

공시일	2023-05-04
기준일	2023-05-03

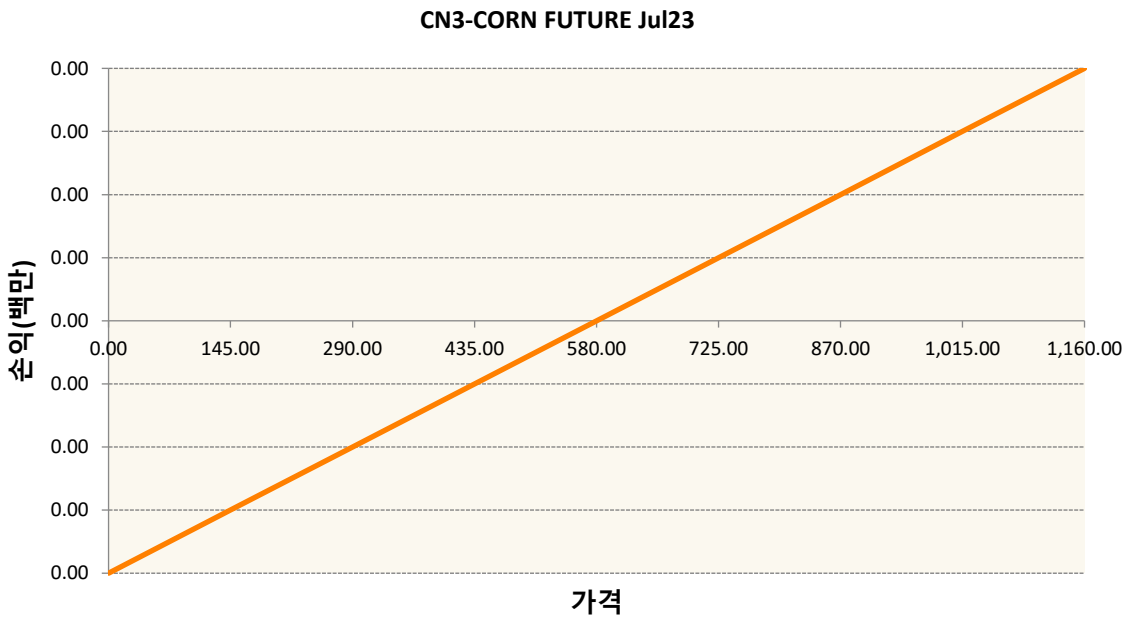
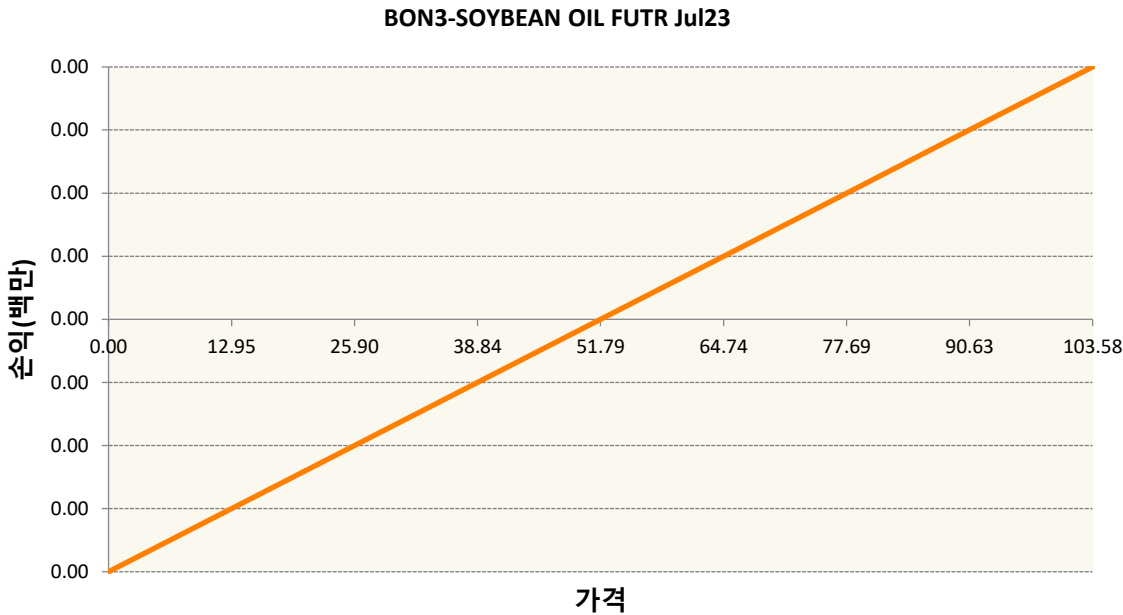
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

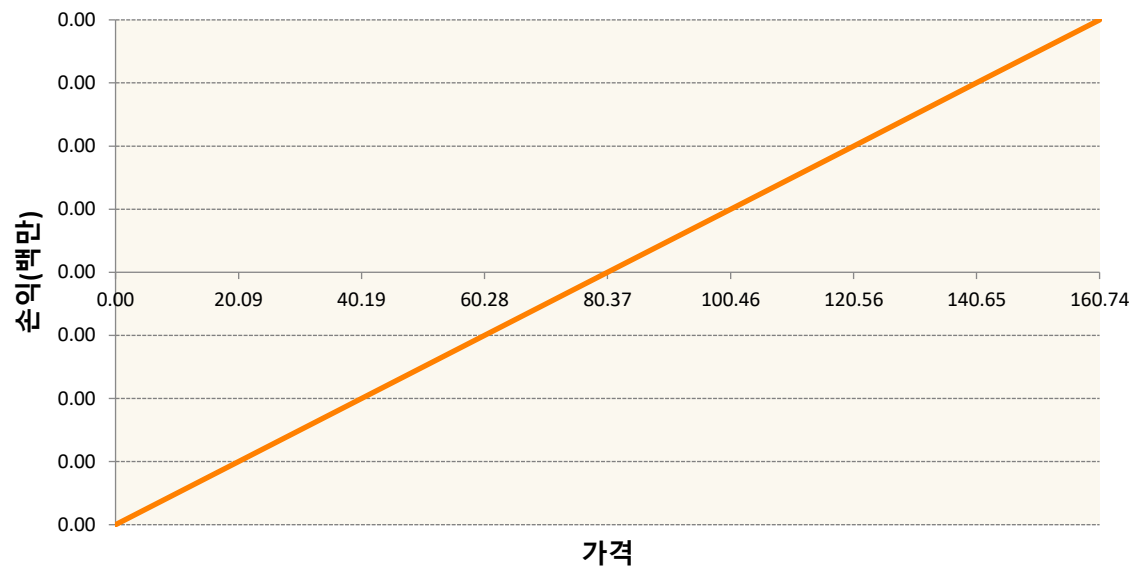
(단위:USD 백만)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,255	535	4,720	

