

공시일	2023-05-30
기준일	2023-05-26

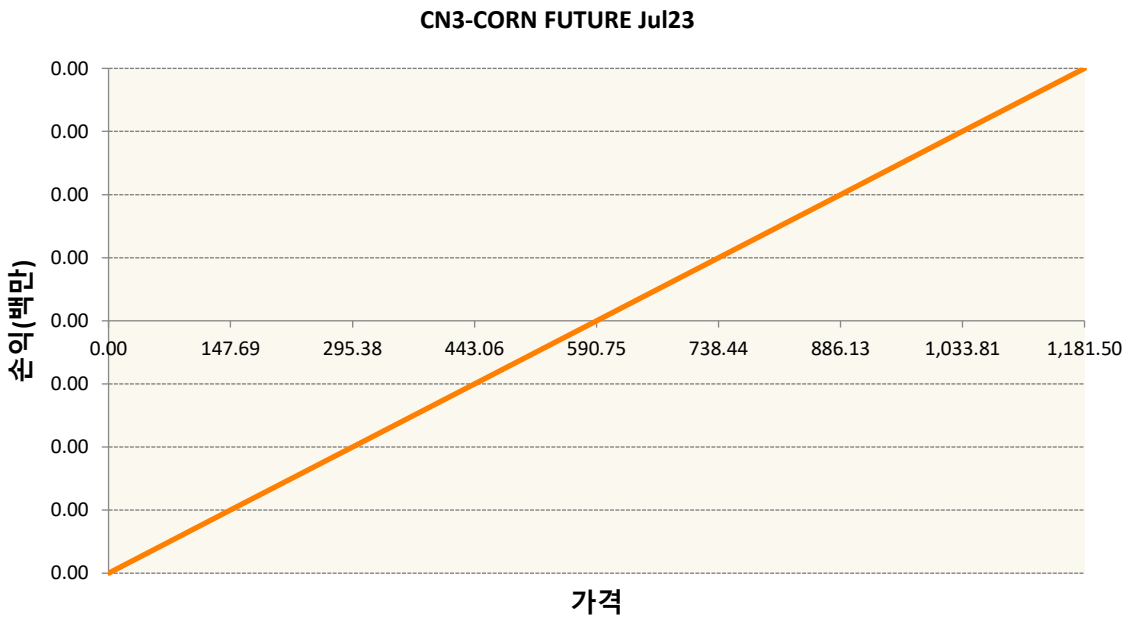
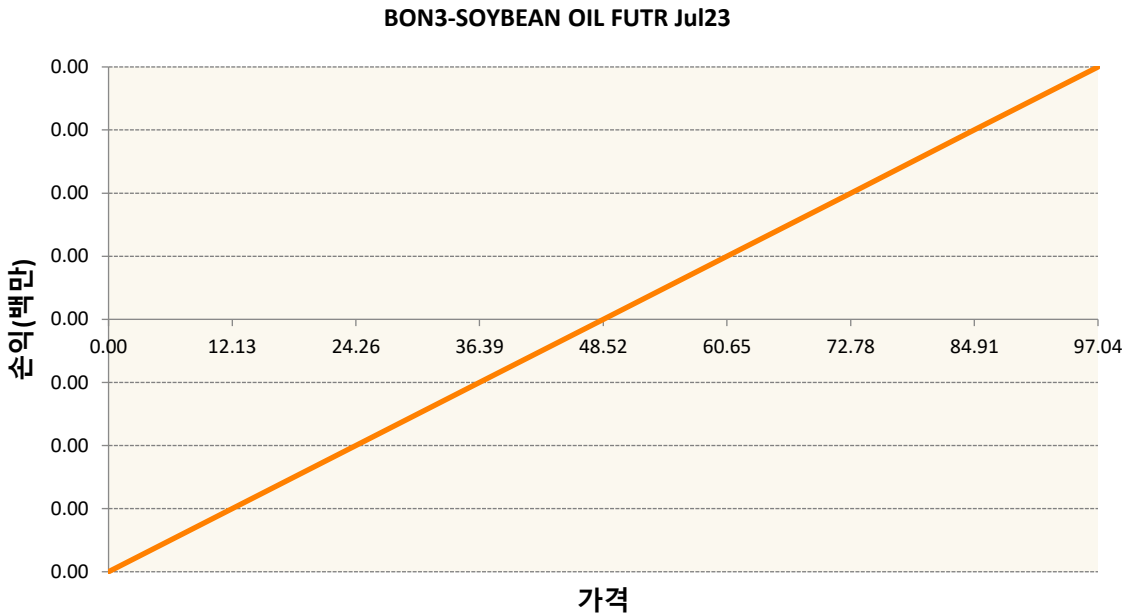
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

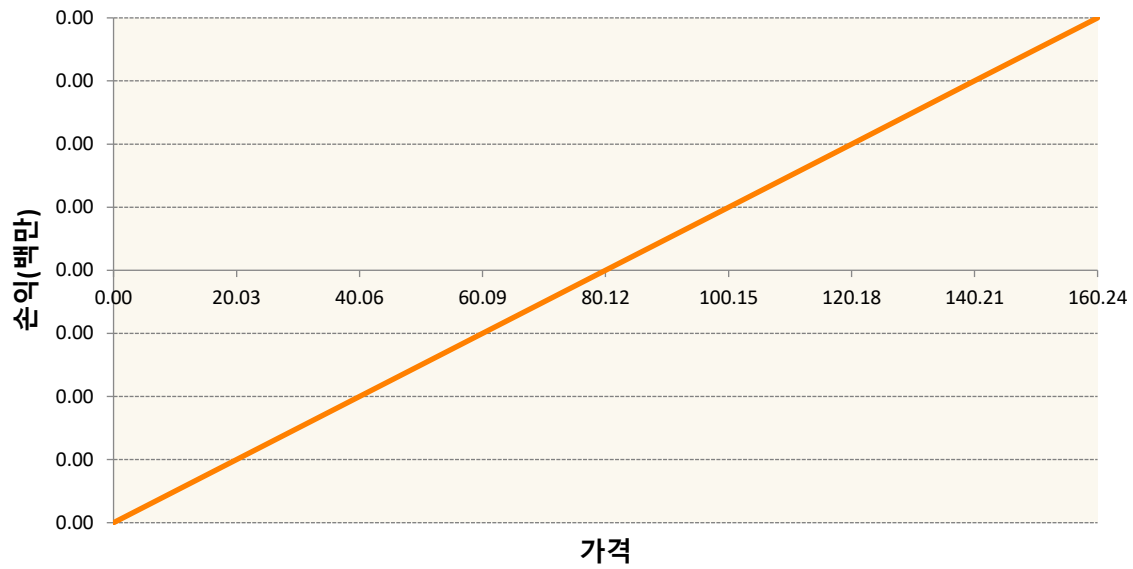
(단위:USD 백만)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,190	529	4,660	

