

공시일	2023-05-12
기준일	2023-05-11

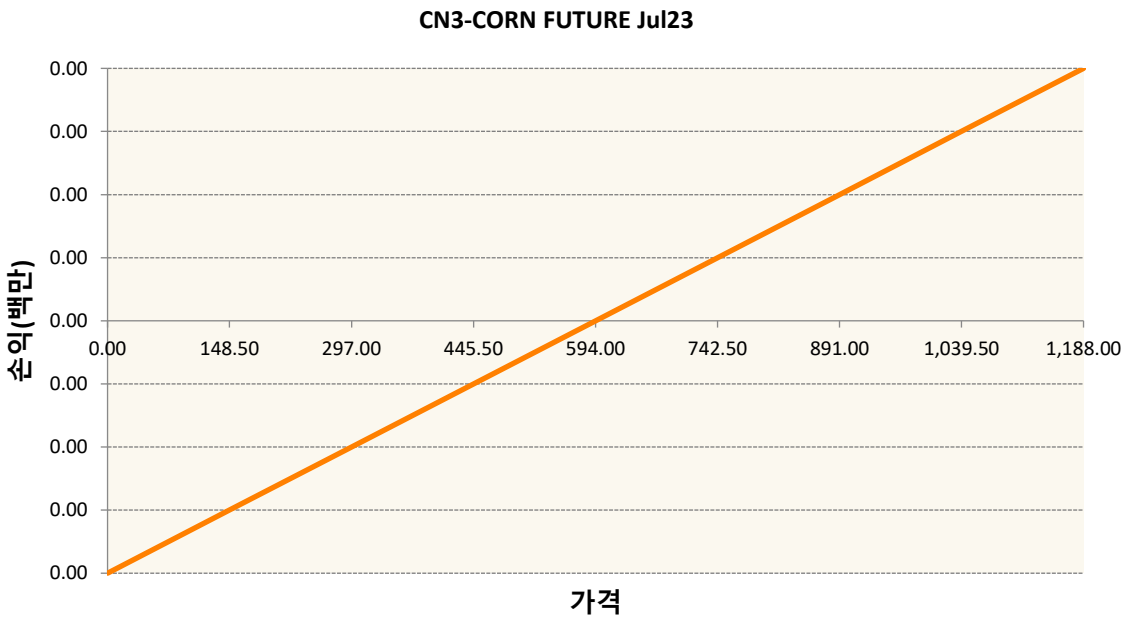
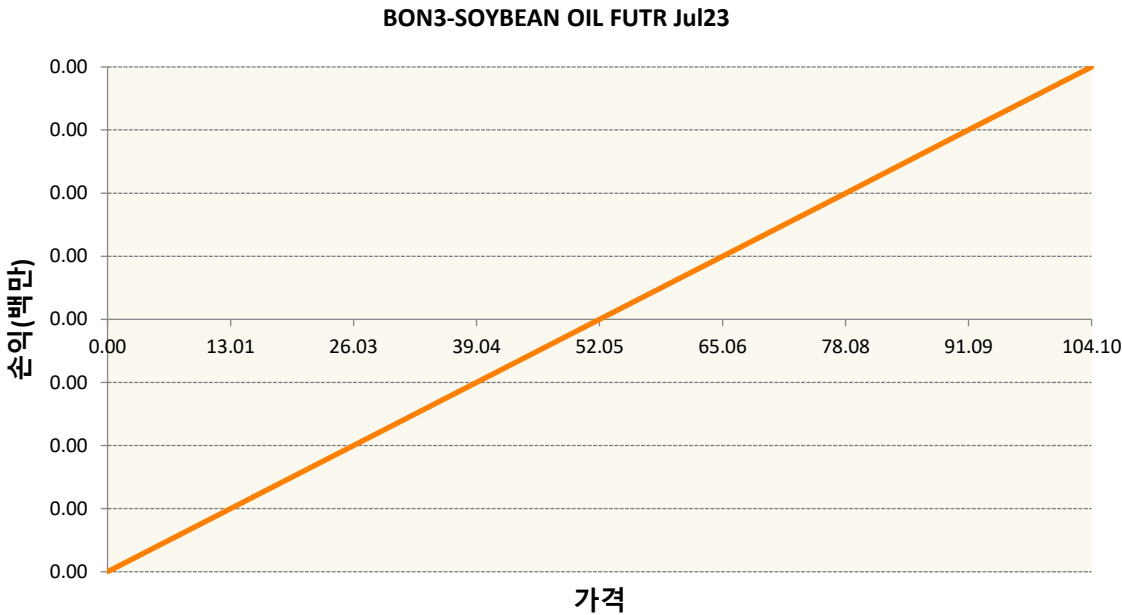
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

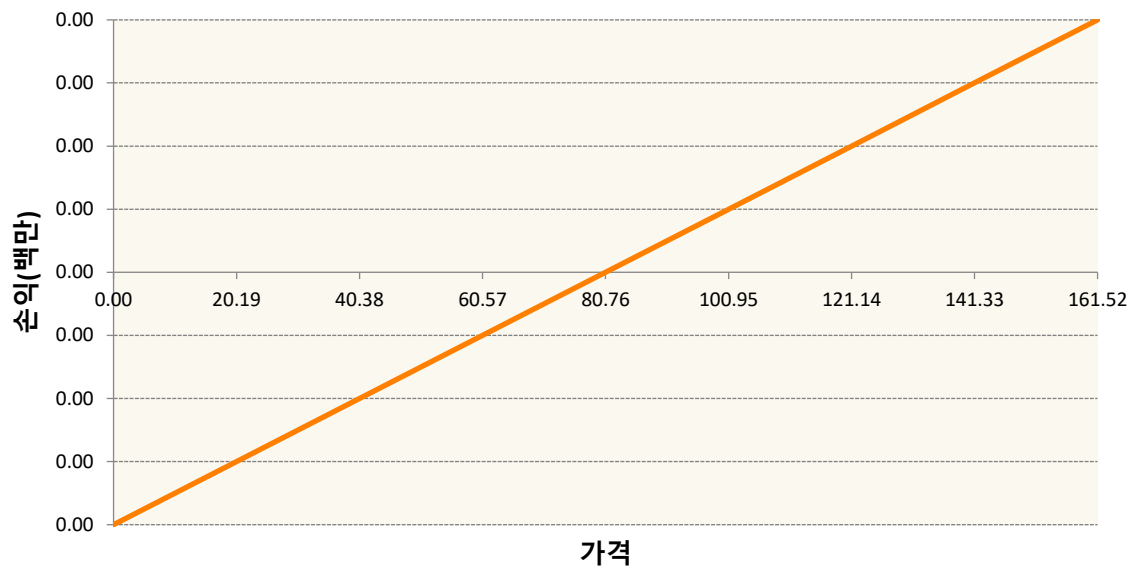
(단위:USD 백만)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,368	530	4,838	