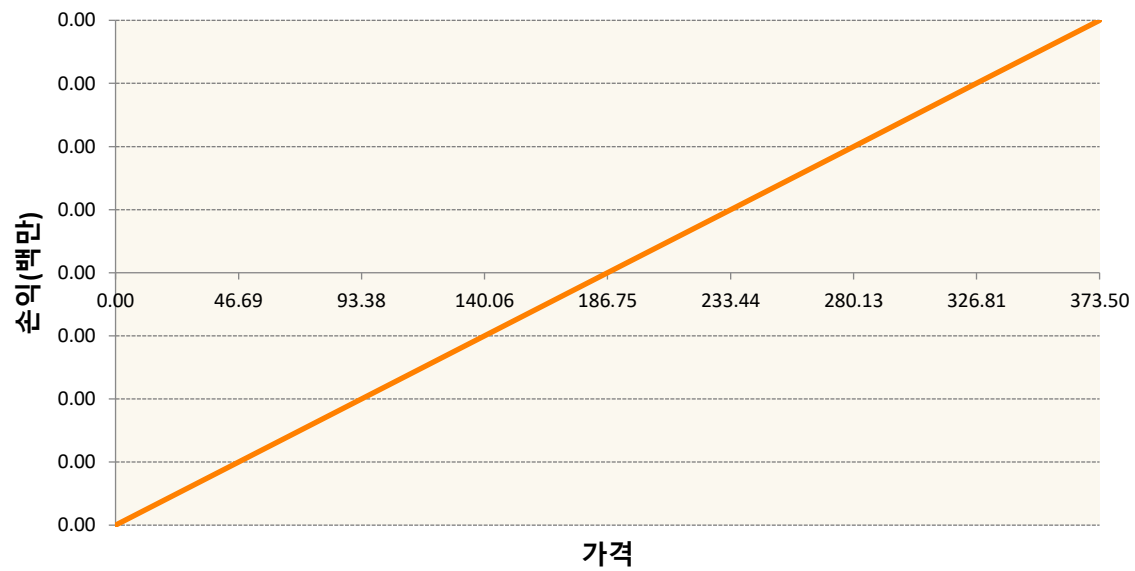
2. 만기시점의 손익구조



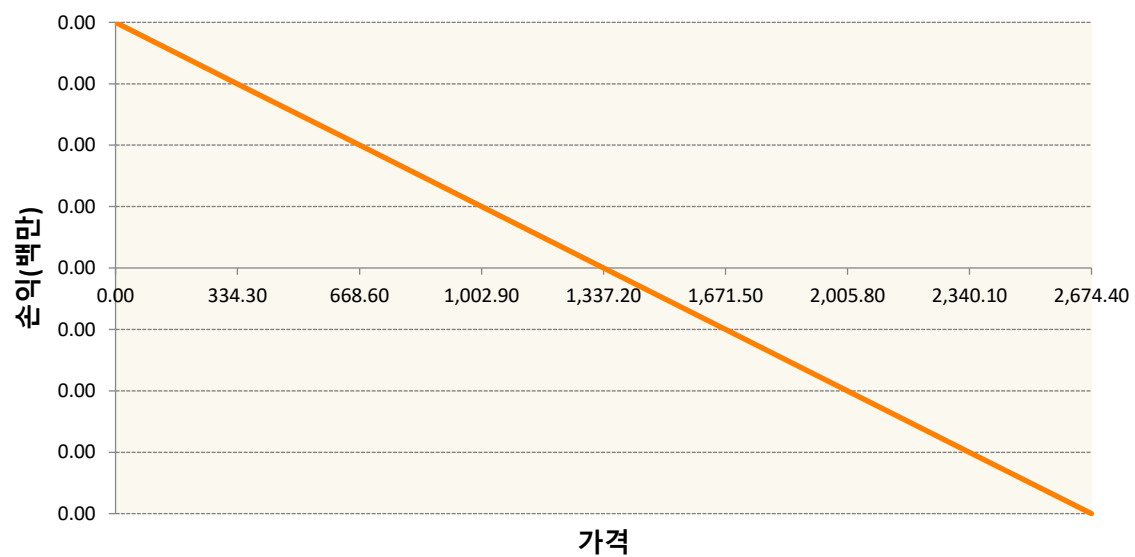
CTN3-COTTON NO.2 FUTR Jul23



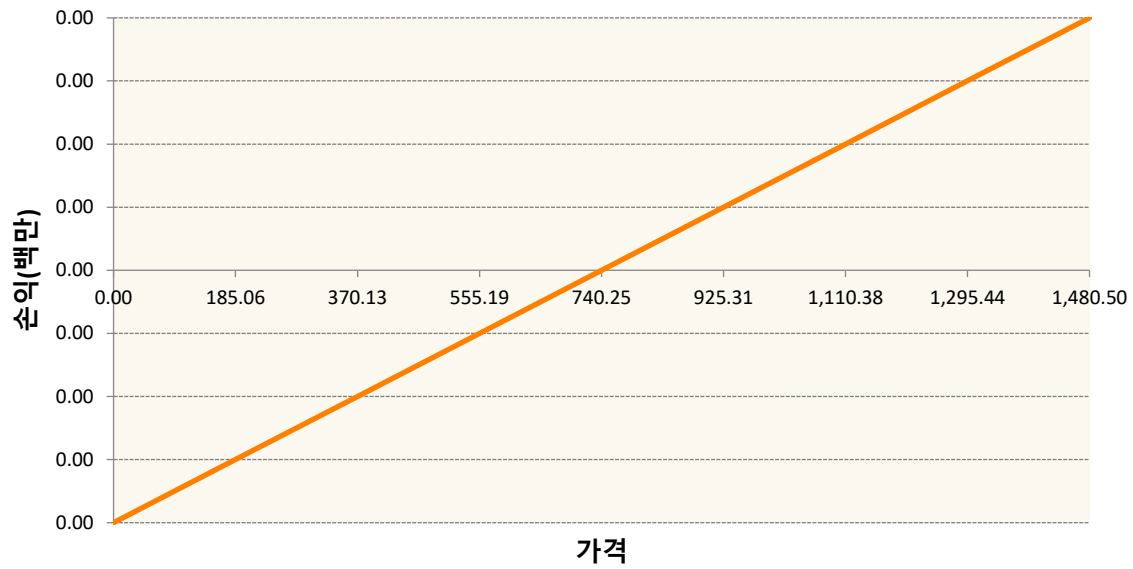
KCN3-COFFEE 'C' FUTURE Jul23



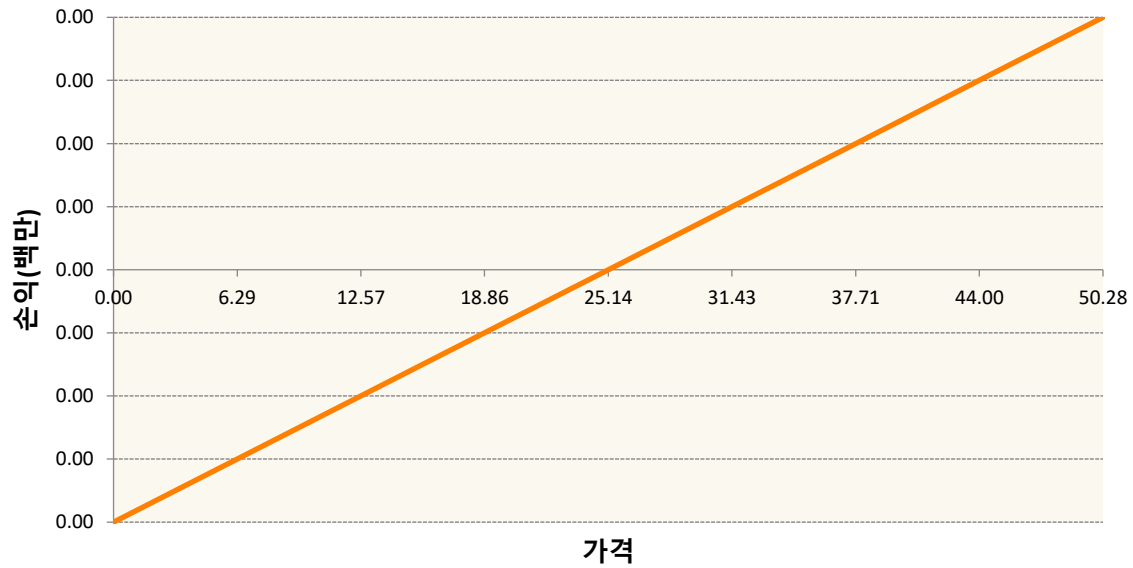
KR4175T50001-2023-05 달러선물



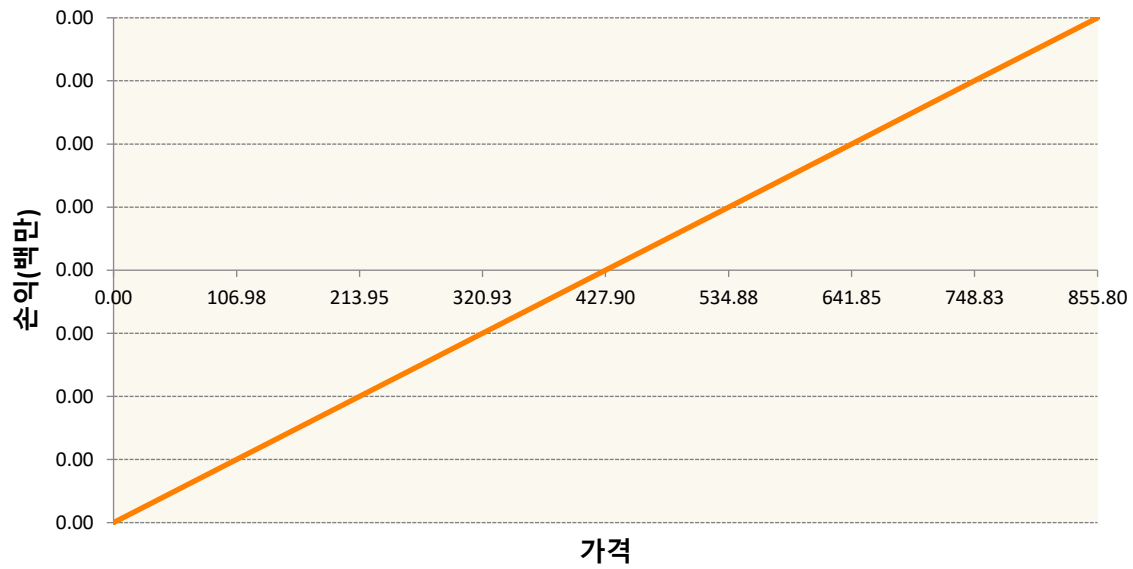
KWN3-KC HRW WHEAT FUT Jul23

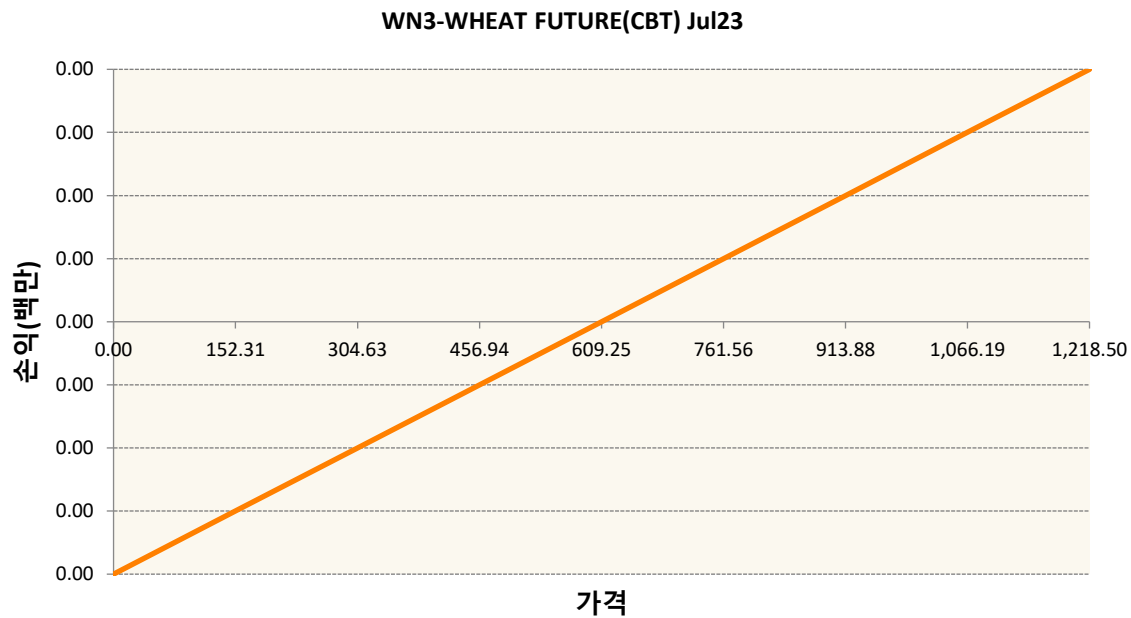
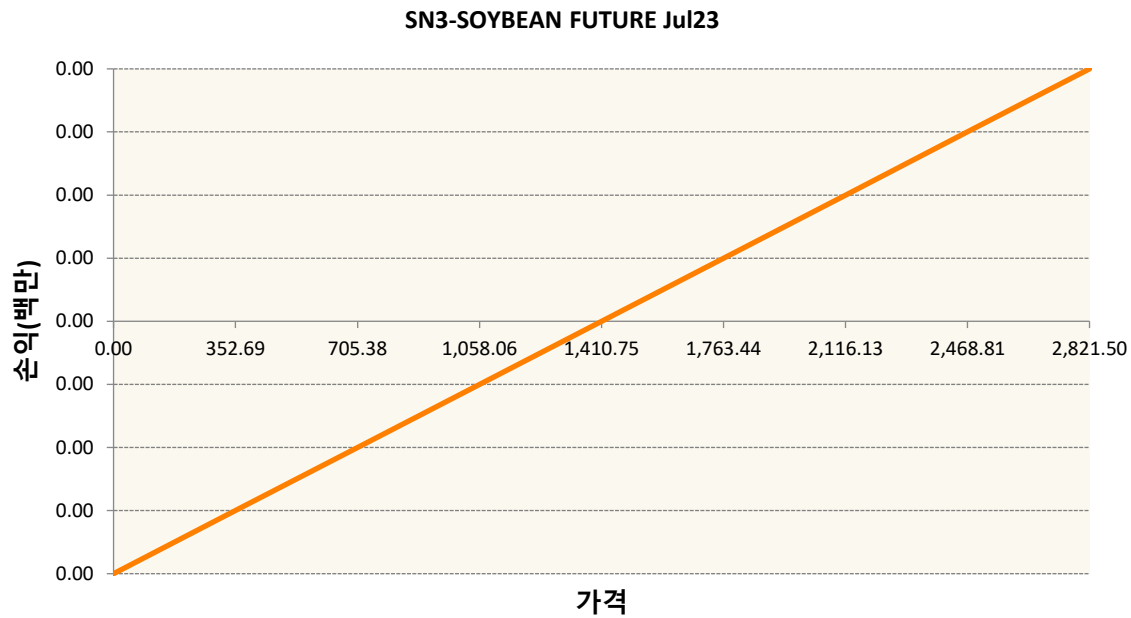


