

공시일	2023-06-12
기준일	2023-06-09

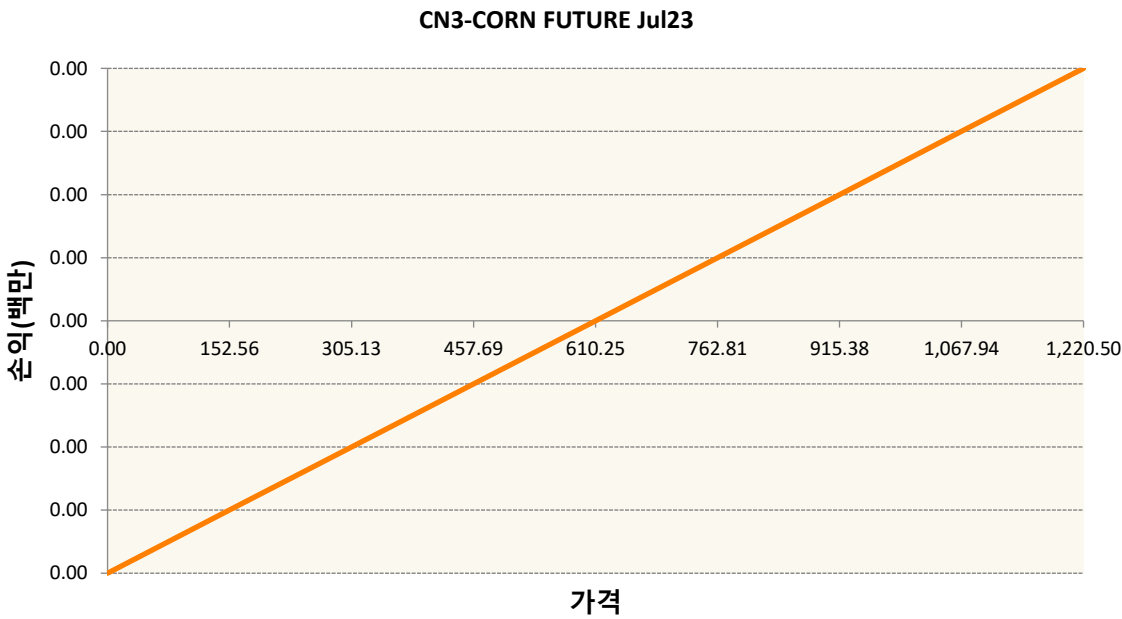
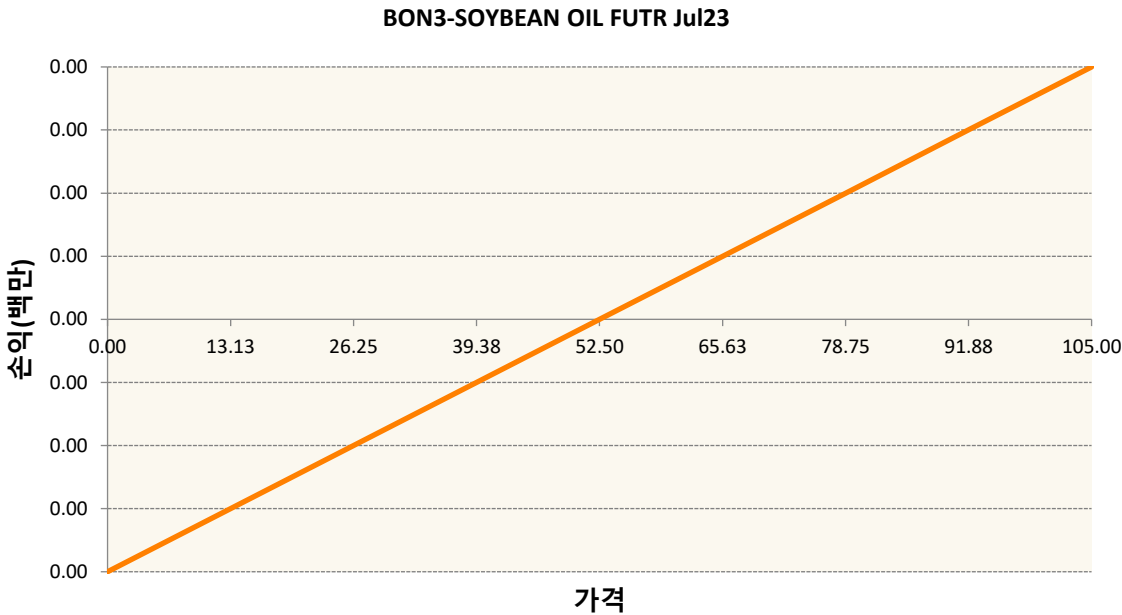
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

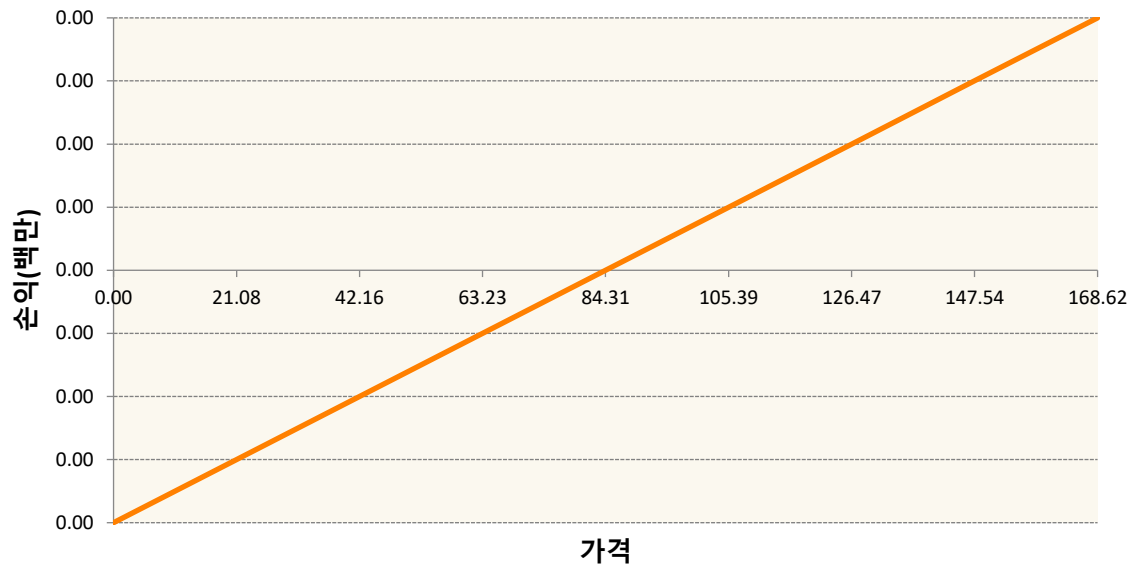
(단위:USD 백만)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,333	361	4,971	

