

공시일	2023-05-23
기준일	2023-05-22

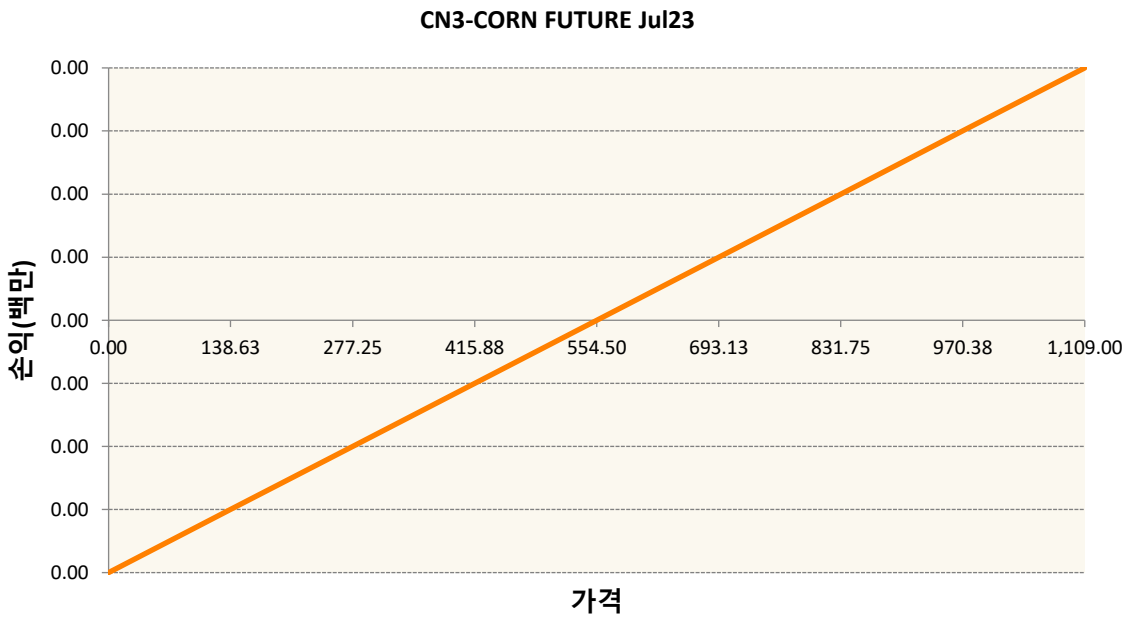
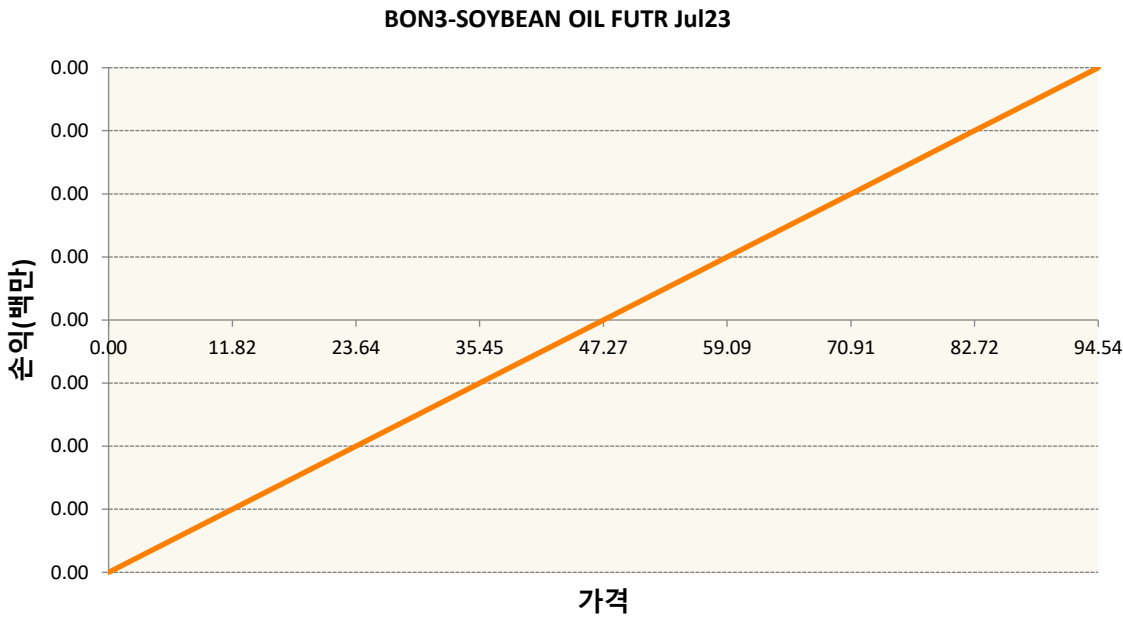
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

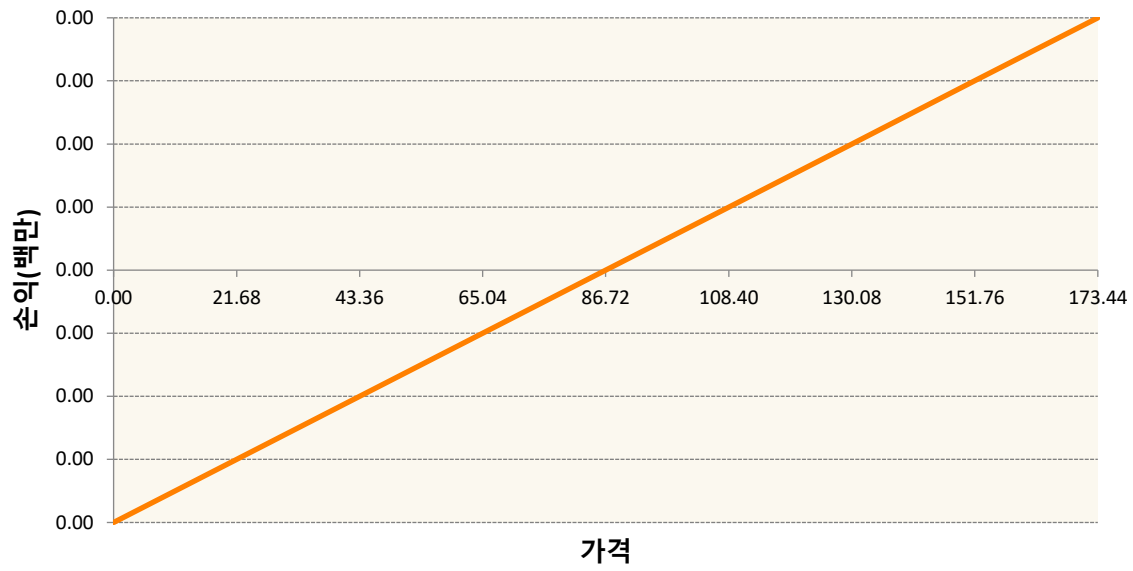
(단위:USD 백만)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,157	527	4,630	

