

공시일	2023-06-15
기준일	2023-06-14

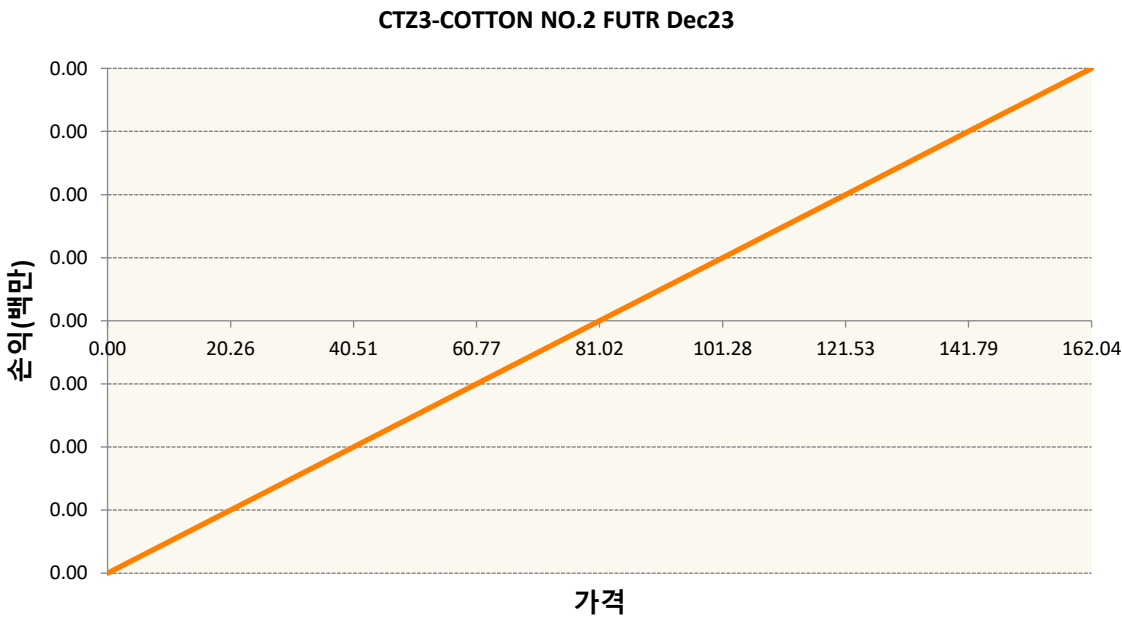
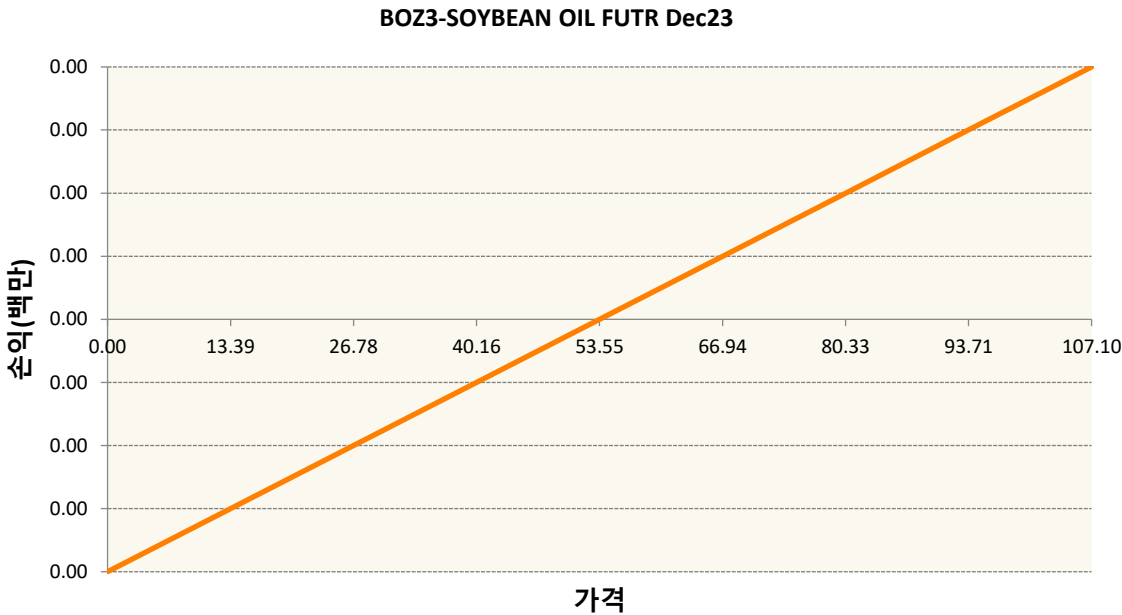
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

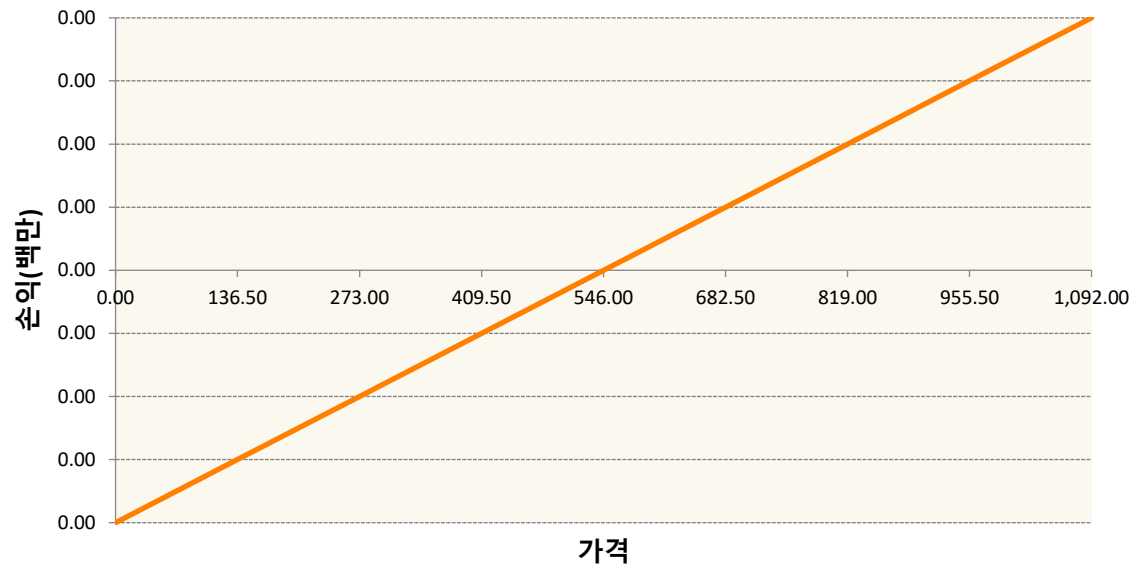
(단위:USD 백만)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,497	358	5,139	