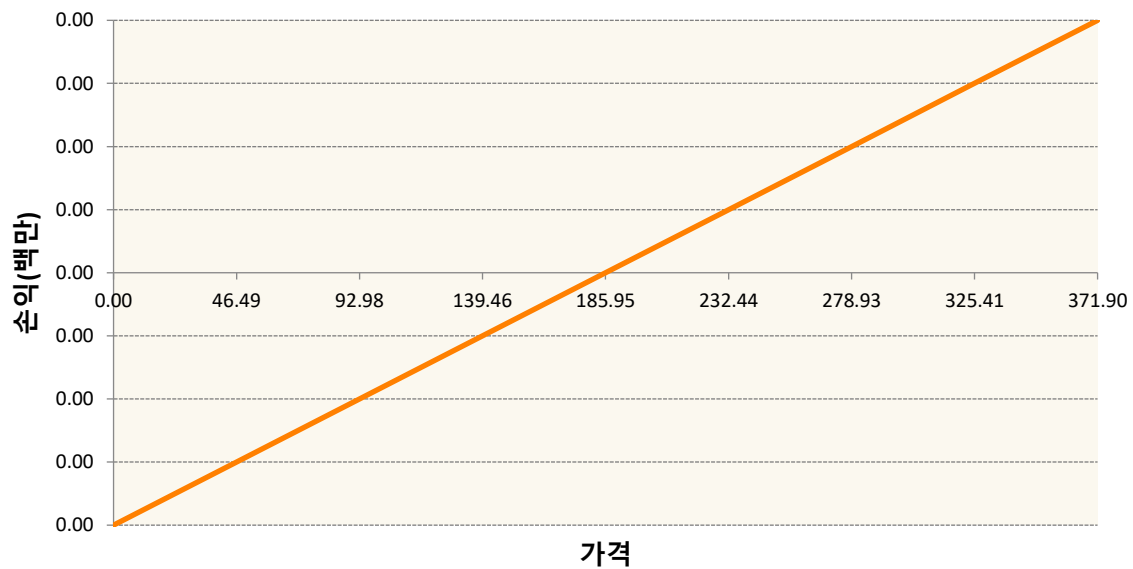
2. 만기시점의 손익구조



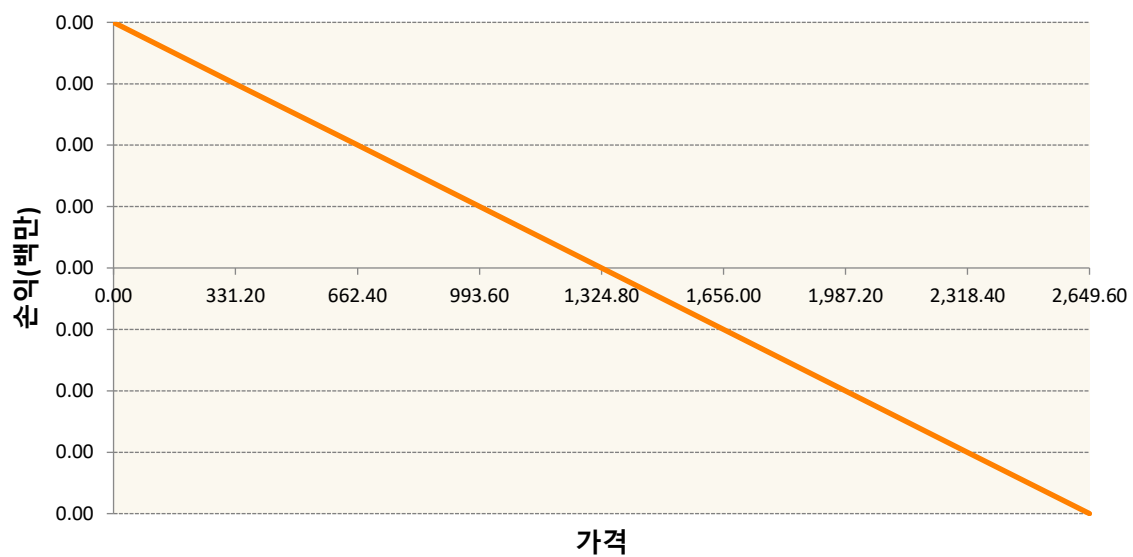
CTN3-COTTON NO.2 FUTR Jul23



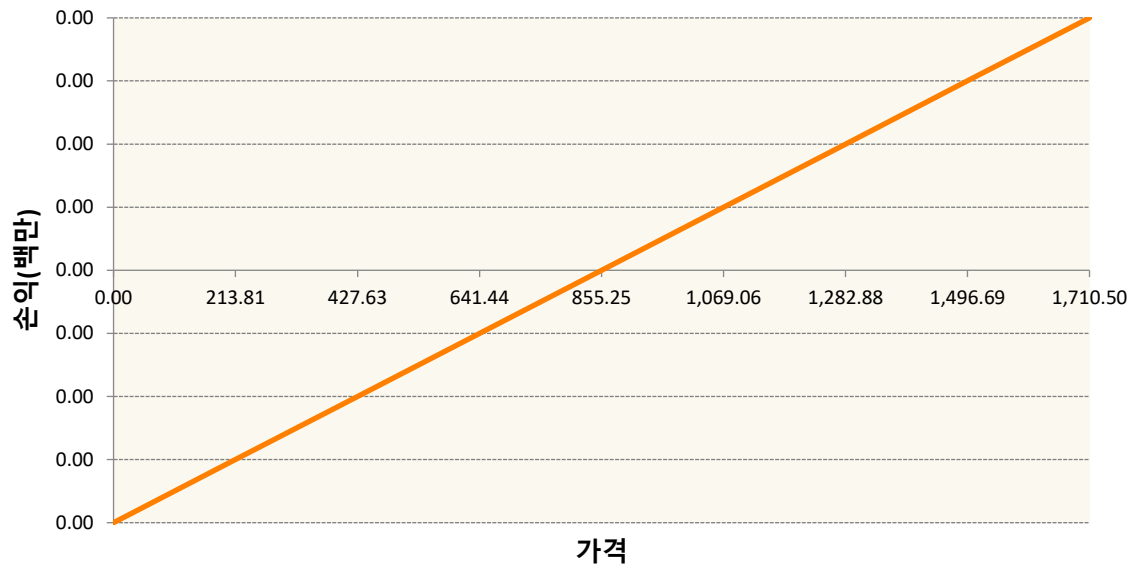
KCN3-COFFEE 'C' FUTURE Jul23



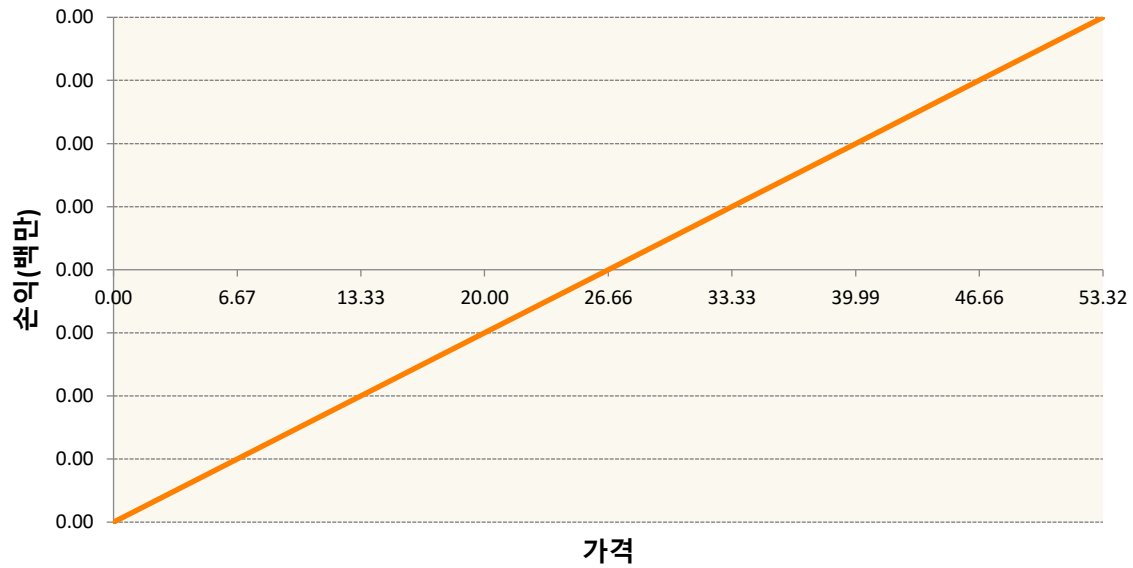
KR4175T60000-2023-06 달러선물



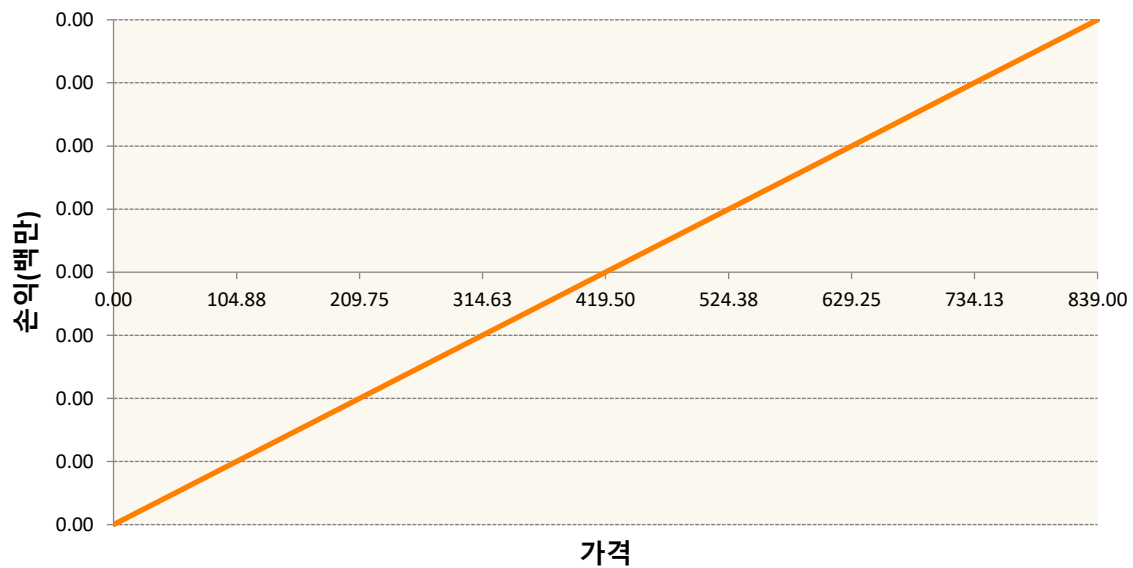
KWN3-KC HRW WHEAT FUT Jul23



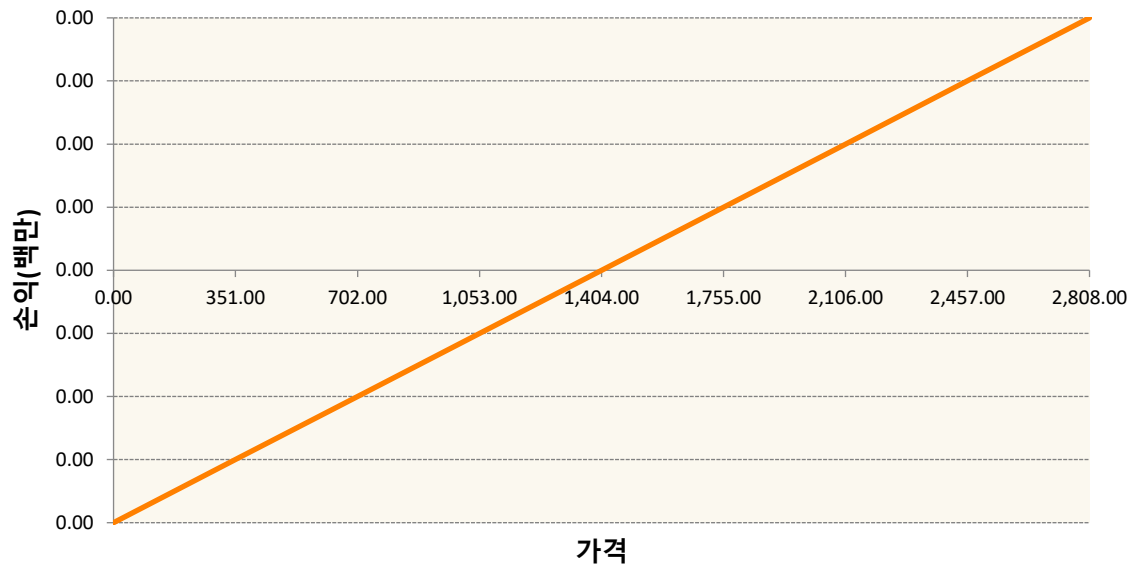
SBN3-Sugar #11 (WORLD) Jul23



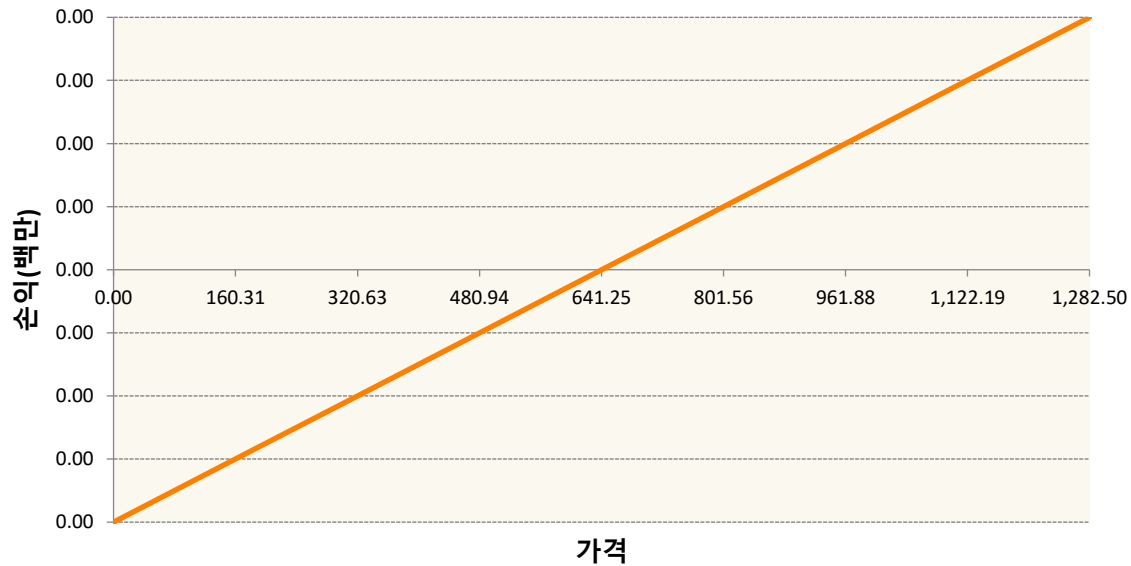
SMN3-SOYBEAN MEAL FUTR Jul23



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	2023-05-12
기준일	2023-05-11

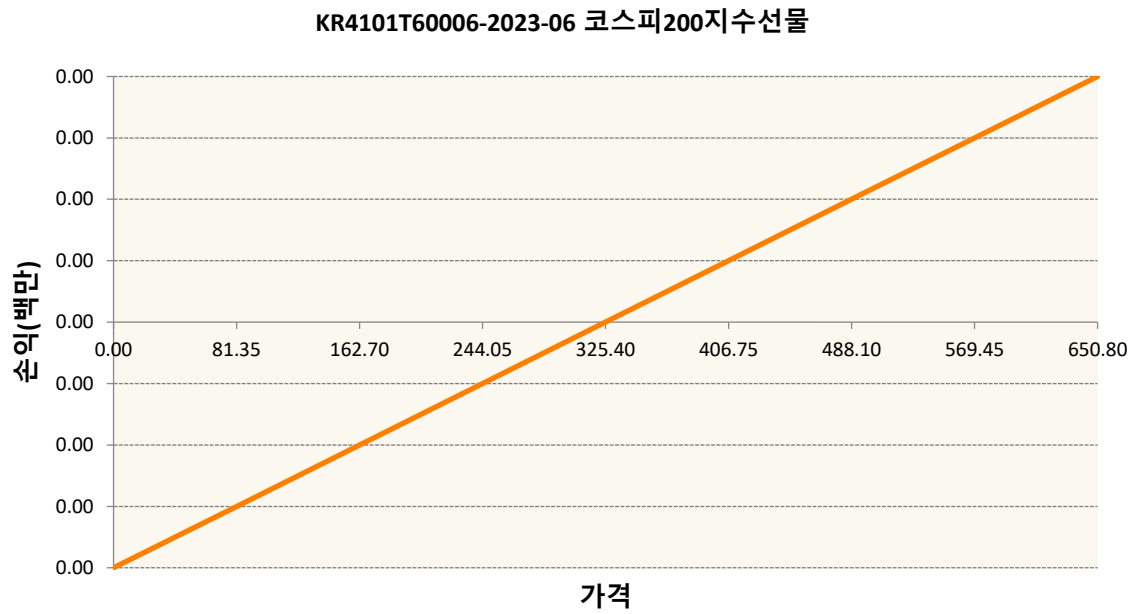
스마트인덱스모

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	2,847	0	2,847	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101T60006		2023-06 코스피200지수선물					228
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-228	-228	-228	-228	-228	-228	-228
-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%	228	228	228	228	228	228	228

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

(단위:백만원)

244

공시일	2023-05-12
기준일	2023-05-11

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	358
-----------------------------	-----

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

