

공시일	2023-05-03
기준일	2023-05-02

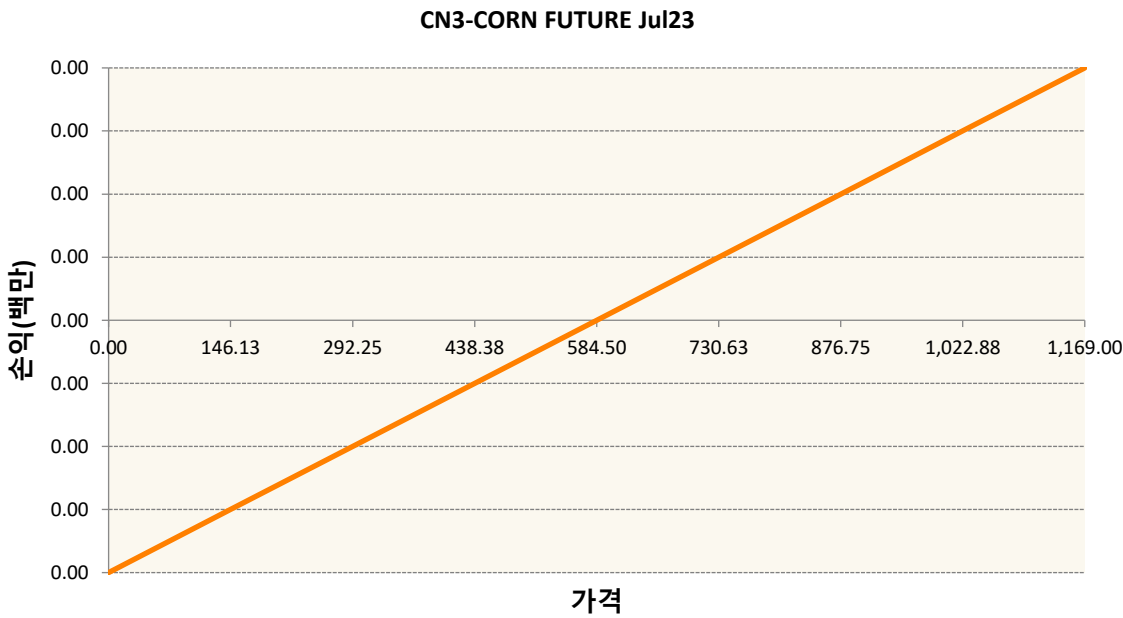
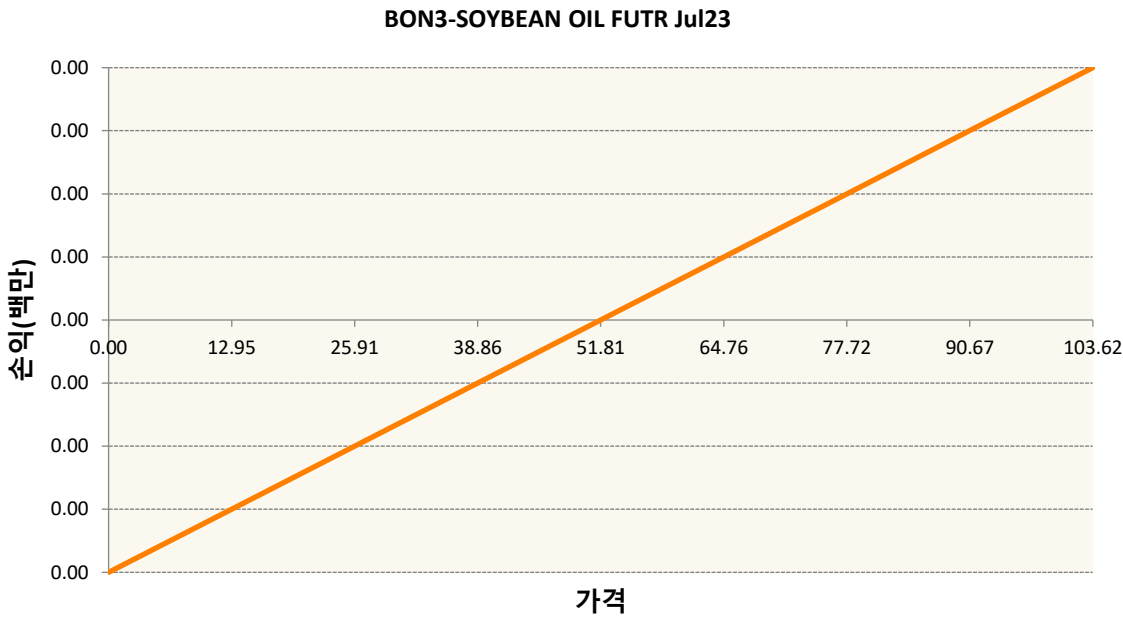
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

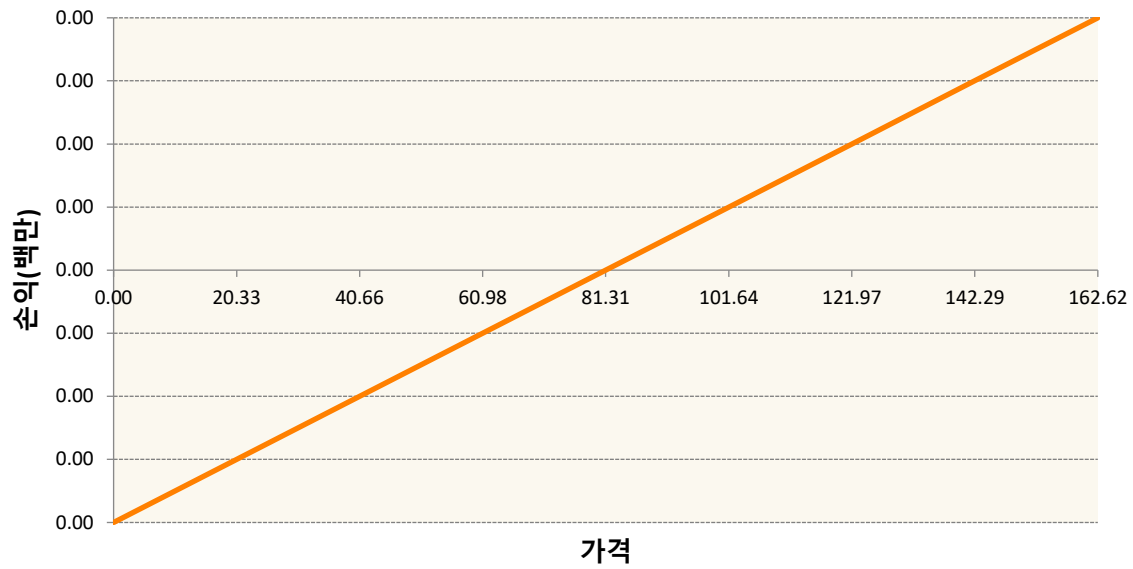
(단위:USD 백만)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,304	536	4,768	