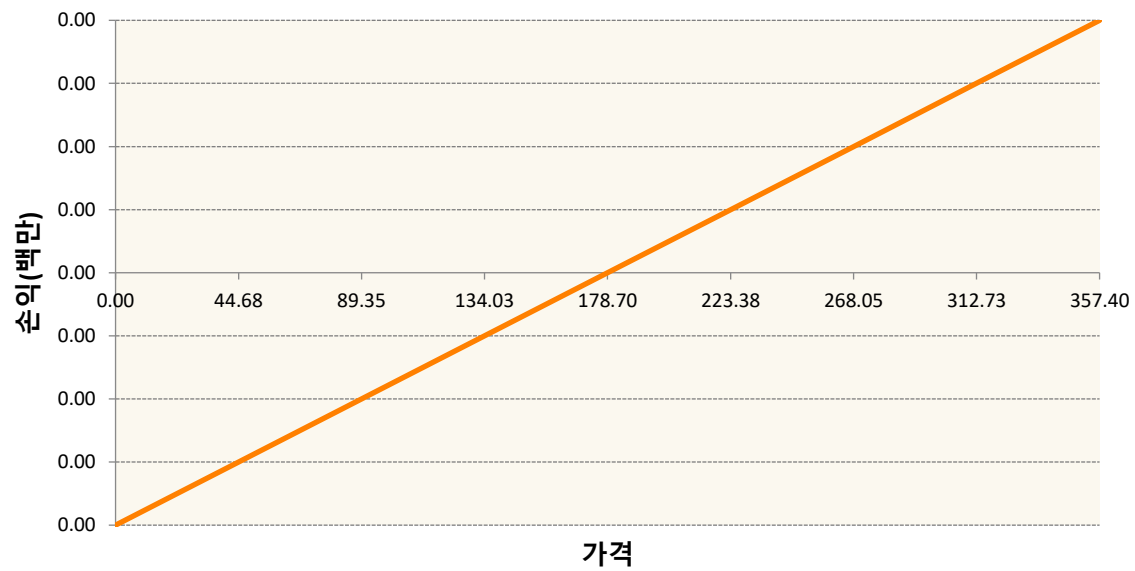
2. 만기시점의 손익구조



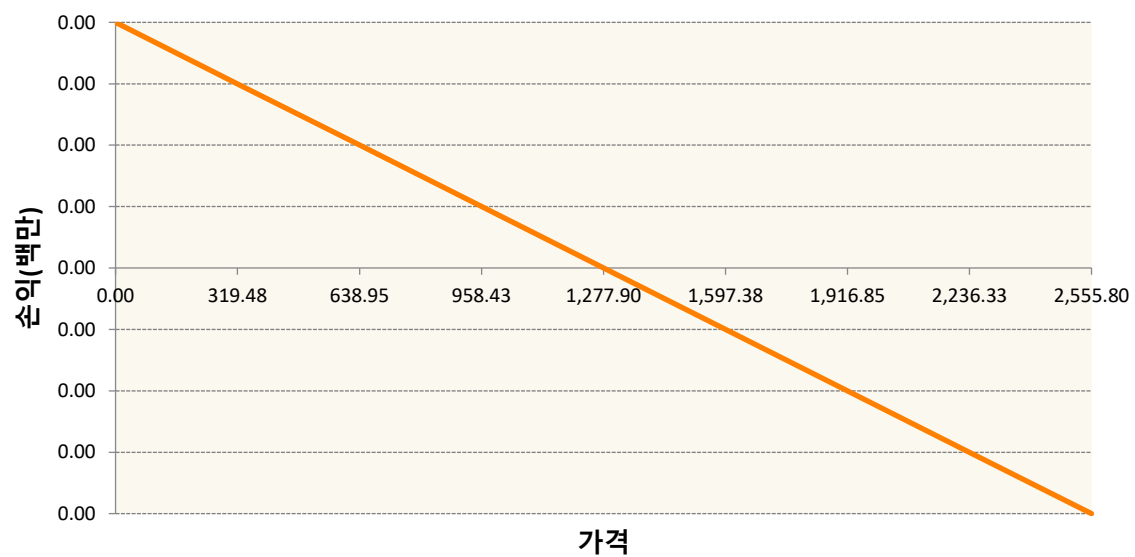
CU3-CORN FUTURE Sep23



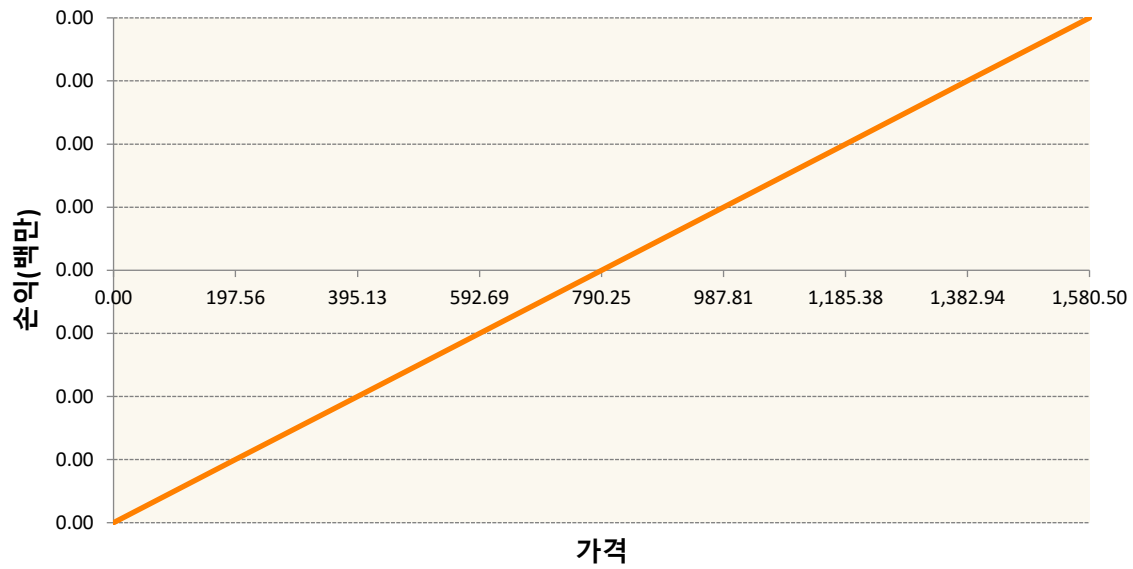
KCU3-COFFEE 'C' FUTURE Sep23



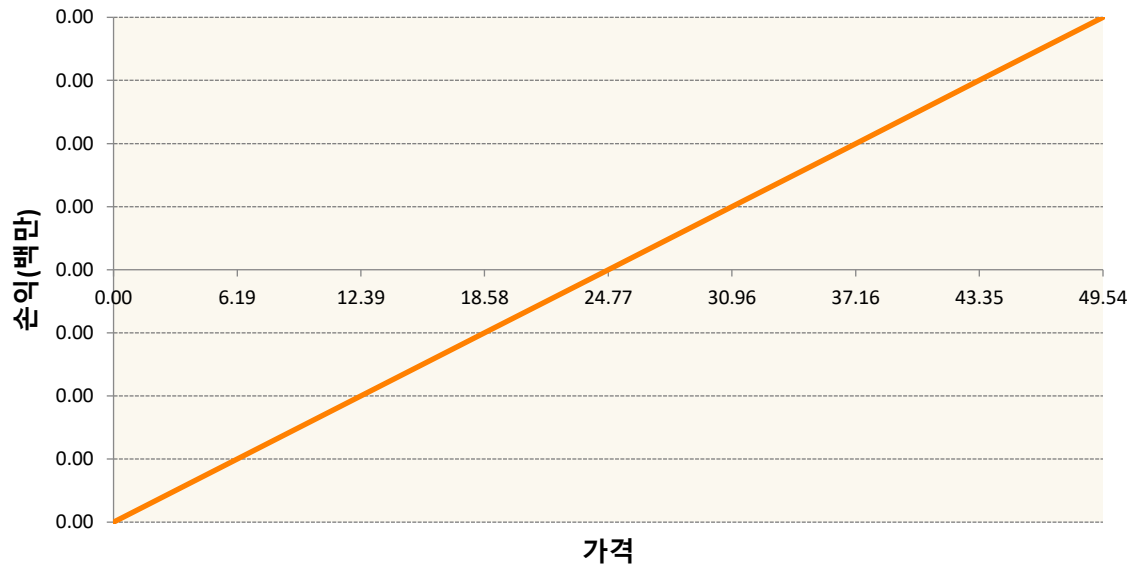
KR4175T60000-2023-06 달러선물



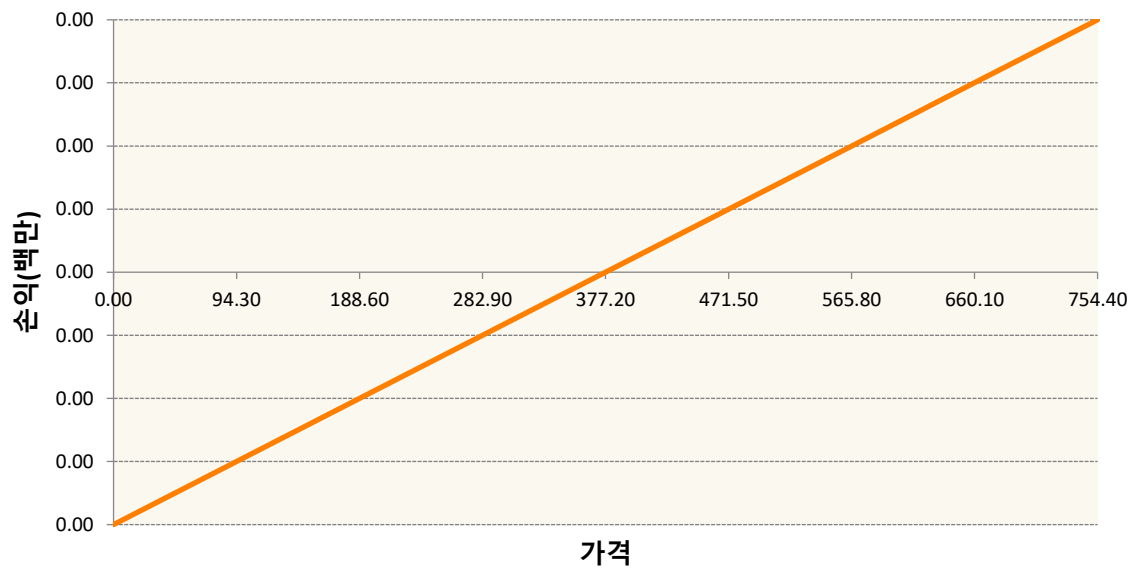
KWU3-KC HRW WHEAT FUT Sep23

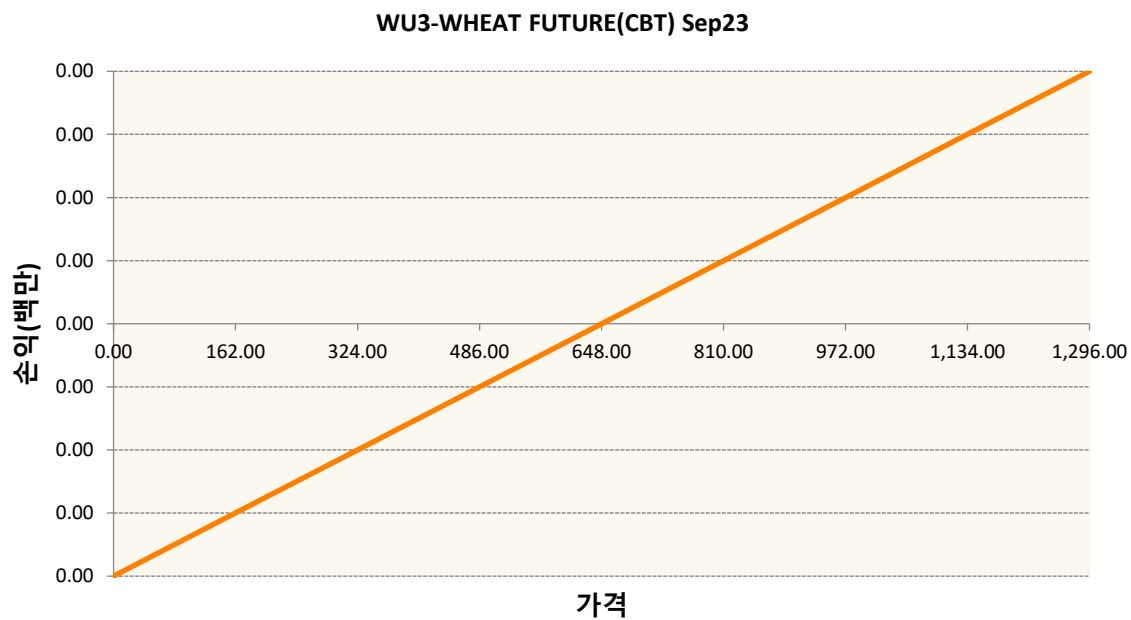
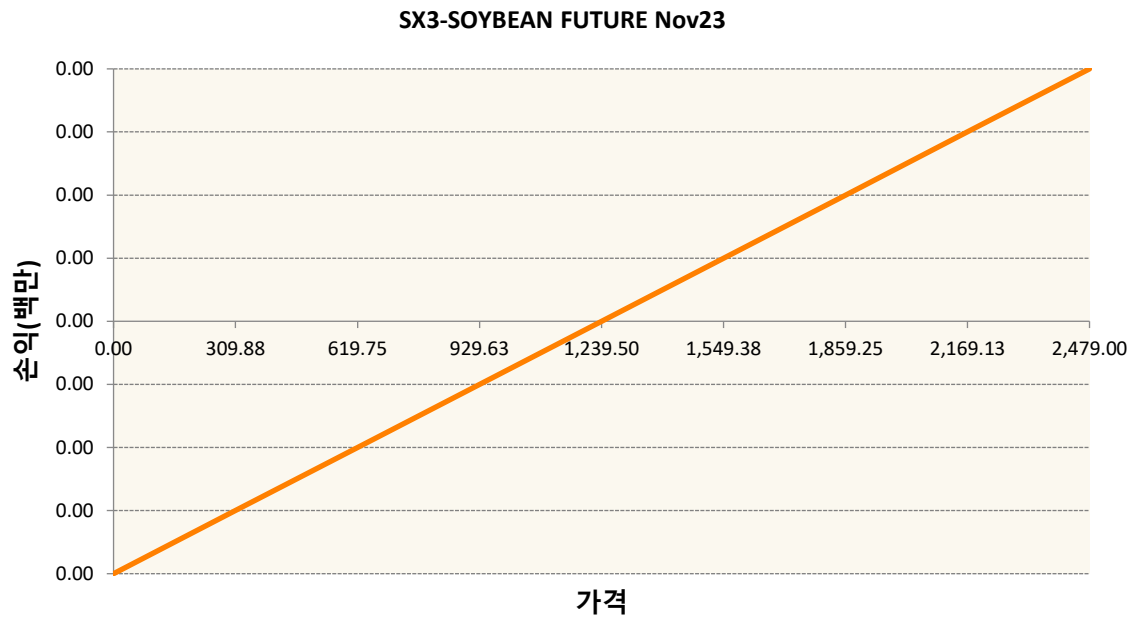


SBV3-Sugar #11 (WORLD) Oct23



SMZ3-SOYBEAN MEAL FUTR Dec23





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

공시일	2023-06-15
