

공시일	2023-05-16
기준일	2023-05-15

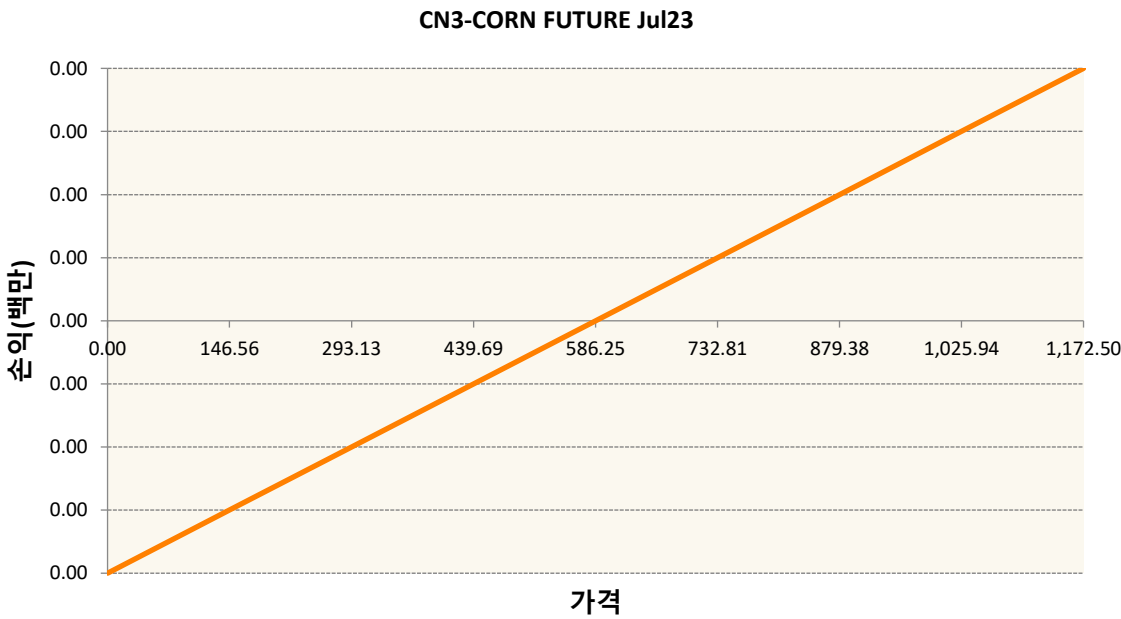
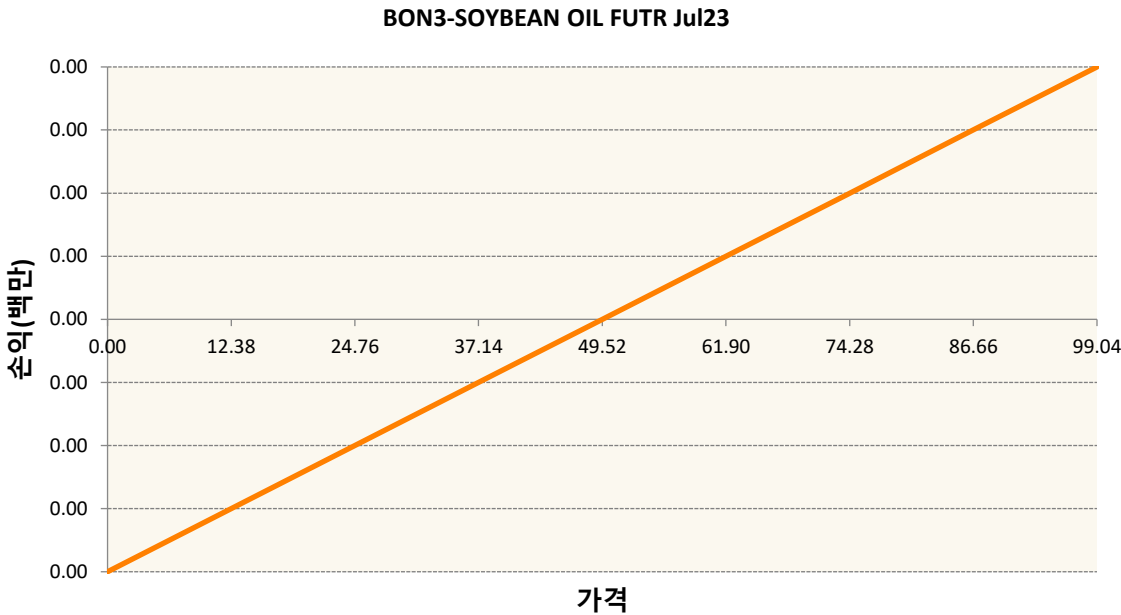
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

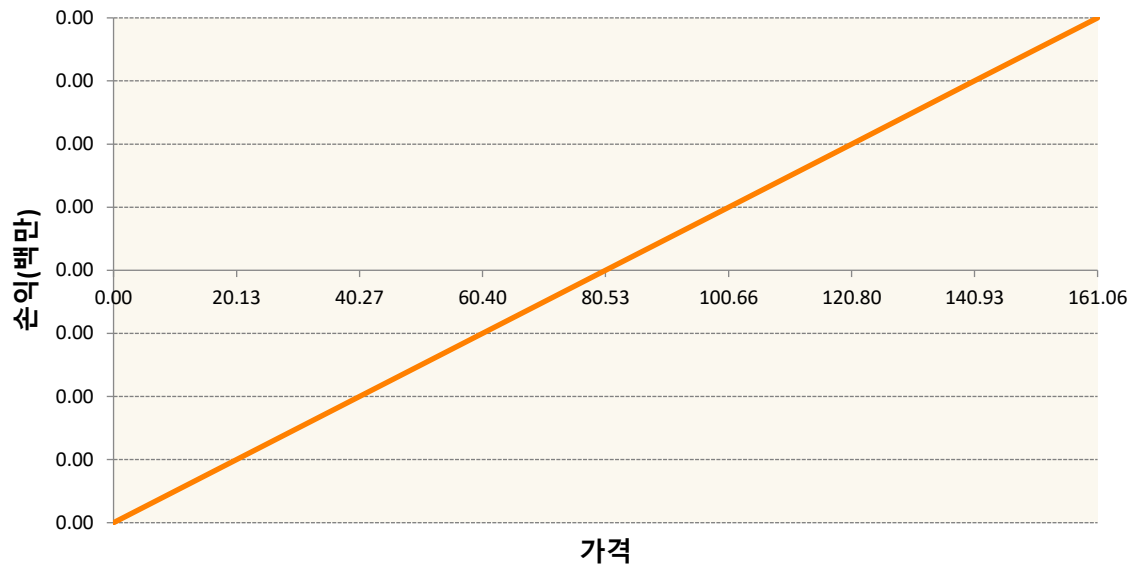
(단위:USD 백만)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,320	534	4,786	