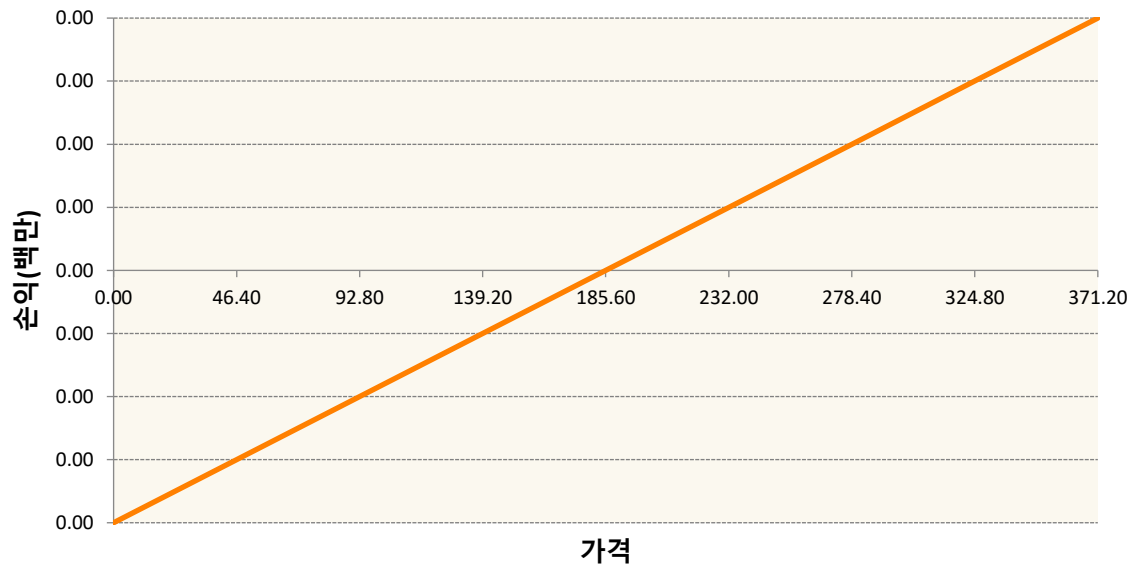
2. 만기시점의 손익구조



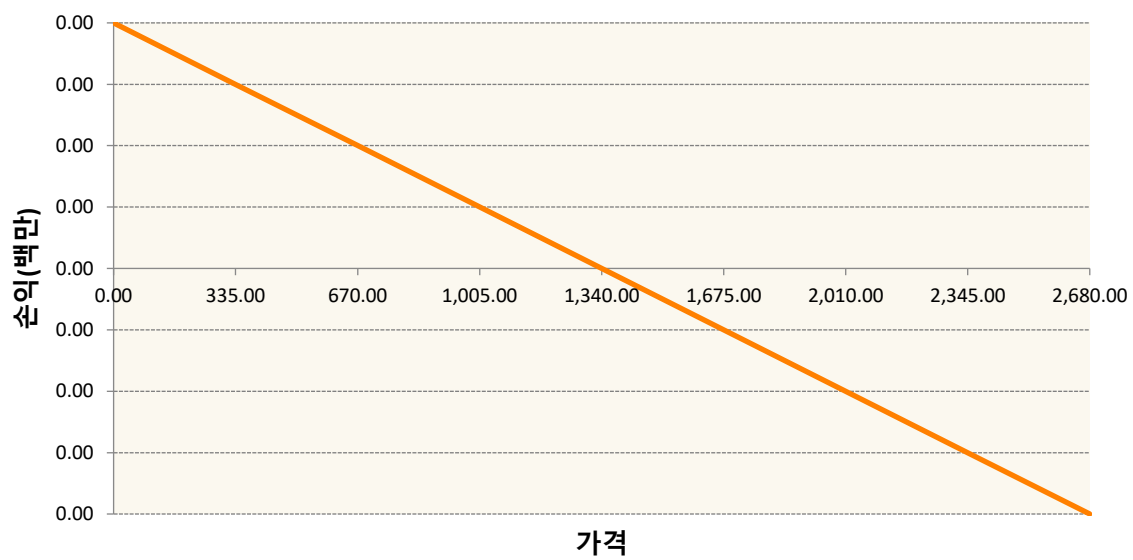
CTN3-COTTON NO.2 FUTR Jul23



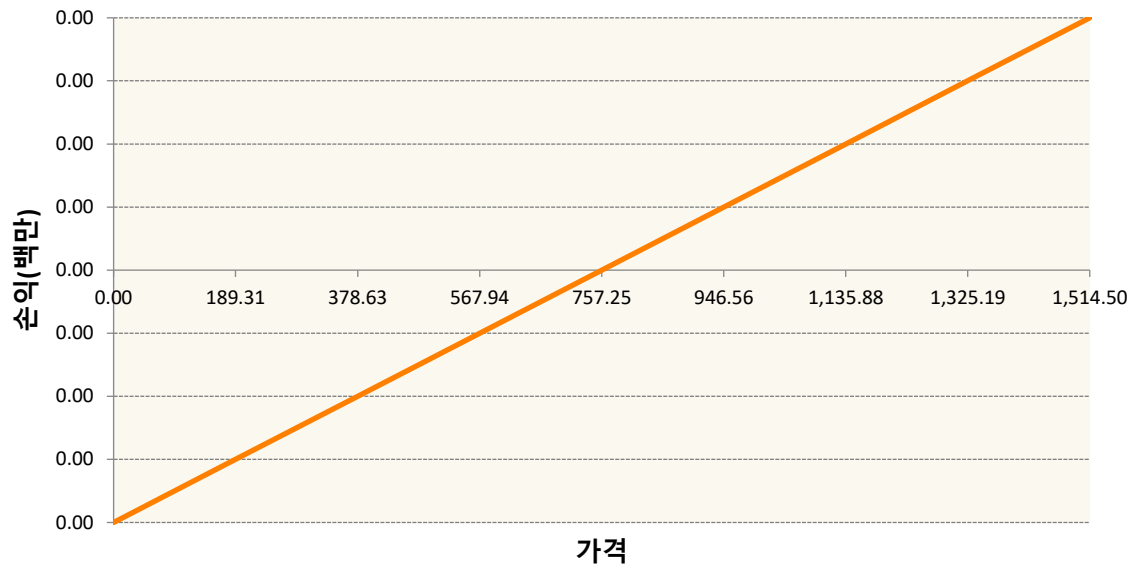
KCN3-COFFEE 'C' FUTURE Jul23



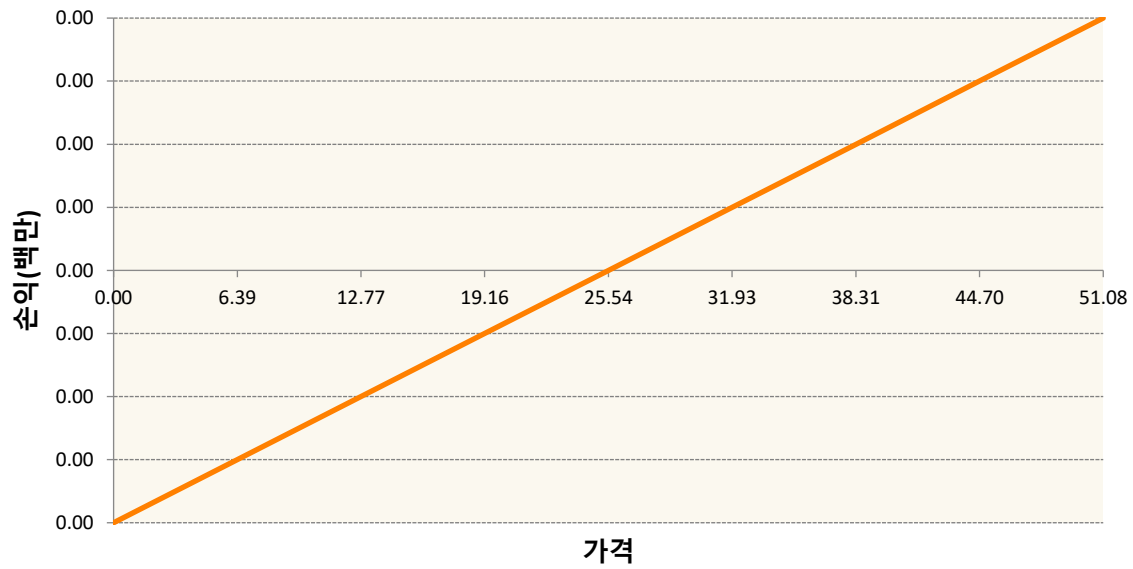
KR4175T50001-2023-05 달러선물



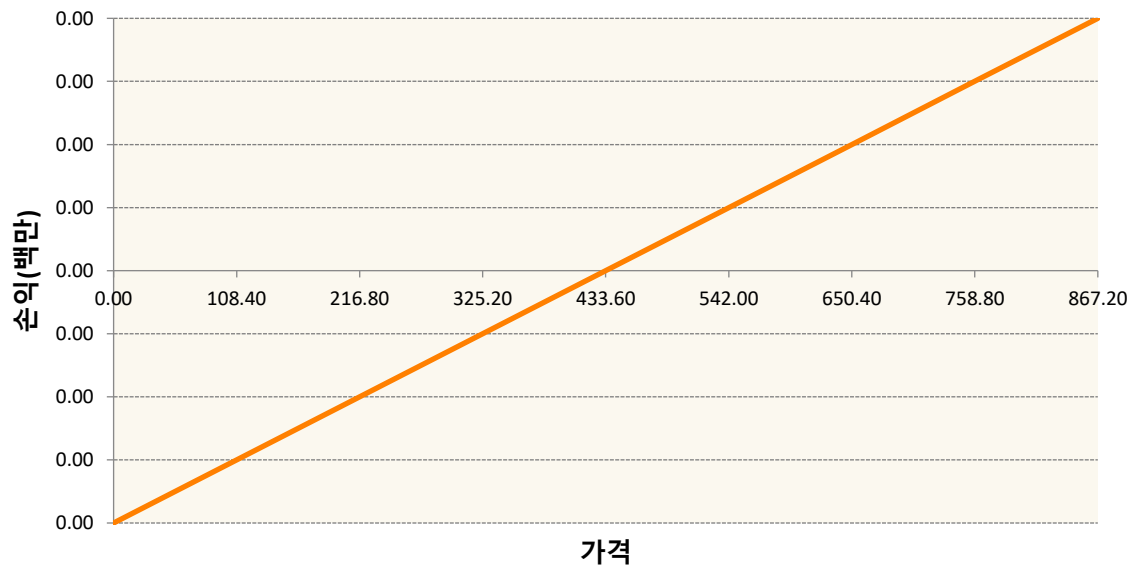
KWN3-KC HRW WHEAT FUT Jul23

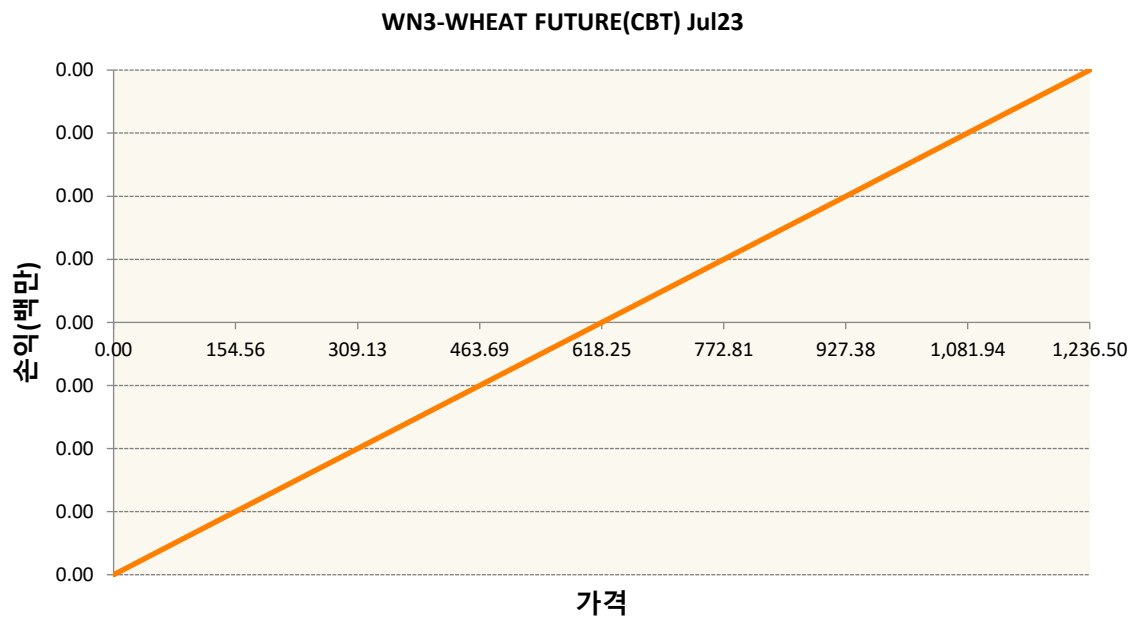
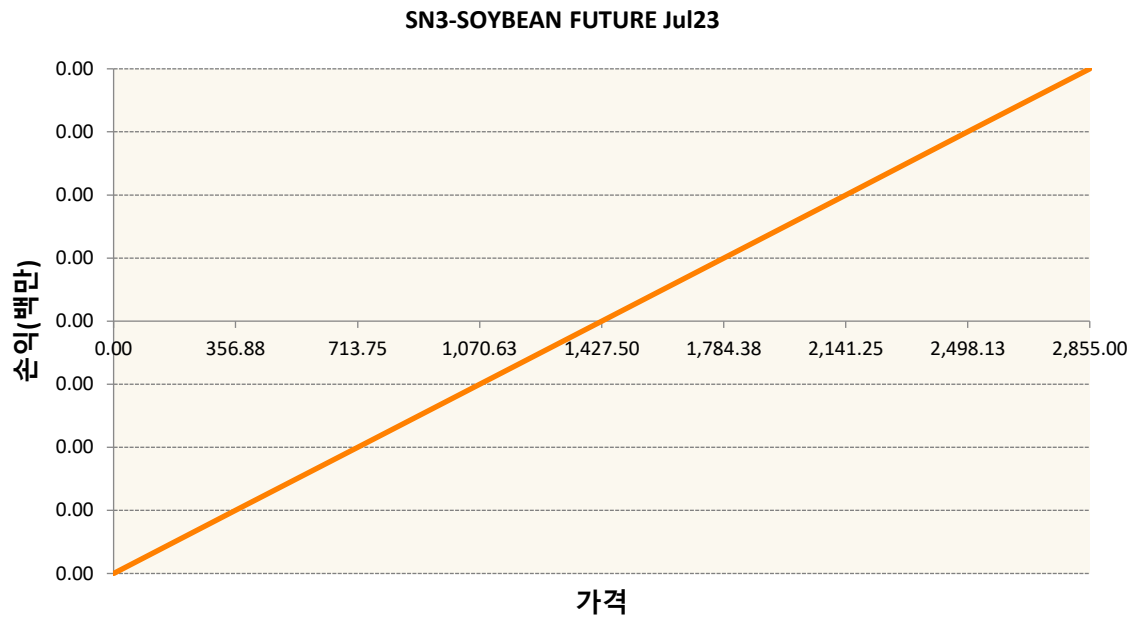


SBN3-Sugar #11 (WORLD) Jul23



SMN3-SOYBEAN MEAL FUTR Jul23





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

공시일	2023-05-03
기준일	2023-05-02

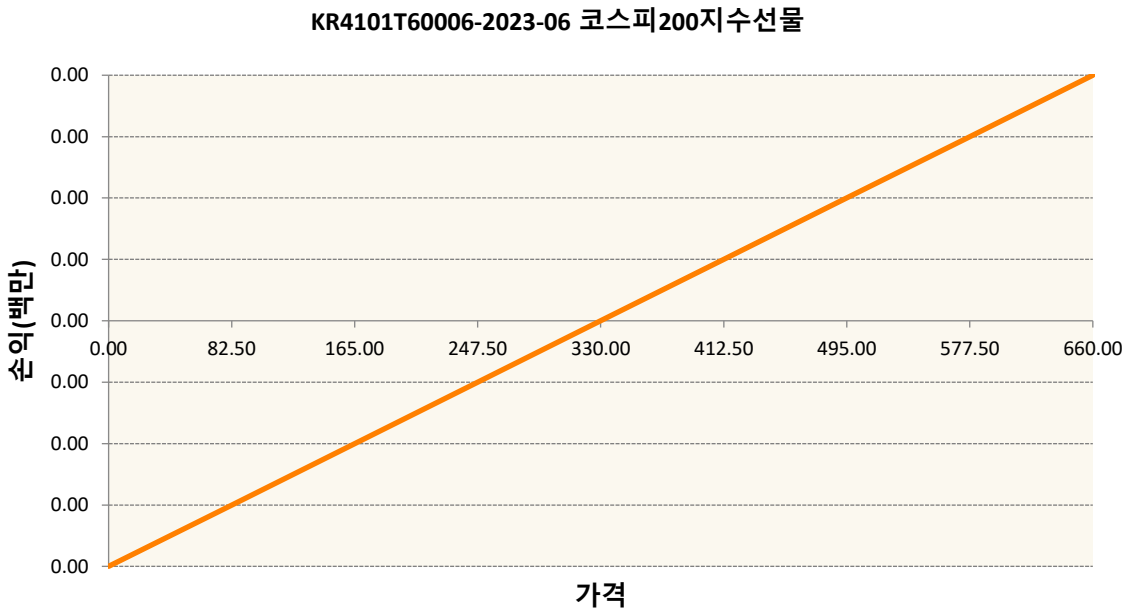
스마트인덱스모

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	2,888	0	2,888	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101T60006			2023-06 코스피200지수선물				230
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-230	-230	-230	-230	-230	-230	-230
-5.33%	-154	-154	-154	-154	-154	-154	-154
-2.67%	-77	-77	-77	-77	-77	-77	-77
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	77	77	77	77	77	77	77
5.33%	154	154	154	154	154	154	154
8.00%	230	230	230	230	230	230	230