기준일	2023-06-14

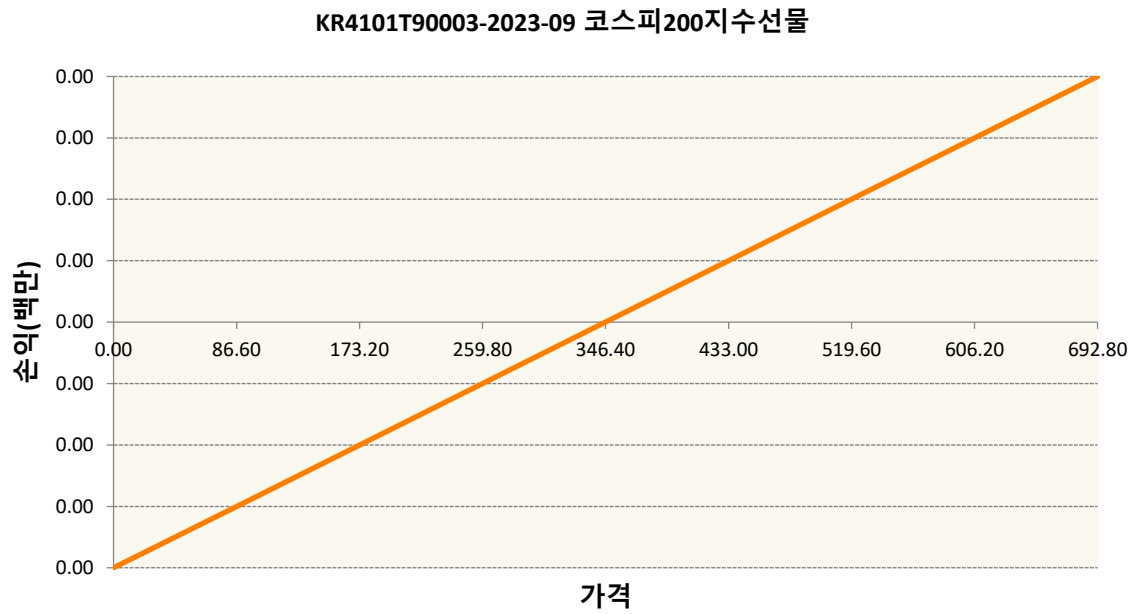
스마트인덱스모

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	2023-06-15
기준일	2023-06-14

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	342
-----------------------------	-----

* 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	2023-06-15
기준일	2023-06-14

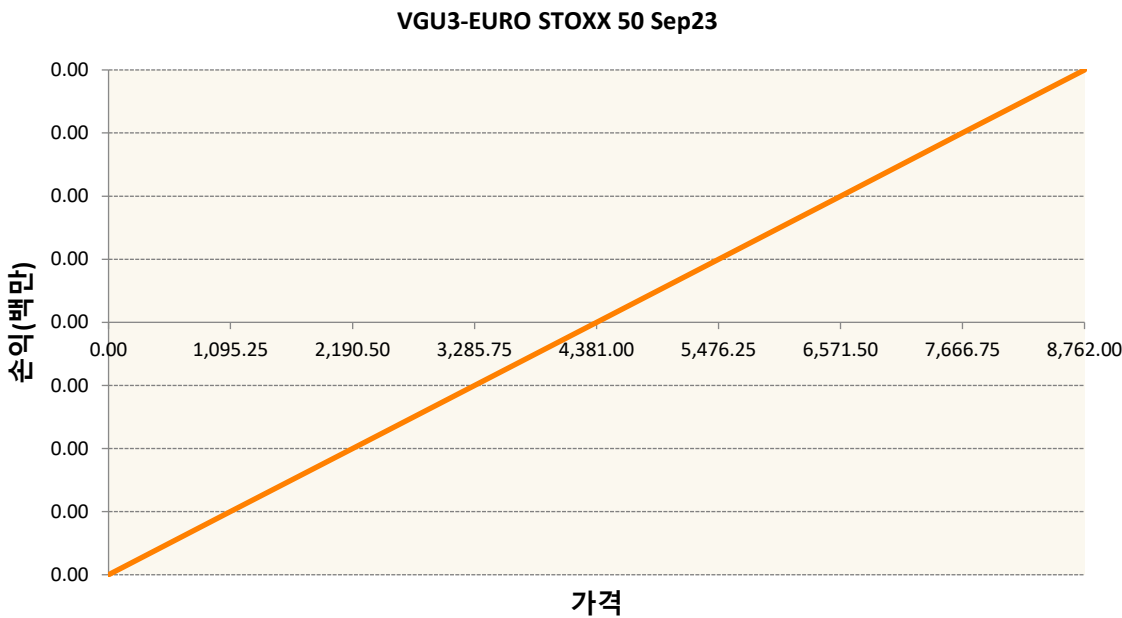
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	604	0	604	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGU3	EURO STOXX 50 Sep23	48
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