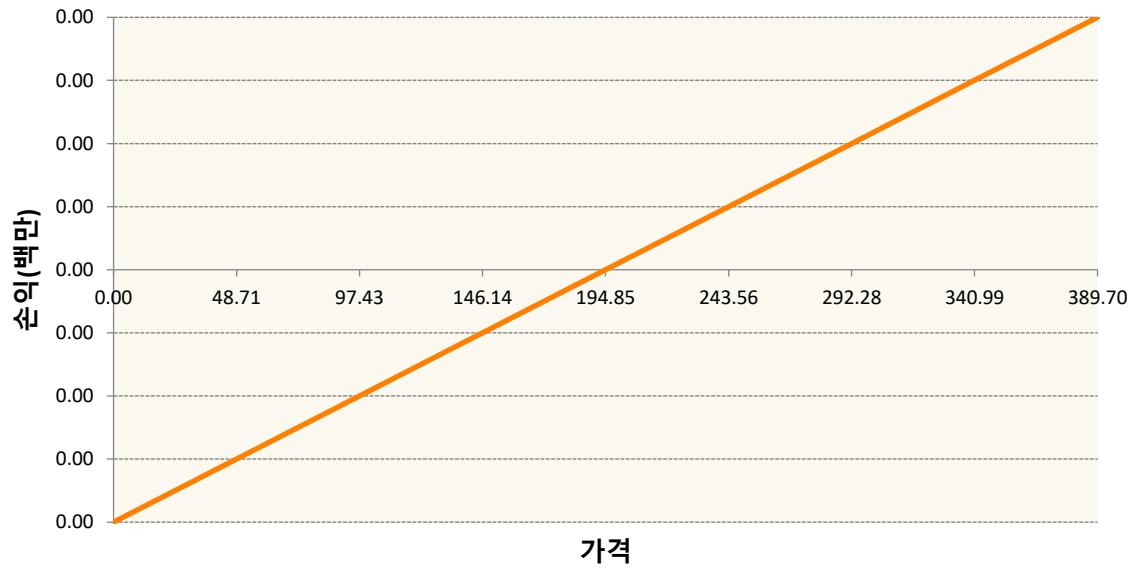
2. 만기시점의 손익구조



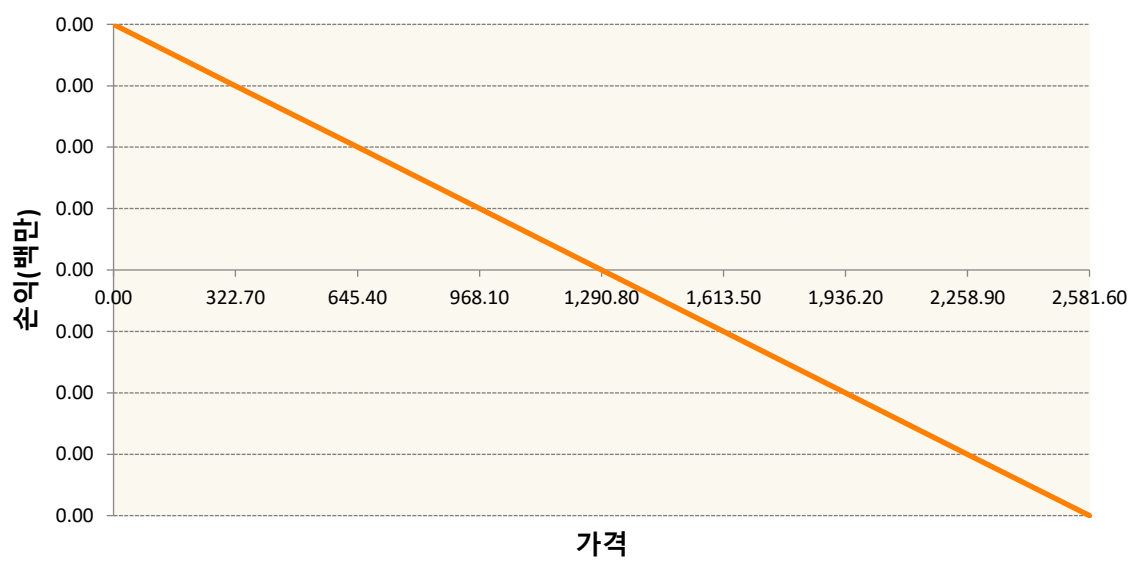
CTN3-COTTON NO.2 FUTR Jul23



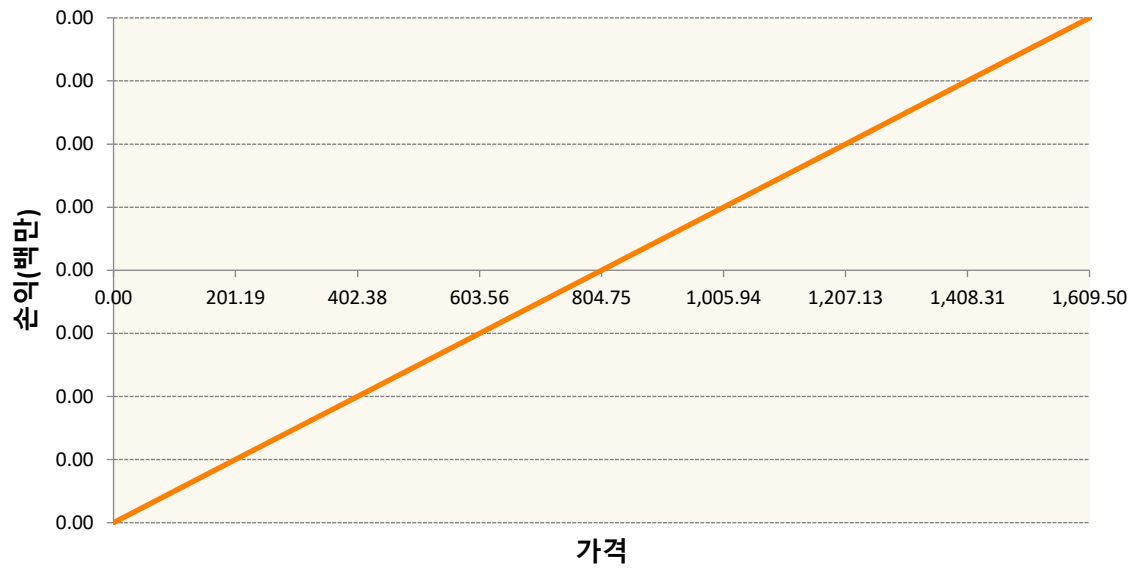
KCN3-COFFEE 'C' FUTURE Jul23



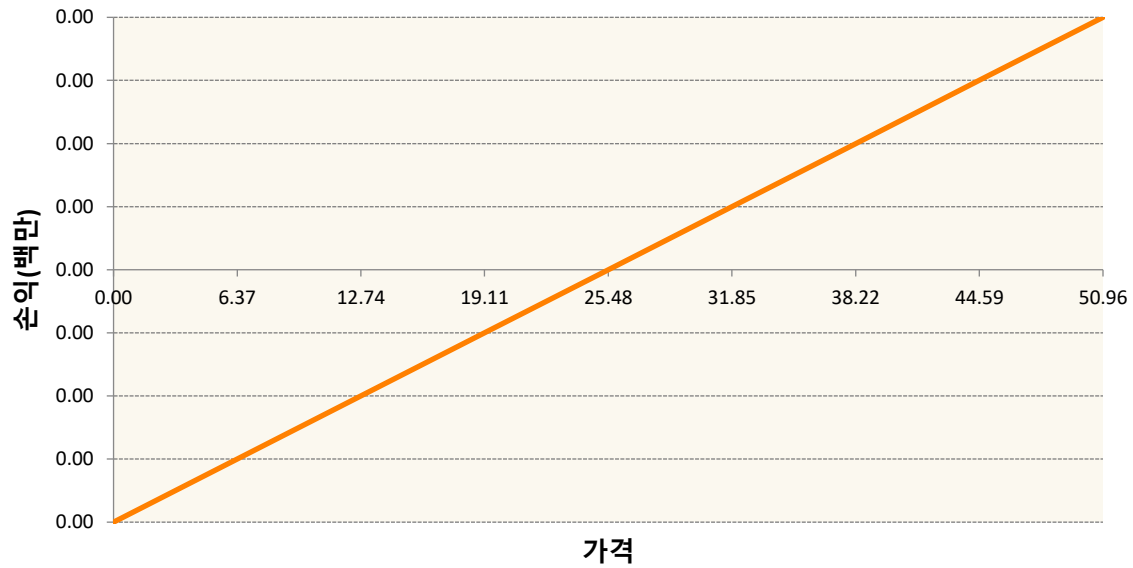
KR4175T60000-2023-06 달러선물



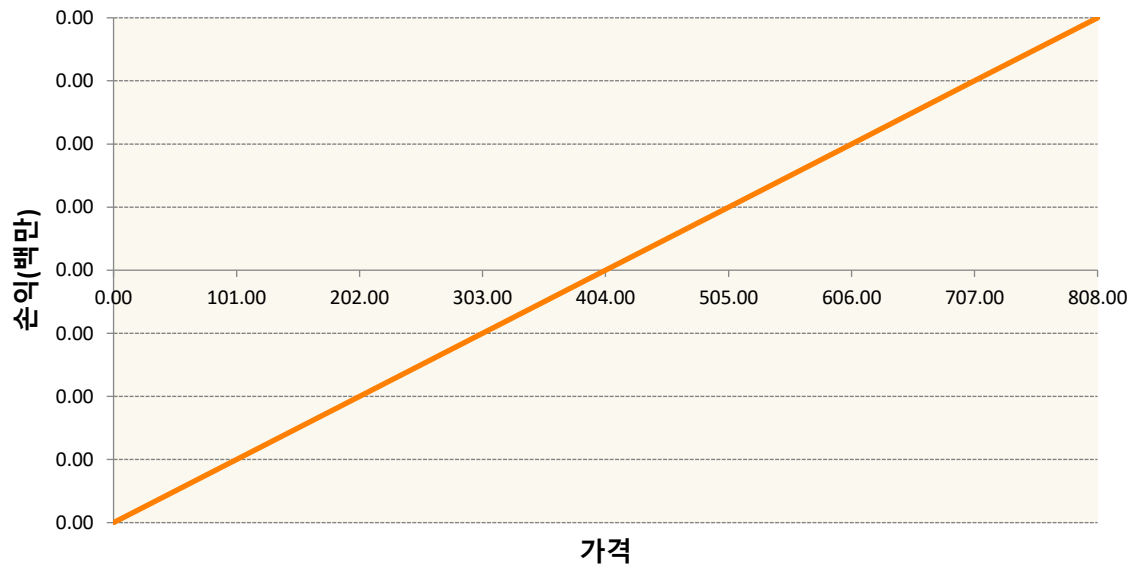
KWN3-KC HRW WHEAT FUT Jul23

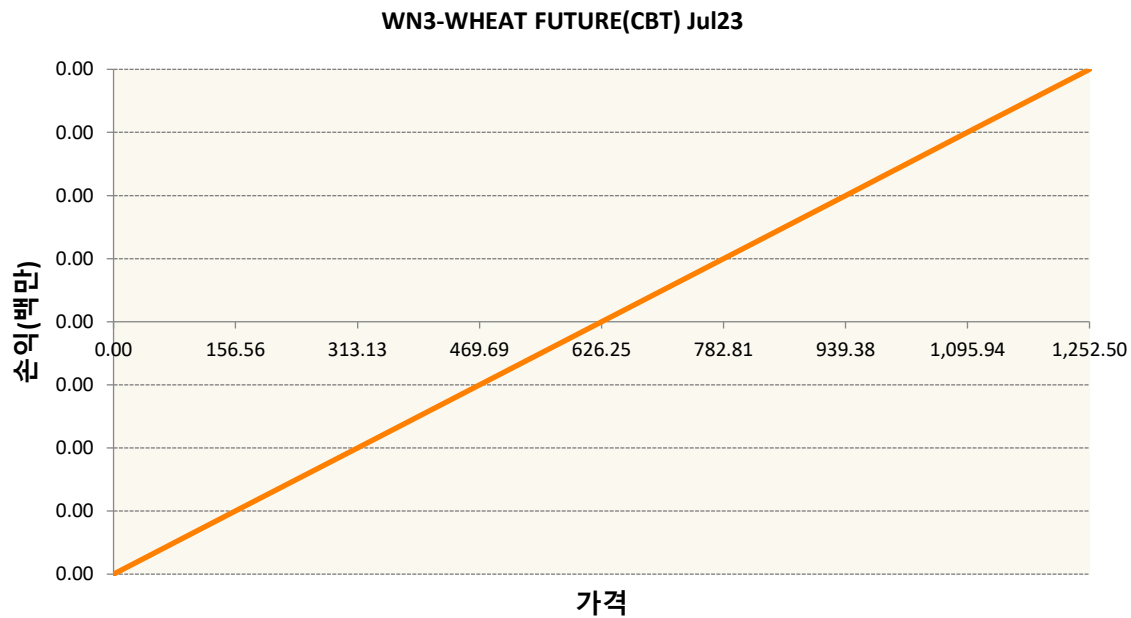
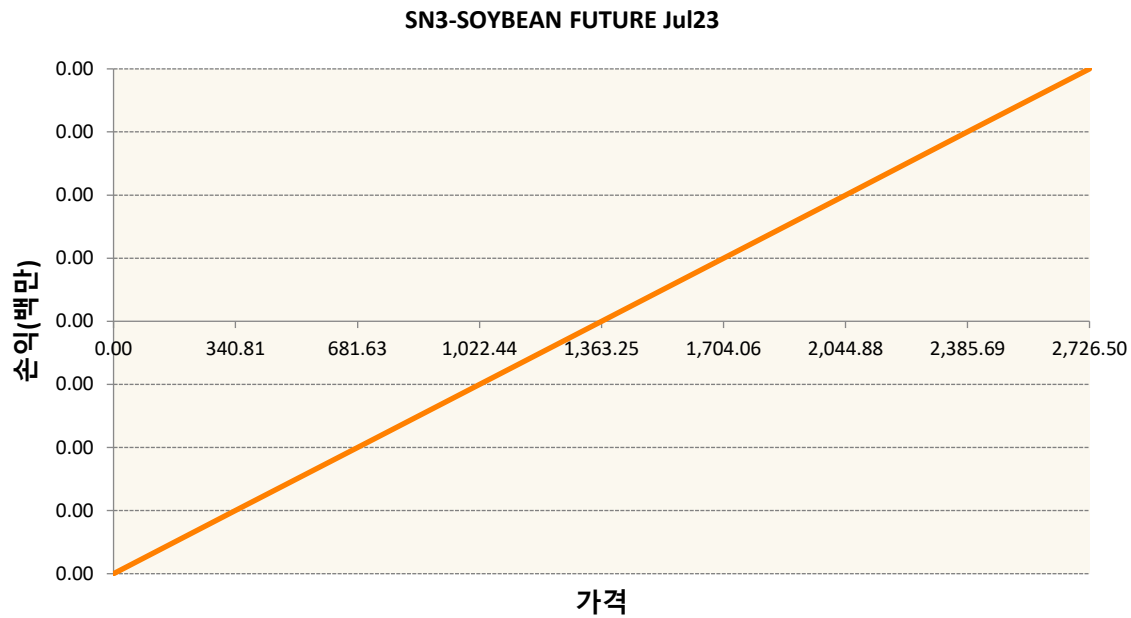