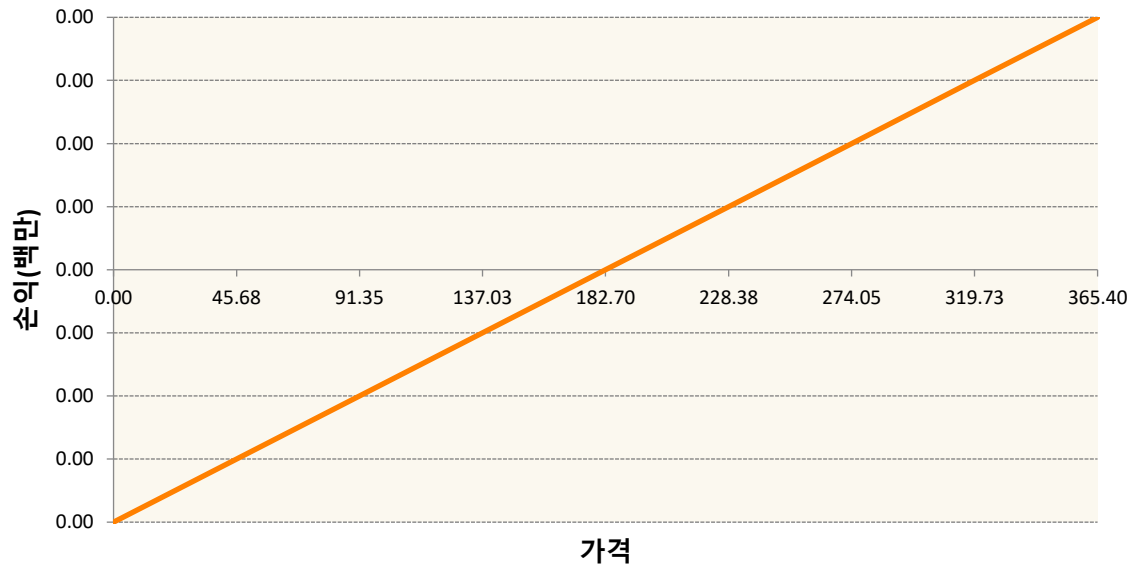
2. 만기시점의 손익구조



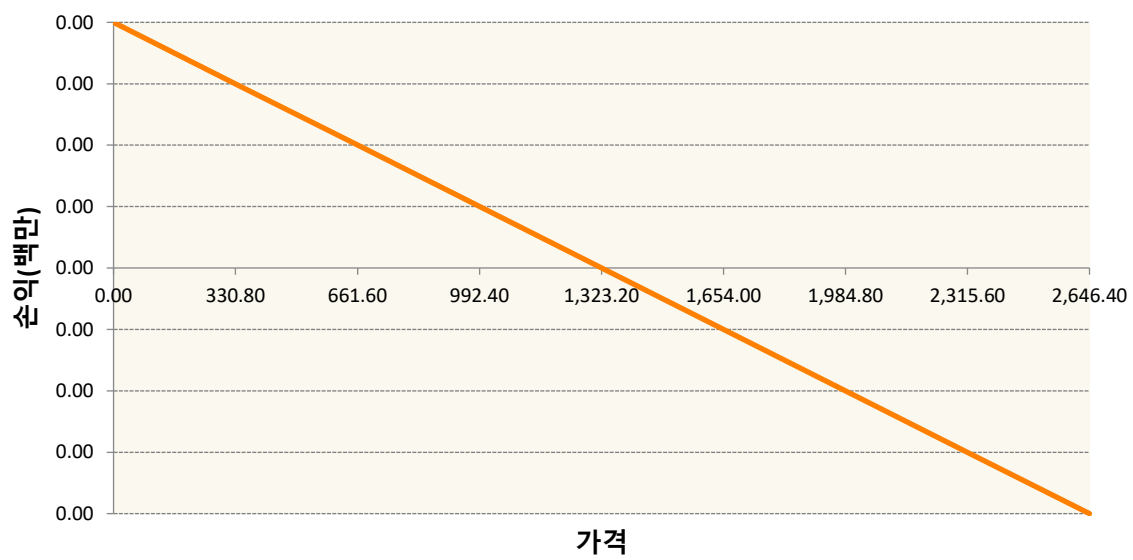
CTN3-COTTON NO.2 FUTR Jul23



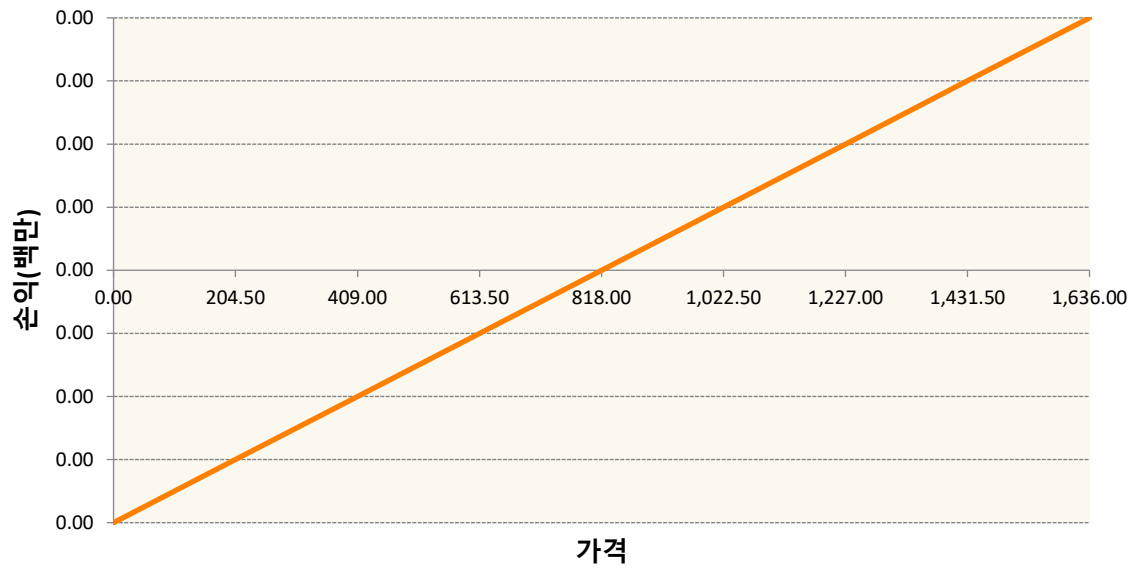
KCN3-COFFEE 'C' FUTURE Jul23



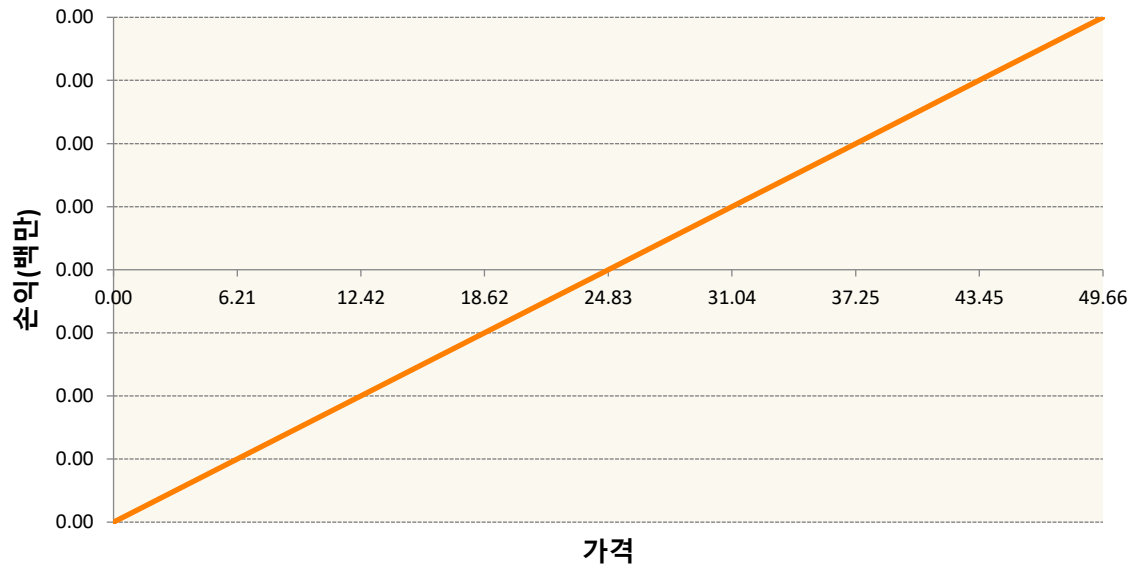
KR4175T60000-2023-06 달러선물



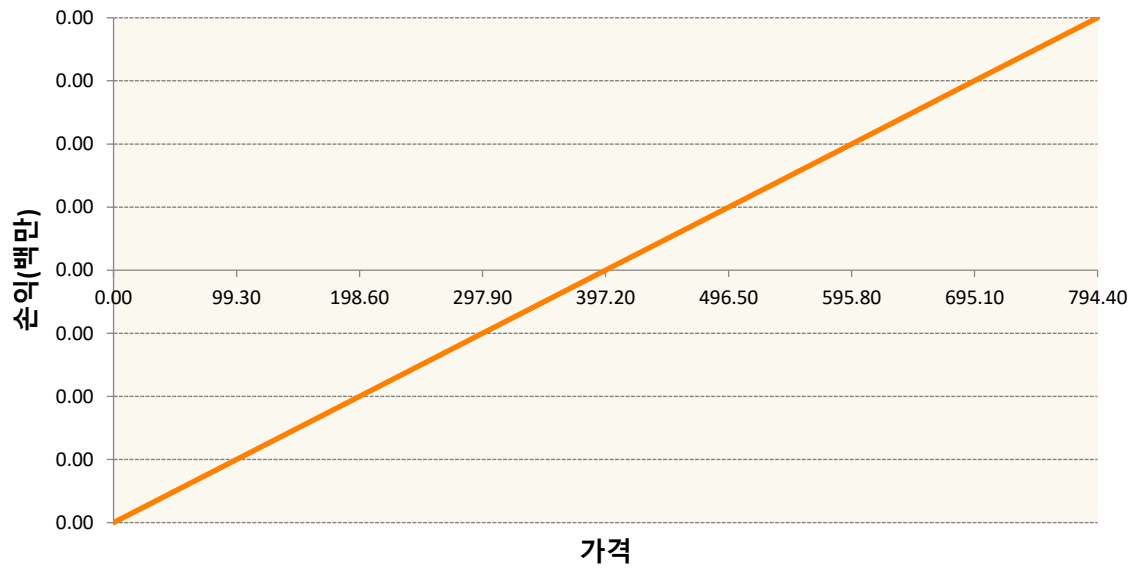
KWN3-KC HRW WHEAT FUT Jul23

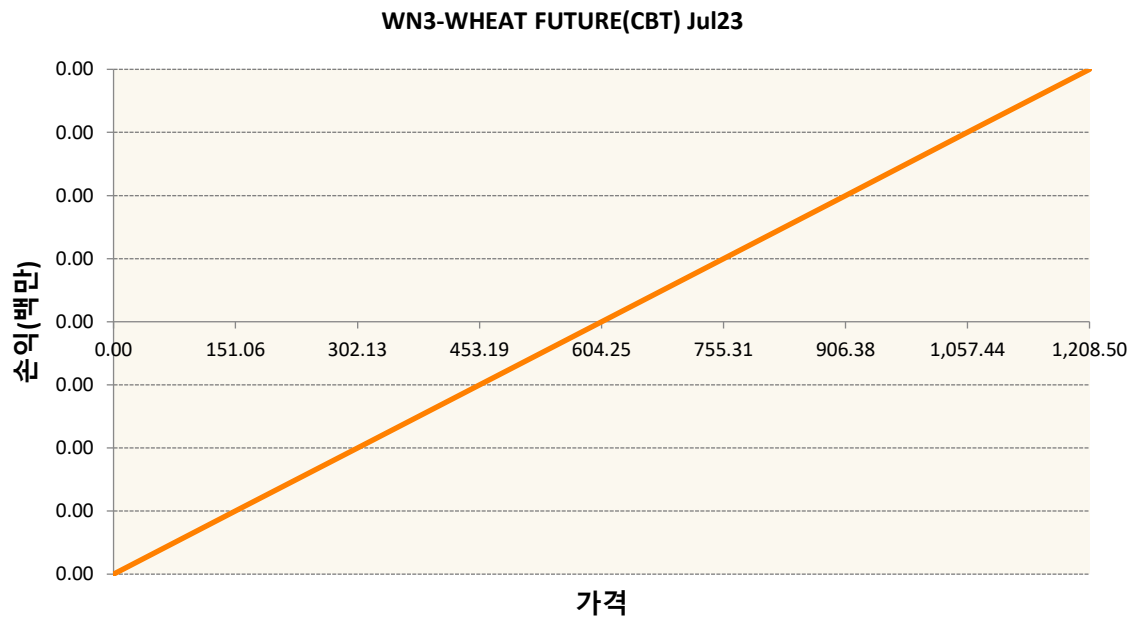
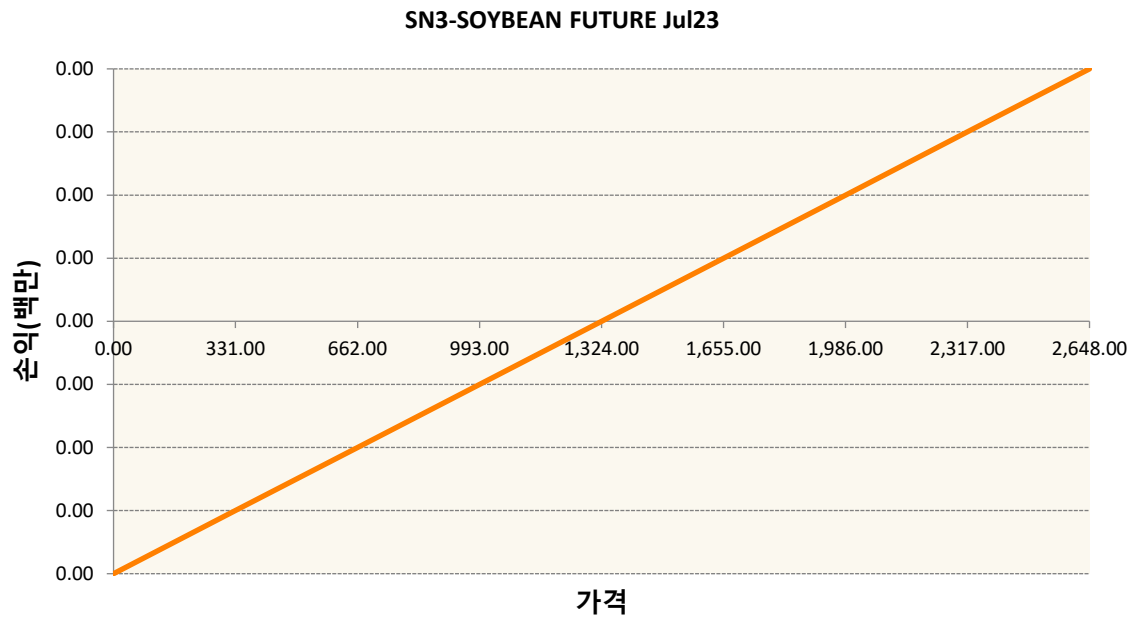


