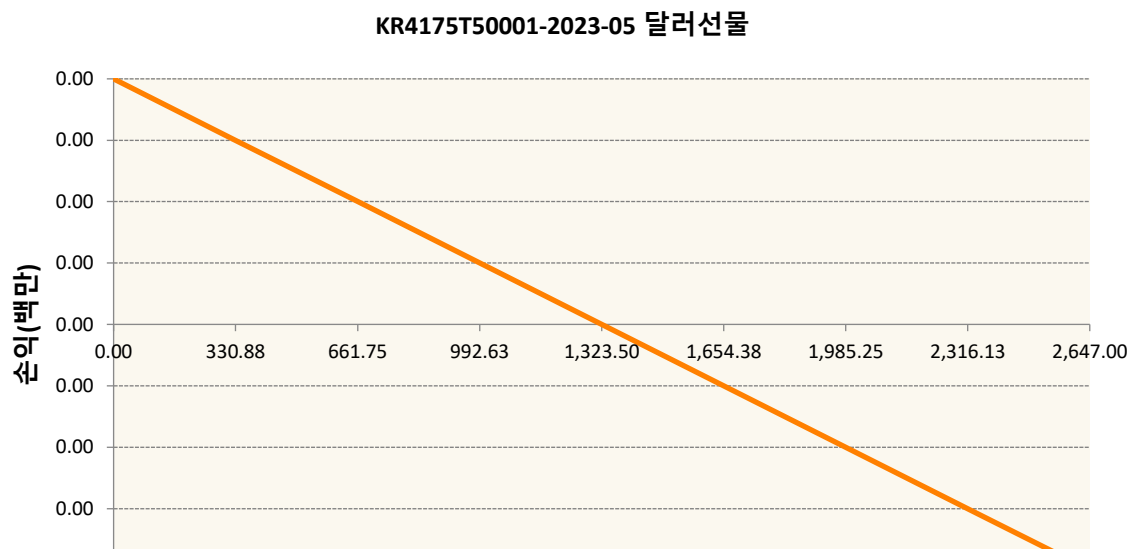
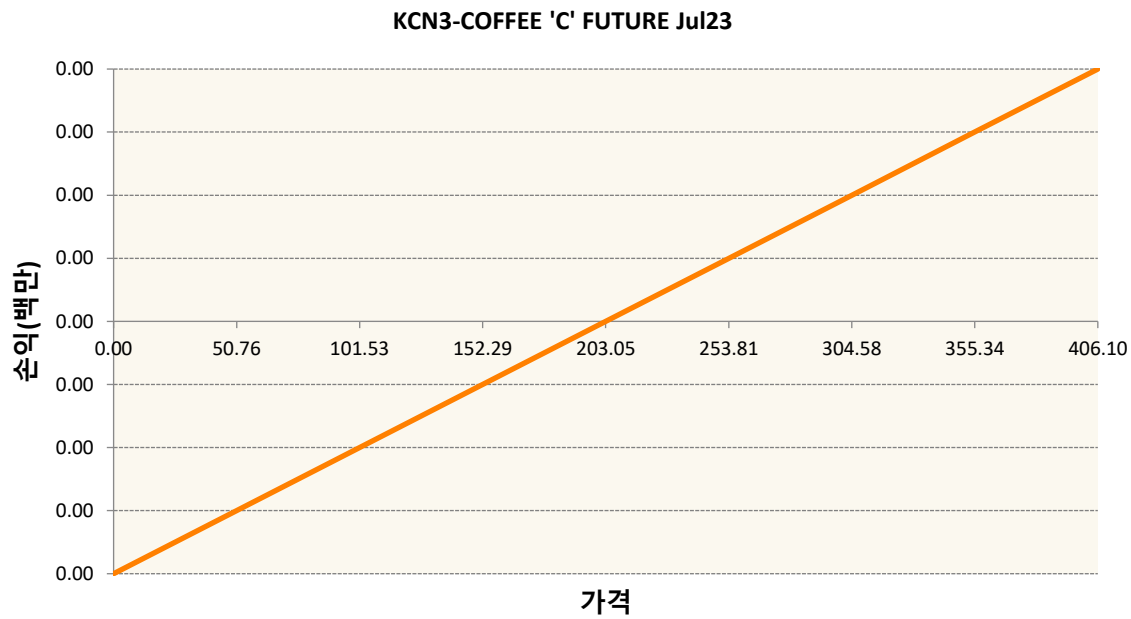
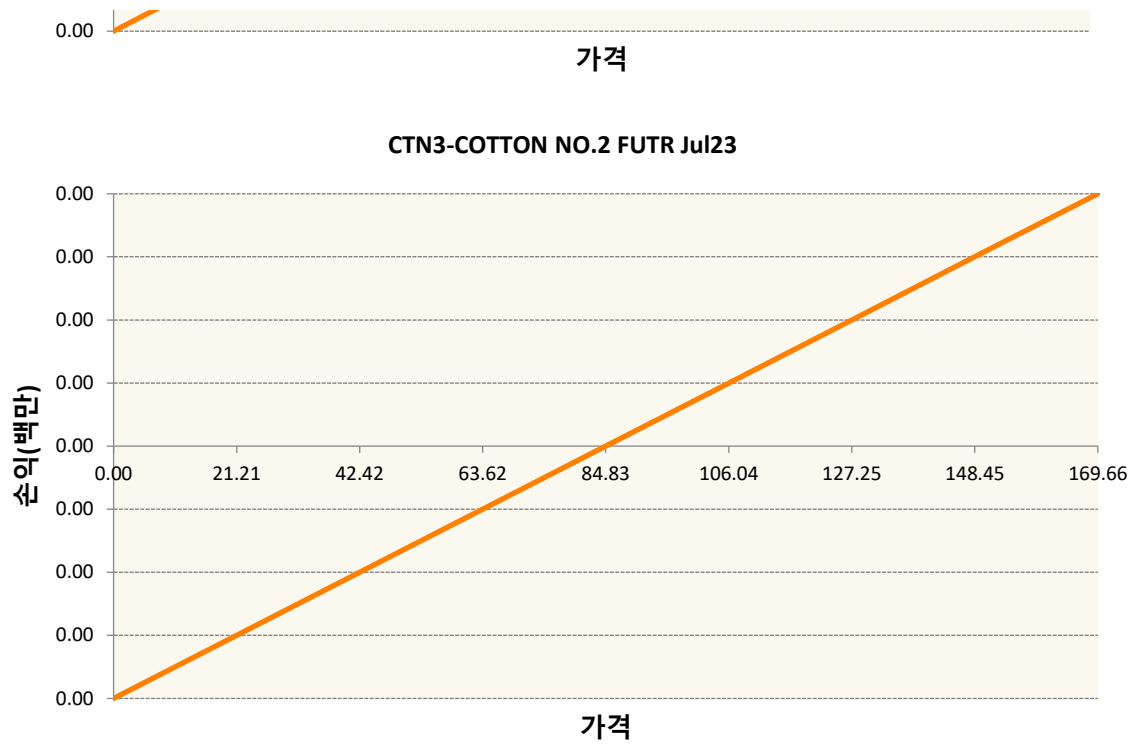
1. 계약금액

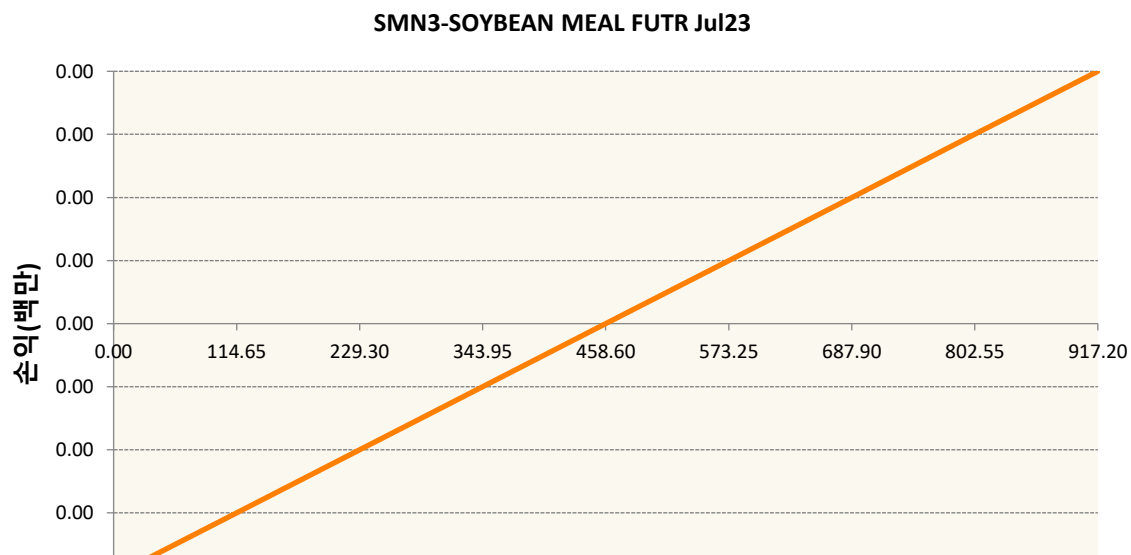
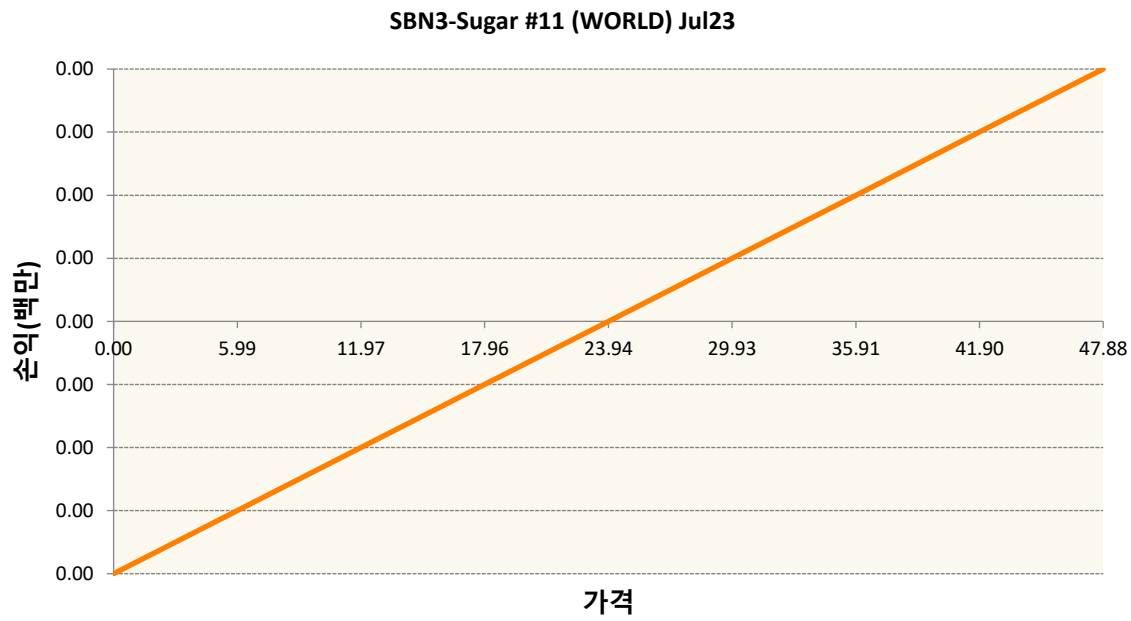
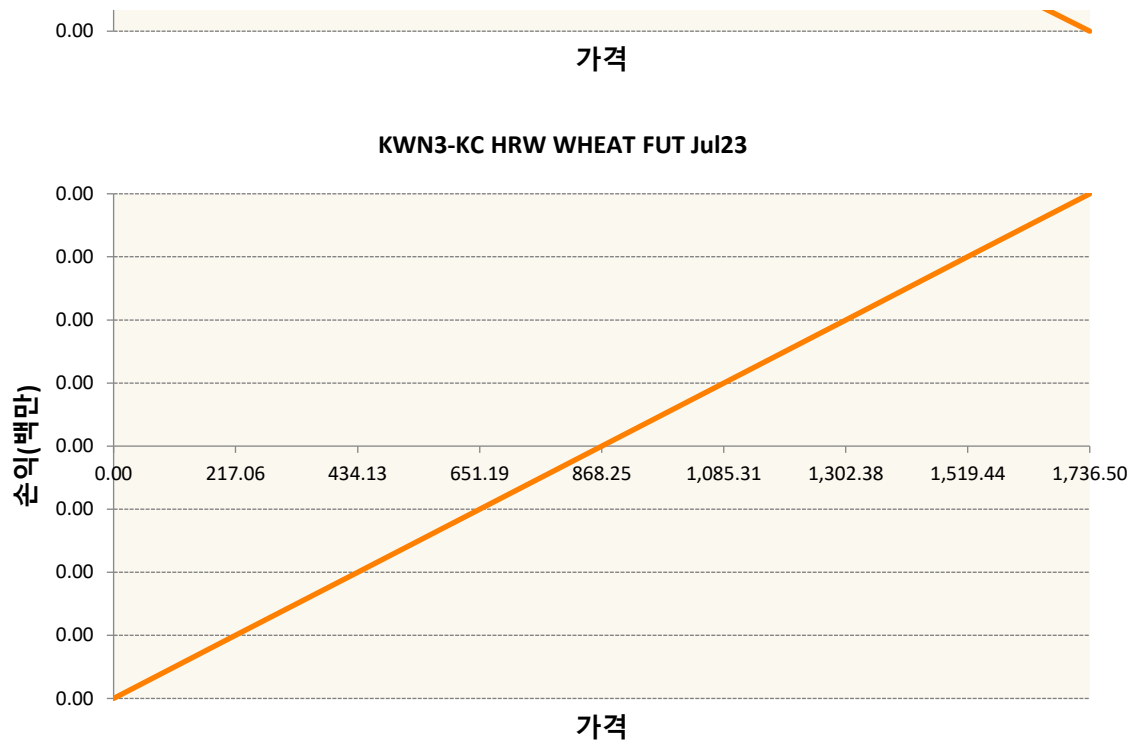
(단위:USD 백만)