SBN3-Sugar #11 (WORLD) Jul23



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	2023-05-04
기준일	2023-05-03

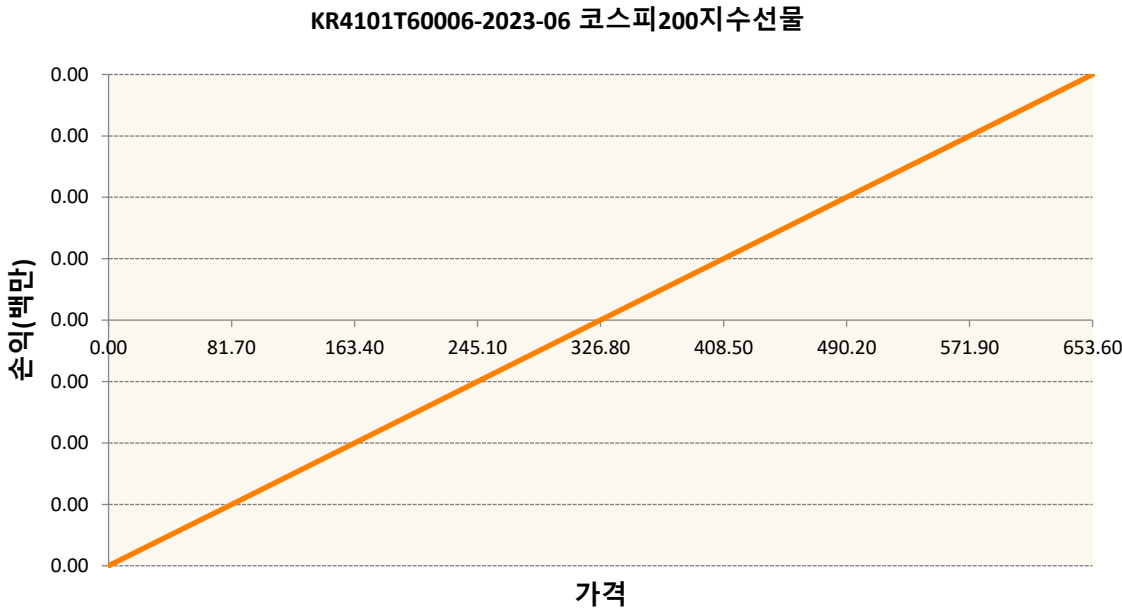
스마트인덱스모

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	2,860	0	2,860	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101T60006		2023-06 코스피200지수선물					229
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-229	-229	-229	-229	-229	-229	-229
-5.33%	-152	-152	-152	-152	-152	-152	-152
-2.67%	-76	-76	-76	-76	-76	-76	-76
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	76	76	76	76	76	76	76
5.33%	152	152	152	152	152	152	152
8.00%	229	229	229	229	229	229	229

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

(단위:백만원)

245

공시일	2023-05-04
기준일	2023-05-03

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)

634

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2023-05-04
기준일	2023-05-03

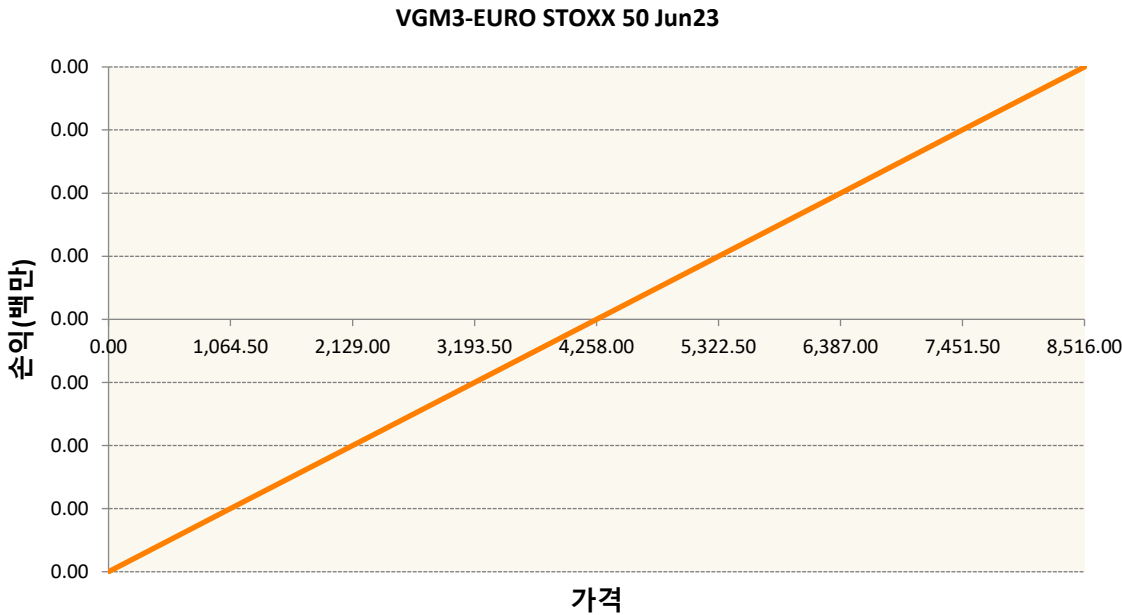
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	357	0	357	

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	2023-05-04
기준일	2023-05-03

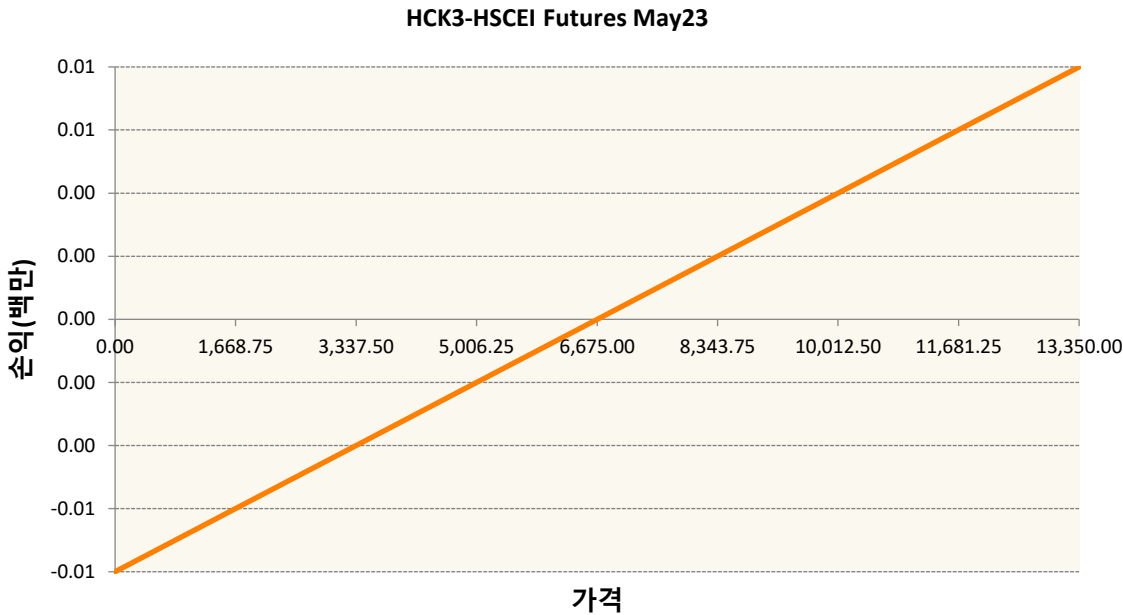
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	852	0	852	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	2023-05-04
기준일	2023-05-03

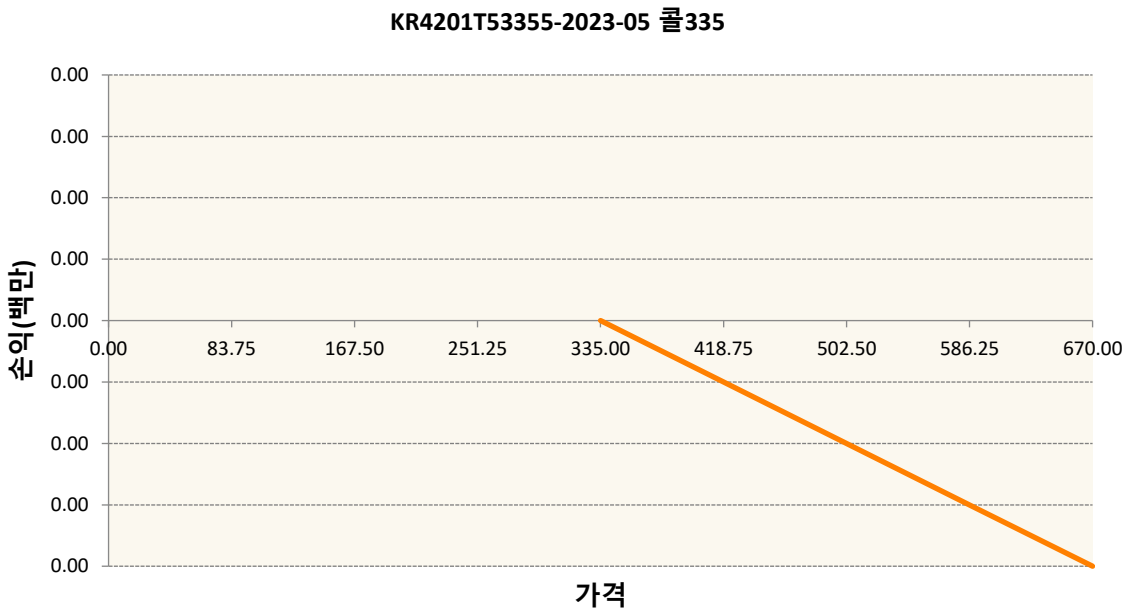
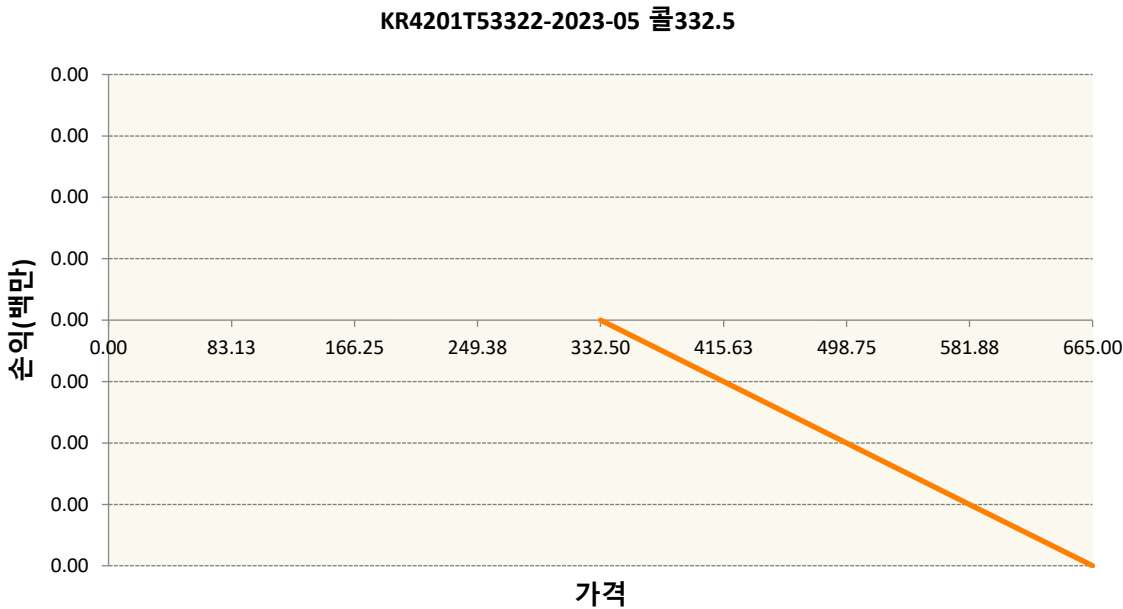
커버드콜모(주식혼합-파생형)