82

공시일	2023-06-15
기준일	2023-06-14

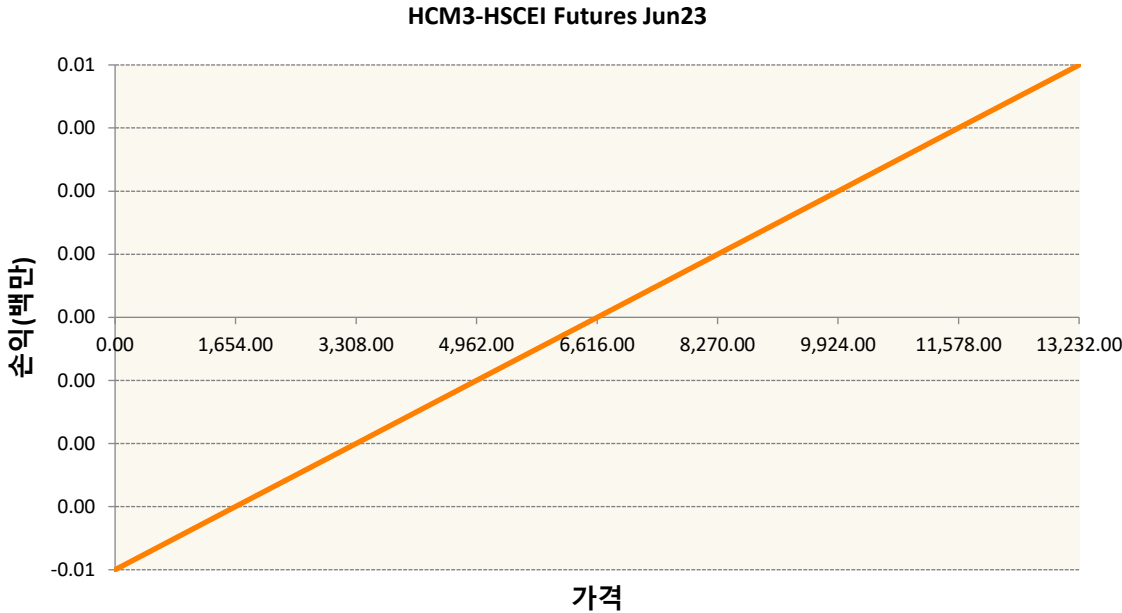
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,223	0	1,223	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCM3	HSCEI Futures Jun23	98
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

165

공시일	2023-06-15
기준일	2023-06-14

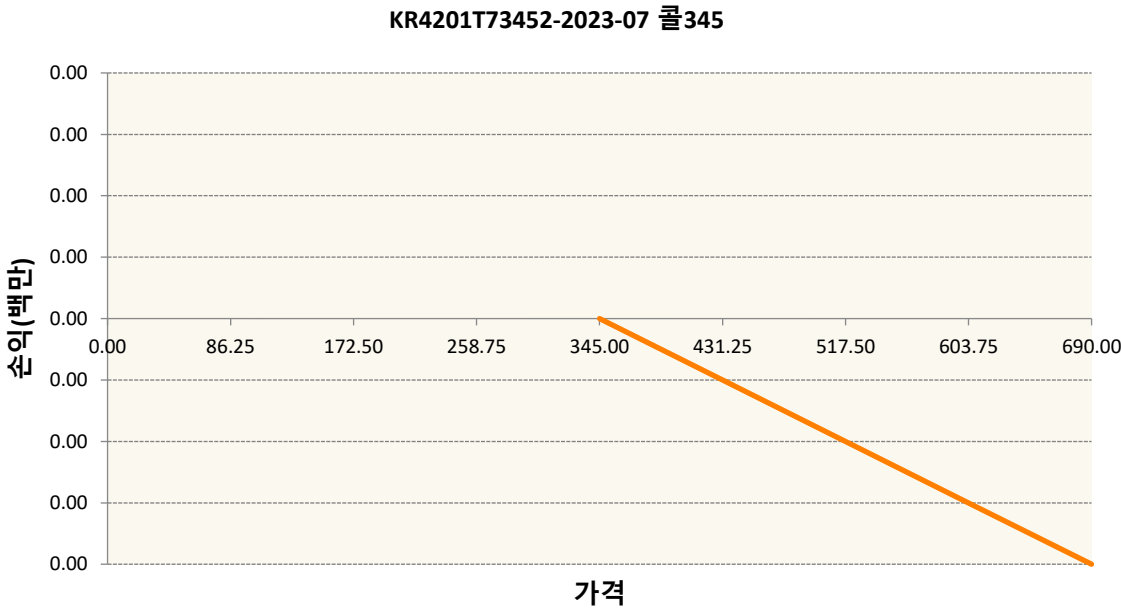
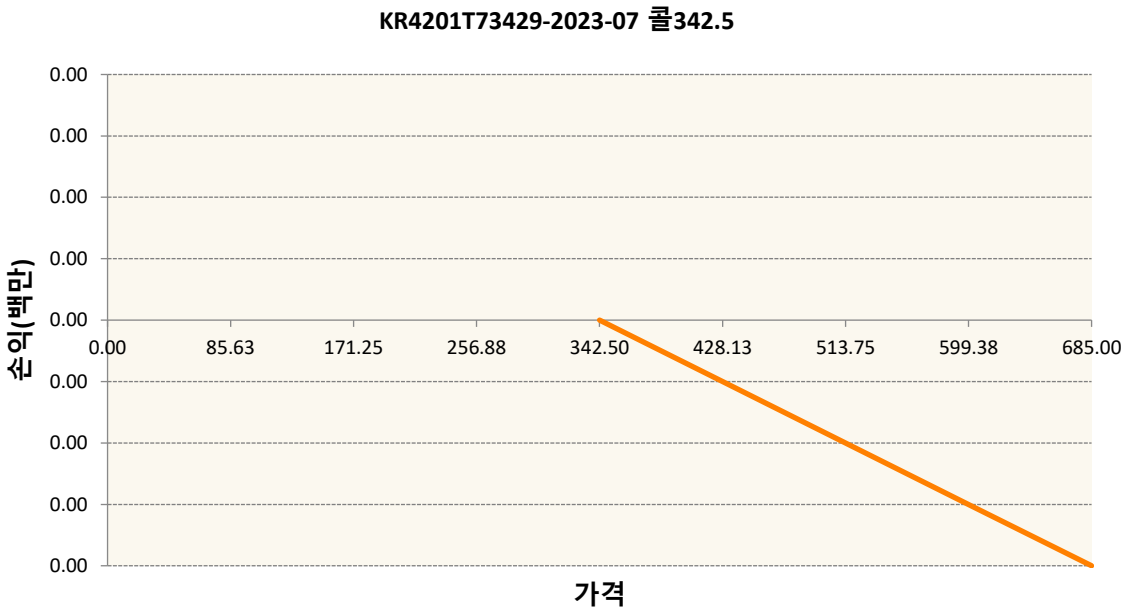
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

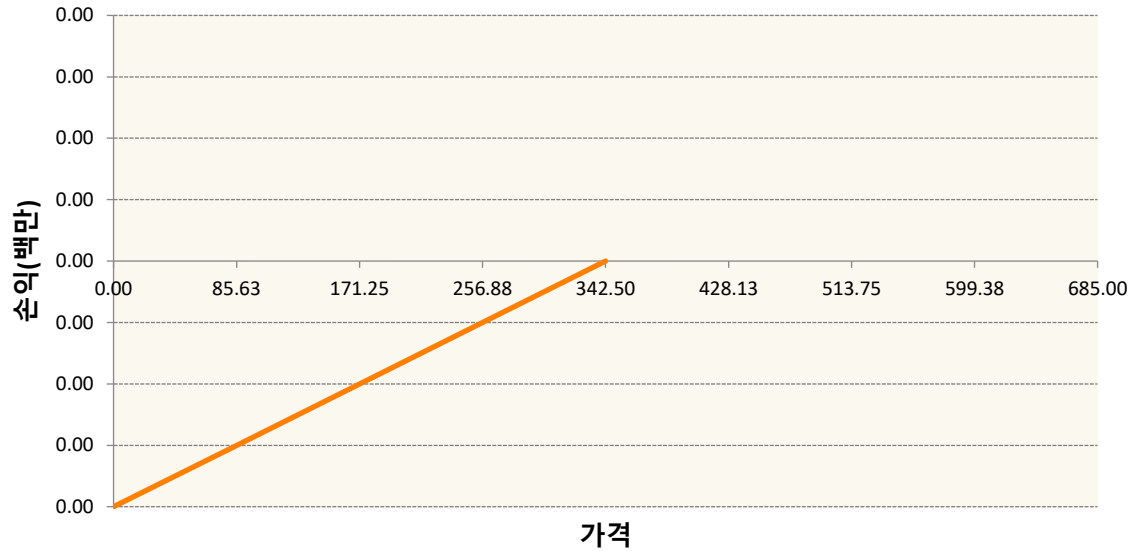
(단위:백만원)

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

2. 만기시점의 손익구조



KR4301T73427-2023-07 풋342.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201T73429			2023-07 콜342.5				2,564
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,176	1,144	1,107	1,063	1,015	962	906
-5.33%	1,047	988	924	857	788	716	642
-2.67%	763	680	596	511	426	340	254
0%	268	179	89	0	-89	-179	-268
2.67%	-443	-518	-596	-675	-756	-839	-923
5.33%	-1,325	-1,375	-1,431	-1,491	-1,556	-1,624	-1,695
8.00%	-2,312	-2,339	-2,373	-2,413	-2,459	-2,509	-2,564
KR4201T73452			2023-07 콜345				339
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	146	142	137	132	126	119	111
-5.33%	131	124	116	107	98	88	78
-2.67%	98	87	76	64	53	41	29
0%	38	25	13	0	-13	-25	-38
2.67%	-52	-63	-75	-87	-99	-111	-123
5.33%	-167	-175	-184	-193	-203	-214	-224
8.00%	-298	-303	-309	-316	-323	-331	-339
KR4301T73427			2023-07 풋342.5				543
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-479	-487	-496	-506	-517	-530	-543
-5.33%	-258	-271	-286	-302	-319	-336	-353
-2.67%	-72	-92	-112	-132	-152	-172	-192
0%	63	42	21	0	-21	-42	-63

