

공시일	2023-05-09
기준일	2023-05-08

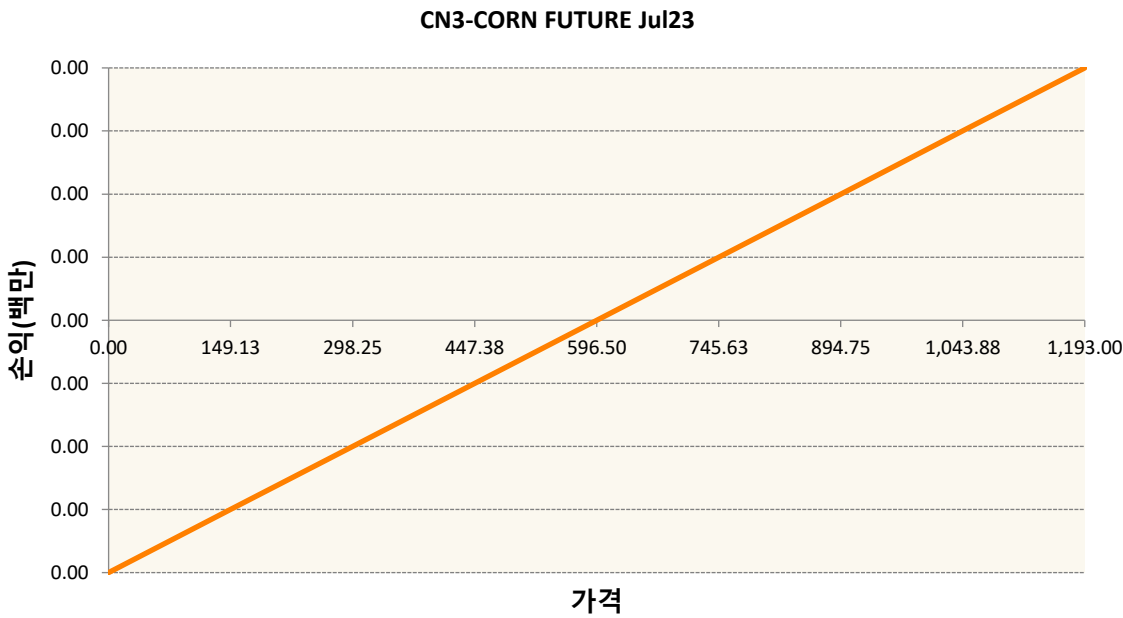
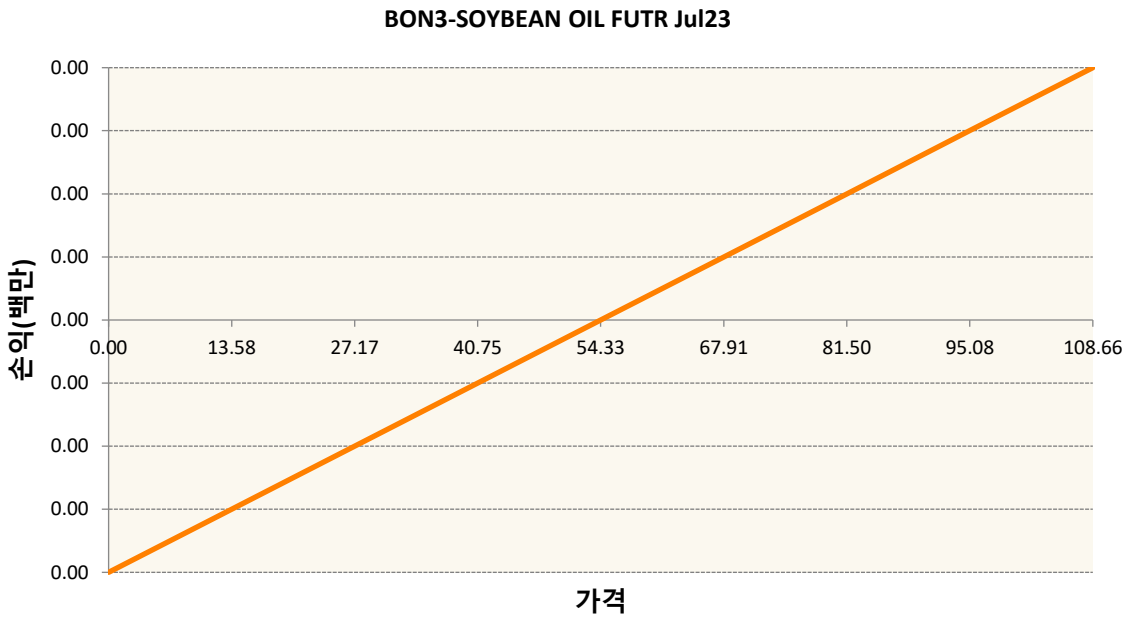
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

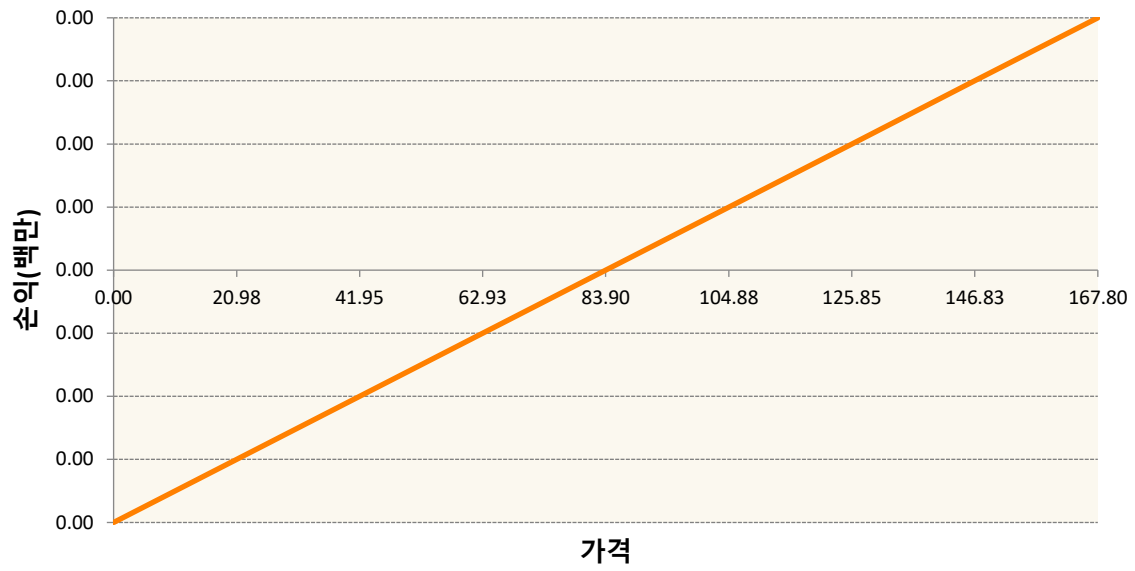
(단위:USD 백만)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,442	528	4,914	