공시일	2023-05-03
기준일	2023-05-02

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	363
-----------------------------	-----

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

632

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2023-05-03
기준일	2023-05-02

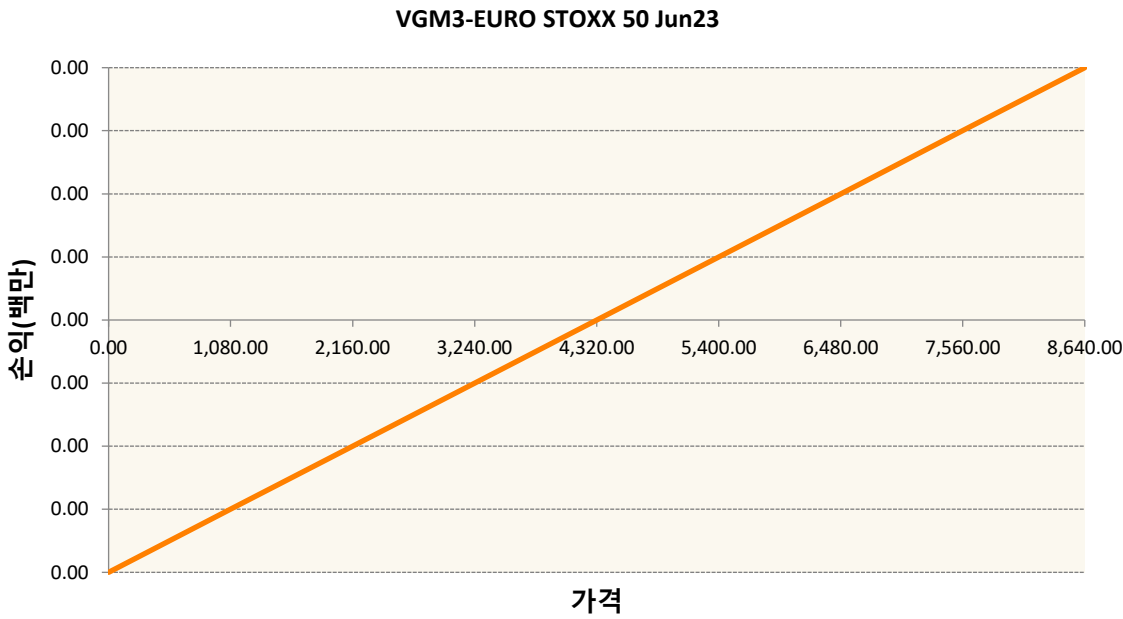
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	363	0	363	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

51

공시일	2023-05-03
기준일	2023-05-02

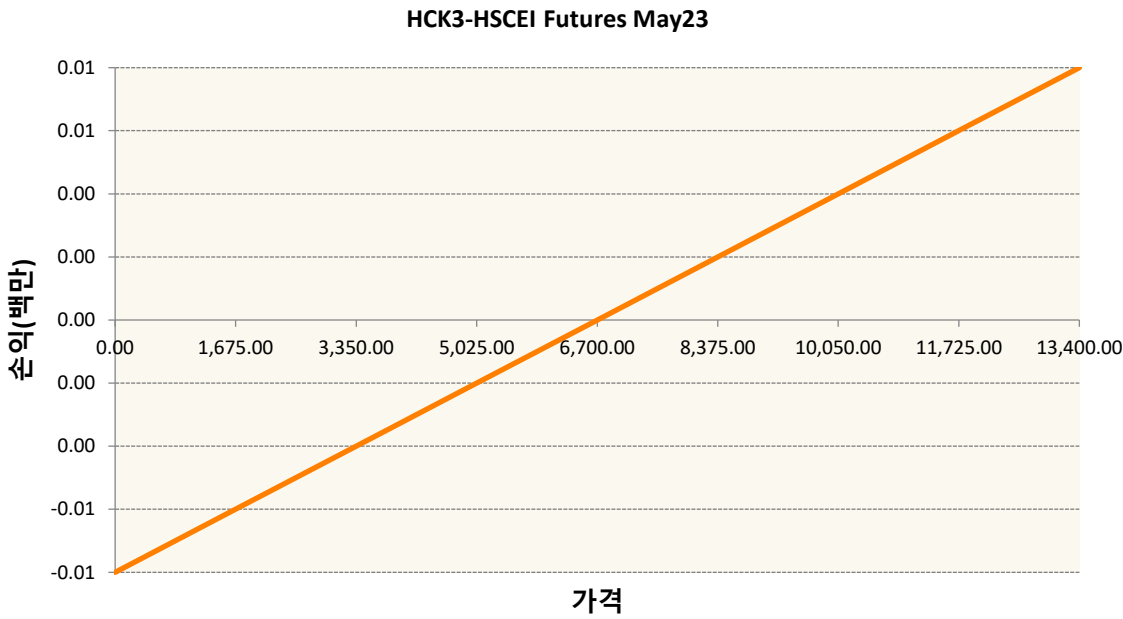
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	855	0	855	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCK3	HSCEI Futures May23	68
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

119

공시일	2023-05-03
기준일	2023-05-02

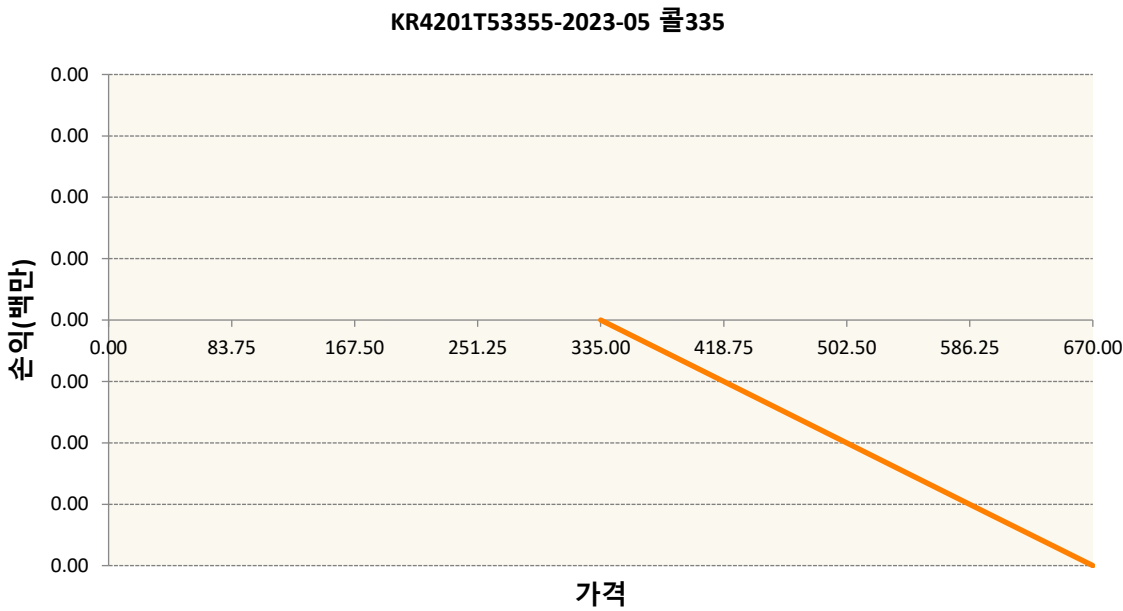
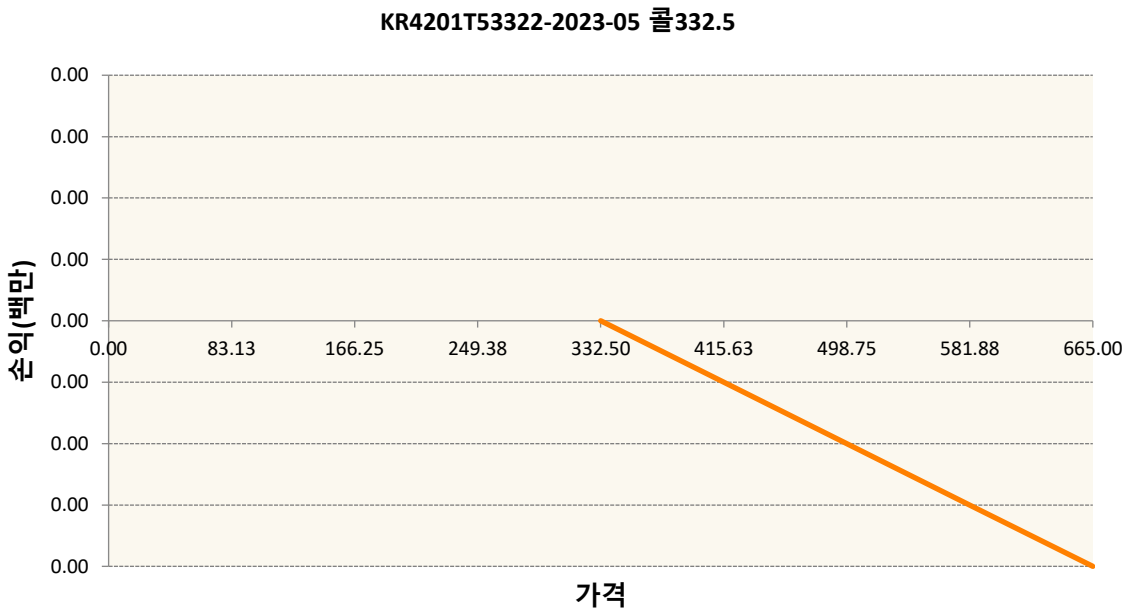
커버드콜모(주식혼합-파생형)

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	56,209	-56,209	장내

2. 만기시점의 손익구조



가격	이익(백만)
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

The graph illustrates a linear relationship between price and profit/loss. The x-axis, labeled '가격' (Price), ranges from 0.00 to 670.00. The y-axis, labeled '손익(백만)' (Profit/Loss in millions), ranges from 0.00 to 0.00. A blue line starts at the origin (0, 0) and extends to the point (335, 0), indicating that the profit/loss is zero at a price of 335.00.