2.67%	148	130	112	93	74	54	35
5.33%	192	180	167	153	137	121	105
8.00%	211	205	197	187	177	165	152

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

(단위:백만원)

3,356

공시일 2023-06-15

기준일 2023-06-14

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	2023-06-15
기준일	2023-06-14

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	6,340	0	6,340	

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	2023-06-15
기준일	2023-06-14

H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	102	-102	
누계	유가증권	수익증권	4,716	0	4,716	

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	2023-06-15
기준일	2023-06-14

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	18,369	0	18,369	
누계	통화	선도	0	18,506	-18,506	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213D3Q KRW/USD 28-06-23E	496
FXW213D4S(KRW/USD 31-07-23E	254
FXW213D5S(KRW/USD 31-08-23E	669
FXW213D6D KRW/USD 28-06-23E	61
IE00BD8RGM75	

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

3,329

공시일	2023-06-15
기준일	2023-06-14

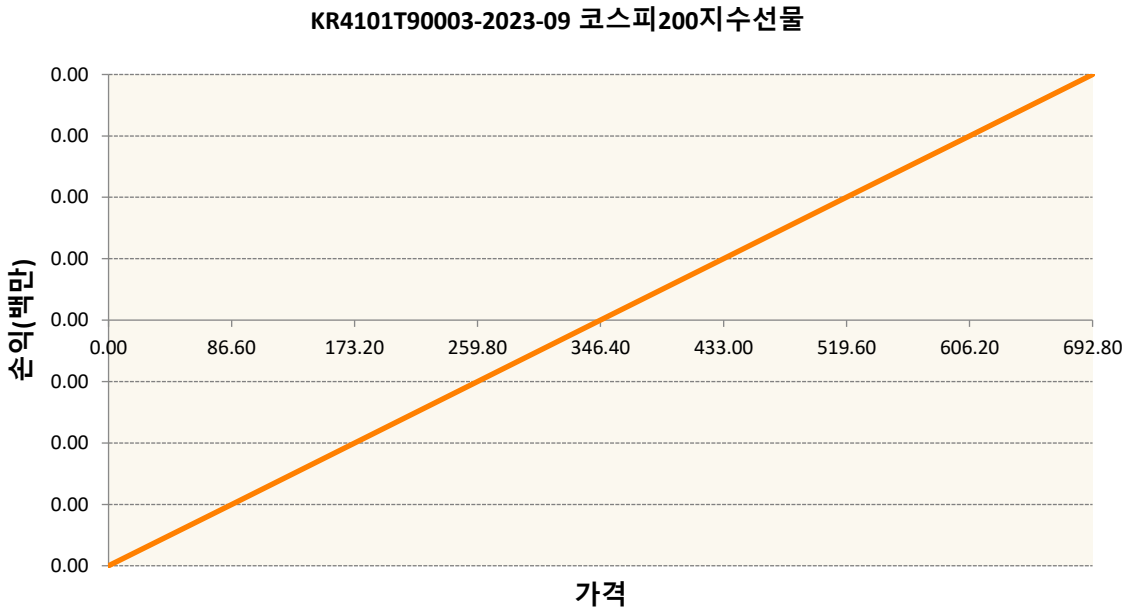
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

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	693	0	693	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101T90003			2023-09 코스피200지수선물				55
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-55	-55	-55	-55	-55	-55	-55
-5.33%	-37	-37	-37	-37	-37	-37	-37
-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%	37	37	37	37	37	37	37
8.00%	55	55	55	55	55	55	55

공시일	2023-06-15
기준일	2023-06-14

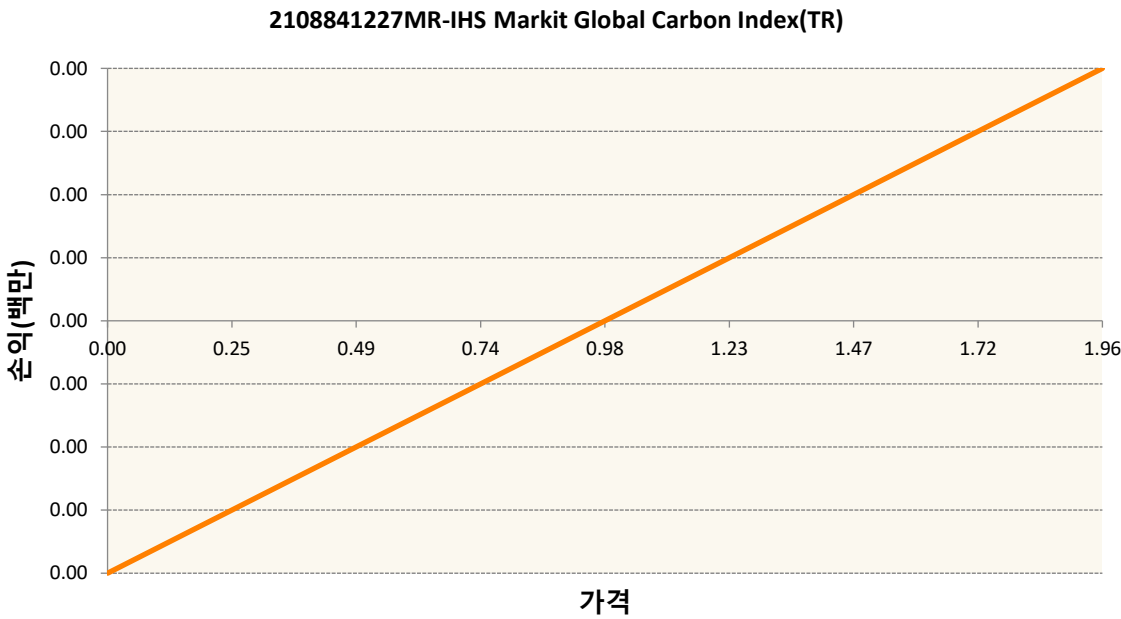
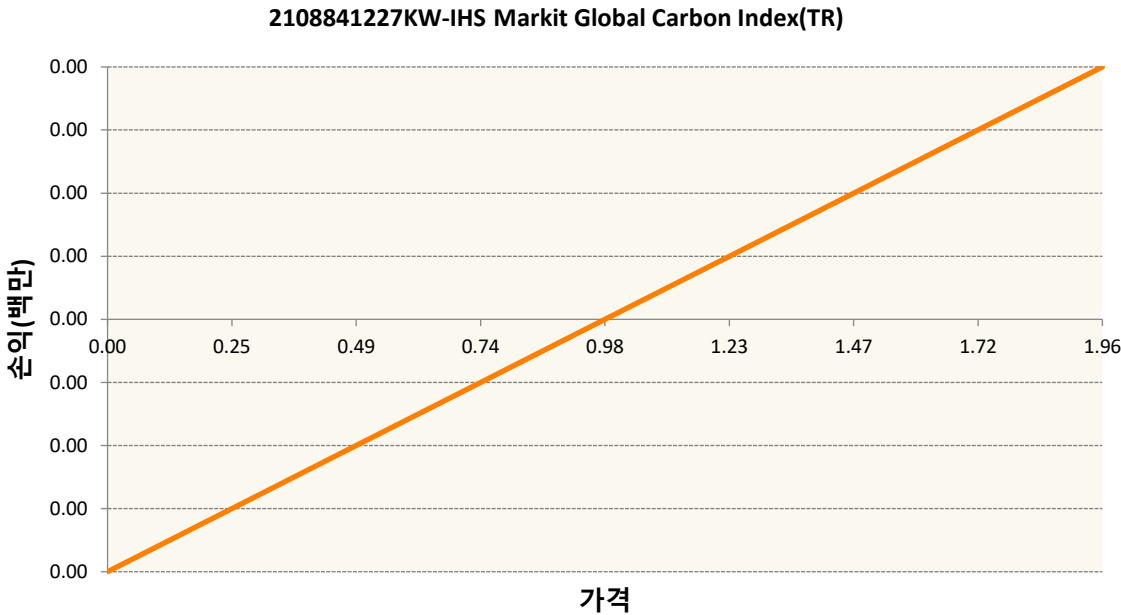
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