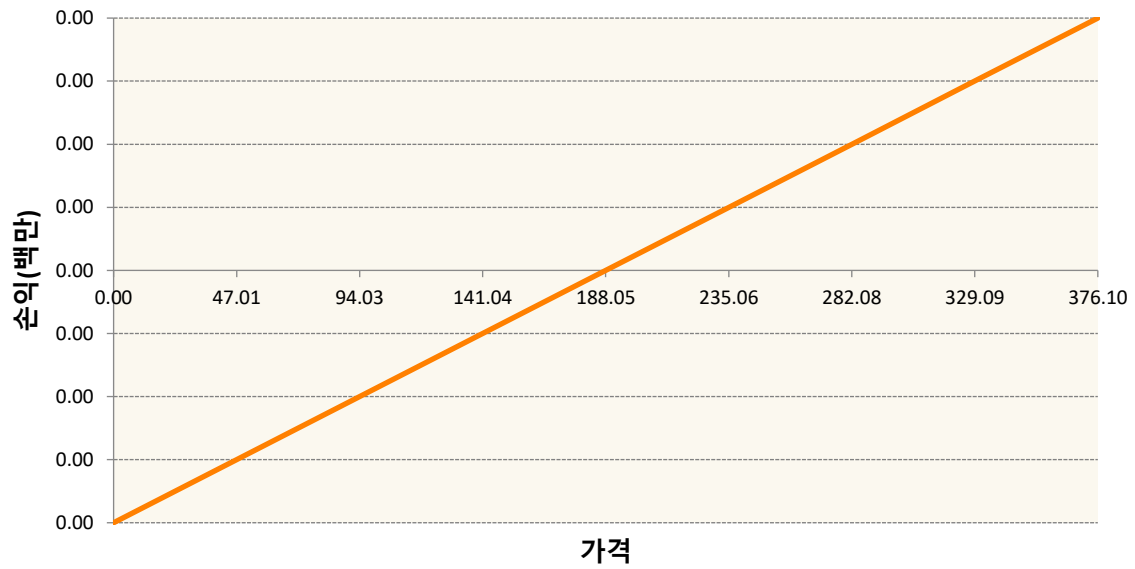
2. 만기시점의 손익구조



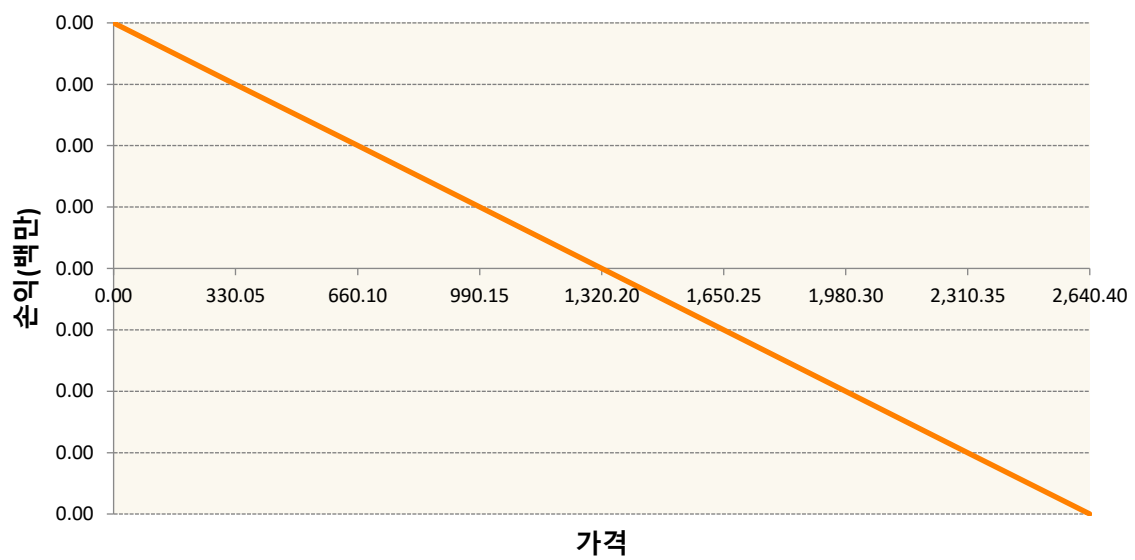
CTN3-COTTON NO.2 FUTR Jul23



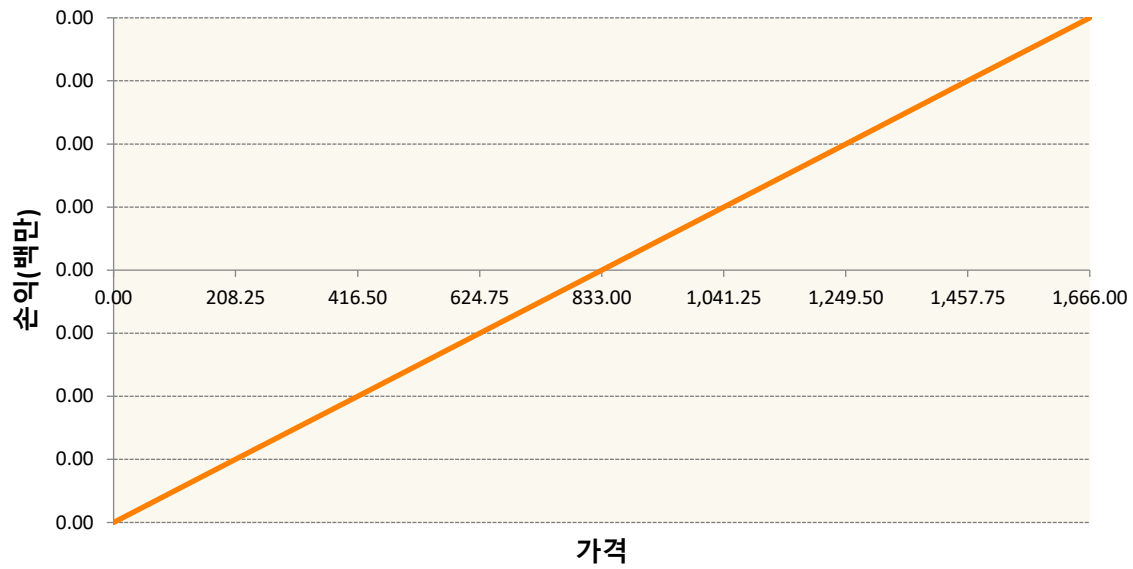
KCN3-COFFEE 'C' FUTURE Jul23



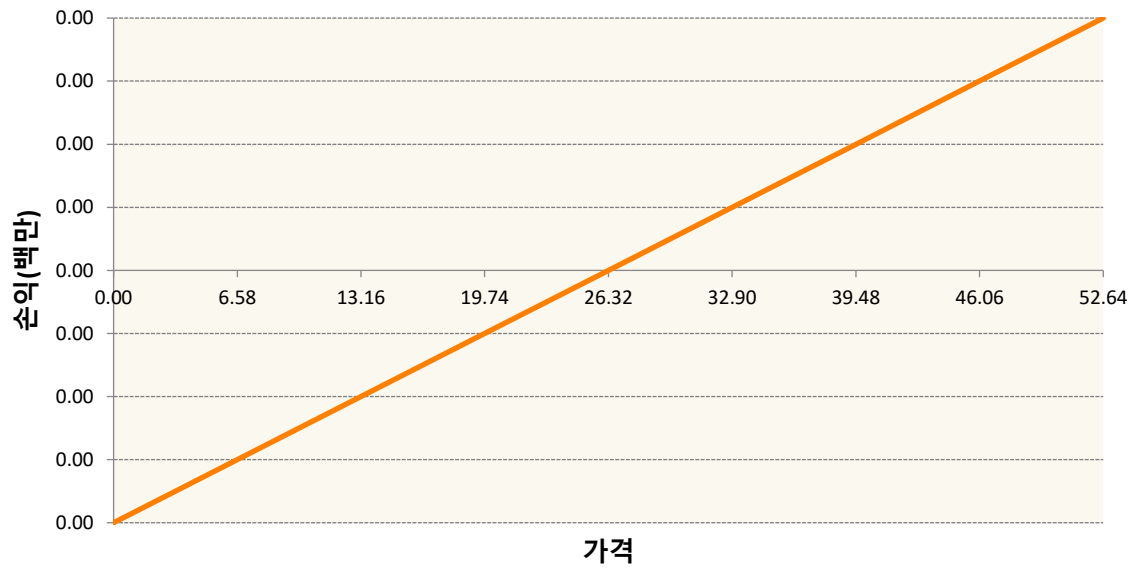
KR4175T50001-2023-05 달러선물



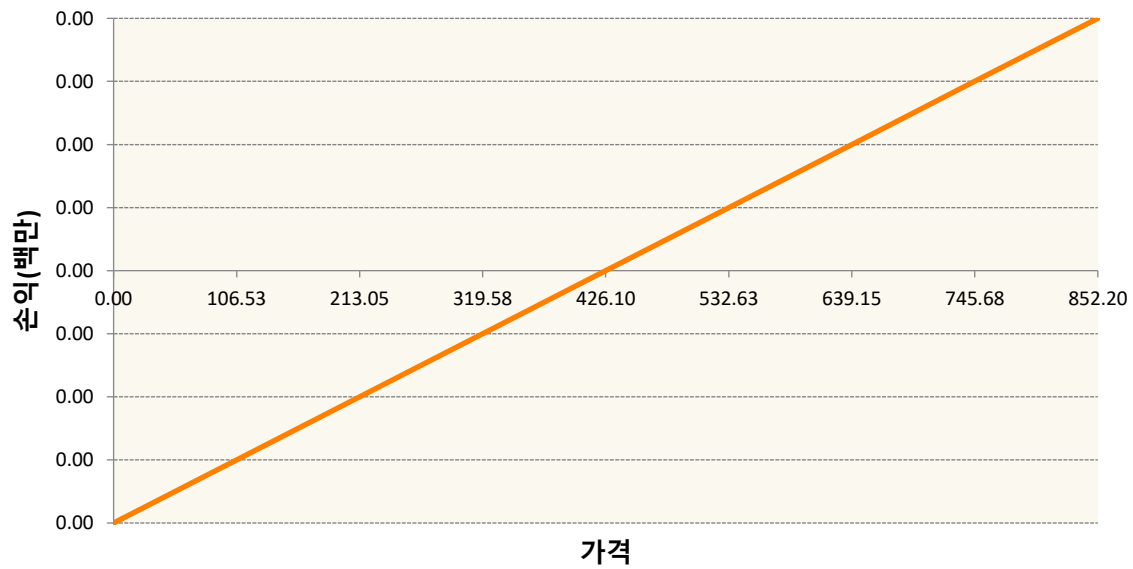
KWN3-KC HRW WHEAT FUT Jul23



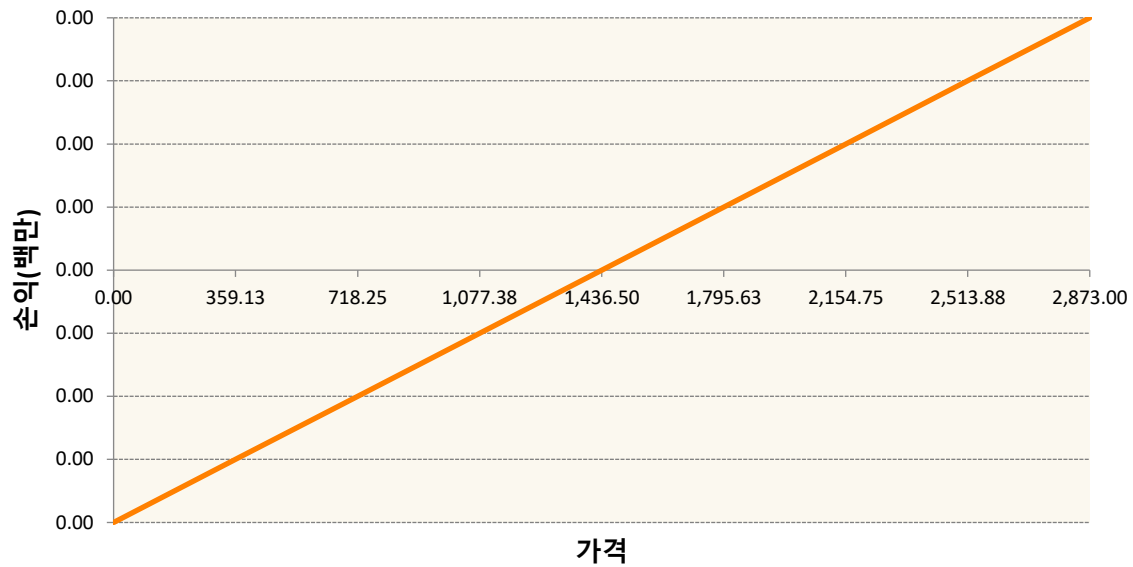
SBN3-Sugar #11 (WORLD) Jul23



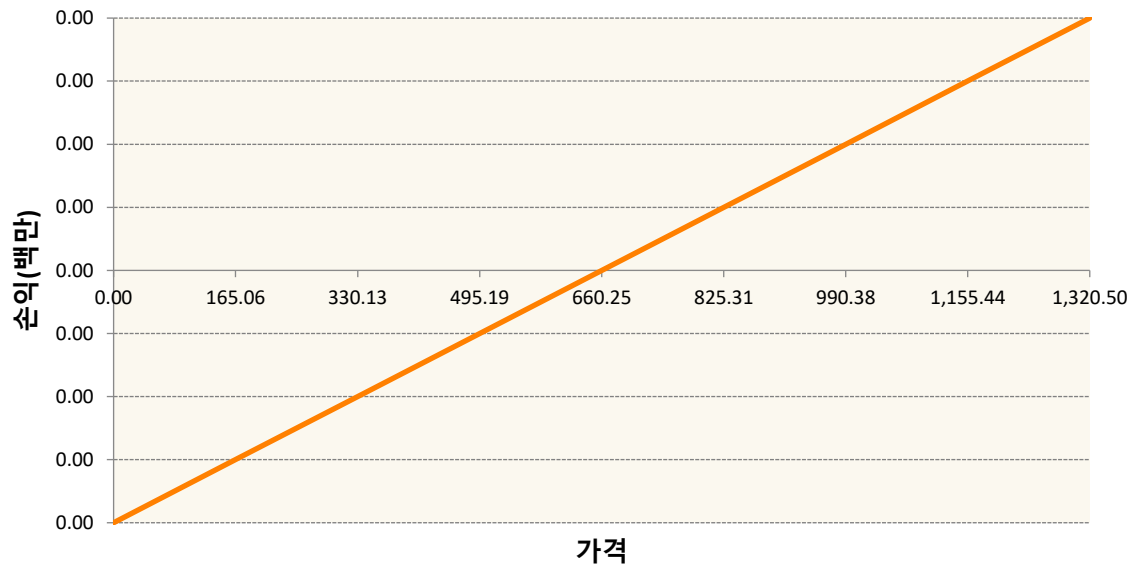
SMN3-SOYBEAN MEAL FUTR Jul23



SN3-SOYBEAN FUTURE Jul23



WN3-WHEAT FUTURE(CBT) 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	2023-05-09
기준일	2023-05-08