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	0	0	장내
누계			334	0	334	
누계	유가증권	선물	5,659	0	5,659	
누계	통화	선물	0	529	-529	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	2023-04-20
기준일	2023-04-19

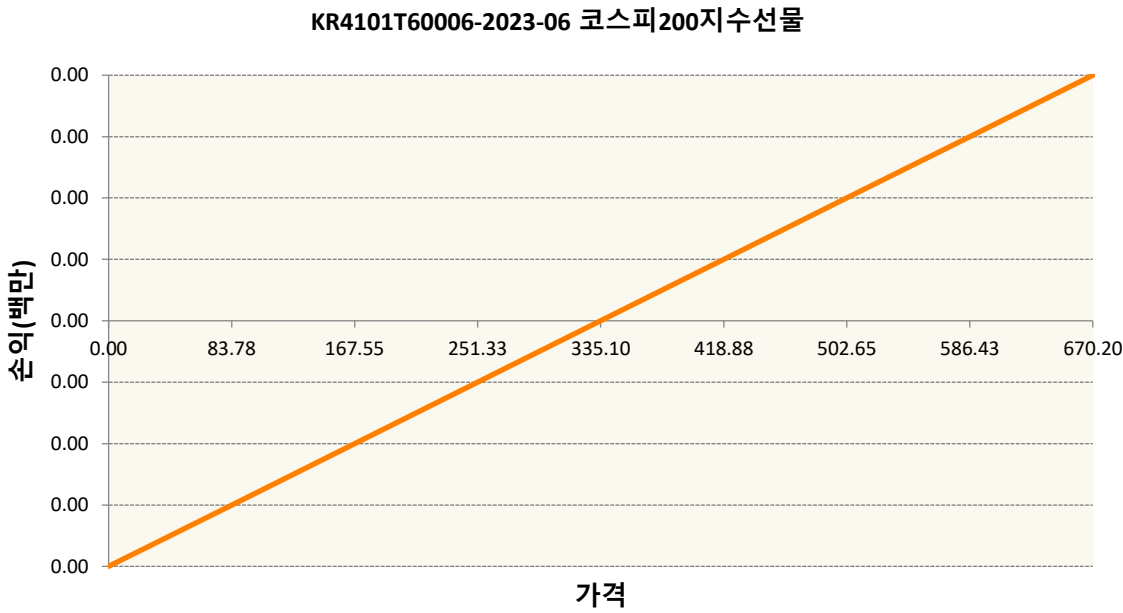
스마트인덱스모

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	2,346	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	2023-04-20
기준일	2023-04-19

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

377

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

652

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2023-04-20
기준일	2023-04-19

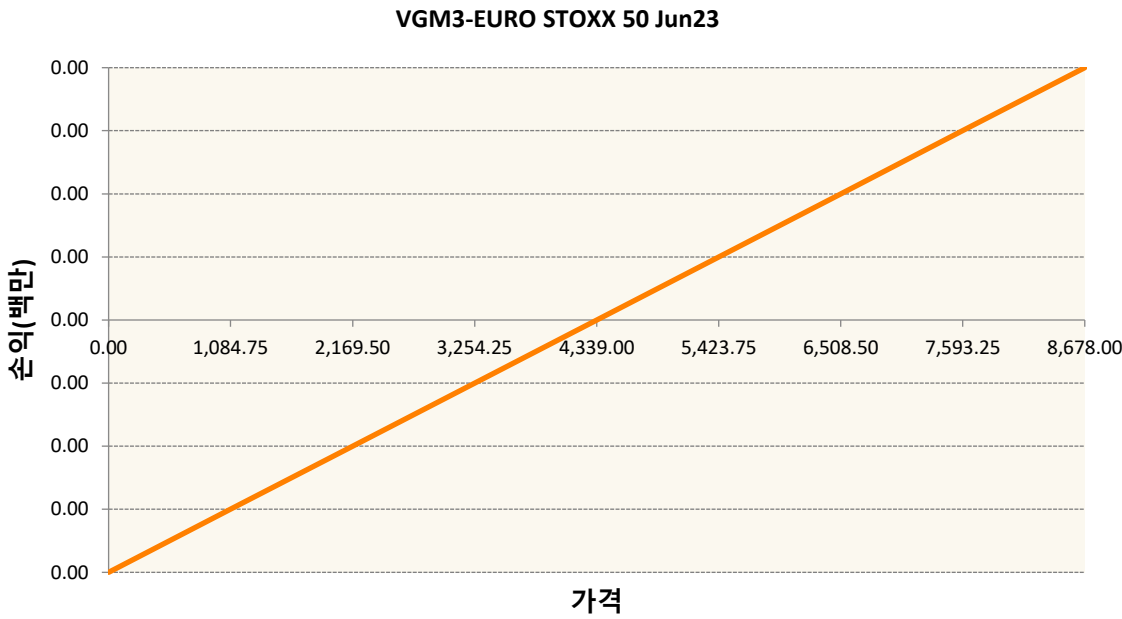
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	364	0	364	

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	2023-04-20
기준일	2023-04-19

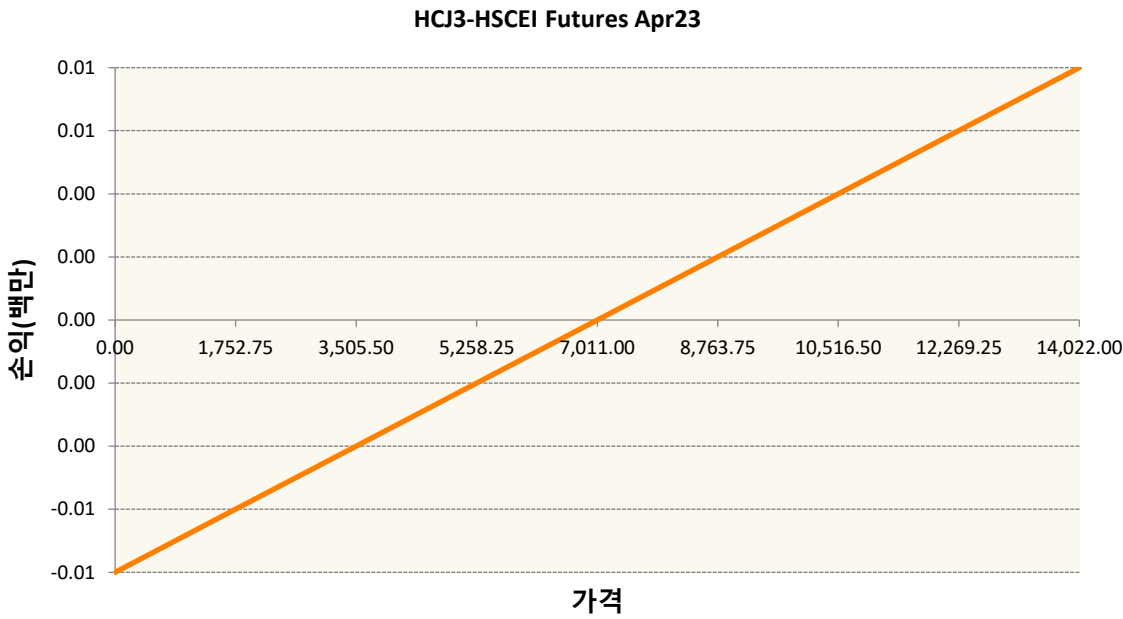
차이나인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,049	0	1,049	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCI3	HSCEI Futures Apr23	84
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

145

공시일	2023-04-20
기준일	2023-04-19

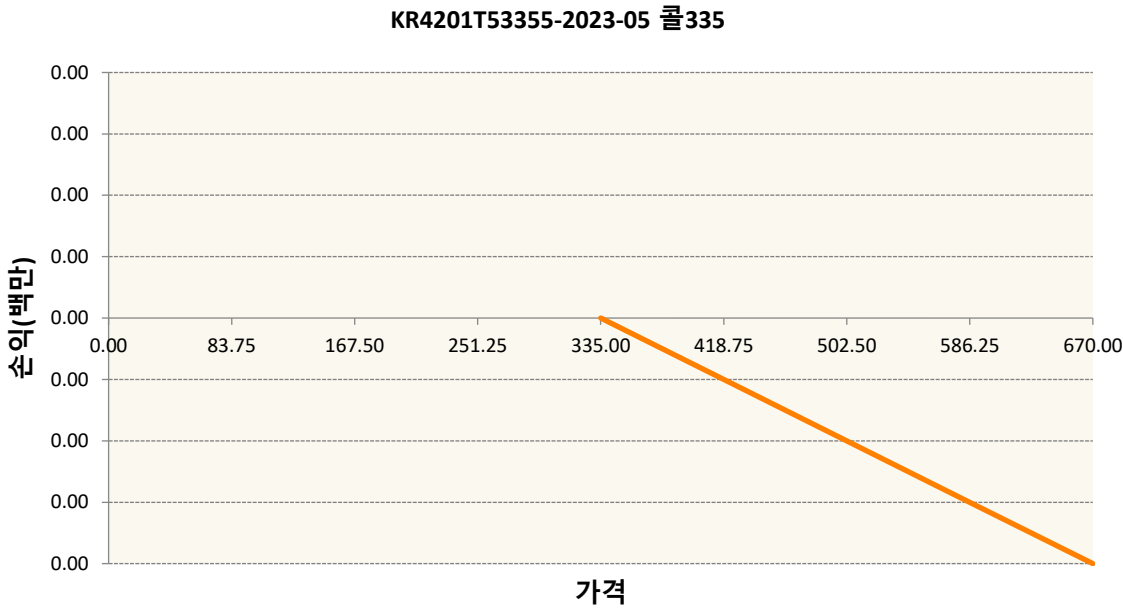
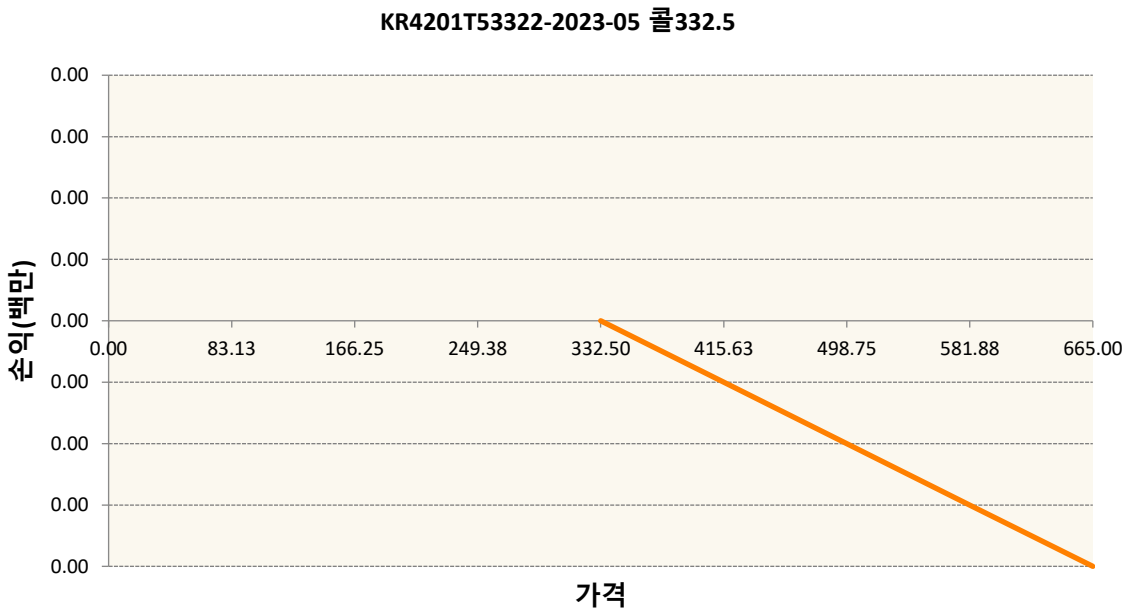
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