SBN3-Sugar #11 (WORLD) Jul23



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	2023-05-30
기준일	2023-05-26

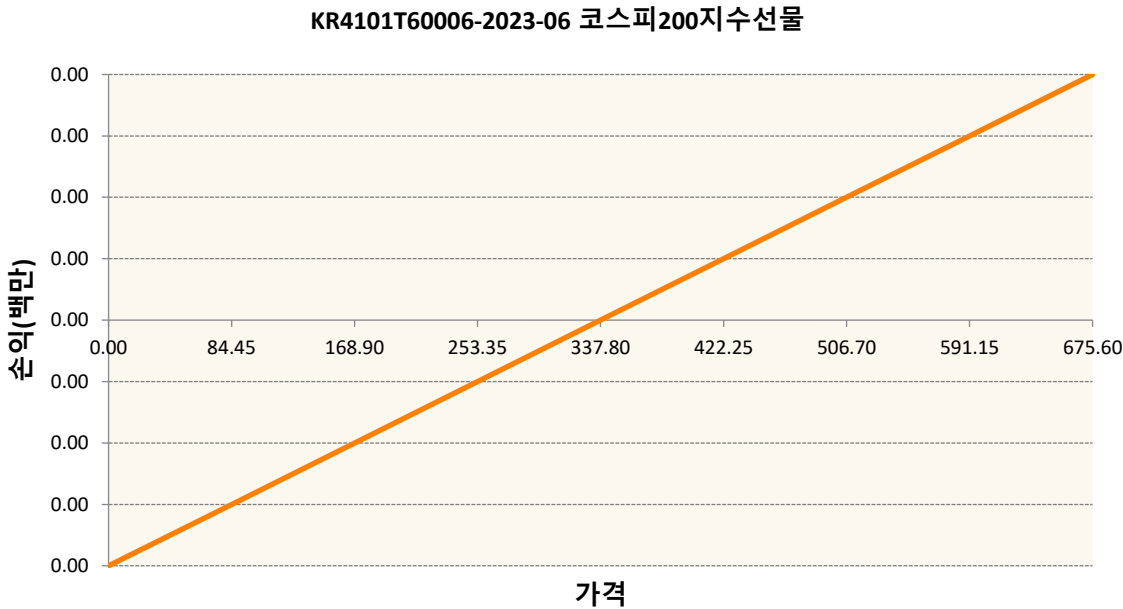
스마트인덱스모

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	929	0	929	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101T60006			2023-06 코스피200지수선물				74
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-74	-74	-74	-74	-74	-74	-74
-5.33%	-49	-49	-49	-49	-49	-49	-49
-2.67%	-25	-25	-25	-25	-25	-25	-25
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	25	25	25	25	25	25	25
5.33%	49	49	49	49	49	49	49
8.00%	74	74	74	74	74	74	74

공시일	2023-05-30
기준일	2023-05-26

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	341
-----------------------------	-----

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

578

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2023-05-30
기준일	2023-05-26

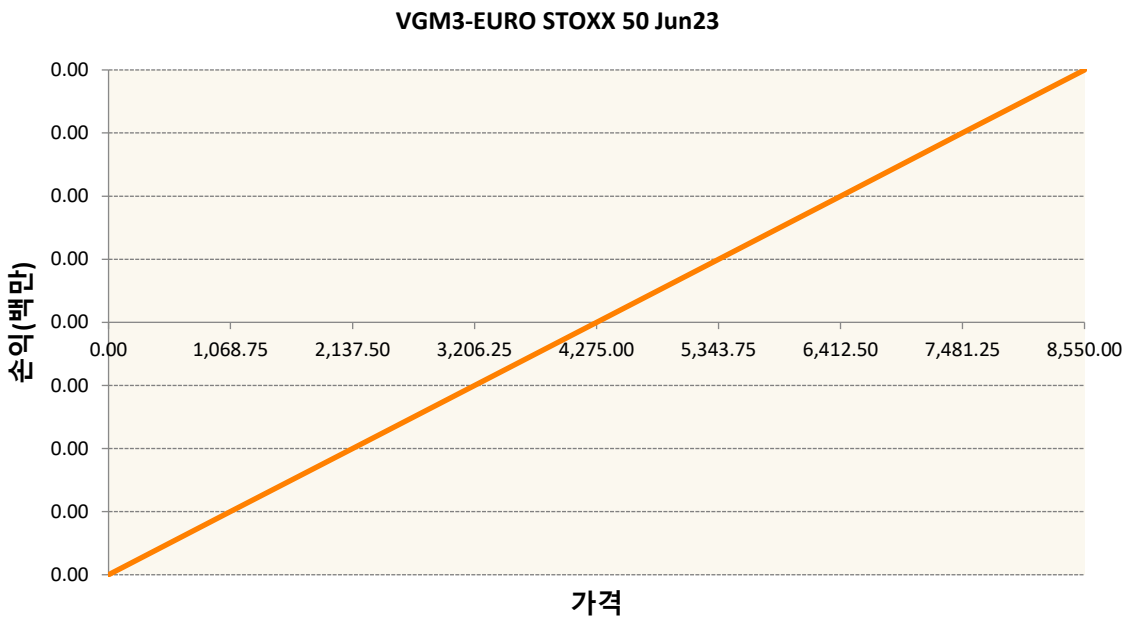
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	542	0	542	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM3	EURO STOXX 50 Jun23	43
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

74

공시일	2023-05-30
기준일	2023-05-26

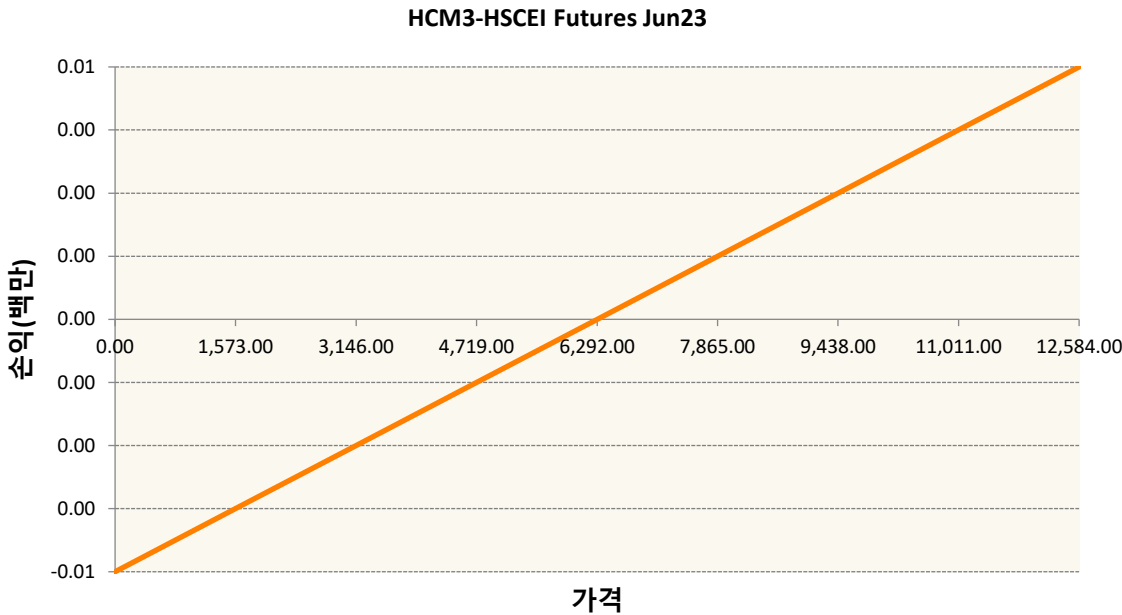
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	958	0	958	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCM3	HSCEI Futures Jun23	77
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

130

공시일	2023-05-30
기준일	2023-05-26

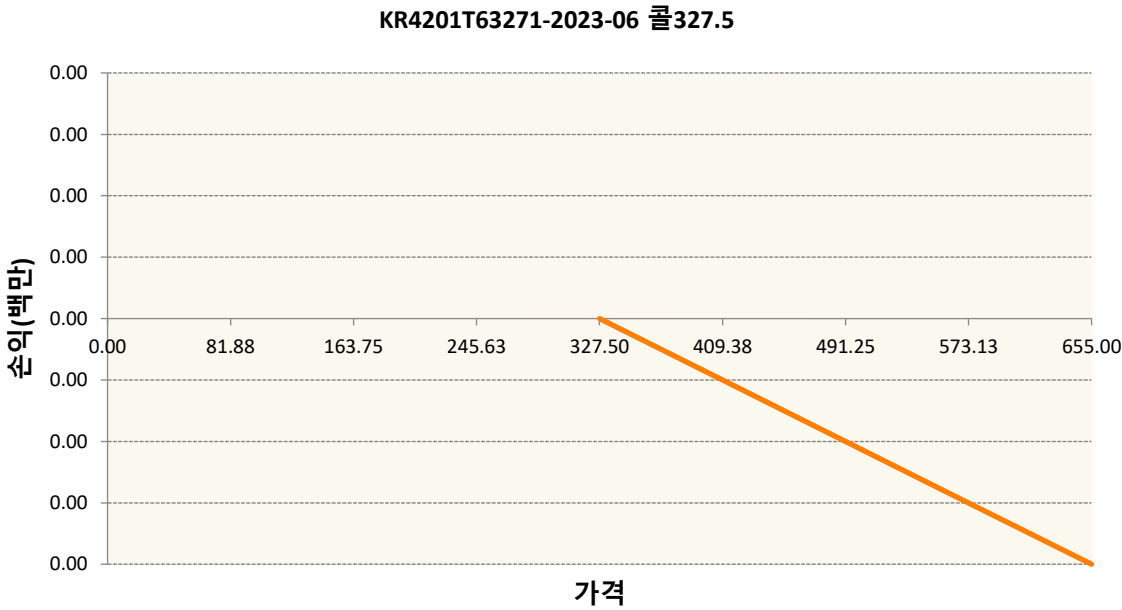
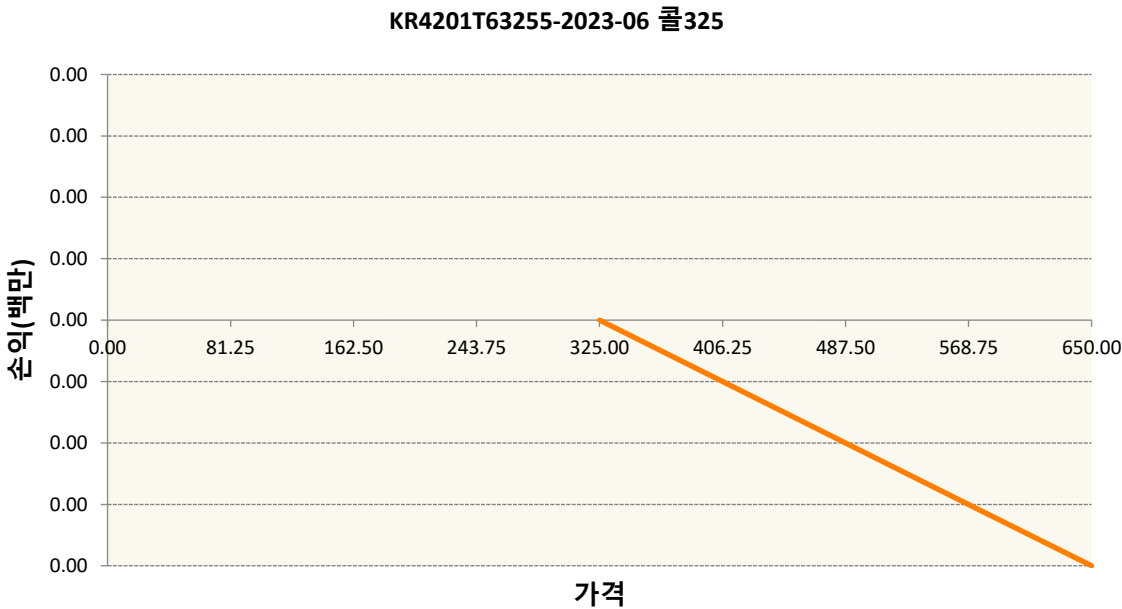
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