SBN3-Sugar #11 (WORLD) Jul23



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	2023-06-12
기준일	2023-06-09

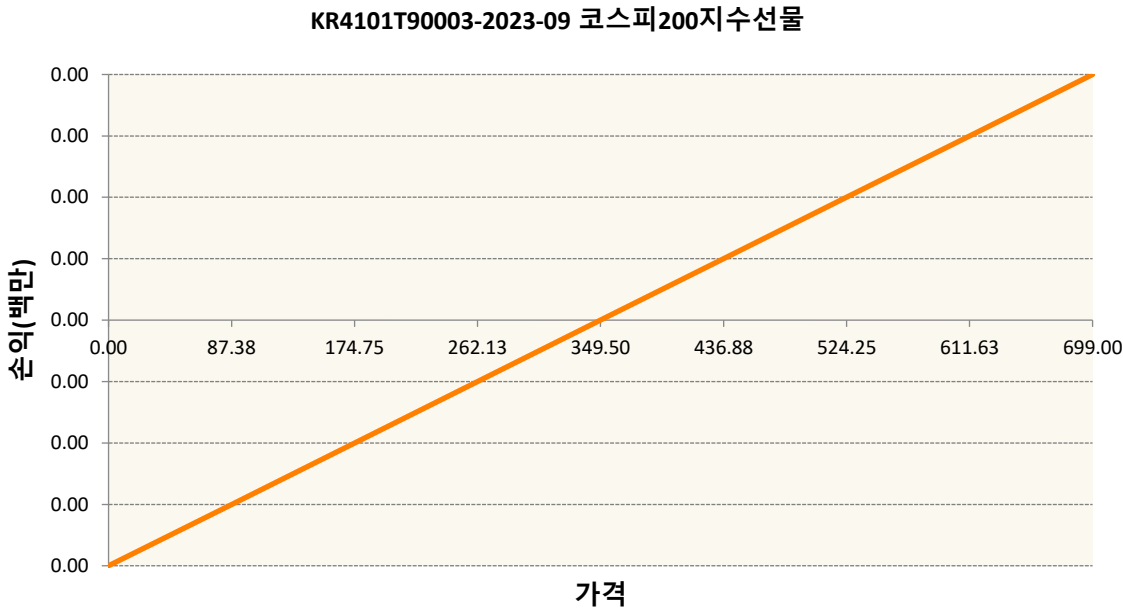
스마트인덱스모

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	87	0	87	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101T90003			2023-09 코스피200지수선물				7
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-7	-7	-7	-7	-7	-7	-7
-5.33%	-5	-5	-5	-5	-5	-5	-5
-2.67%	-2	-2	-2	-2	-2	-2	-2
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	2	2	2	2	2	2	2
5.33%	5	5	5	5	5	5	5
8.00%	7	7	7	7	7	7	7

공시일	2023-06-12
기준일	2023-06-09

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	339
-----------------------------	-----

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

573

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2023-06-12
기준일	2023-06-09

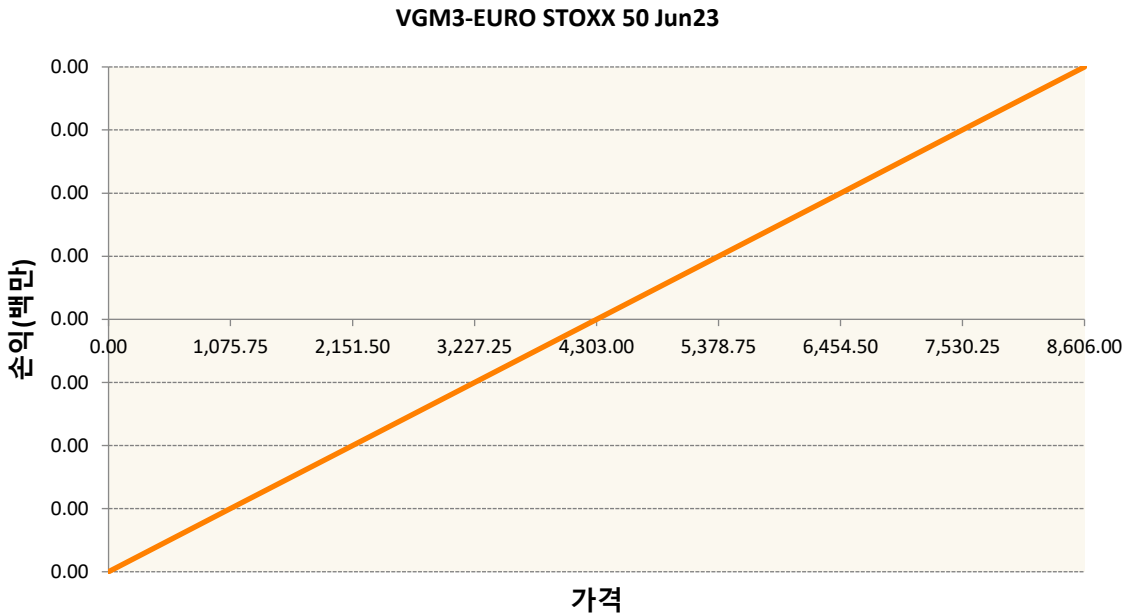
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	546	0	546	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM3	EURO STOXX 50 Jun23	44
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

74

공시일	2023-06-12
기준일	2023-06-09

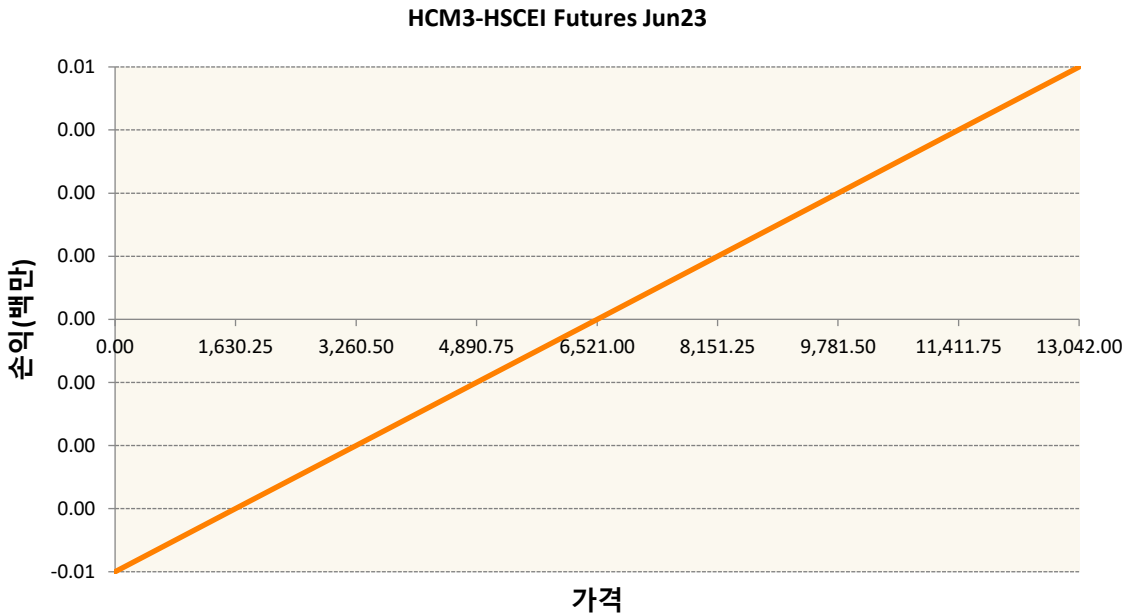
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,047	0	1,047	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCM3	HSCEI Futures Jun23	84
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

142

공시일	2023-06-12
기준일	2023-06-09

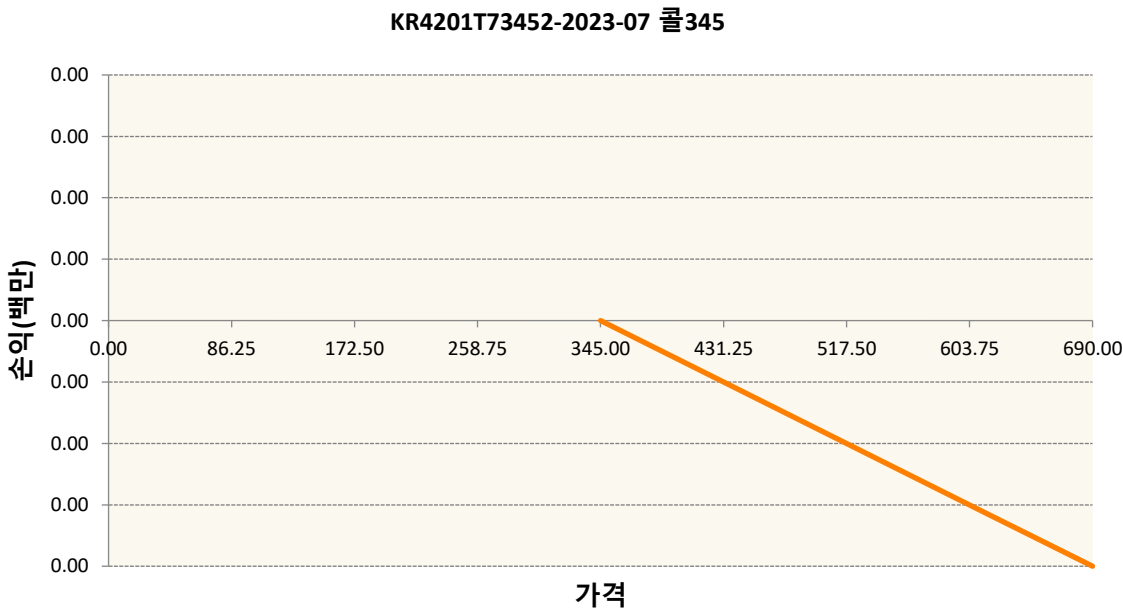
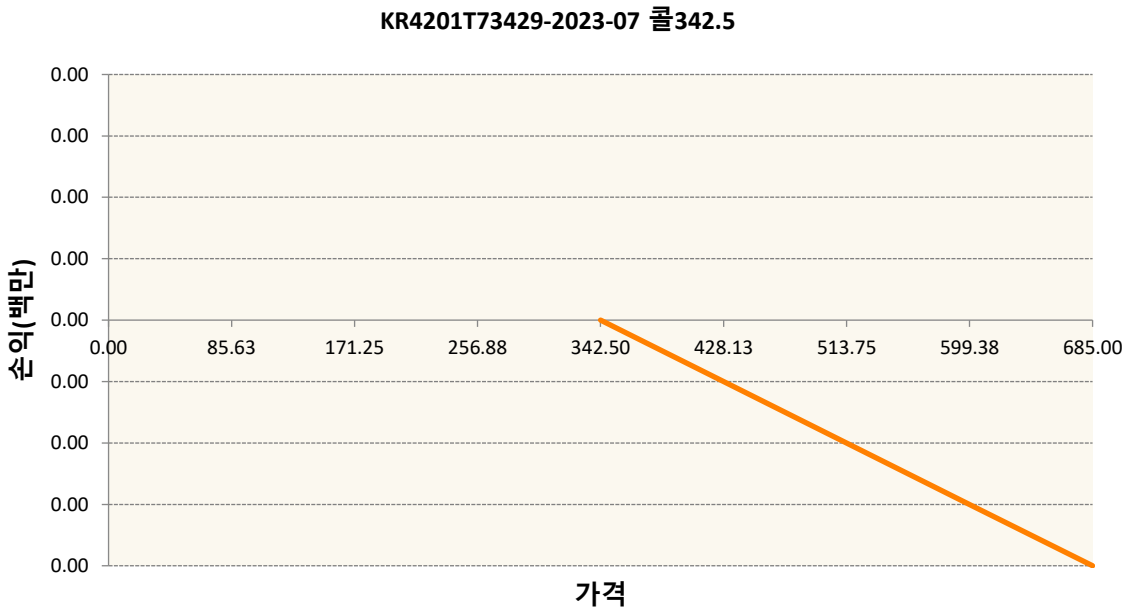
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