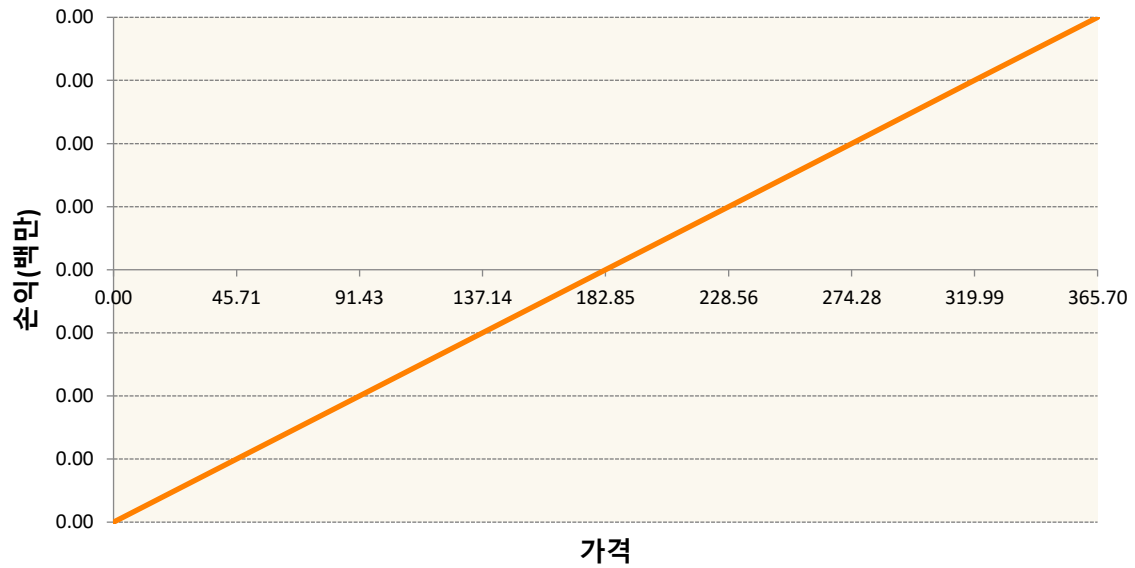
2. 만기시점의 손익구조



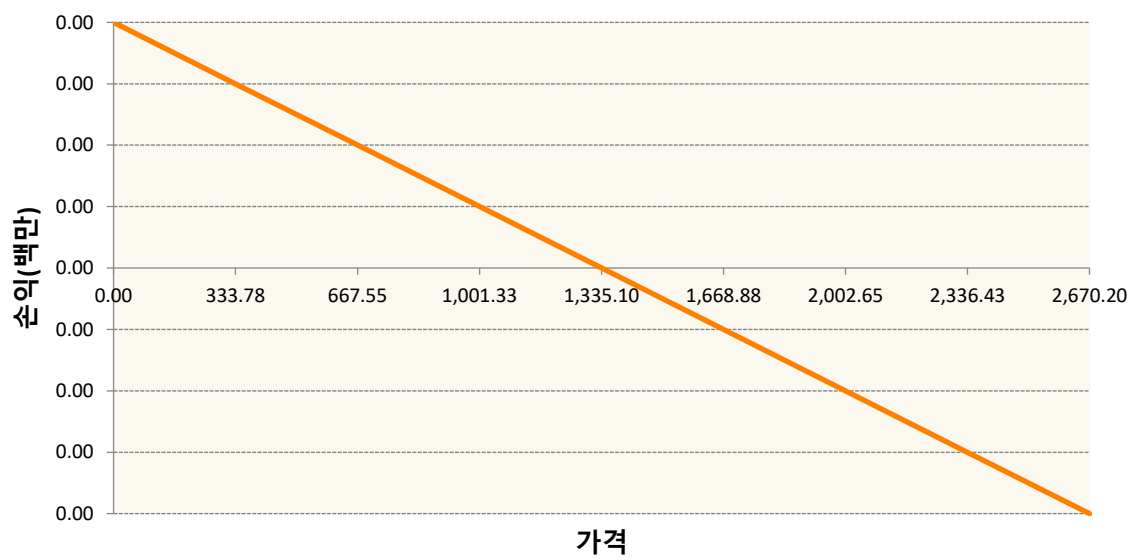
CTN3-COTTON NO.2 FUTR Jul23



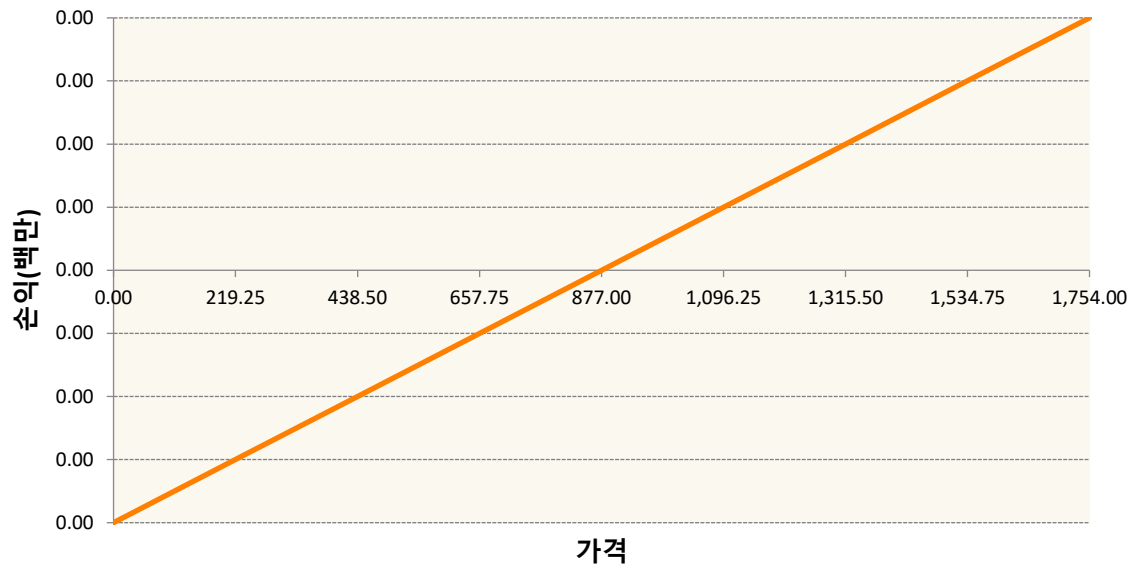
KCN3-COFFEE 'C' FUTURE Jul23



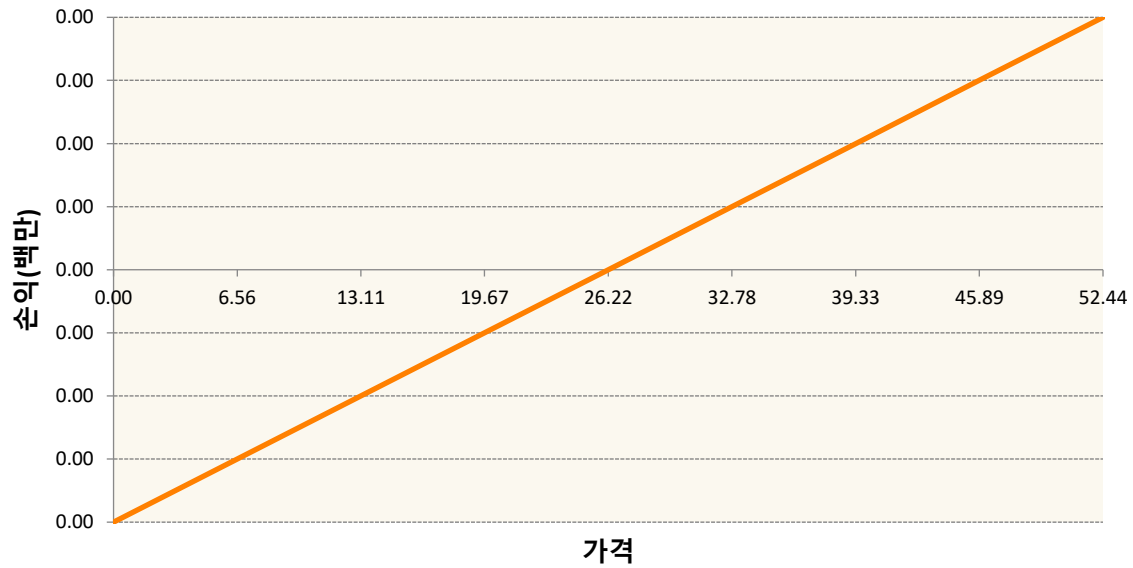
KR4175T60000-2023-06 달러선물



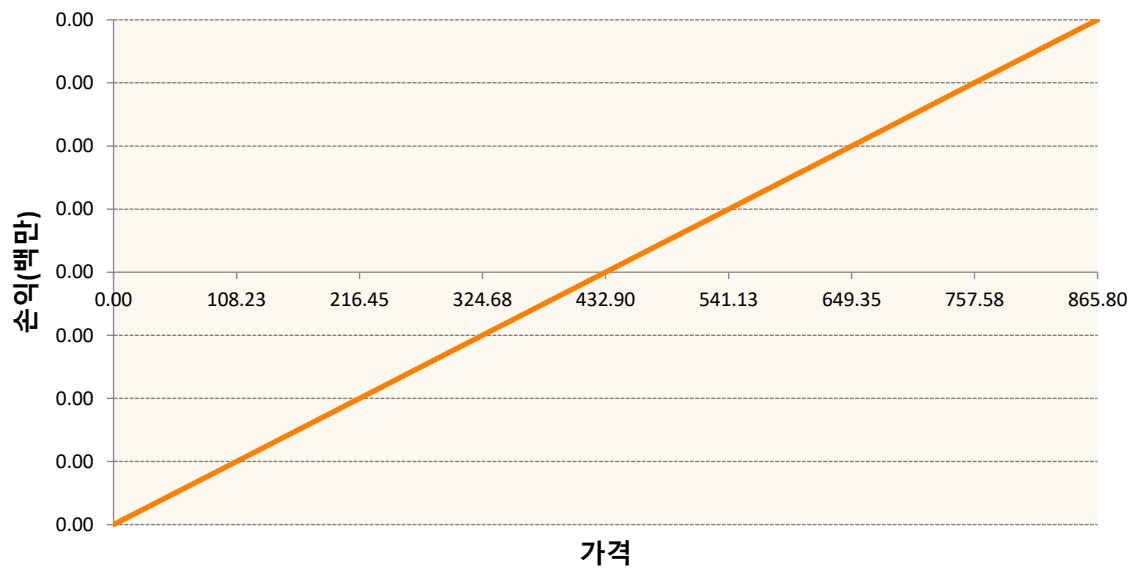
KWN3-KC HRW WHEAT FUT Jul23

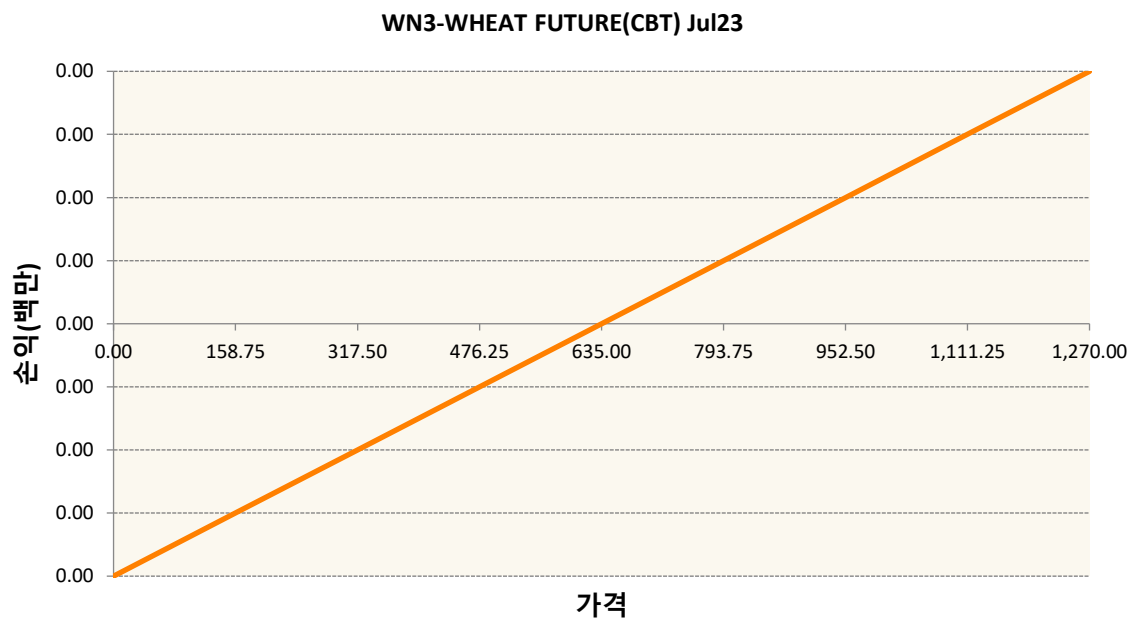
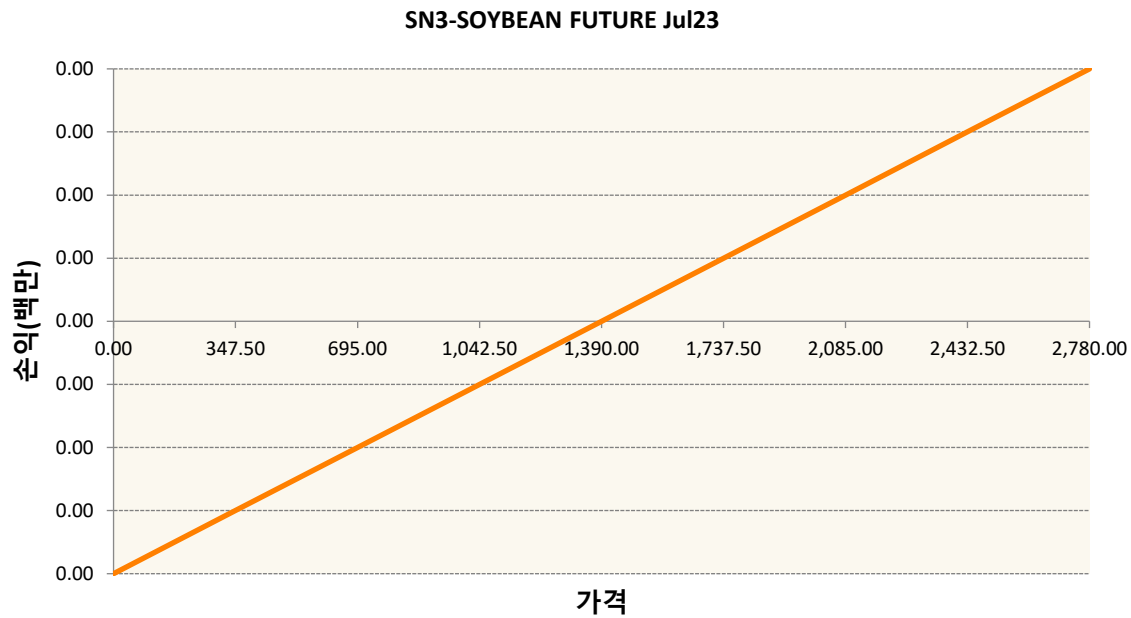