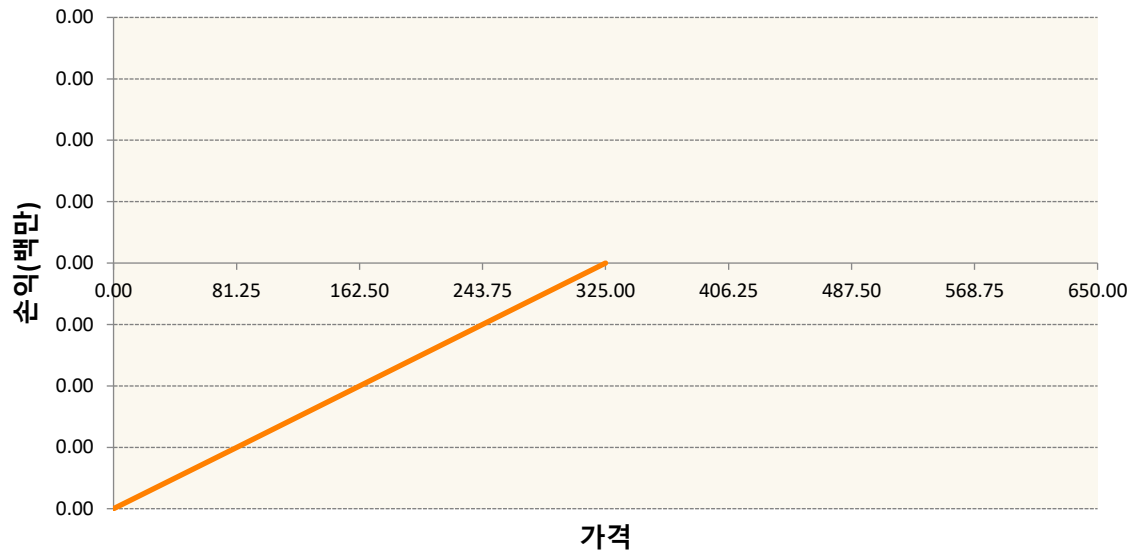
(단위:백만원)

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

2. 만기시점의 손익구조



KR4301T63253-2023-06 풋325



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201T63255		2023-06 콜325					2,998
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,617	1,591	1,561	1,527	1,491	1,452	1,410
-5.33%	1,414	1,362	1,309	1,254	1,199	1,144	1,088
-2.67%	919	862	804	746	688	629	571
0%	118	82	43	0	-45	-92	-140
2.67%	-865	-879	-897	-919	-945	-974	-1,006
5.33%	-1,914	-1,917	-1,922	-1,931	-1,942	-1,956	-1,974
8.00%	-2,976	-2,977	-2,978	-2,980	-2,984	-2,990	-2,998
KR4201T63271		2023-06 콜327.5					440
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	212	209	205	201	197	191	186
-5.33%	190	183	176	168	161	153	145
-2.67%	129	120	111	102	93	84	76
0%	21	14	7	0	-8	-15	-23
2.67%	-121	-124	-127	-131	-136	-141	-147
5.33%	-276	-277	-278	-280	-282	-285	-288
8.00%	-435	-435	-435	-436	-437	-438	-440
KR4301T63253		2023-06 풋325					429
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-379	-385	-393	-401	-410	-419	-429
-5.33%	-172	-184	-197	-210	-224	-237	-250
-2.67%	-35	-49	-63	-77	-91	-105	-119
0%	28	20	10	0	-11	-22	-34

2.67%	48	45	40	35	29	22	14
5.33%	52	51	50	48	45	42	37
8.00%	52	52	52	51	50	49	47

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

(단위:백만원)

4,102

공시일 2023-05-30

기준일 2023-05-26

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

* 해당 펀드는 파생상품을 포함하지 않음

2. 만기시점의 손익구조

* 해당 펀드는 파생상품을 포함하지 않음

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

* 해당 펀드는 파생상품을 포함하지 않음

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

* 해당 펀드는 파생상품을 포함하지 않음

공시일	2023-05-30
기준일	2023-05-26

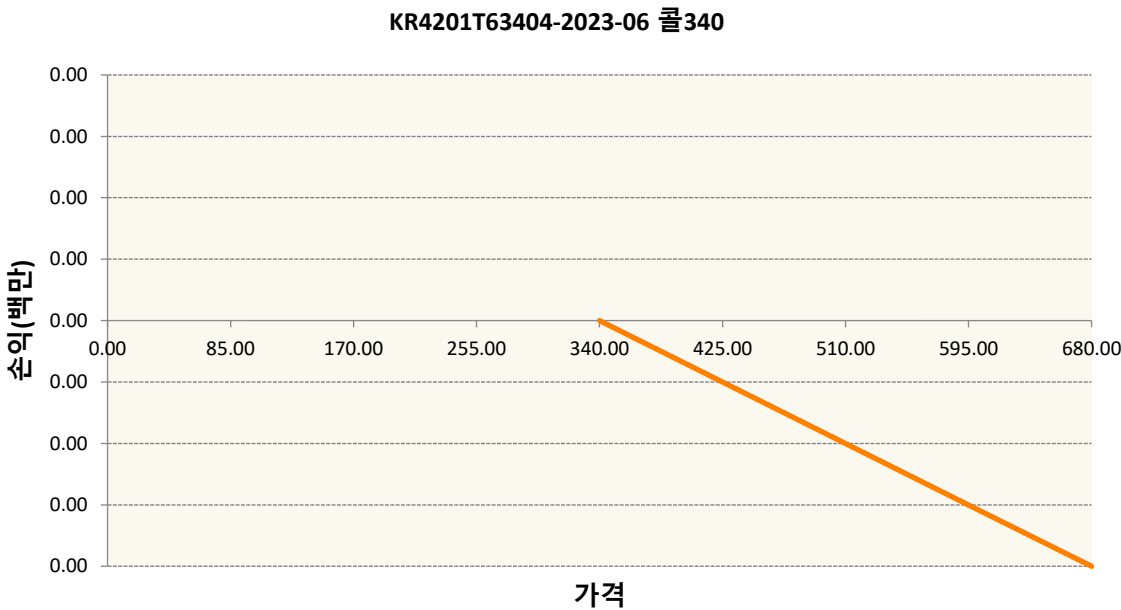
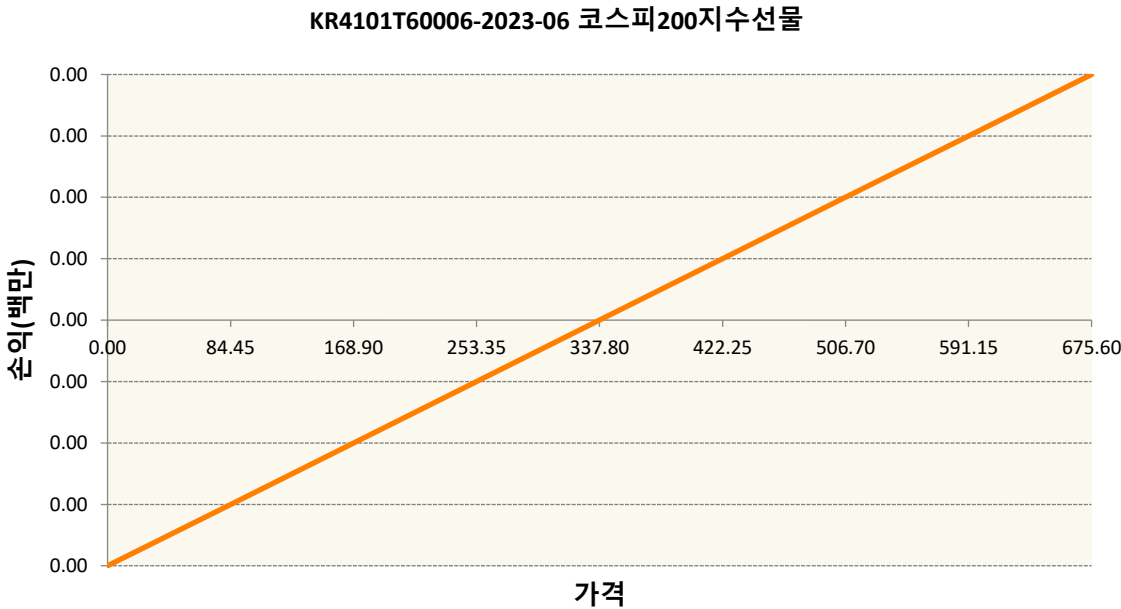
리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

1. 계약금액

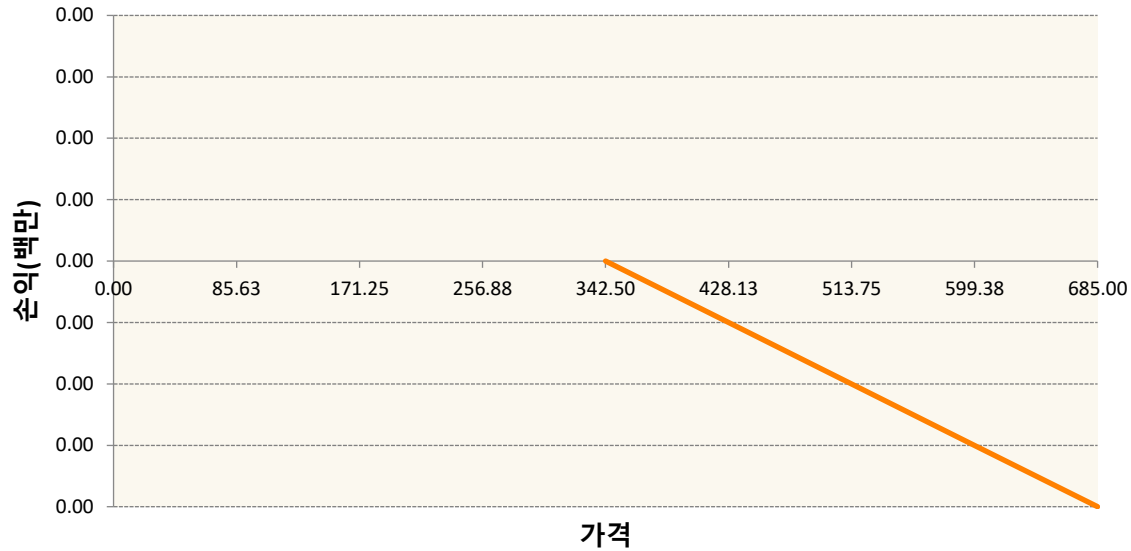
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	170	0	170	장내
누계	유가증권	선물	507	0	507	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,160	-3,160	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					66
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	16	16	16	16	16	15	15
-5.33%	16	15	15	14	14	13	12
-2.67%	13	12	11	10	8	7	6
0%	5	3	2	0	-2	-3	-5
2.67%	-12	-13	-15	-16	-18	-19	-21
5.33%	-35	-36	-37	-38	-39	-41	-42
8.00%	-63	-63	-64	-64	-65	-66	-66
KR4201T63420		2023-06 콜342.5					115
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	24	24	24	24	23	23	22
-5.33%	24	23	22	21	20	19	18
-2.67%	20	19	17	15	13	11	8
0%	9	6	3	0	-3	-6	-9