624

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2023-05-12
기준일	2023-05-11

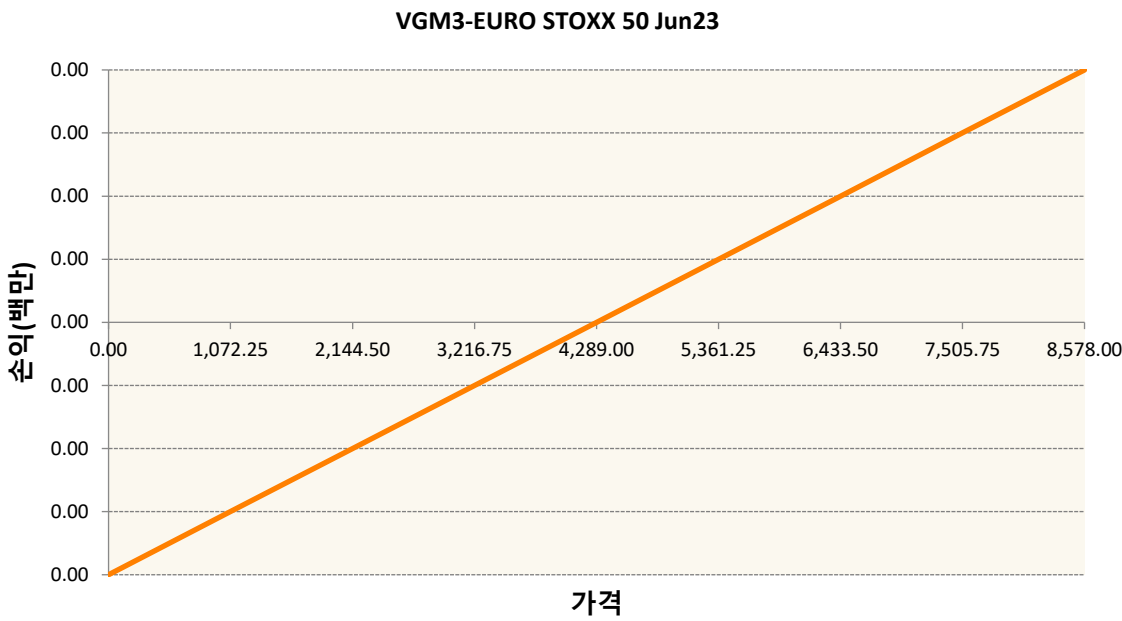
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	422	0	422	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM3	EURO STOXX 50 Jun23	34
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

59

공시일	2023-05-12
기준일	2023-05-11

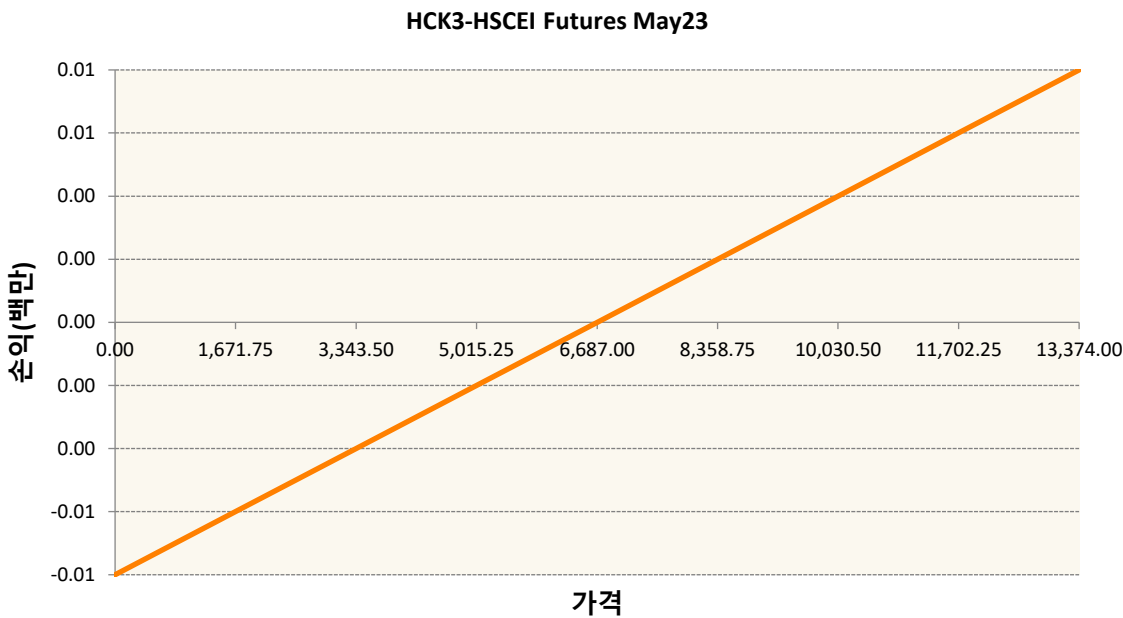
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	910	0	910	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCK3	HSCEI Futures May23	73
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

127

공시일	2023-05-12
기준일	2023-05-11

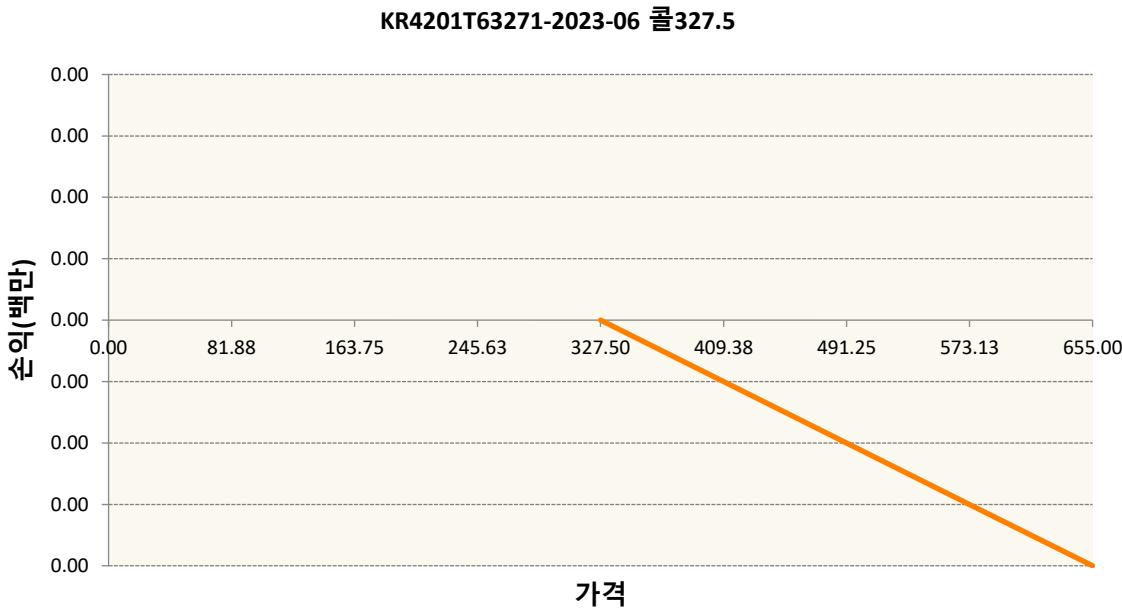
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	35,625	-35,625	장내
누계	유가증권	옵션	0	35,124	-35,124	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201T63271						2023-06 콜327.5		2,084
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	797	780	758	731	699	664	625	
-5.33%	731	693	650	604	553	500	444	
-2.67%	562	500	436	370	303	235	165	
0%	228	152	76	0	-76	-152	-229	
2.67%	-300	-372	-444	-518	-592	-667	-741	
5.33%	-1,002	-1,055	-1,112	-1,172	-1,235	-1,299	-1,366	
8.00%	-1,825	-1,856	-1,893	-1,935	-1,981	-2,031	-2,084	