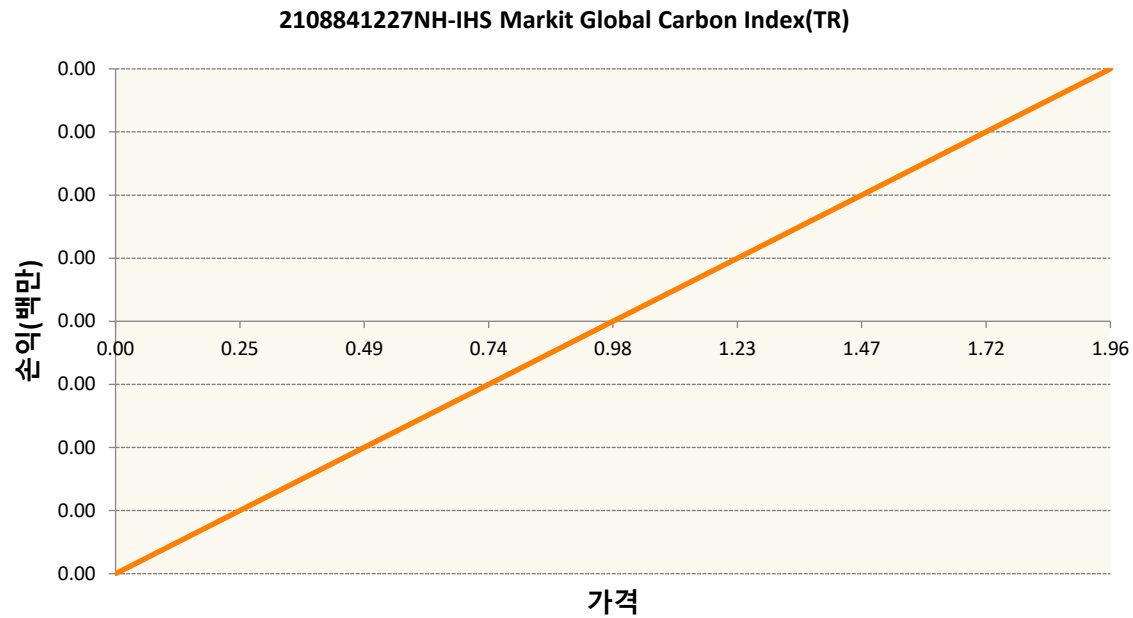
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	25,269	0	25,269	

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108841227IHS Markit Global Carbon Index(TR)		1,721
2108841227IHS Markit Global Carbon Index(TR)		203
2108841227IHS Markit Global Carbon Index(TR)		101

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)		(단위:백만원)
		3,420

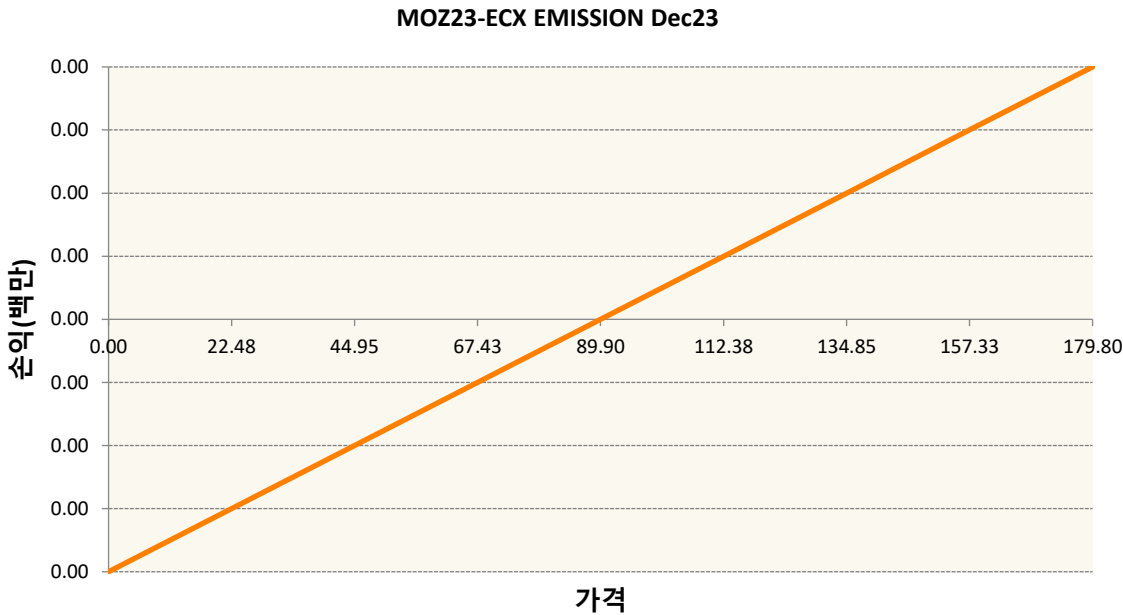
공시일	2023-06-15
기준일	2023-06-14

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	9,317	0	9,317	
누계	통화	선도	0	2,364	-2,364	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
FXW213D5S(KRW/EUR 30-06-23E		39
FXW213D5S(KRW/EUR 30-06-23E		44
FXW213D5S(KRW/EUR 30-06-23E		66
FXW213D6D KRW/EUR 30-06-23E		40
MOZ23 ECX EMISSION Dec23		745

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,409

공시일	2023-06-15
기준일	2023-06-14

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)

243

공시일	2023-06-15
기준일	2023-06-14

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)	13
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 230116(메리츠)	19
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 230116(미래)	16
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 230427(키움)	6

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

(단위:백만원)

91

공시일	2023-06-15
기준일	2023-06-14

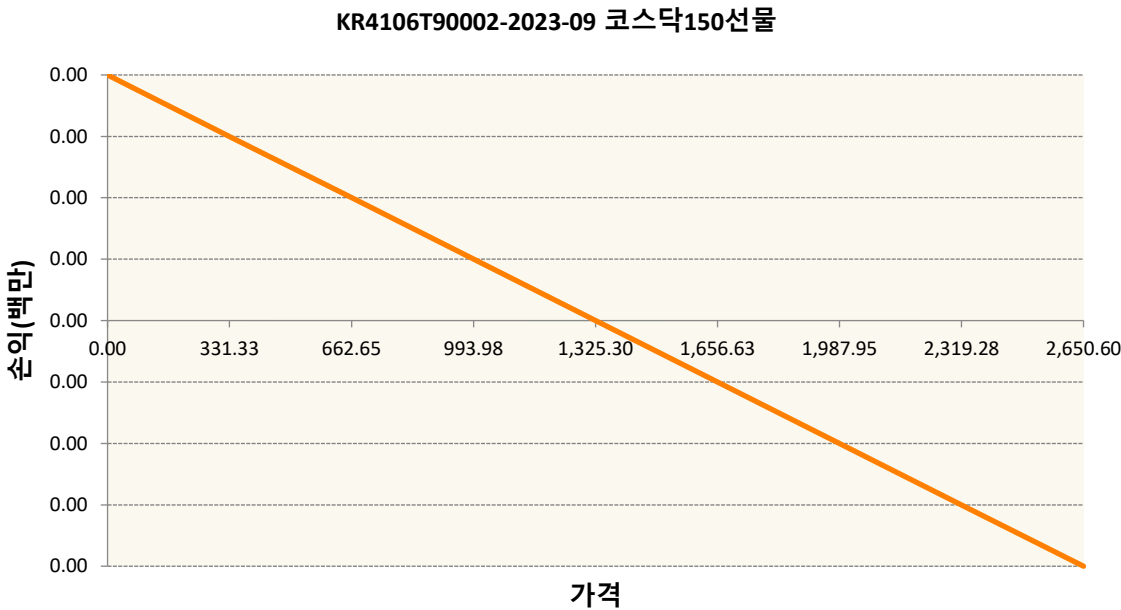
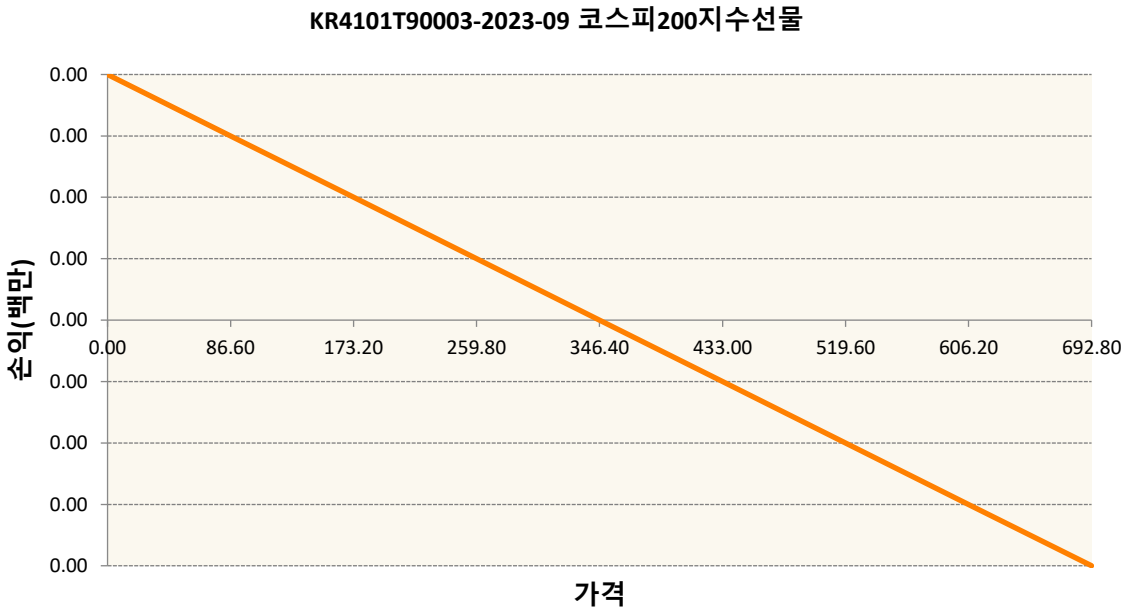
에쿼티알파일반사모혼합자산