2.67%	-17	-20	-23	-26	-30	-33	-36
5.33%	-58	-60	-62	-64	-67	-69	-72
8.00%	-108	-108	-109	-111	-112	-114	-115

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

(단위:백만원)

224

공시일	2023-05-30
기준일	2023-05-26

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	6,704	0	6,704	

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	2023-05-30
기준일	2023-05-26

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	4,897	0	4,897	

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	2023-05-30
기준일	2023-05-26

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	18,323	0	18,323	
누계	통화	선도	662	27,834	-27,172	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
FXW213D2Q KRW/USD 31-05-23E		714
FXW213D3Q KRW/USD 28-06-23E		514
FXW213D4S(KRW/USD 31-07-23E		263
FXW213D52(USD/KRW 31-05-23E		53
FXW213D5A KRW/USD 31-05-23E		42
FXW213D5S(KRW/USD 31-08-23E		693
IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	3,819

공시일	2023-05-30
기준일	2023-05-26

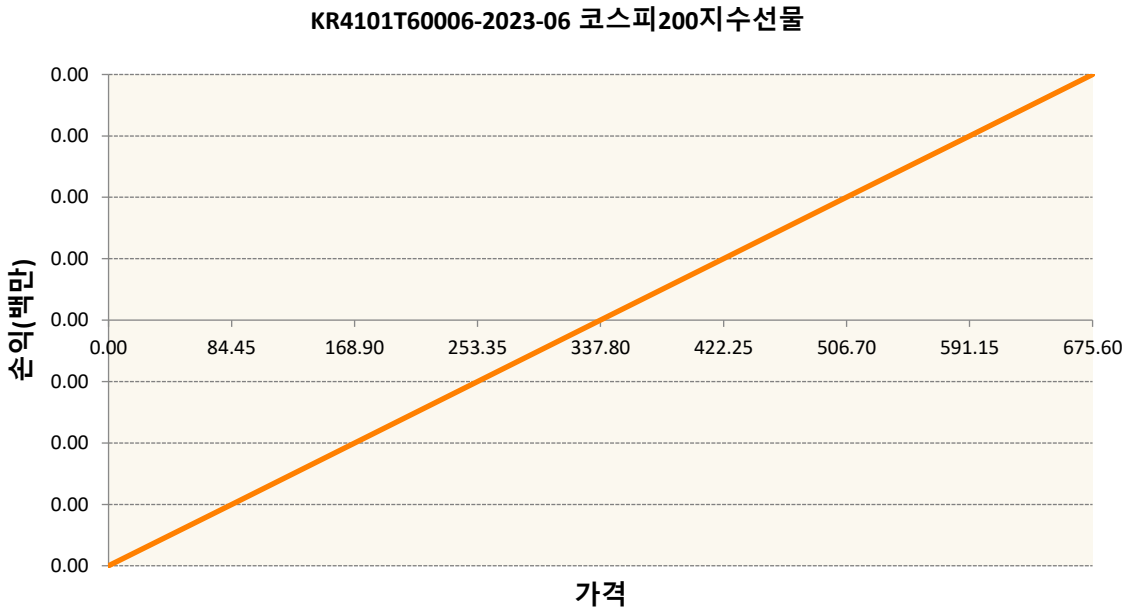
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

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	338	0	338	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101T60006			2023-06 코스피200지수선물				27
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-27	-27	-27	-27	-27	-27	-27
-5.33%	-18	-18	-18	-18	-18	-18	-18
-2.67%	-9	-9	-9	-9	-9	-9	-9
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	9	9	9	9	9	9	9
5.33%	18	18	18	18	18	18	18
8.00%	27	27	27	27	27	27	27

공시일	2023-05-30
기준일	2023-05-26

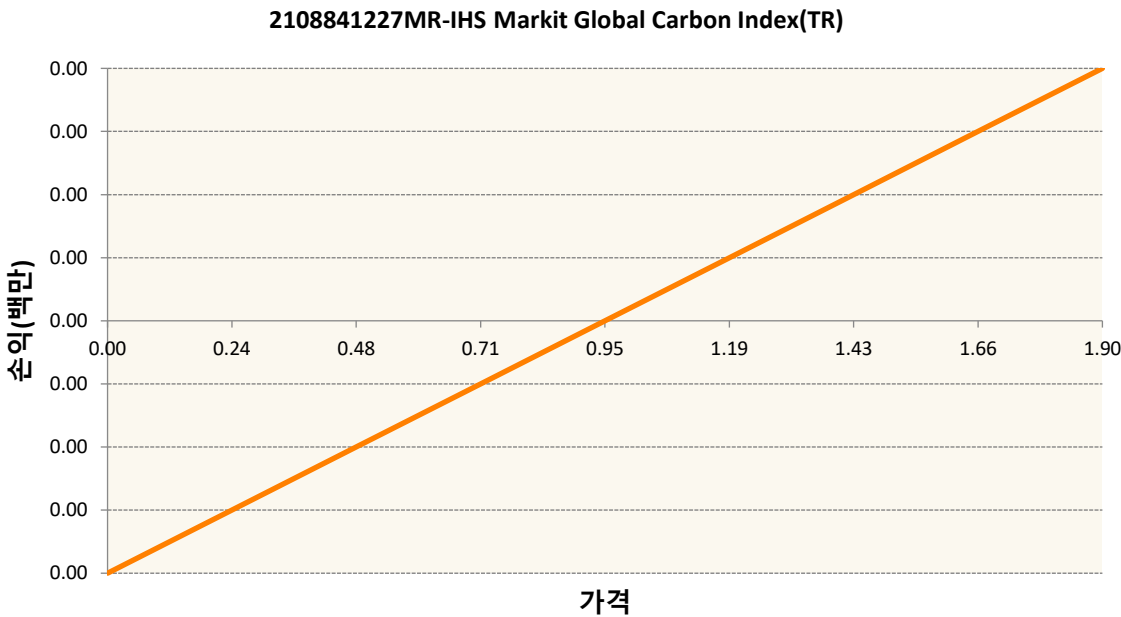
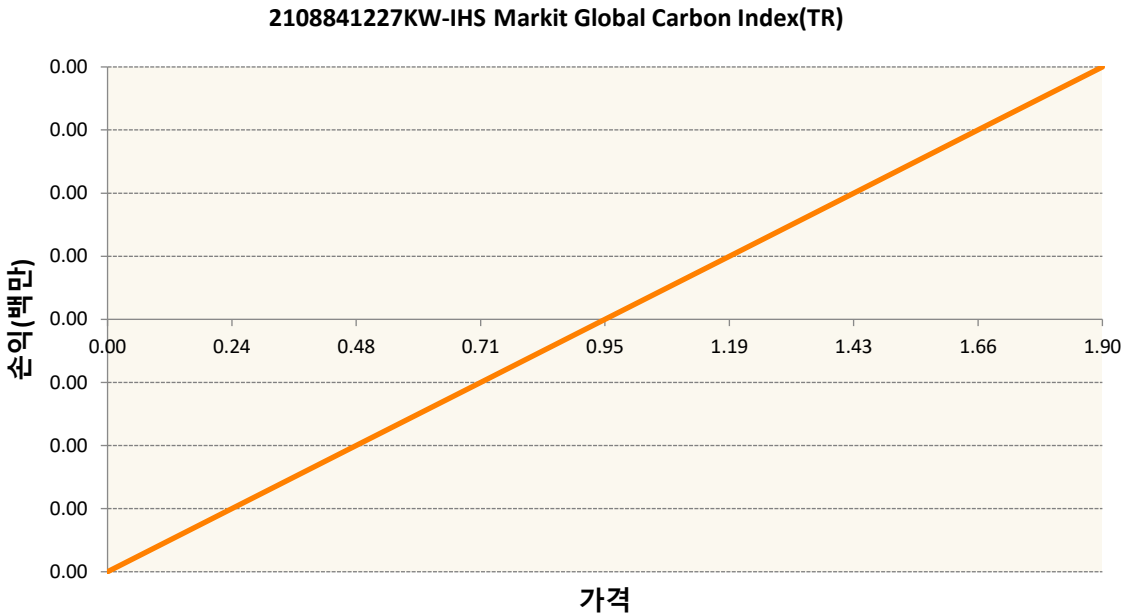
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

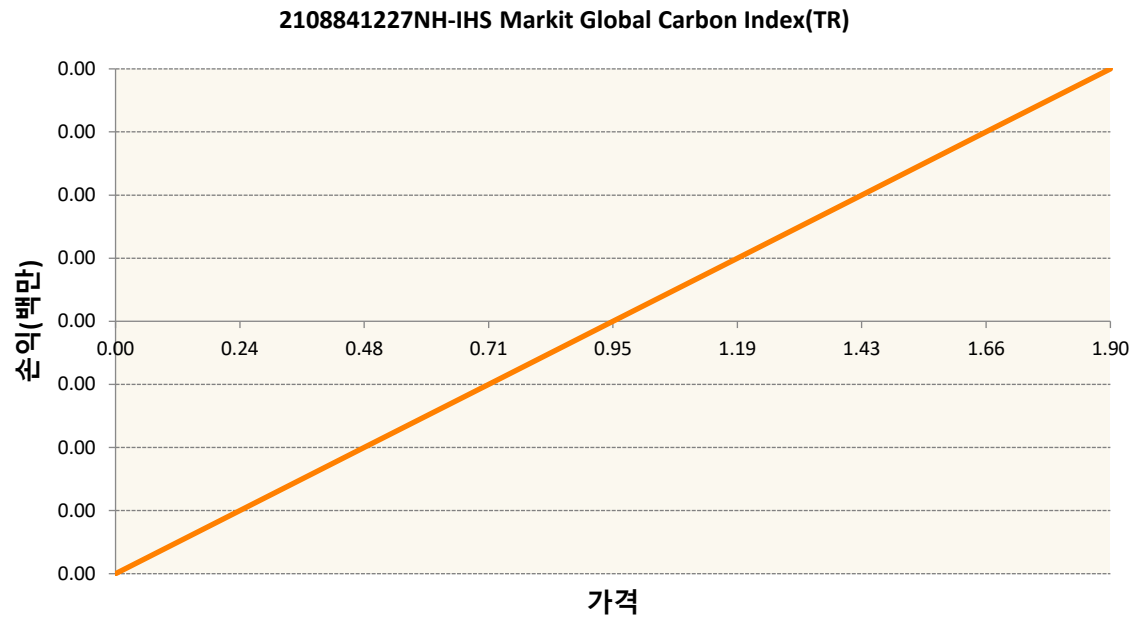
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	24,495	0	24,495	

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108841227IHS Markit Global Carbon Index(TR)		1,670
2108841227IHS Markit Global Carbon Index(TR)		196
2108841227IHS Markit Global Carbon Index(TR)		98