(단위:백만원)

KR4201T53322		2023-05 콜332.5					2,220
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	394	394	393	391	389	384	378
-5.33%	390	386	379	369	357	343	326
-2.67%	346	325	300	272	243	211	178
0%	133	89	45	0	-45	-90	-136
2.67%	-400	-440	-482	-525	-568	-612	-656
5.33%	-1,217	-1,235	-1,257	-1,282	-1,309	-1,339	-1,370
8.00%	-2,158	-2,162	-2,168	-2,177	-2,189	-2,204	-2,220
KR4201T53355		2023-05 콜335					551
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	79	79	79	79	78	77	76
-5.33%	79	78	77	75	73	70	66
-2.67%	72	68	63	57	50	43	35
0%	32	22	11	0	-11	-23	-34
2.67%	-84	-96	-108	-120	-132	-145	-157
5.33%	-283	-290	-298	-306	-315	-324	-333
8.00%	-528	-530	-533	-536	-540	-545	-551
KR4301T53320 2023-05 풋332.5							412

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-410	-410	-410	-410	-411	-411	-412
-5.33%	-252	-253	-254	-256	-258	-260	-263
-2.67%	-102	-105	-109	-114	-118	-124	-129
0%	22	15	7	0	-7	-15	-22
2.67%	93	86	80	73	66	58	51
5.33%	118	115	112	107	103	98	93
8.00%	123	122	121	120	118	116	113

KR4301T53353 2023-05 풋335							249
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-248	-248	-248	-248	-248	-249	-249
-5.33%	-156	-156	-157	-158	-158	-159	-161
-2.67%	-67	-68	-70	-72	-74	-77	-80
0%	12	8	4	0	-4	-8	-12
2.67%	62	58	54	49	45	41	36
5.33%	83	81	78	75	72	69	66
8.00%	88	88	87	85	84	82	80

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

(단위:백만원)

3,621

공시일	2023-05-03
기준일	2023-05-02

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	통화	선도	590	590	0	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213D2N KRW/EUR 26-05-23E	47
FXW213D4K EUR/KRW 26-05-23E	47

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

(단위:백만원)

76

공시일	2023-05-03
기준일	2023-05-02

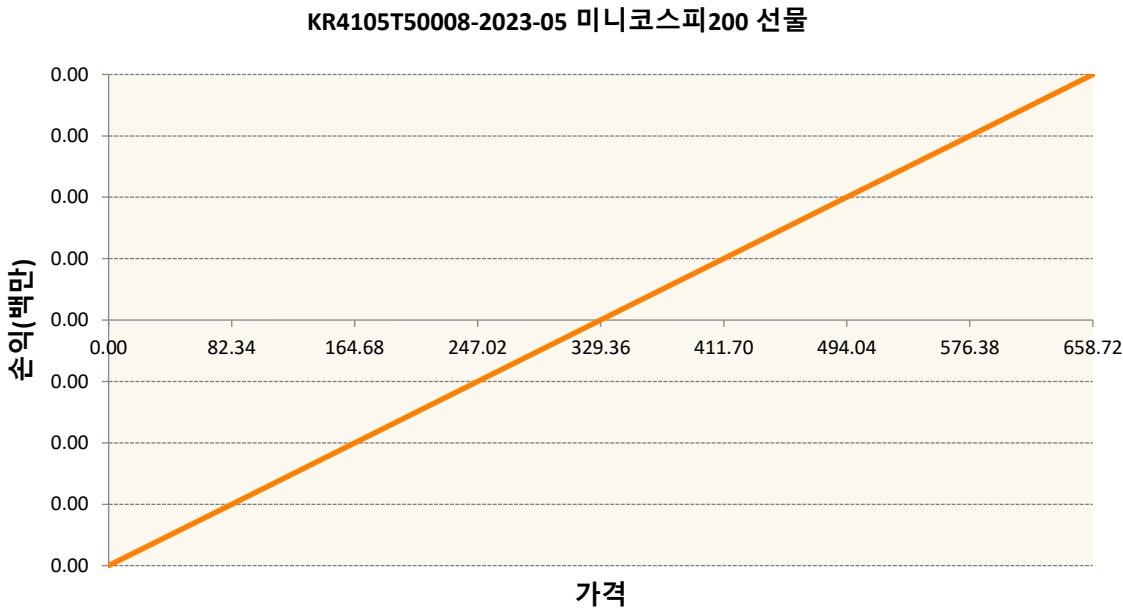
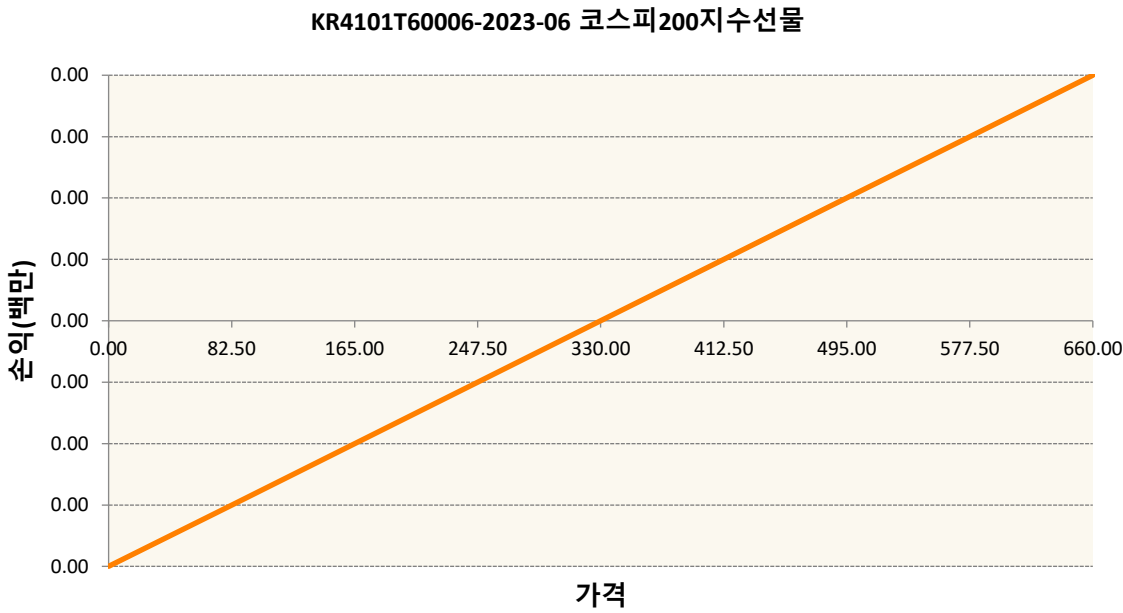
리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

1. 계약금액

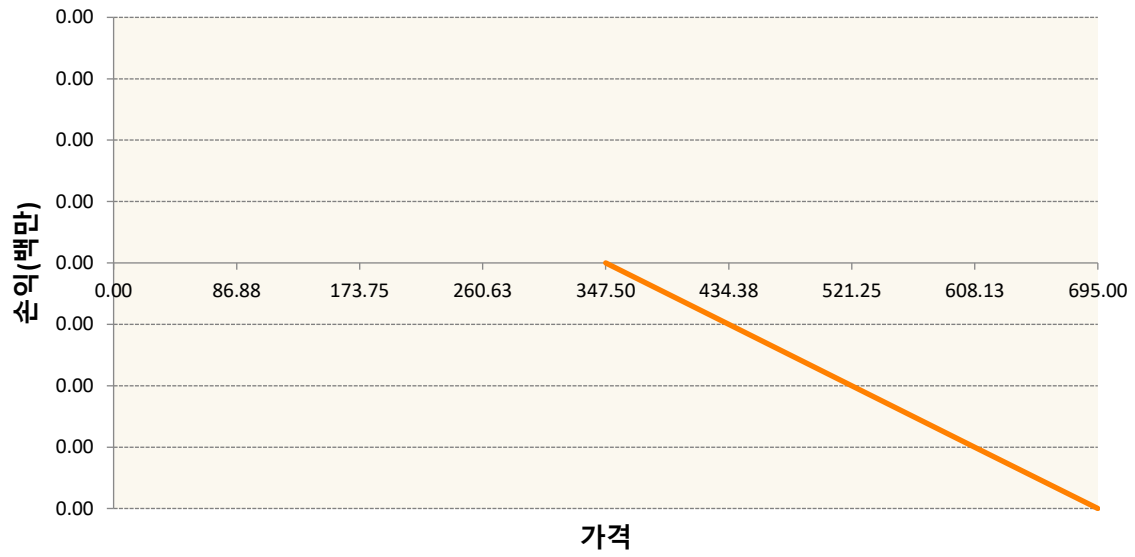
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	82	0	82	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	577	0	577	장내
누계	유가증권	옵션	167	4,109	-3,943	장내