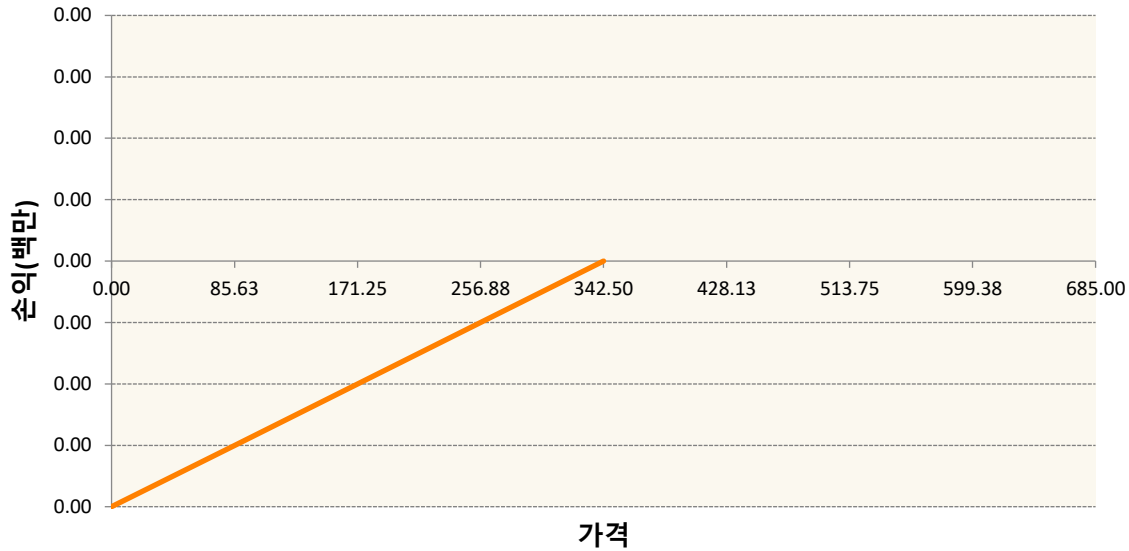
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	20,025	-20,025	장내
누계	유가증권	옵션	0	54,840	-54,840	장내

2. 만기시점의 손익구조



KR4301T73427-2023-07 풋342.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201T73429			2023-07 콜342.5				2,635
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,360	1,315	1,264	1,207	1,146	1,081	1,013
-5.33%	1,182	1,109	1,032	953	871	788	703
-2.67%	836	743	649	555	461	367	272
0%	284	190	95	0	-95	-191	-287
2.67%	-466	-543	-624	-707	-792	-879	-968
5.33%	-1,368	-1,420	-1,478	-1,542	-1,610	-1,682	-1,757
8.00%	-2,364	-2,393	-2,429	-2,473	-2,522	-2,576	-2,635
KR4201T73452			2023-07 콜345				351
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	170	165	159	151	143	135	126
-5.33%	150	141	131	120	109	98	87
-2.67%	109	96	83	71	58	45	32
0%	40	27	14	0	-14	-27	-41
2.67%	-55	-67	-79	-91	-104	-117	-129
5.33%	-174	-182	-191	-201	-212	-222	-234
8.00%	-307	-312	-318	-325	-333	-341	-351
KR4301T73427			2023-07 풋342.5				522
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-441	-451	-463	-477	-491	-506	-522
-5.33%	-229	-246	-264	-283	-302	-322	-342
-2.67%	-57	-79	-101	-123	-145	-167	-190
0%	67	45	22	0	-22	-45	-68

2.67%	144	126	107	87	67	46	25
5.33%	185	173	159	144	128	111	93
8.00%	204	197	188	178	166	153	139

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

(단위:백만원)

3,388

공시일 2023-06-12

기준일 2023-06-09

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

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	2023-06-12
기준일	2023-06-09

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	6,399	0	6,399	

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	2023-06-12
기준일	2023-06-09

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	4,863	0	4,863	

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	2023-06-12
기준일	2023-06-09

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	18,541	0	18,541	
누계	통화	선도	0	17,920	-17,920	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
FXW213D3Q KRW/USD 28-06-23E		501
FXW213D4S(KRW/USD 31-07-23E		257
FXW213D5S(KRW/USD 31-08-23E		676
IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	3,334

공시일	2023-06-12
기준일	2023-06-09

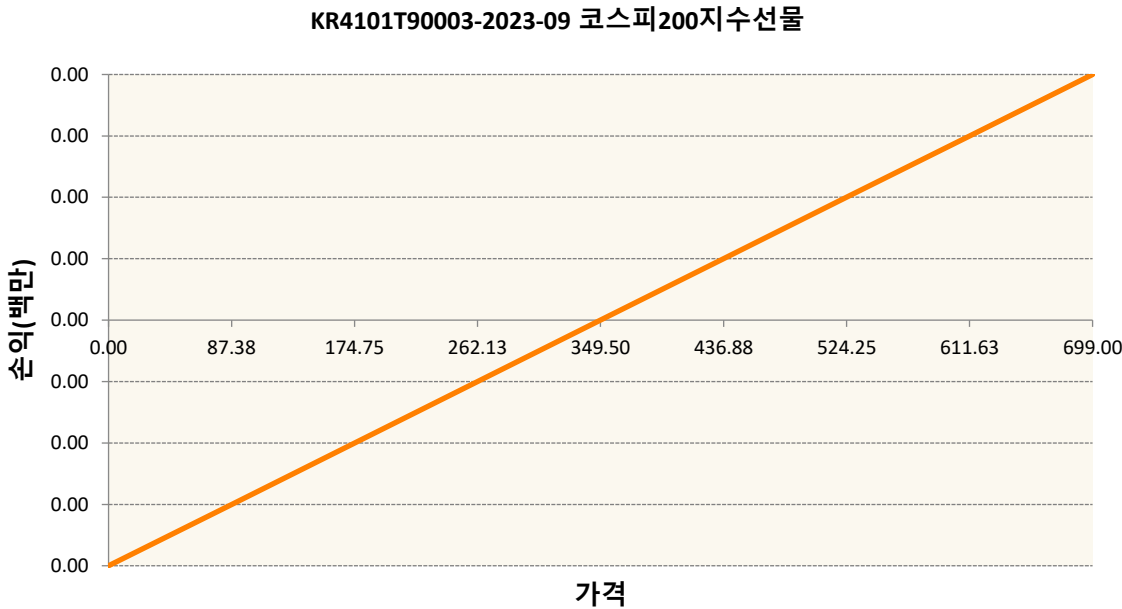
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

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	350	0	350	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101T90003			2023-09 코스피200지수선물				28
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-28	-28	-28	-28	-28	-28	-28
-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%	28	28	28	28	28	28	28