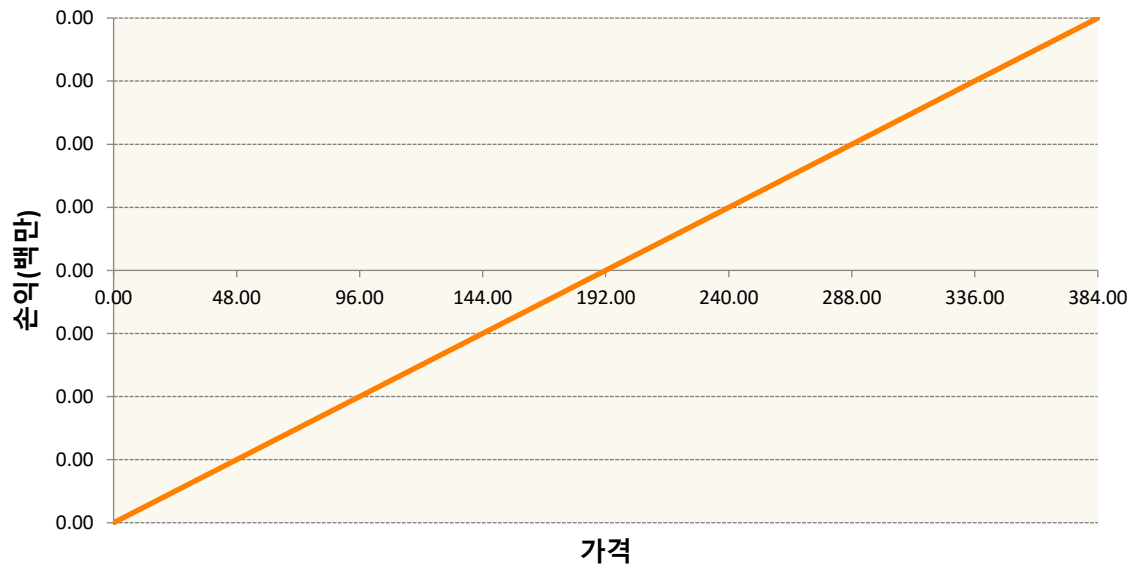
2. 만기시점의 손익구조



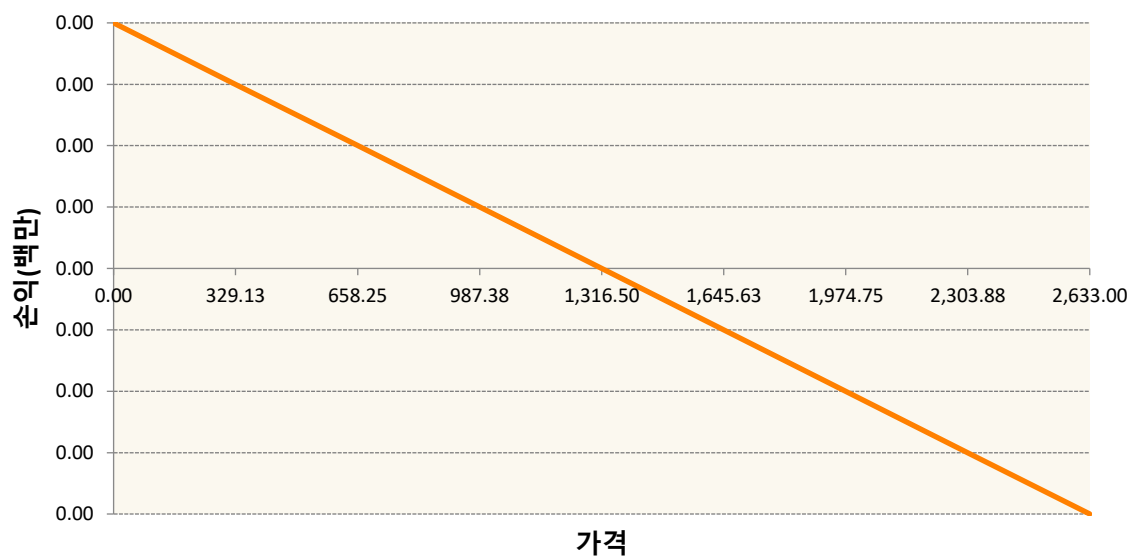
CTN3-COTTON NO.2 FUTR Jul23



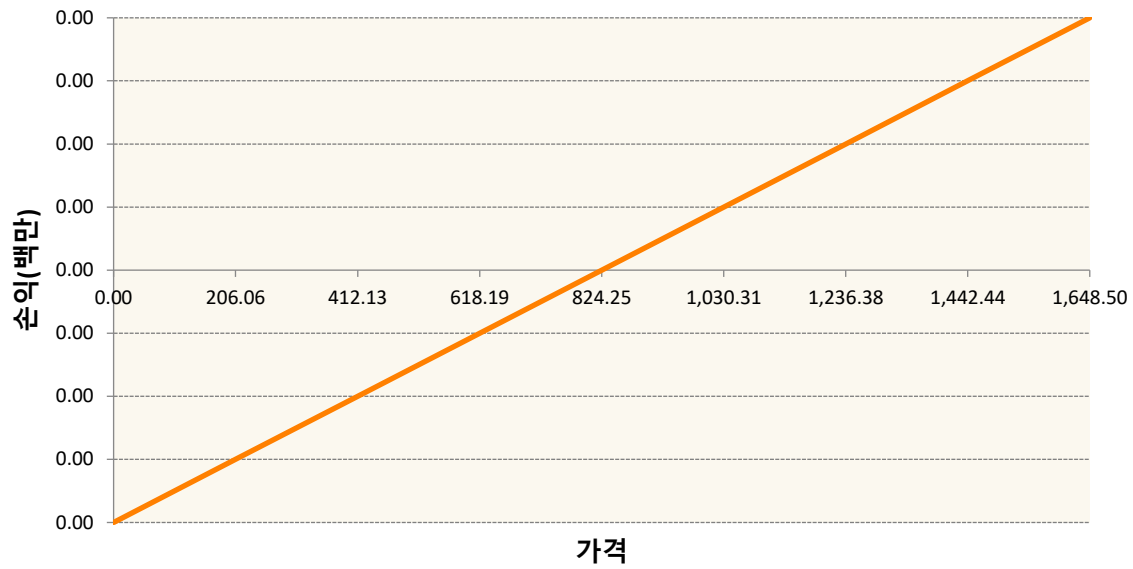
KCN3-COFFEE 'C' FUTURE Jul23



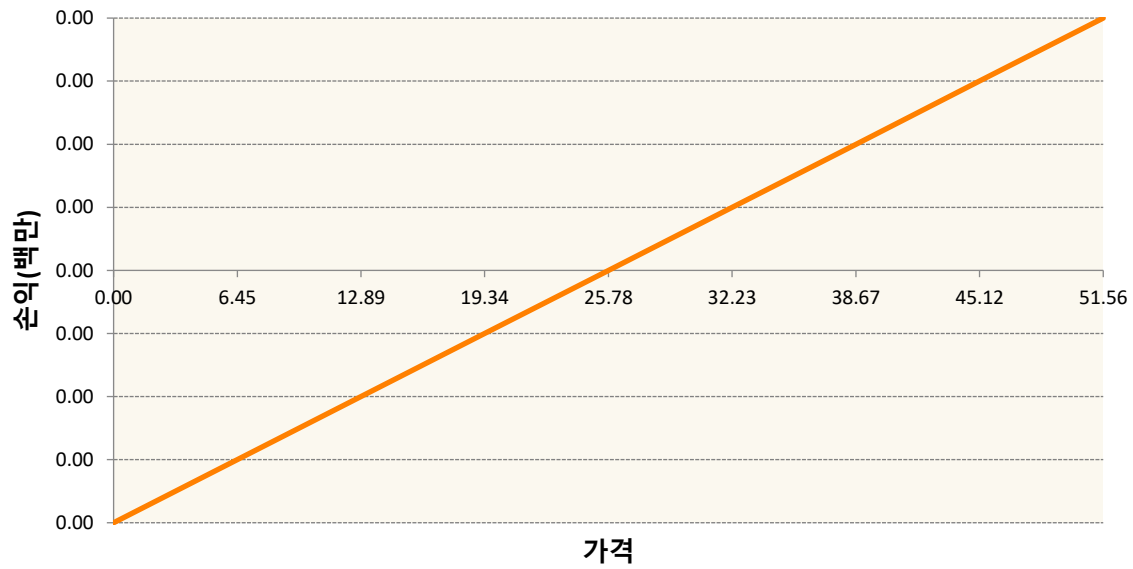
KR4175T60000-2023-06 달러선물



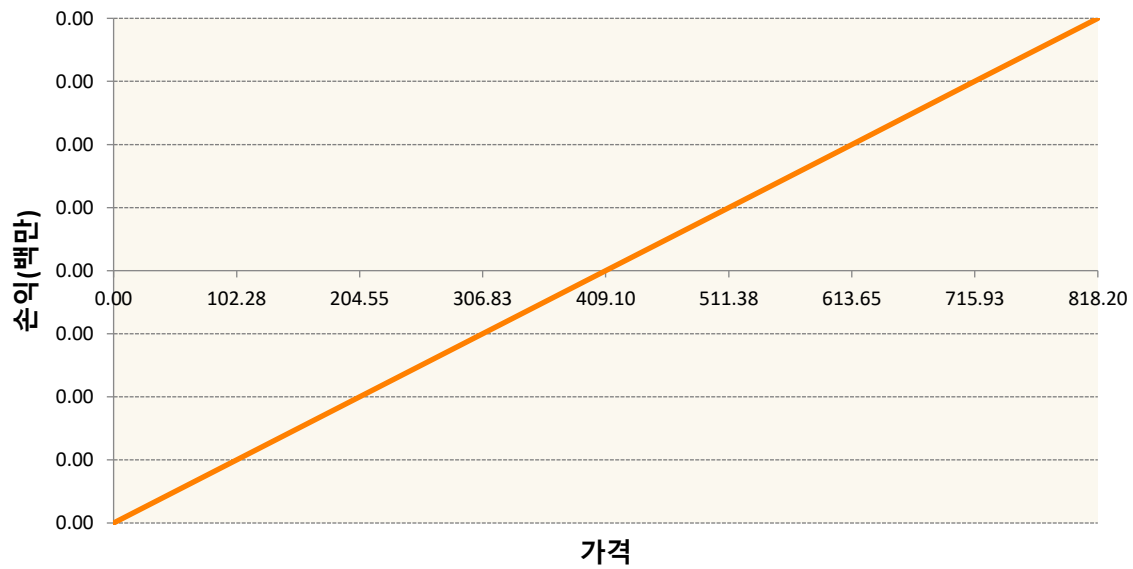
KWN3-KC HRW WHEAT FUT Jul23

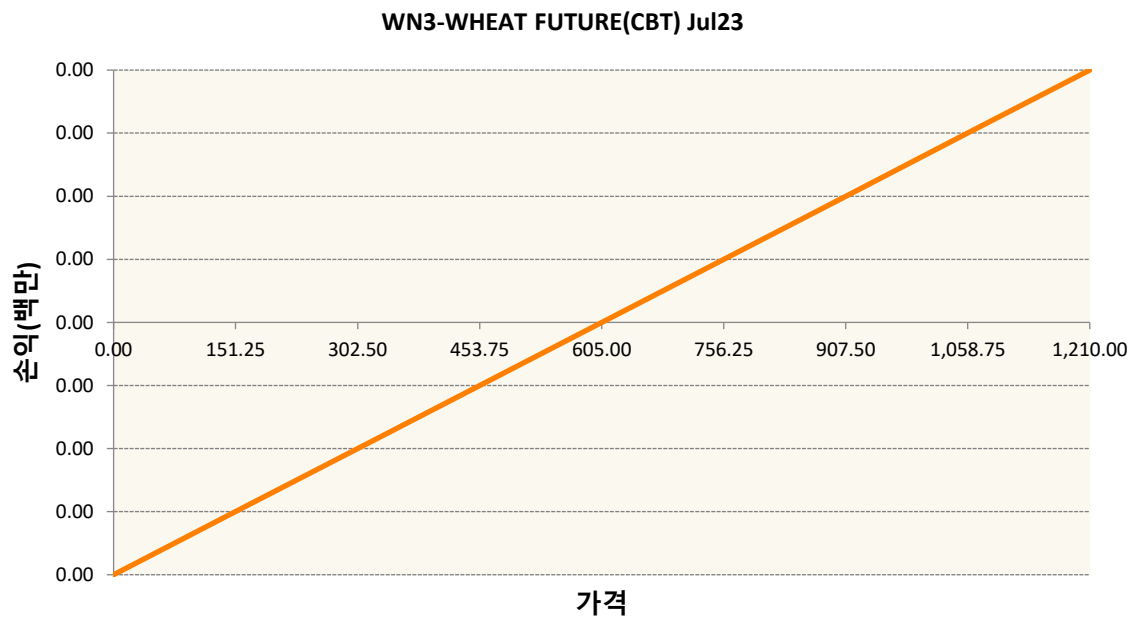
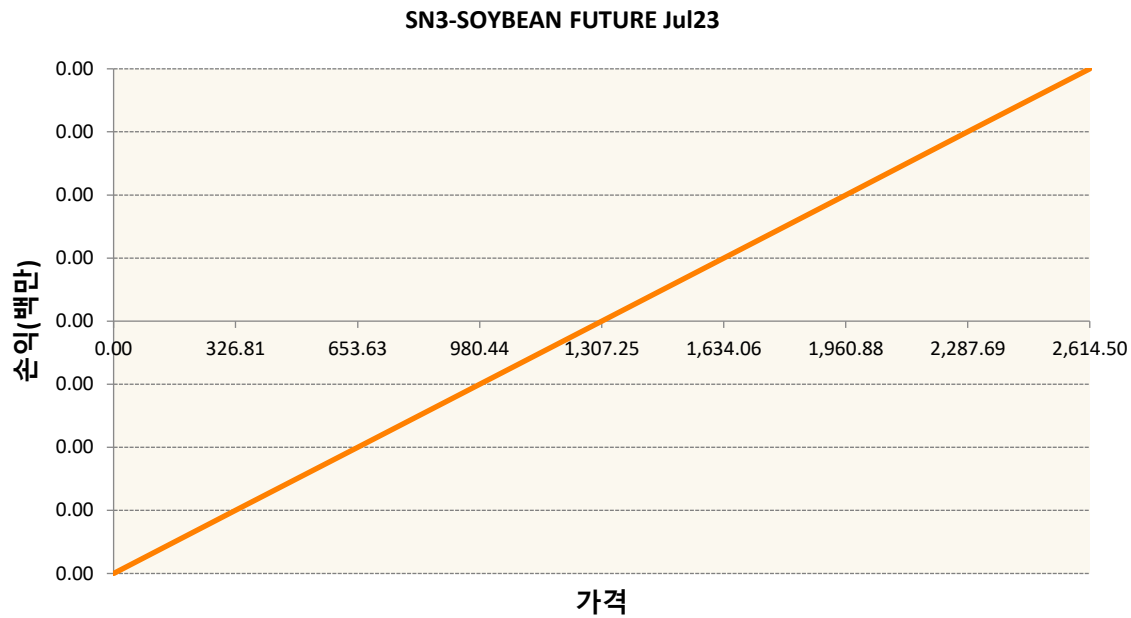