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)		(단위:백만원)
		3,329

공시일 2023-05-30

기준일 2023-05-26

SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

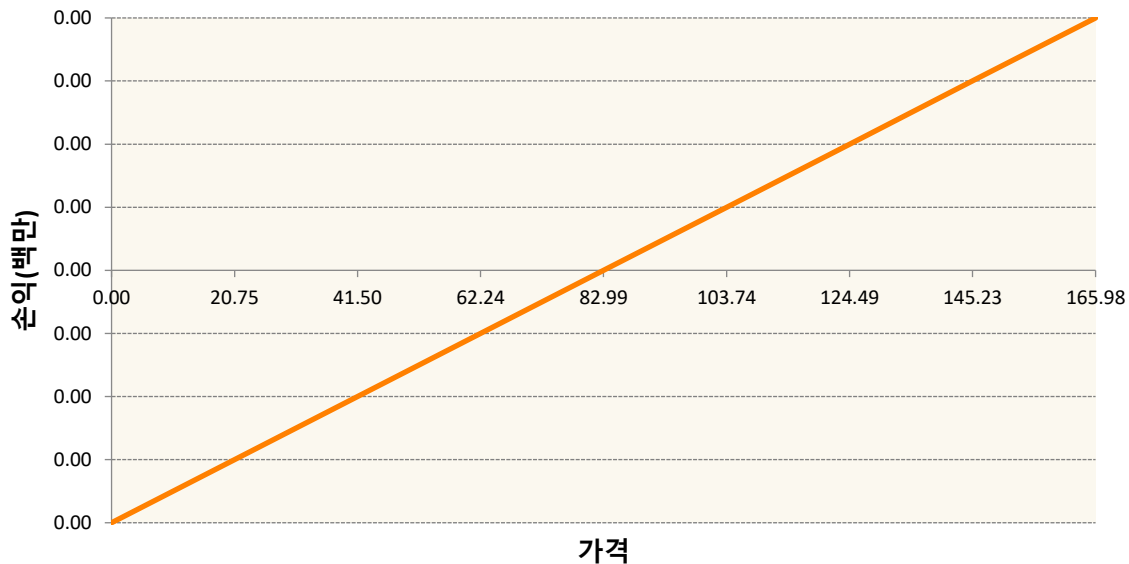
1. 계약금액

(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	8,496	0	8,496	
누계	통화	선도	0	4,050	-4,050	장외

2. 만기시점의 손익구조

MOZ23-ECX EMISSION Dec23



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
FXW213D5S(KRW/EUR 30-06-23E	40
FXW213D5S(KRW/EUR 30-06-23E	45
FXW213D5S(KRW/EUR 30-06-23E	68
MOZ23 ECX EMISSION Dec23	680

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

(단위:백만원)

1,413

공시일	2023-05-30
기준일	2023-05-26

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)	6
SWCSI00000 신한CSI Index 221222 (키움)	7
SWCSI00000 신한CSI Index 221222 (미래)	7
SWCSI00000 신한CSI Index 221222 (메리츠)	7

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

(단위:백만원)

49

공시일	2023-05-30
기준일	2023-05-26

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)		8
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 230116(메리츠)		11
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 230116(미래)		9
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 230427(키움)		4

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	54

공시일	2023-05-30
기준일	2023-05-26

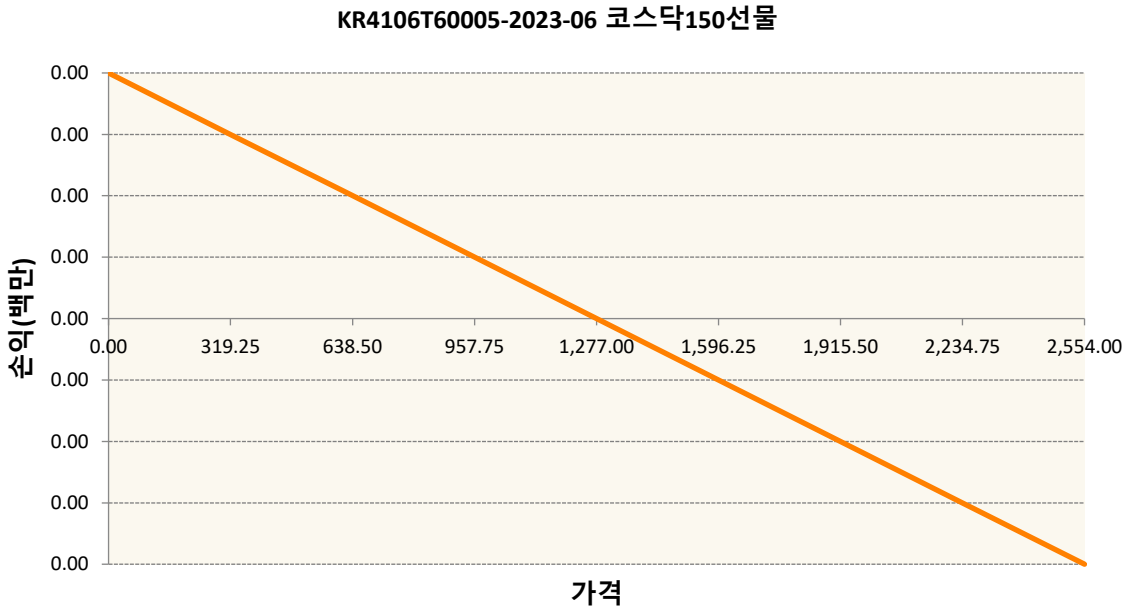
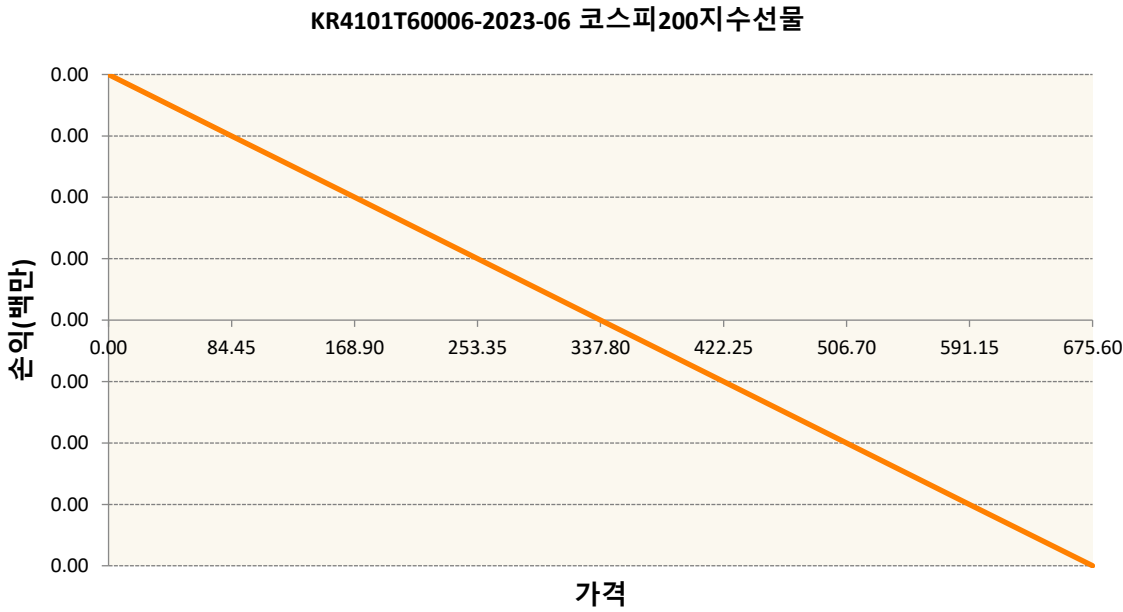
에쿼티알파일반사모혼합자산

1. 계약금액

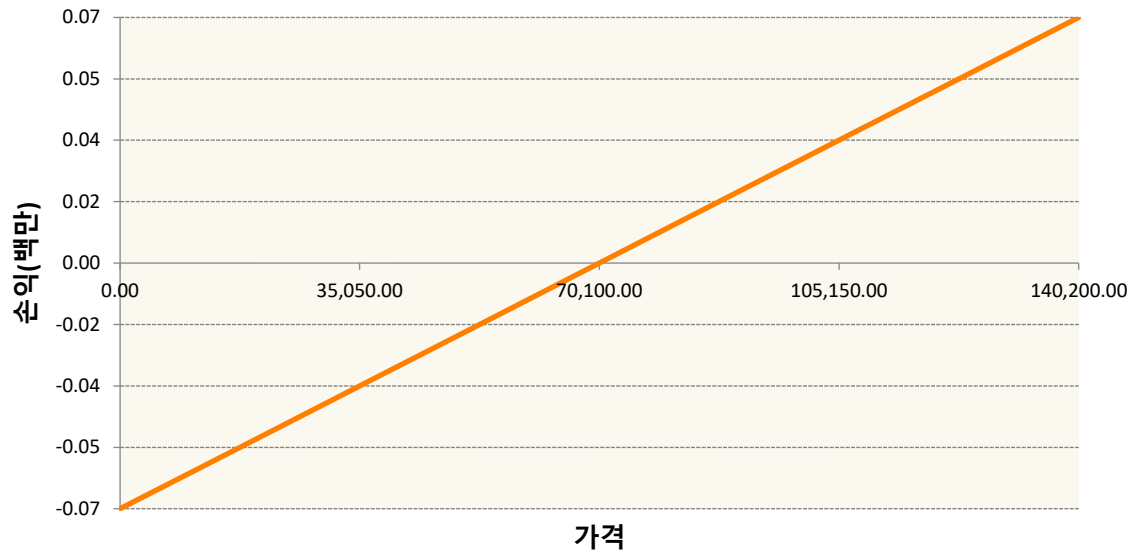
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	675	0	675	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,017	1,803	-786	장내
누계	유가증권	스왑	0	0	0	장외

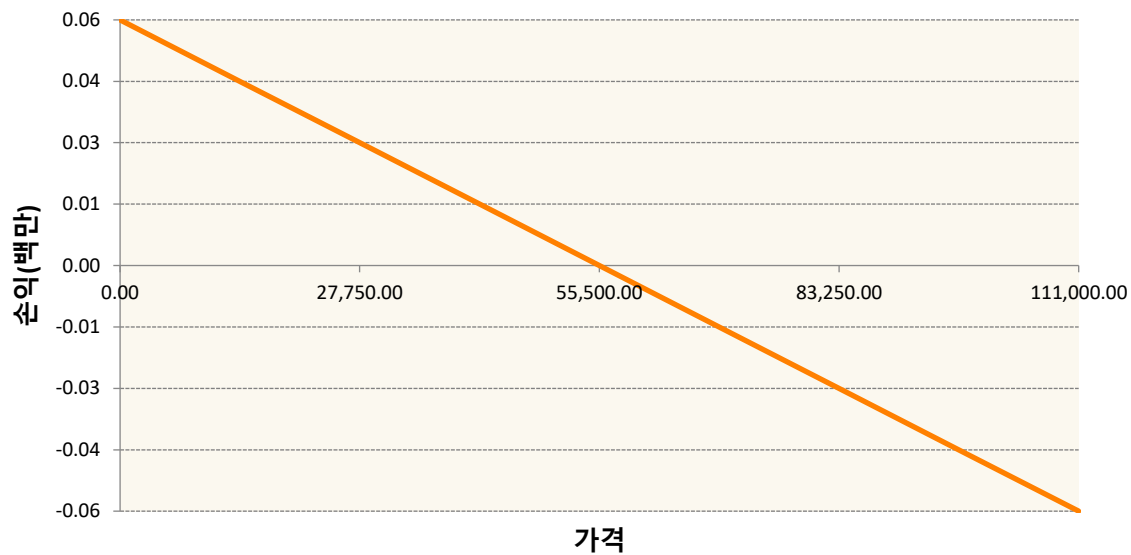
2. 만기시점의 손익구조



KR4111T60005-2023-06 삼성전자개별선물



KR41F7T60007-2023-06 카카오페이개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101T600 2023-06 코스피200지수선물	41
KR4106T600 2023-06 코스닥150선물	97
KR4111T600 2023-06 삼성전자개별선물	81
KR41F7T600 2023-06 카카오페이개별선물	7
KRS0004099 SWAP_MICRON TECH_0308	0.42
KRS0004212 SWAP_SPDR S&P BIOTECH_0413	0.24