공시일	2023-06-12
기준일	2023-06-09

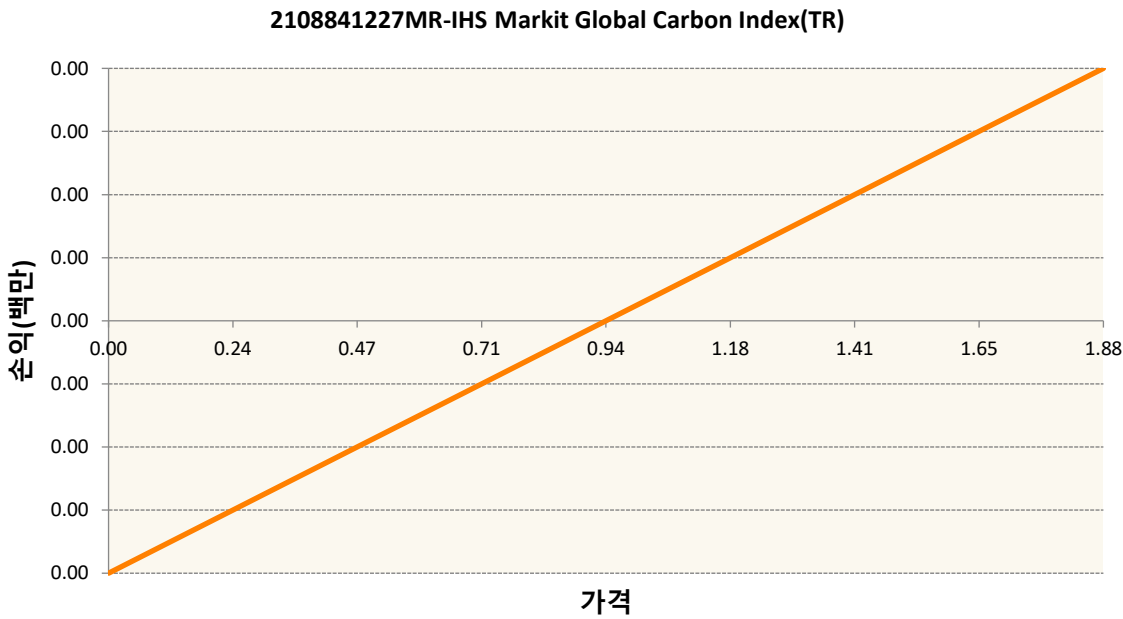
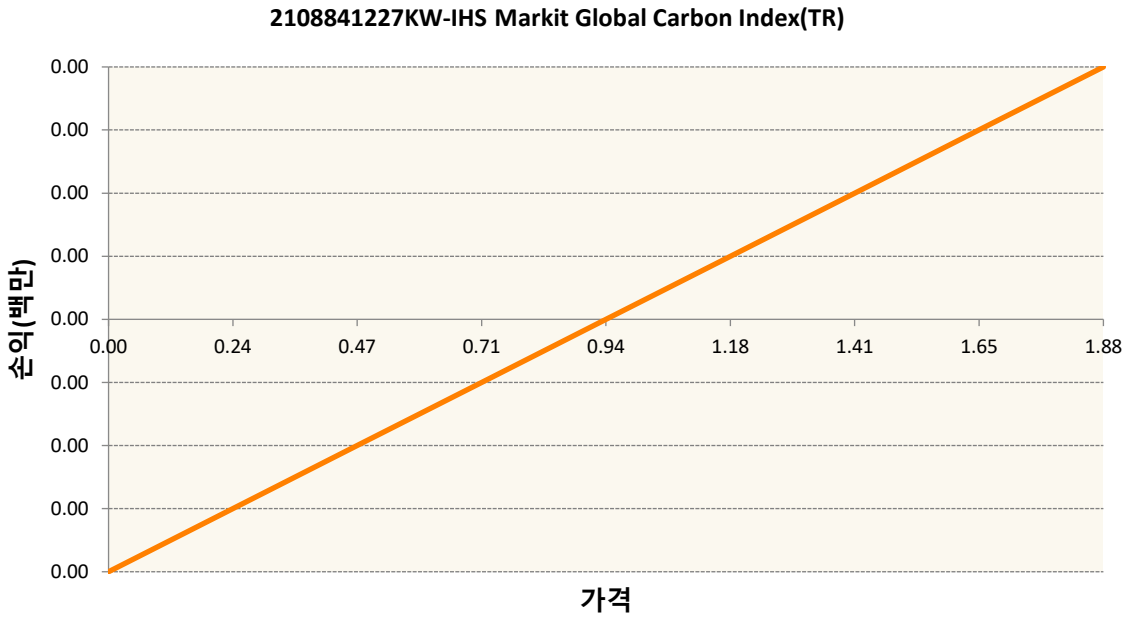
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

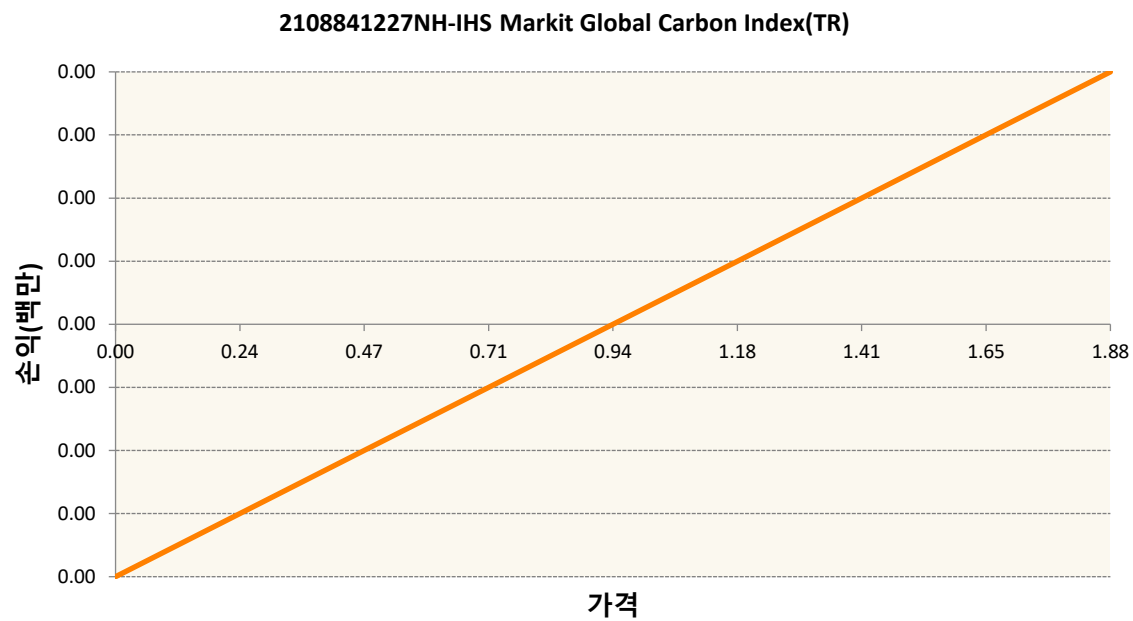
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	24,237	0	24,237	

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108841227IHS Markit Global Carbon Index(TR)		1,650
2108841227IHS Markit Global Carbon Index(TR)		194
2108841227IHS Markit Global Carbon Index(TR)		97

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)		(단위:백만원)
		3,284

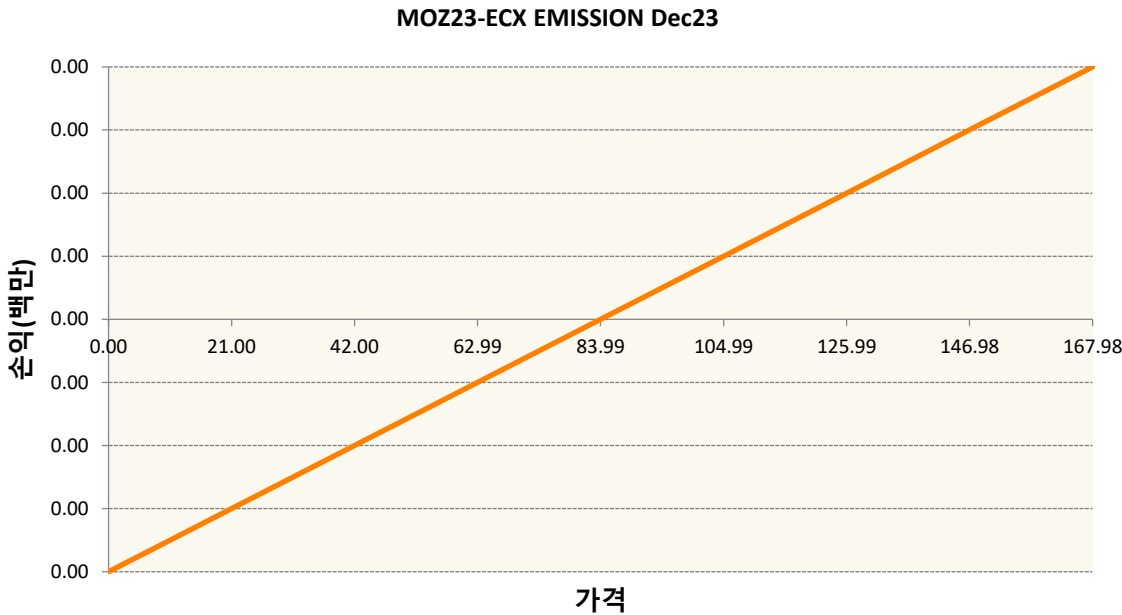
공시일	2023-06-12
기준일	2023-06-09

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	8,709	0	8,709	
누계	통화	선도	0	1,878	-1,878	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
FXW213D5S(KRW/EUR 30-06-23E		39
FXW213D5S(KRW/EUR 30-06-23E		45
FXW213D5S(KRW/EUR 30-06-23E		67
MOZ23 ECX EMISSION Dec23		697

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,297

공시일	2023-06-12
기준일	2023-06-09

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)	34
SWCSI00000 신한CSI Index 221222 (키움)	37
SWCSI00000 신한CSI Index 221222 (미래)	37
SWCSI00000 신한CSI Index 221222 (메리츠)	37

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

(단위:백만원)

245

공시일	2023-06-12
기준일	2023-06-09

SOL차이나육성산업엑티브상장지

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)	16
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 230116(메리츠)	22
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 230116(미래)	18
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 230427(키움)	6

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

(단위:백만원)

106

공시일	2023-06-12
기준일	2023-06-09

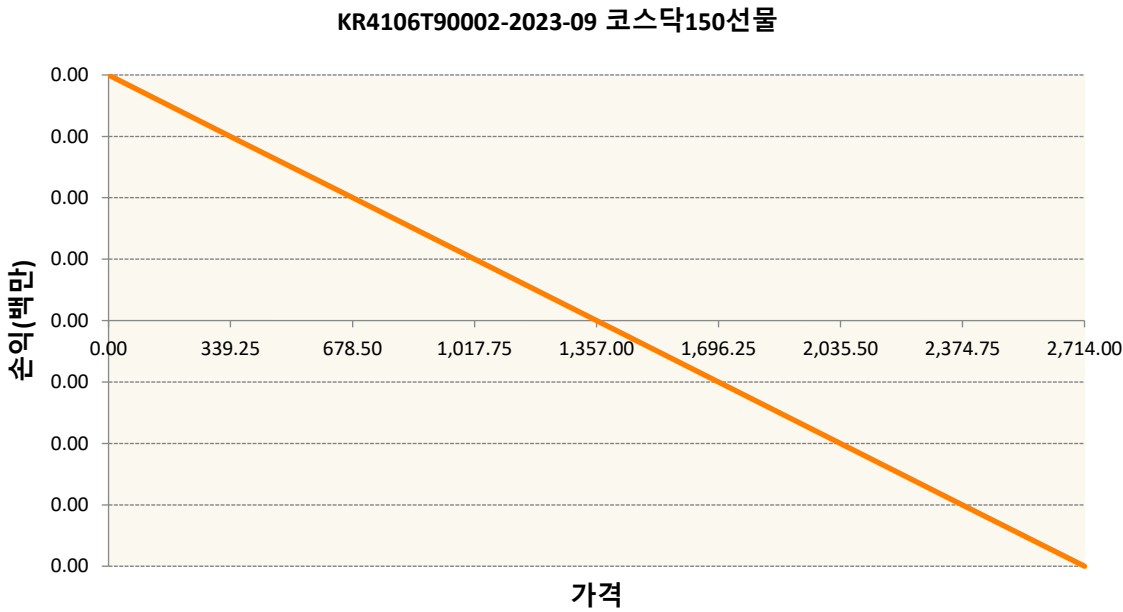
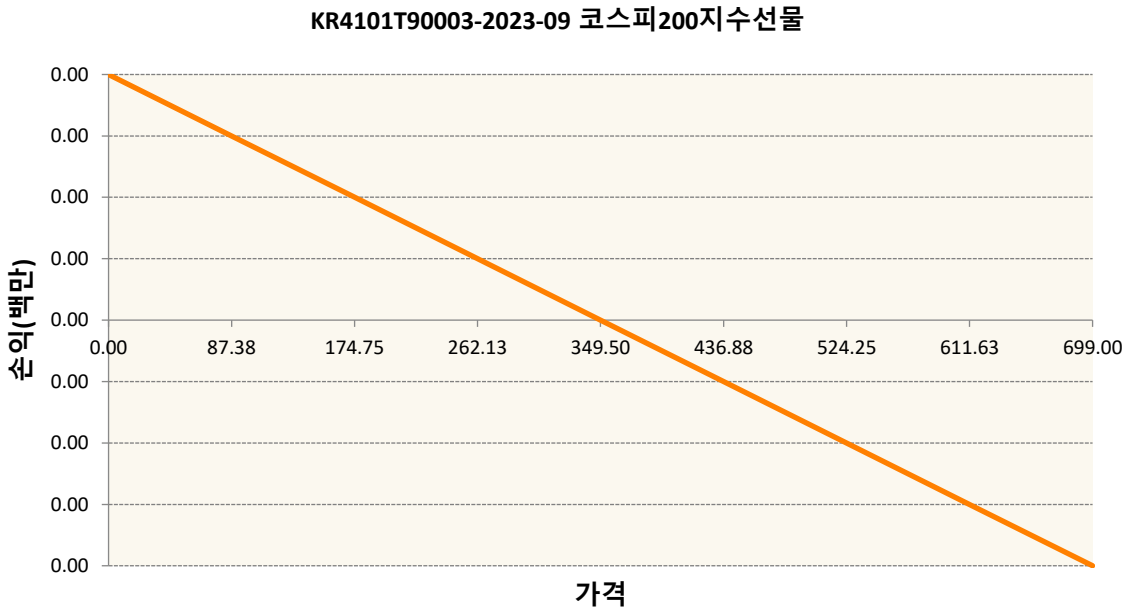
에쿼티알파일반사모혼합자산