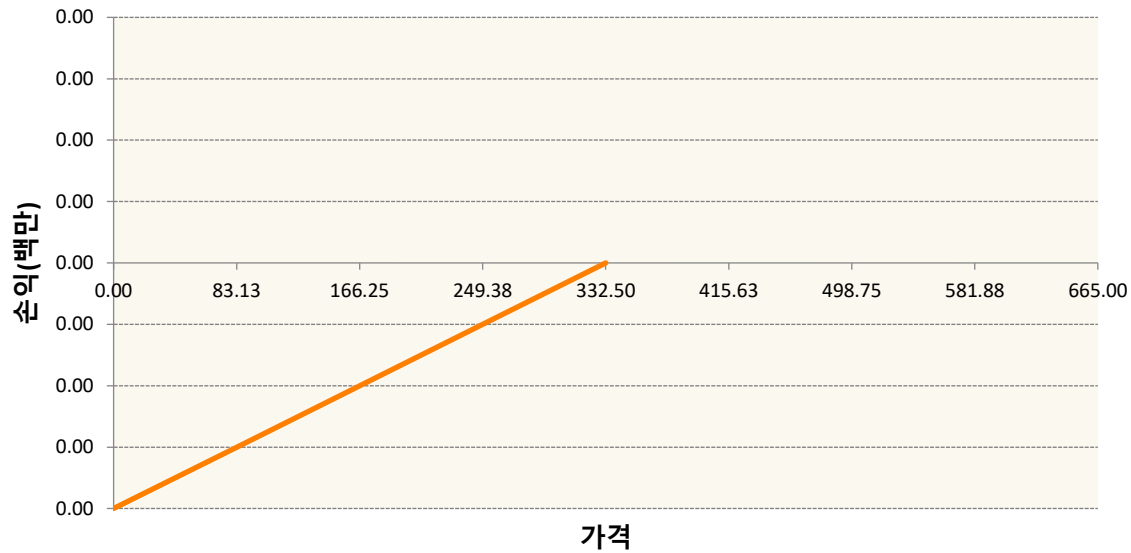
(단위:백만원)

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

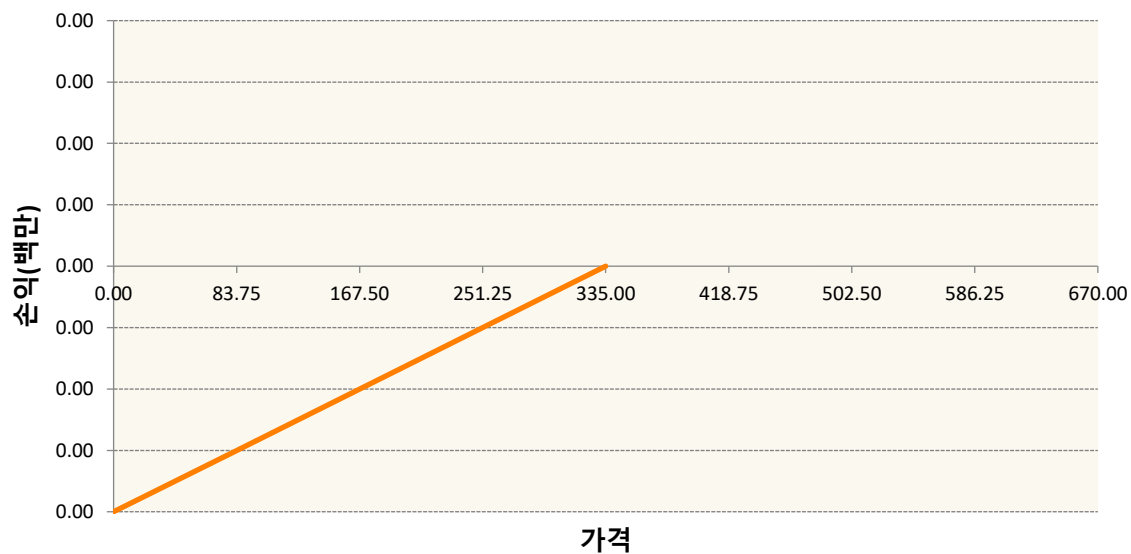
2. 만기시점의 손익구조



KR4301T53320-2023-05 푼332.5



KR4301T53353-2023-05 쪽335



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201T53322		2023-05 콜332.5					2,355
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	942	924	902	874	842	807	768
-5.33%	861	820	775	726	674	620	564
-2.67%	644	579	513	446	378	310	241
0%	220	146	73	0	-73	-147	-220
2.67%	-430	-490	-553	-617	-683	-750	-818
5.33%	-1,253	-1,291	-1,333	-1,379	-1,429	-1,483	-1,538
8.00%	-2,177	-2,194	-2,217	-2,245	-2,278	-2,315	-2,355
KR4201T53355		2023-05 콜335					602
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	217	213	208	202	195	187	178
-5.33%	201	192	182	170	158	144	130
-2.67%	155	139	123	106	89	71	54
0%	59	39	20	0	-20	-39	-59
2.67%	-98	-116	-134	-152	-170	-189	-208
5.33%	-306	-318	-331	-345	-360	-375	-391
8.00%	-546	-552	-559	-568	-578	-590	-602
KR4301T53320 2023-05 풋332.5							345

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-318	-321	-324	-329	-334	-339	-345
-5.33%	-175	-182	-189	-196	-205	-213	-222
-2.67%	-54	-64	-74	-85	-96	-107	-118
0%	35	23	12	0	-12	-23	-35
2.67%	88	78	68	58	48	37	26
5.33%	113	107	101	93	85	77	68
8.00%	123	120	116	112	107	101	95

KR4301T53353 2023-05 풋335							207
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-193	-194	-196	-198	-201	-203	-207
-5.33%	-110	-113	-116	-120	-124	-129	-134
-2.67%	-36	-42	-47	-53	-59	-65	-71
0%	20	13	7	0	-7	-13	-20
2.67%	56	50	44	37	31	25	18
5.33%	74	70	66	61	56	51	45
8.00%	82	80	77	74	71	67	63

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

(단위:백만원)

3,495

공시일	2023-04-20
기준일	2023-04-19

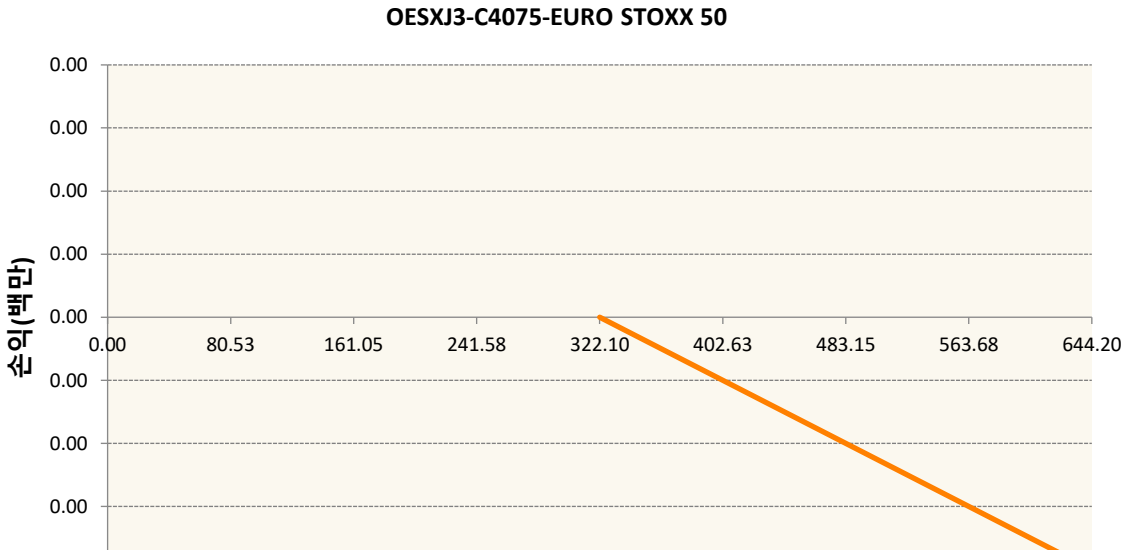
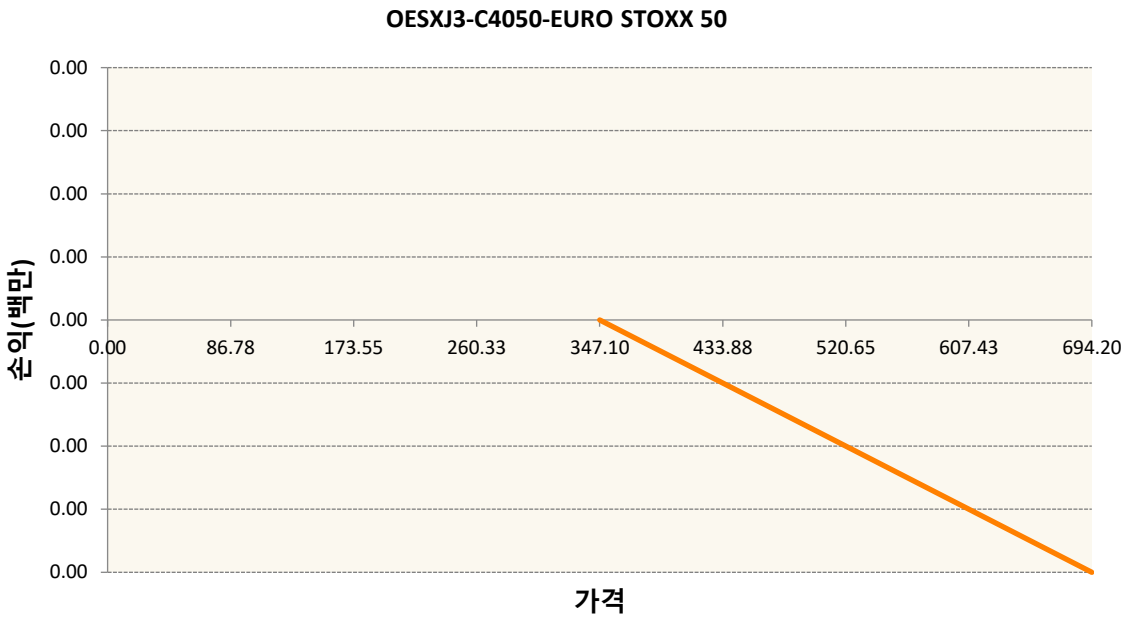
유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