SBN3-Sugar #11 (WORLD) Jul23



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	2023-05-23
기준일	2023-05-22

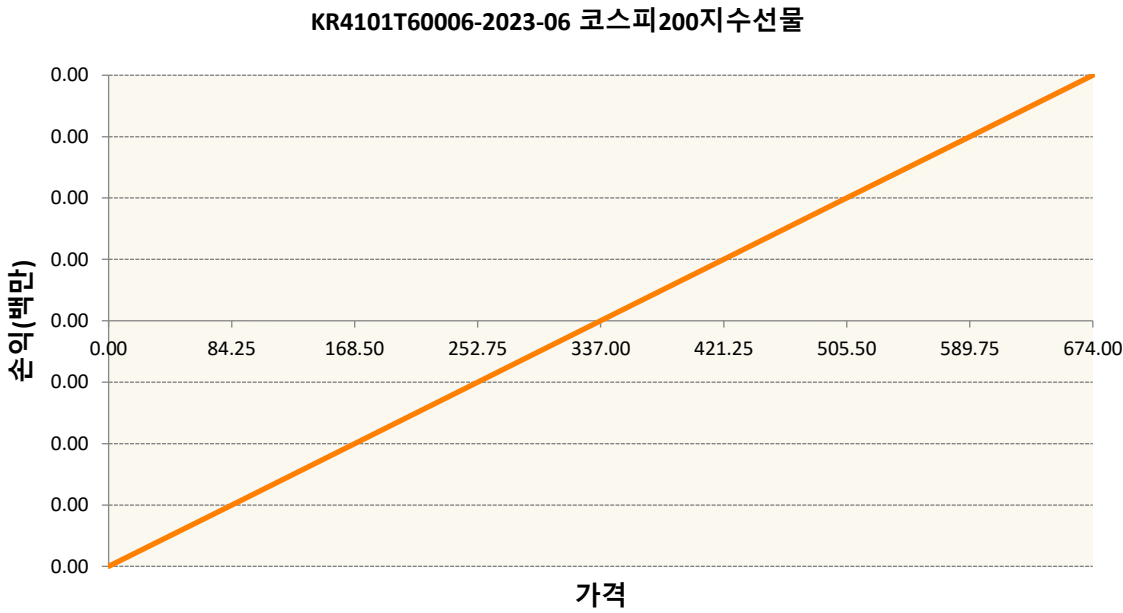
스마트인덱스모

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	337	-337	장내
누계	유가증권	선물	2,022	0	2,022	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101T60006			2023-06 코스피200지수선물				161
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-161	-161	-161	-161	-161	-161	-161
-5.33%	-108	-108	-108	-108	-108	-108	-108
-2.67%	-54	-54	-54	-54	-54	-54	-54
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	54	54	54	54	54	54	54
5.33%	108	108	108	108	108	108	108
8.00%	161	161	161	161	161	161	161

공시일	2023-05-23
기준일	2023-05-22

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

350

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

599

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2023-05-23
기준일	2023-05-22

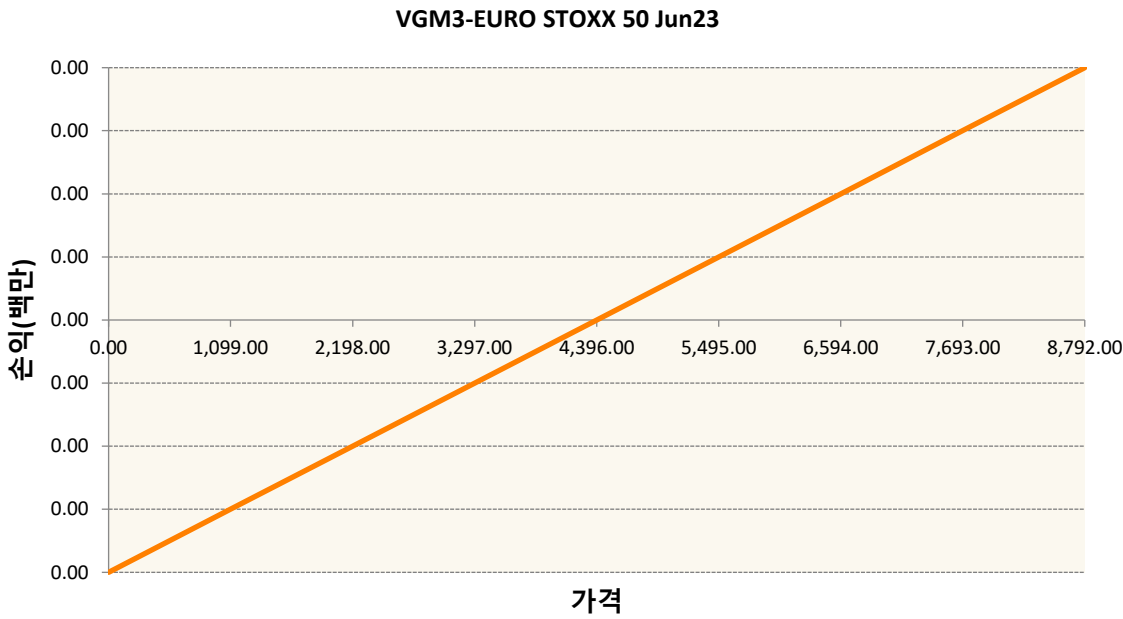
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	432	0	432	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM3	EURO STOXX 50 Jun23	35
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

59

공시일	2023-05-23
기준일	2023-05-22

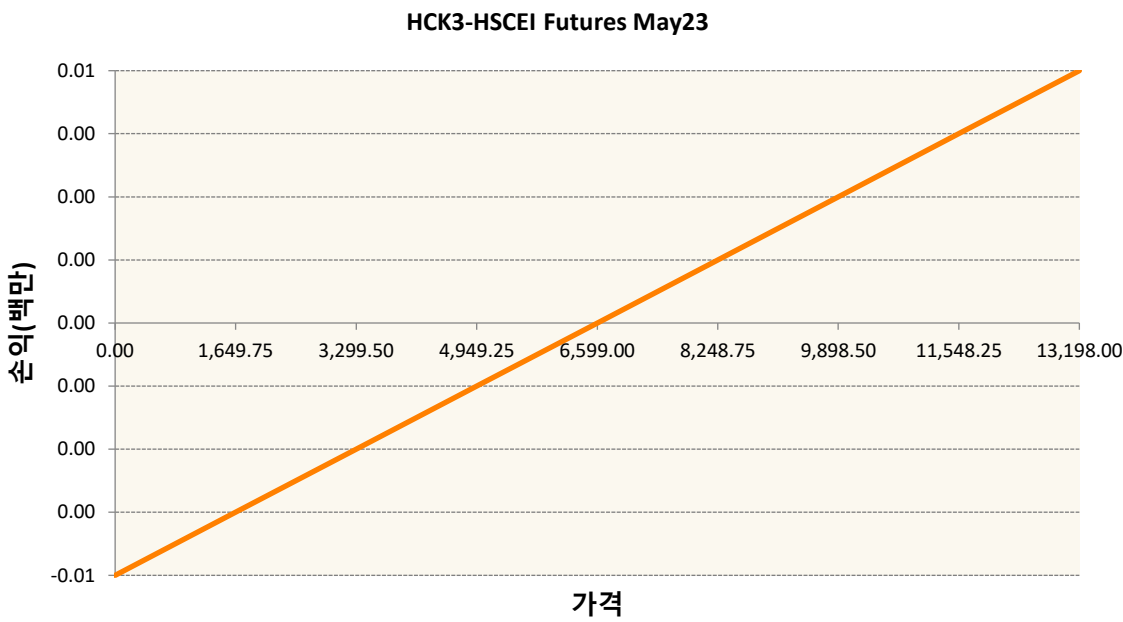
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	842	0	842	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCK3	HSCEI Futures May23	67
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

115

공시일	2023-05-23
기준일	2023-05-22

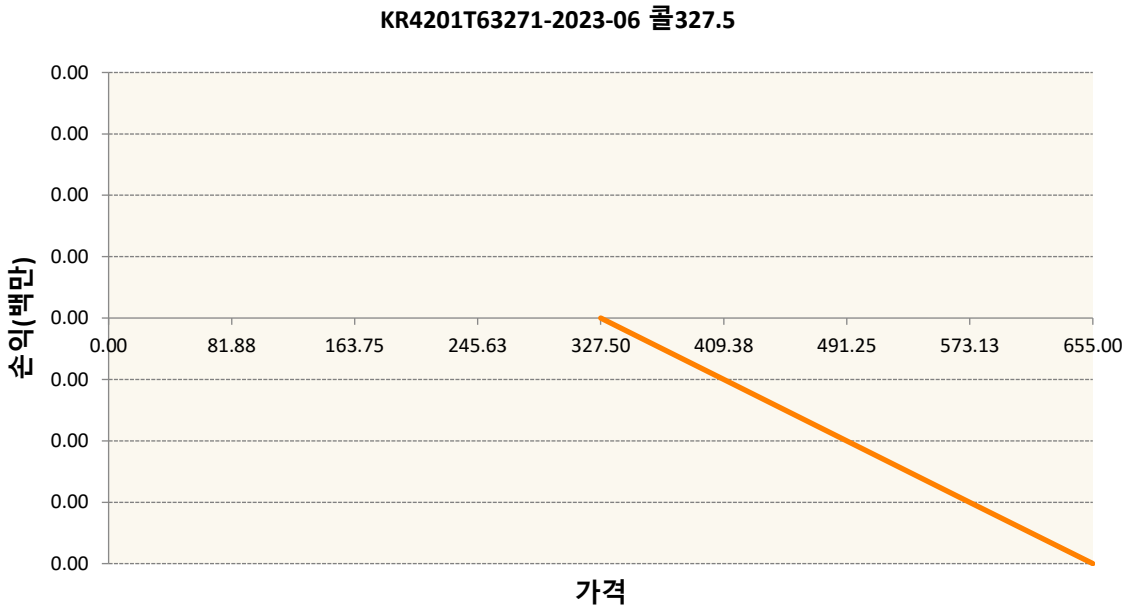
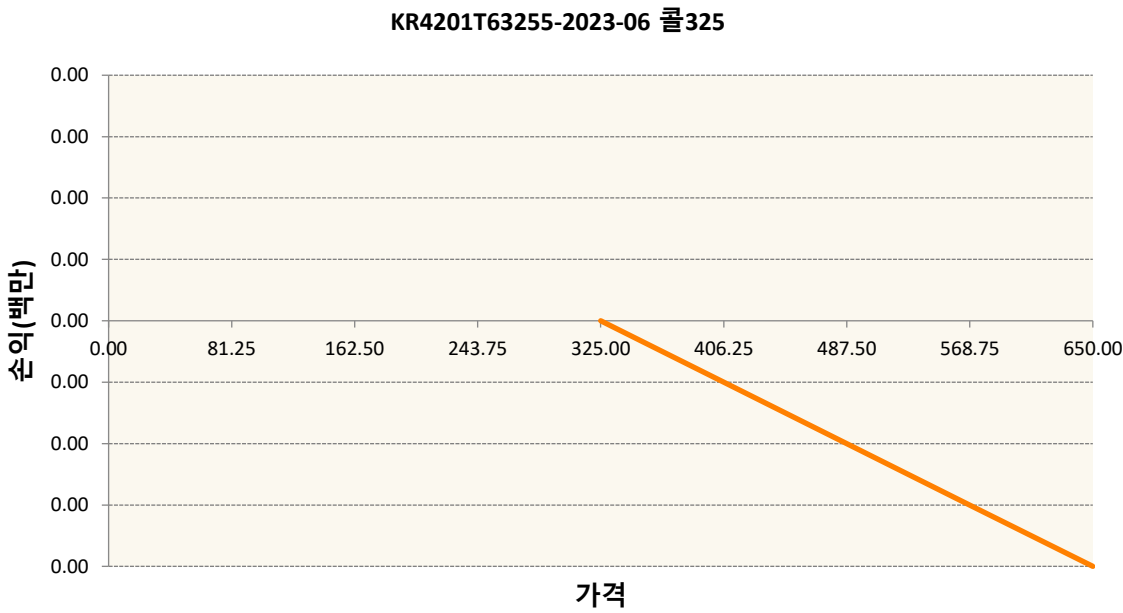
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