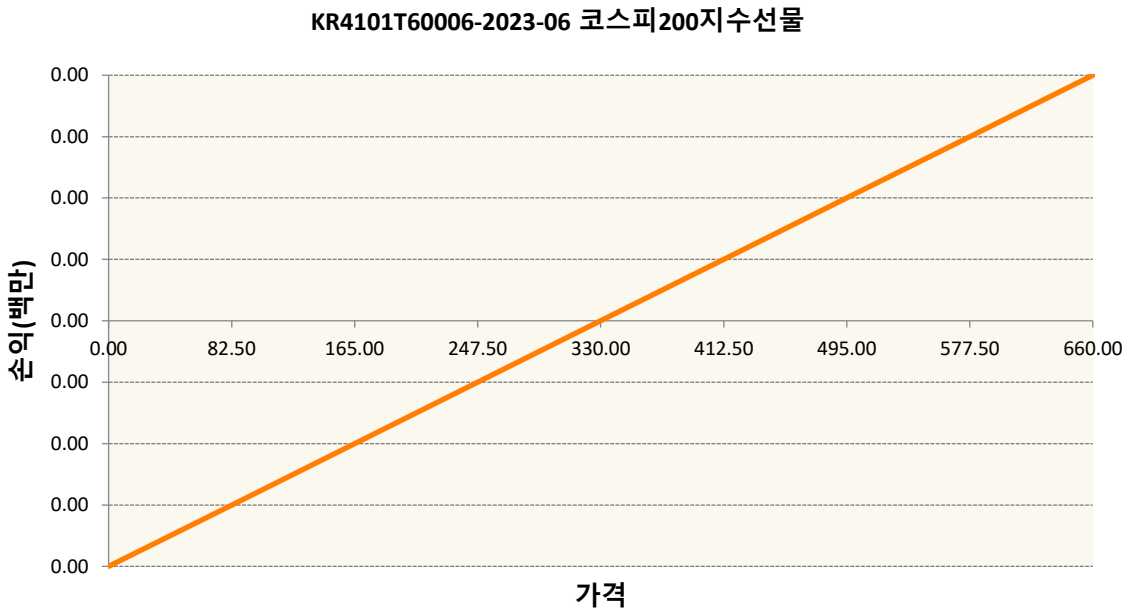
스마트인덱스모

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%	-153	-153	-153	-153	-153	-153	-153
-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%	153	153	153	153	153	153	153
8.00%	230	230	230	230	230	230	230

공시일	2023-05-09
기준일	2023-05-08

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	361
-----------------------------	-----

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

	631
--	-----

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2023-05-09
기준일	2023-05-08

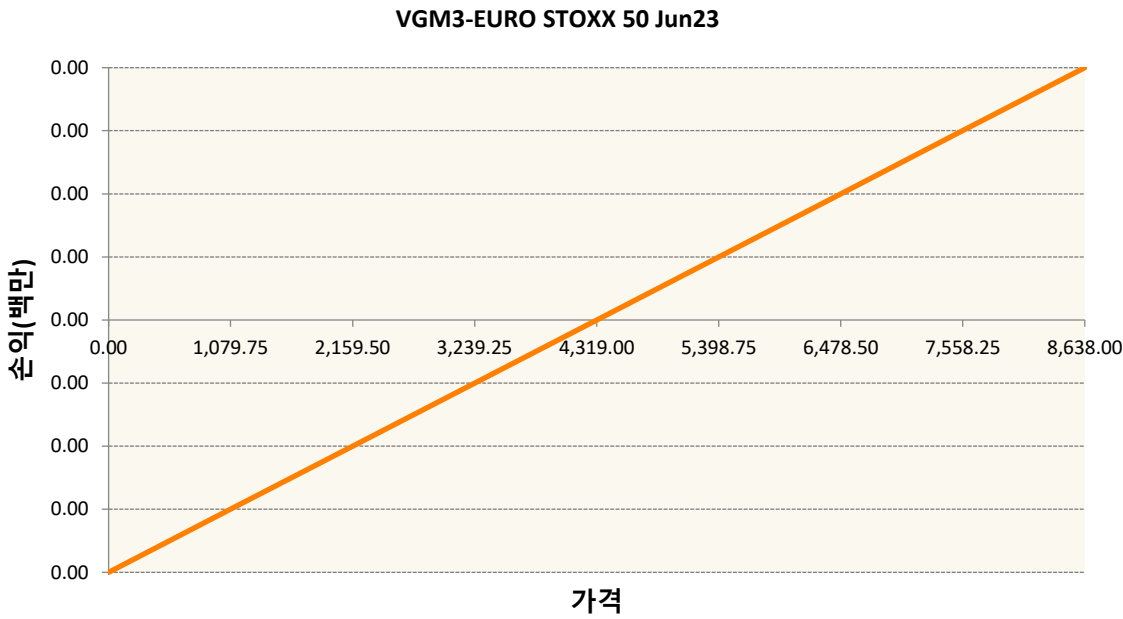
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	362	0	362	

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	2023-05-09
기준일	2023-05-08

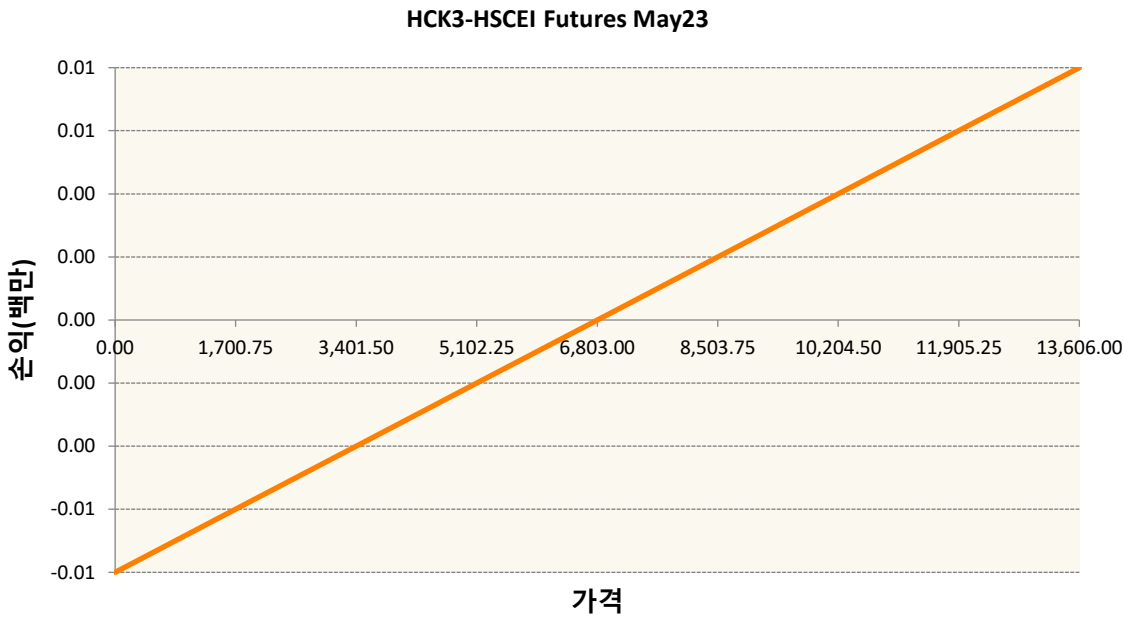
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	868	0	868	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCK3	HSCEI Futures May23	69
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

121

공시일	2023-05-09
기준일	2023-05-08

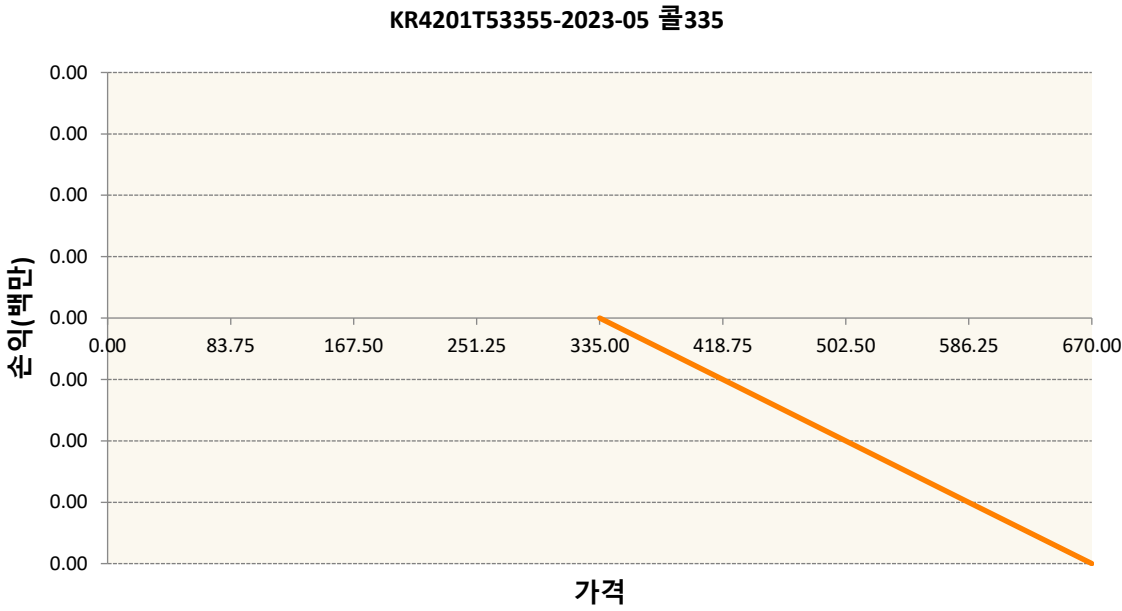
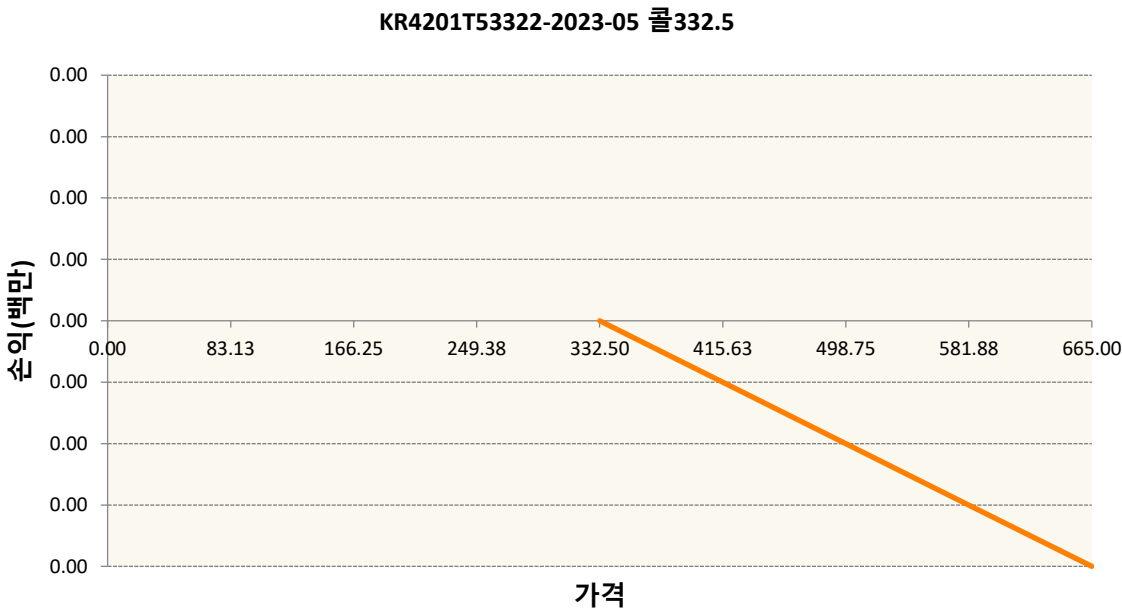
커버드콜모(주식혼합-파생형)

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.