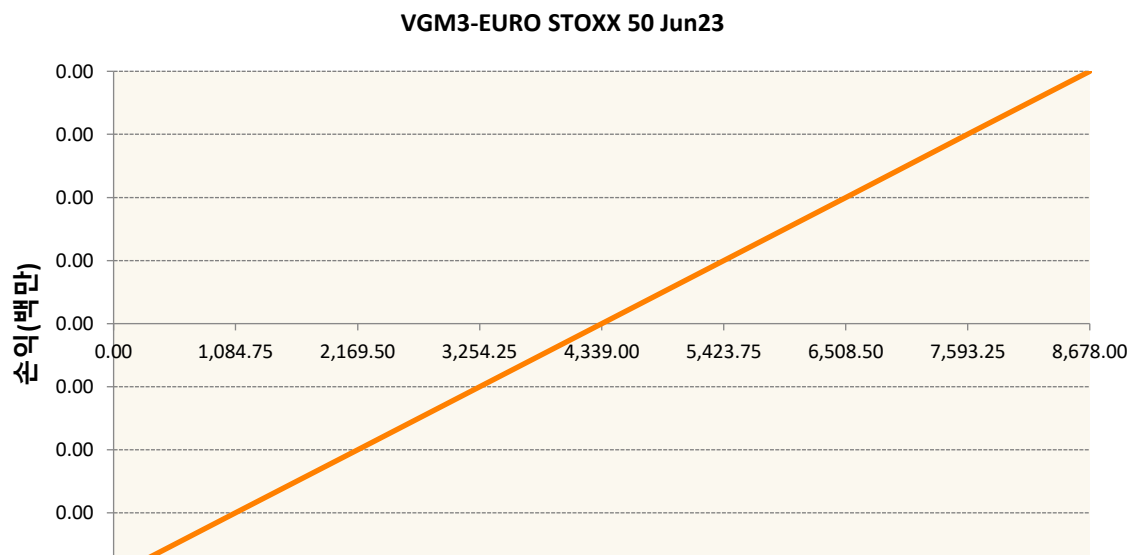
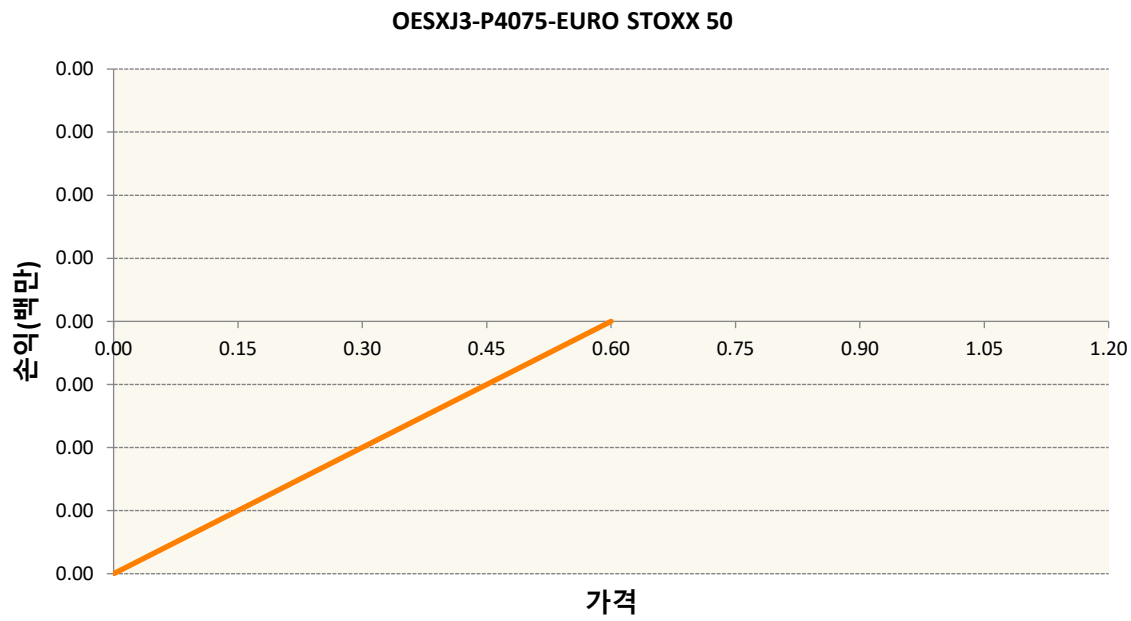
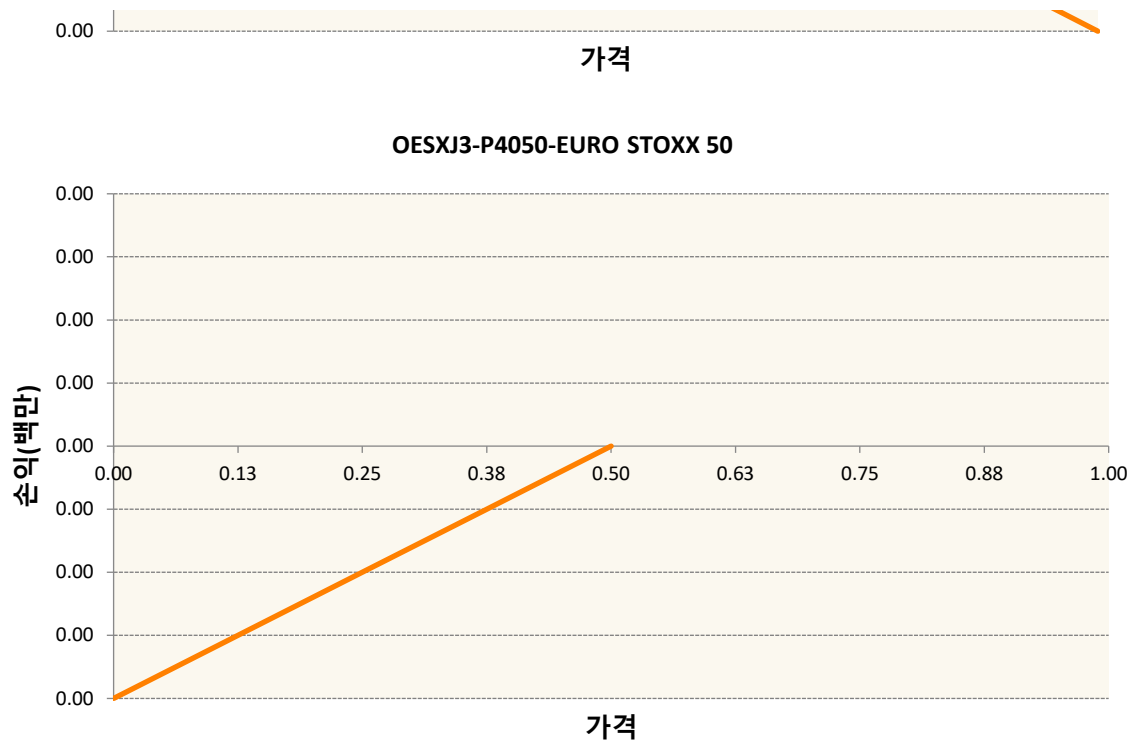
1. 계약금액

(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	970	0	970	
누계	유가증권	옵션	0	72	-72	장내
누계	통화	선도	1,641	2,323	-682	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		73
FXW213D4K EUR/KRW 26-05-23E		46
FXW213D4K KRW/EUR 26-04-23E		46
OESXJ3-C40 EURO STOXX 50		2
OESXJ3-C40 EURO STOXX 50		3
OESXJ3-P40 EURO STOXX 50		0
OESXJ3-P40 EURO STOXX 50		0.01
VGM3 EURO STOXX 50 Jun23		78

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	398

공시일	2023-04-20
기준일	2023-04-19

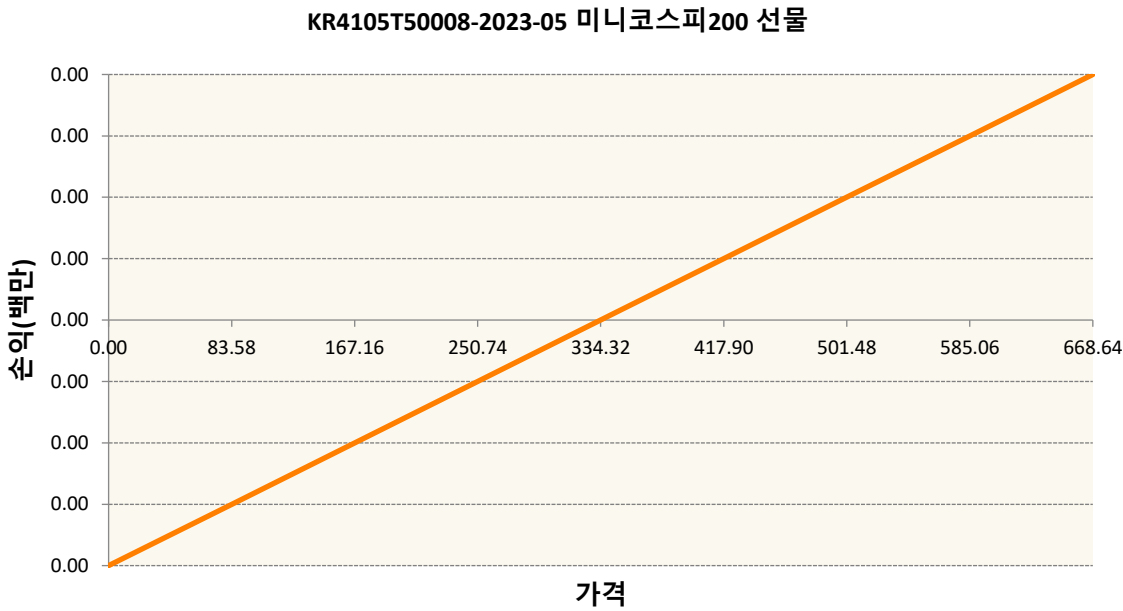
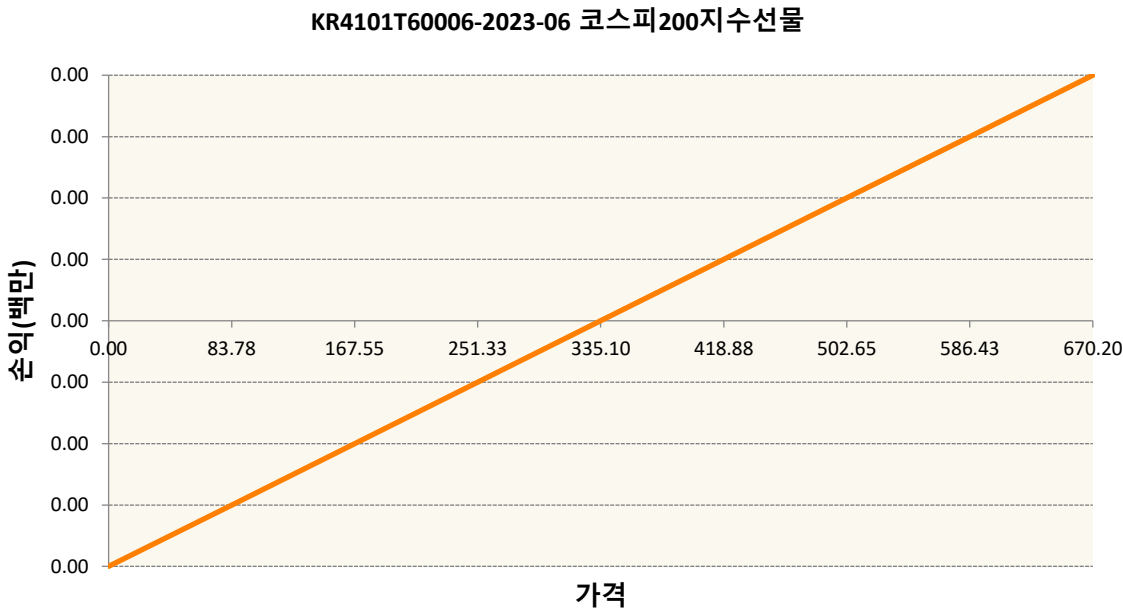
리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

1. 계약금액

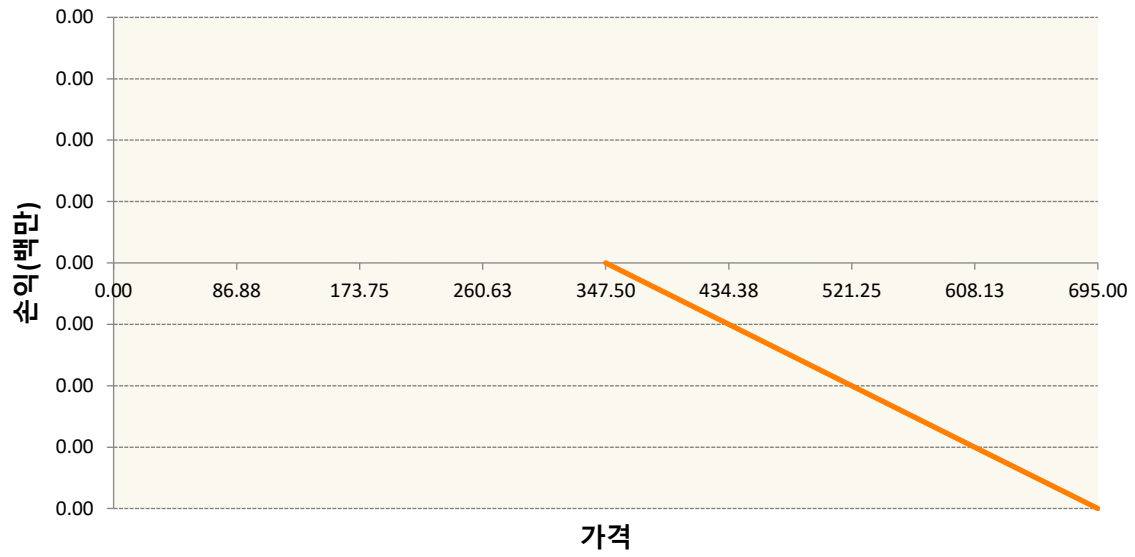
(단위:백만원)