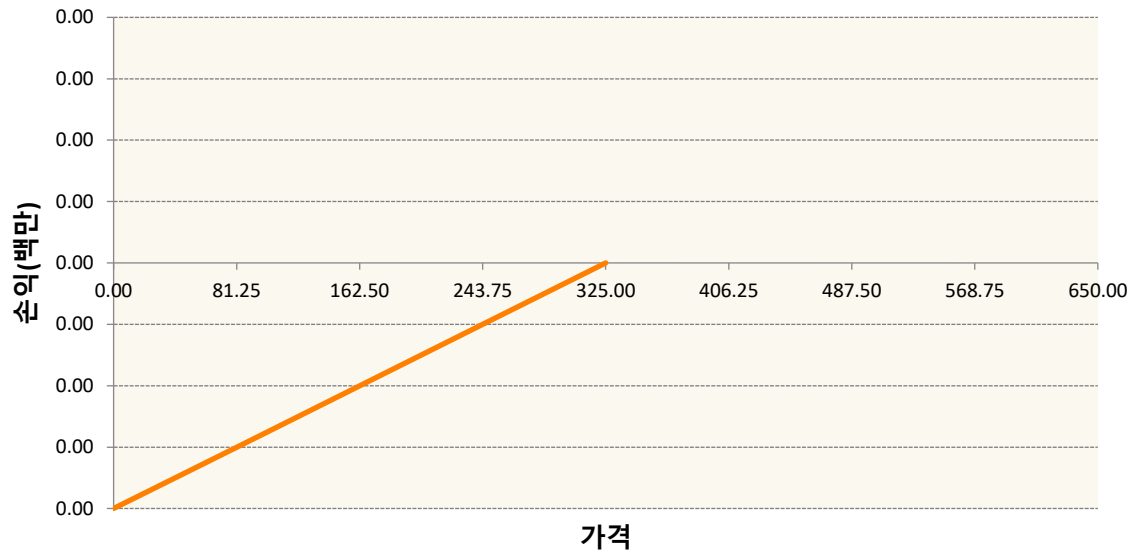
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	472	0	472	장내
누계	유가증권	옵션	0	53,588	-53,588	장내

2. 만기시점의 손익구조



KR4301T63253-2023-06 풋325



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201T63255			2023-06 콜325				2,921
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,594	1,562	1,524	1,484	1,440	1,393	1,345
-5.33%	1,380	1,321	1,261	1,200	1,138	1,075	1,012
-2.67%	905	839	773	707	640	573	507
0%	153	105	54	0	-56	-113	-171
2.67%	-790	-814	-842	-875	-912	-952	-996
5.33%	-1,819	-1,827	-1,839	-1,854	-1,874	-1,898	-1,925
8.00%	-2,874	-2,876	-2,880	-2,886	-2,895	-2,906	-2,921
KR4201T63271			2023-06 콜327.5				427
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	211	207	203	197	192	185	179
-5.33%	187	179	171	162	153	144	135
-2.67%	128	117	107	97	87	77	67
0%	26	17	9	0	-9	-18	-28
2.67%	-109	-114	-119	-125	-131	-138	-145
5.33%	-261	-262	-265	-268	-271	-276	-281
8.00%	-418	-418	-419	-420	-422	-424	-427
KR4301T63253			2023-06 풋325				443
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-383	-390	-399	-409	-420	-431	-443
-5.33%	-179	-193	-207	-222	-237	-252	-267
-2.67%	-38	-53	-69	-85	-101	-117	-133
0%	37	25	13	0	-13	-27	-41

2.67%	65	60	53	45	36	26	16
5.33%	73	71	68	65	60	54	48
8.00%	75	74	73	72	70	67	63

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

(단위:백만원)

3,957

공시일	2023-05-23
기준일	2023-05-22

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	570	570	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)

73

공시일	2023-05-23
기준일	2023-05-22

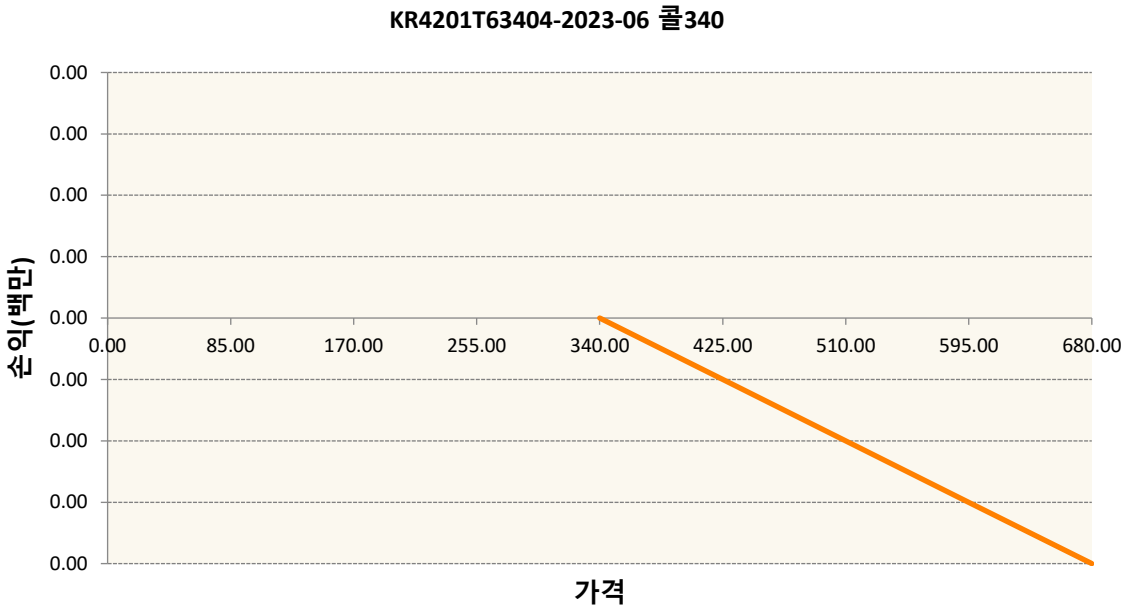
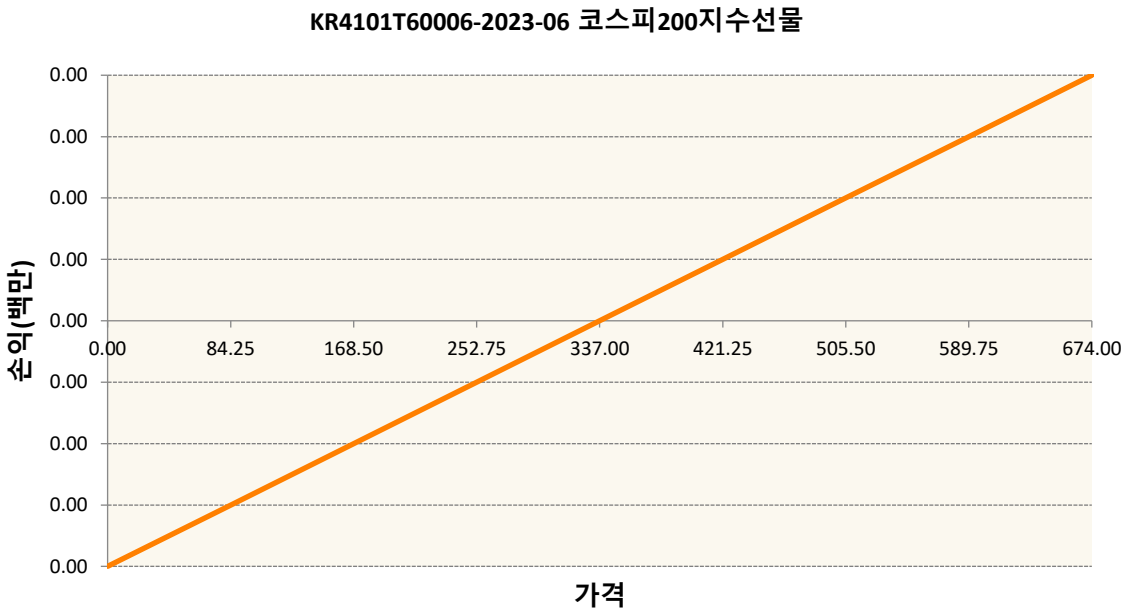
리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

1. 계약금액

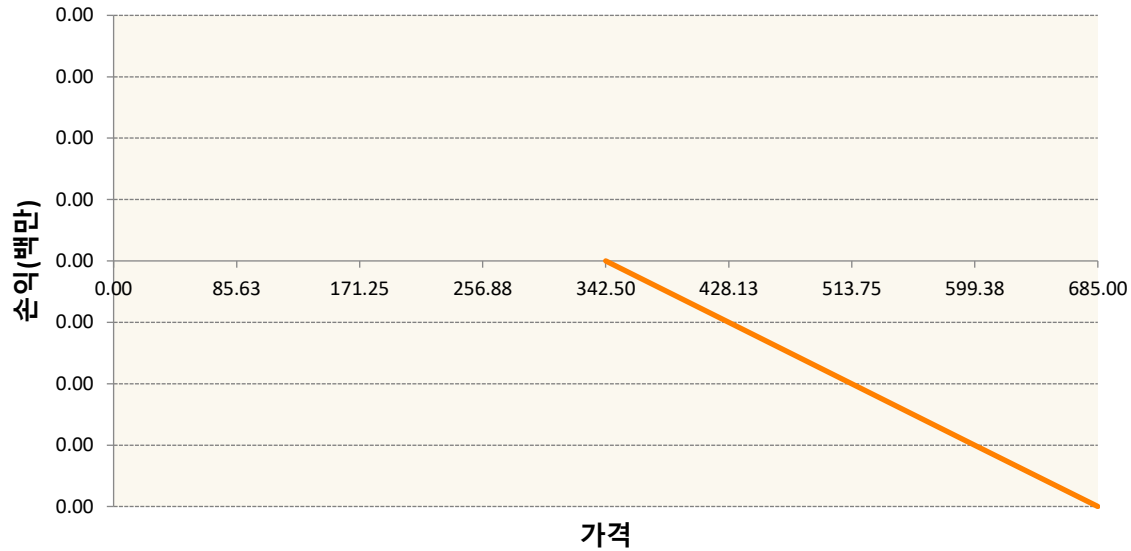
(단위:백만원)

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	506	0	506	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,501	-3,501	장내

2. 만기시점의 손익구조



KR4201T63420-2023-06 콜342.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101T60006		2023-06 코스피200지수선물					40
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-40	-40	-40	-40	-40	-40	-40
-5.33%	-27	-27	-27	-27	-27	-27	-27
-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%	27	27	27	27	27	27	27
8.00%	40	40	40	40	40	40	40
KR4201T63404		2023-06 콜340					74
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	20	20	20	19	19	18	18
-5.33%	19	19	18	17	16	15	14
-2.67%	16	14	13	11	10	8	6
0%	6	4	2	0	-2	-4	-7
2.67%	-12	-14	-16	-18	-20	-22	-24
5.33%	-37	-39	-40	-42	-44	-45	-47
8.00%	-68	-69	-70	-71	-72	-73	-74
KR4201T63420		2023-06 콜342.5					121
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	29	29	29	28	27	27	25
-5.33%	28	27	26	25	23	22	20
-2.67%	24	22	19	17	14	11	8
0%	11	7	4	0	-4	-7	-11