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

(단위:백만원)

1,997

공시일	2023-05-12
기준일	2023-05-11

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	581	581	0	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213D2N KRW/EUR 26-05-23E	46
FXW213D4K EUR/KRW 26-05-23E	46

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

(단위:백만원)

75

공시일	2023-05-12
기준일	2023-05-11

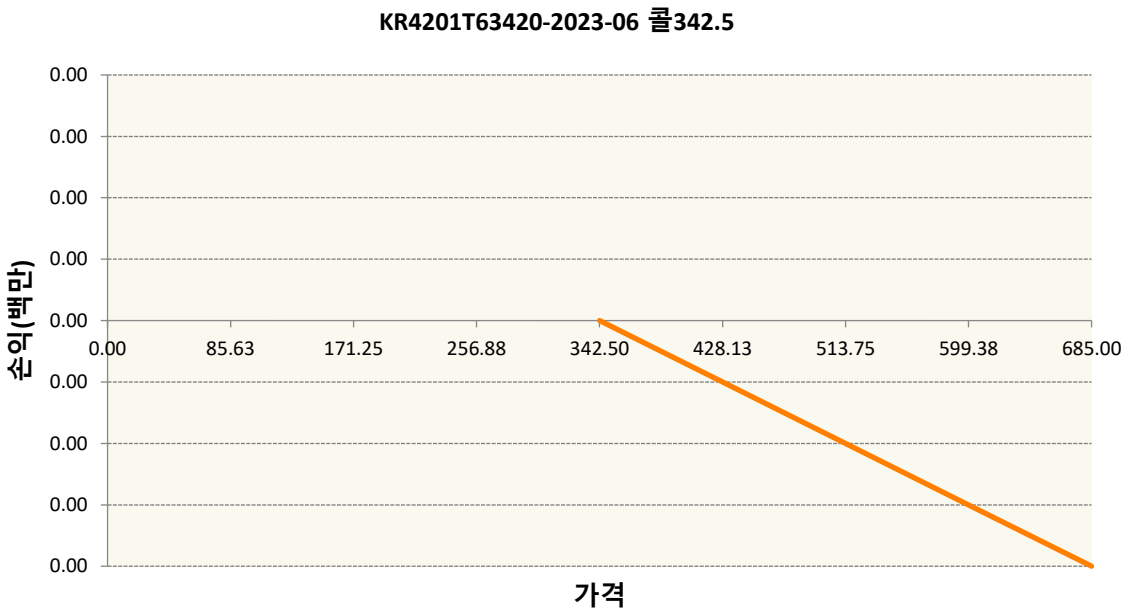
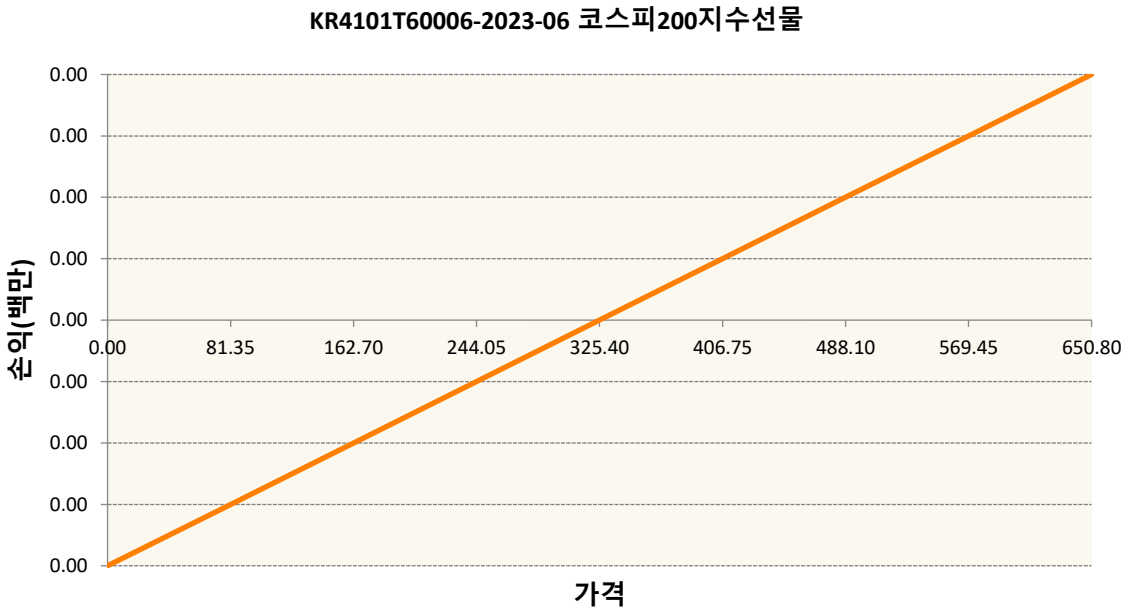
리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

1. 계약금액

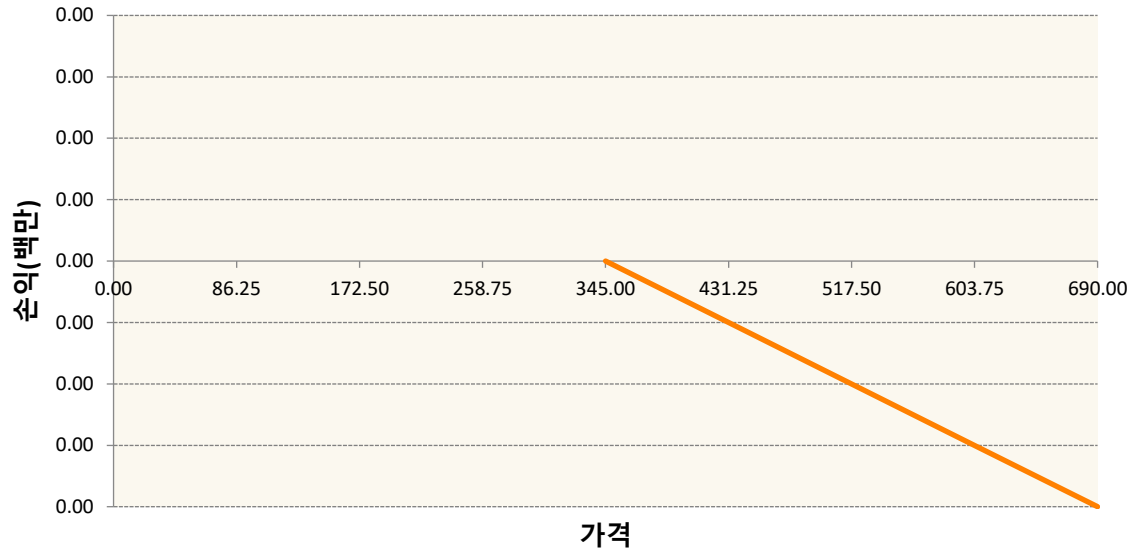
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	81	0	81	장내
신규	유가증권	옵션	0	3,954	-3,954	장내
누계	유가증권	선물	488	0	488	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,951	-3,951	장내

2. 만기시점의 손익구조



KR4201T63453-2023-06 콜345



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101T60006		2023-06 코스피200지수선물					39
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-39	-39	-39	-39	-39	-39	-39
-5.33%	-26	-26	-26	-26	-26	-26	-26
-2.67%	-13	-13	-13	-13	-13	-13	-13
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	13	13	13	13	13	13	13
5.33%	26	26	26	26	26	26	26
8.00%	39	39	39	39	39	39	39
KR4201T63420		2023-06 콜342.5					93
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	19	19	18	18	17	16	15
-5.33%	18	18	17	15	14	12	10
-2.67%	16	14	13	10	8	5	2
0%	10	7	4	0	-4	-8	-12
2.67%	-4	-8	-13	-17	-22	-27	-32
5.33%	-28	-33	-38	-43	-48	-54	-59
8.00%	-64	-69	-74	-78	-83	-88	-93
KR4201T63453		2023-06 콜345					60
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	11	11	11	10	10	9	9
-5.33%	11	10	10	9	8	7	6
-2.67%	10	9	8	6	5	3	1
0%	6	4	2	0	-2	-5	-8

2.67%	-2	-5	-8	-11	-14	-17	-20
5.33%	-17	-20	-24	-27	-31	-34	-38
8.00%	-40	-43	-47	-50	-53	-57	-60

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

(단위:백만원)

162

공시일	2023-05-12
기준일	2023-05-11

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	6,712	0	6,712	

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	2023-05-12
기준일	2023-05-11

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	5,008	0	5,008	

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	2023-05-12
기준일	2023-05-11

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	18,676	0	18,676	
누계	통화	선도	663	19,198	-18,535	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
FXW213D2Q KRW/USD 31-05-23E	715
FXW213D3Q KRW/USD 28-06-23E	515
FXW213D4S(KRW/USD 31-07-23E	264
FXW213D5I(USD/KRW 31-05-23E	53
FXW213D5A KRW/USD 31-05-23E	42
IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	3,525