가격	손익(백만)
0.00	0.00
335.00	0.00

(단위:백만원)

KR4201T53322				2023-05 콜332.5				2,366	
	기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%		
-8.00%	155	155	155	155	155	155	155		
-5.33%	155	155	155	155	154	154	154		
-2.67%	153	151	148	143	137	129	120		
0%	66	45	23	0	-23	-47	-71		
2.67%	-475	-492	-511	-531	-552	-573	-595		
5.33%	-1,394	-1,395	-1,398	-1,401	-1,406	-1,412	-1,420		
8.00%	-2,364	-2,364	-2,364	-2,364	-2,365	-2,365	-2,366		
KR4201T53355				2023-05 콜335				576	
	기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	23	23	23	23	23	23	23
-5.33%	23	23	23	23	23	23	23
-2.67%	23	23	22	22	21	20	18
0%	13	9	5	0	-5	-10	-16
2.67%	-88	-95	-101	-108	-114	-121	-128
5.33%	-317	-318	-319	-321	-323	-326	-329
8.00%	-574	-574	-574	-574	-575	-575	-576

KR4301T53320

2023-05 풋332.5

448

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-448	-448	-448	-448	-448	-448	-448
-5.33%	-291	-291	-291	-291	-291	-291	-291
-2.67%	-133	-133	-134	-135	-136	-137	-138
0%	11	7	4	0	-4	-8	-12
2.67%	81	78	75	72	68	65	61
5.33%	89	89	89	88	87	86	85
8.00%	89	89	89	89	89	89	89

KR4301T53353

2023-05 풋335

268

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-268	-268	-268	-268	-268	-268	-268
-5.33%	-176	-176	-176	-176	-176	-176	-176
-2.67%	-84	-84	-84	-84	-85	-85	-86
0%	5	3	2	0	-2	-4	-6
2.67%	61	58	56	54	51	49	47
5.33%	71	71	71	70	69	68	67
8.00%	72	72	72	72	72	72	71

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

(단위:백만원)

4,247

공시일	2023-05-09
기준일	2023-05-08

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	584	584	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)
	75

공시일	2023-05-09
기준일	2023-05-08

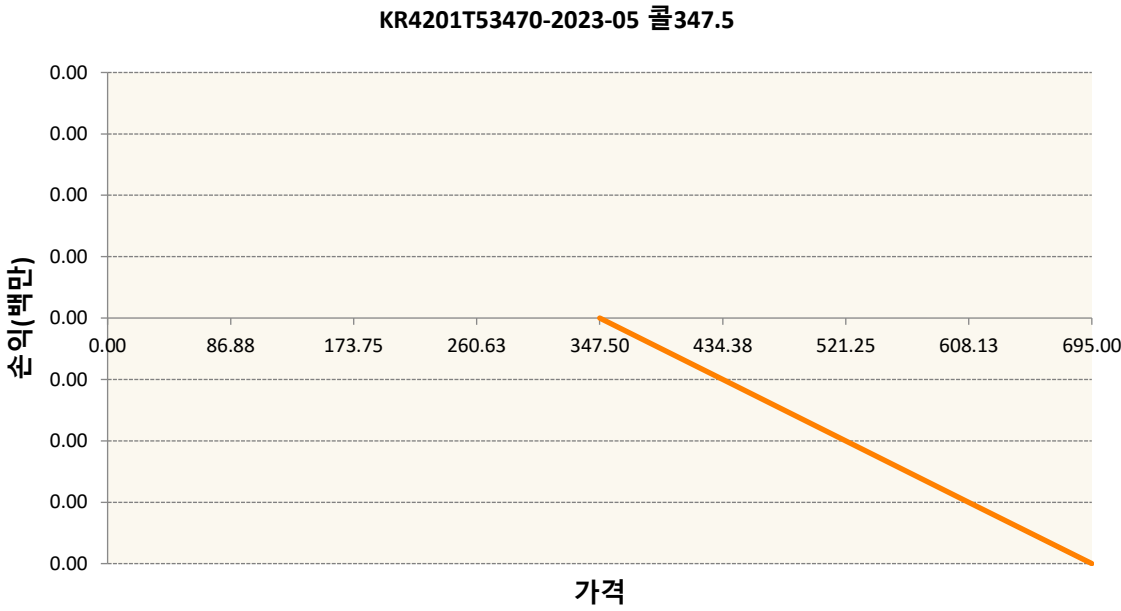
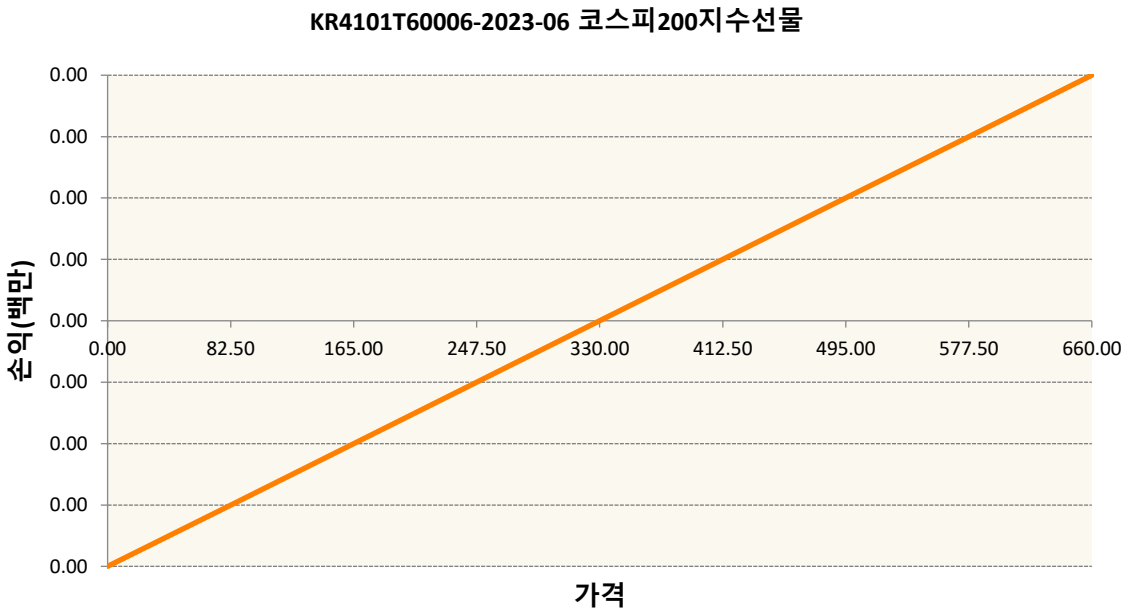
리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

1. 계약금액

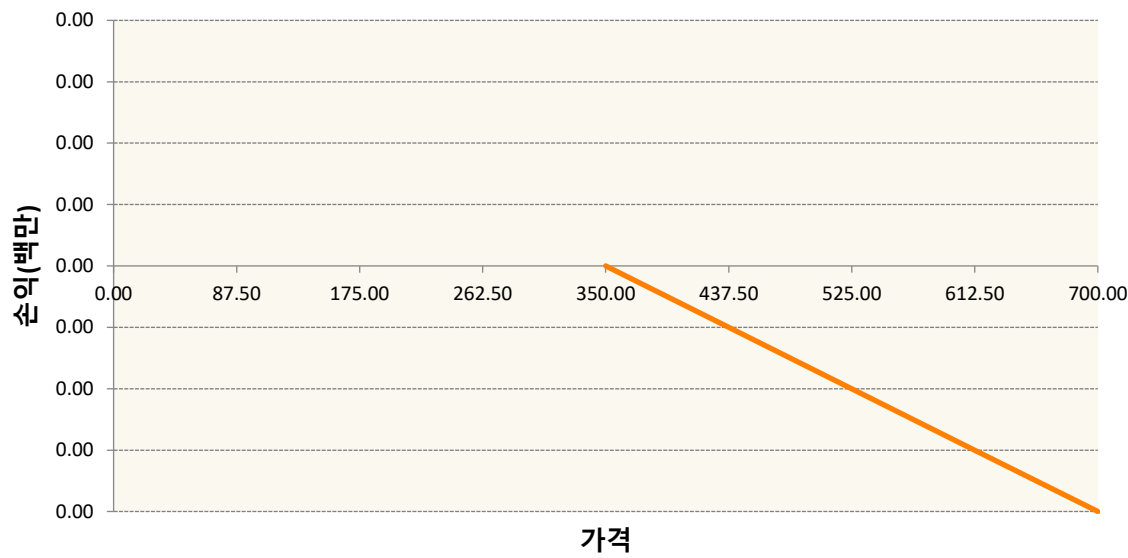
(단위:백만원)

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	413	0	413	장내
누계	유가증권	옵션	167	4,109	-3,943	장내