2.67%	-16	-20	-24	-28	-32	-35	-39
5.33%	-58	-60	-63	-67	-70	-73	-77
8.00%	-109	-111	-112	-114	-116	-119	-121

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

(단위:백만원)

232

공시일	2023-05-23
기준일	2023-05-22

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	6,761	0	6,761	

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	2023-05-23
기준일	2023-05-22

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	4,939	0	4,939	

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	2023-05-23
기준일	2023-05-22

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	18,479	0	18,479	
누계	통화	선도	659	19,079	-18,420	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
FXW213D2Q KRW/USD 31-05-23E		711
FXW213D3Q KRW/USD 28-06-23E		511
FXW213D4S(KRW/USD 31-07-23E		262
FXW213D52(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)
	3,444

공시일	2023-05-23
기준일	2023-05-22

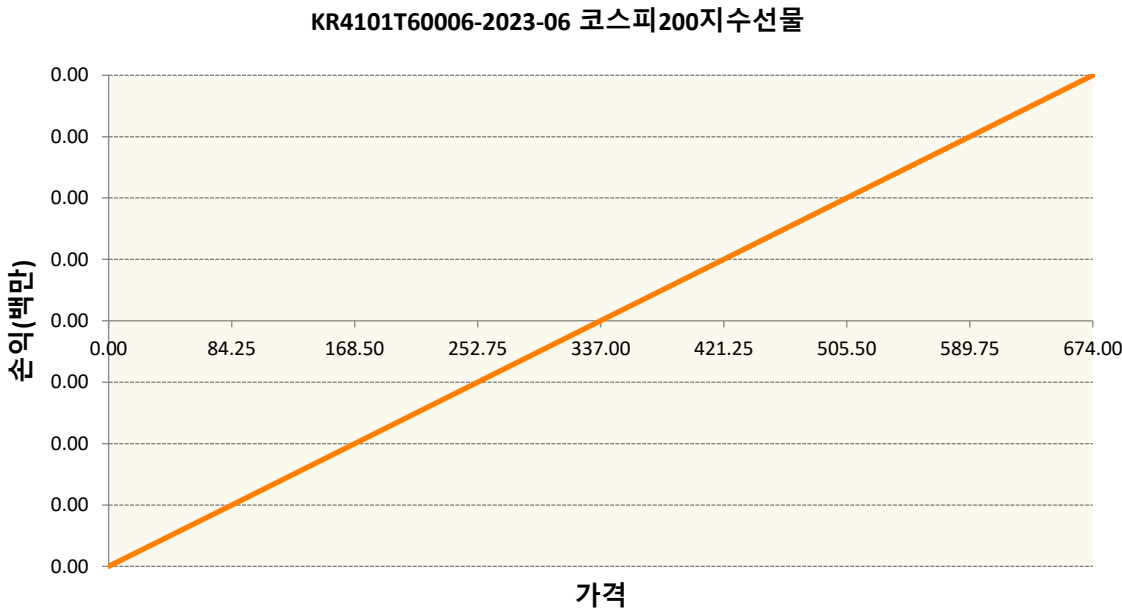
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	84	-84	장내
누계	유가증권	선물	421	0	421	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101T60006			2023-06 코스피200지수선물					34
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-34	-34	-34	-34	-34	-34	-34	
-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%	34	34	34	34	34	34	34	

공시일	2023-05-23
기준일	2023-05-22

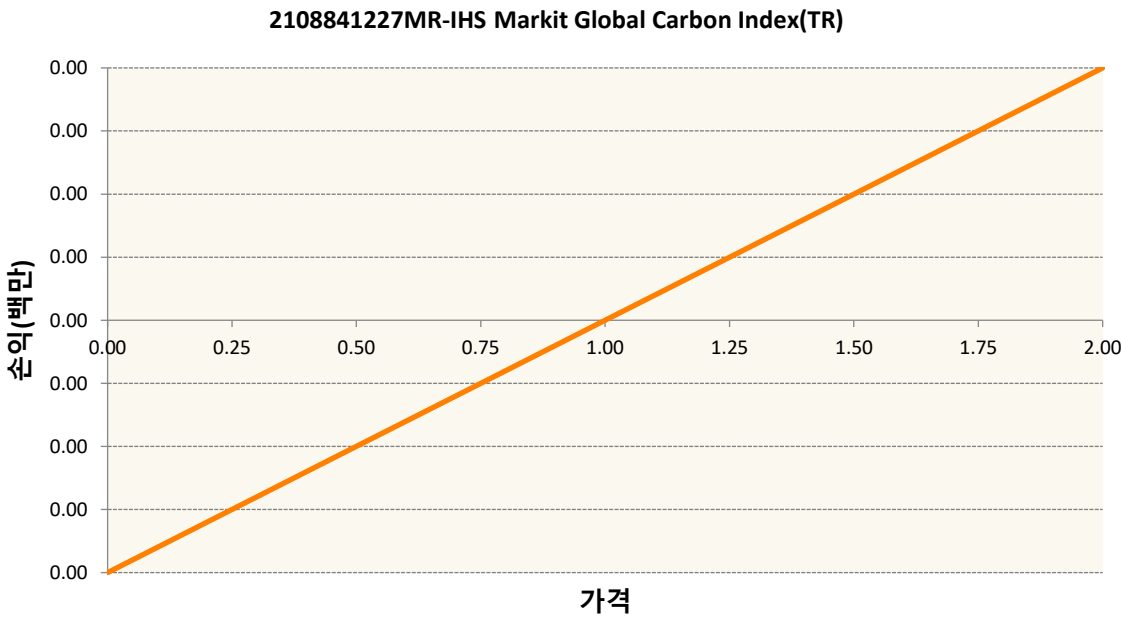
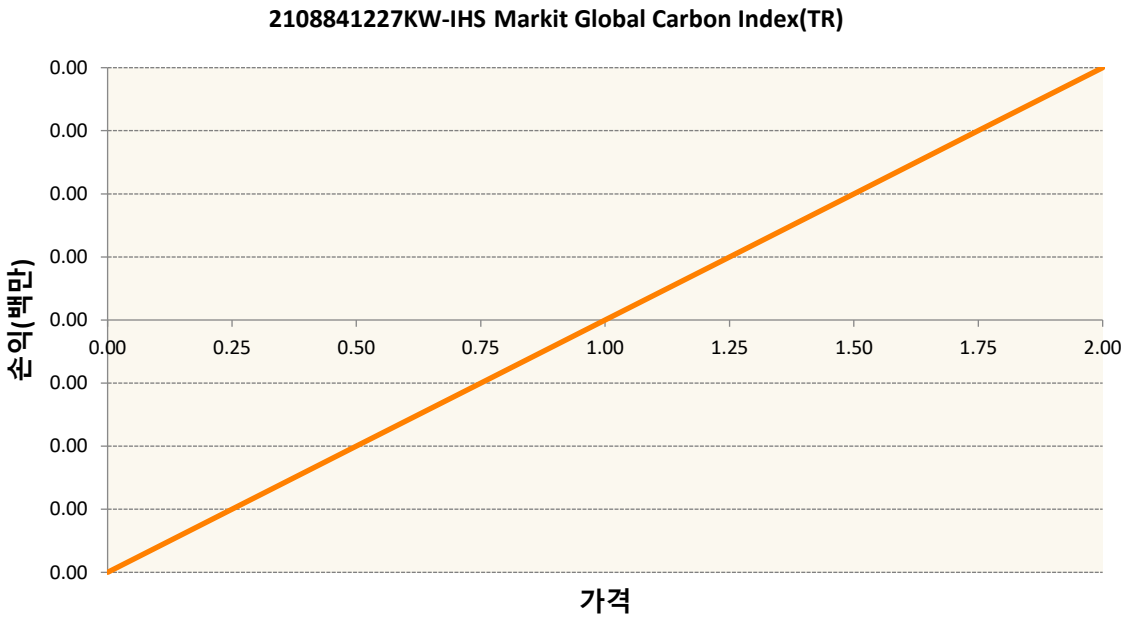
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

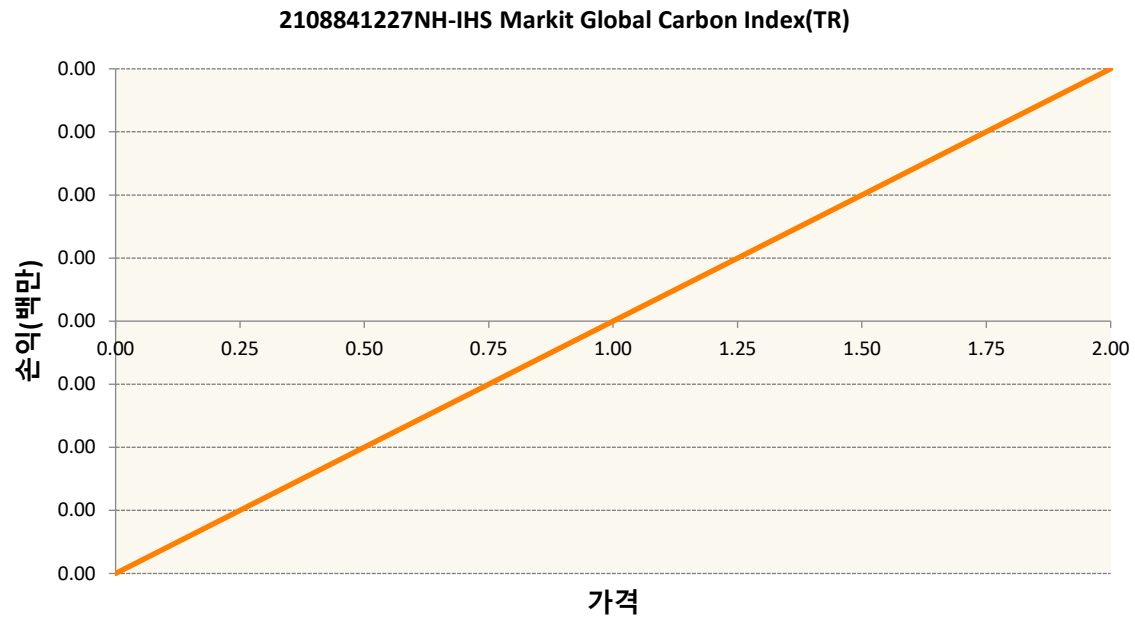
1. 계약금액

(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)		1,754
2108841227IHS Markit Global Carbon Index(TR)		206
2108841227IHS Markit Global Carbon Index(TR)		103