SBN3-Sugar #11 (WORLD) Jul23



SMN3-SOYBEAN MEAL FUTR Jul23





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

공시일	2023-05-16
기준일	2023-05-15

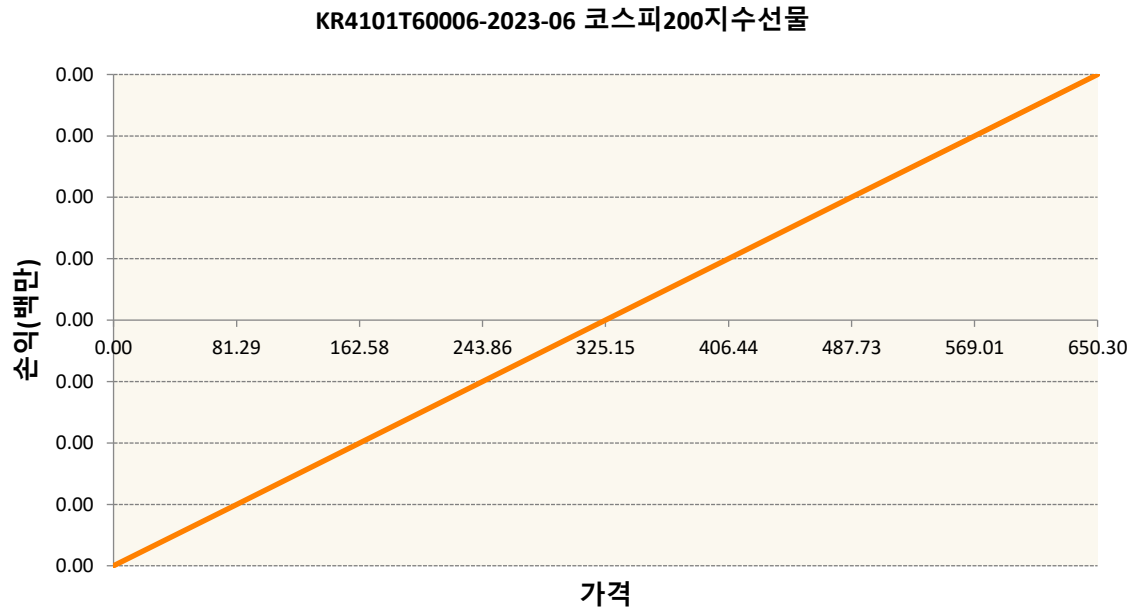
스마트인덱스모

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	2,845	0	2,845	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101T60006			2023-06 코스피200지수선물				227
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-227	-227	-227	-227	-227	-227	-227
-5.33%	-151	-151	-151	-151	-151	-151	-151
-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%	151	151	151	151	151	151	151
8.00%	227	227	227	227	227	227	227

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

(단위:백만원)

242

공시일	2023-05-16
기준일	2023-05-15

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	353
-----------------------------	-----

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

605

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2023-05-16
기준일	2023-05-15

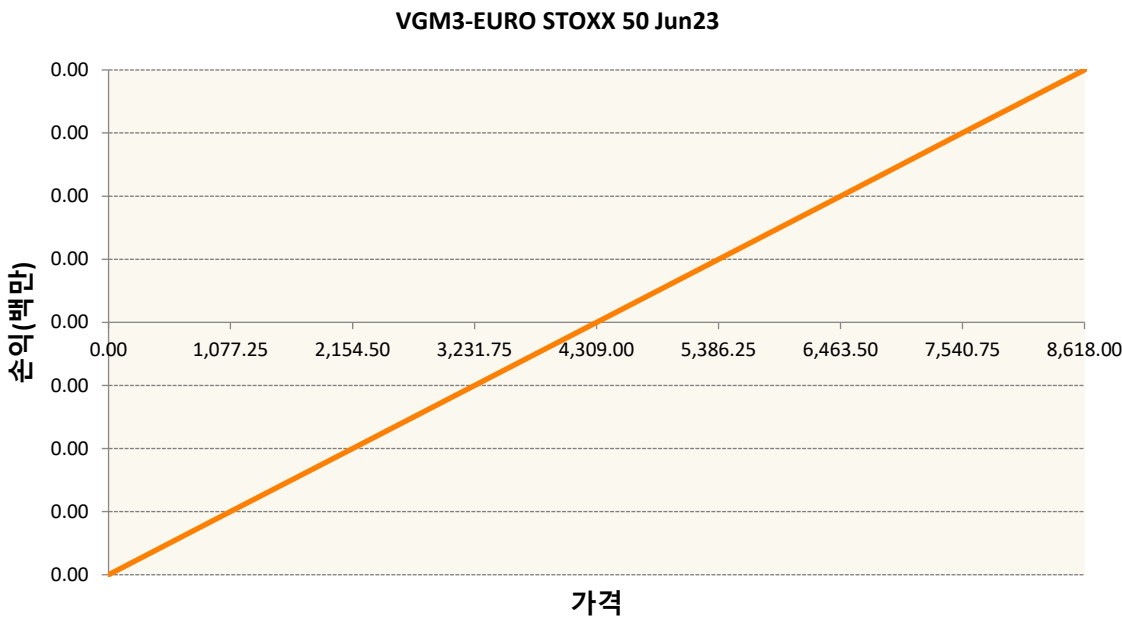
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	424	0	424	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM3 EURO STOXX 50 Jun23

34

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

(단위:백만원)

58

공시일	2023-05-16
기준일	2023-05-15

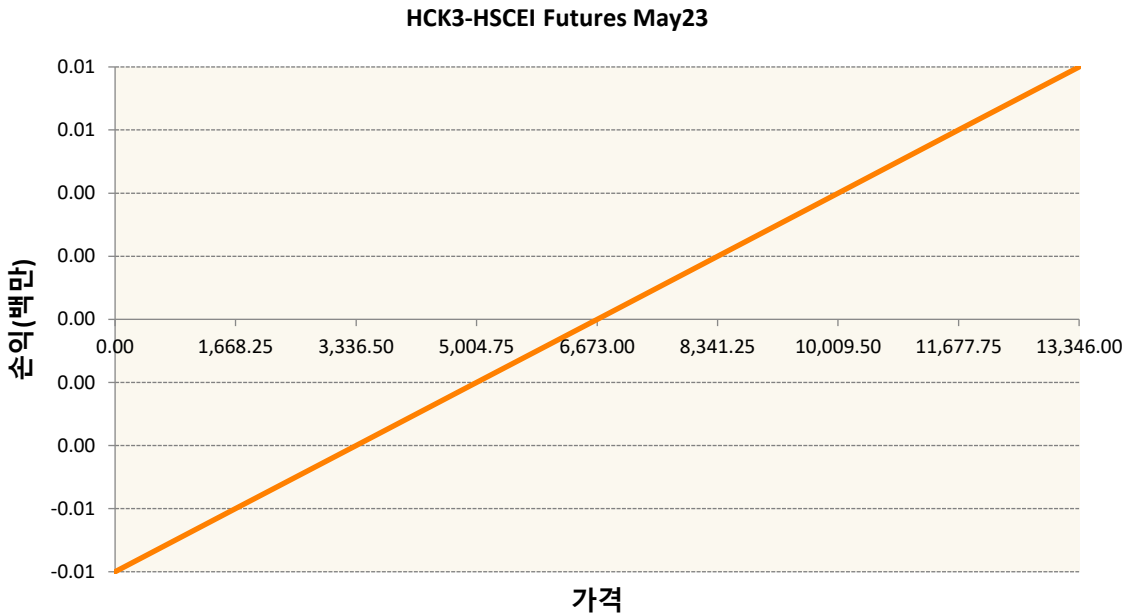
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	908	0	908	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

125

공시일	2023-05-16
기준일	2023-05-15

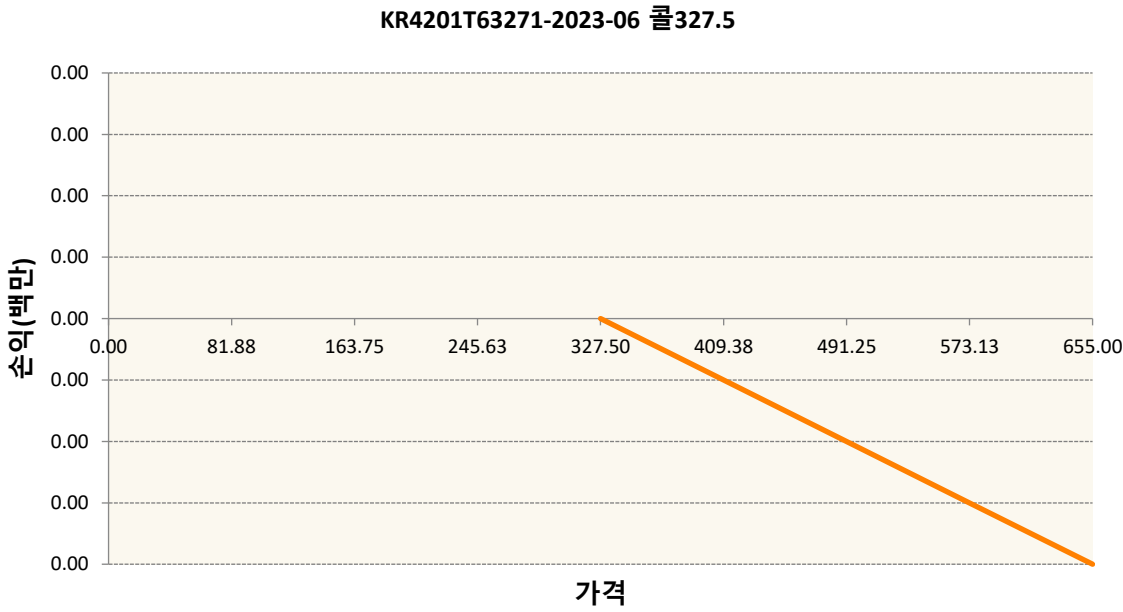
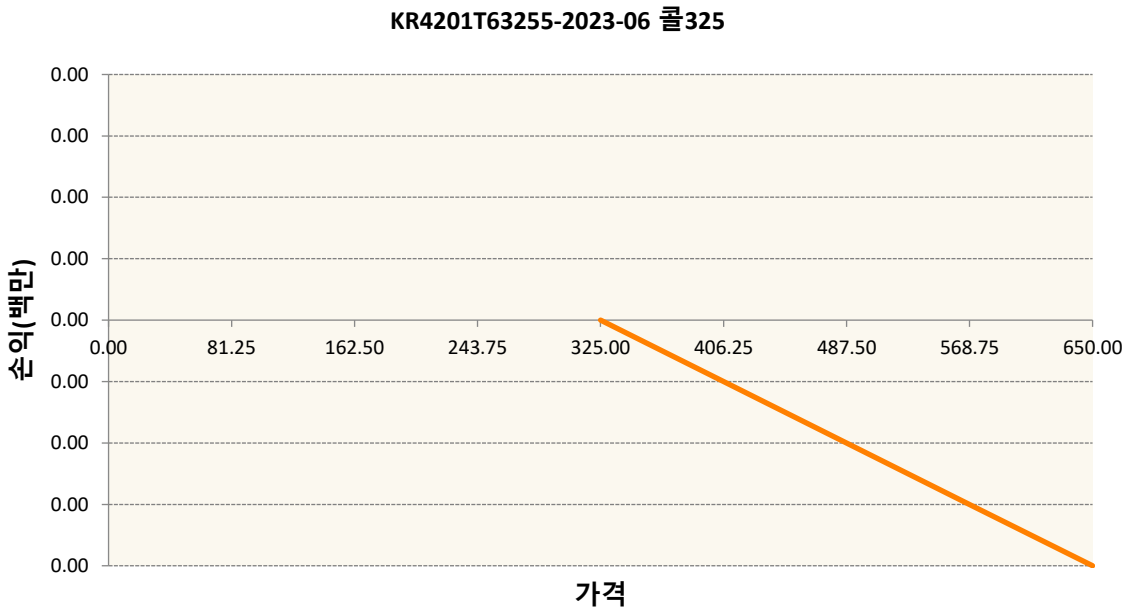
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