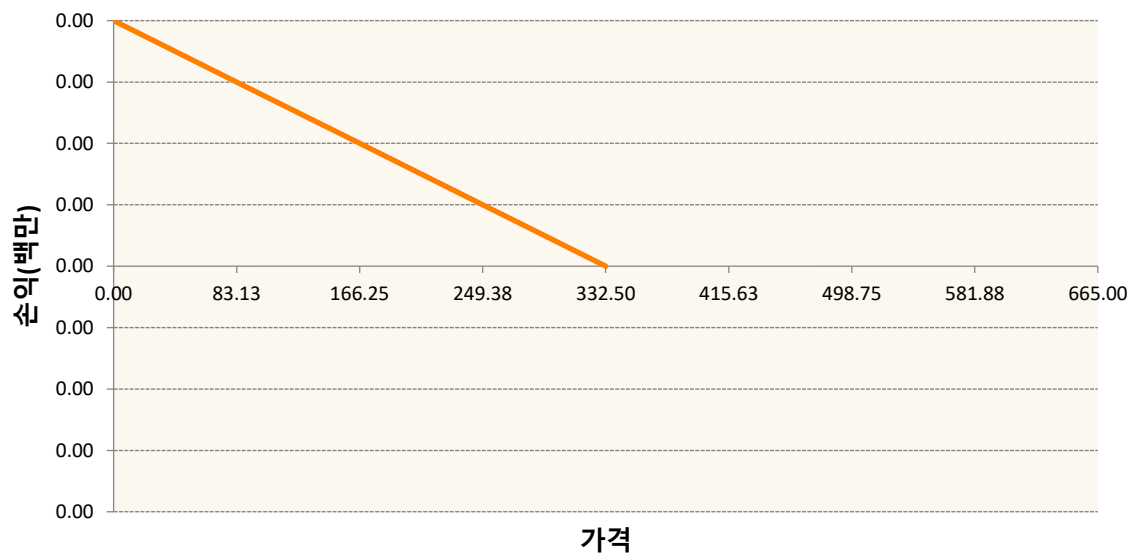
2. 만기시점의 손익구조



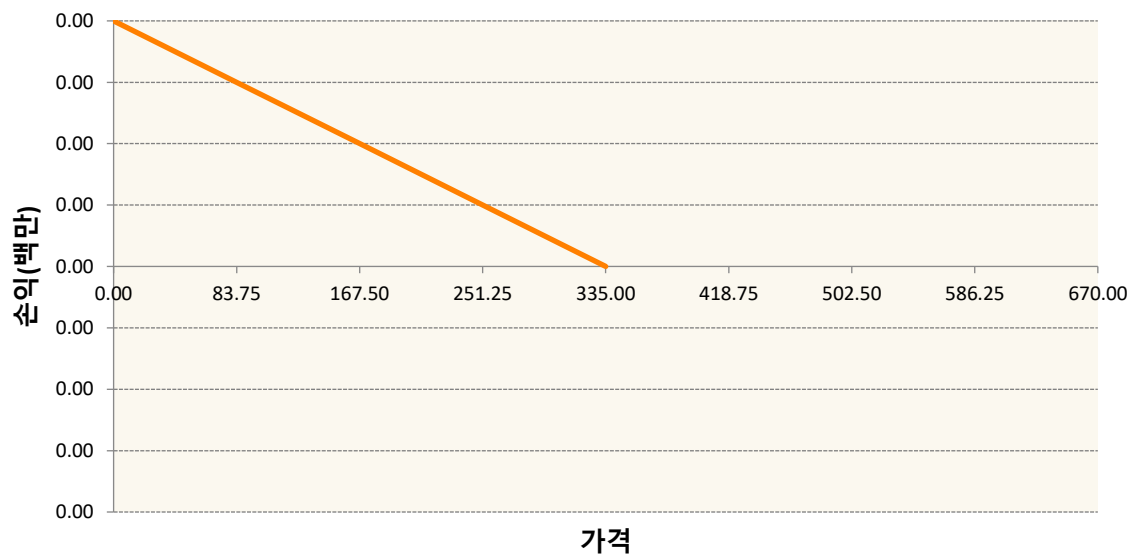
KR4201T53504-2023-05 콜350



KR4301T53320-2023-05 풋332.5



KR4301T53353-2023-05 풋335



(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			
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	0	0	-1	-1	-1			
5.33%	-2	-2	-3	-3	-3	-4	-4			
8.00%	-10	-10	-10	-10	-11	-11	-11			
KR4201T53504							2023-05 콜350		73	
	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	-1	-1	-1	-2	-3	-4			
5.33%	-9	-12	-14	-16	-19	-21	-23			
8.00%	-61	-63	-65	-67	-69	-71	-73			
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%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1			
8.00%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1			
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)

57

공시일	2023-05-09
기준일	2023-05-08

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	6,667	0	6,667	

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	2023-05-09
기준일	2023-05-08

H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	265	-265	
누계	유가증권	수익증권	5,081	0	5,081	

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	2023-05-09
기준일	2023-05-08

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	18,552	0	18,552	
누계	통화	선도	661	18,599	-17,938	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213D2Q KRW/USD 31-05-23E	712
FXW213D3Q KRW/USD 28-06-23E	513
FXW213D4S(KRW/USD 31-07-23E	263
FXW213D52(USD/KRW 31-05-23E	53
IE00BD8RGM75	

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

3,491

공시일	2023-05-09
기준일	2023-05-08

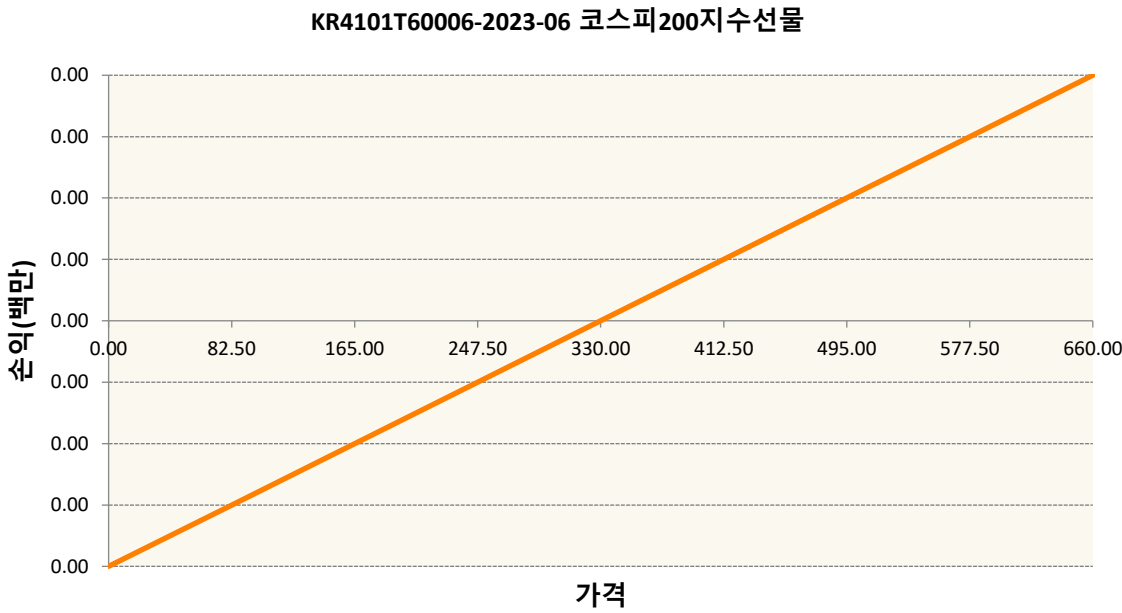
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

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	2023-05-09
기준일	2023-05-08

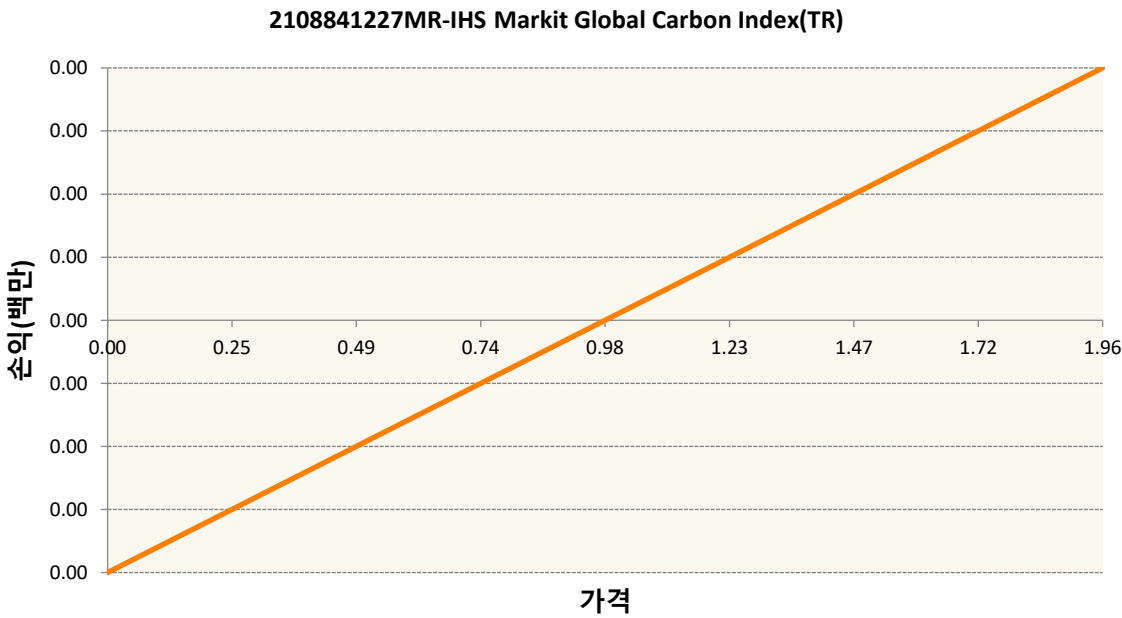
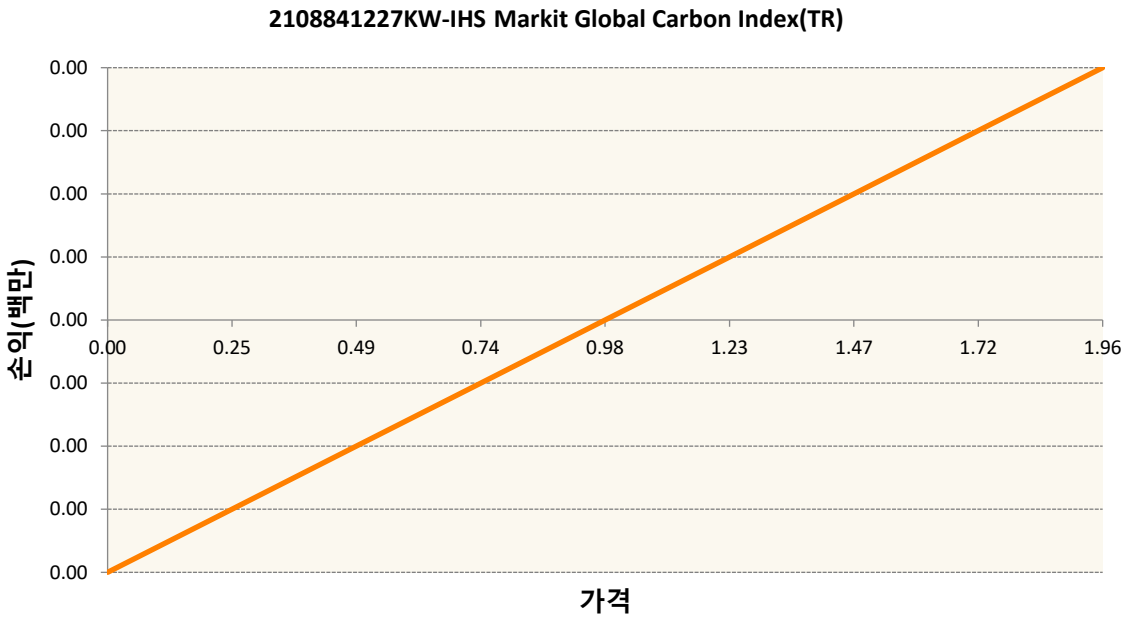
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

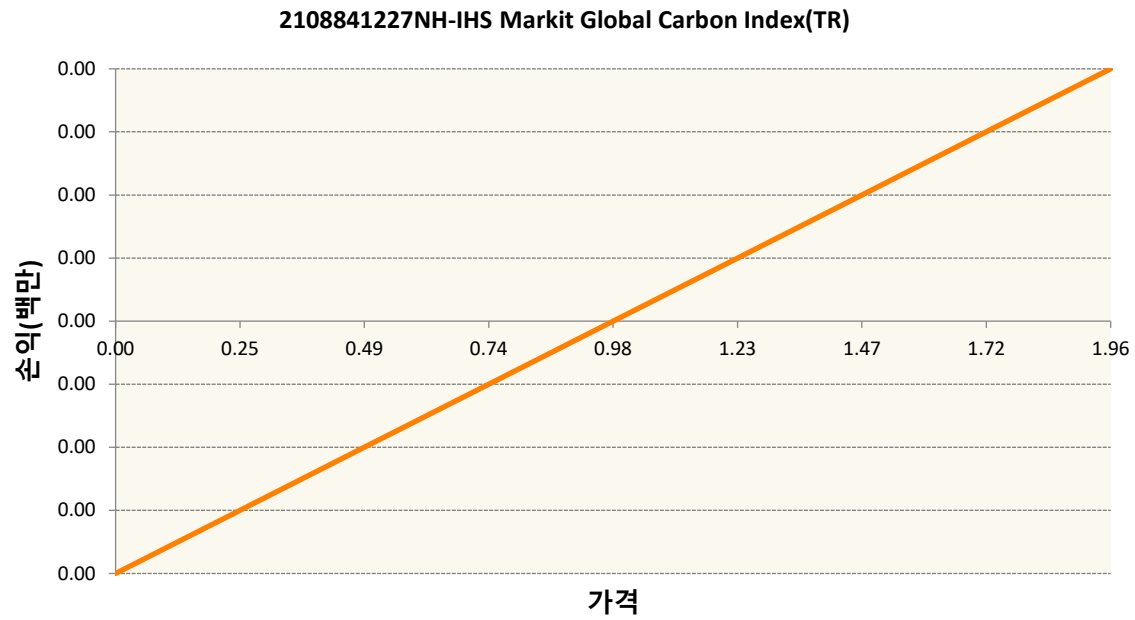
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	25,269	0	25,269	