1. 계약금액

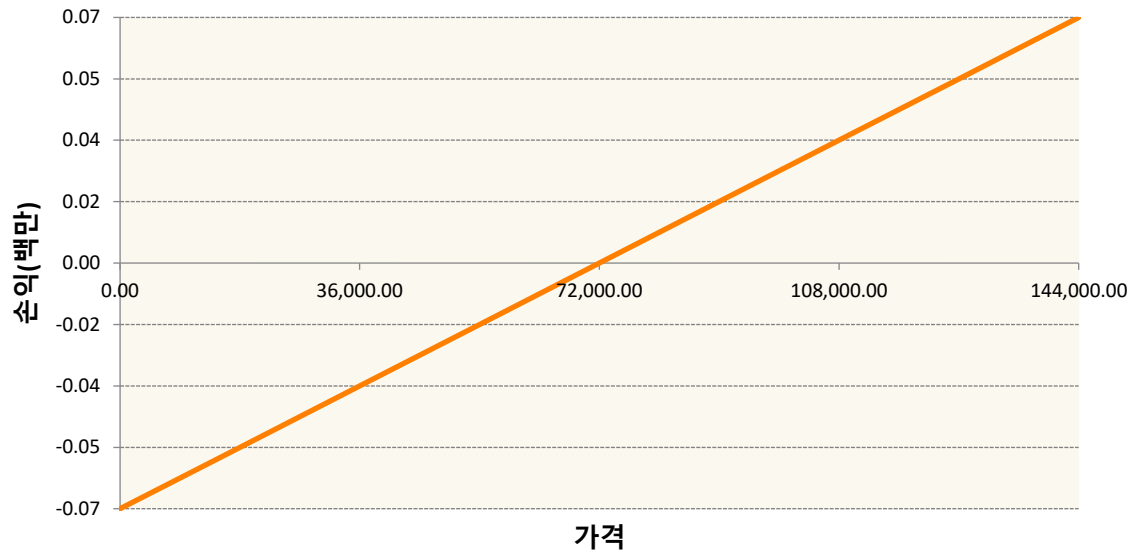
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	260	0	260	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,045	2,857	-1,812	장내
누계	유가증권	스왑	0	0	0	장외

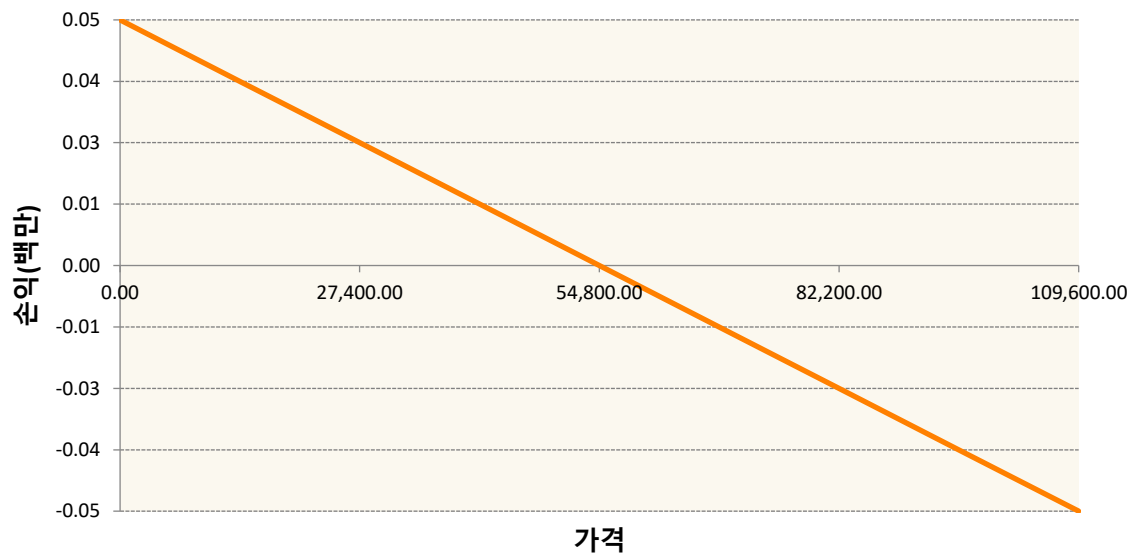
2. 만기시점의 손익구조



KR4111T70004-2023-07 삼성전자개별선물



KR41F7T70006-2023-07 카카오페이개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101T900 2023-09 코스피200지수선물	119
KR4106T900 2023-09 코스닥150선물	103
KR4111T700 2023-07 삼성전자개별선물	84
KR41F7T700 2023-07 카카오페이개별선물	7
KRS0004099 SWAP_MICRON TECH_0308	1
KRS0004212 SWAP_SPDR S&P BIOTECH_0413	1

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

(단위:백만원)

530

공시일	2023-06-12
기준일	2023-06-09

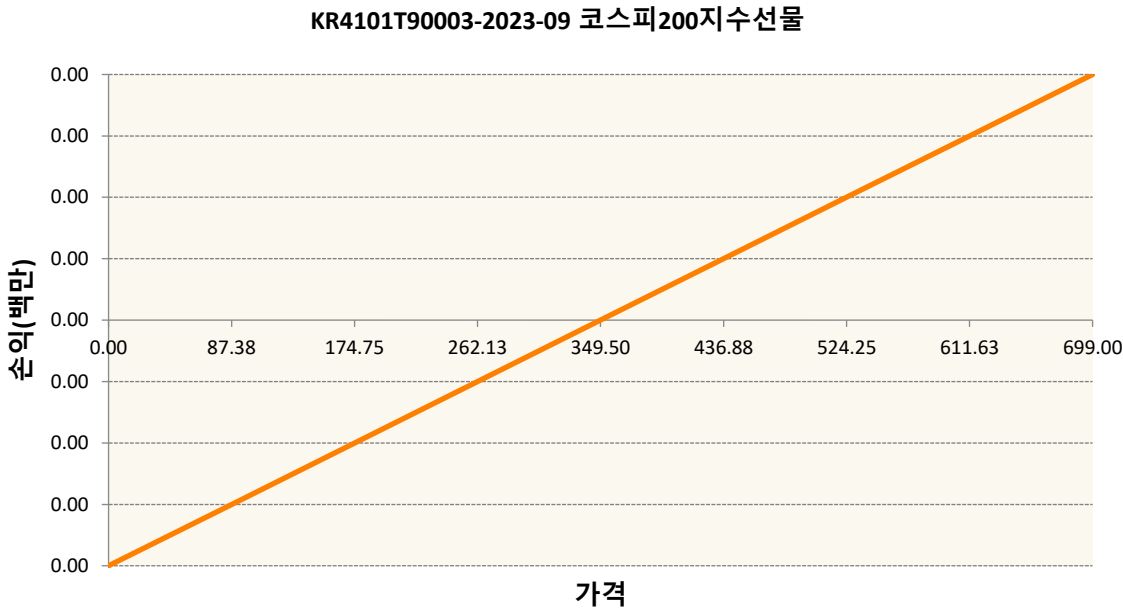
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	87	-87	장내
누계	유가증권	선물	437	0	437	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101T90003			2023-09 코스피200지수선물				35
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-35	-35	-35	-35	-35	-35	-35
-5.33%	-23	-23	-23	-23	-23	-23	-23
-2.67%	-12	-12	-12	-12	-12	-12	-12
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	12	12	12	12	12	12	12
5.33%	23	23	23	23	23	23	23
8.00%	35	35	35	35	35	35	35

공시일	2023-06-12
기준일	2023-06-09

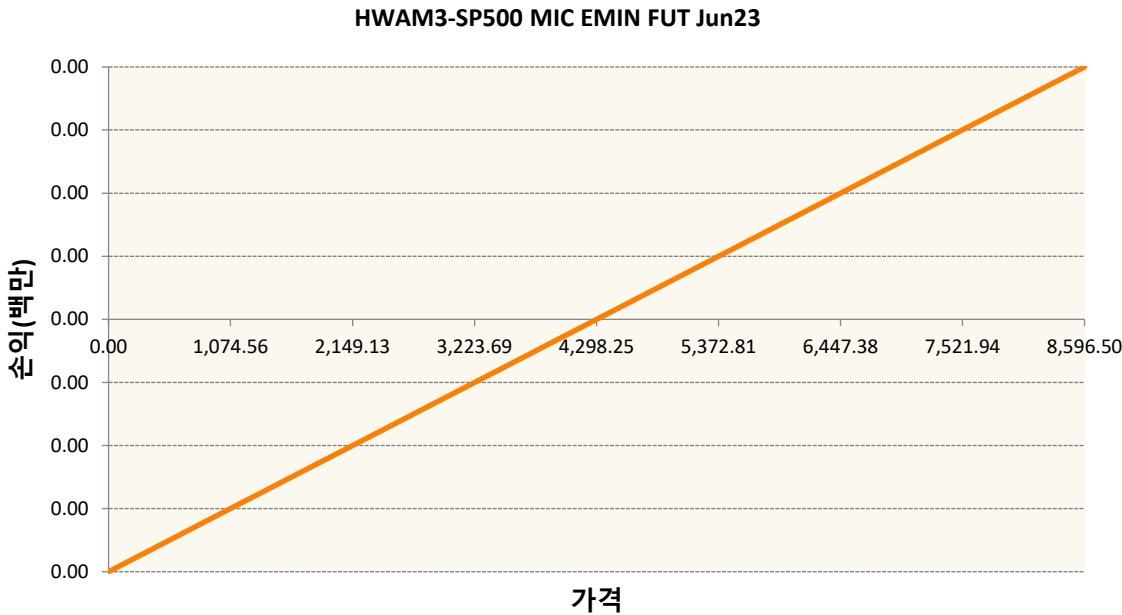
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