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



The graph displays a linear relationship between price and profit. The x-axis, labeled '가격' (Price), ranges from 0.00 to 665.00 with major ticks every 83.13 units. The y-axis, labeled '이익(백만)' (Profit in millions), ranges from 0.00 to 0.00 with major ticks every 0.00 units. A single orange line is plotted, starting at the origin (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 in millions)
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					2,051
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	270	270	270	269	268	266	263
-5.33%	269	267	264	259	251	242	231
-2.67%	249	236	219	200	178	153	127
0%	114	77	39	0	-40	-80	-121
2.67%	-311	-354	-398	-441	-485	-529	-574
5.33%	-1,060	-1,082	-1,108	-1,137	-1,168	-1,200	-1,234
8.00%	-1,976	-1,982	-1,990	-2,002	-2,016	-2,032	-2,051
KR4201T53355		2023-05 콜335					501
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	52	52	52	52	52	51	51
-5.33%	52	52	51	50	49	47	45
-2.67%	49	47	44	40	35	30	24
0%	26	18	9	0	-10	-19	-29
2.67%	-61	-73	-85	-98	-110	-122	-134
5.33%	-239	-247	-255	-265	-274	-284	-294
8.00%	-474	-477	-480	-485	-490	-495	-501
KR4301T53320 2023-05 풋332.5							427

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-426	-426	-426	-426	-426	-427	-427
-5.33%	-270	-270	-270	-271	-272	-274	-276
-2.67%	-116	-118	-121	-124	-128	-132	-136
0%	19	13	6	0	-6	-13	-20
2.67%	106	99	92	85	78	71	63
5.33%	141	137	133	129	124	118	113
8.00%	149	148	146	145	142	140	137

KR4301T53353 2023-05 풋335							256
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-256	-256	-256	-256	-256	-256	-256
-5.33%	-164	-164	-165	-165	-165	-166	-167
-2.67%	-74	-75	-76	-77	-79	-81	-83
0%	9	6	3	0	-3	-7	-10
2.67%	70	65	61	57	52	48	44
5.33%	98	95	92	89	85	82	78
8.00%	105	104	103	102	100	98	96

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

(단위:백만원)

3,296

공시일	2023-05-04
기준일	2023-05-03

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	2023-05-04
기준일	2023-05-03

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

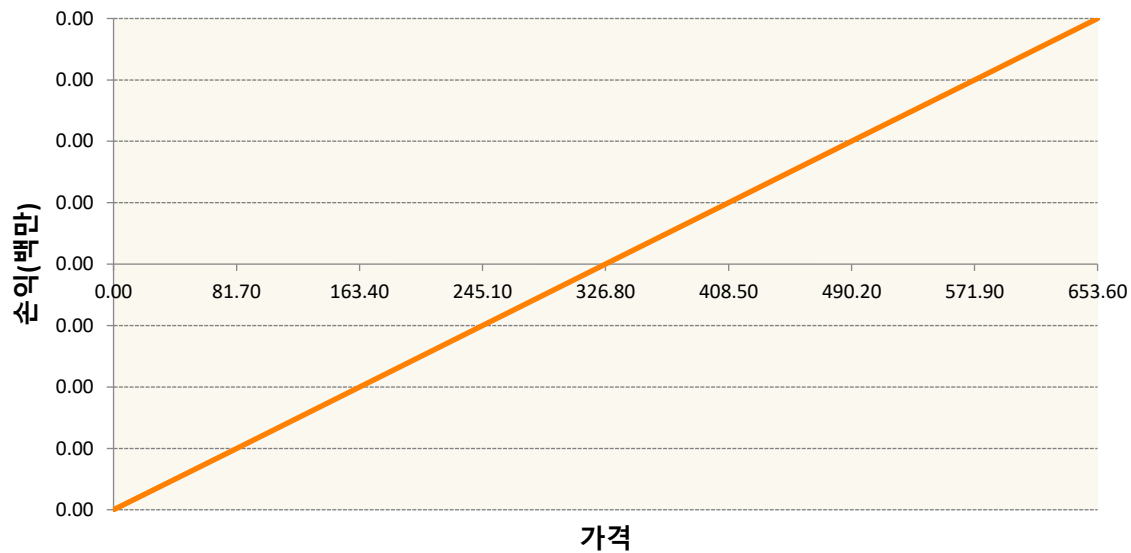
1. 계약금액

(단위:백만원)

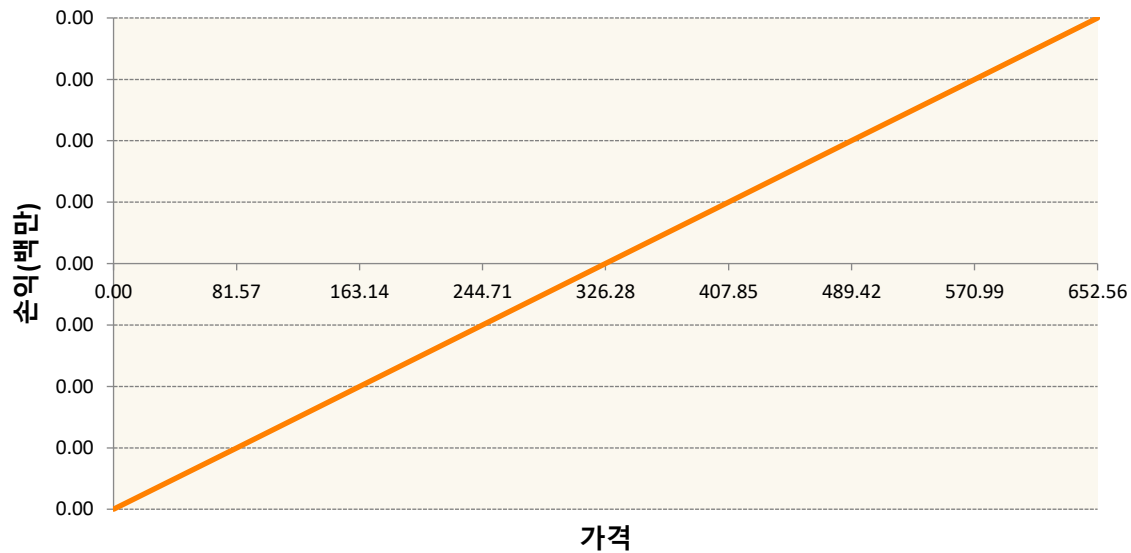
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	572	0	572	장내
누계	유가증권	옵션	167	4,109	-3,943	장내