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

공시일	2023-05-23
기준일	2023-05-22

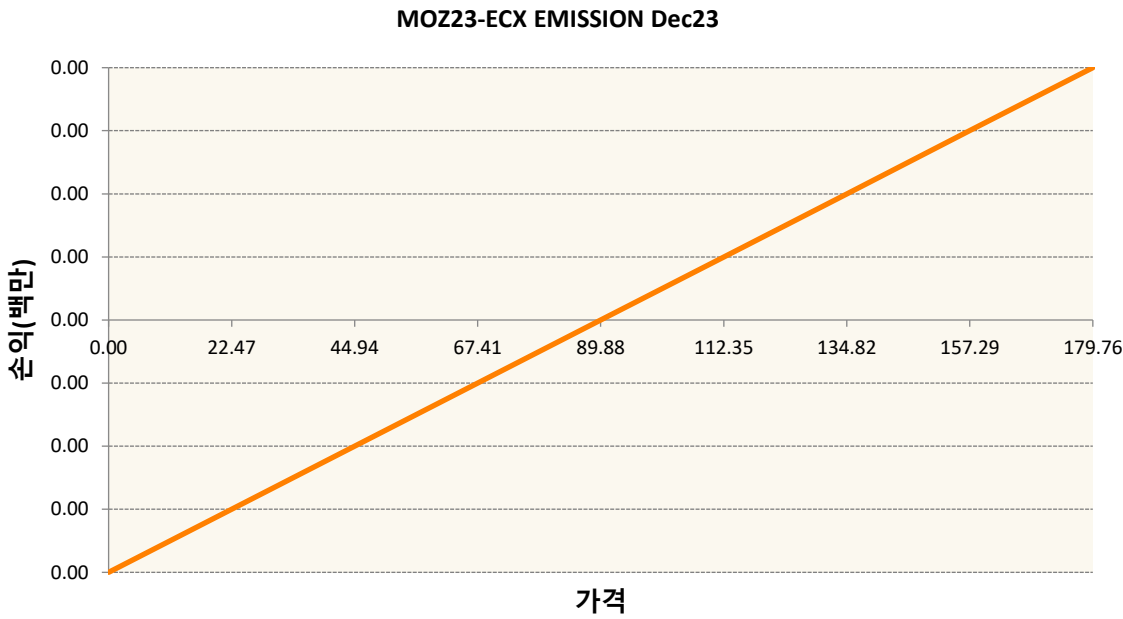
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	9,096	0	9,096	
누계	통화	선도	0	2,138	-2,138	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213D4S(KRW/EUR 31-05-23E	57
FXW213D4S(KRW/EUR 31-05-23E	57
FXW213D4S(KRW/EUR 31-05-23E	57
MOZ23 ECX EMISSION Dec23	728

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

(단위:백만원)

1,381

공시일	2023-05-23
기준일	2023-05-22

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)	14
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)

101

공시일	2023-05-23
기준일	2023-05-22

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)

36

공시일	2023-05-23
기준일	2023-05-22

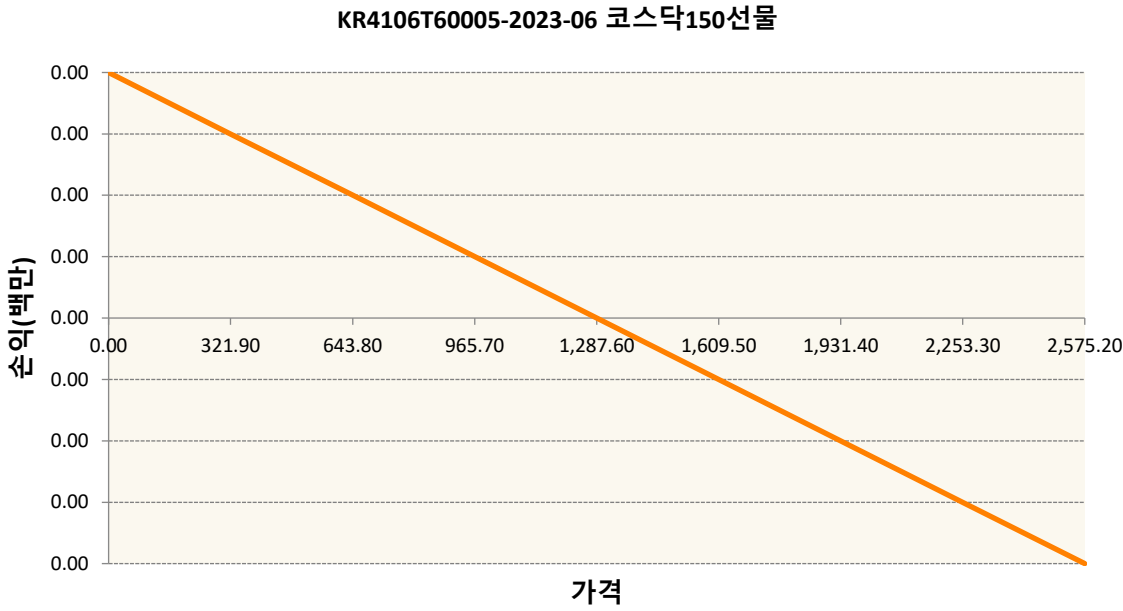
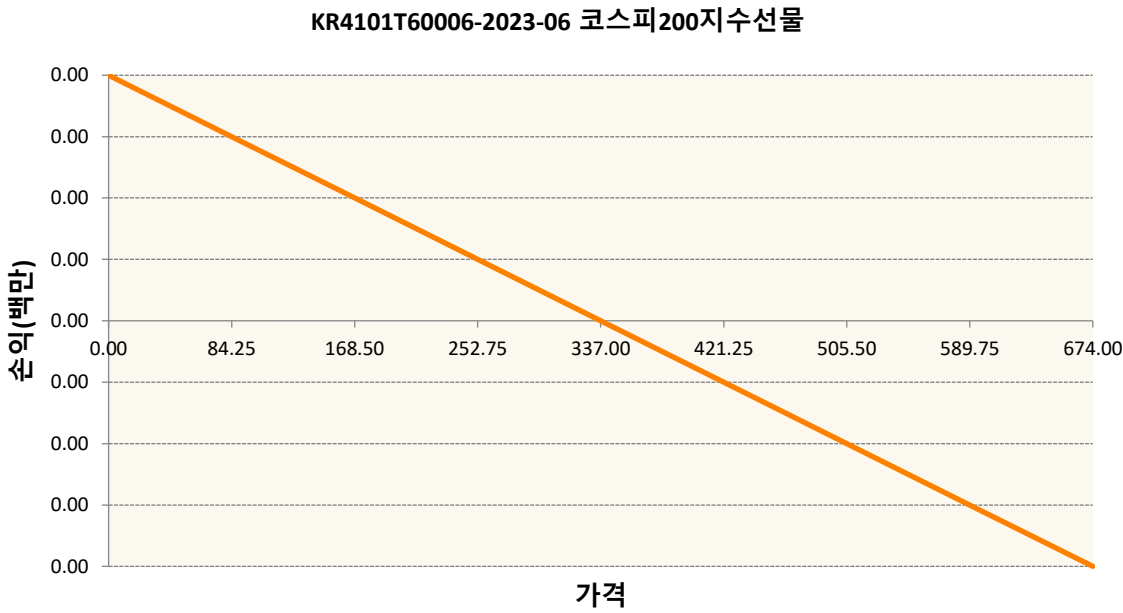
에쿼티알파일반사모혼합자산

1. 계약금액

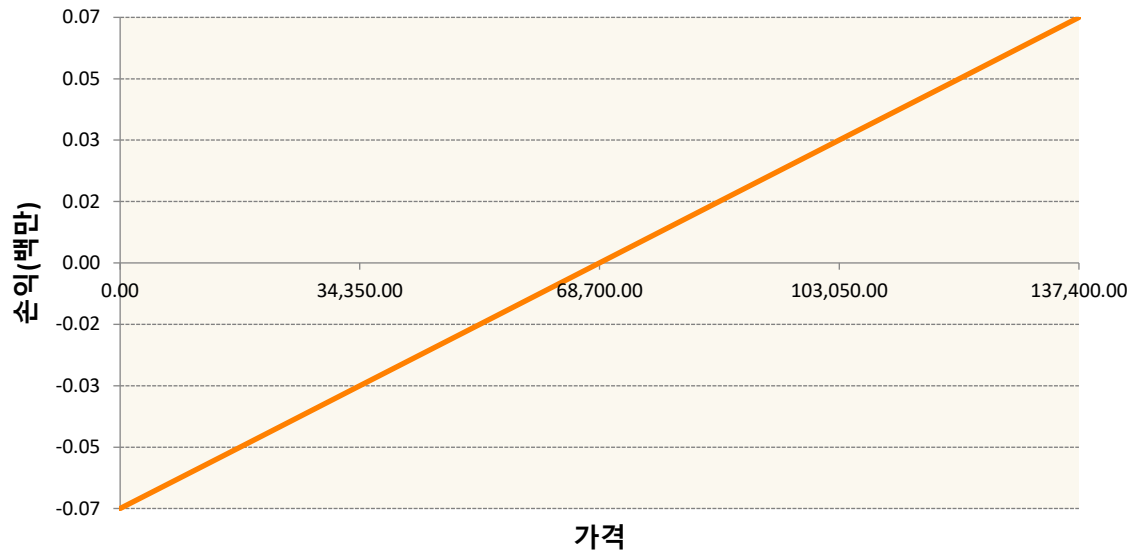
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	589	163	426	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,538	2,994	-1,456	장내
누계	유가증권	스왑	0	0	0	장외

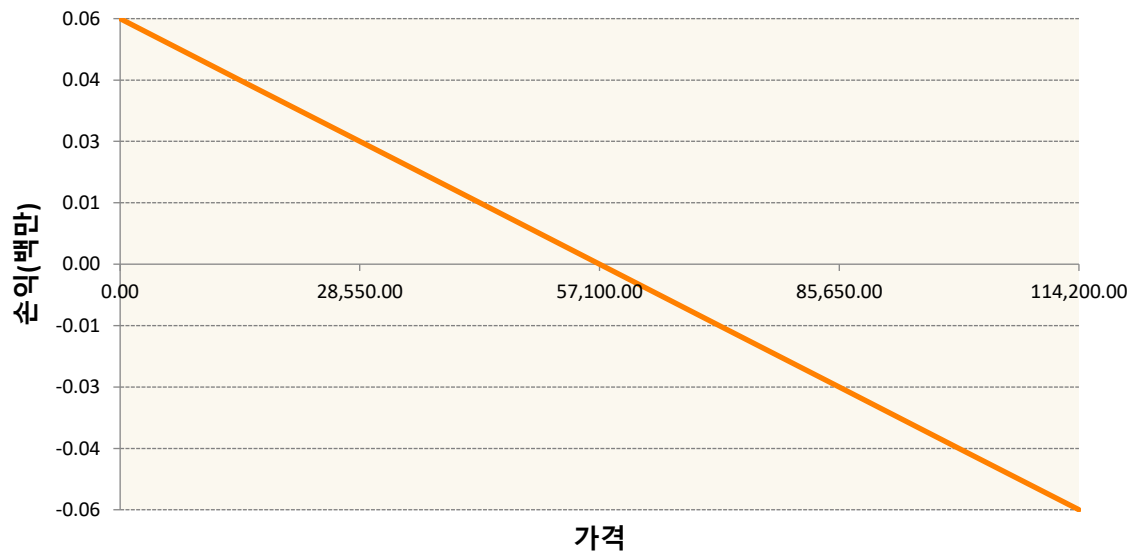
2. 만기시점의 손익구조



KR4111T60005-2023-06 삼성전자개별선물



KR41F7T60007-2023-06 카카오페이개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101T600 2023-06 코스피200지수선물	135
KR4106T600 2023-06 코스닥150선물	98
KR4111T600 2023-06 삼성전자개별선물	123
KR41F7T600 2023-06 카카오페이개별선물	7
KRS0004099 SWAP_MICRON TECH_0308	0.12
KRS0004212 SWAP_SPDR S&P BIOTECH_0413	0.12

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

(단위:백만원)

620

공시일	2023-05-23
기준일	2023-05-22

코리아인덱스(주식-파생형)(종)