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	777	0	777	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HWAM3	SP500 MIC EMIN FUT Jun23	62
-------	--------------------------	----

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

(단위:백만원)

105

공시일	2023-06-12
기준일	2023-06-09

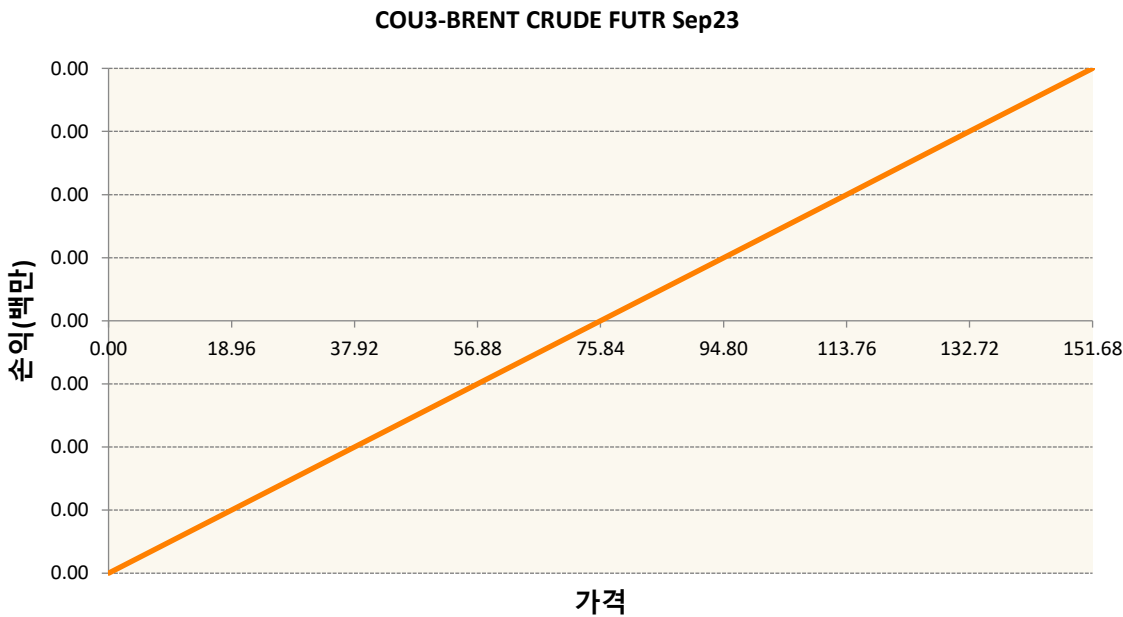
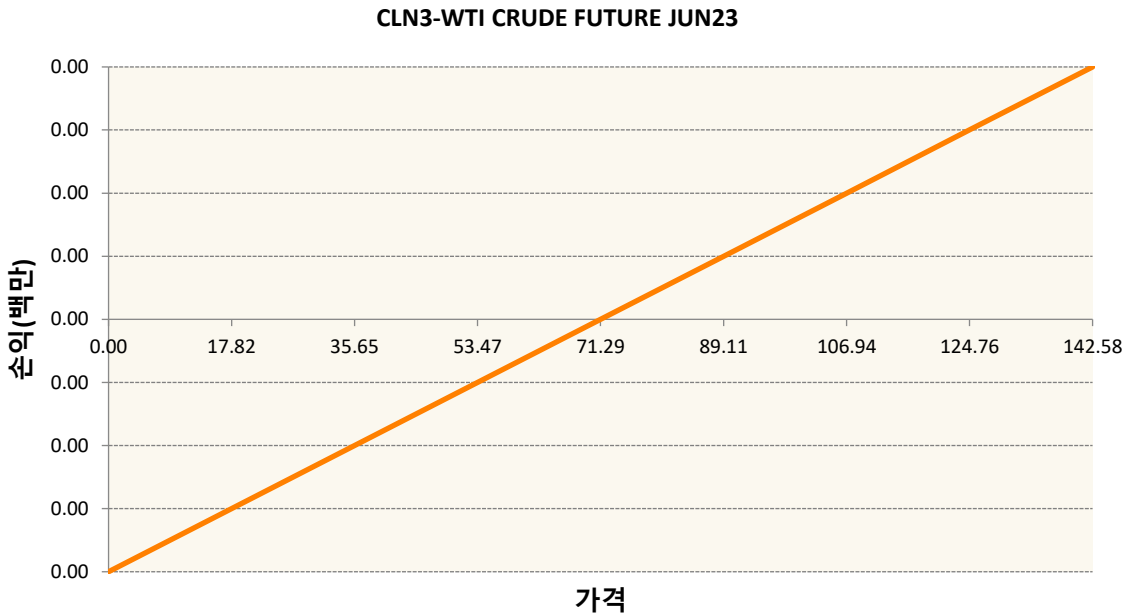
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

1. 계약금액

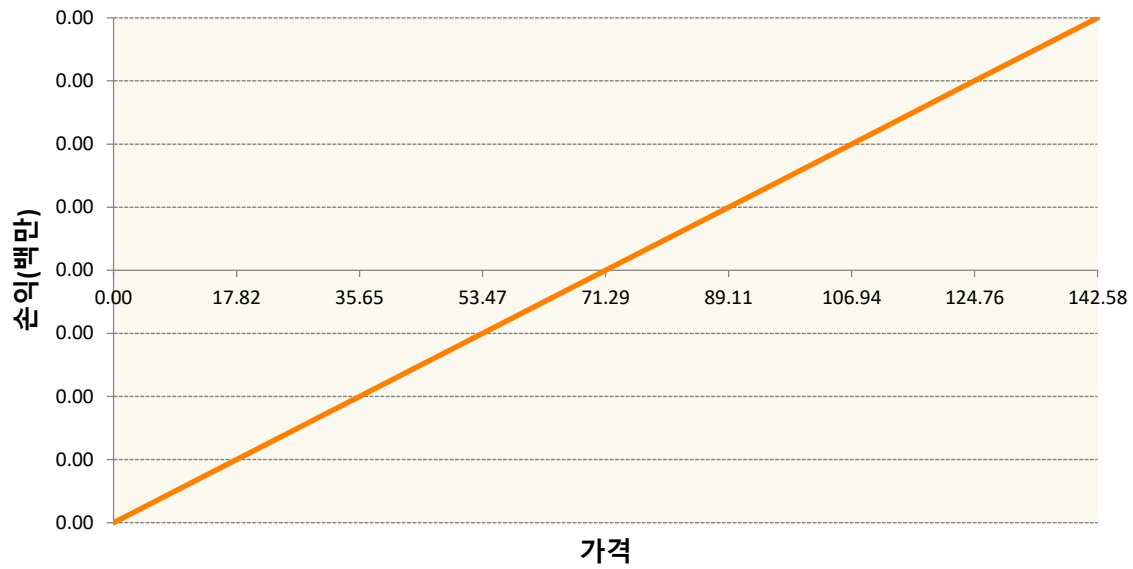
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,283	129	1,154	