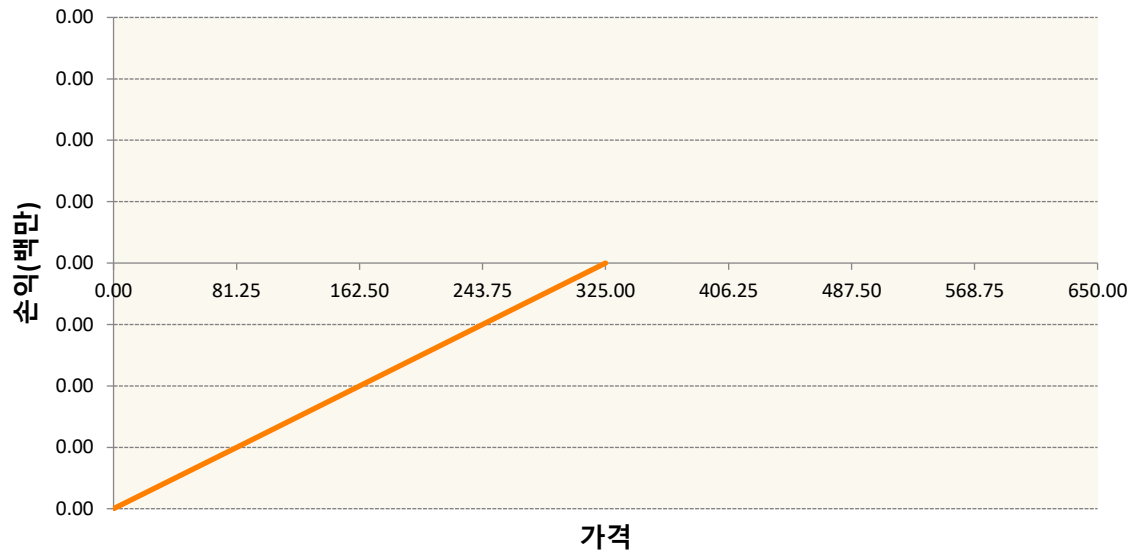
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	54,728	-54,728	장내

2. 만기시점의 손익구조



KR4301T63253-2023-06 풋325



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201T63255			2023-06 콜325				2,428
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	912	896	874	848	817	781	742
-5.33%	841	801	757	708	656	601	543
-2.67%	642	576	508	439	368	296	224
0%	237	158	79	0	-79	-158	-237
2.67%	-406	-475	-547	-619	-693	-768	-843
5.33%	-1,247	-1,293	-1,343	-1,398	-1,457	-1,518	-1,582
8.00%	-2,209	-2,232	-2,261	-2,296	-2,336	-2,380	-2,428
KR4201T63271			2023-06 콜327.5				359
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	121	119	117	113	109	104	99
-5.33%	113	108	102	96	88	81	72
-2.67%	89	80	70	60	50	39	28
0%	36	24	12	0	-12	-24	-37
2.67%	-53	-64	-76	-88	-100	-112	-124
5.33%	-175	-183	-192	-202	-212	-222	-233
8.00%	-320	-324	-330	-336	-343	-351	-359
KR4301T63253			2023-06 풋325				564
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-524	-528	-533	-539	-546	-555	-564
-5.33%	-294	-304	-314	-326	-338	-351	-365
-2.67%	-95	-110	-127	-143	-160	-176	-194
0%	56	37	19	0	-19	-37	-56

2.67%	151	134	117	100	83	65	48
5.33%	199	188	176	163	149	135	120
8.00%	219	213	206	198	189	178	167

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

(단위:백만원)

3,302

공시일	2023-05-16
기준일	2023-05-15

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	2023-05-16
기준일	2023-05-15

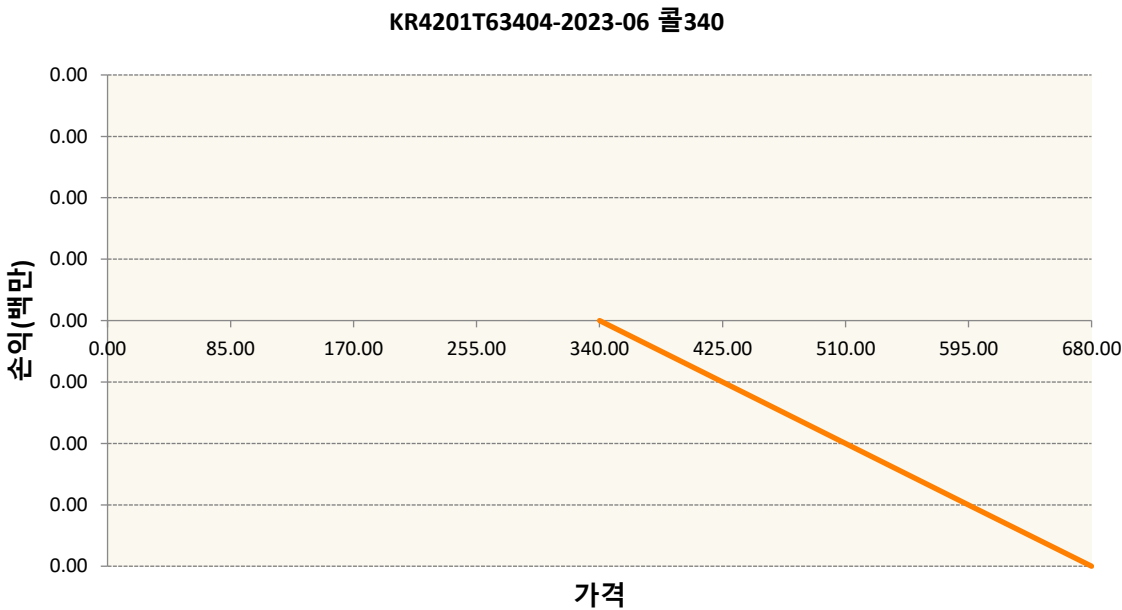
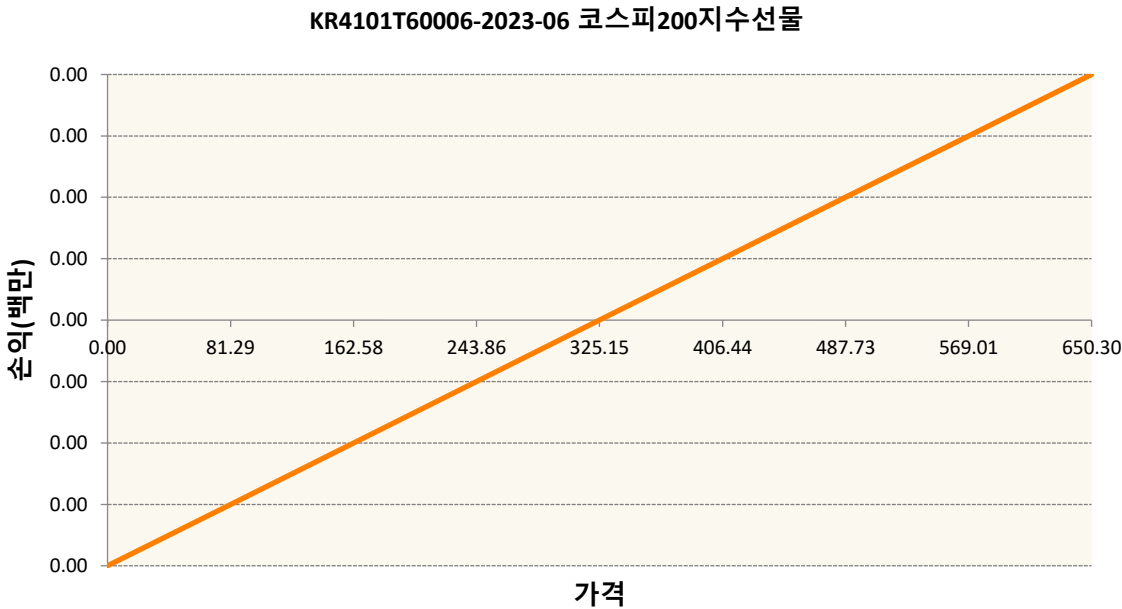
리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

1. 계약금액

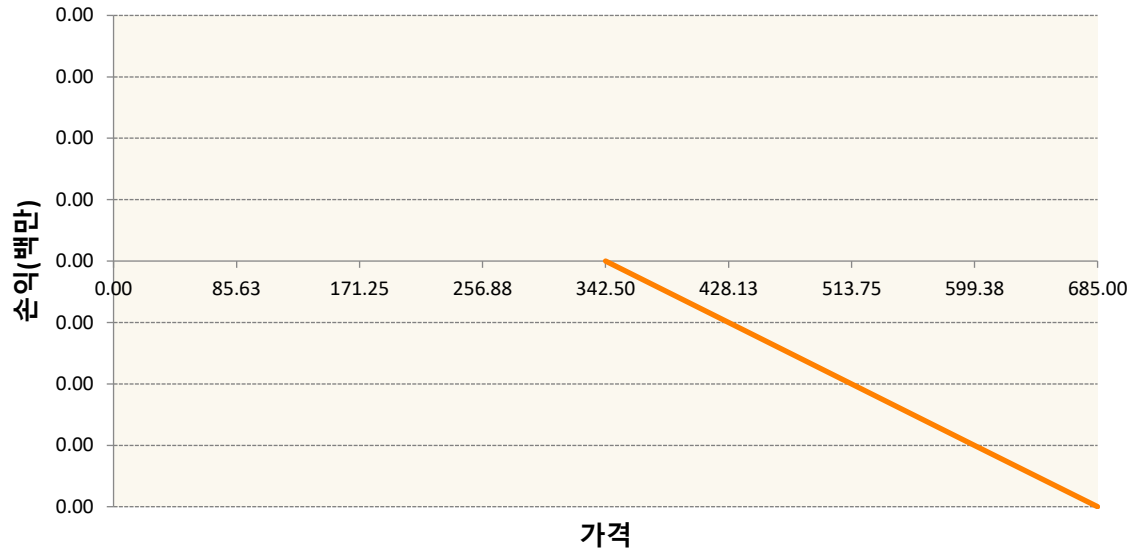
(단위:백만원)