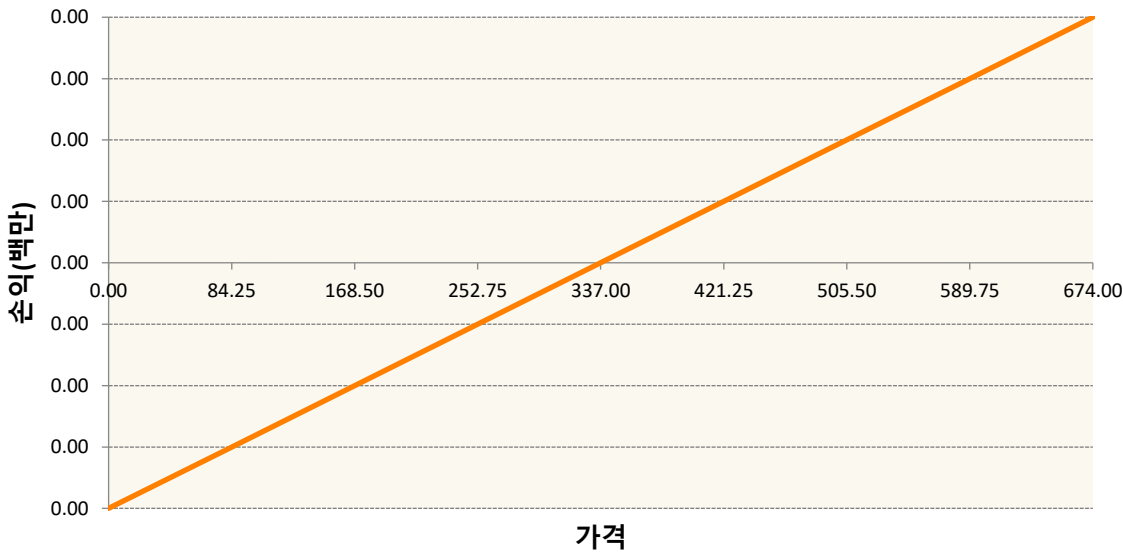
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	674	0	674	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101T60006-2023-06 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101T60006		2023-06 코스피200지수선물					54
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-54	-54	-54	-54	-54	-54	-54
-5.33%	-36	-36	-36	-36	-36	-36	-36
-2.67%	-18	-18	-18	-18	-18	-18	-18
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	18	18	18	18	18	18	18
5.33%	36	36	36	36	36	36	36
8.00%	54	54	54	54	54	54	54

공시일	2023-05-23
기준일	2023-05-22

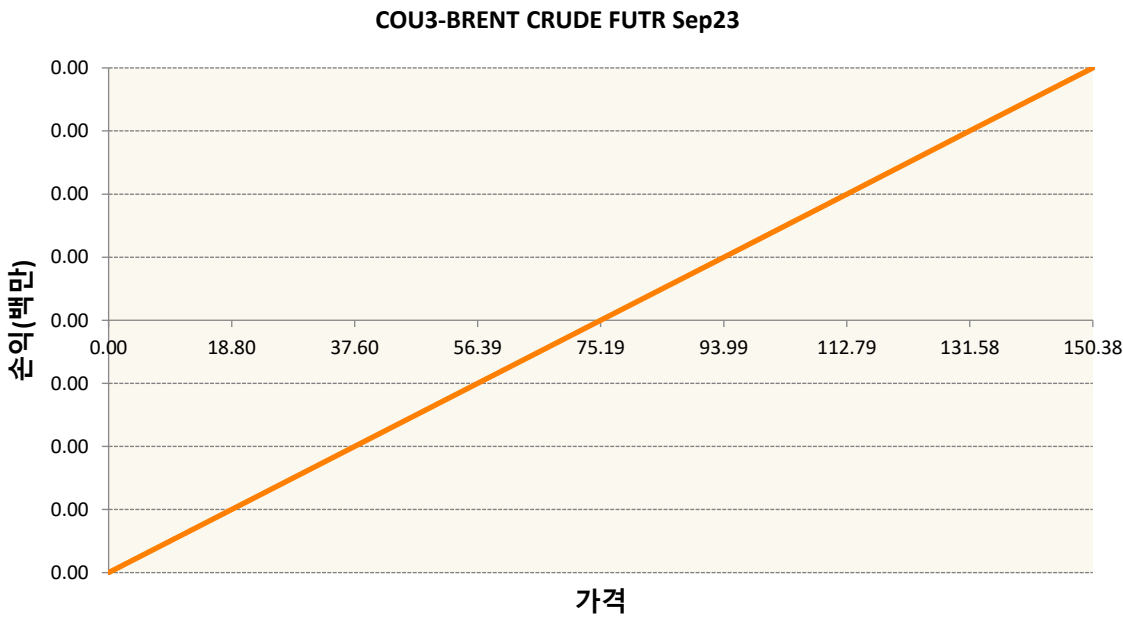
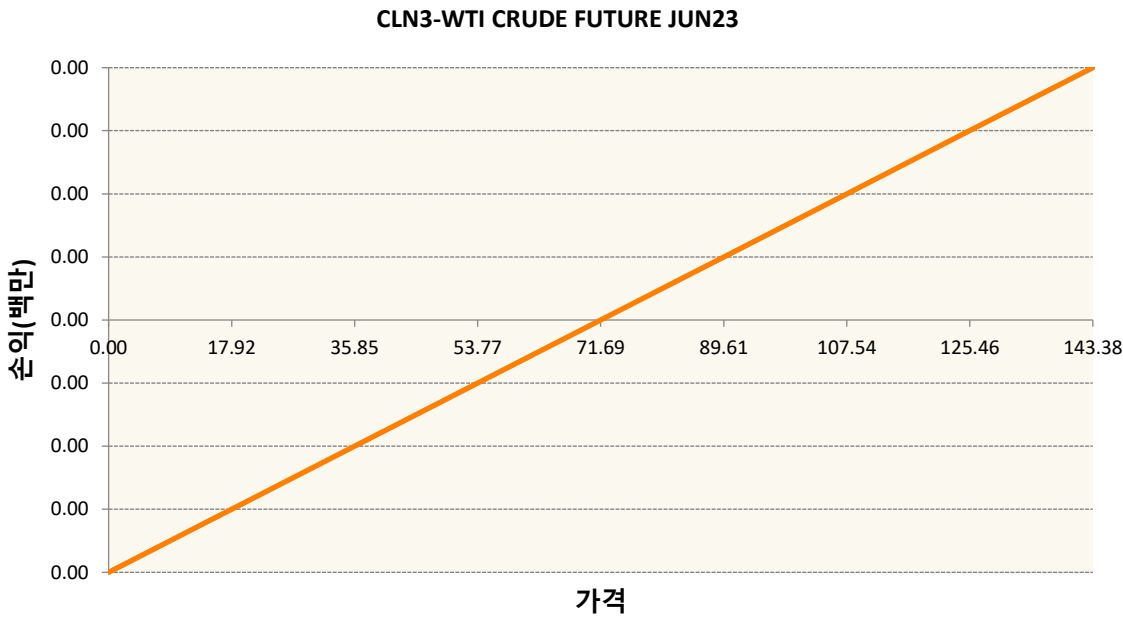
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

1. 계약금액

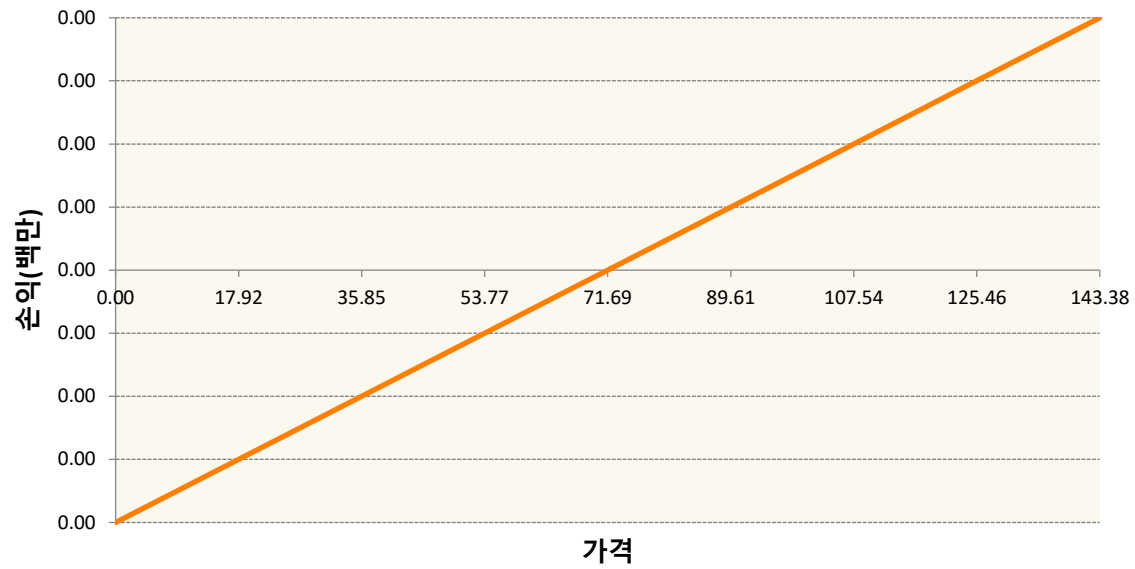
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,323	211	1,112	