공시일	2023-05-12
기준일	2023-05-11

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

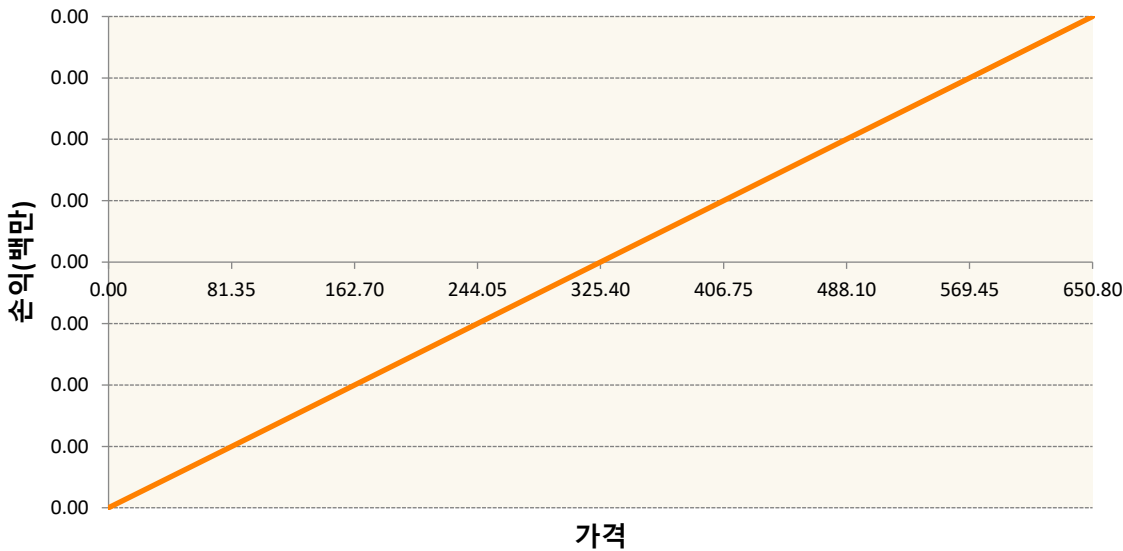
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,220	0	1,220	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	2023-05-12
기준일	2023-05-11

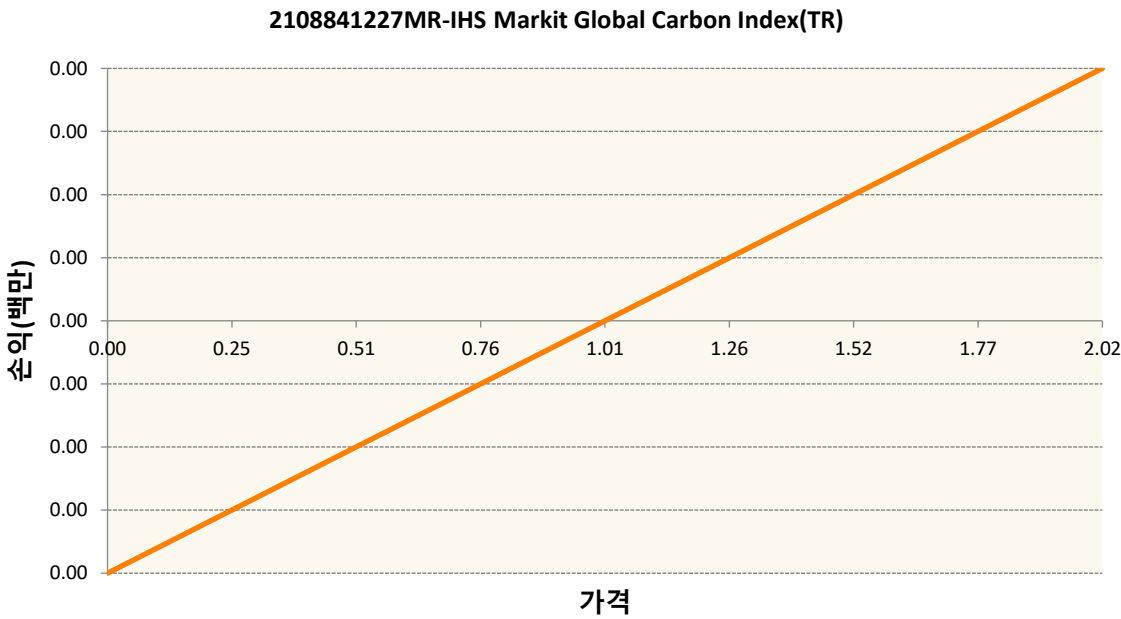
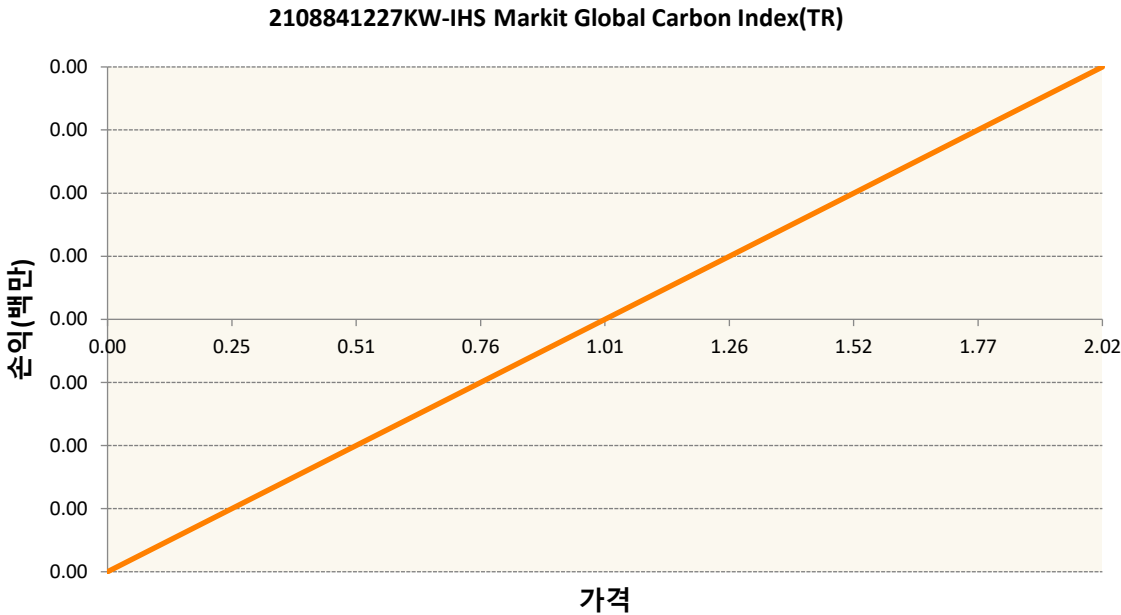
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

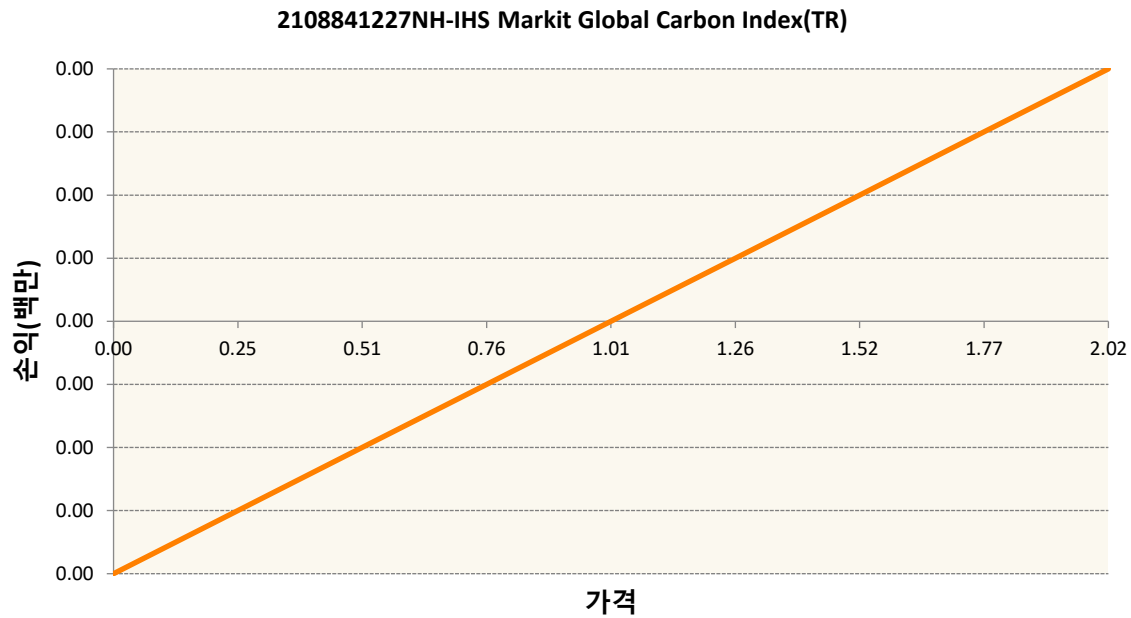
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	26,042	0	26,042	

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108841227IHS Markit Global Carbon Index(TR)		1,773
2108841227IHS Markit Global Carbon Index(TR)		209
2108841227IHS Markit Global Carbon Index(TR)		104

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)		(단위:백만원)
		3,632

공시일	2023-05-12
기준일	2023-05-11

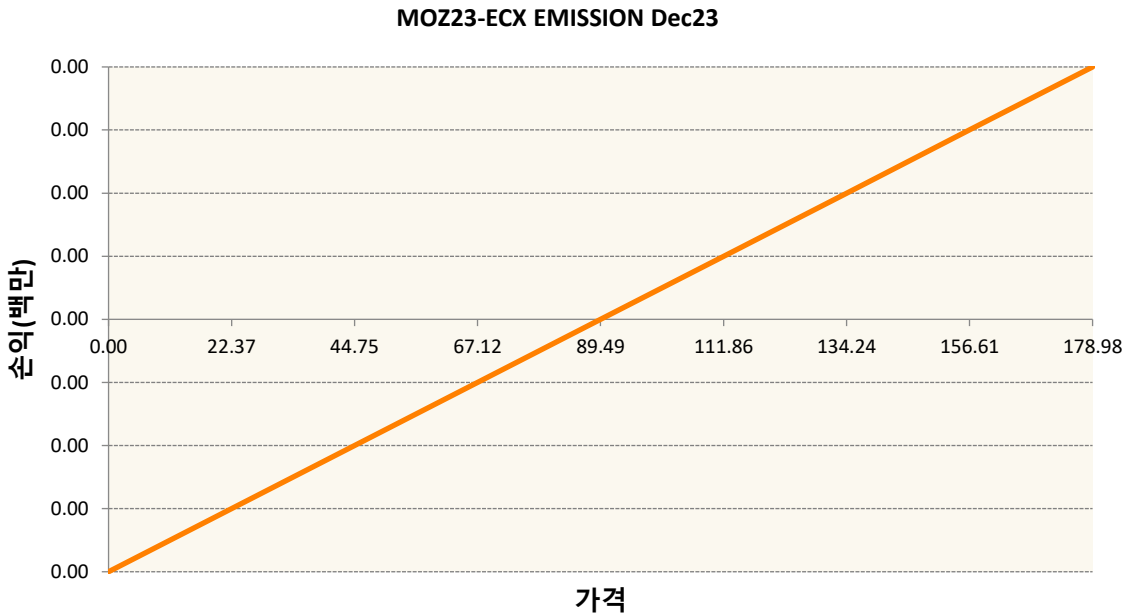
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	8,946	0	8,946	
누계	통화	선도	0	2,178	-2,178	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	716