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	488	0	488	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,928	-3,928	장내

2. 만기시점의 손익구조



KR4201T63420-2023-06 콜342.5



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
KR4201T63404		2023-06 콜340					63
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	12	12	11	11	11	10	10
-5.33%	11	11	11	10	9	8	7
-2.67%	10	9	8	7	5	4	2
0%	6	4	2	0	-2	-5	-7
2.67%	-3	-6	-9	-12	-15	-18	-21
5.33%	-21	-24	-27	-30	-33	-36	-39
8.00%	-47	-49	-52	-55	-57	-60	-63
KR4201T63420		2023-06 콜342.5					91
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	15	15	14	14	14	13	12
-5.33%	14	14	14	13	12	10	9
-2.67%	13	12	11	9	7	4	2
0%	8	6	3	0	-3	-7	-10

2.67%	-4	-8	-12	-16	-20	-25	-29
5.33%	-27	-32	-37	-42	-46	-51	-56
8.00%	-64	-68	-72	-77	-82	-86	-91

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

(단위:백만원)

164

공시일	2023-05-16
기준일	2023-05-15

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	6,693	0	6,693	

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	2023-05-16
기준일	2023-05-15

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	4,890	0	4,890	

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	2023-05-16
기준일	2023-05-15

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	18,624	0	18,624	
누계	통화	선도	669	19,353	-18,685	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
FXW213D2Q KRW/USD 31-05-23E		721
FXW213D3Q KRW/USD 28-06-23E		519
FXW213D4S(KRW/USD 31-07-23E		266
FXW213D52(USD/KRW 31-05-23E		53
FXW213D5A KRW/USD 31-05-23E		43
IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	3,488

공시일	2023-05-16
기준일	2023-05-15

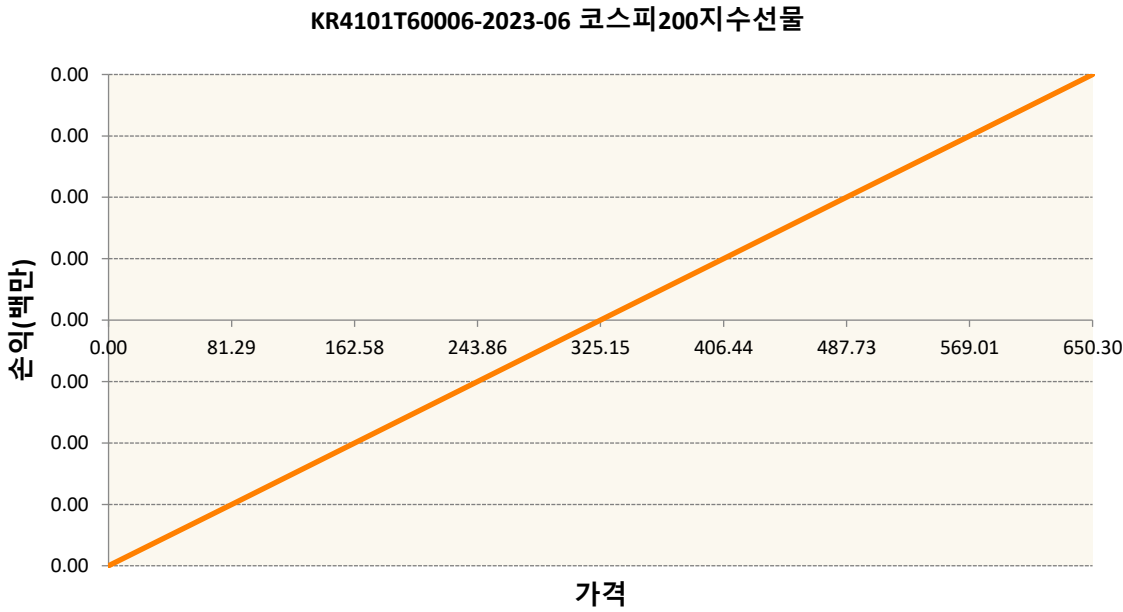
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

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	1,219	0	1,219	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101T60006			2023-06 코스피200지수선물				97
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-97	-97	-97	-97	-97	-97	-97
-5.33%	-65	-65	-65	-65	-65	-65	-65
-2.67%	-32	-32	-32	-32	-32	-32	-32
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	32	32	32	32	32	32	32
5.33%	65	65	65	65	65	65	65
8.00%	97	97	97	97	97	97	97

공시일	2023-05-16
기준일	2023-05-15

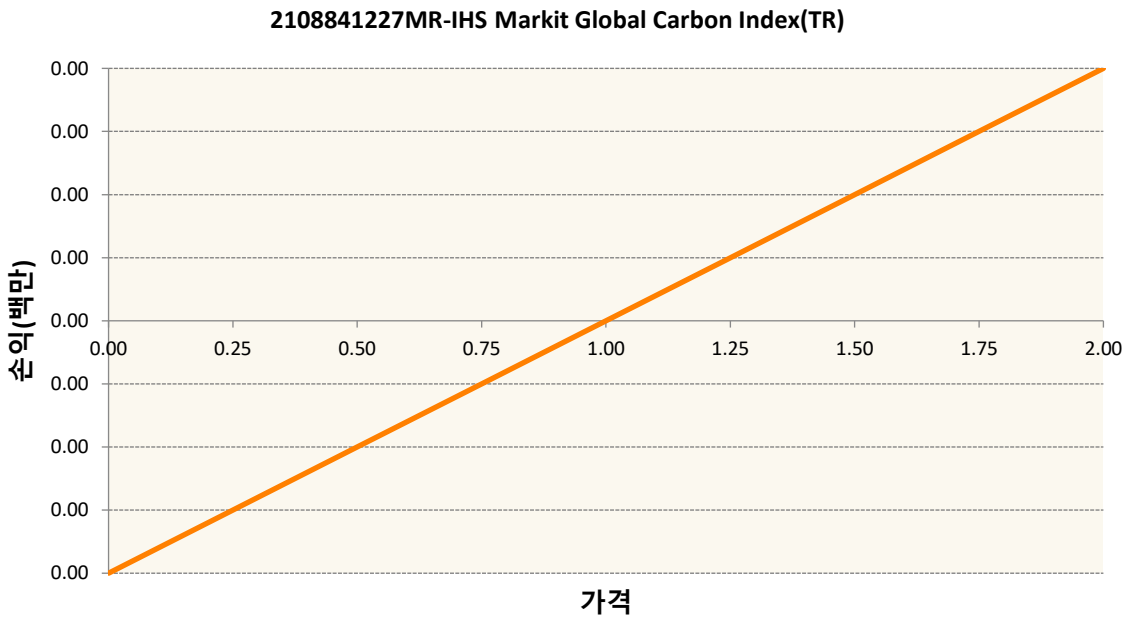
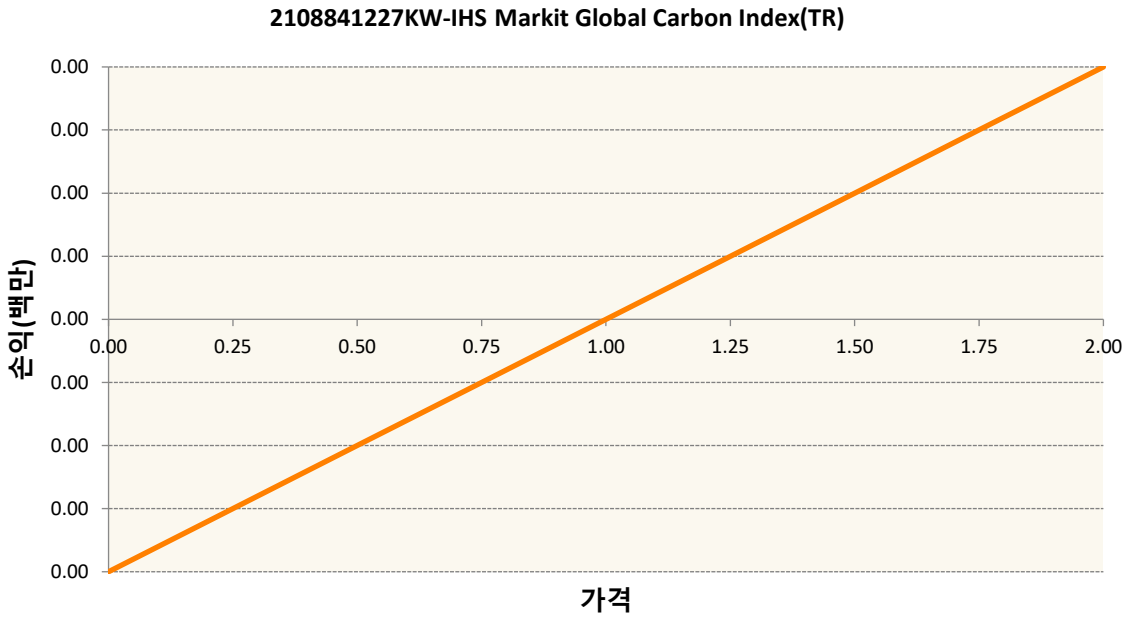
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

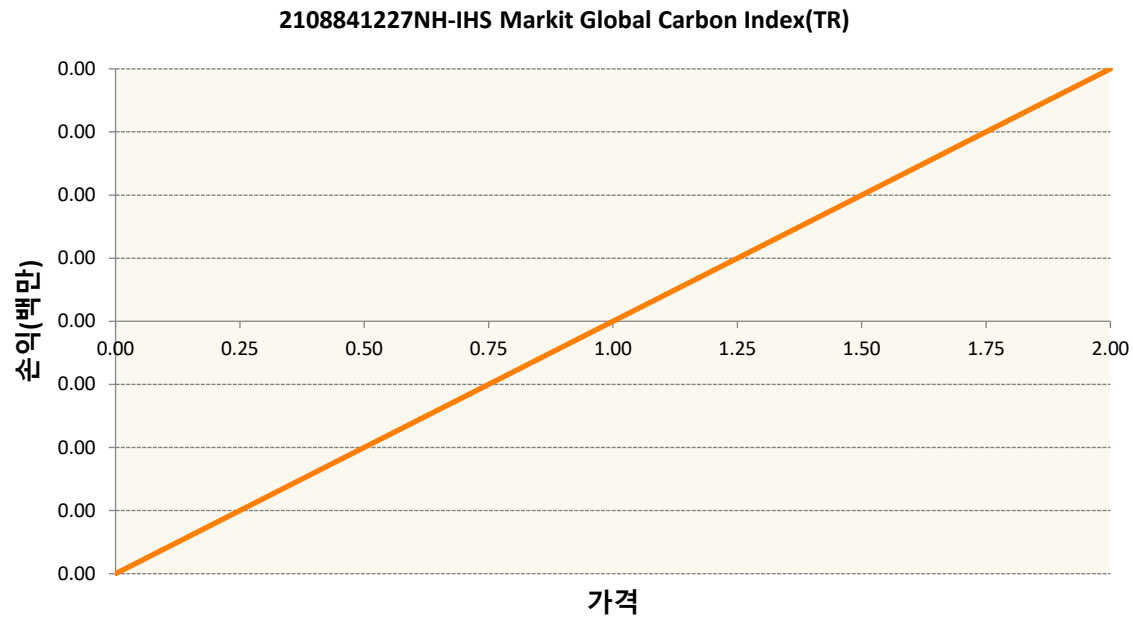
1. 계약금액

(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)		1,761
2108841227IHS Markit Global Carbon Index(TR)		207
2108841227IHS Markit Global Carbon Index(TR)		104