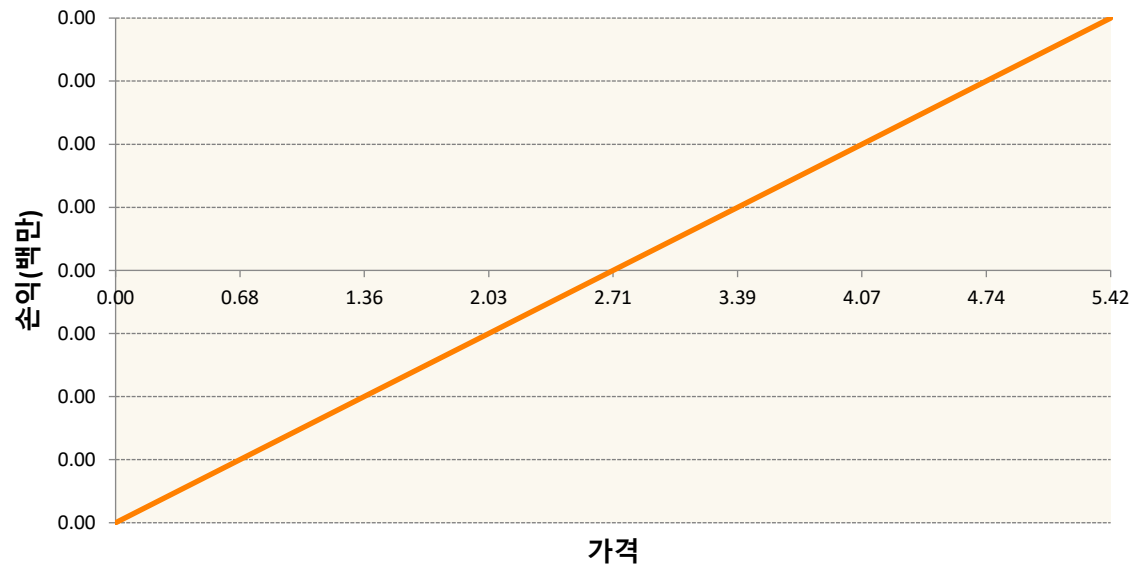
2. 만기시점의 손익구조



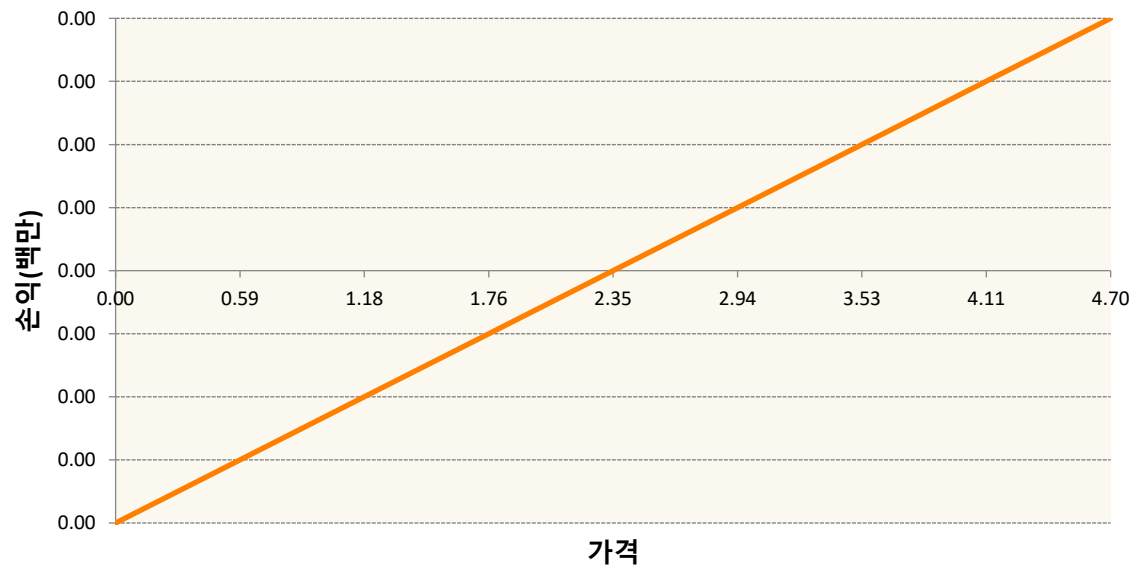
ECN3-E-mini Crude Oil Jul23



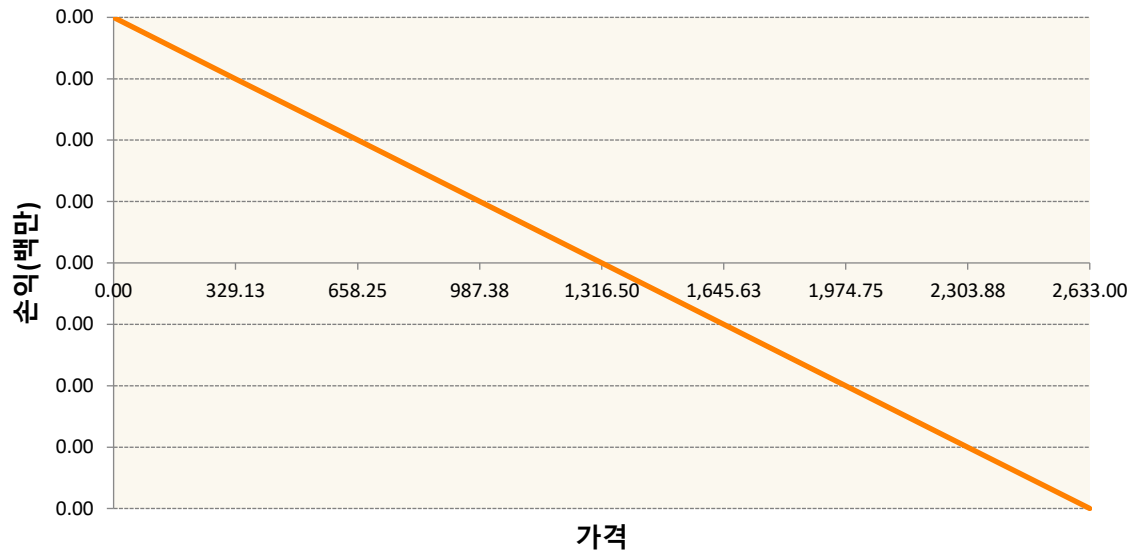
EON3-E-MINI NATURAL GAS Jul23



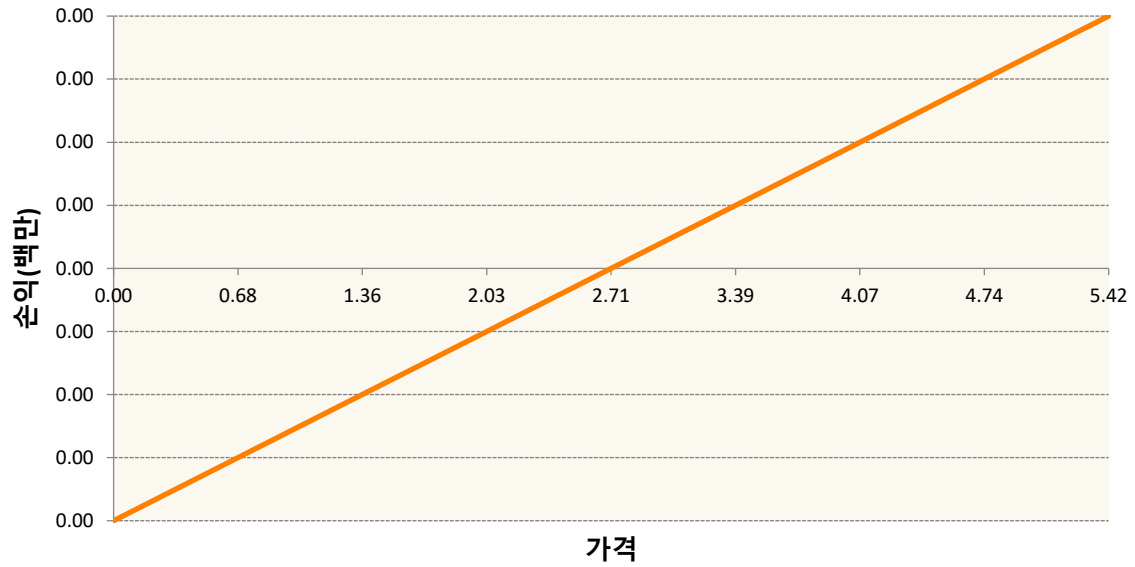
HON3-NY Harb ULSD Fut Jul23



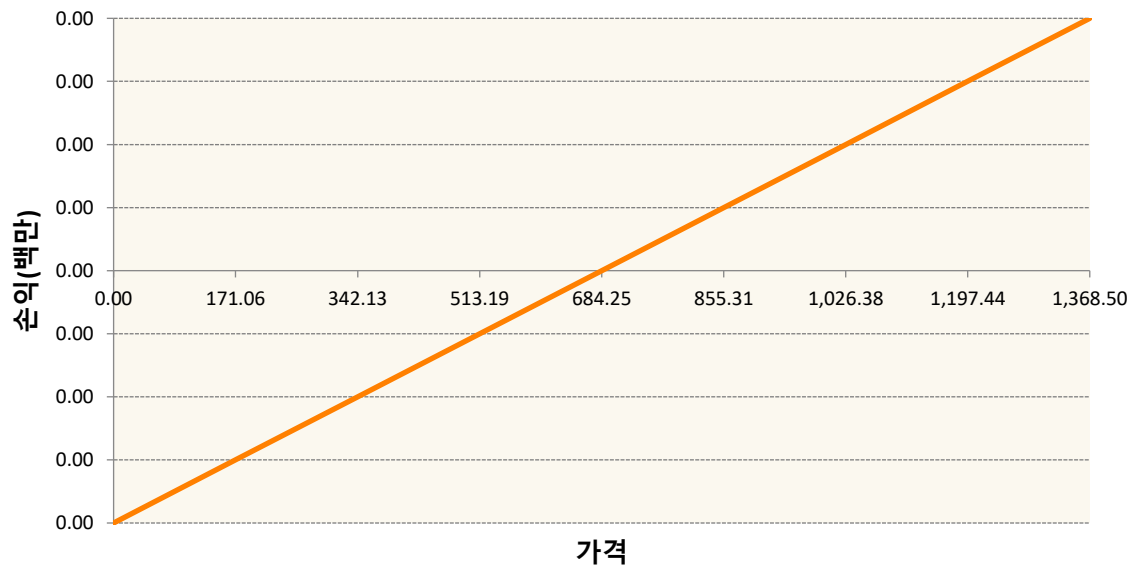
KR4175T60000-2023-06 달러선물

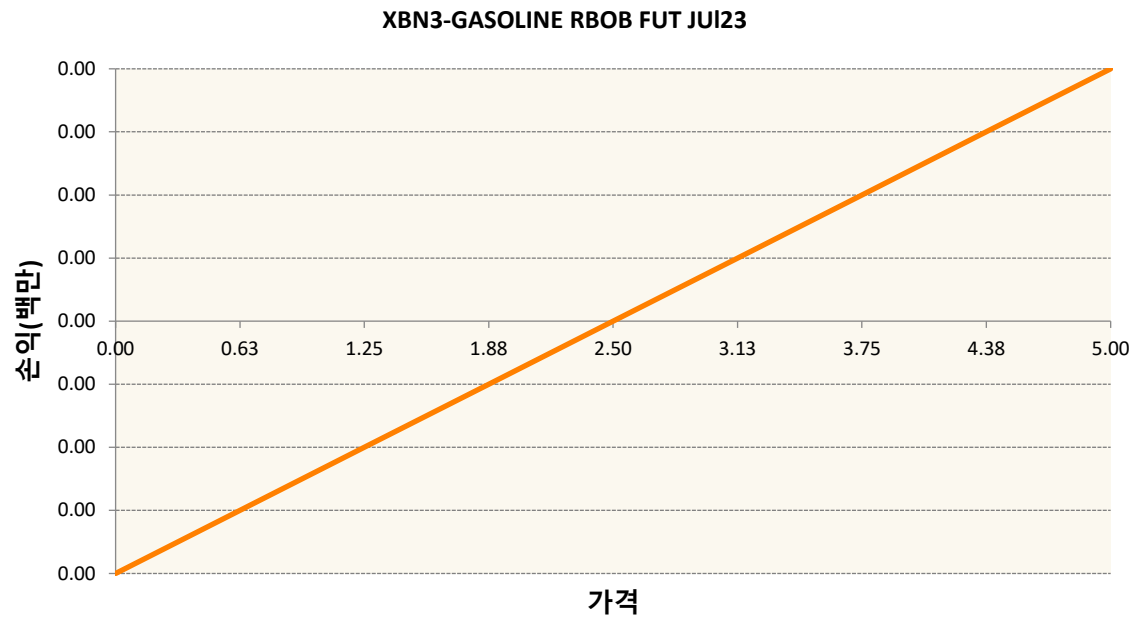


NGN23-NATURAL GAS FUTR JUL23



QSN3-Low Su Gasoil G JUL23





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
CLN3	WTI CRUDE FUTURE JUN23	23
COU3	BRENT CRUDE FUTR Sep23	24
ECN3	E-mini Crude Oil JUL23	4
EON3	E-MINI NATURAL GAS JUL23	1
HON3	NY Harb ULSD Fut Jul23	10
KR4175T600	2023-06 달러선물	17
NGN23	NATURAL GAS FUTR JUL23	26
QSN3	Low Su Gasoil G JUL23	7
XBN3	GASOLINE RBOB FUT JUL23	11

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