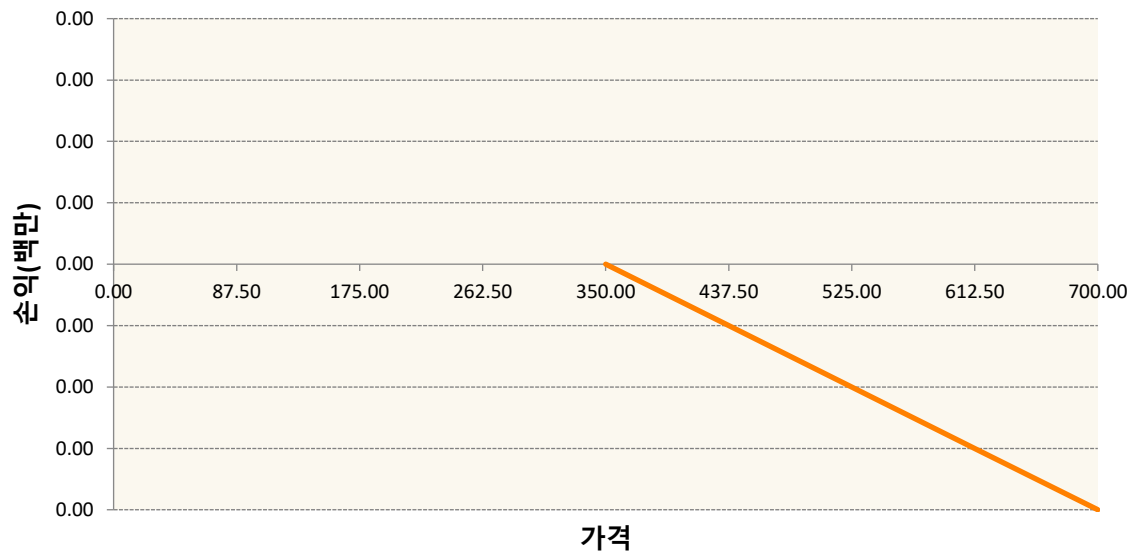
2. 만기시점의 손익구조



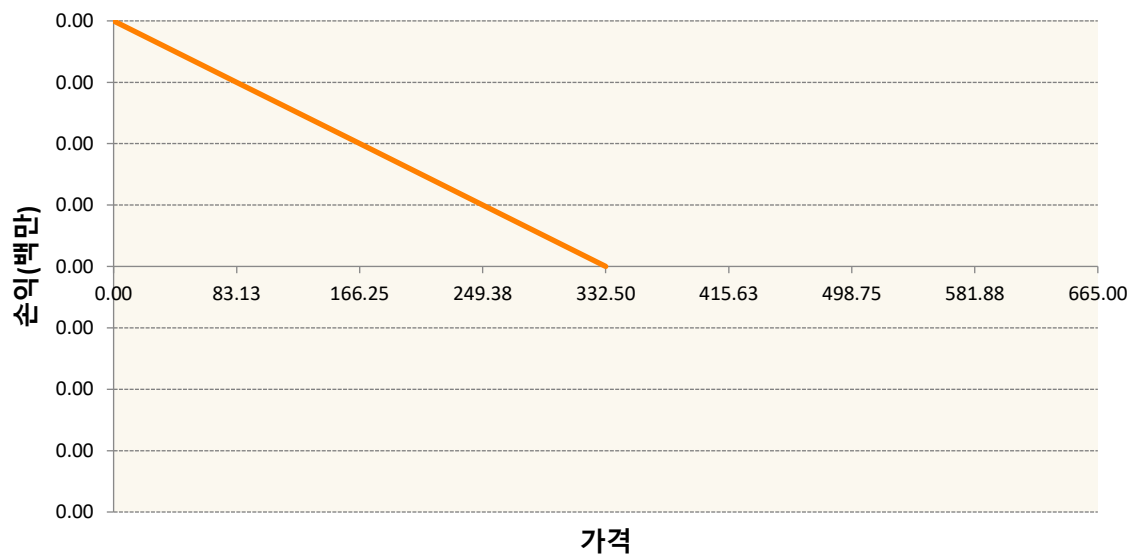
KR4201T53470-2023-05 콜347.5



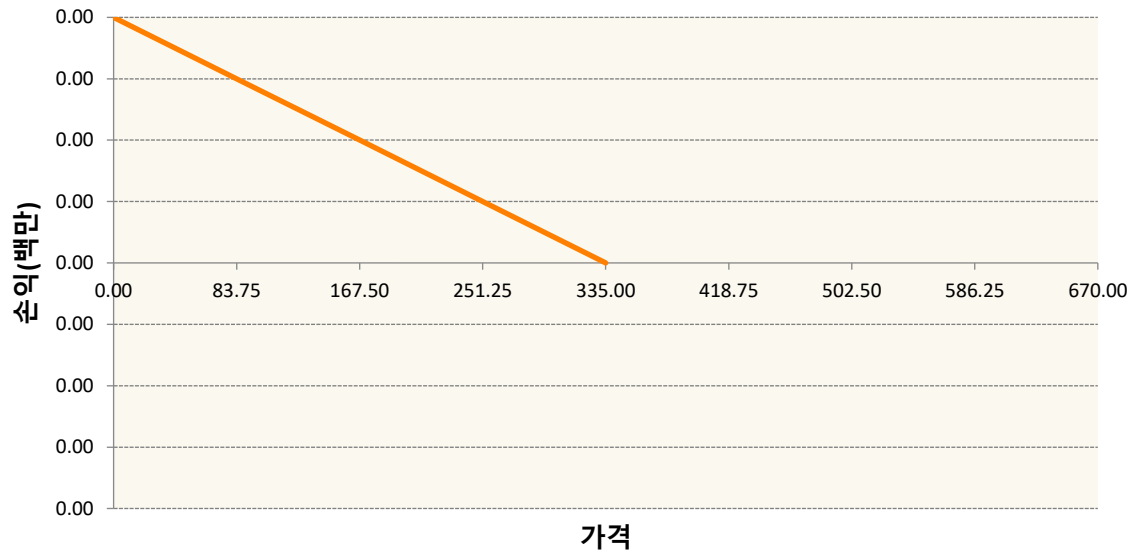
KR4201T53504-2023-05 콜350



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	-33
-5.33%	-22	-22	-22	-22	-22	-22	-22	-22
-2.67%	-11	-11	-11	-11	-11	-11	-11	-11
0%	0	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	11	11	11	11	11	11	11	11
5.33%	22	22	22	22	22	22	22	22
8.00%	33	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	-3
-5.33%	-2	-2	-2	-2	-2	-2	-2	-2
-2.67%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1
0%	0	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	1	1	1	1	1	1	1	1
5.33%	2	2	2	2	2	2	2	2
8.00%	3	3	3	3	3	3	3	3
KR4201T53470 2023-05 콜347.5								14
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	1	1	1	1	1	1	1	1
-5.33%	1	1	1	1	1	1	1	0
-2.67%	1	1	1	0	0	0	0	0
0%	0	0	0	0	0	0	0	-1

2.67%	-1	-1	-1	-2	-2	-3	-3
5.33%	-4	-4	-5	-6	-6	-7	-7
8.00%	-11	-11	-12	-12	-13	-13	-14

KR4201T53504

2023-05 콜350

100

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%	3	3	3	3	3	3	3
-2.67%	3	3	3	3	2	2	1
0%	3	2	1	0	-1	-3	-5
2.67%	-2	-5	-7	-10	-13	-17	-20
5.33%	-24	-28	-33	-37	-42	-46	-51
8.00%	-74	-78	-83	-87	-91	-96	-100

KR4301T53320

2023-05 풋332.5

6

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	6	6	6	6	6	6	6
-5.33%	4	4	4	4	4	4	4
-2.67%	1	1	2	2	2	2	2
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1
5.33%	-2	-2	-2	-1	-1	-1	-1
8.00%	-2	-2	-2	-2	-2	-2	-2

KR4301T53353

2023-05 풋335

6

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	6	6	6	6	6	6	6
-5.33%	4	4	4	4	4	4	4
-2.67%	2	2	2	2	2	2	2
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%	-2	-2	-2	-2	-2	-2	-2

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

(단위:백만원)

111

공시일	2023-05-03
기준일	2023-05-02

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	6,732	0	6,732	

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	2023-05-03
기준일	2023-05-02

H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	54	-54	
누계	유가증권	수익증권	5,397	0	5,397	

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	2023-05-03
기준일	2023-05-02

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	18,731	0	18,731	
누계	통화	선도	671	18,890	-18,219	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
FXW213D2Q KRW/USD 31-05-23E		724
FXW213D3Q KRW/USD 28-06-23E		521
FXW213D4S(KRW/USD 31-07-23E		267
FXW213D52(USD/KRW 31-05-23E		54
IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	3,518

공시일	2023-05-03
기준일	2023-05-02

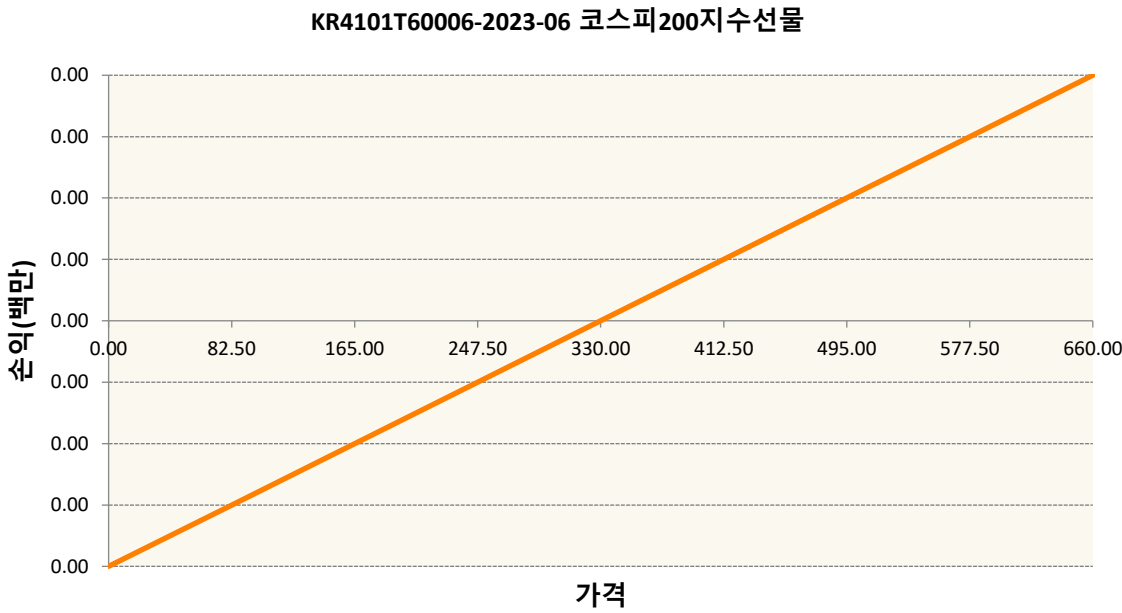
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

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	1,238	0	1,238	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101T60006			2023-06 코스피200지수선물				99
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-99	-99	-99	-99	-99	-99	-99
-5.33%	-66	-66	-66	-66	-66	-66	-66
-2.67%	-33	-33	-33	-33	-33	-33	-33
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	33	33	33	33	33	33	33
5.33%	66	66	66	66	66	66	66
8.00%	99	99	99	99	99	99	99

공시일	2023-05-03
기준일	2023-05-02

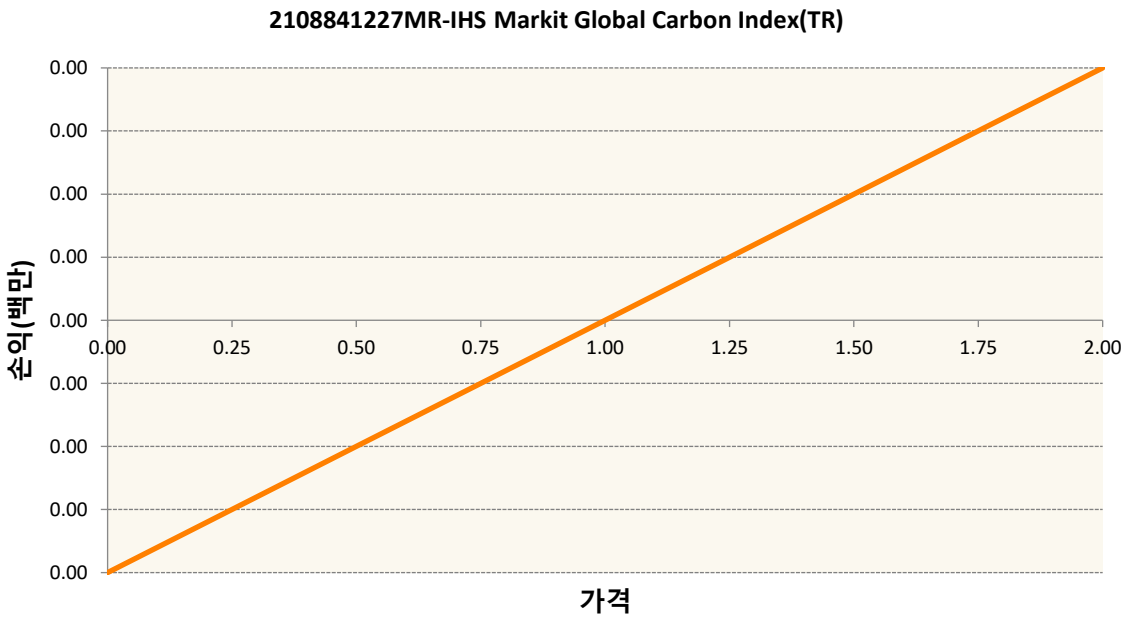
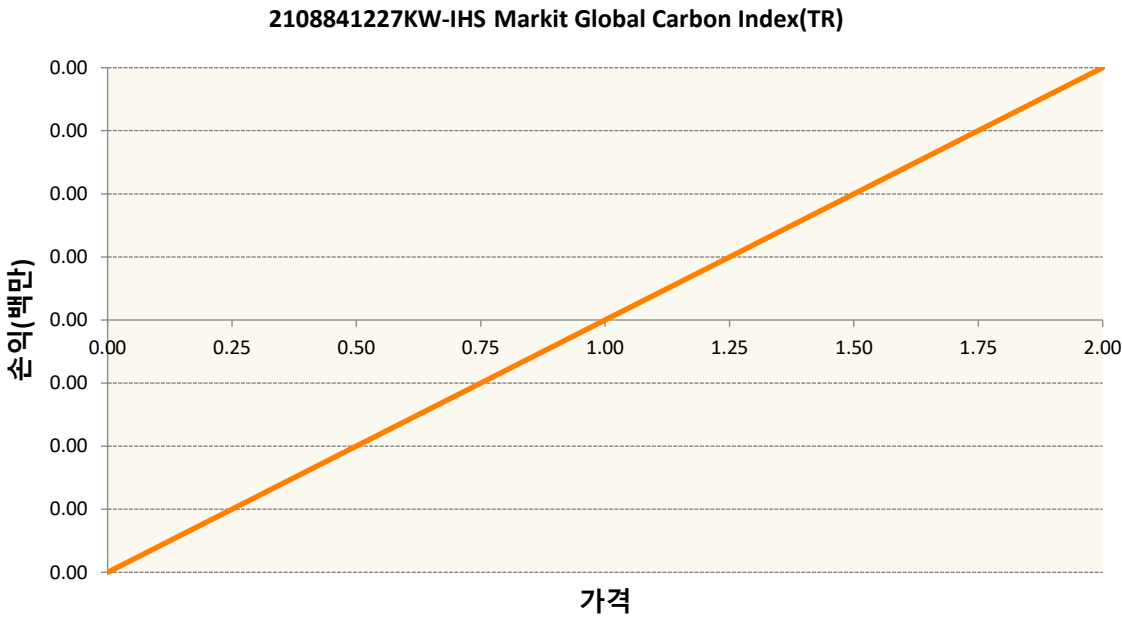
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

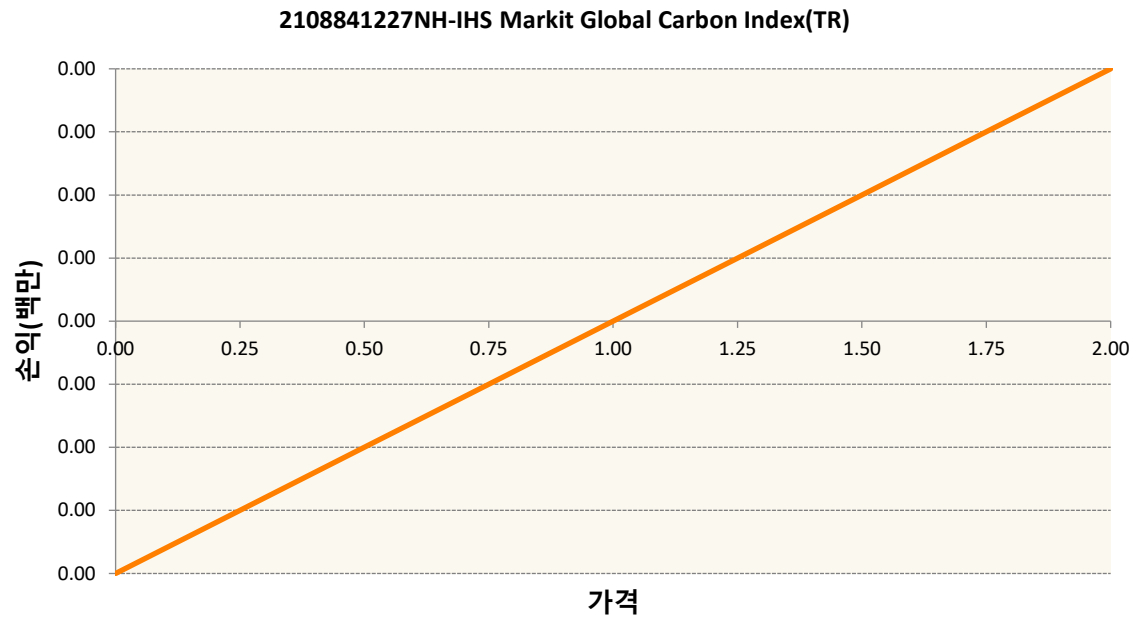
1. 계약금액

(단위:백만원)