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)		(단위:백만원)
		3,552

공시일	2023-05-16
기준일	2023-05-15

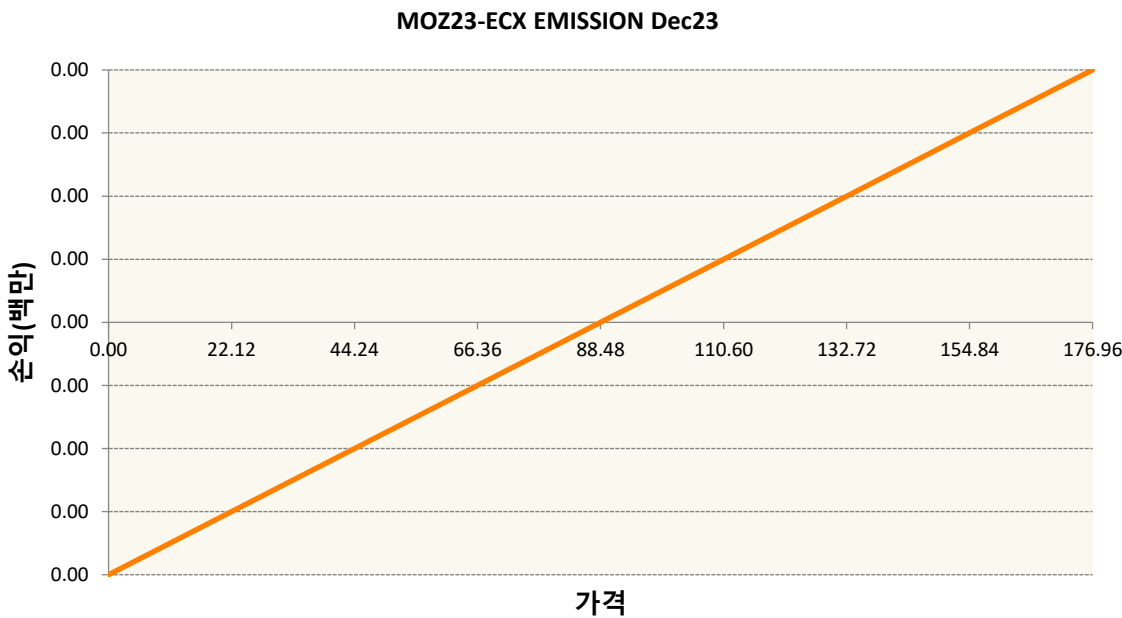
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	8,841	0	8,841	
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	707

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

(단위:백만원)

1,353

공시일	2023-05-16
기준일	2023-05-15

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)	13
SWCSI00000 신한CSI Index 221222 (키움)	15
SWCSI00000 신한CSI Index 221222 (미래)	15
SWCSI00000 신한CSI Index 221222 (메리츠)	15

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

(단위:백만원)

98

공시일	2023-05-16
기준일	2023-05-15

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)	5
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 230116(메리츠)	7
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 230116(미래)	6
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 230427(키움)	3

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

(단위:백만원)

37

공시일	2023-05-16
기준일	2023-05-15

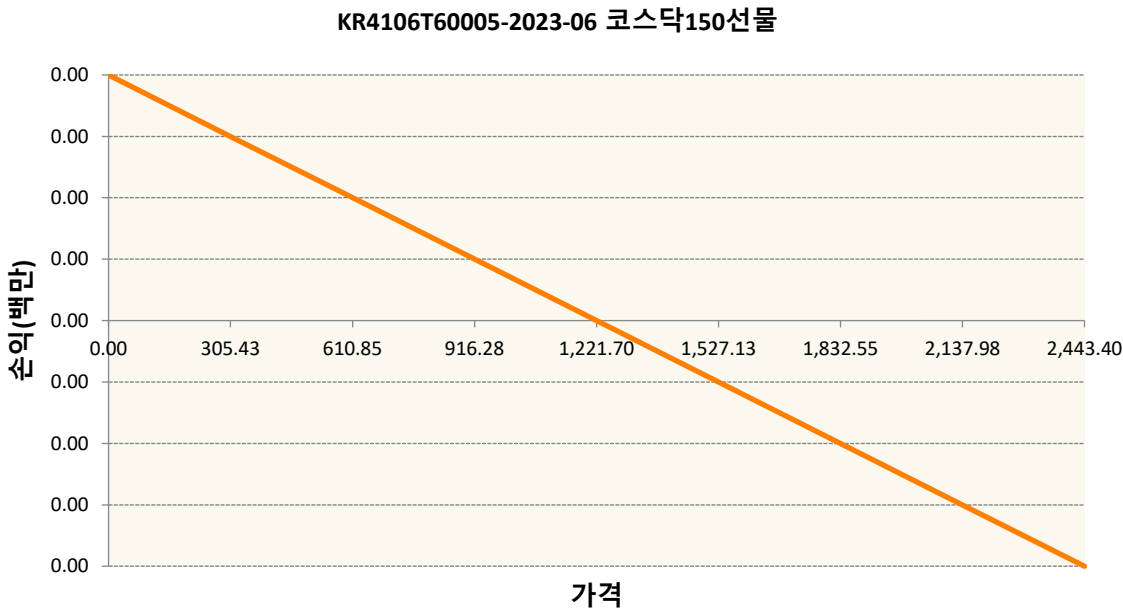
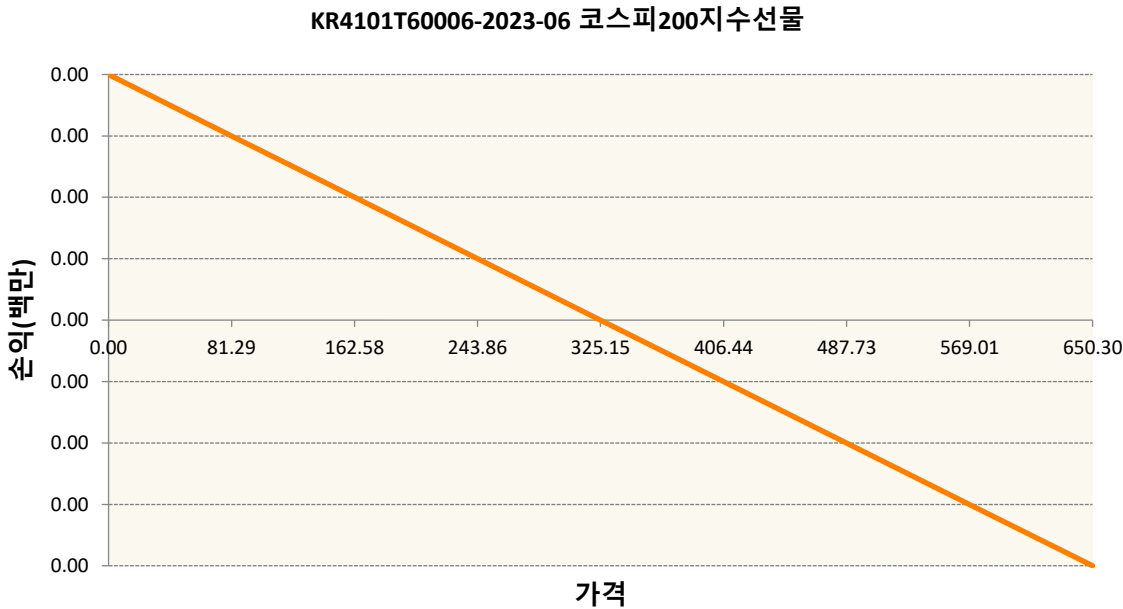
에쿼티알파일반사모혼합자산

1. 계약금액

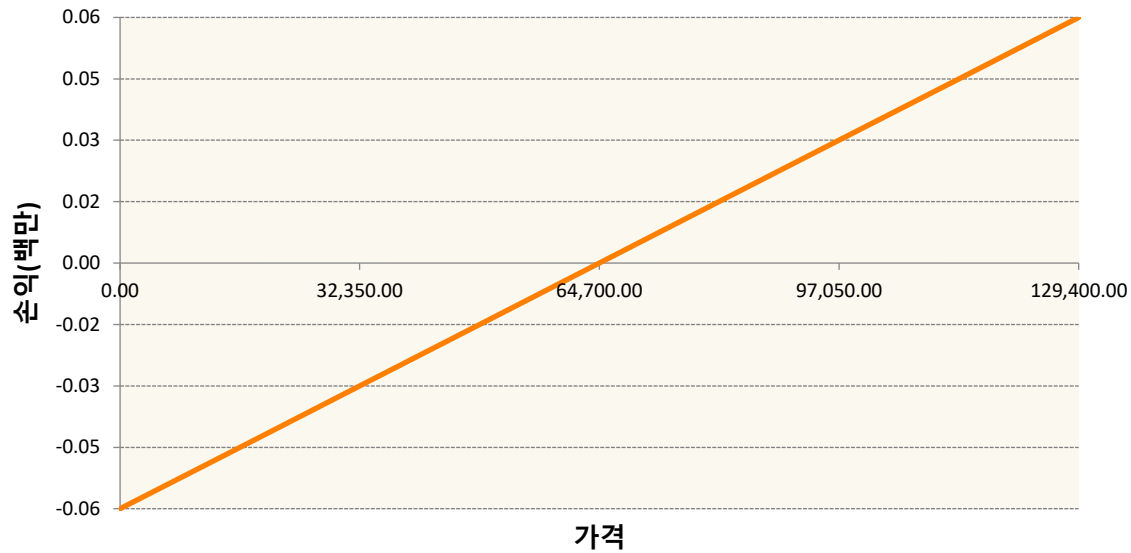
(단위:백만원)

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	1,074	3,254	-2,180	장내
누계	유가증권	스왑	0	0	0	장외