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108841227IHS Markit Global Carbon Index(TR)		1,710
2108841227IHS Markit Global Carbon Index(TR)		201
2108841227IHS Markit Global Carbon Index(TR)		101

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

공시일	2023-05-09
기준일	2023-05-08

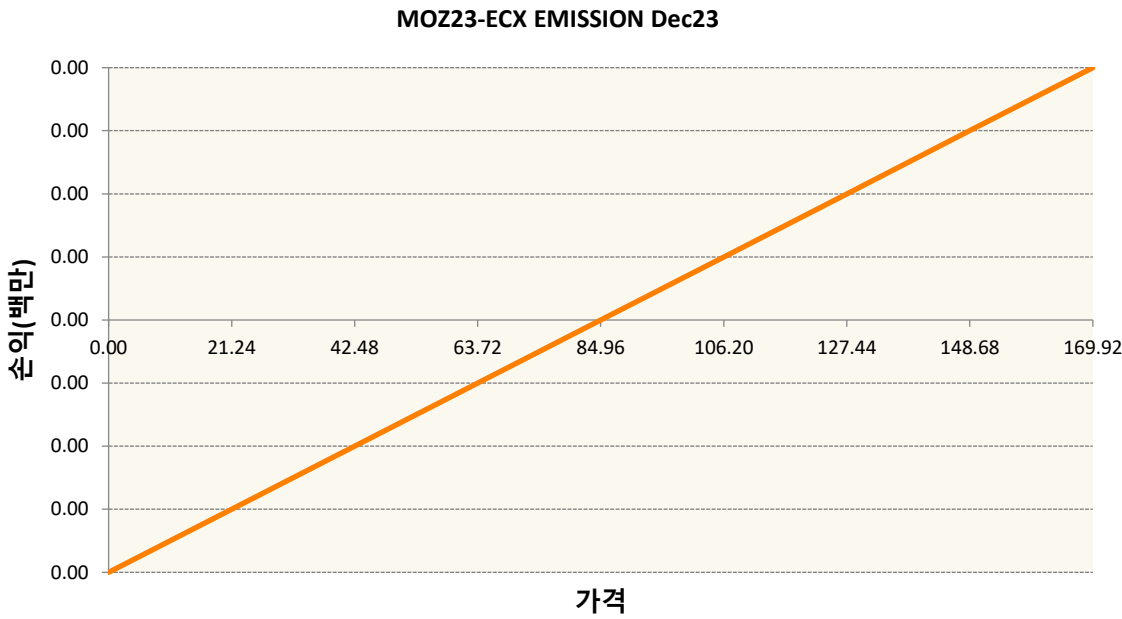
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	8,352	0	8,352	
누계	통화	선도	0	2,188	-2,188	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213D4S(KRW/EUR 31-05-23E	58
FXW213D4S(KRW/EUR 31-05-23E	58
FXW213D4S(KRW/EUR 31-05-23E	58
MOZ23 ECX EMISSION Dec23	668

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

(단위:백만원)

1,310

공시일	2023-05-09
기준일	2023-05-08

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)		10
SWCSI00000 신한CSI Index 221222 (키움)		11
SWCSI00000 신한CSI Index 221222 (미래)		11
SWCSI00000 신한CSI Index 221222 (메리츠)		11

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	73

공시일	2023-05-09
기준일	2023-05-08

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)	0.35
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 230116(메리츠)	0.5
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 230116(미래)	0.41
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 230427(키움)	2

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

(단위:백만원)

5

공시일	2023-05-09
기준일	2023-05-08

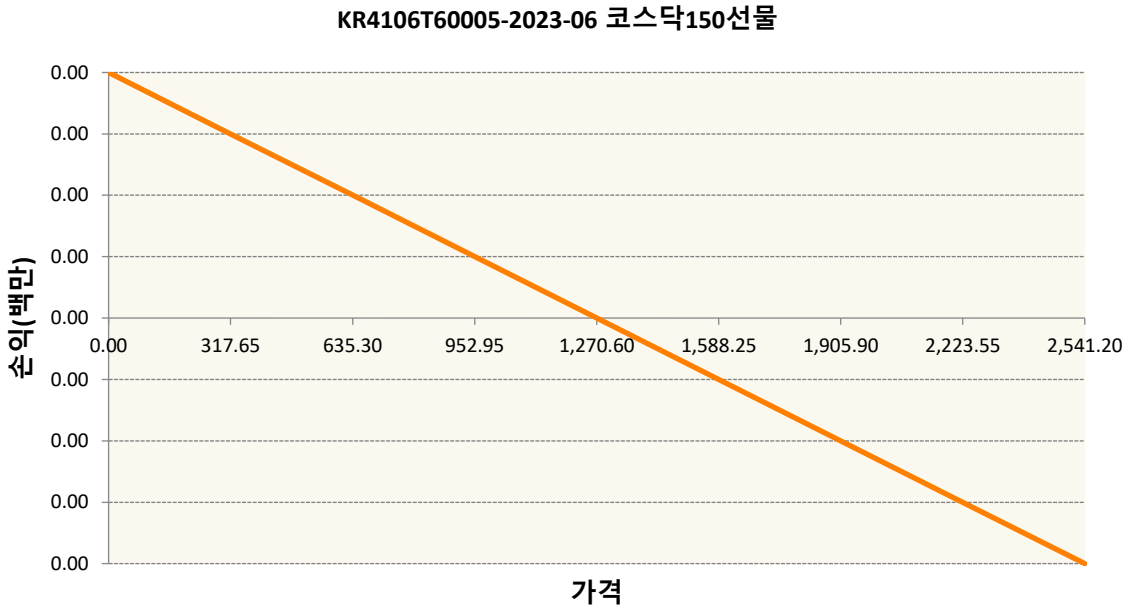
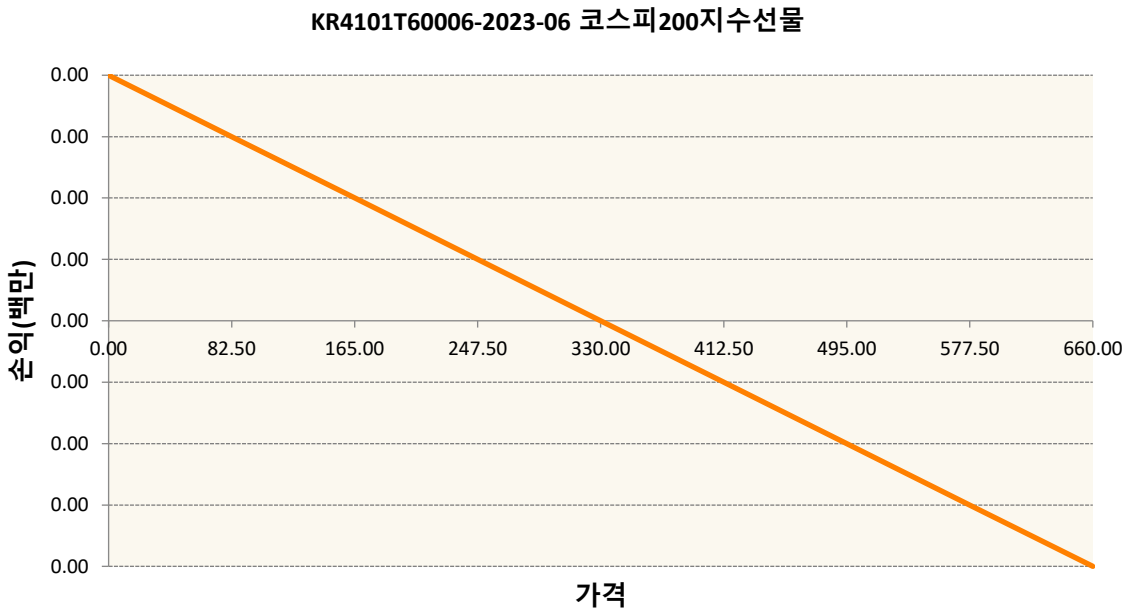
에쿼티알파일반사모혼합자산

1. 계약금액

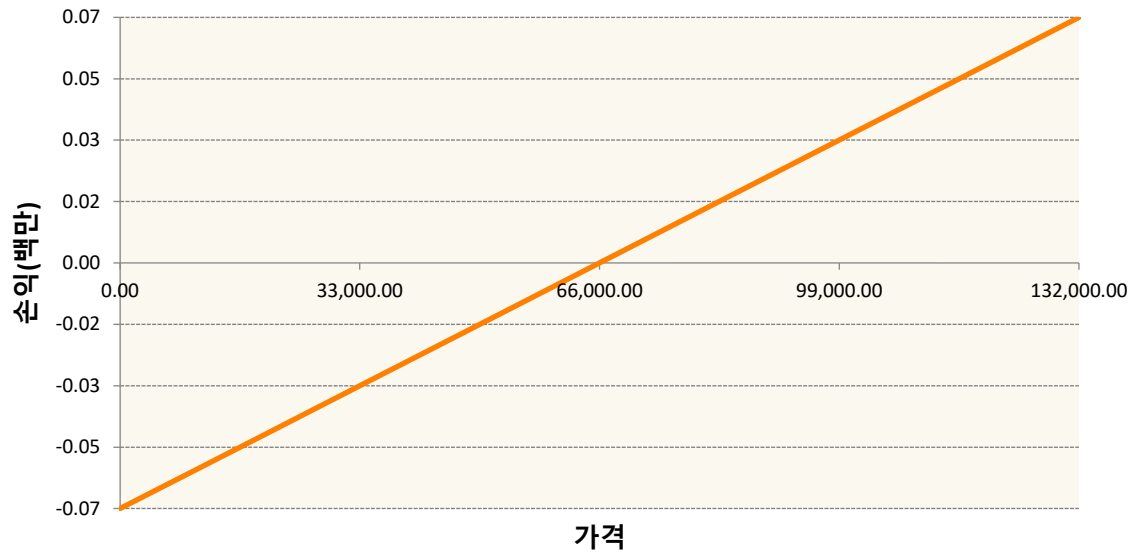
(단위:백만원)

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	548	4,069	-3,521	장내
누계	유가증권	스왑	0	0	0	장외