1. 계약금액

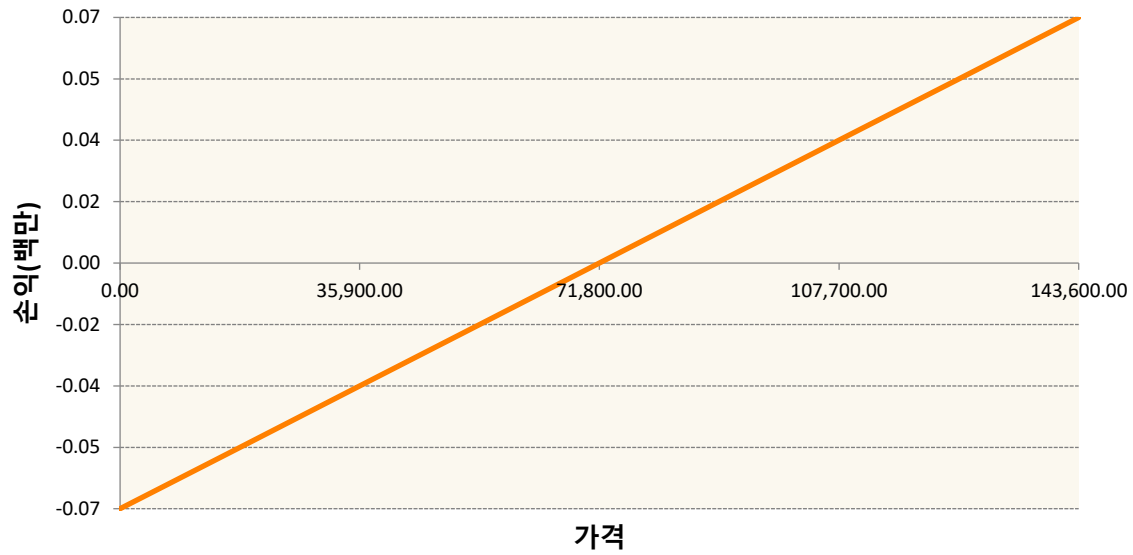
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	106	-106	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	496	2,508	-2,012	장내
누계	유가증권	스왑	0	0	0	장외

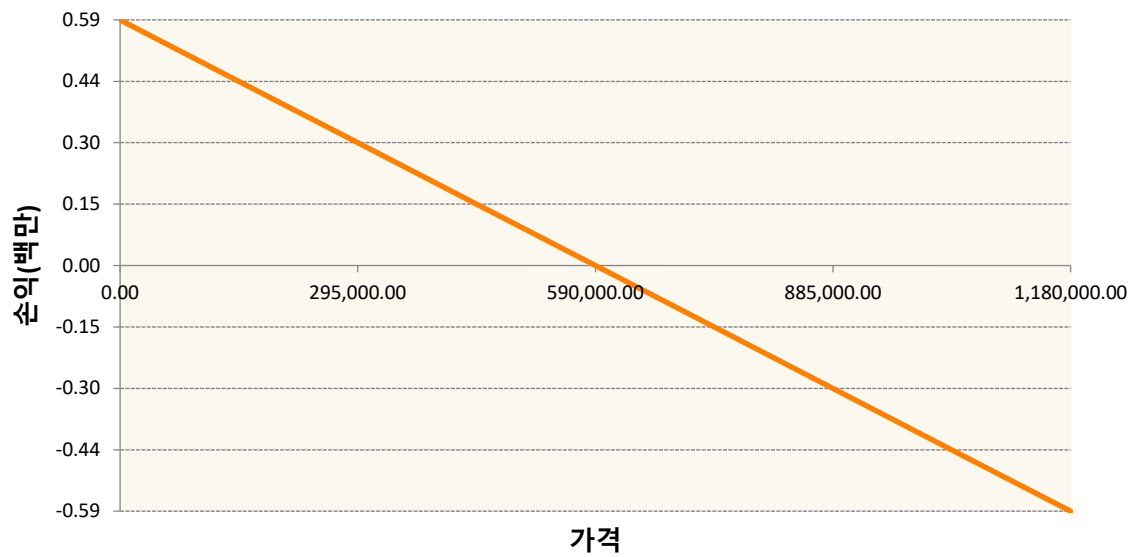
2. 만기시점의 손익구조



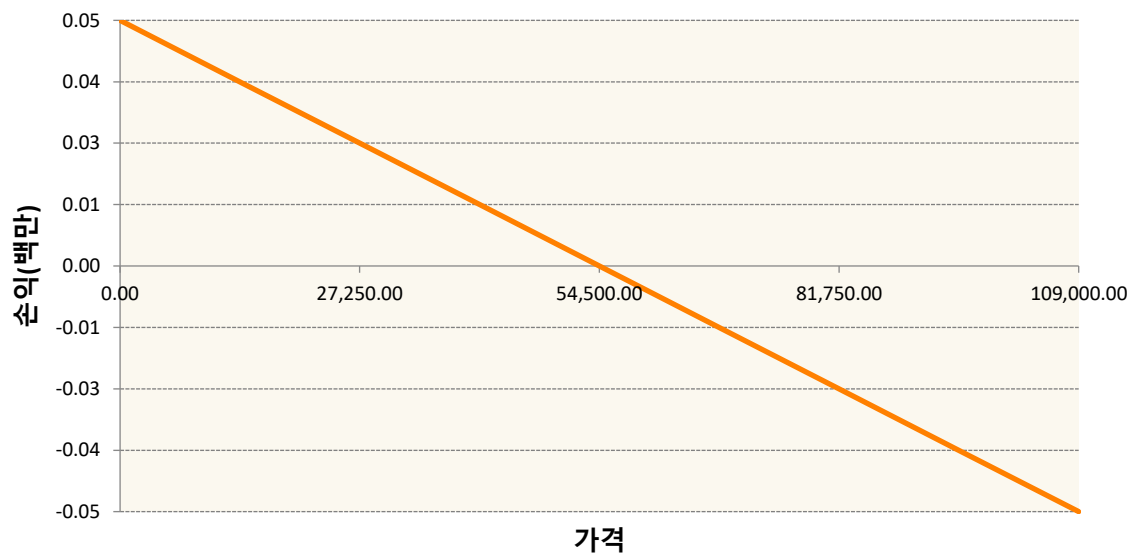
KR4111T70004-2023-07 삼성전자개별선물



KR41F5T70000-2023-07 LG에너지솔루션개별선물



KR41F7T70006-2023-07 카카오페이개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
KR4101T900	2023-09 코스피200지수선물	118
KR4106T900	2023-09 코스닥150선물	68
KR4111T700	2023-07 삼성전자개별선물	40
KR41F5T700	2023-07 LG에너지솔루션개별선물	8
KR41F7T700	2023-07 카카오페이개별선물	7
KRS0004099	SWAP_MICRON TECH_0308	0.01
KRS0004212	SWAP_SPDR S&P BIOTECH_0413	1

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	408

공시일	2023-06-15
기준일	2023-06-14

코리아인덱스(주식-파생형)(종)

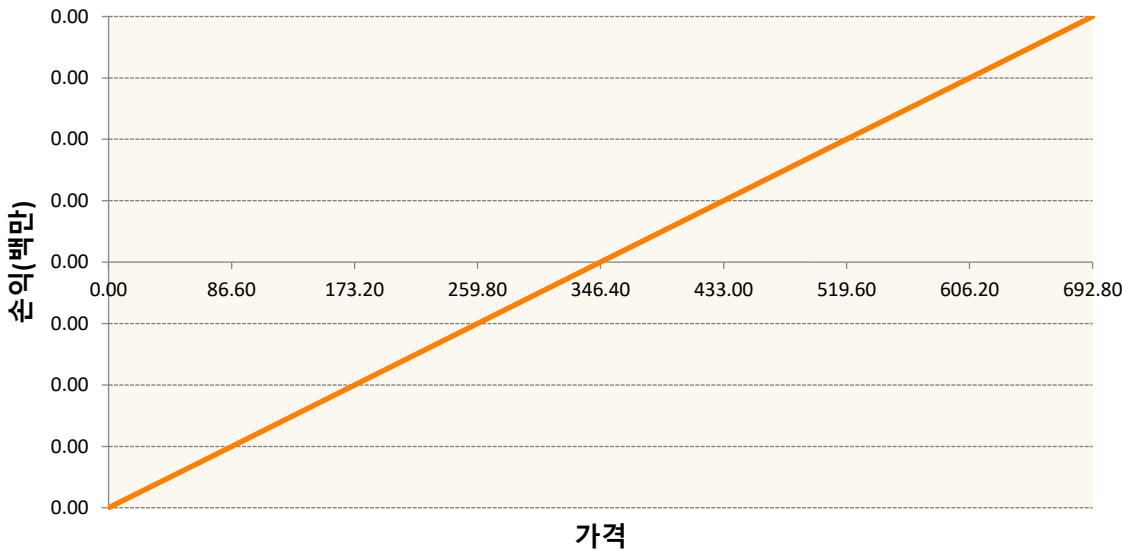
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	433	0	433	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101T90003-2023-09 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101T90003			2023-09 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%	-23	-23	-23	-23	-23	-23	-23
-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%	23	23	23	23	23	23	23
8.00%	34	34	34	34	34	34	34