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

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108841227IHS Markit Global Carbon Index(TR)		1,759
2108841227IHS Markit Global Carbon Index(TR)		207
2108841227IHS Markit Global Carbon Index(TR)		103

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)		(단위:백만원)
		3,604

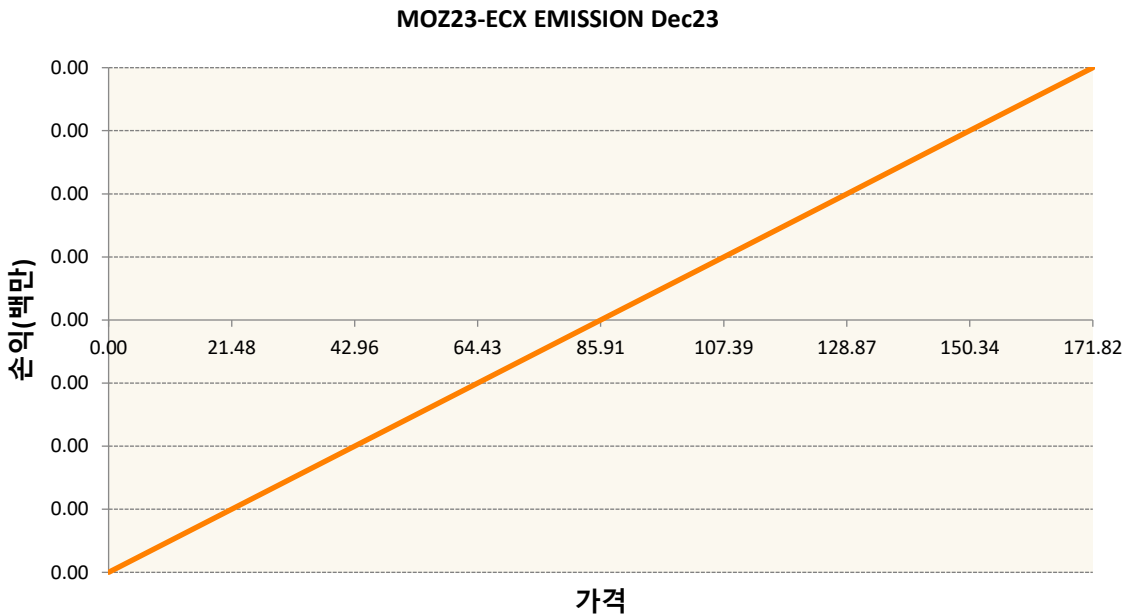
공시일	2023-05-03
기준일	2023-05-02

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	8,457	0	8,457	
누계	통화	선도	0	2,211	-2,211	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
FXW213D4S(KRW/EUR 31-05-23E		59
FXW213D4S(KRW/EUR 31-05-23E		59
FXW213D4S(KRW/EUR 31-05-23E		59
MOZ23	ECX EMISSION Dec23	677

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,320

공시일	2023-05-03
기준일	2023-05-02

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)	2
SWCSI00000 신한CSI Index 221222 (키움)	3
SWCSI00000 신한CSI Index 221222 (미래)	3
SWCSI00000 신한CSI Index 221222 (메리츠)	3

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

(단위:백만원)

21

공시일	2023-05-03
기준일	2023-05-02

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	8,143	0	8,143	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 230116(NH)	9
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 230116(메리츠)	12
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 230116(미래)	10
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 230427(키움)	1

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

(단위:백만원)

56

공시일	2023-05-03
기준일	2023-05-02

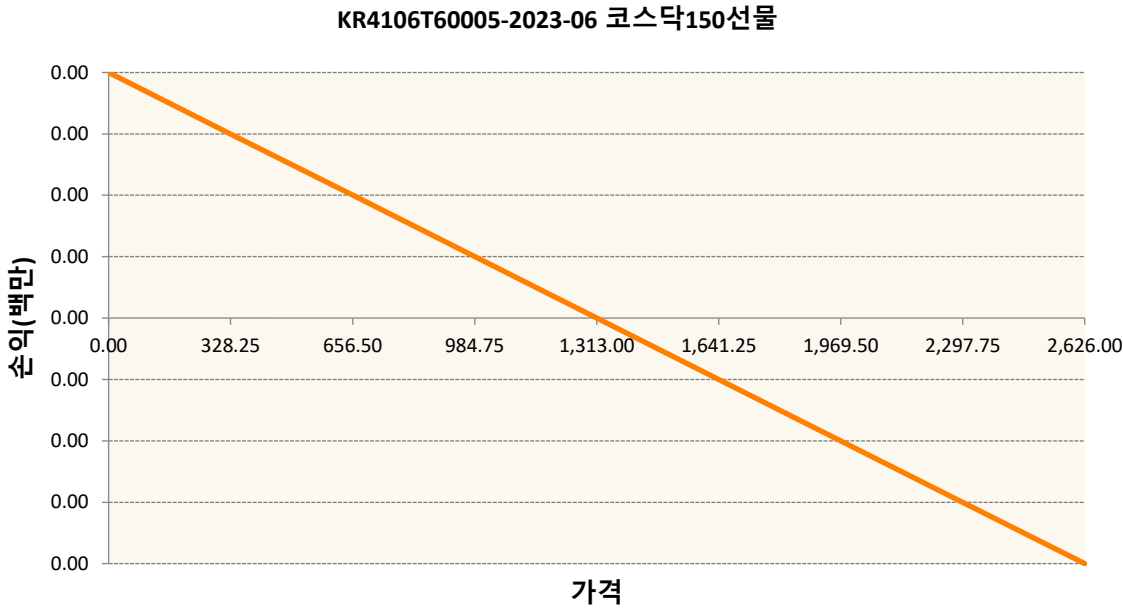
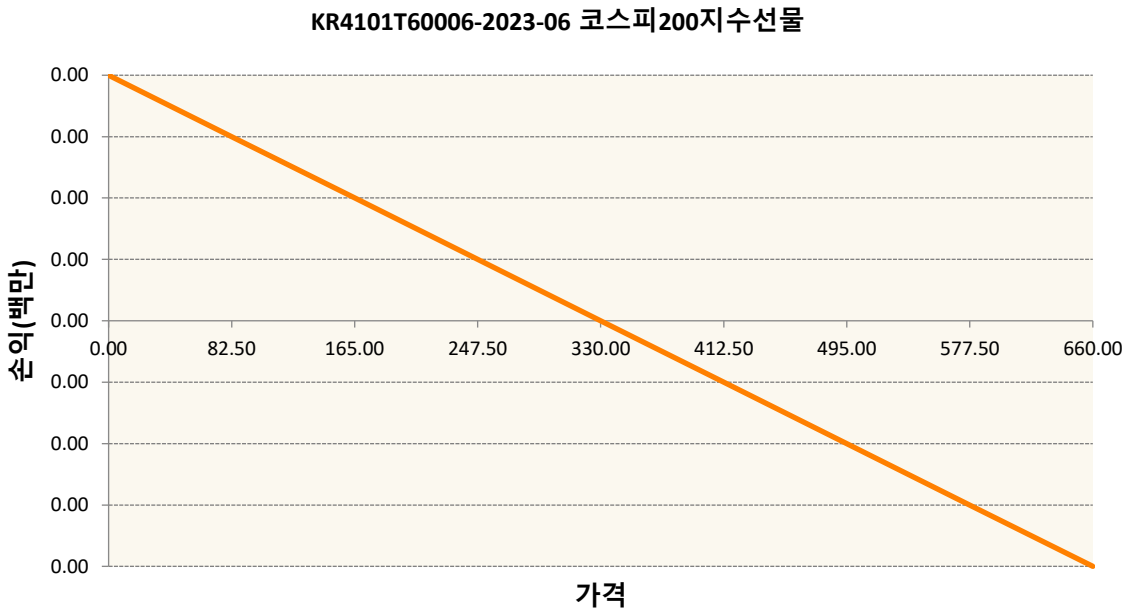
에쿼티알파일반사모혼합자산

1. 계약금액

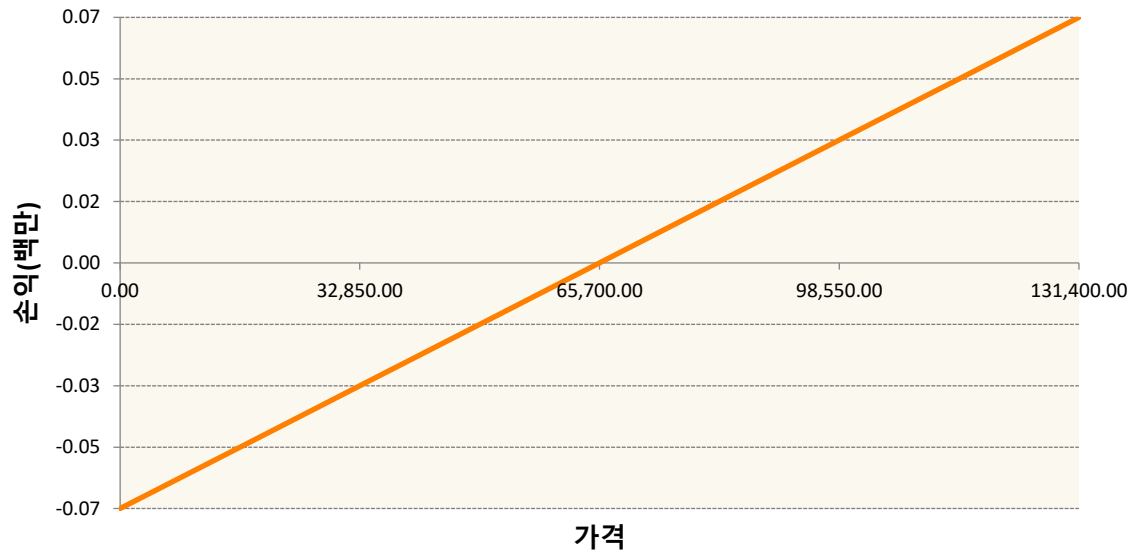
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	56	411	-355	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	874	3,918	-3,044	장내
누계	유가증권	스왑	0	0	0	장외