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	586	0	586	장내
누계	유가증권	옵션	167	4,109	-3,943	장내

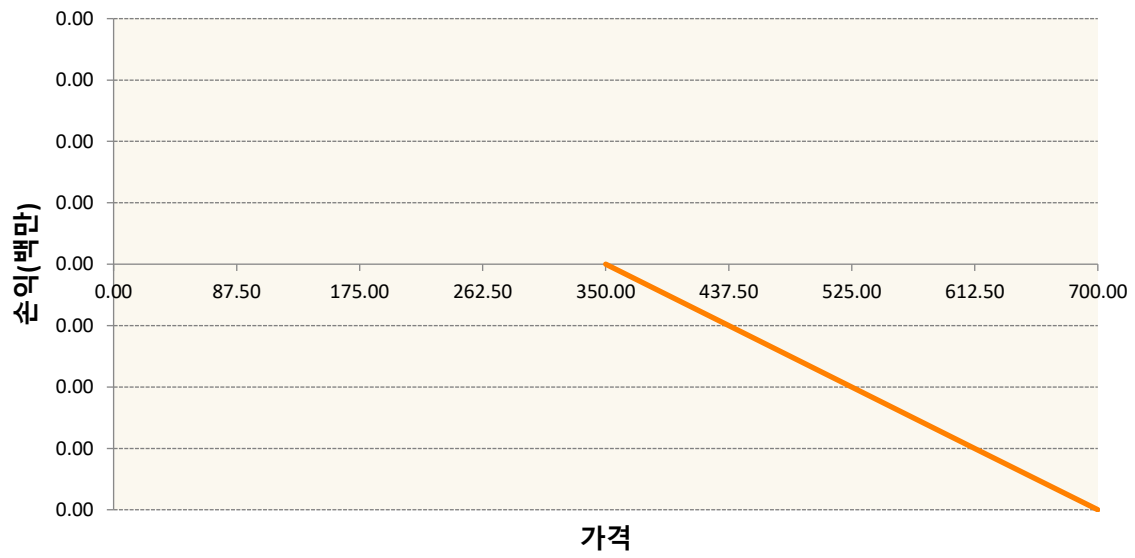
2. 만기시점의 손익구조



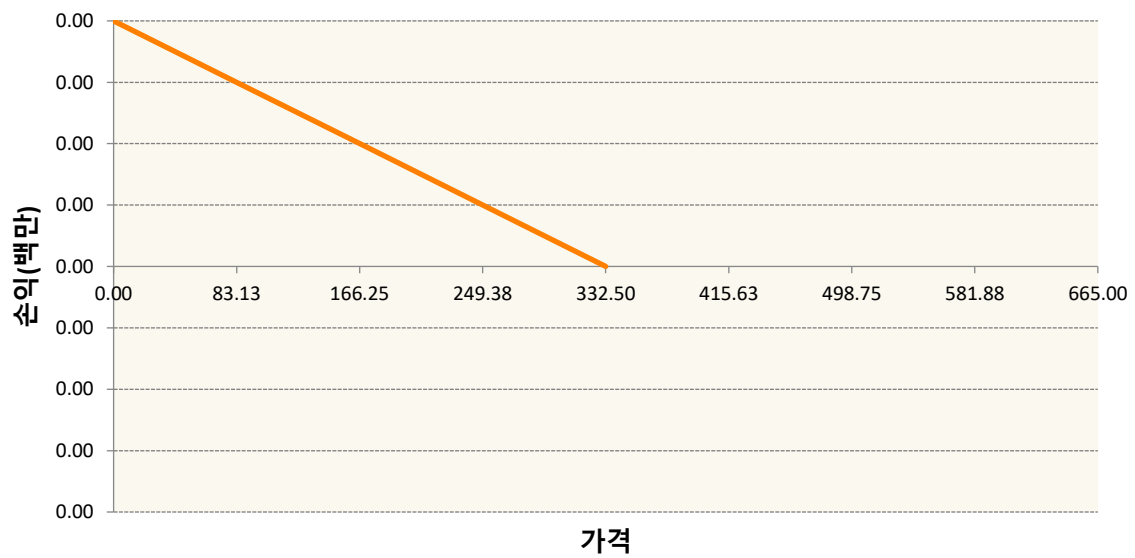
KR4201T53470-2023-05 콜347.5



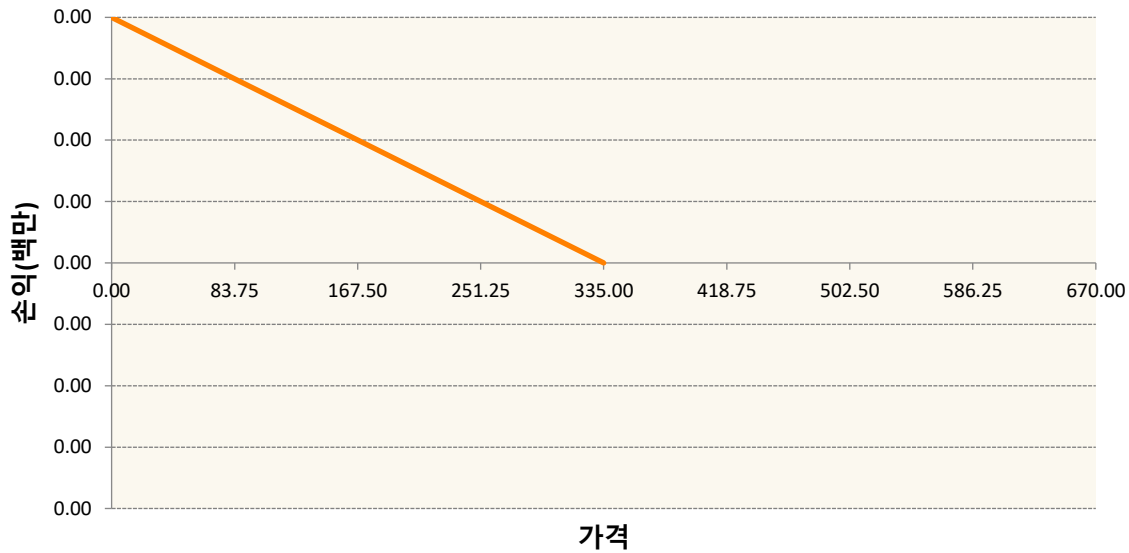
KR4201T53504-2023-05 콜350



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				19
	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	-5	-5	-6
5.33%	-7	-8	-9	-9	-10	-11	-12
8.00%	-15	-16	-16	-17	-18	-18	-19
KR4201T53504 2023-05 콜350							150
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	27	27	26	26	25	24	22
-5.33%	26	25	24	23	21	19	16
-2.67%	23	21	19	16	12	8	4
0%	14	10	5	0	-5	-11	-17
2.67%	-8	-14	-21	-28	-35	-42	-49
5.33%	-49	-57	-64	-71	-78	-86	-93
8.00%	-111	-117	-123	-130	-136	-143	-150
KR4301T53320 2023-05 풋332.5							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	-1	-1	-1	-1	-1
8.00%	-2	-2	-2	-2	-2	-1	-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%	0	0	0	0	0	0	0
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)

183

공시일	2023-04-20
기준일	2023-04-19

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	6,875	0	6,875	

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	2023-04-20
기준일	2023-04-19

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	5,453	0	5,453	

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	2023-04-20
기준일	2023-04-19

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	19,044	0	19,044	
누계	통화	선도	663	19,322	-18,659	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
FXW213D1SI KRW/USD 28-04-23E		317
FXW213D2Q KRW/USD 31-05-23E		715
FXW213D3Q KRW/USD 28-06-23E		514
FXW213D3W USD/KRW 28-04-23E		53
IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	3,565

공시일	2023-04-20
기준일	2023-04-19

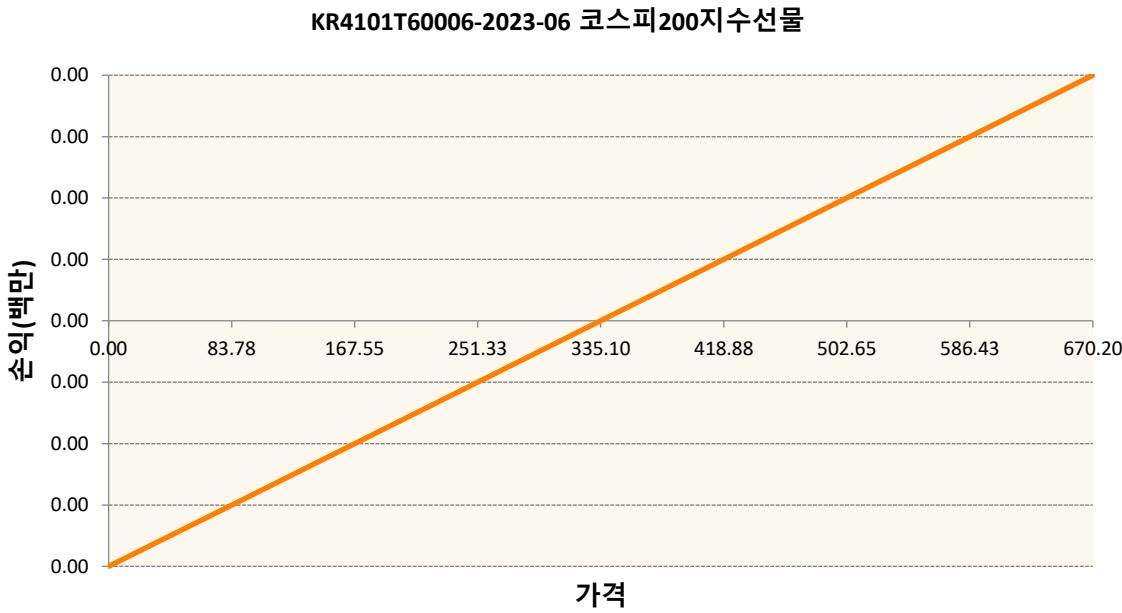
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

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	754	0	754	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101T60006			2023-06 코스피200지수선물				60
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-60	-60	-60	-60	-60	-60	-60
-5.33%	-40	-40	-40	-40	-40	-40	-40
-2.67%	-20	-20	-20	-20	-20	-20	-20
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	20	20	20	20	20	20	20
5.33%	40	40	40	40	40	40	40
8.00%	60	60	60	60	60	60	60