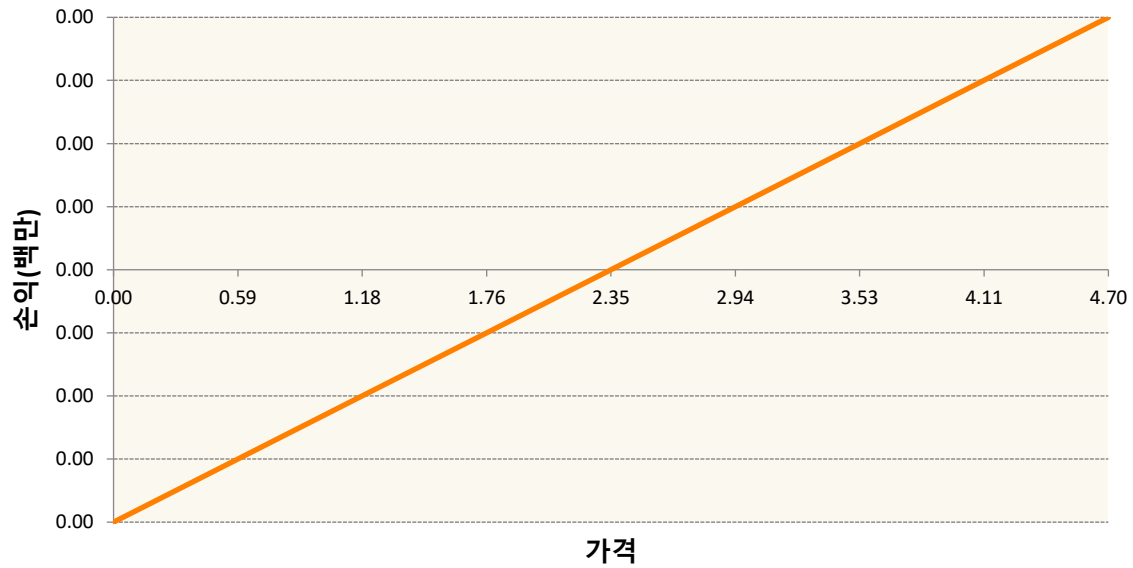
2. 만기시점의 손익구조



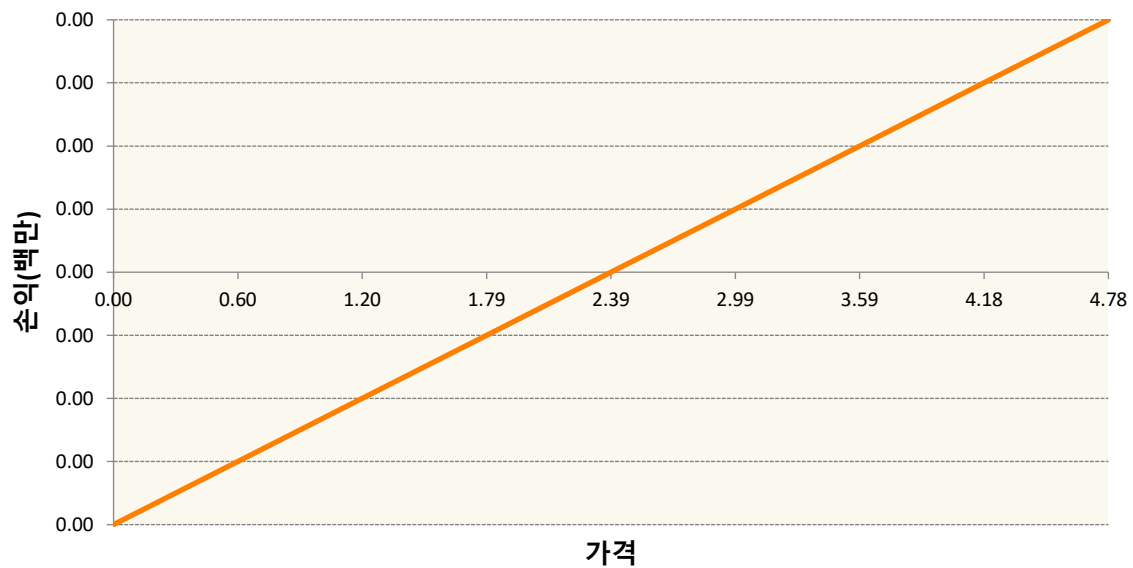
ECN3-E-mini Crude Oil Jul23



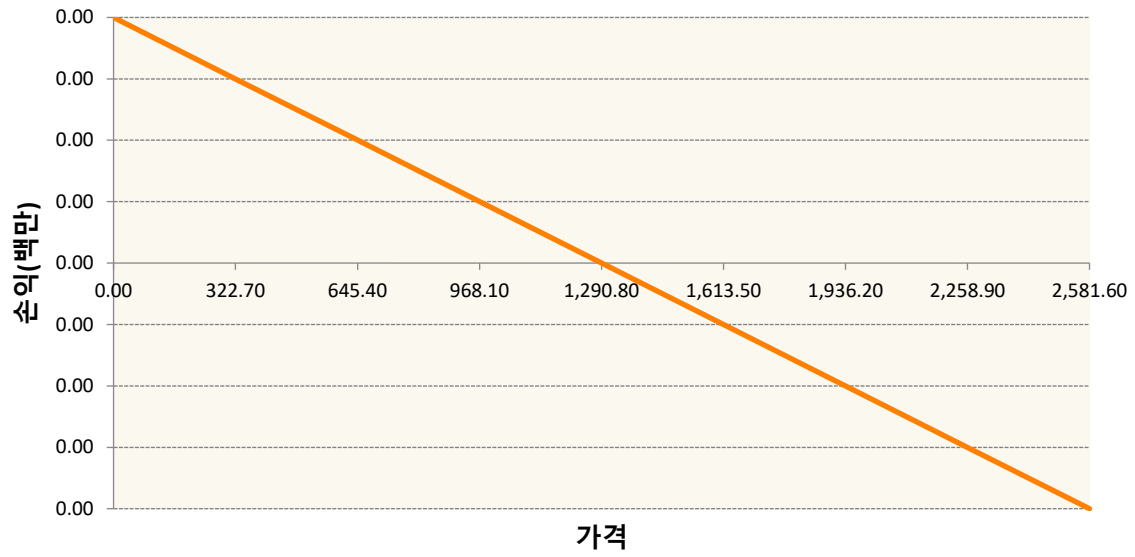
EON3-E-MINI NATURAL GAS Jul23



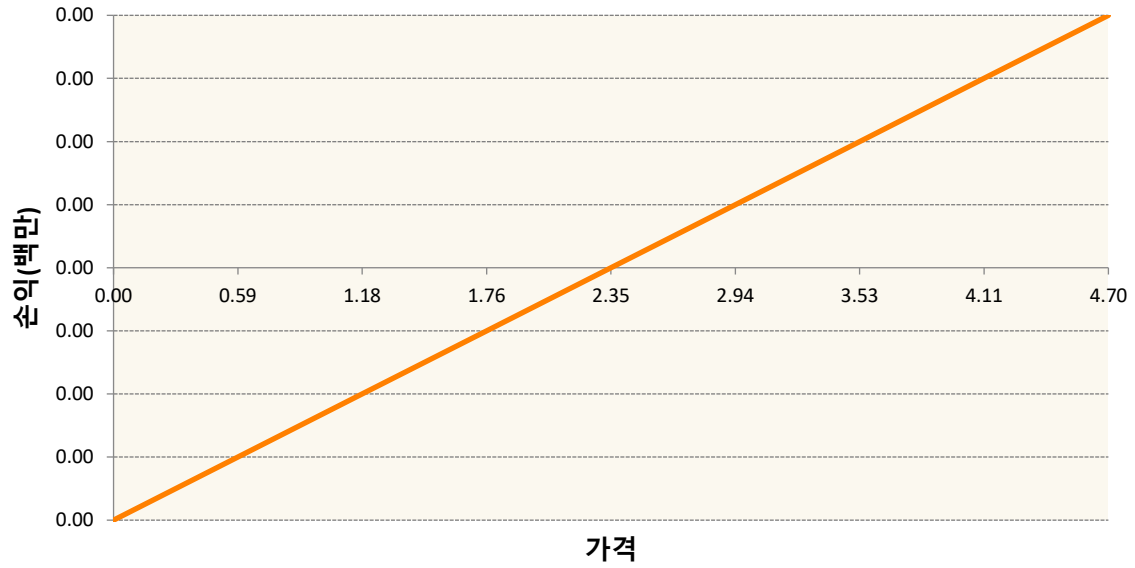
HON3-NY Harb ULSD Fut Jul23



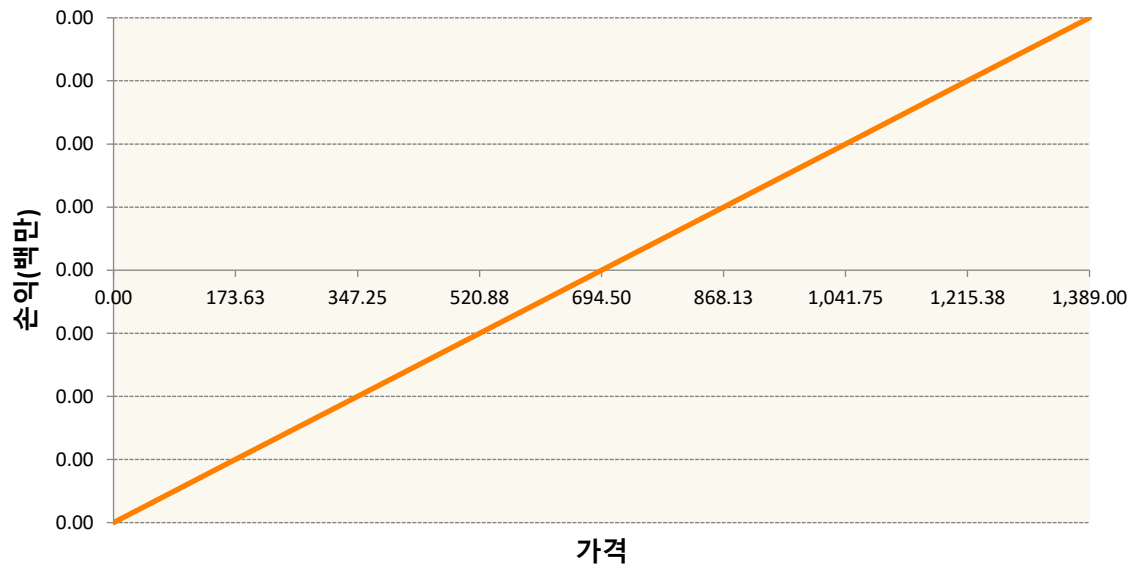
KR4175T60000-2023-06 달러선물

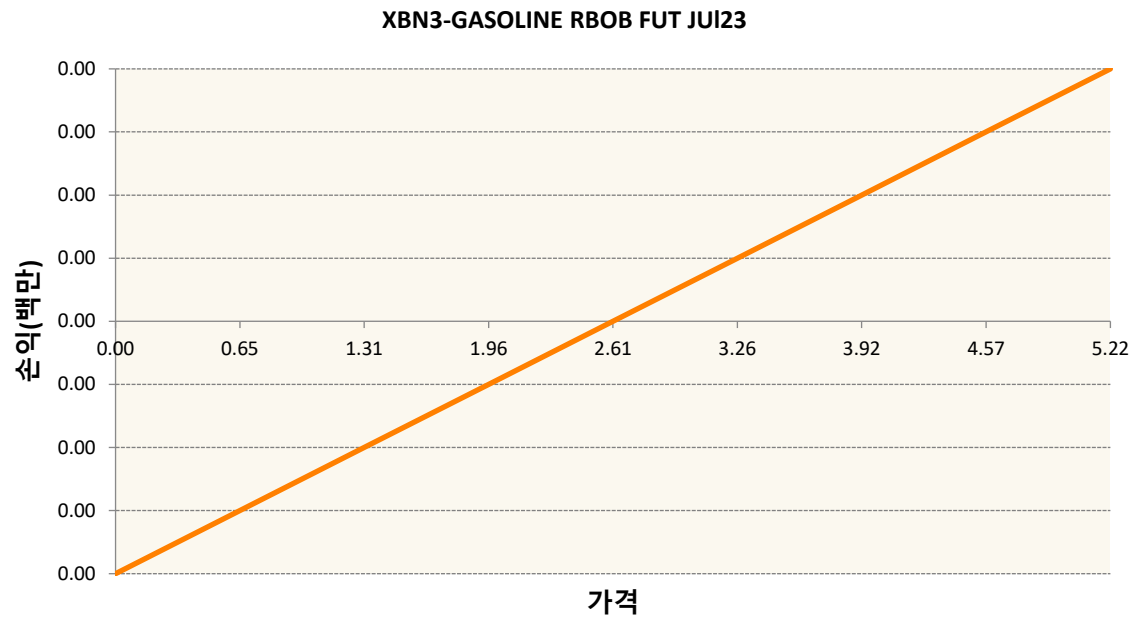


NGN23-NATURAL GAS FUTR JUL23



QSN3-Low Su Gasoil G JUL23





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
CLN3	WTI CRUDE FUTURE JUN23	22
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	11
KR4175T600 2023-06 달러선물		10
NGN23	NATURAL GAS FUTR JUL23	22
QSN3	Low Su Gasoil G JUL23	7
XBN3	GASOLINE RBOB FUT JUL23	12

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	191