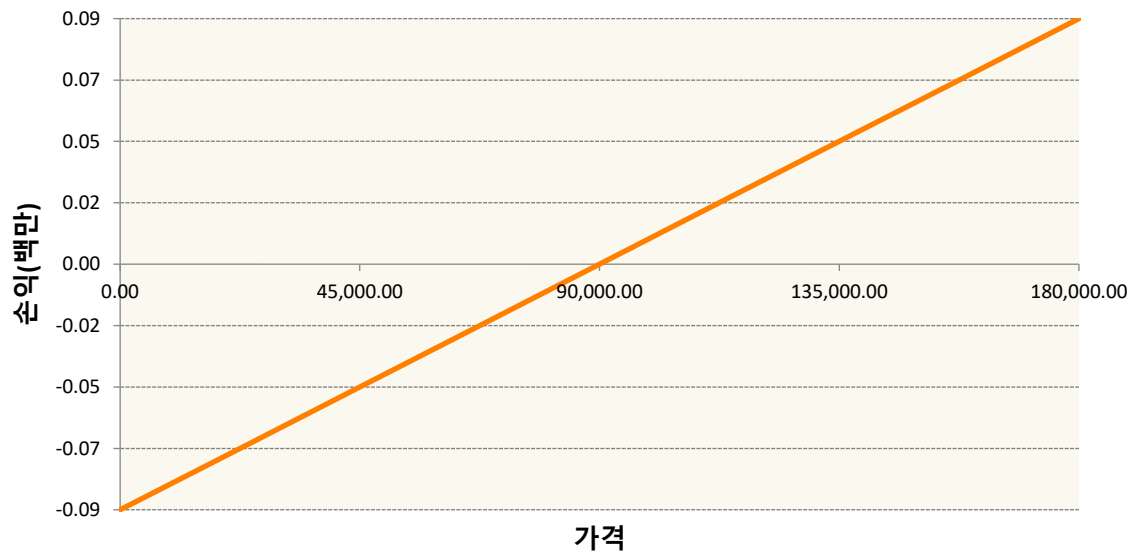
2. 만기시점의 손익구조



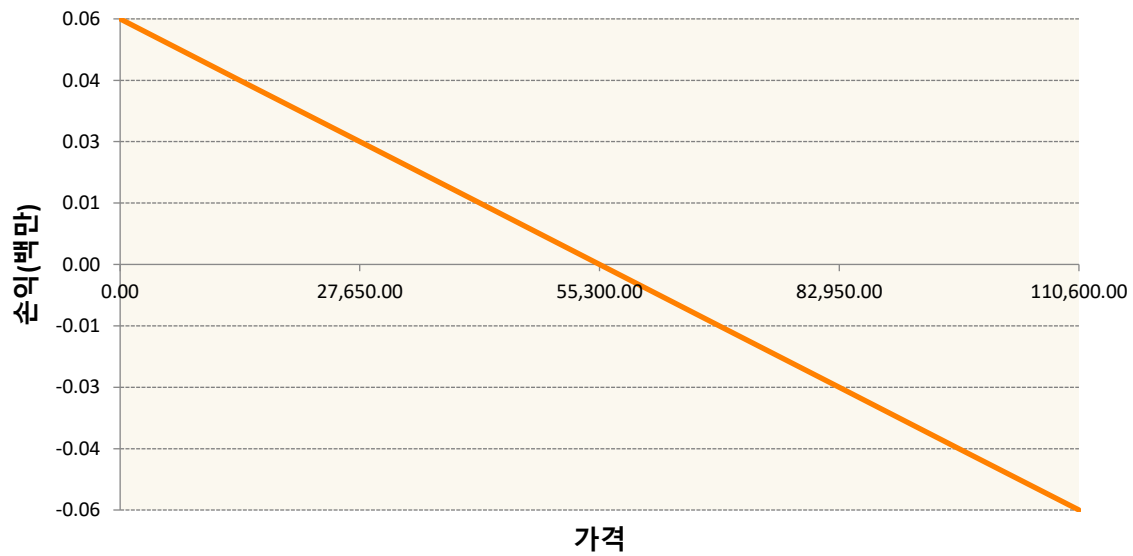
KR4111T50006-2023-05 삼성전자개별선물



KR4150T50004-2023-05 SK하이닉스개별선물



KR41F7T50008-2023-05 카카오페이개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
KR4101T600	2023-06 코스피200지수선물	165
KR4106T600	2023-06 코스닥150선물	142
KR4111T500	2023-05 삼성전자개별선물	44
KR4150T500	2023-05 SK하이닉스개별선물	26
KR41F7T500	2023-05 카카오페이개별선물	7
KRS0004099	SWAP_MICRON TECH_0308	0.06
KRS0004212	SWAP_SPDR S&P BIOTECH_0413	0.11

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	668

공시일	2023-05-03
기준일	2023-05-02

코리아인덱스(주식-파생형)(종)

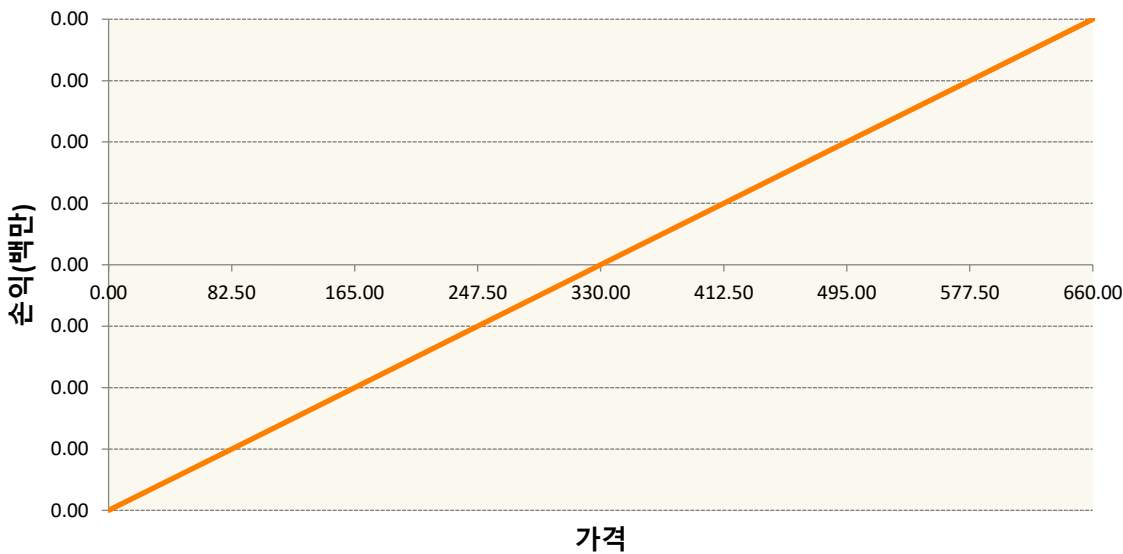
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	990	0	990	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101T60006-2023-06 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101T60006		2023-06 코스피200지수선물					79
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-79	-79	-79	-79	-79	-79	-79
-5.33%	-53	-53	-53	-53	-53	-53	-53
-2.67%	-26	-26	-26	-26	-26	-26	-26
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	26	26	26	26	26	26	26
5.33%	53	53	53	53	53	53	53
8.00%	79	79	79	79	79	79	79

공시일	2023-05-03
기준일	2023-05-02

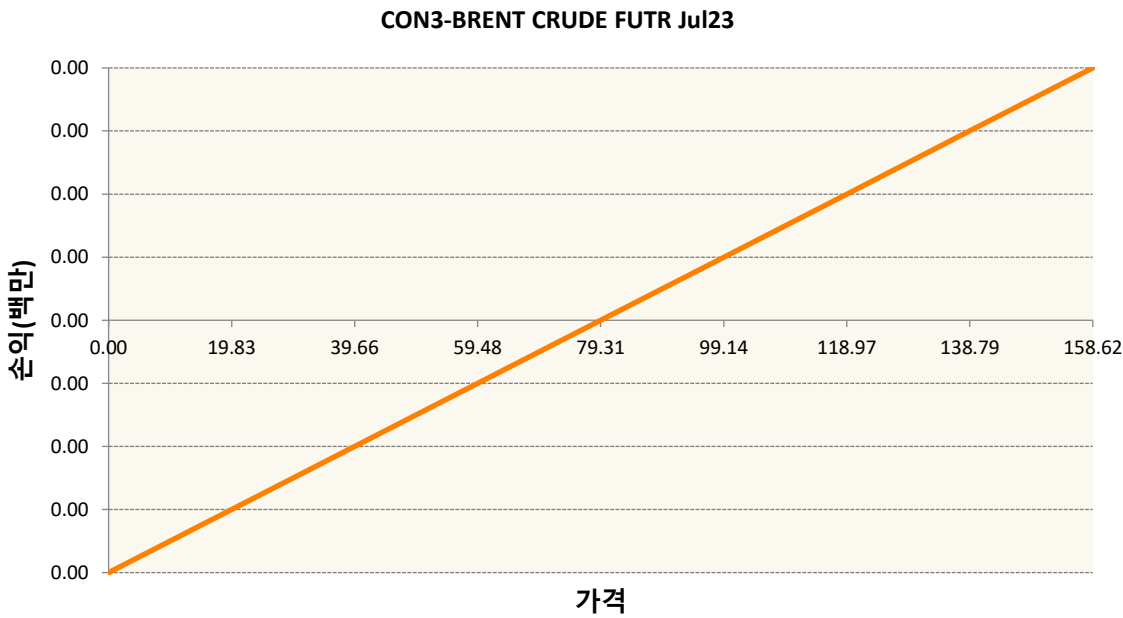
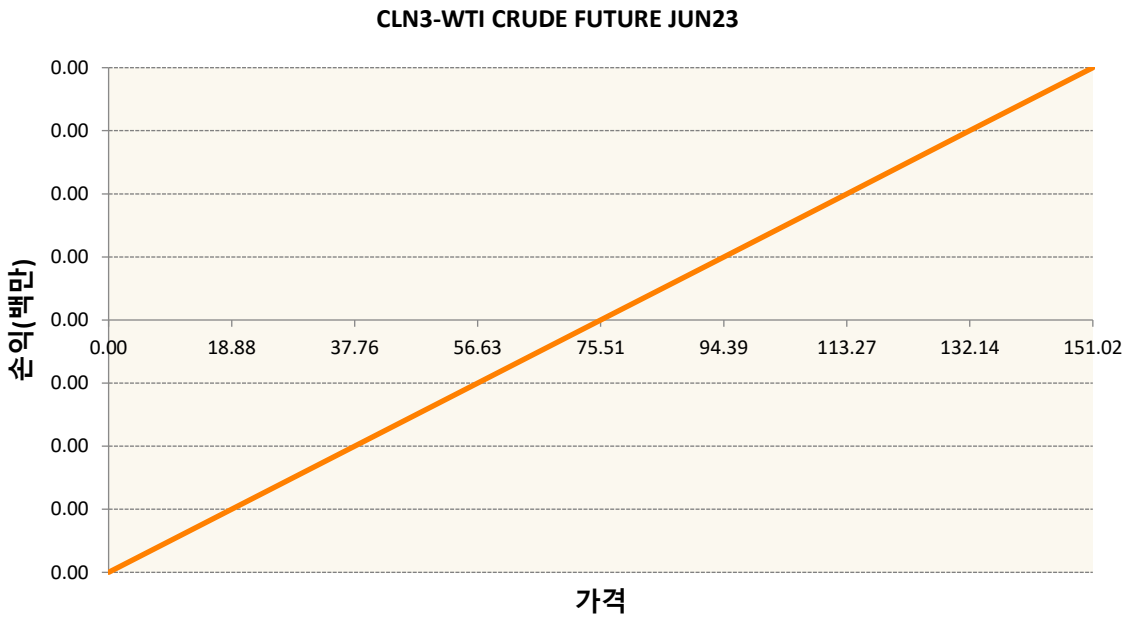
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

1. 계약금액

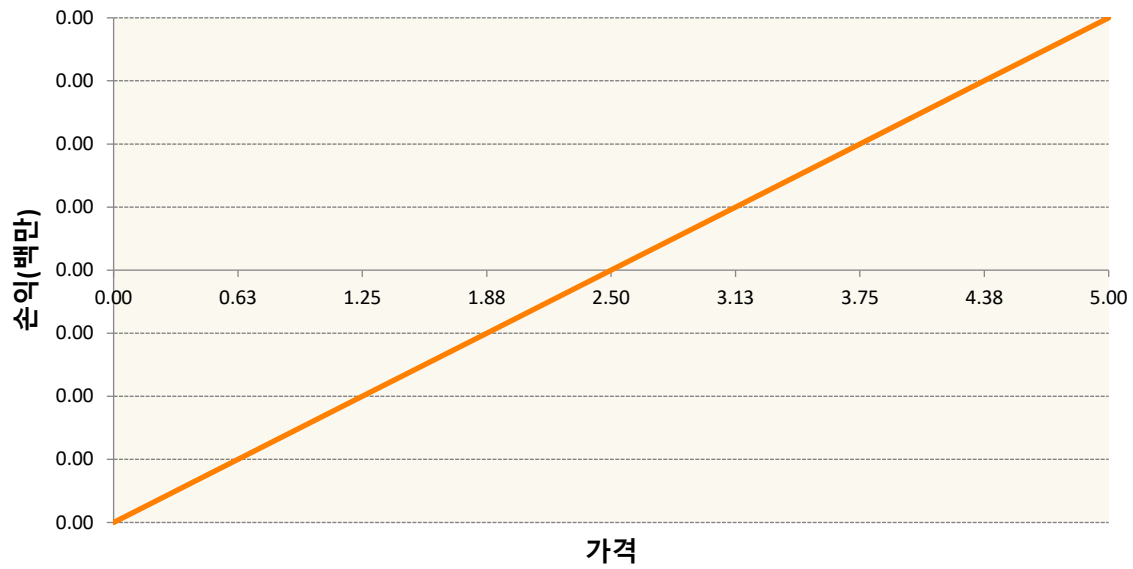
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,345	161	1,184	