공시일	2023-04-20
기준일	2023-04-19

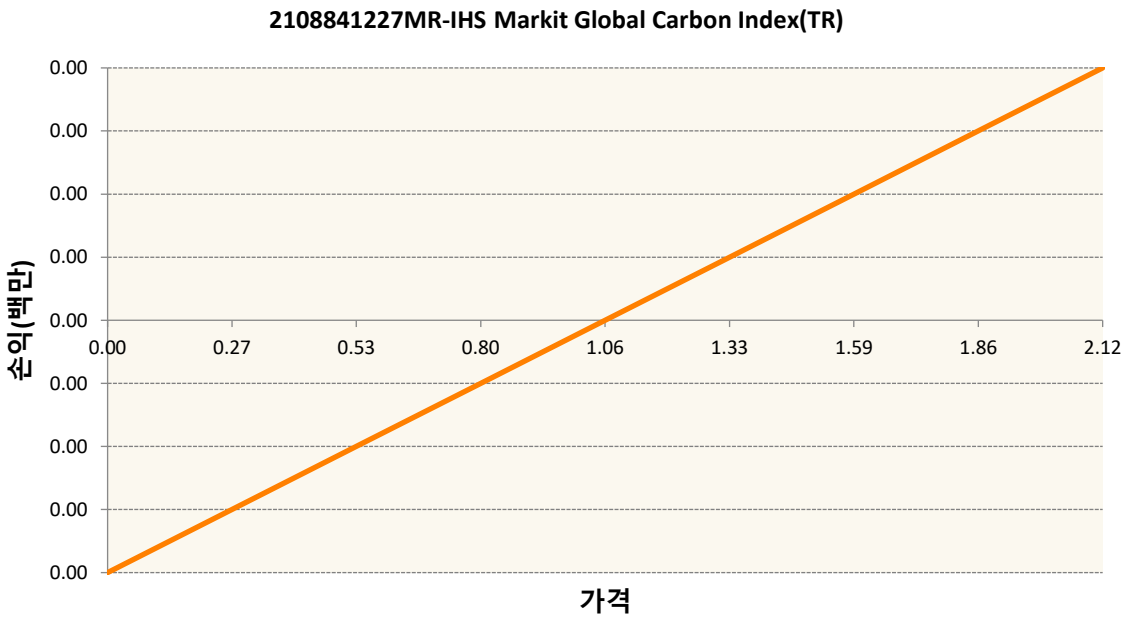
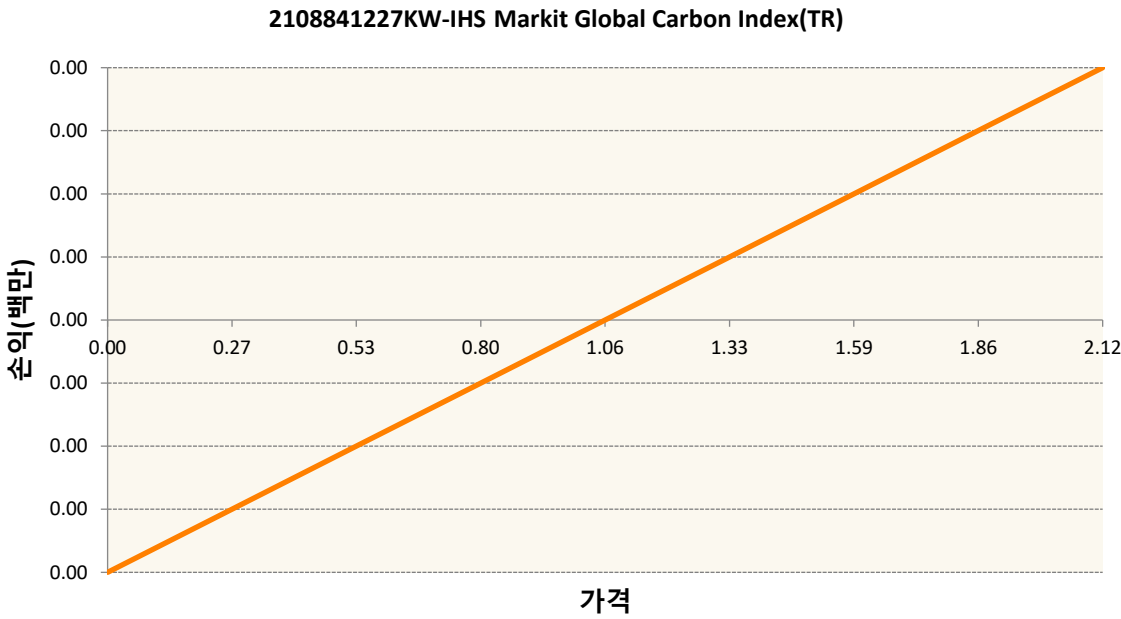
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

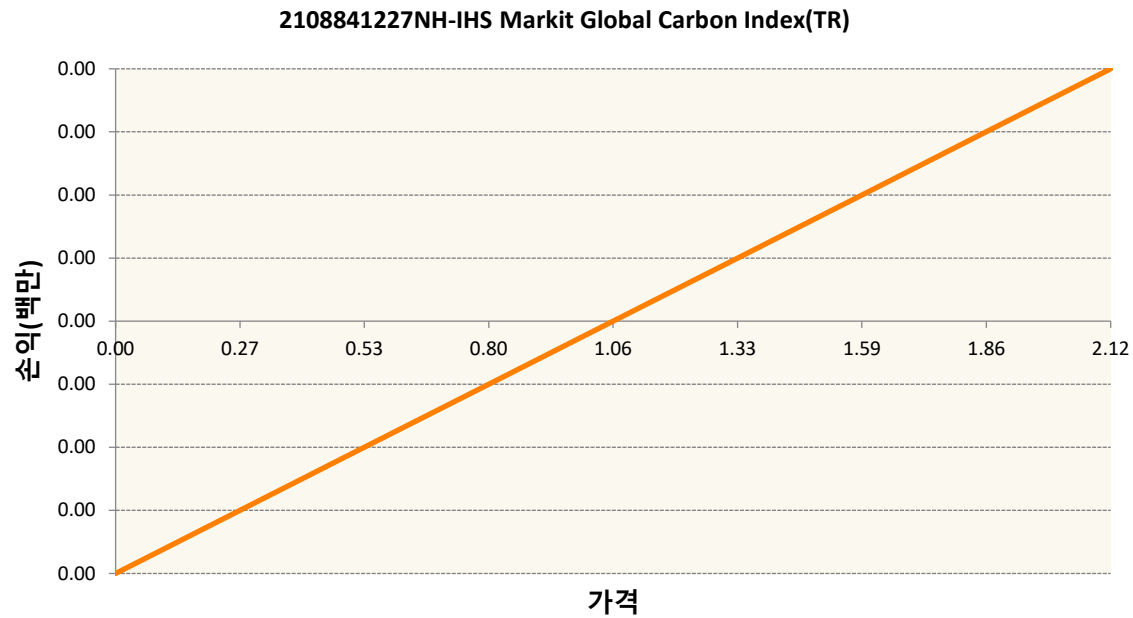
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	27,331	0	27,331	

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108841227IHS Markit Global Carbon Index(TR)		1,859
2108841227IHS Markit Global Carbon Index(TR)		219
2108841227IHS Markit Global Carbon Index(TR)		109

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)		(단위:백만원)
		3,776

공시일	2023-04-20
기준일	2023-04-19

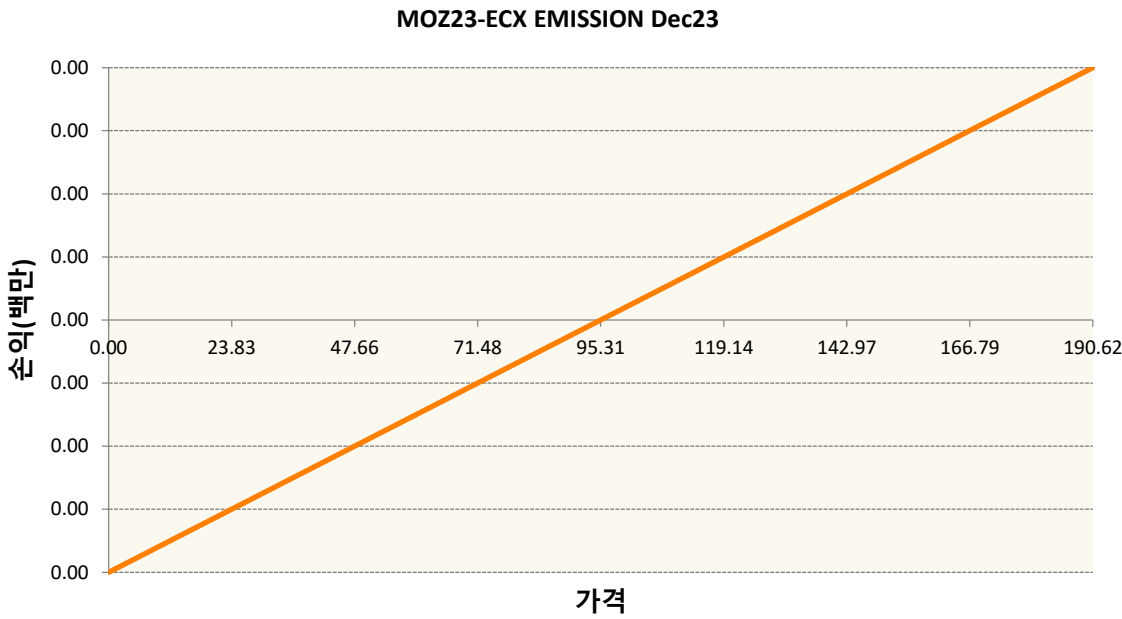
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	9,679	0	9,679	
누계	통화	선도	0	3,090	-3,090	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213D3W KRW/EUR 28-04-23E	64
FXW213D3W KRW/EUR 28-04-23E	64
FXW213D3W KRW/EUR 28-04-23E	64
FXW213D44I KRW/EUR 28-04-23E	55
MOZ23 ECX EMISSION Dec23	774

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

(단위:백만원)

1,535

공시일	2023-04-20
기준일	2023-04-19

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)	6
SWCSI00000 신한CSI Index 221222 (키움)	6
SWCSI00000 신한CSI Index 221222 (미래)	6
SWCSI00000 신한CSI Index 221222 (메리츠)	6

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

(단위:백만원)

40

공시일	2023-04-20
기준일	2023-04-19

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)	14
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 230116(메리츠)	20
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 230116(미래)	16
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 230116(키움)	14

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

(단위:백만원)

110

공시일	2023-04-20
기준일	2023-04-19

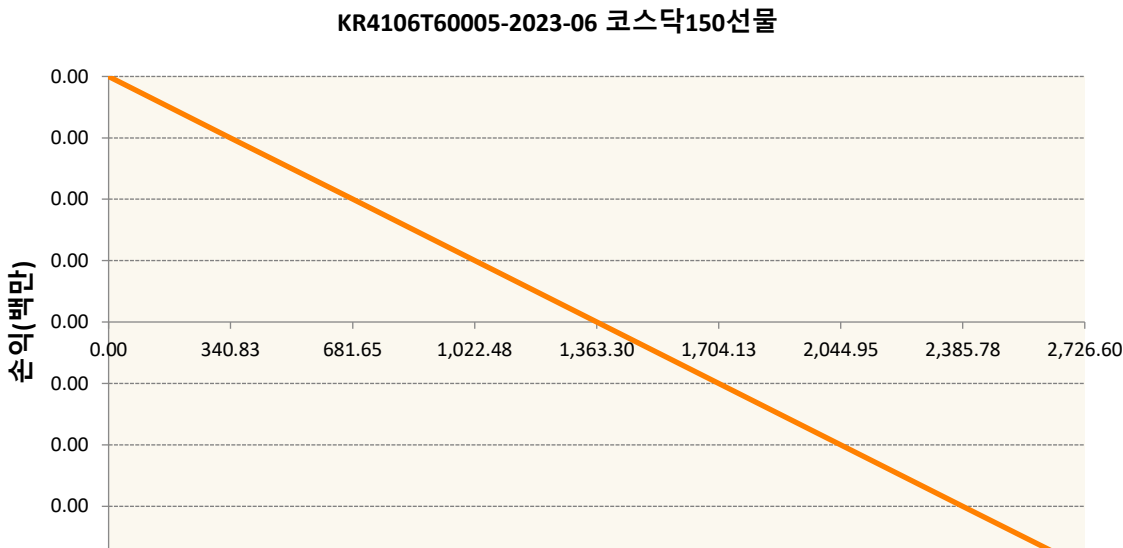
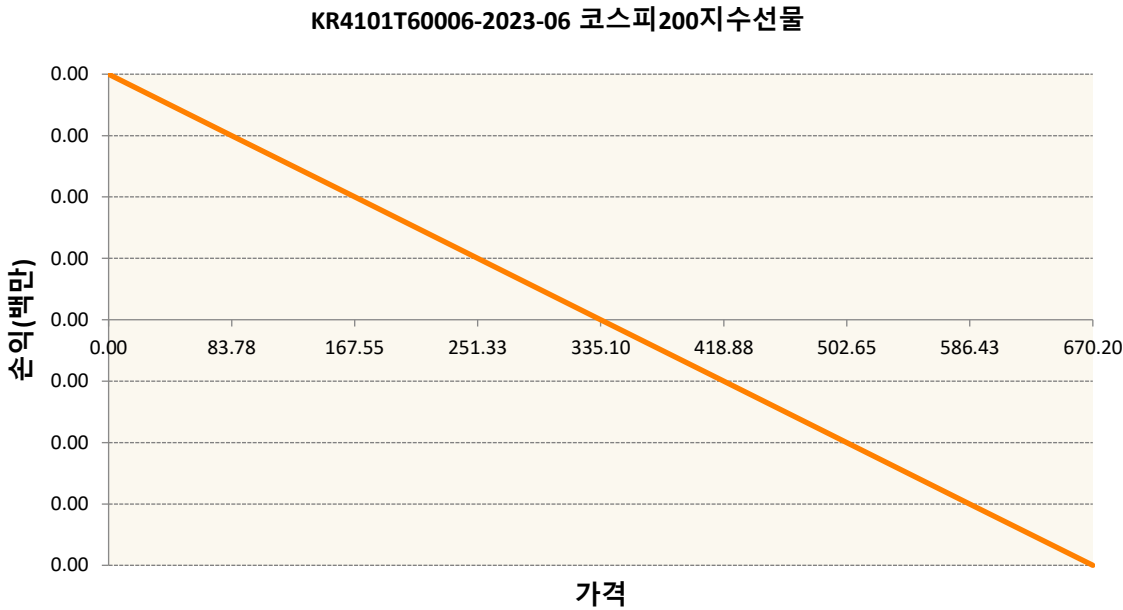
에퀴티알파일반사모혼합자산