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

(단위:백만원)

383

공시일	2023-05-30
기준일	2023-05-26

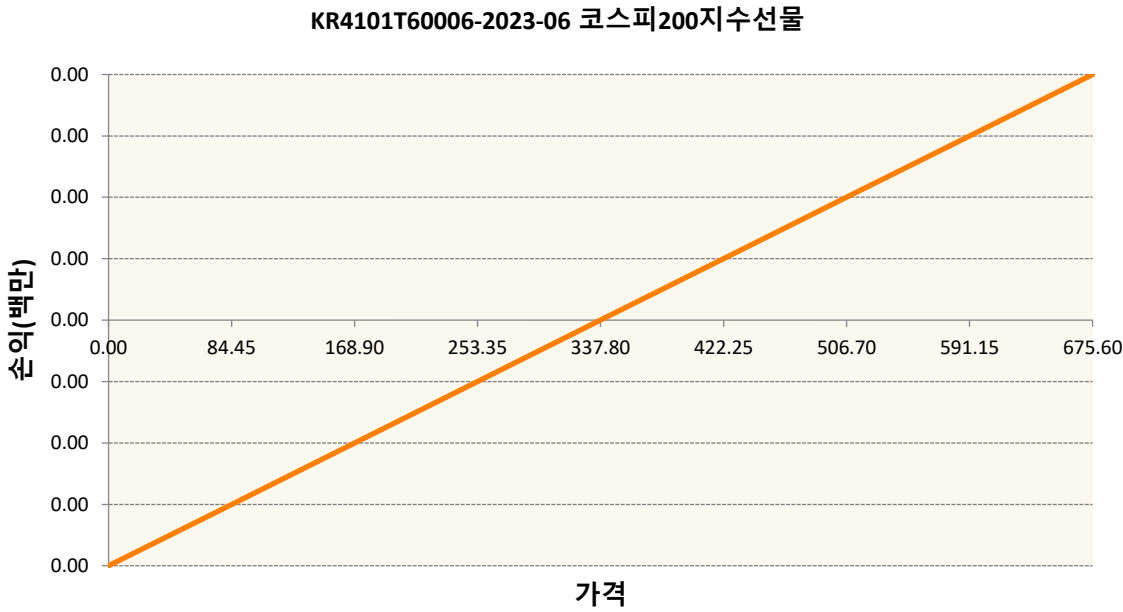
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

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	676	0	676	장내

2. 만기시점의 손익구조



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	2023-05-30
기준일	2023-05-26

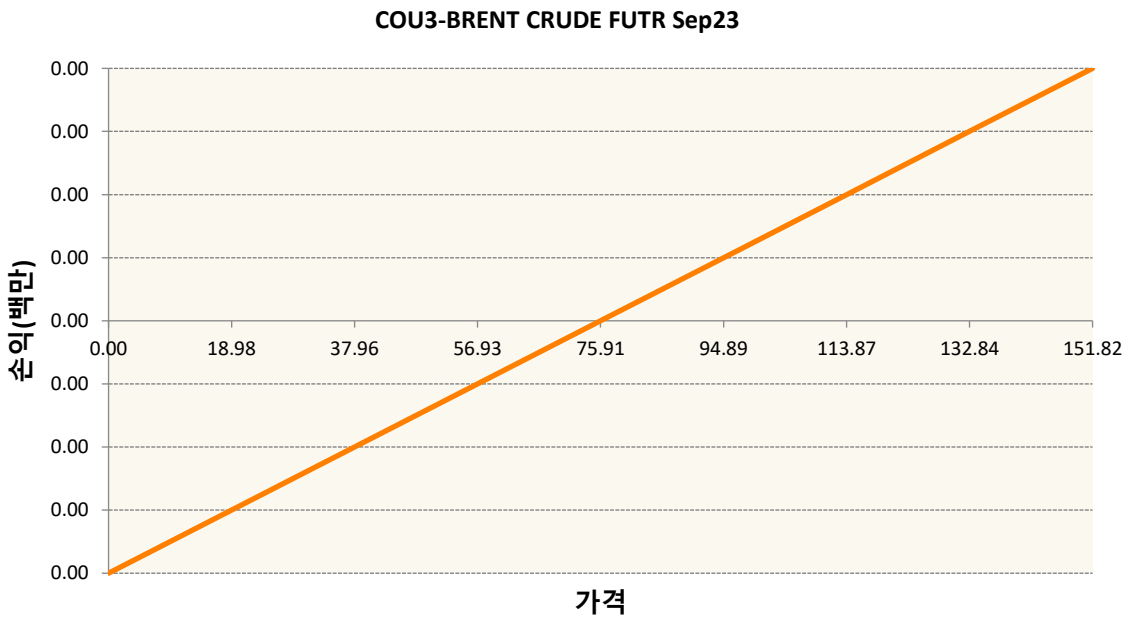
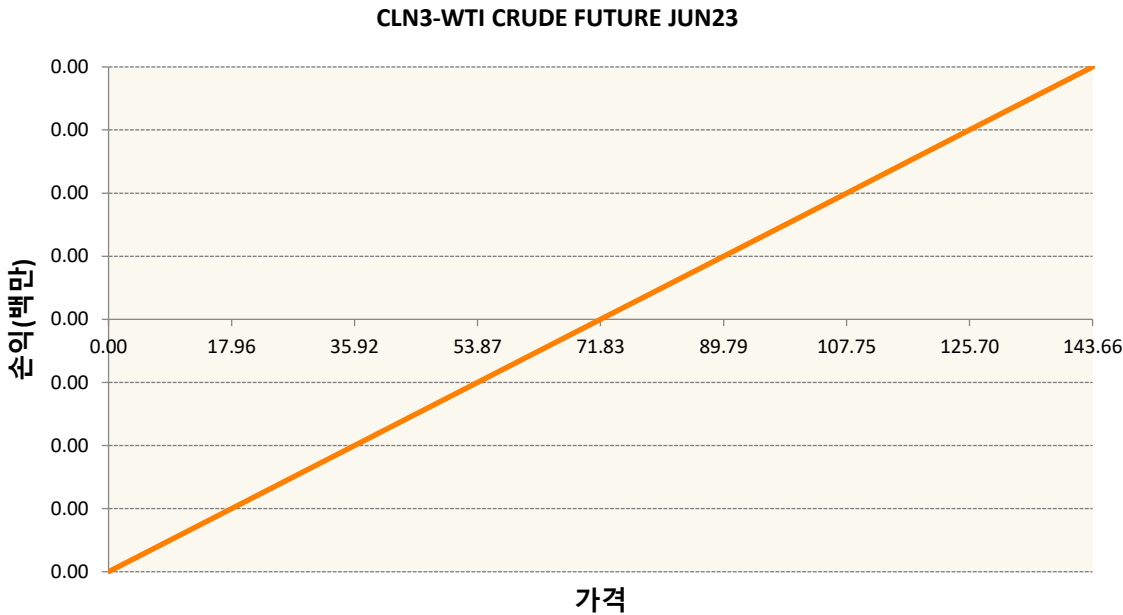
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

1. 계약금액

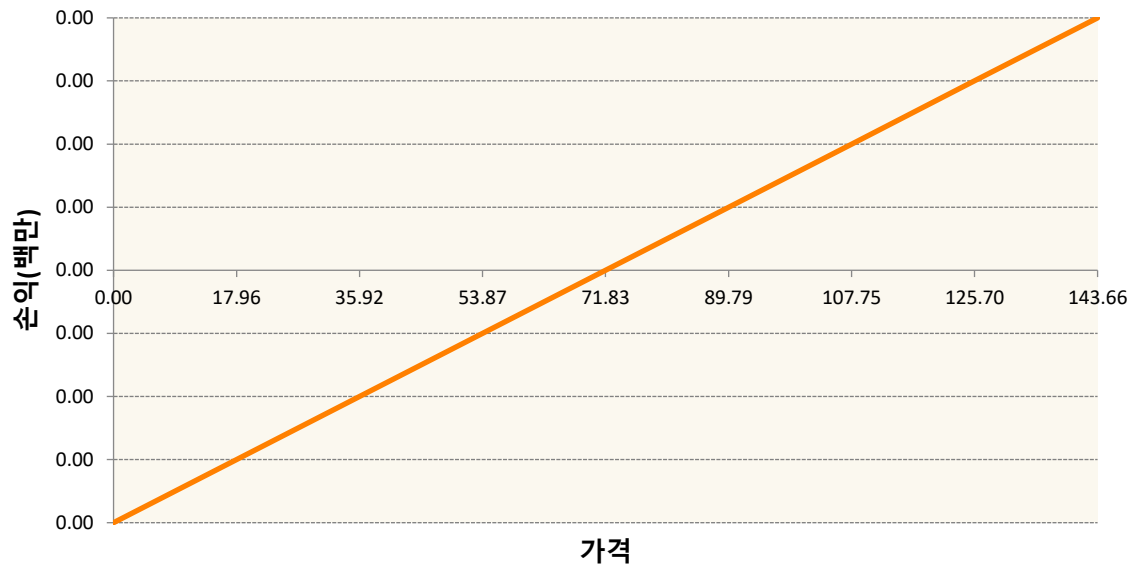
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,298	212	1,086	