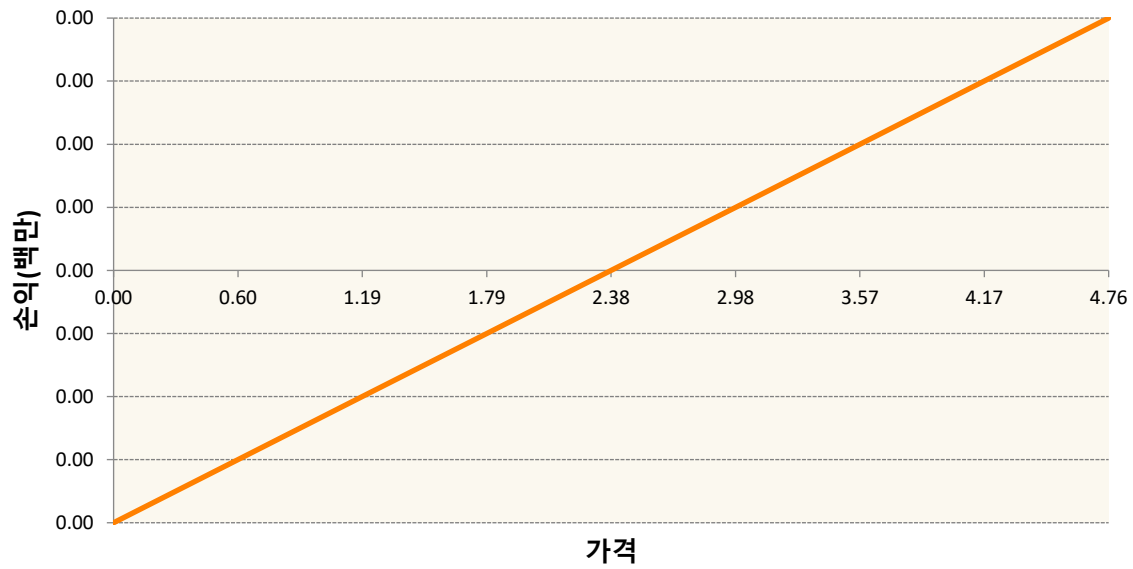
2. 만기시점의 손익구조



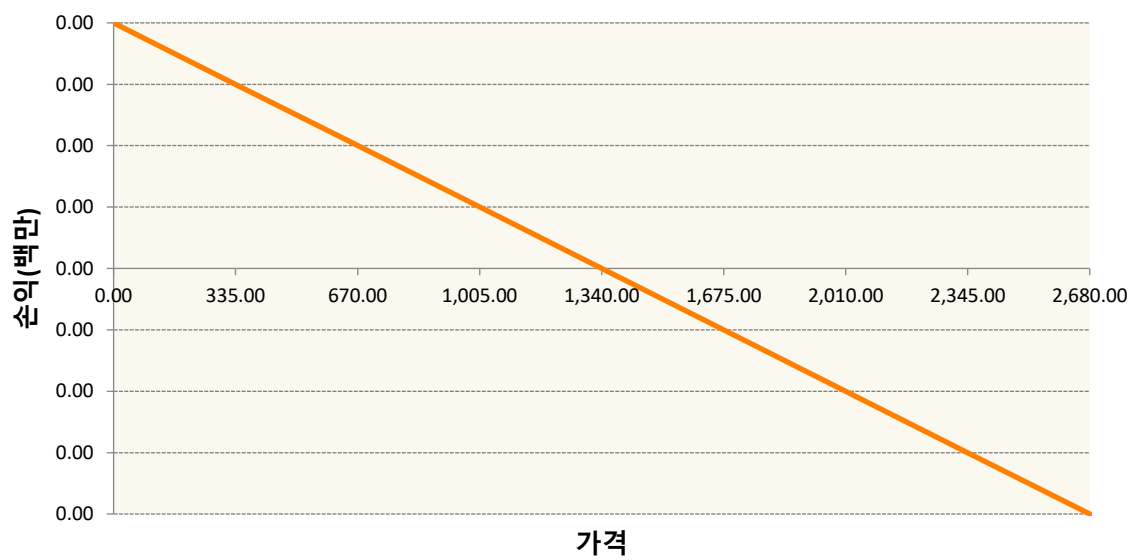
EON3-E-MINI NATURAL GAS JUL23



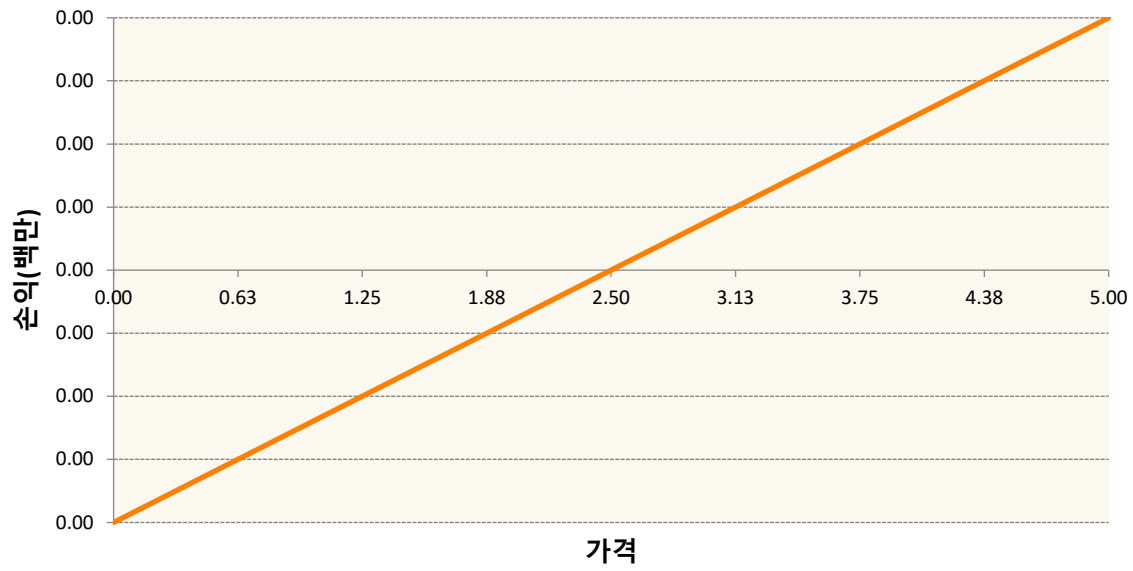
HON3-NY Harb ULSD Fut Jul23



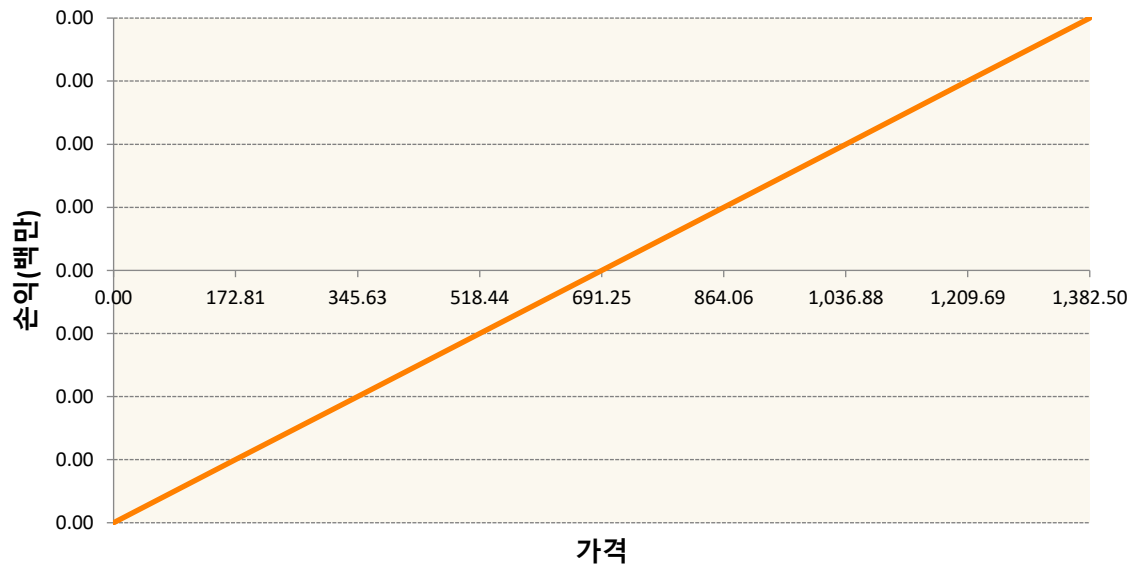
KR4175T50001-2023-05 달러선물



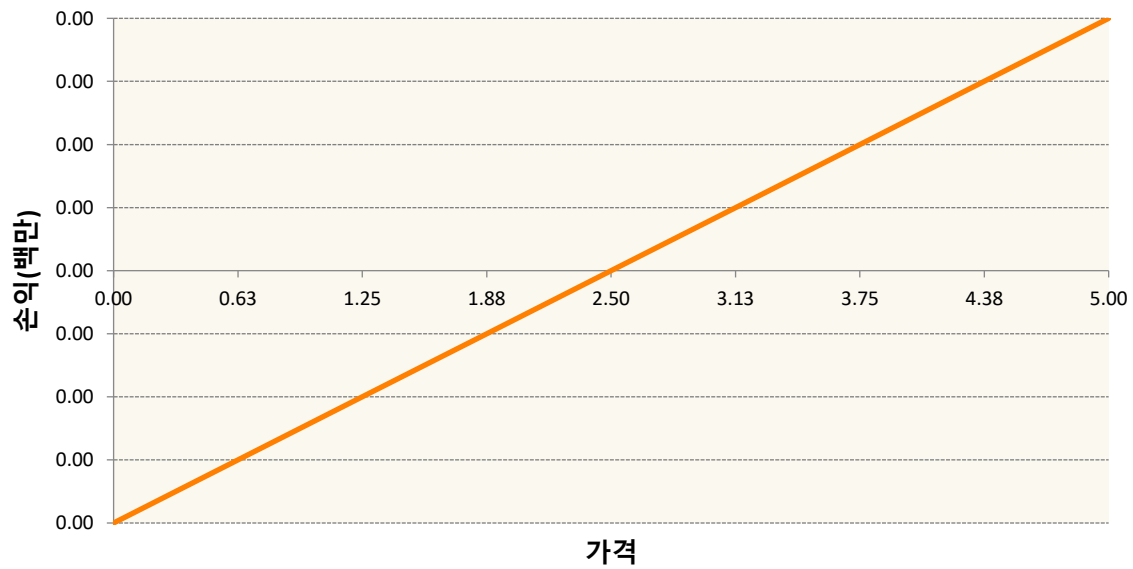
NGN23-NATURAL GAS FUTR JUL23



QSN3-Low Su Gasoil G JUL23



XBN3-GASOLINE RBOB FUT JUL23



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
CLN3	WTI CRUDE FUTURE JUN23	24
CON3	BRENT CRUDE FUTR Jul23	34
EON3	E-MINI NATURAL GAS JUL23	1
HON3	NY Harb ULSD Fut Jul23	10
KR4175T500	2023-05 달러선물	13
NGN23	NATURAL GAS FUTR JUL23	21
QSN3	Low Su Gasoil G JUL23	7
XBN3	GASOLINE RBOB FUT JUL23	11

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	210