2. 만기시점의 손익구조

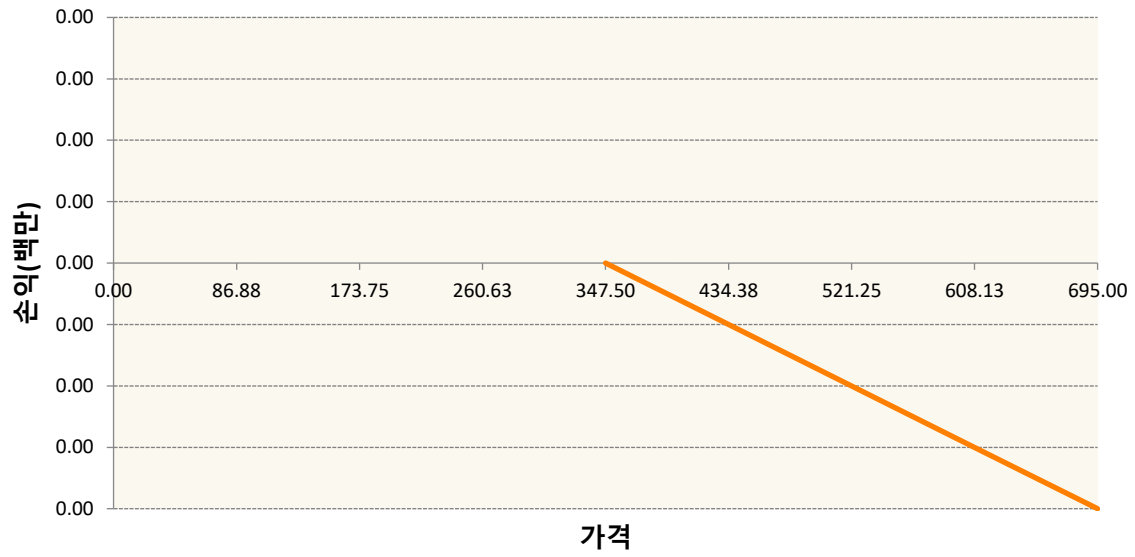
KR4101T60006-2023-06 코스피200지수선물



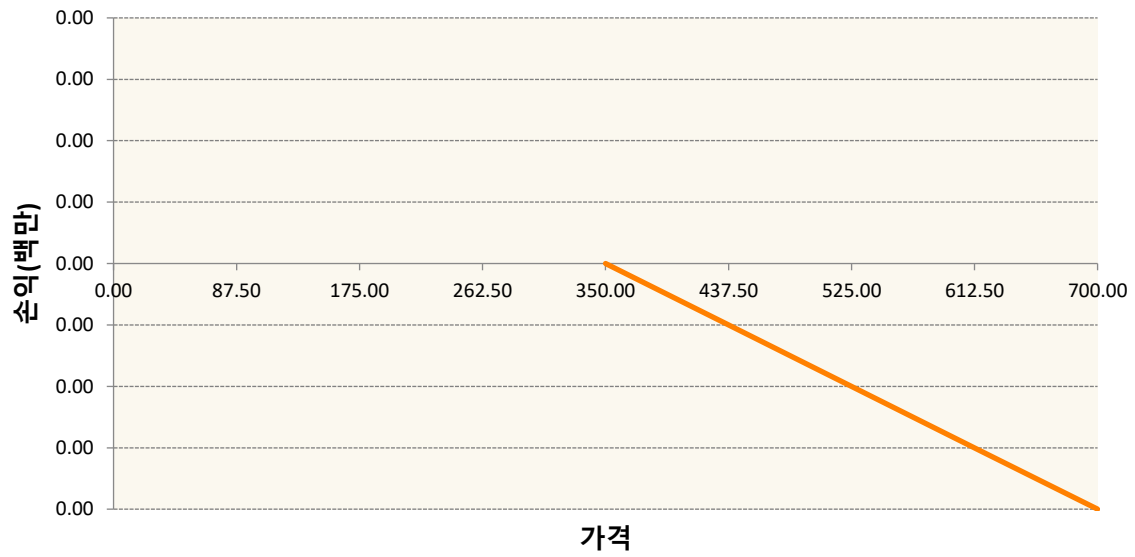
KR4105T50008-2023-05 미니코스피200 선물



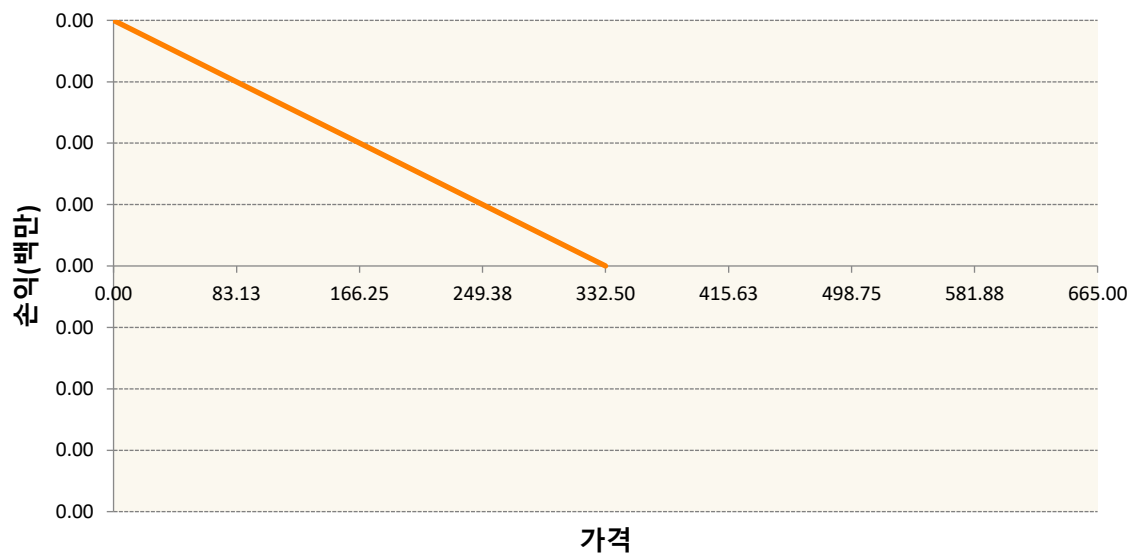
KR4201T53470-2023-05 콜347.5



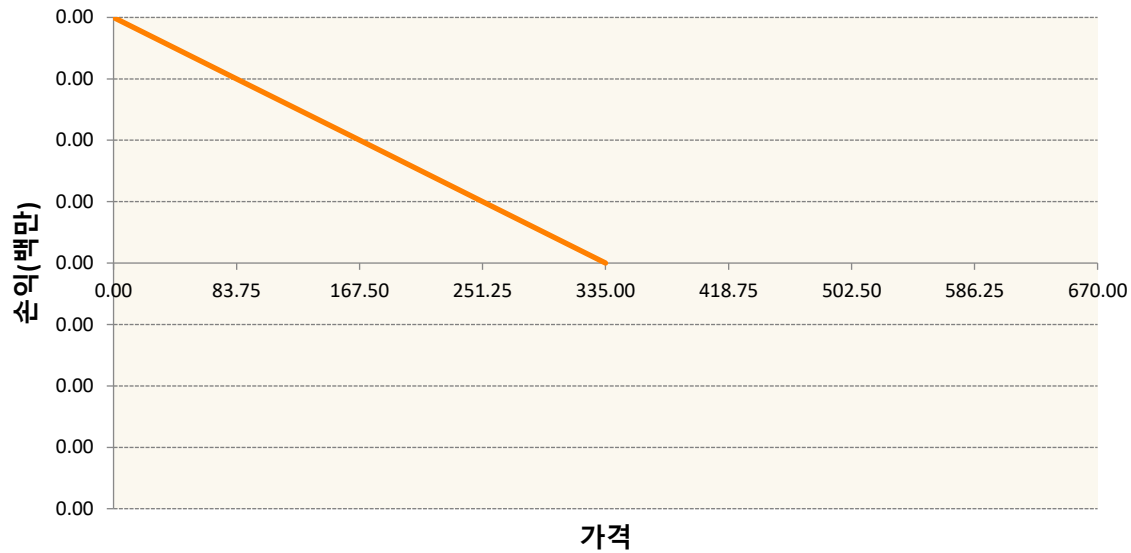
KR4201T53504-2023-05 콜350



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					11
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	0	0	0	0	0	0	0
-5.33%	0	0	0	0	0	0	0
-2.67%	0	0	0	0	0	0	0
0%	0	0	0	0	0	0	0

2.67%	0	0	-1	-1	-1	-2	-2
5.33%	-3	-3	-4	-4	-5	-5	-6
8.00%	-8	-9	-9	-10	-10	-11	-11

KR4201T53504 2023-05 콜350 81

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
-5.33%	1	1	1	1	1	1	1
-2.67%	1	1	1	1	1	1	0
0%	1	1	1	0	-1	-2	-3
2.67%	-1	-3	-4	-6	-9	-11	-14
5.33%	-15	-18	-22	-26	-30	-34	-38
8.00%	-55	-59	-64	-68	-72	-77	-81

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%	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

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%	-2	-2	-1	-1	-1	-1	-1
5.33%	-2	-2	-2	-2	-2	-2	-2
8.00%	-3	-2	-2	-2	-2	-2	-2

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

(단위:백만원)

89

공시일	2023-05-04
기준일	2023-05-03

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	6,759	0	6,759	

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	2023-05-04
기준일	2023-05-03

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	5,419	0	5,419	

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	2023-05-04
기준일	2023-05-03

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	18,807	0	18,807	
누계	통화	선도	669	18,835	-18,166	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
FXW213D2Q KRW/USD 31-05-23E		722
FXW213D3Q KRW/USD 28-06-23E		519
FXW213D4S(KRW/USD 31-07-23E		266
FXW213D52(USD/KRW 31-05-23E		54
IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	3,535

공시일	2023-05-04
기준일	2023-05-03

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

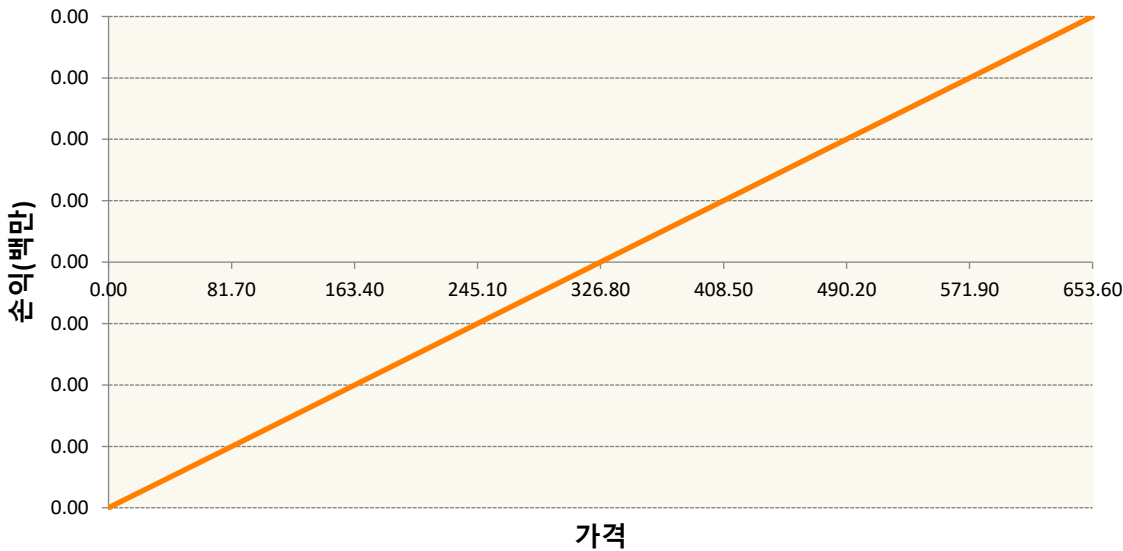
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,226	0	1,226	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101T60006-2023-06 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101T60006		2023-06 코스피200지수선물					98
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-98	-98	-98	-98	-98	-98	-98
-5.33%	-65	-65	-65	-65	-65	-65	-65
-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%	65	65	65	65	65	65	65
8.00%	98	98	98	98	98	98	98

공시일	2023-05-04
기준일	2023-05-03

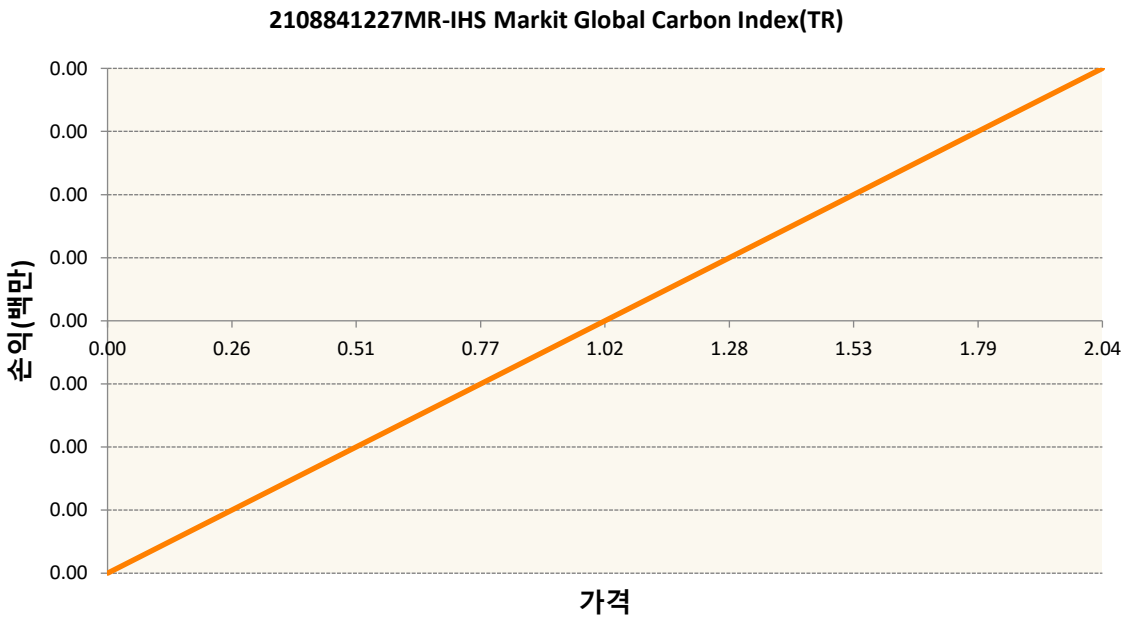
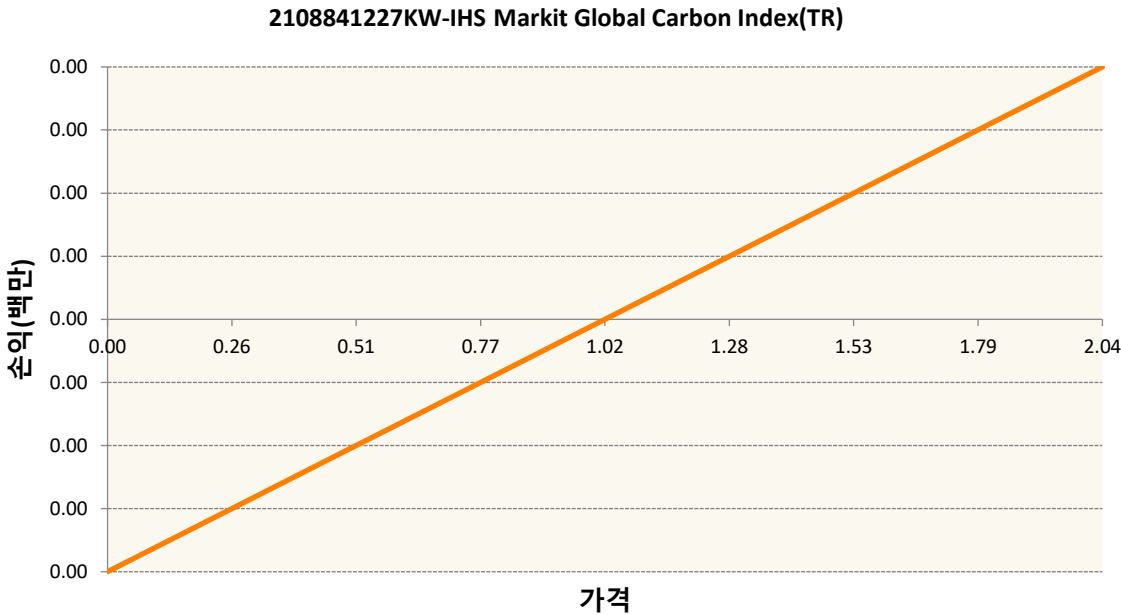
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