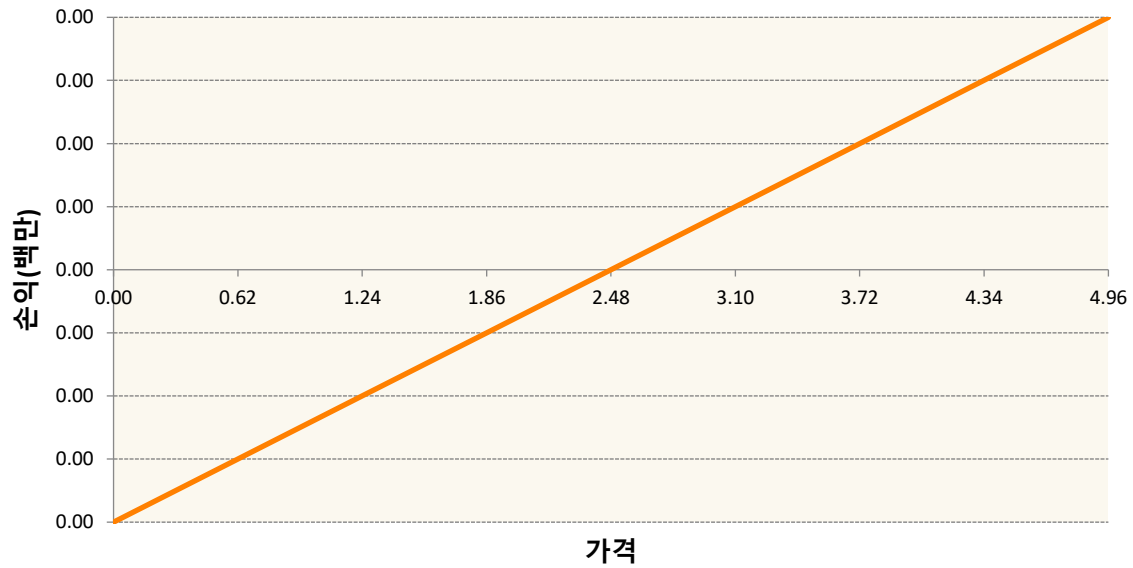
2. 만기시점의 손익구조



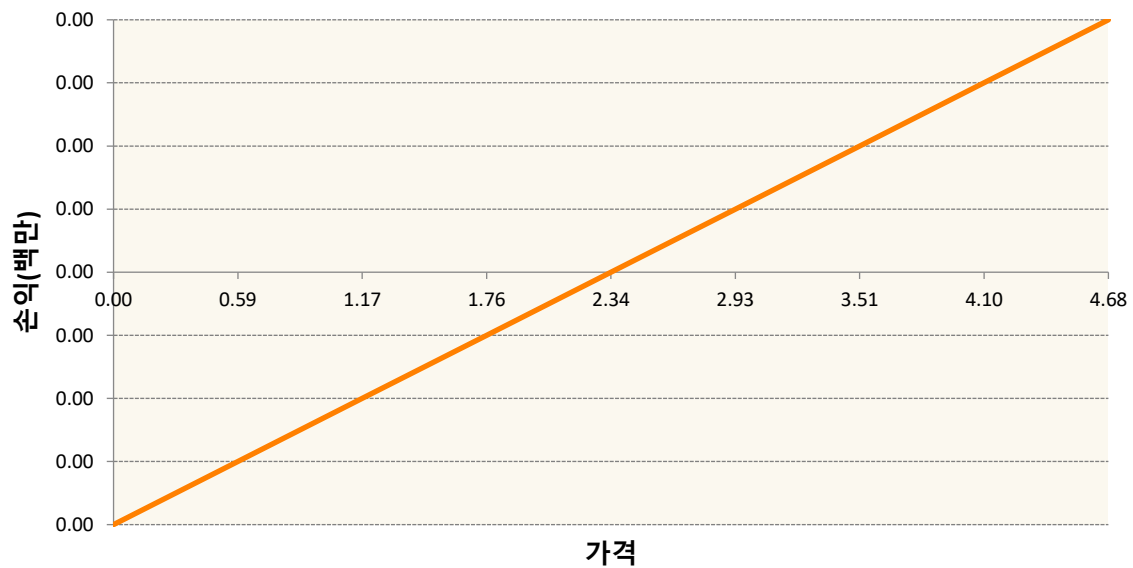
ECN3-E-mini Crude Oil Jul23



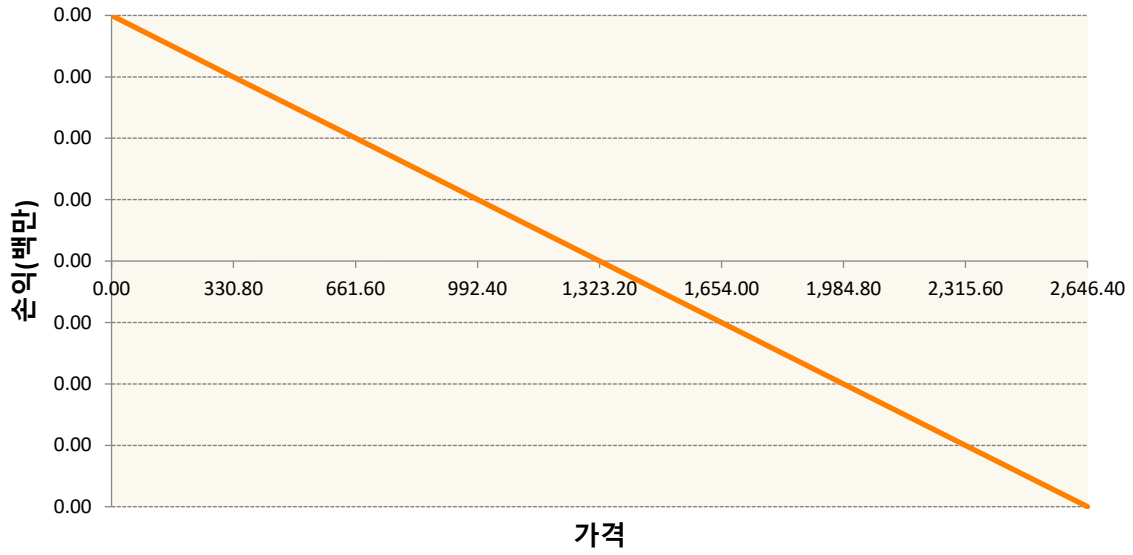
EON3-E-MINI NATURAL GAS Jul23



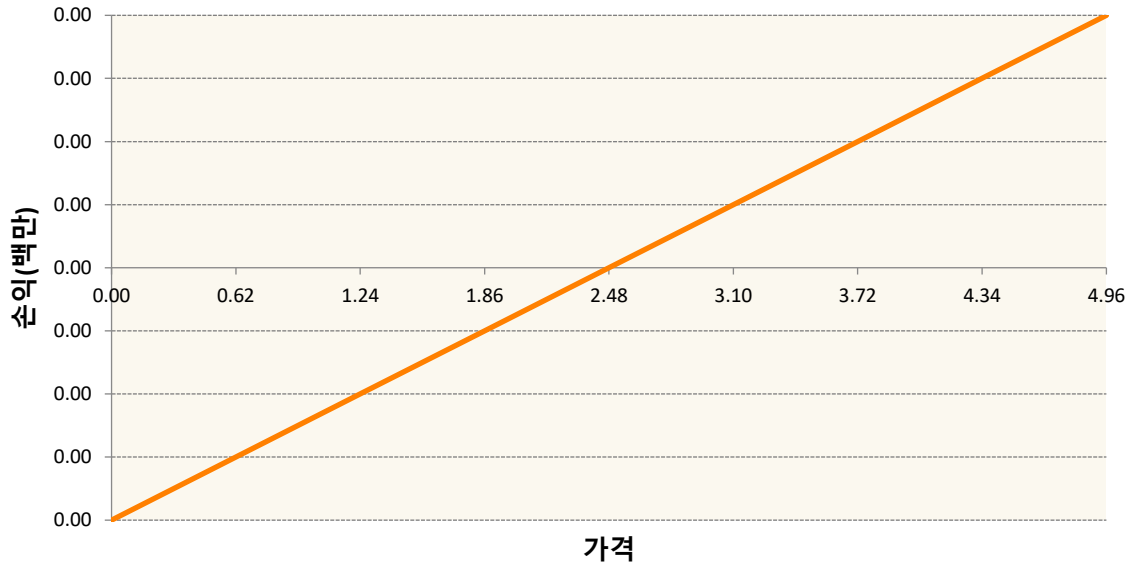
HON3-NY Harb ULSD Fut Jul23



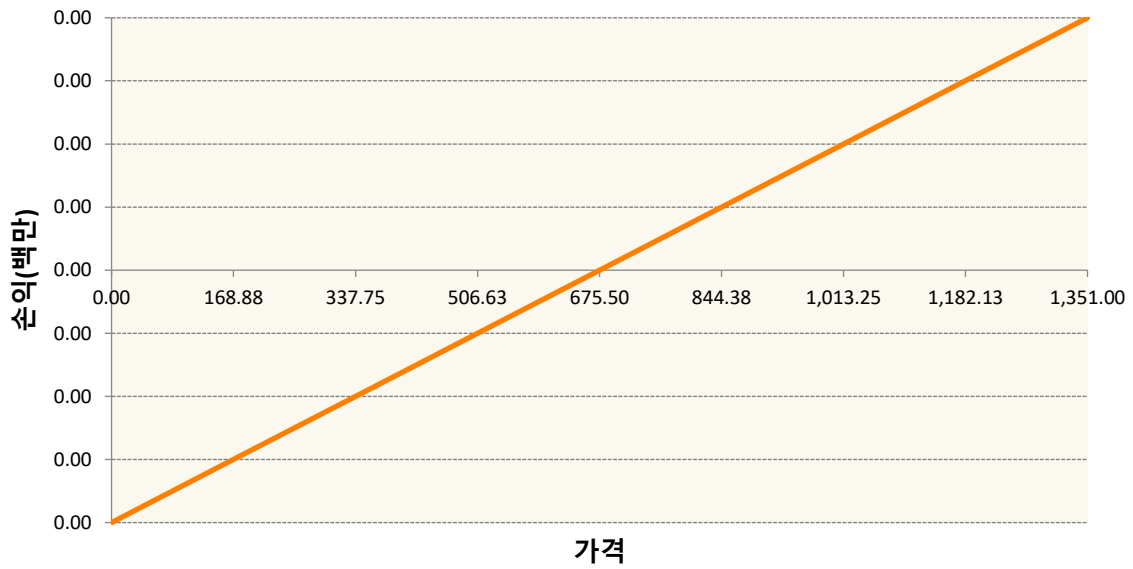
KR4175T60000-2023-06 달러선물

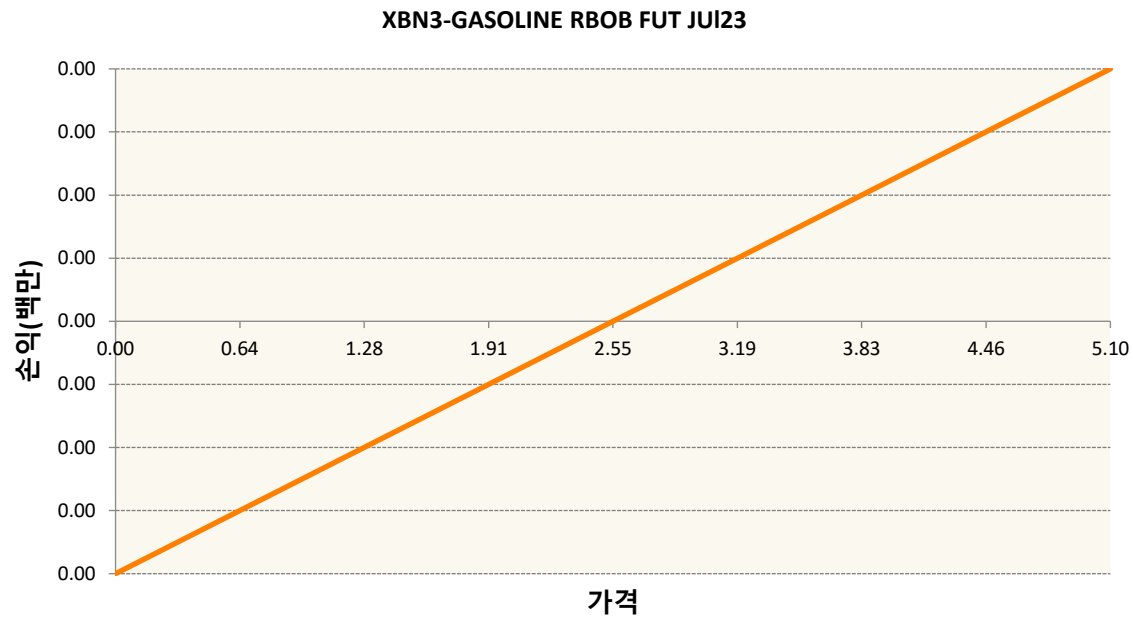


NGN23-NATURAL GAS FUTR JUL23



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	23
QSN3	Low Su Gasoil G JUL23	7
XBN3	GASOLINE RBOB FUT JUL23	11

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	205