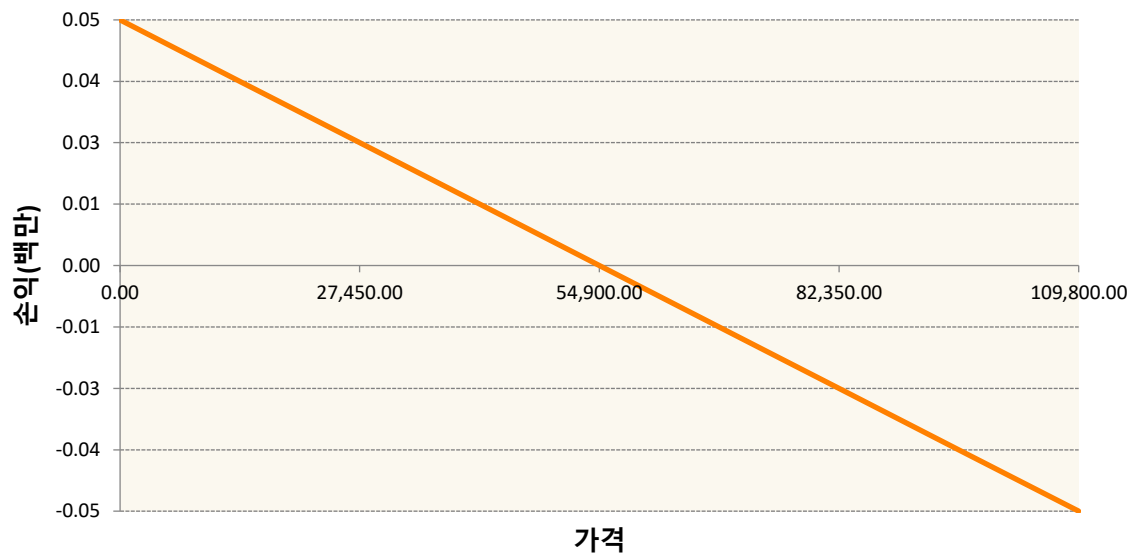
2. 만기시점의 손익구조



KR4111T60005-2023-06 삼성전자개별선물



KR41F7T60007-2023-06 카카오페이개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101T600 2023-06 코스피200지수선물	176
KR4106T600 2023-06 코스닥150선물	78
KR4111T600 2023-06 삼성전자개별선물	86
KR41F7T600 2023-06 카카오페이개별선물	7
KRS0004099 SWAP_MICRON TECH_0308	0.27
KRS0004212 SWAP_SPDR S&P BIOTECH_0413	1

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

(단위:백만원)

595

공시일	2023-05-16
기준일	2023-05-15

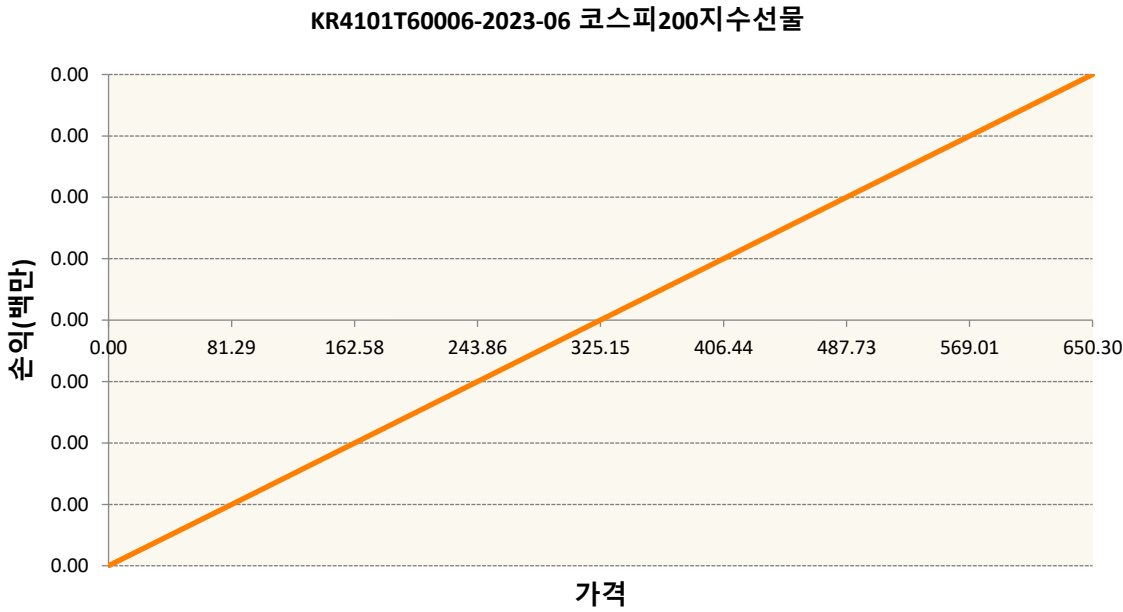
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	406	0	406	장내
누계	유가증권	선물	1,544	0	1,544	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101T60006		2023-06 코스피200지수선물					123
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-123	-123	-123	-123	-123	-123	-123
-5.33%	-82	-82	-82	-82	-82	-82	-82
-2.67%	-41	-41	-41	-41	-41	-41	-41
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	41	41	41	41	41	41	41
5.33%	82	82	82	82	82	82	82
8.00%	123	123	123	123	123	123	123

공시일	2023-05-16
기준일	2023-05-15

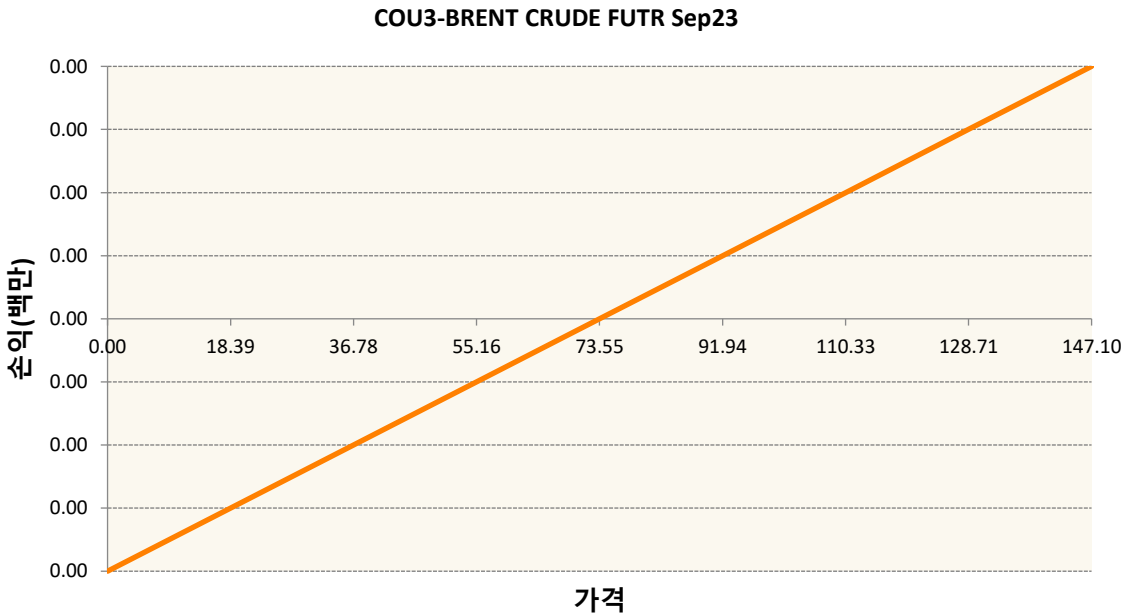
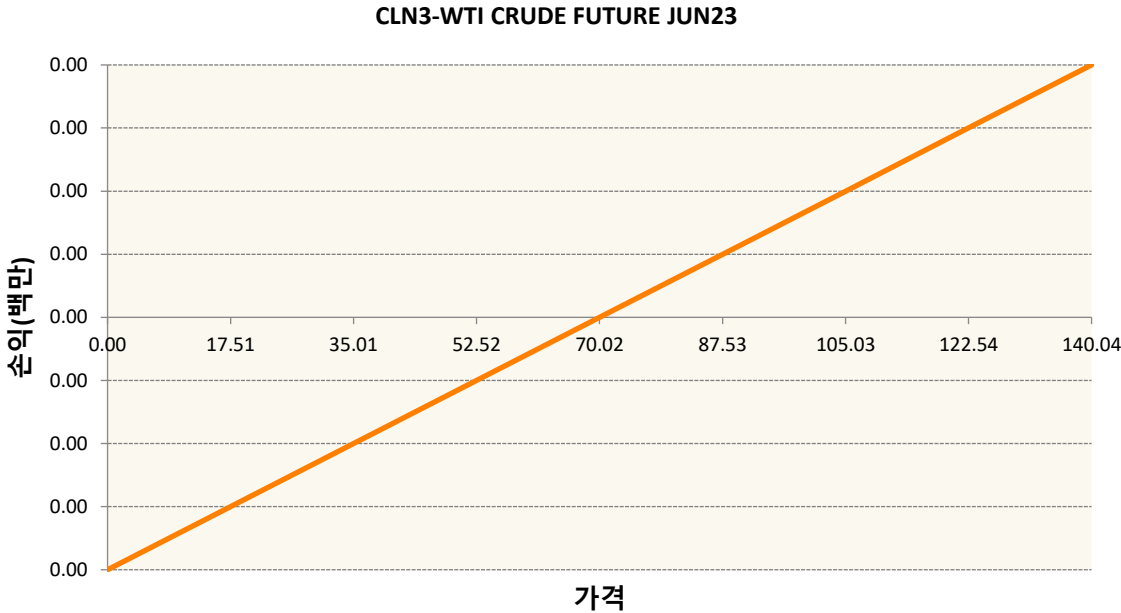
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

1. 계약금액

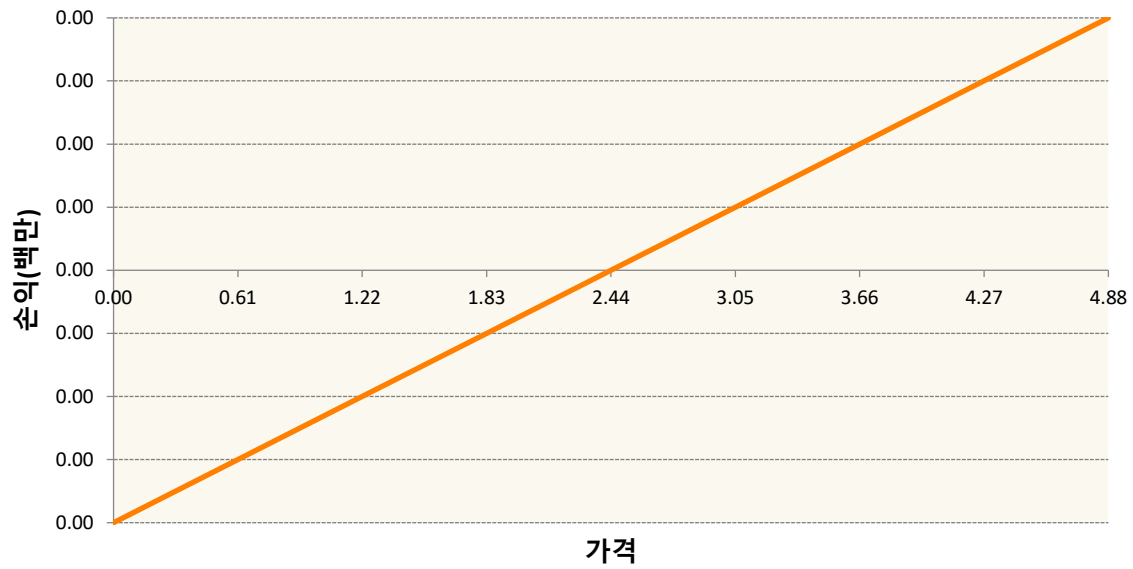
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,279	160	1,119	