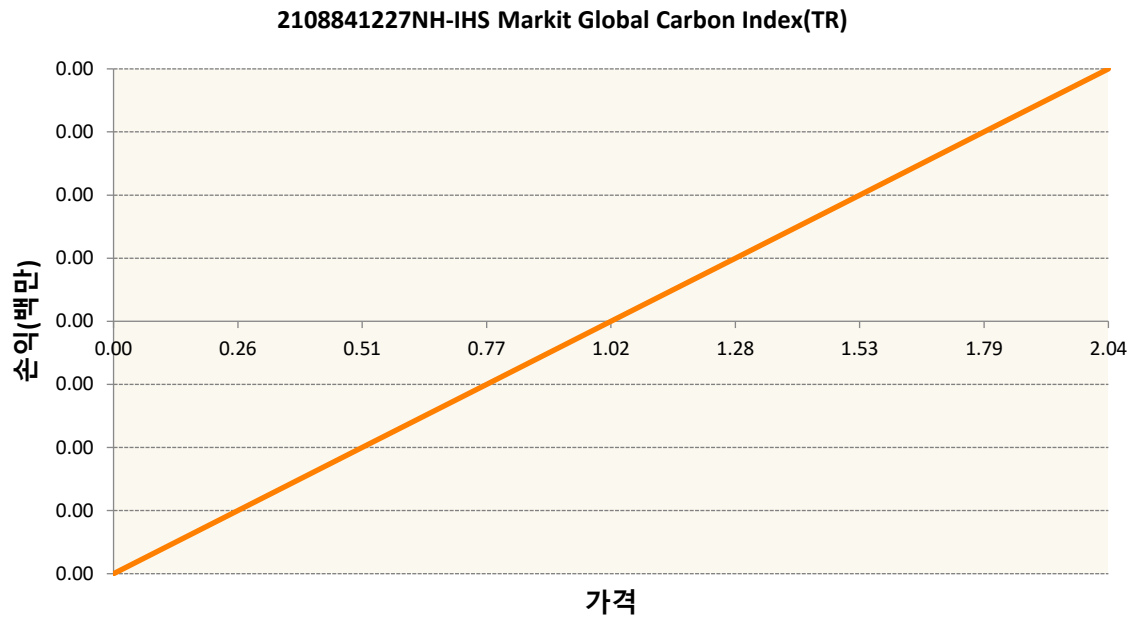
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	26,300	0	26,300	

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108841227IHS Markit Global Carbon Index(TR)		1,783
2108841227IHS Markit Global Carbon Index(TR)		210
2108841227IHS Markit Global Carbon Index(TR)		105

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)		(단위:백만원)
		3,665

공시일	2023-05-04
기준일	2023-05-03

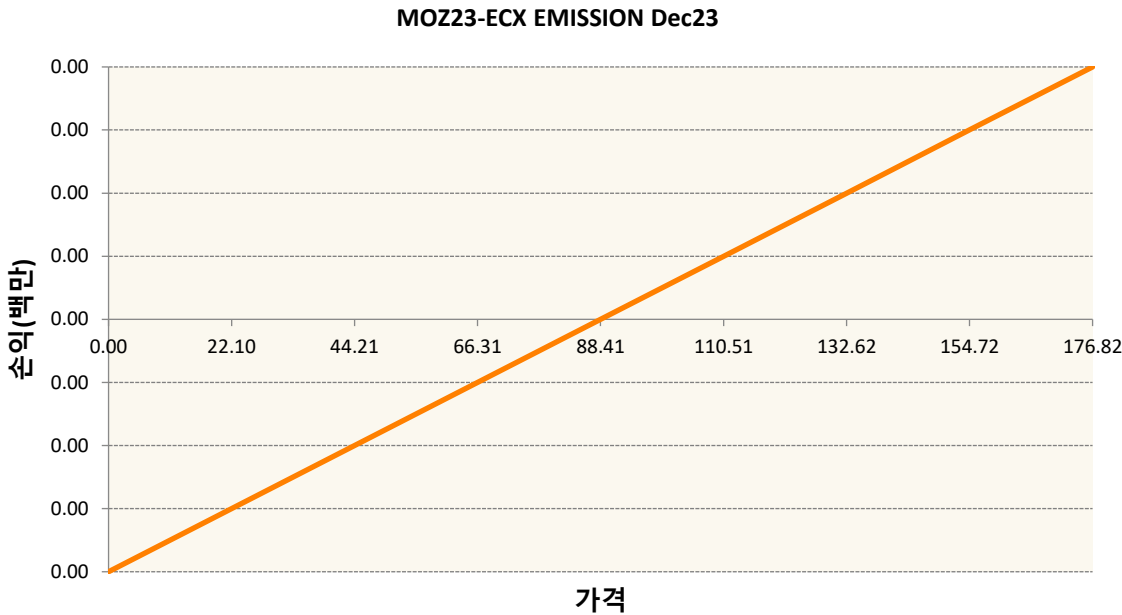
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	8,719	0	8,719	
누계	통화	선도	0	2,213	-2,213	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	698

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

(단위:백만원)

1,361

공시일	2023-05-04
기준일	2023-05-03

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)	3
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	2023-05-04
기준일	2023-05-03

SOL차이나육성산업엑티브상장지

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)	8
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)

53

공시일	2023-05-04
기준일	2023-05-03

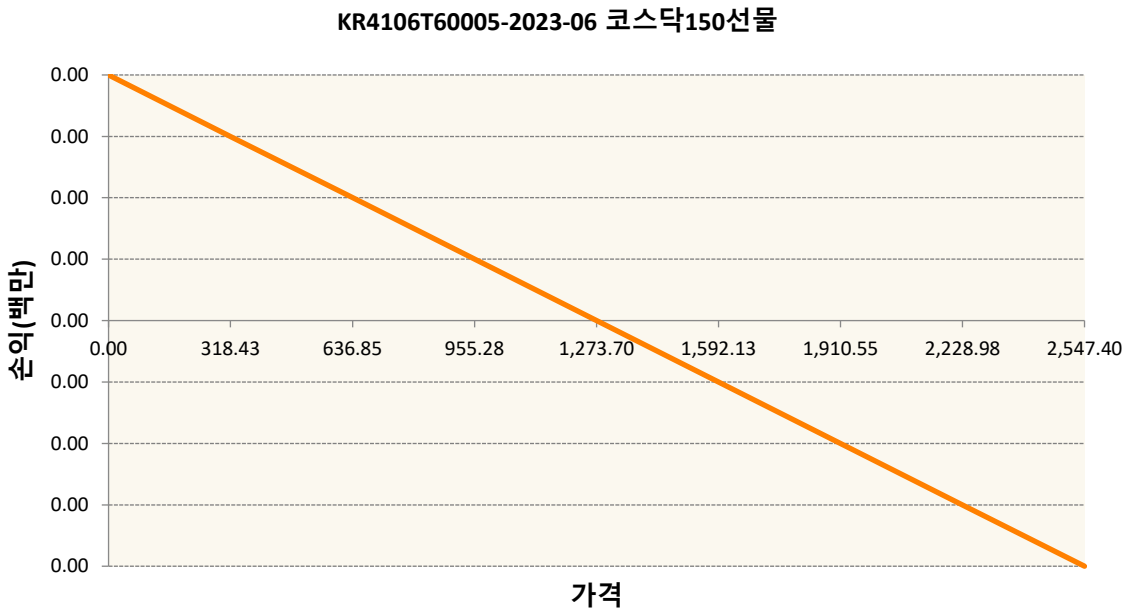
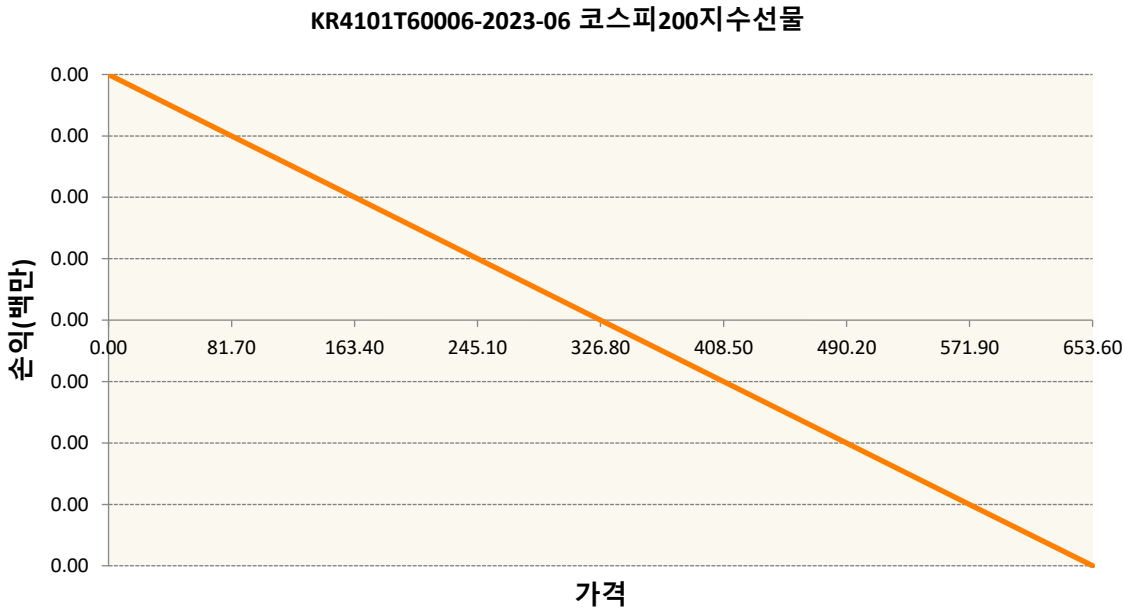
에쿼티알파일반사모혼합자산

1. 계약금액

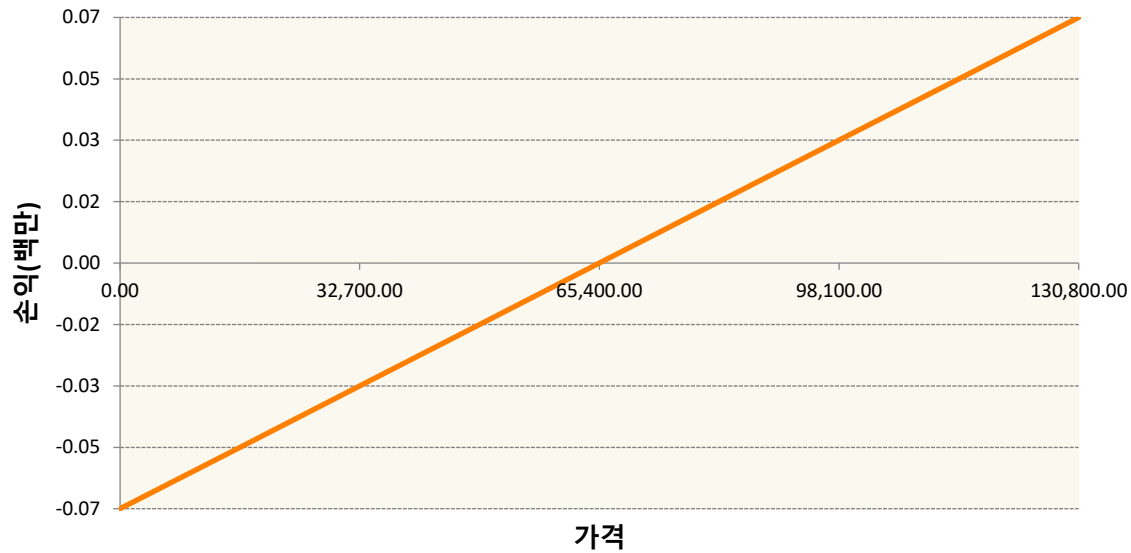
(단위:백만원)