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

(단위:백만원)

1,387

공시일	2023-05-12
기준일	2023-05-11

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)

77

공시일	2023-05-12
기준일	2023-05-11

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)	4
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 230116(메리츠)	6
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 230116(미래)	5
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 230427(키움)	3

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	30

공시일	2023-05-12
기준일	2023-05-11

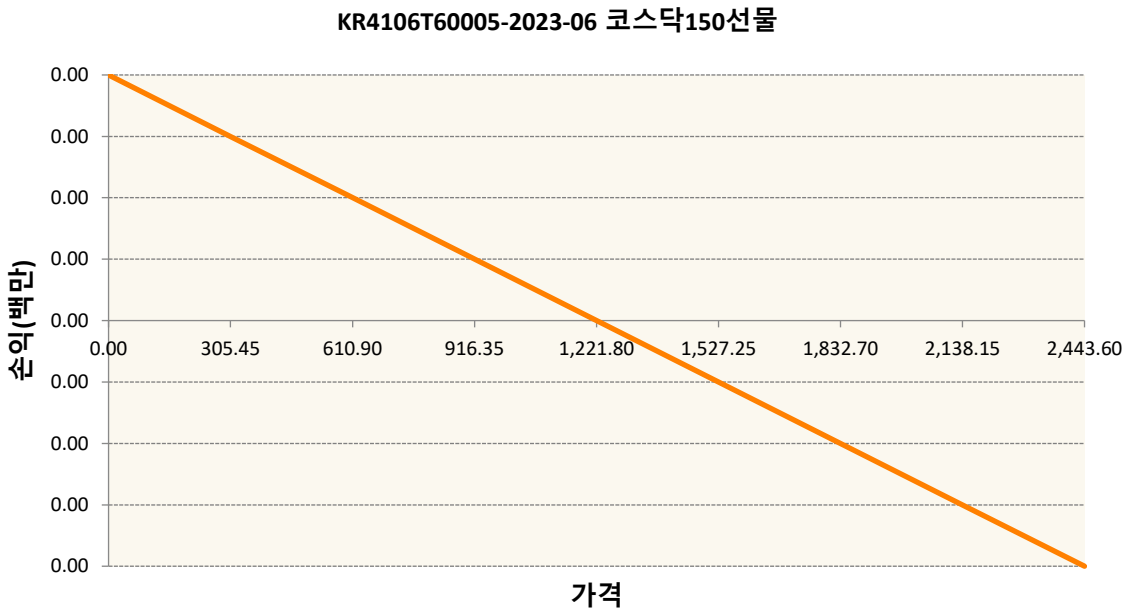
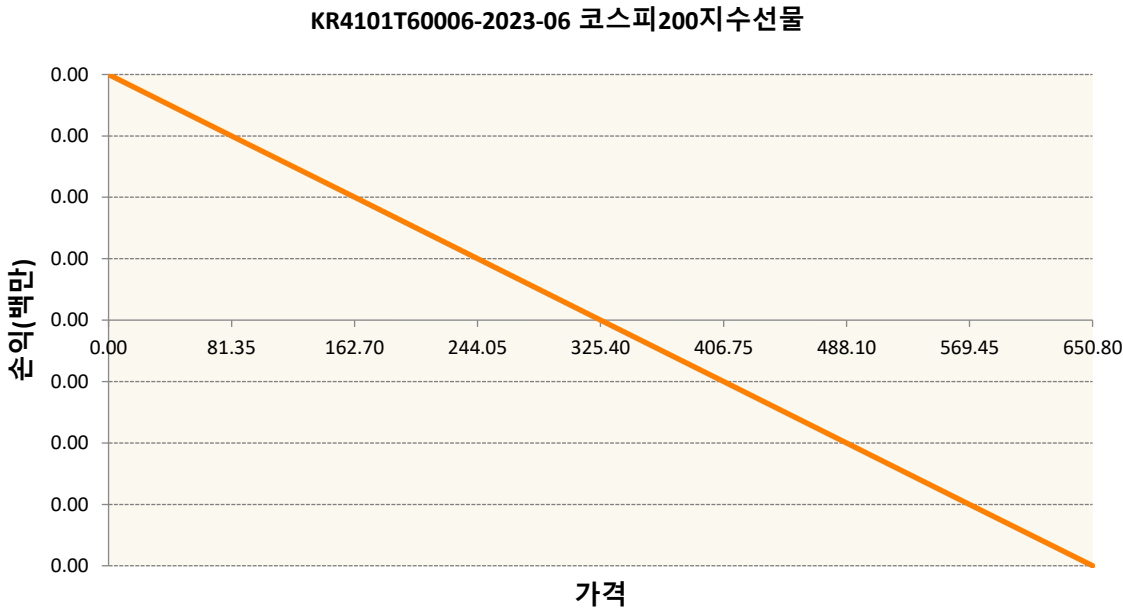
에쿼티알파일반사모혼합자산

1. 계약금액

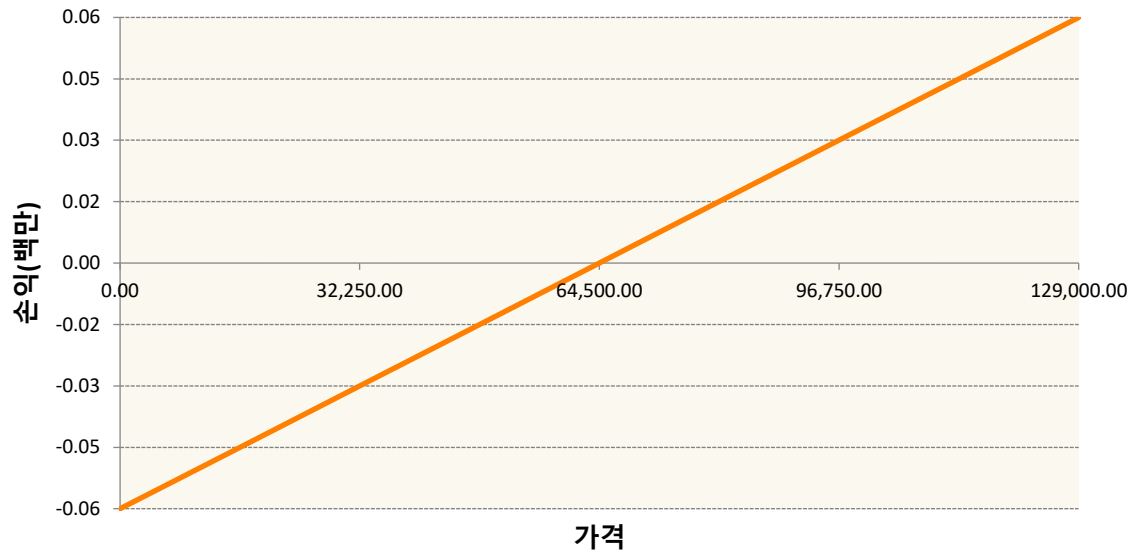
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	538	85	453	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	535	3,829	-3,294	장내
누계	유가증권	스왑	0	0	0	장외

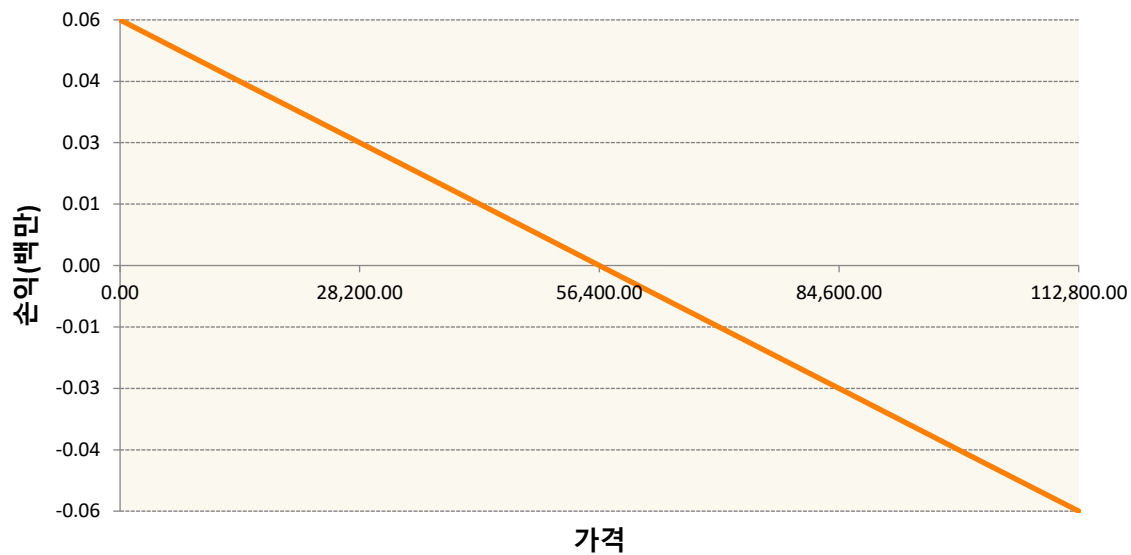
2. 만기시점의 손익구조



KR4111T60005-2023-06 삼성전자개별선물



KR41F7T60007-2023-06 카카오페이개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101T600 2023-06 코스피200지수선물	163
KR4106T600 2023-06 코스닥150선물	137
KR4111T600 2023-06 삼성전자개별선물	43
KR41F7T600 2023-06 카카오페이개별선물	7
KRS0004099 SWAP_MICRON TECH_0308	0.46
KRS0004212 SWAP_SPDR S&P BIOTECH_0413	1