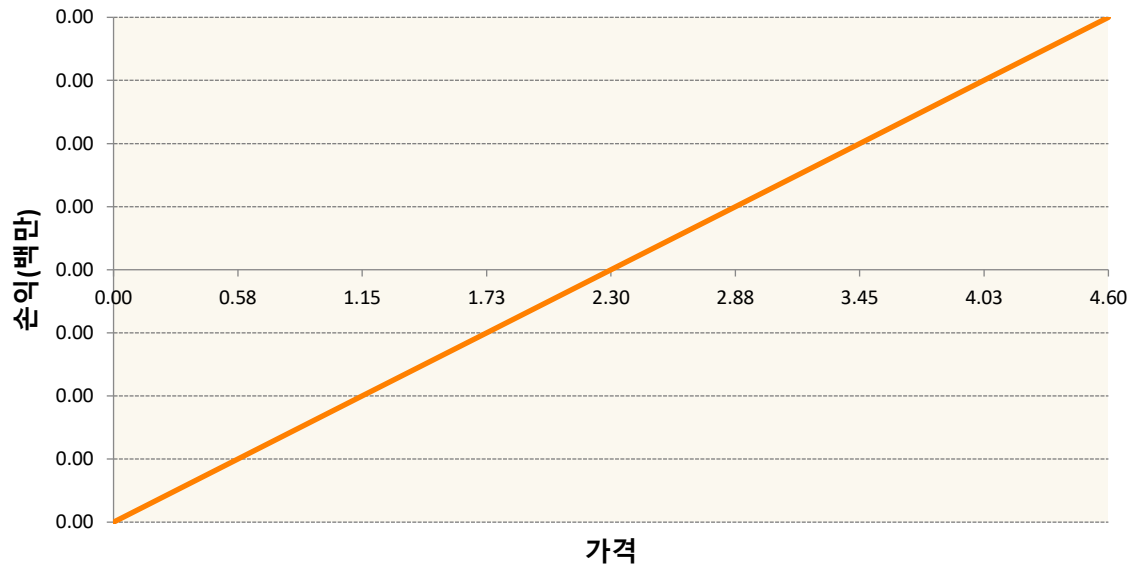
2. 만기시점의 손익구조



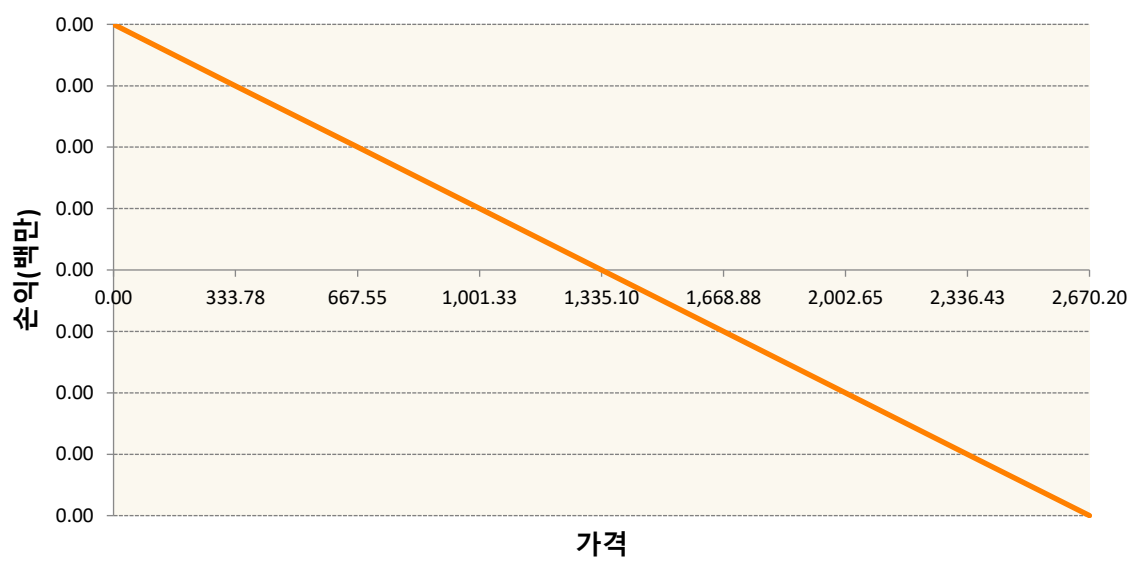
EON3-E-MINI NATURAL GAS JUL23



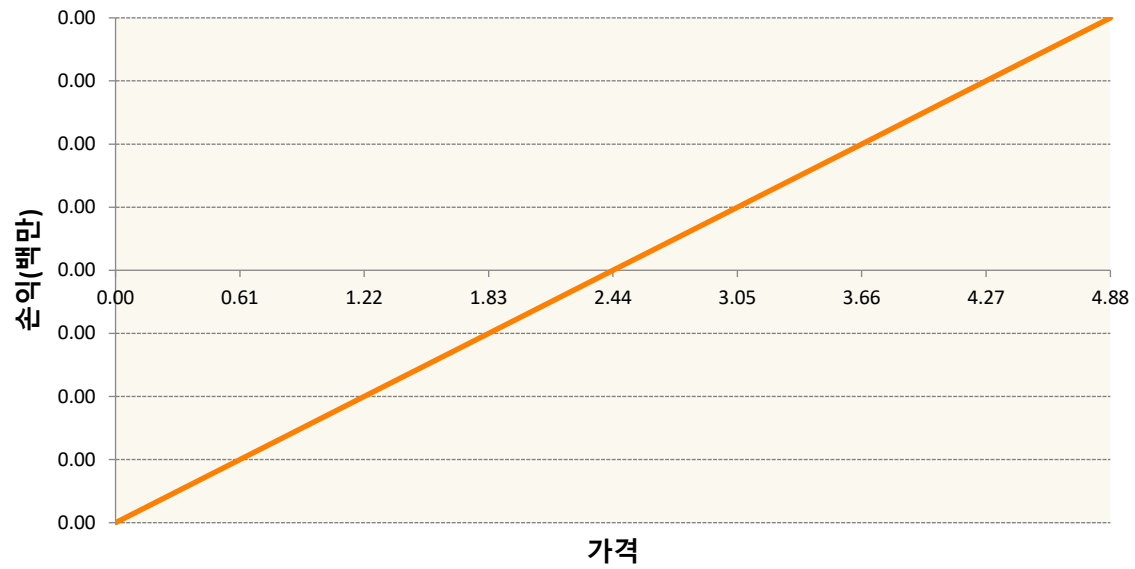
HON3-NY Harb ULSD Fut Jul23



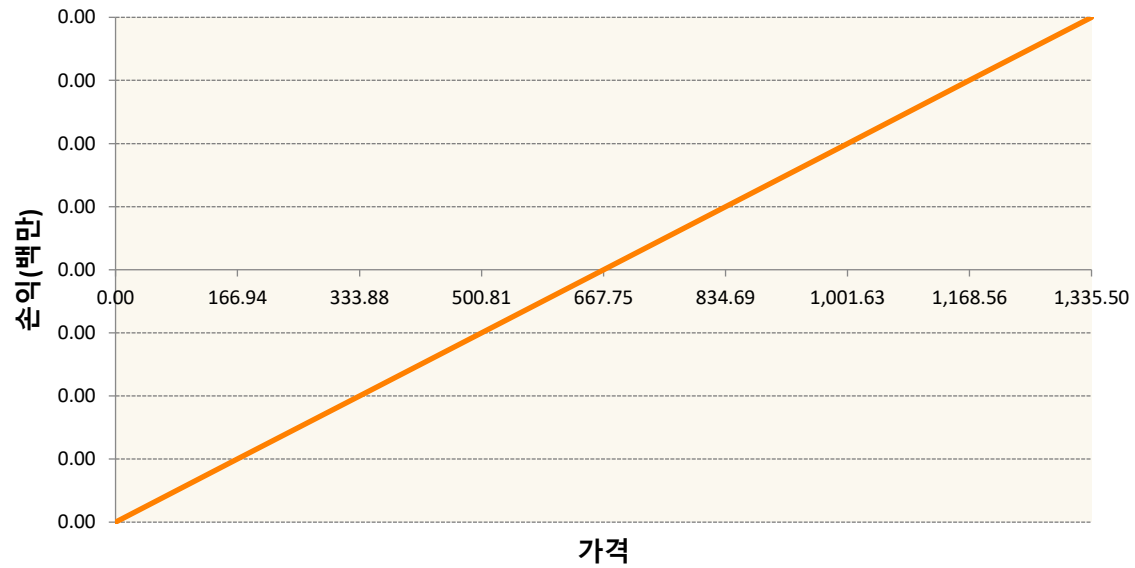
KR4175T60000-2023-06 달러선물



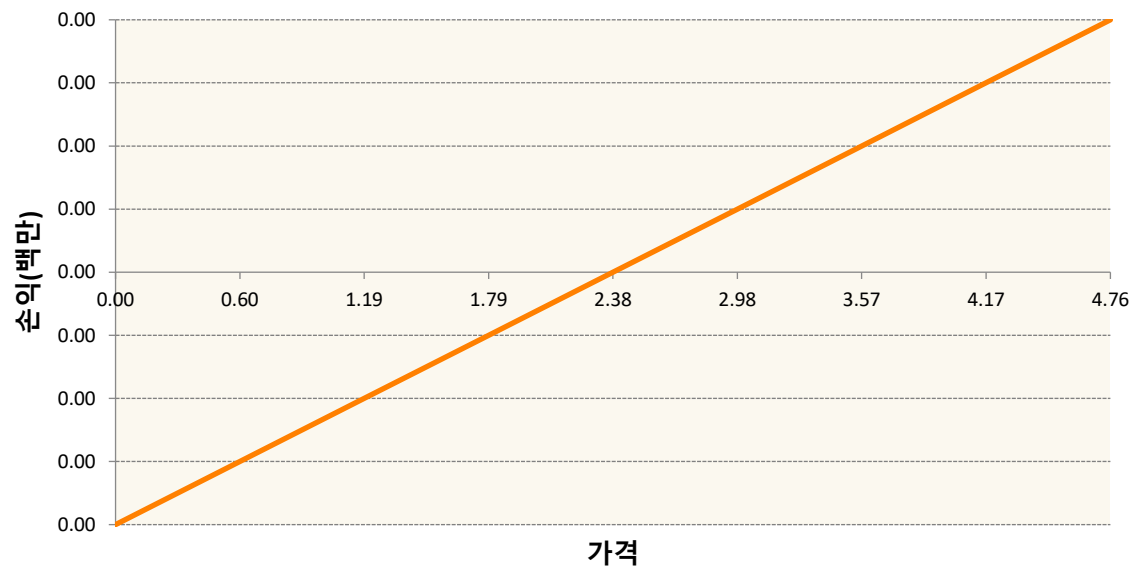
NGN23-NATURAL GAS FUTR JUL23



QSN3-Low Su Gasoil G JUL23



XBN3-GASOLINE RBOB FUT JUL23



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLN3	WTI CRUDE FUTURE JUN23	22
COU3	BRENT CRUDE FUTR Sep23	31
EON3	E-MINI NATURAL GAS JUL23	1
HON3	NY Harb ULSD Fut Jul23	10
KR4175T600	2023-06 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)

197