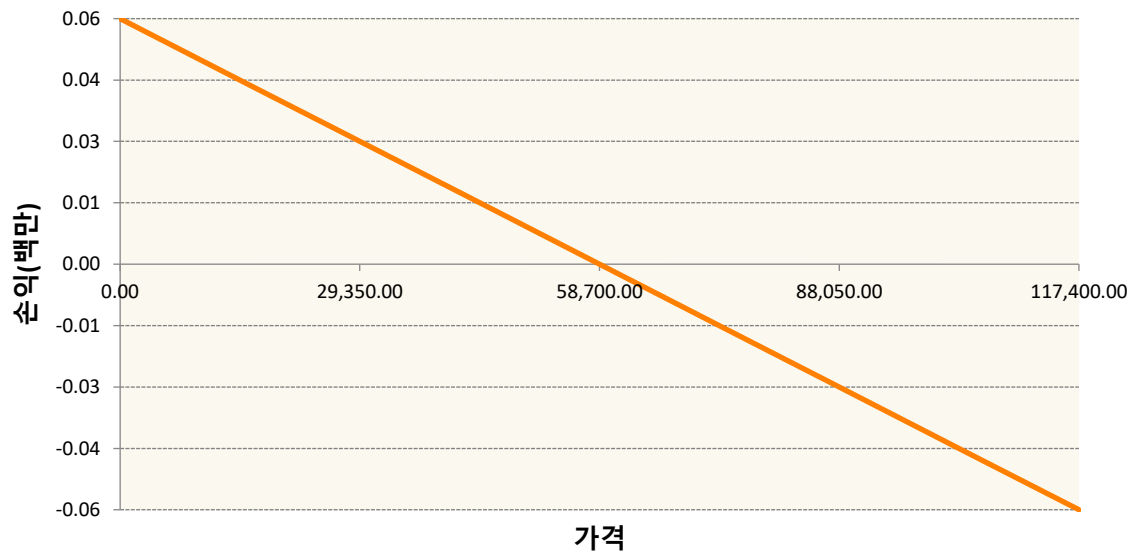
2. 만기시점의 손익구조



KR4111T50006-2023-05 삼성전자개별선물



KR41F7T50008-2023-05 카카오페이개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101T600 2023-06 코스피200지수선물	165
KR4106T600 2023-06 코스닥150선물	153
KR4111T500 2023-05 삼성전자개별선물	44
KR41F7T500 2023-05 카카오페이개별선물	7
KRS0004099 SWAP_MICRON TECH_0308	0.19
KRS0004212 SWAP_SPDR S&P BIOTECH_0413	1

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

(단위:백만원)

647

공시일	2023-05-09
기준일	2023-05-08

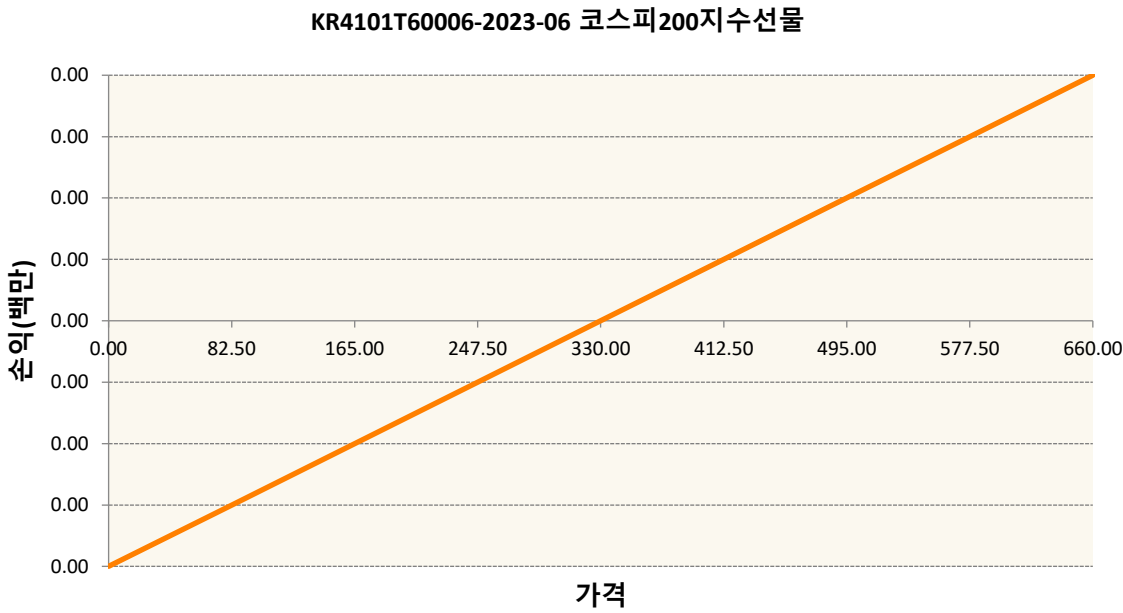
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	248	-248	장내
누계	유가증권	선물	743	0	743	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101T60006		2023-06 코스피200지수선물					59
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-59	-59	-59	-59	-59	-59	-59
-5.33%	-39	-39	-39	-39	-39	-39	-39
-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%	39	39	39	39	39	39	39
8.00%	59	59	59	59	59	59	59

공시일	2023-05-09
기준일	2023-05-08

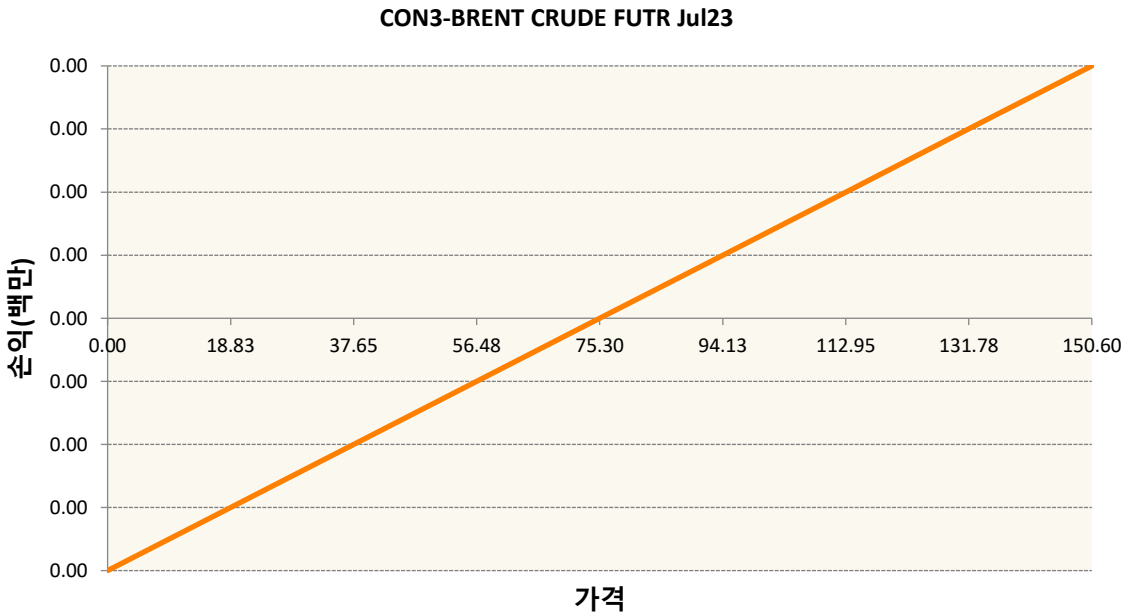
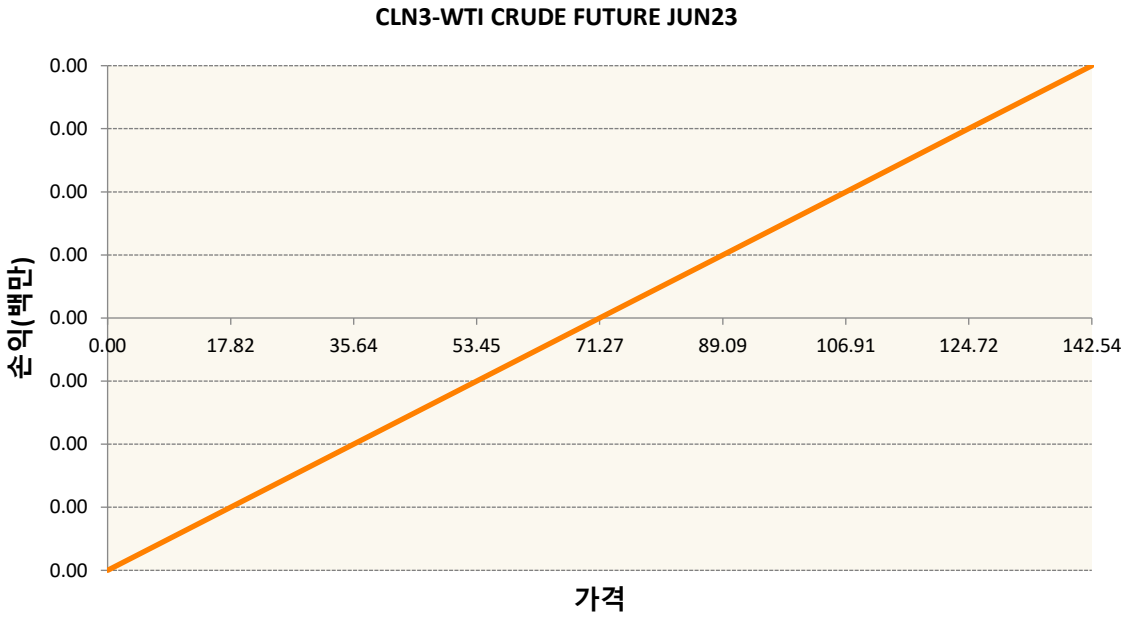
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

1. 계약금액

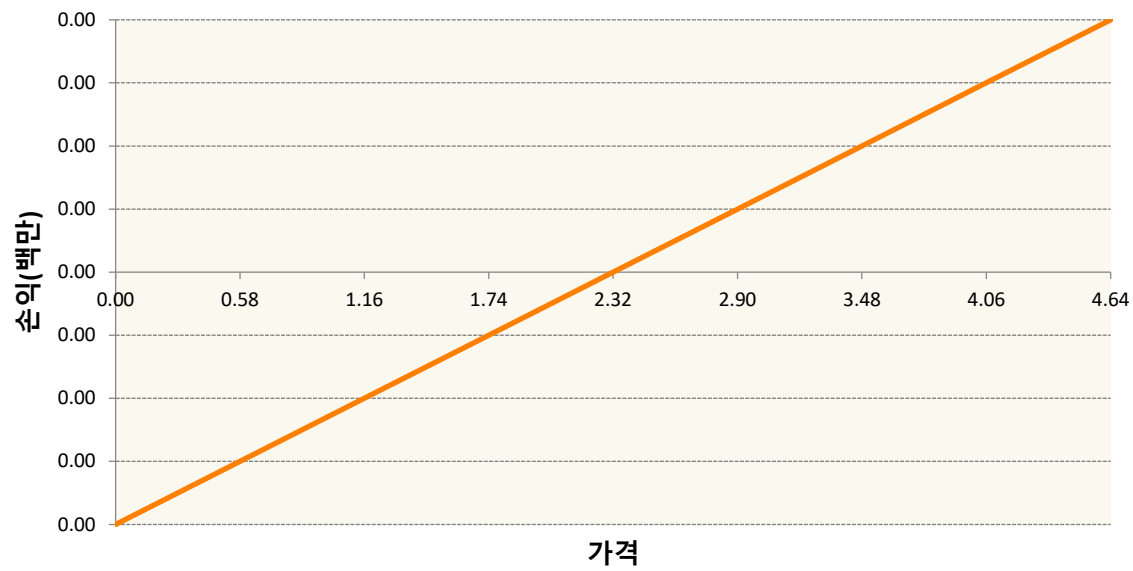
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,273	158	1,115	