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

(단위:백만원)

610

공시일	2023-05-12
기준일	2023-05-11

코리아인덱스(주식-파생형)(종)

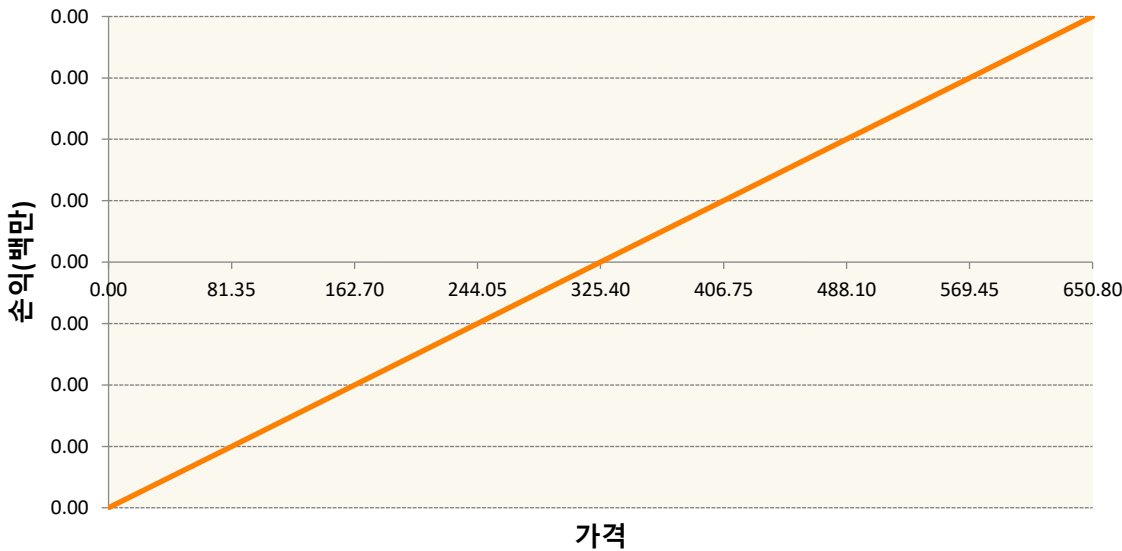
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	732	0	732	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101T60006-2023-06 코스피200지수선물



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	2023-05-12
기준일	2023-05-11

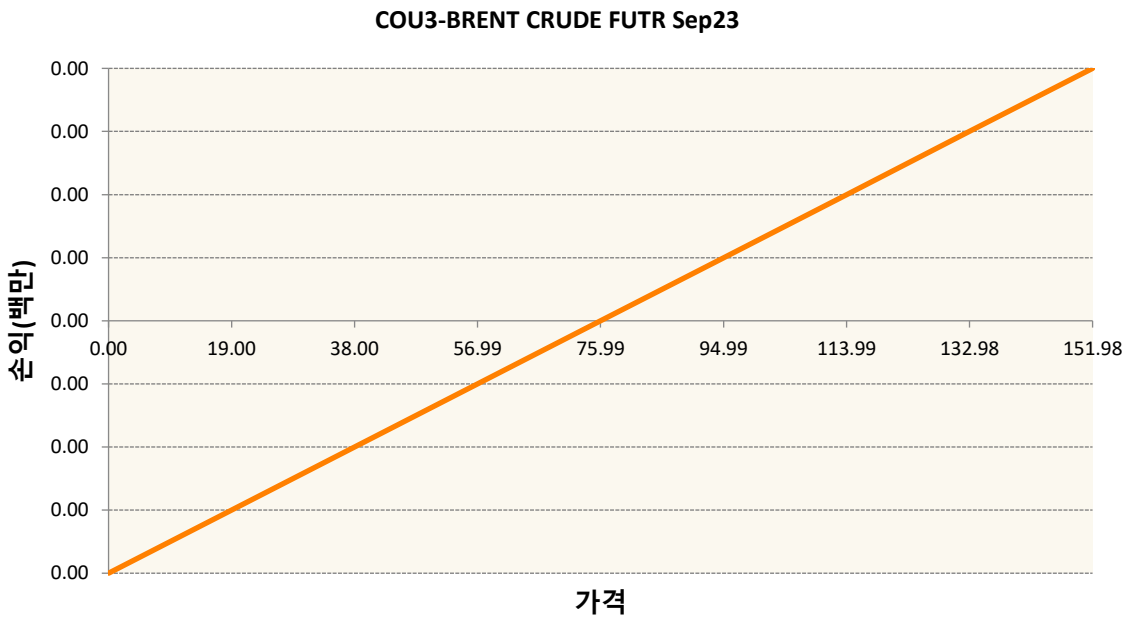
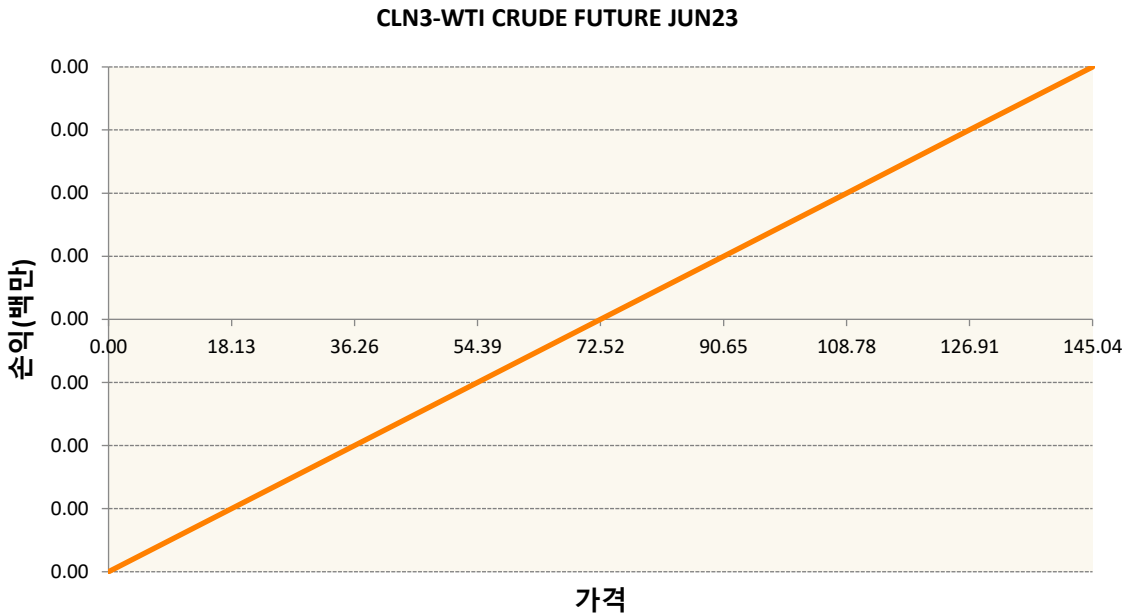
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

1. 계약금액

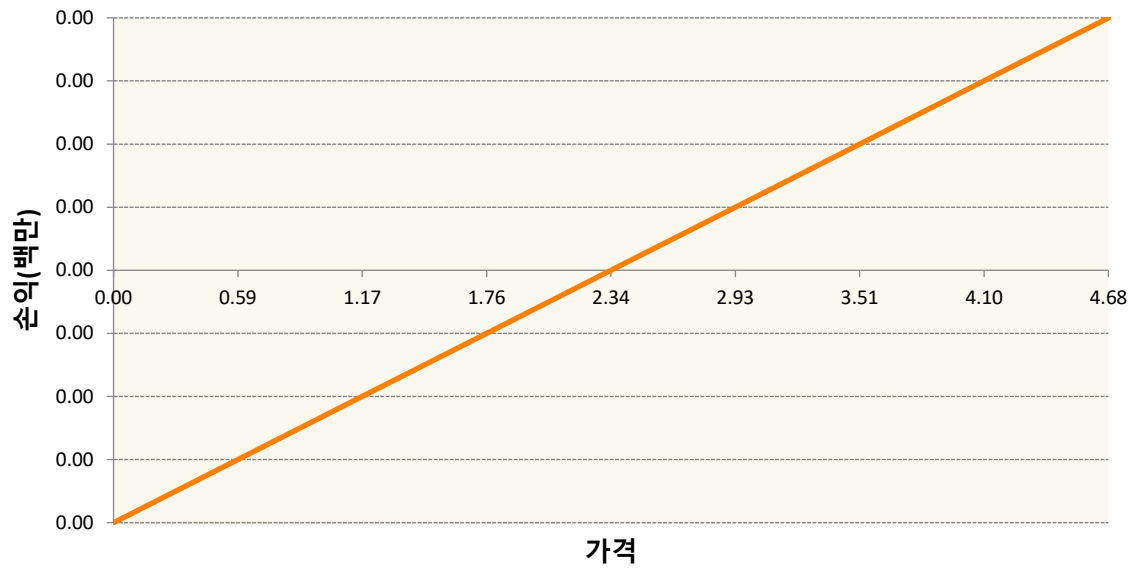
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,304	159	1,145	