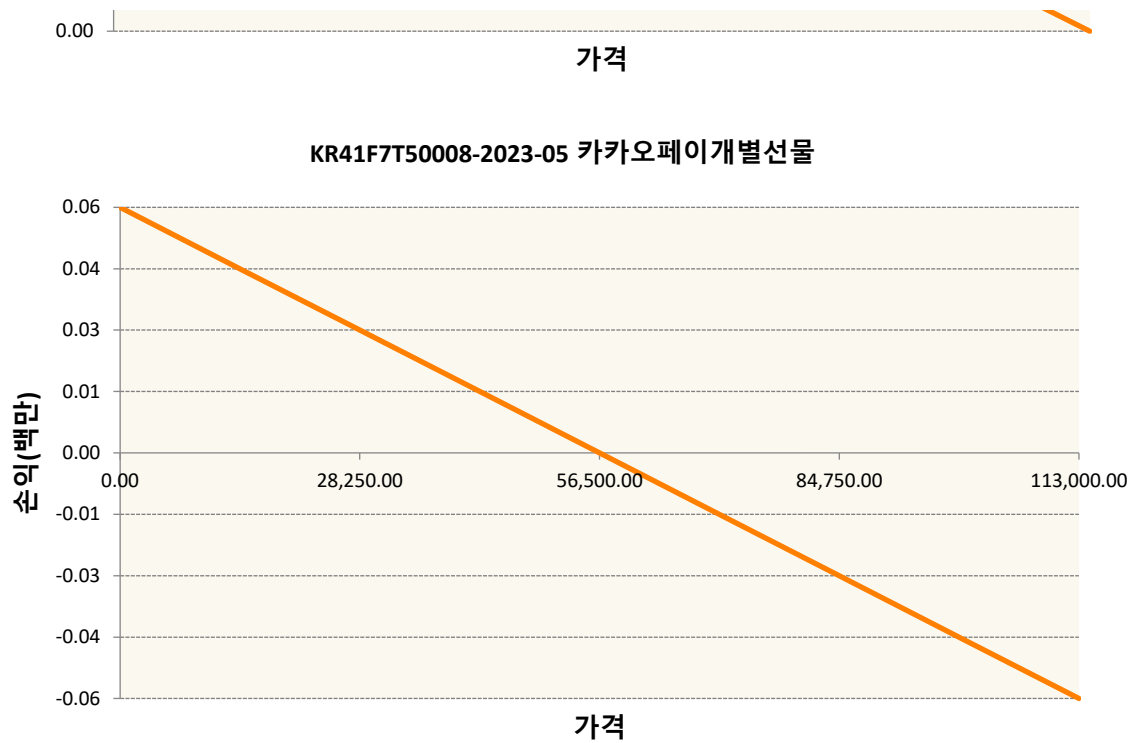
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규			0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
누계			0	0	0	
누계	유가증권	선물	0	3,316	-3,316	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	11
KRS0004054 SWAP_MICROSOFT CP_0221	0
KRS0004099 SWAP_MICRON TECH_0308	0
KRS0004212 SWAP_SPDR S&P BIOTECH_0413	0

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

(단위:백만원)

공시일	2023-04-20
기준일	2023-04-19

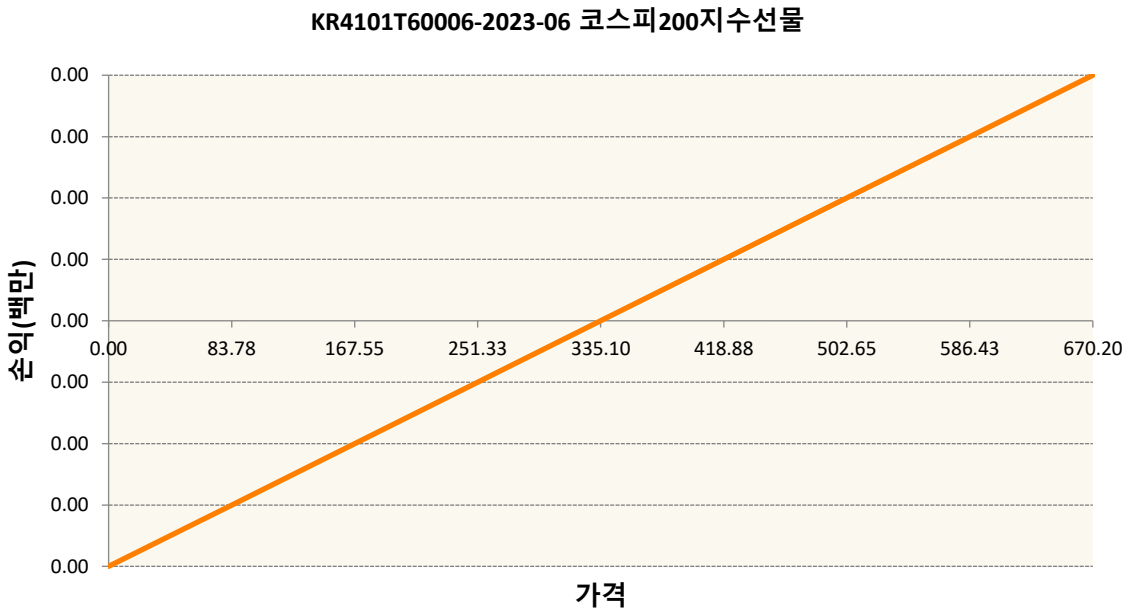
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

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	2,178	0	2,178	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101T60006		2023-06 코스피200지수선물					174
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-174	-174	-174	-174	-174	-174	-174
-5.33%	-116	-116	-116	-116	-116	-116	-116
-2.67%	-58	-58	-58	-58	-58	-58	-58
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	58	58	58	58	58	58	58
5.33%	116	116	116	116	116	116	116
8.00%	174	174	174	174	174	174	174

공시일	2023-04-20
기준일	2023-04-19

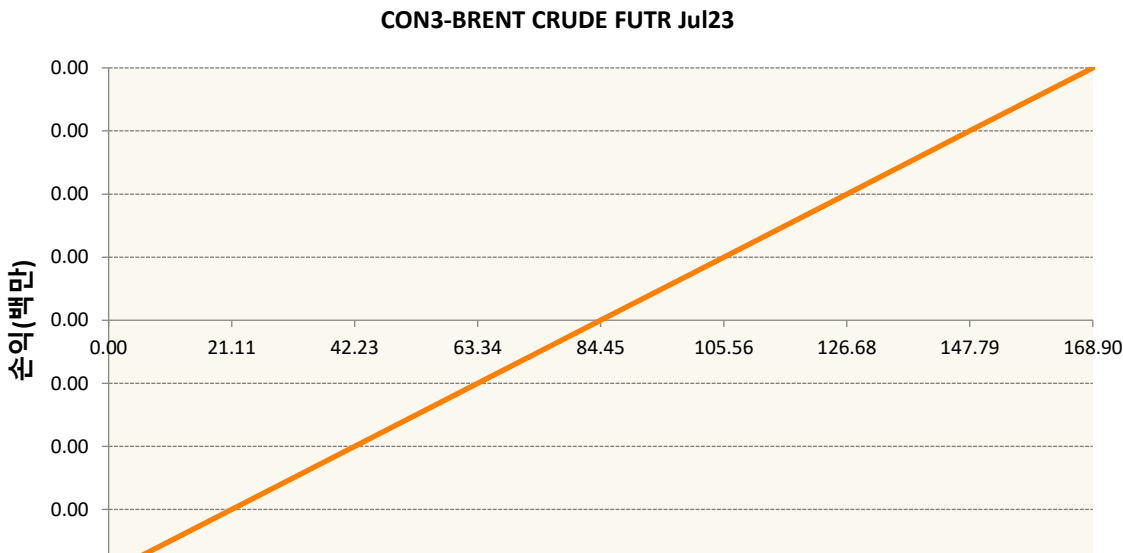
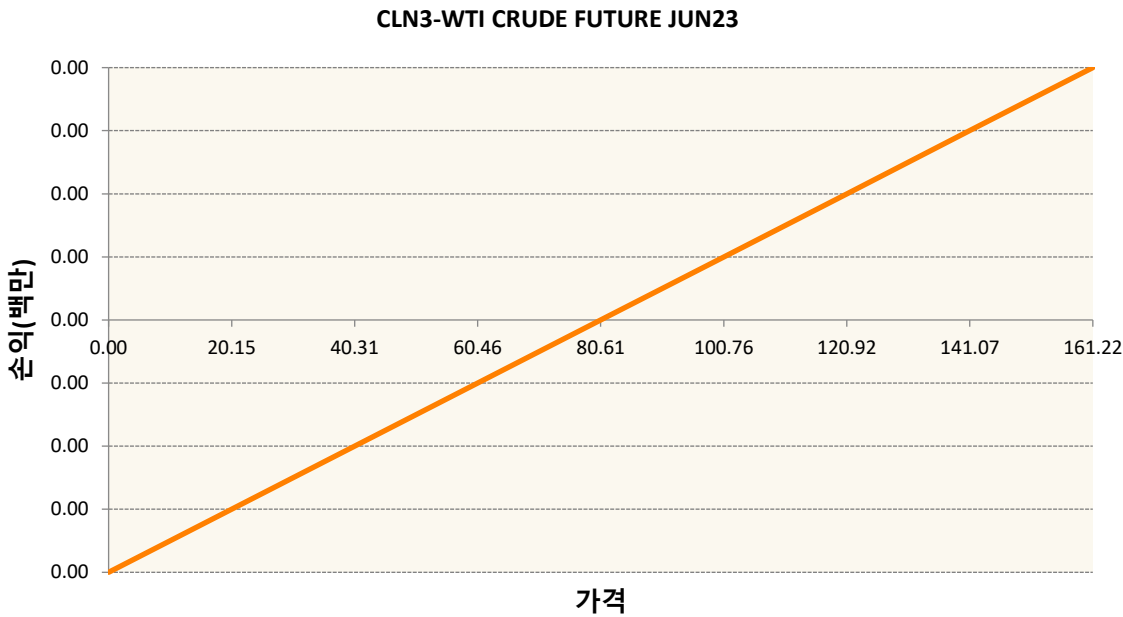
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