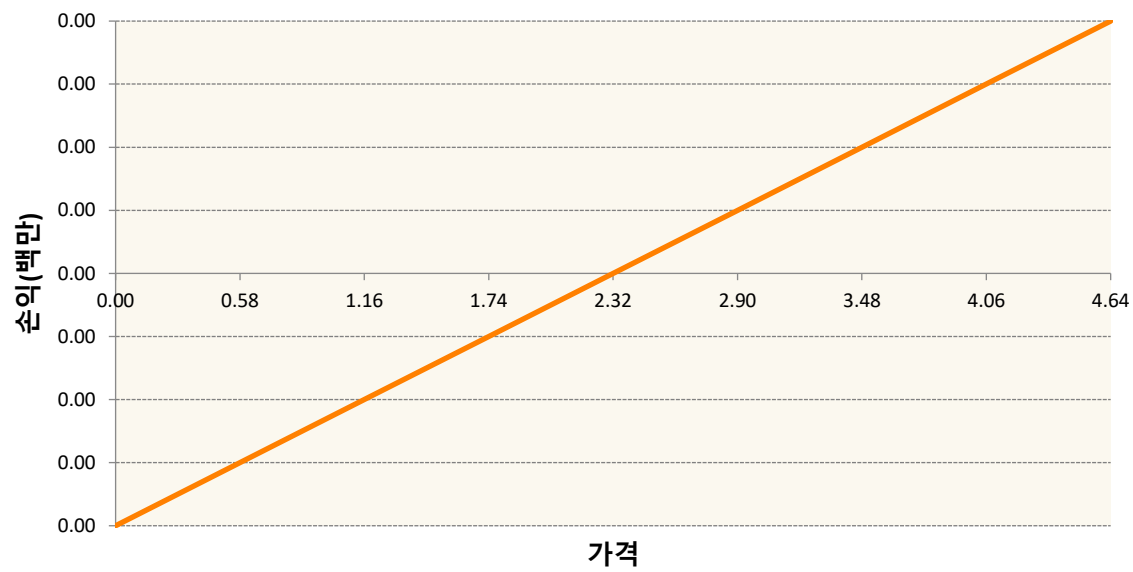
2. 만기시점의 손익구조



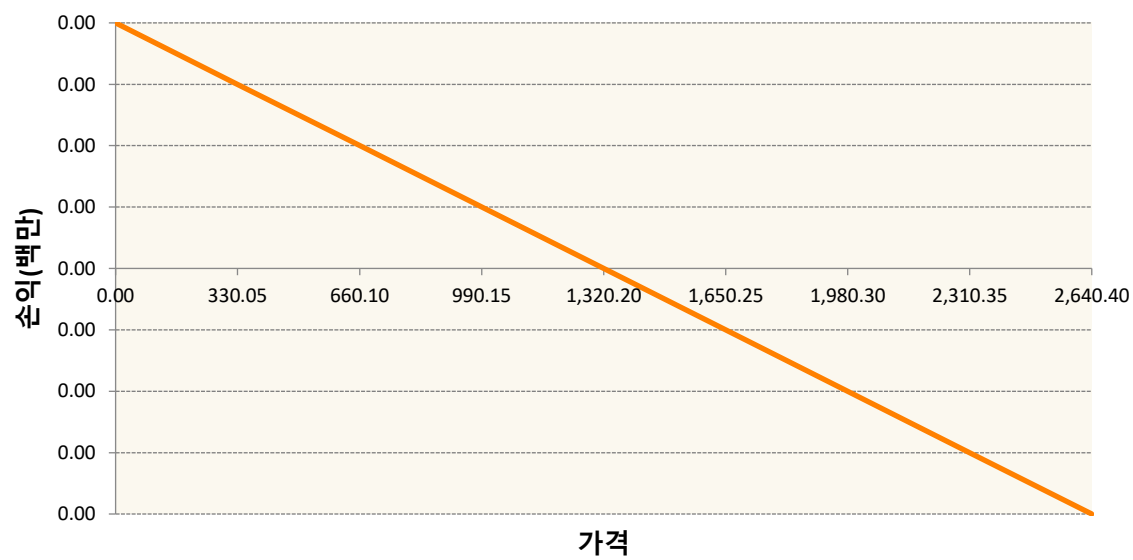
EON3-E-MINI NATURAL GAS JUL23



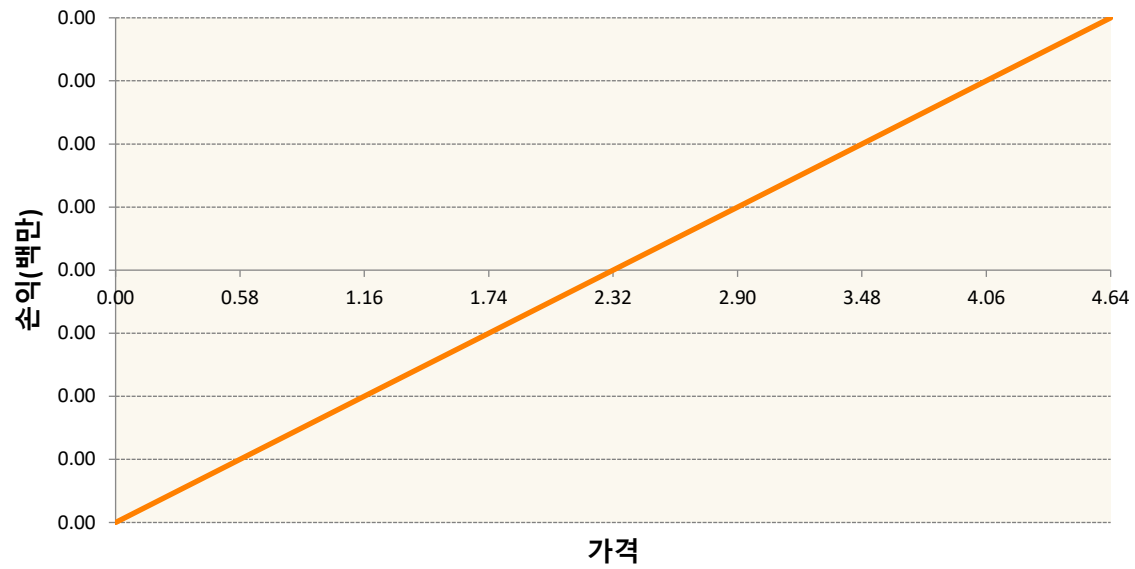
HON3-NY Harb ULSD Fut Jul23



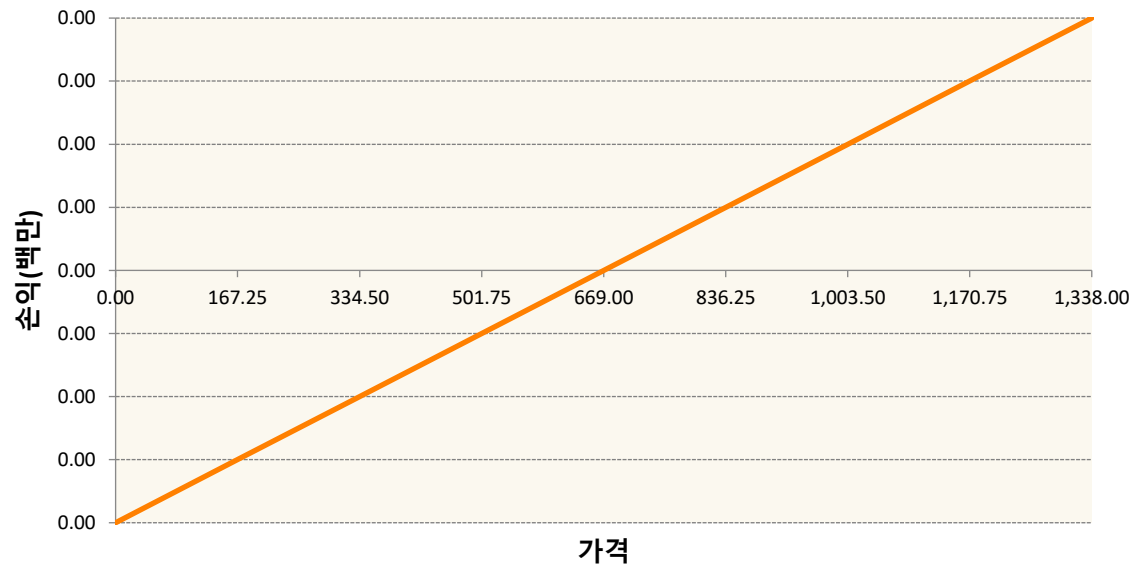
KR4175T50001-2023-05 달러선물



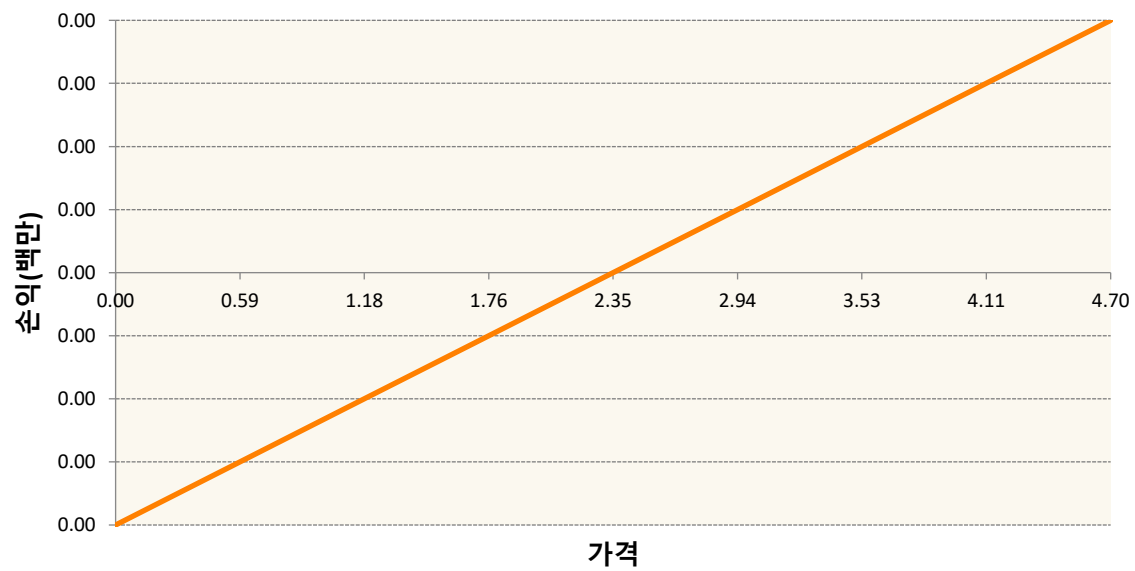
NGN23-NATURAL GAS FUTR JUL23



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		19
QSN3	Low Su Gasoil G JUL23		7
XBN3	GASOLINE RBOB FUT JUL23		10

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	200