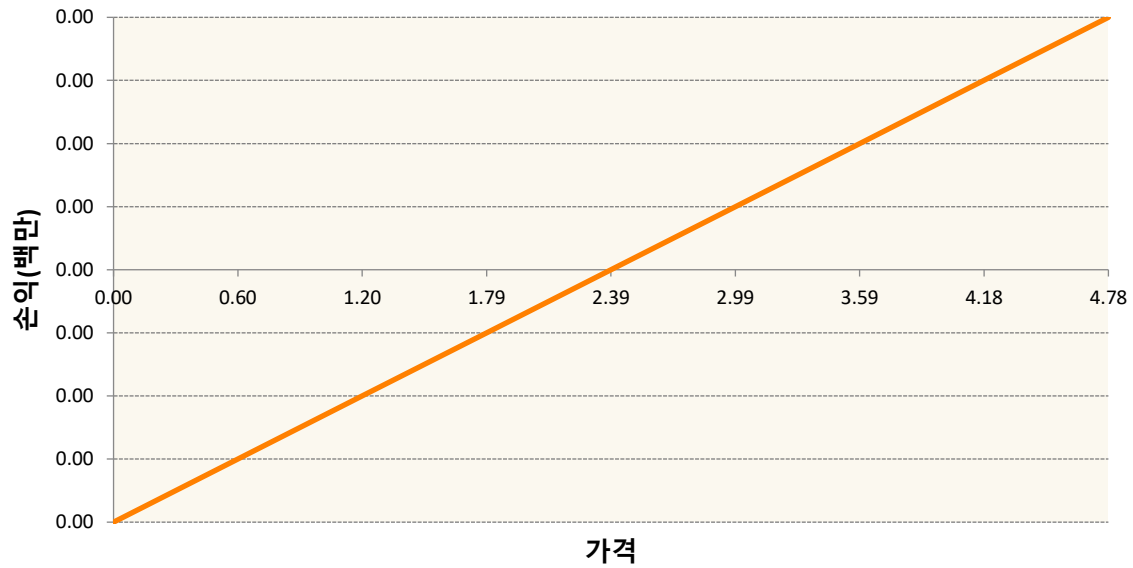
2. 만기시점의 손익구조



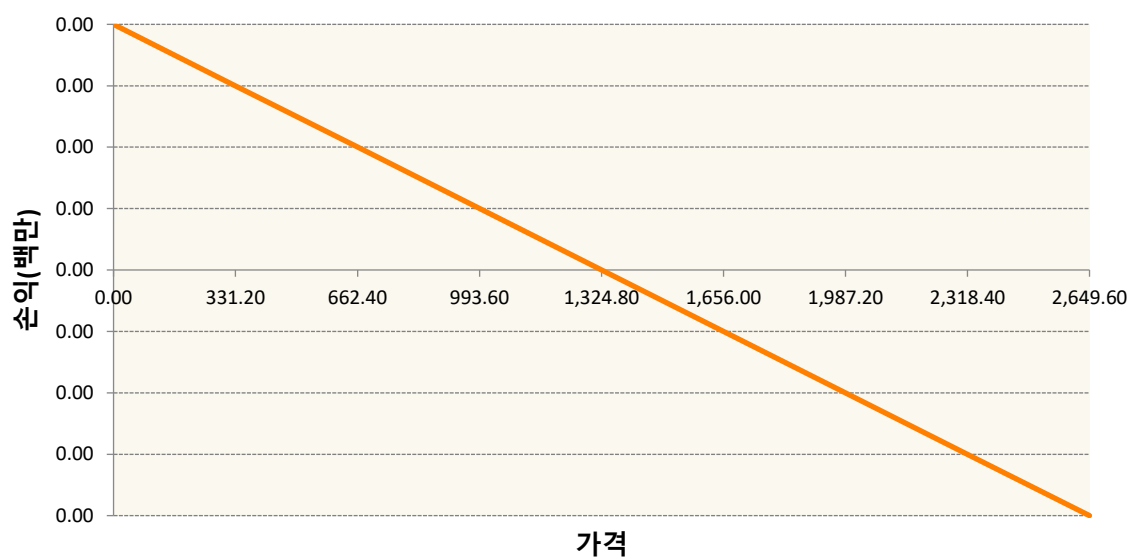
EON3-E-MINI NATURAL GAS JUL23



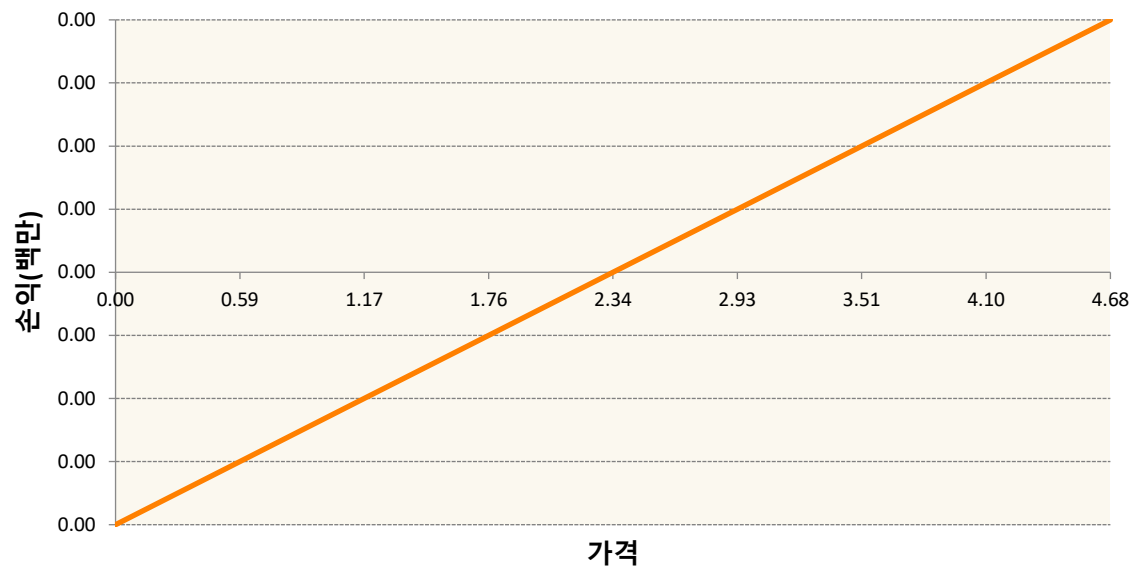
HON3-NY Harb ULSD Fut Jul23



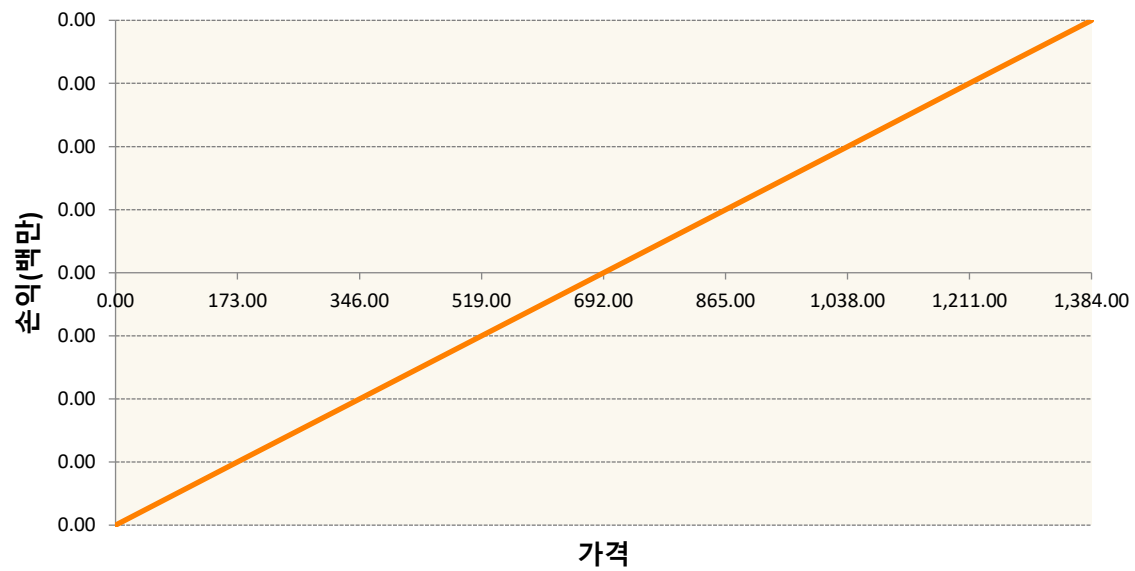
KR4175T60000-2023-06 달러선물



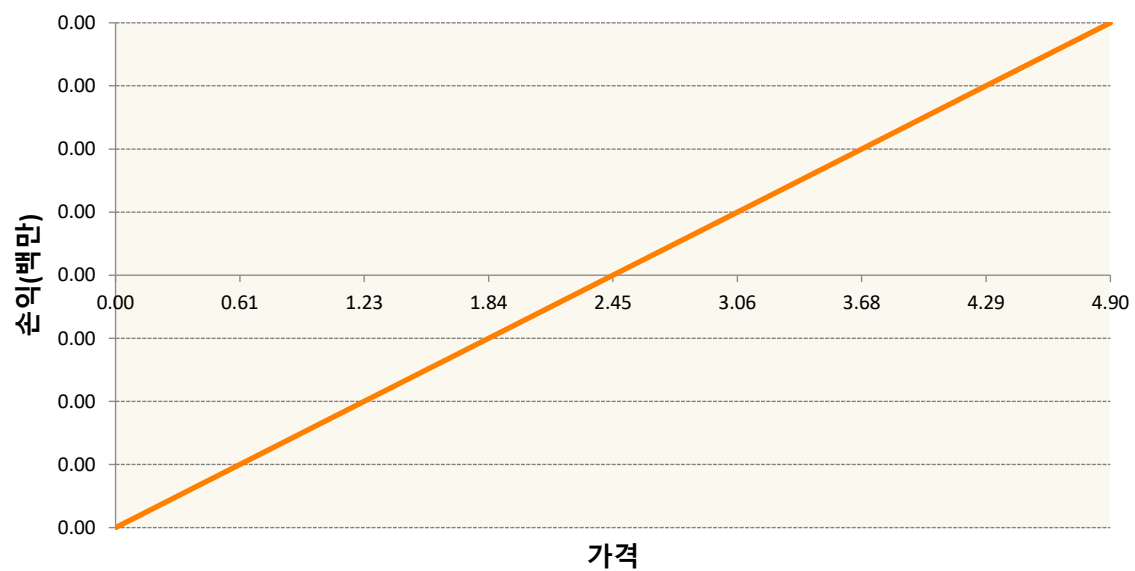
NGN23-NATURAL GAS FUTR JUL23



QSN3-Low Su Gasoil G JUL23



XBN3-GASOLINE RBOB FUT JUL23



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLN3	WTI CRUDE FUTURE JUN23	23
COU3	BRENT CRUDE FUTR Sep23	32
EON3	E-MINI NATURAL GAS JUL23	1
HON3	NY Harb ULSD Fut Jul23	11
KR4175T600	2023-06 달러선물	13
NGN23	NATURAL GAS FUTR JUL23	20
QSN3	Low Su Gasoil G JUL23	7
XBN3	GASOLINE RBOB FUT JUL23	11

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

204