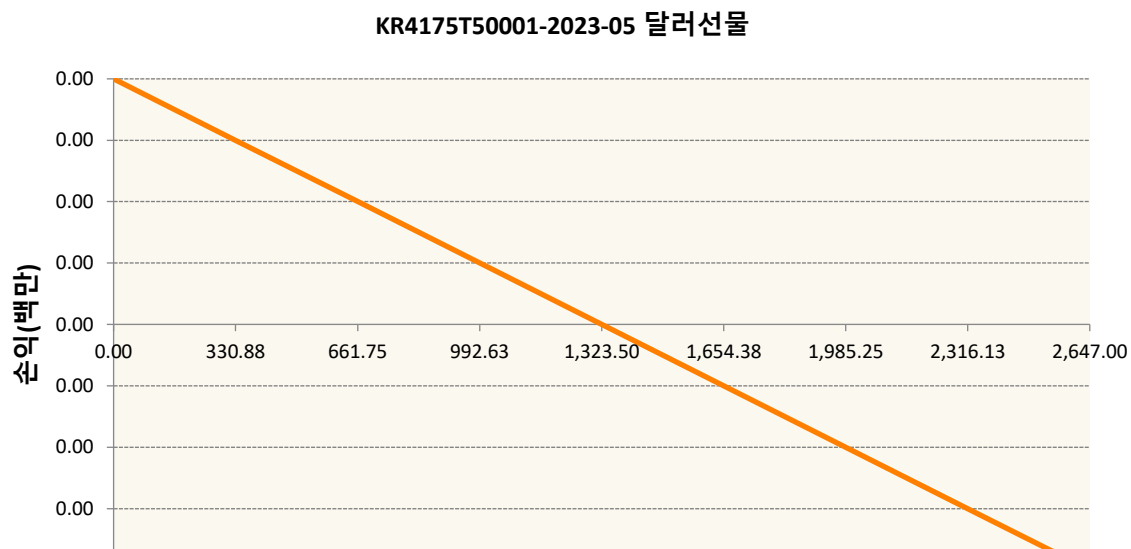
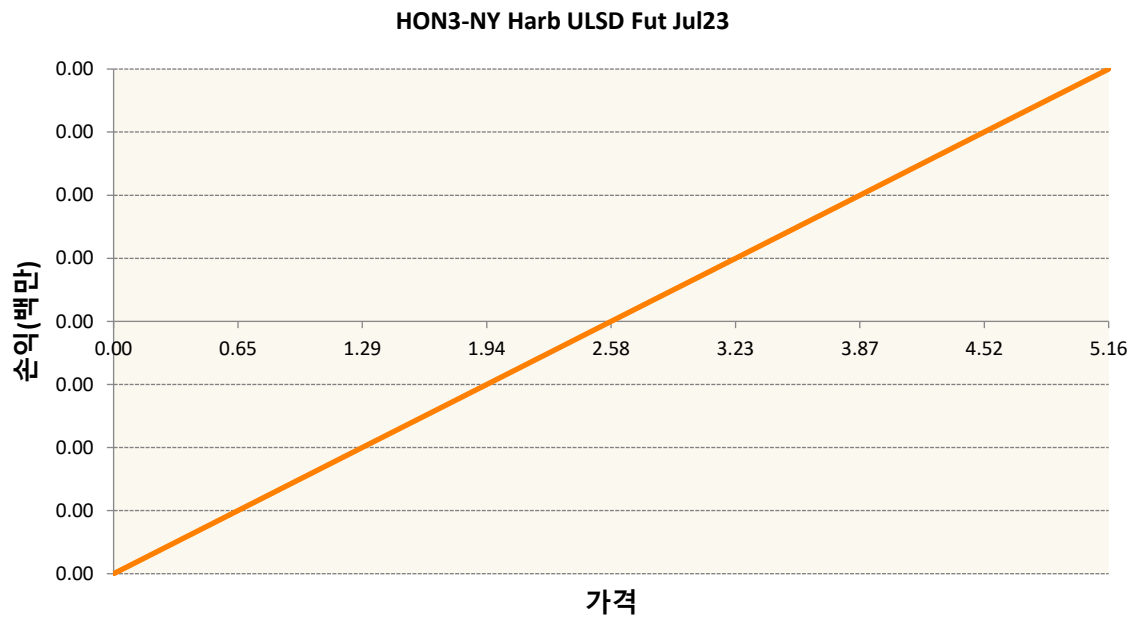
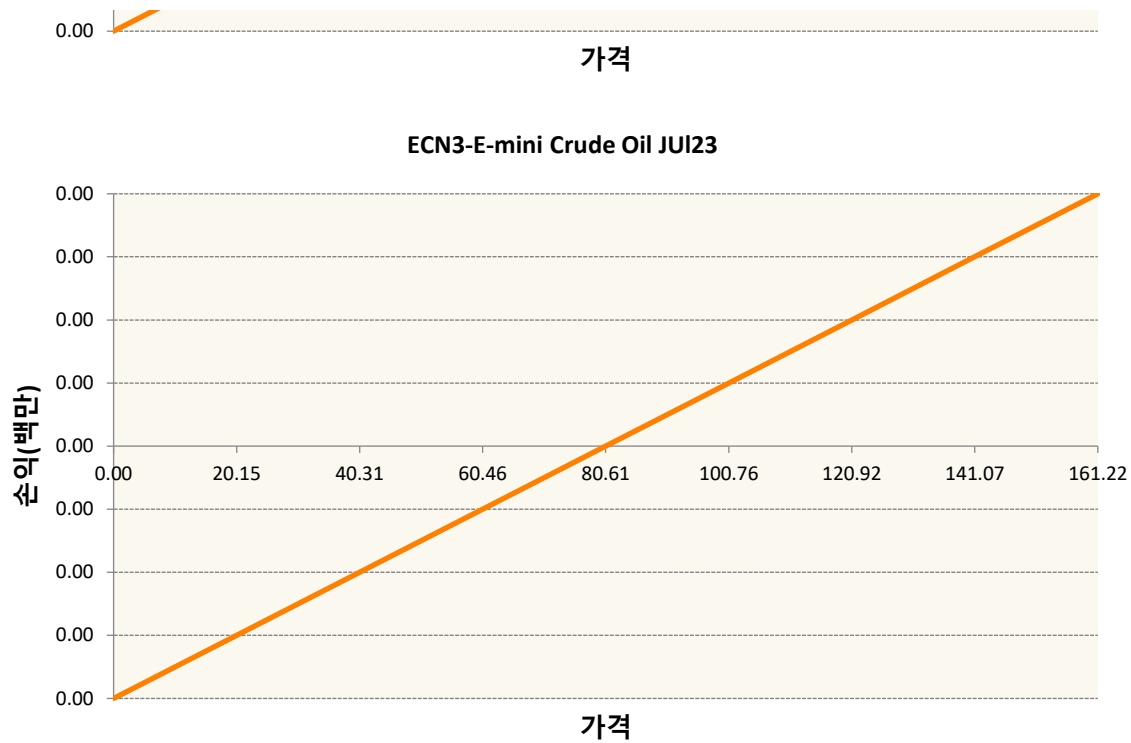
1. 계약금액

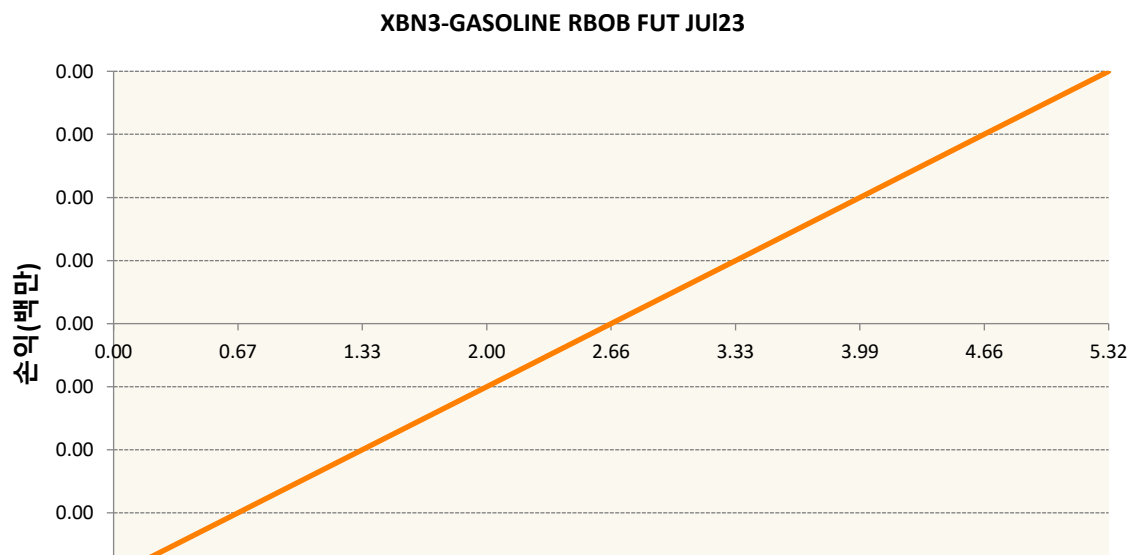
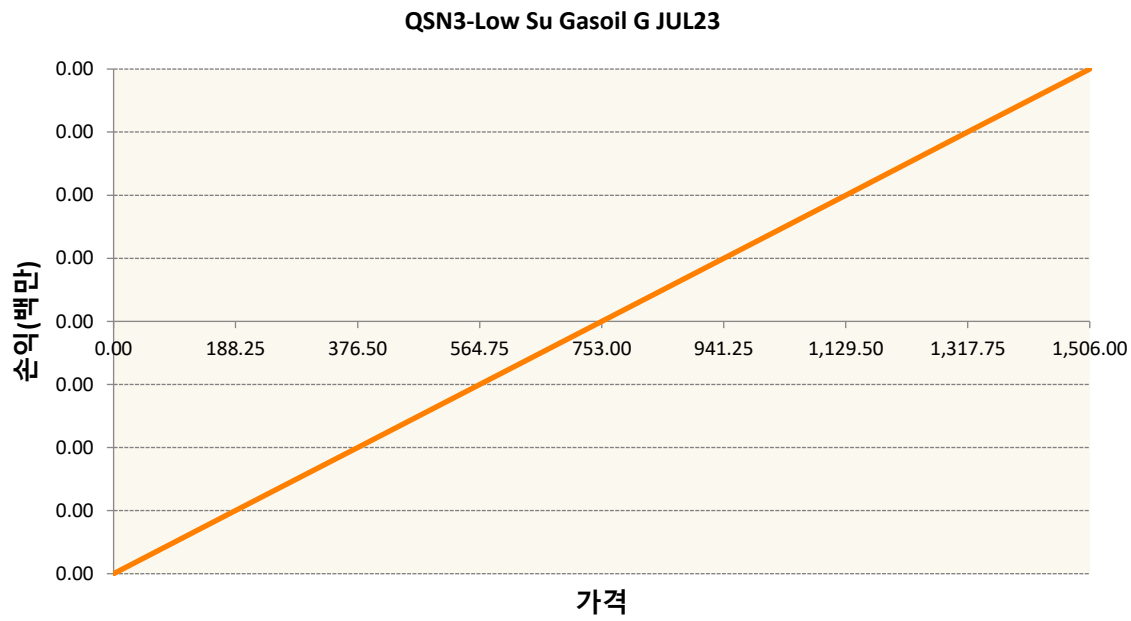
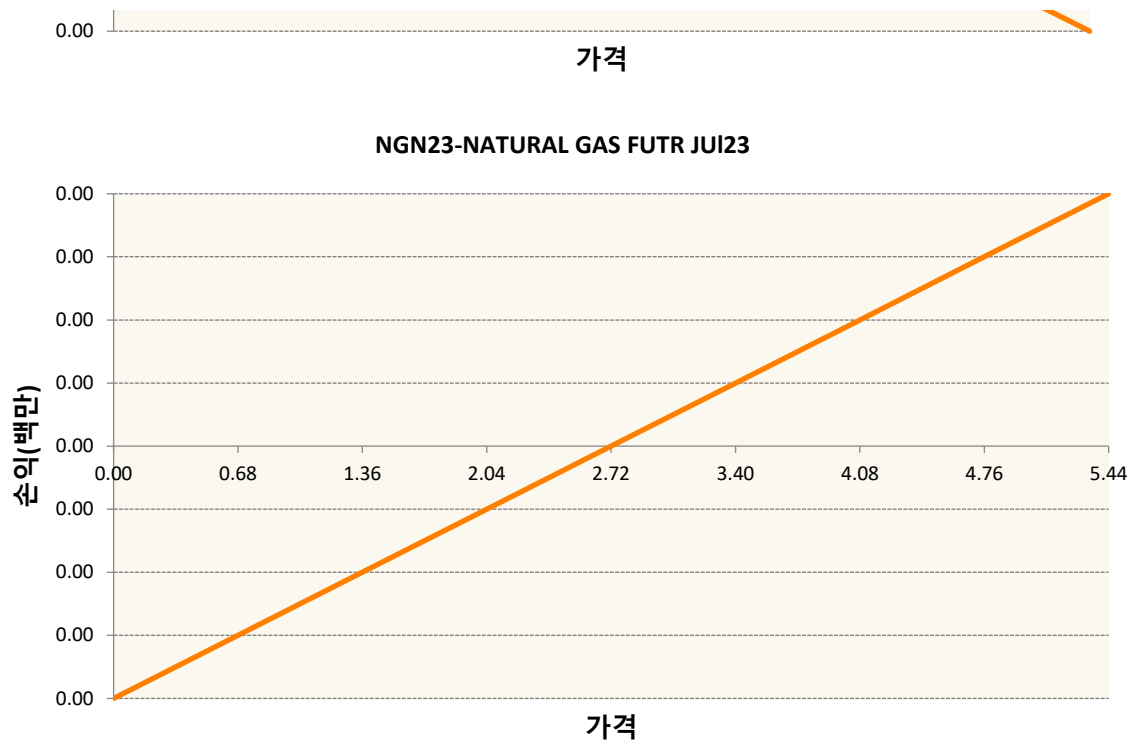
(단위:백만원)

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	0	0	장내
누계			618	0	618	
누계	유가증권	선물	906	0	906	
누계	통화	선물	0	199	-199	장내

2. 만기시점의 손익구조







0.00

가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

CLN3	WTI CRUDE FUTURE JUN23	25
CON3	BRENT CRUDE FUTR Jul23	36
ECN3	E-mini Crude Oil JUL23	4
HON3	NY Harb ULSD Fut Jul23	11
KR4175T500	2023-05 달러선물	16
NGN23	NATURAL GAS FUTR JUL23	26
QSN3	Low Su Gasoil G JUL23	8
XBN3	GASOLINE RBOB FUT JUL23	12

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

(단위:백만원)

238