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	543	4,369	-3,826	장내
누계	유가증권	스왑	0	0	0	장외

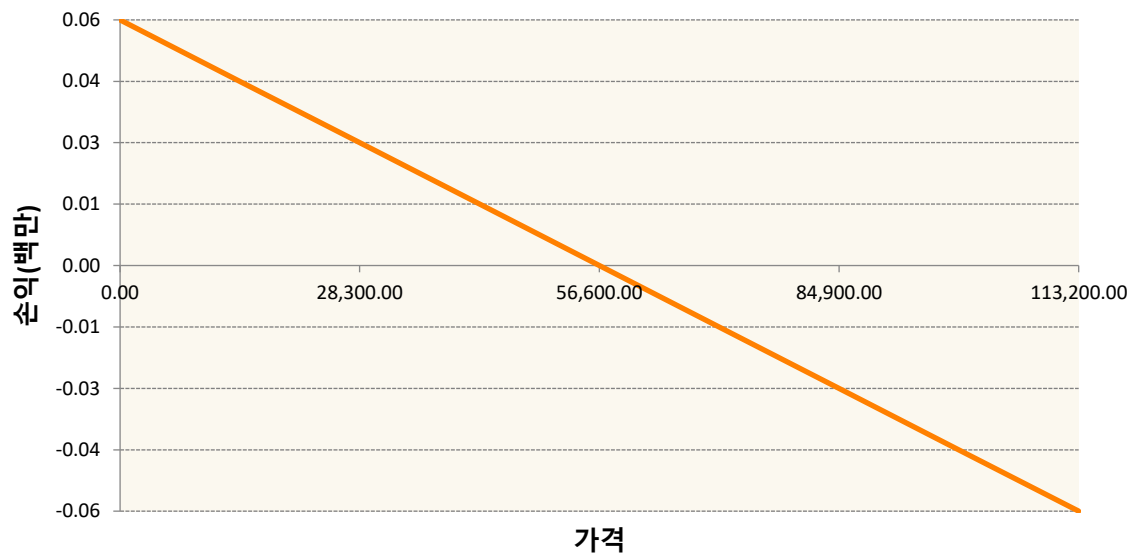
2. 만기시점의 손익구조



KR4111T50006-2023-05 삼성전자개별선물



KR41F7T50008-2023-05 카카오페이개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101T600 2023-06 코스피200지수선물	163
KR4106T600 2023-06 코스닥150선물	179
KR4111T500 2023-05 삼성전자개별선물	43
KR41F7T500 2023-05 카카오페이개별선물	7
KRS0004099 SWAP_MICRON TECH_0308	0.04
KRS0004212 SWAP_SPDR S&P BIOTECH_0413	0.34

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

(단위:백만원)

687

공시일	2023-05-04
기준일	2023-05-03

코리아인덱스(주식-파생형)(종)

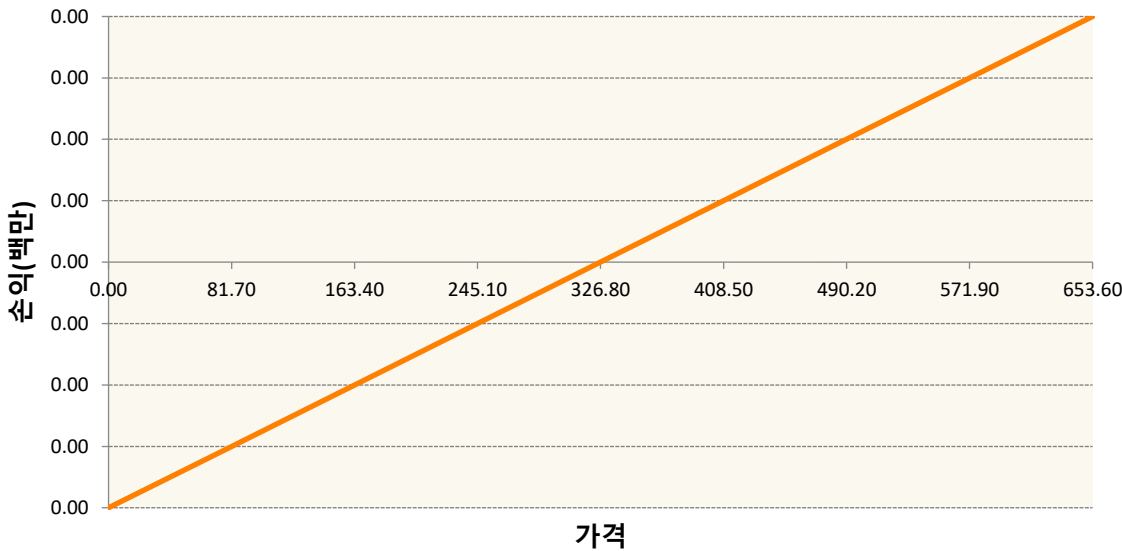
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	980	0	980	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101T60006-2023-06 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101T60006		2023-06 코스피200지수선물					78
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-78	-78	-78	-78	-78	-78	-78
-5.33%	-52	-52	-52	-52	-52	-52	-52
-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%	52	52	52	52	52	52	52
8.00%	78	78	78	78	78	78	78

공시일	2023-05-04
기준일	2023-05-03

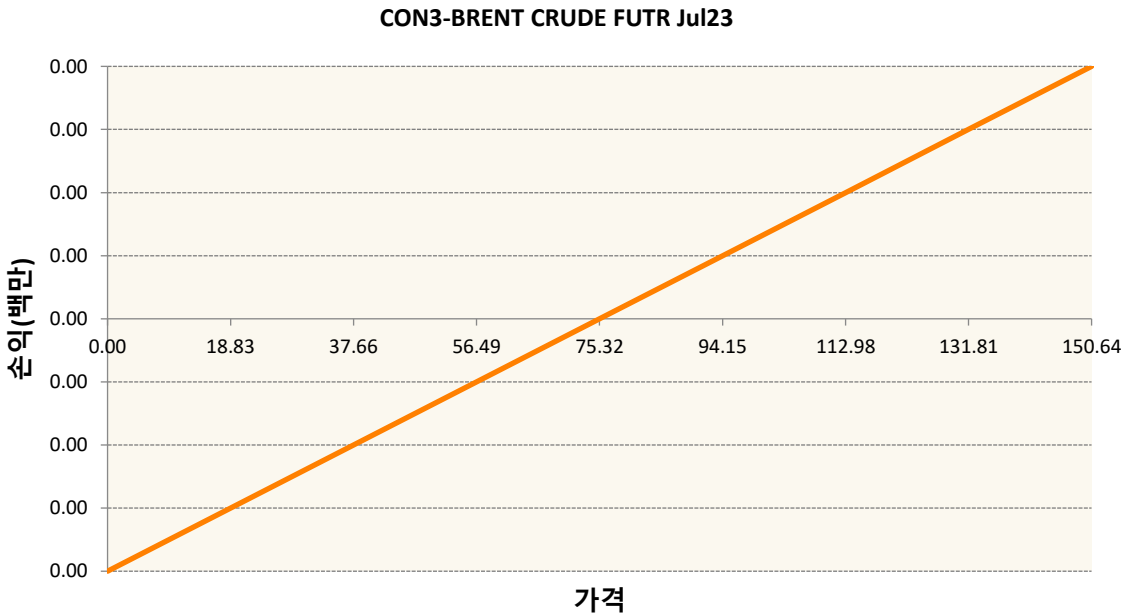
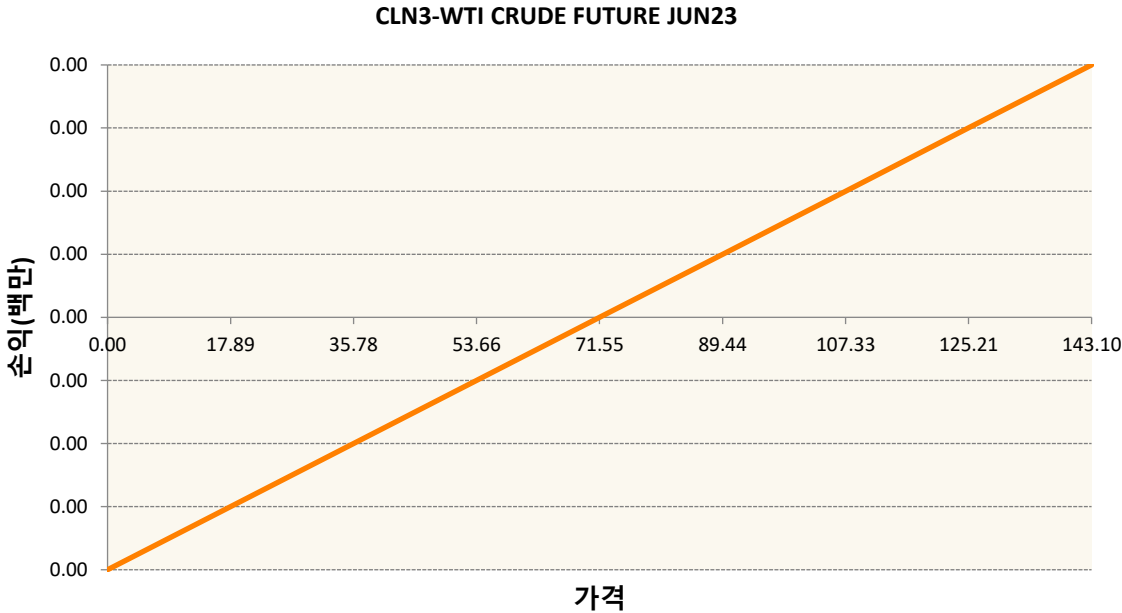
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

1. 계약금액

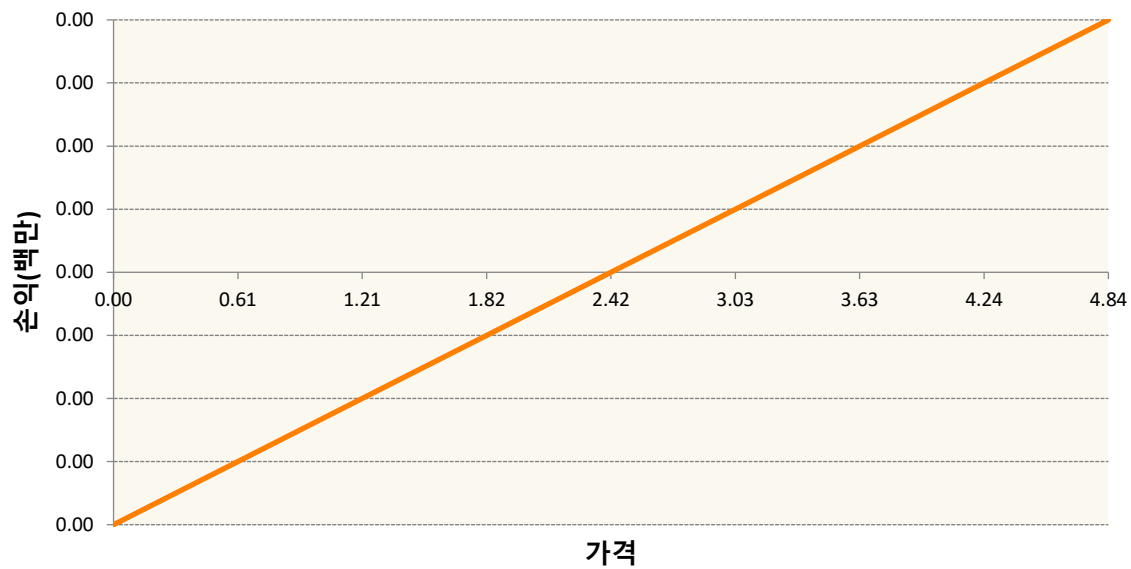
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,283	160	1,123	

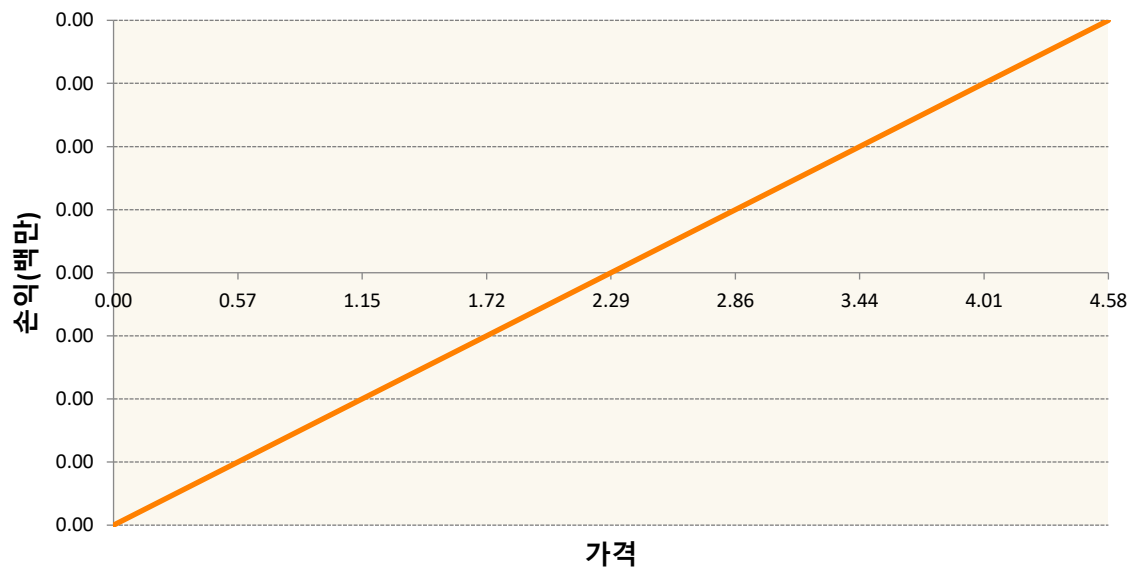
2. 만기시점의 손익구조



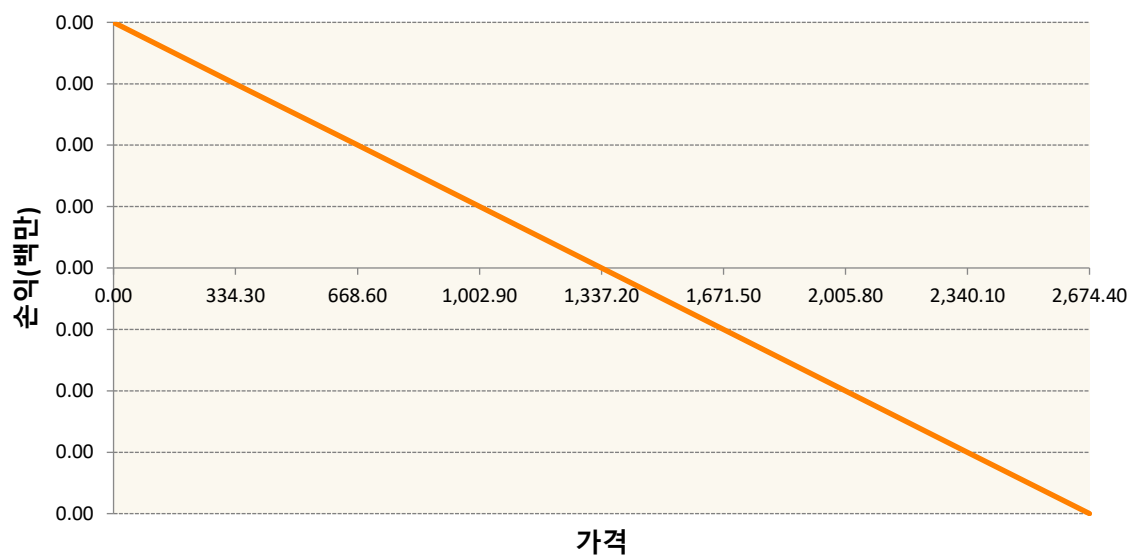
EON3-E-MINI NATURAL GAS JUL23



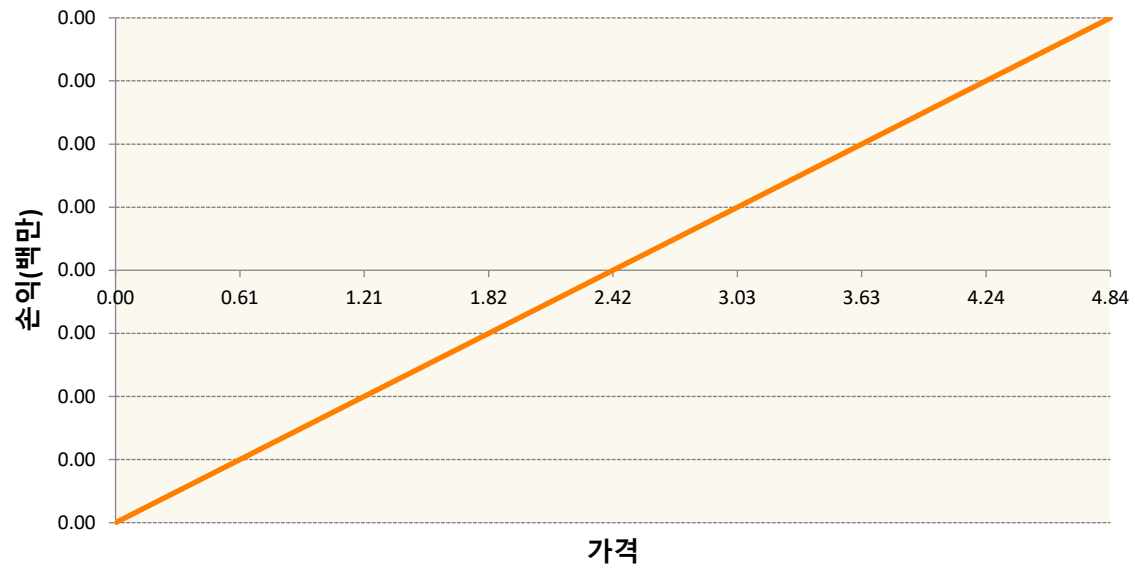
HON3-NY Harb ULSD Fut Jul23



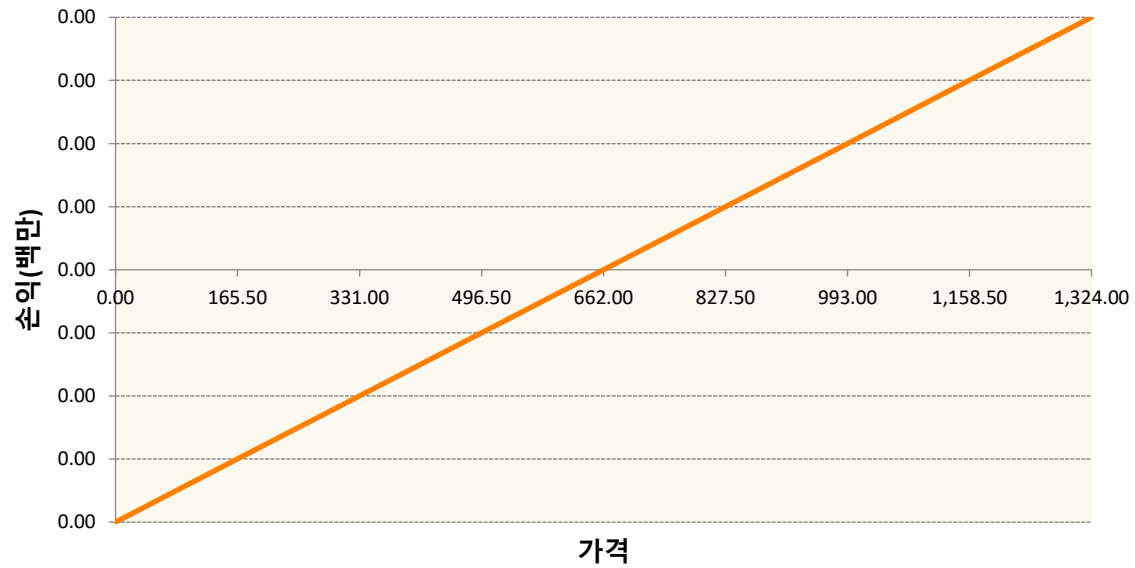
KR4175T50001-2023-05 달러선물



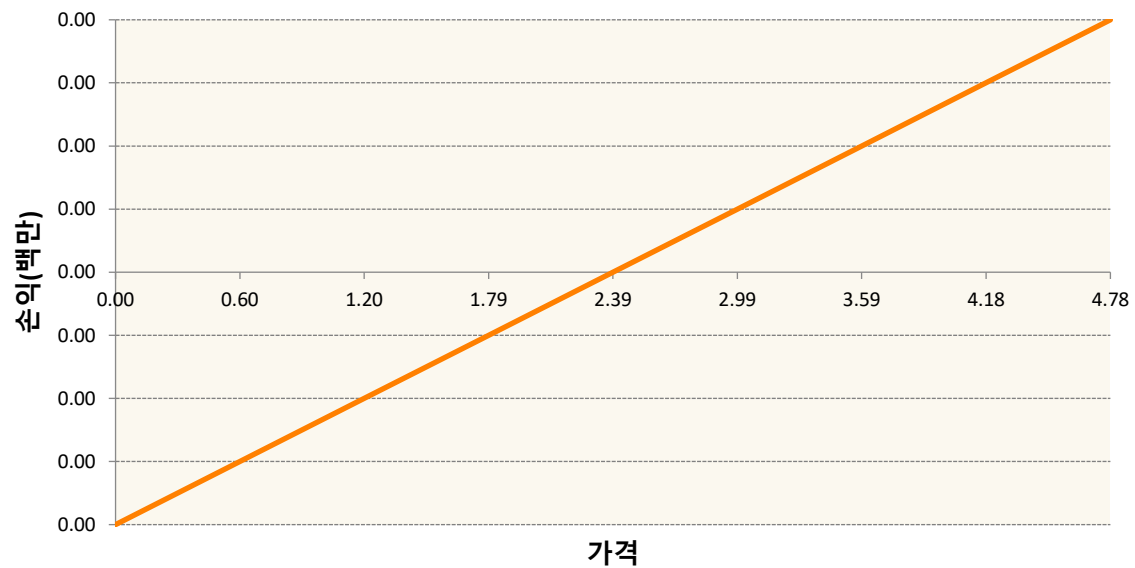
NGN23-NATURAL GAS FUTR JUL23



QSN3-Low Su Gasoil G JUL23



XBN3-GASOLINE RBOB FUT JUL23



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLN3	WTI CRUDE FUTURE JUN23	22
CON3	BRENT CRUDE FUTR Jul23	32
EON3	E-MINI NATURAL GAS JUL23	1
HON3	NY Harb ULSD Fut Jul23	10
KR4175T500	2023-05 달러선물	13
NGN23	NATURAL GAS FUTR JUL23	20
QSN3	Low Su Gasoil G JUL23	7
XBN3	GASOLINE RBOB FUT JUL23	10

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

202