공시일	2023-06-15
기준일	2023-06-14

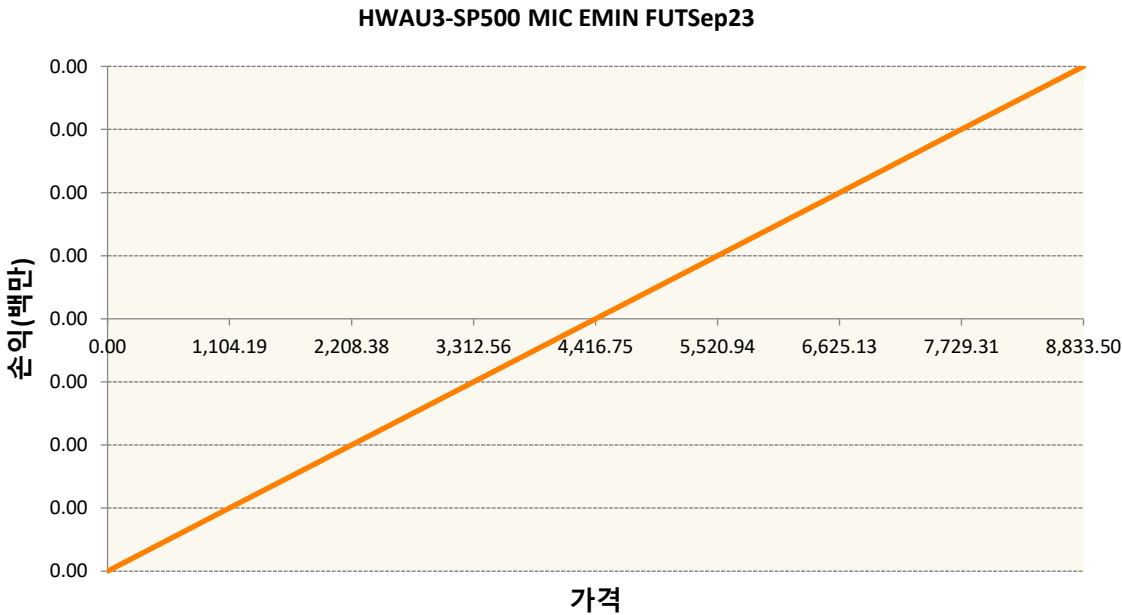
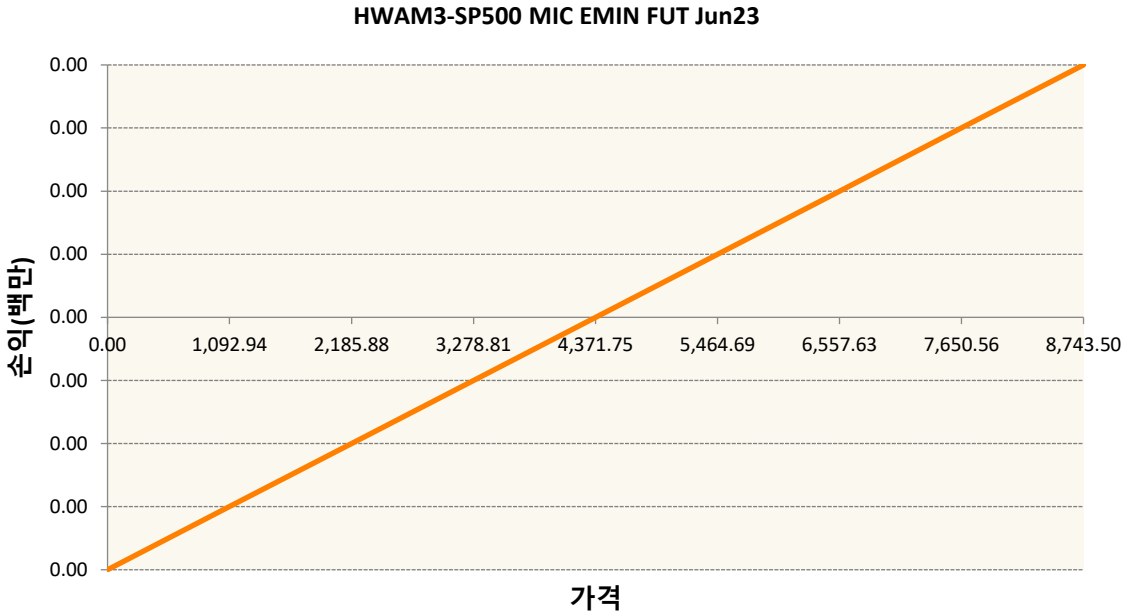
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

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	875	0	875	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
HWAM3	SP500 MIC EMIN FUT Jun23		32
HWAU3	SP500 MIC EMIN FUTSep23		38

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)			(단위:백만원)
			118

공시일	2023-06-15
기준일	2023-06-14

SOL유럽탄소배출권선물인버스ICE특별자산상

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	0	2,206	-2,206	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213D6E002	KRW/EUR 30-06-23E	177
--------------	-------------------	-----

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

(단위:백만원)

141

공시일	2023-06-15
기준일	2023-06-14

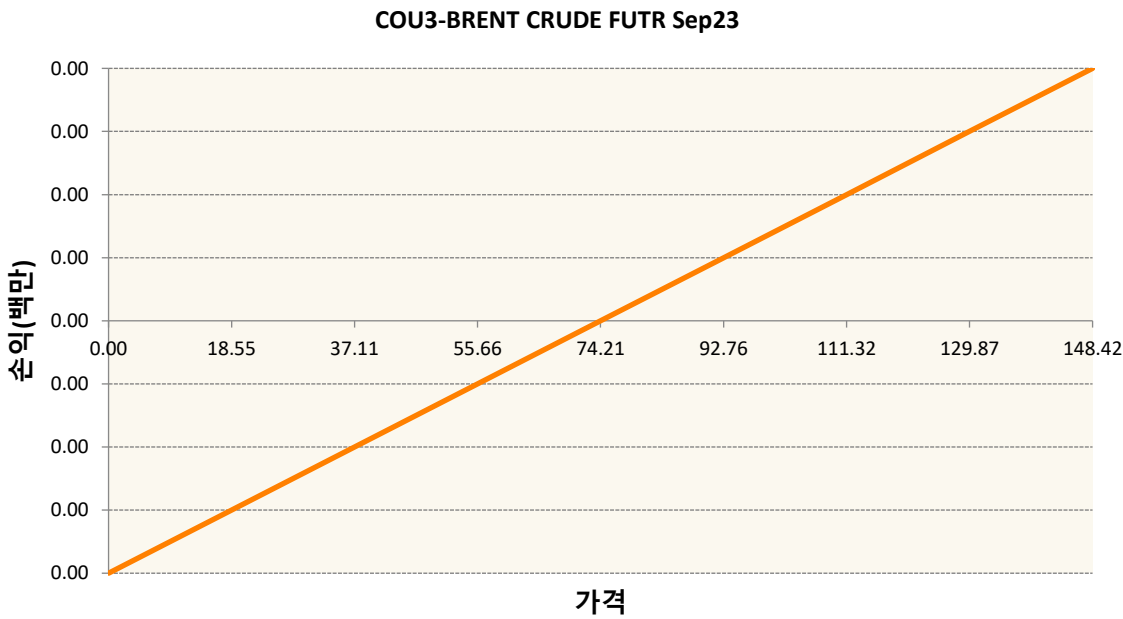
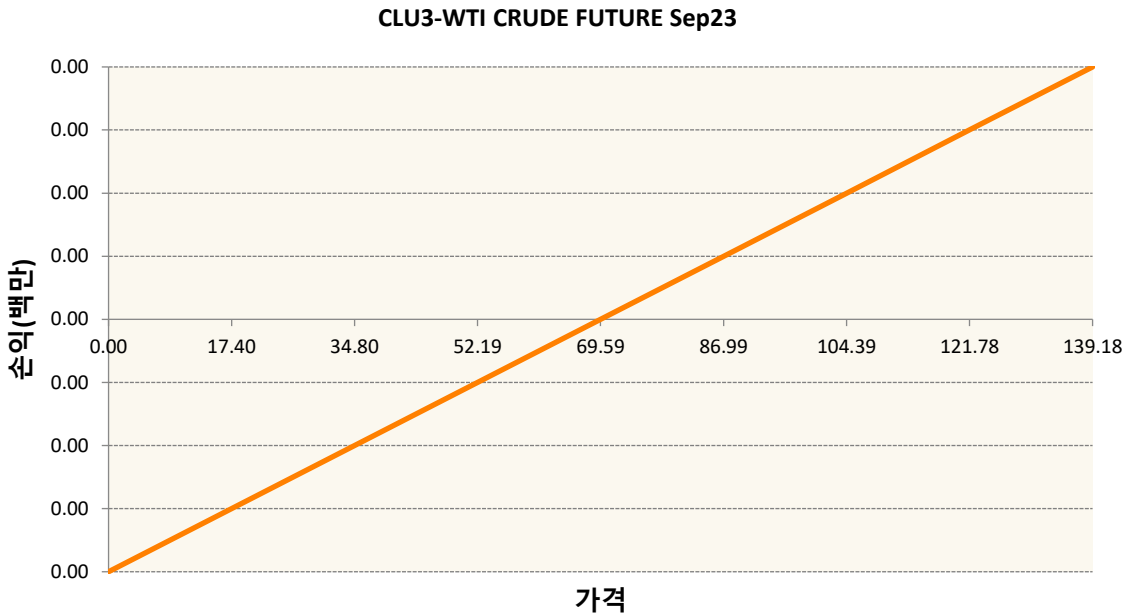
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

1. 계약금액

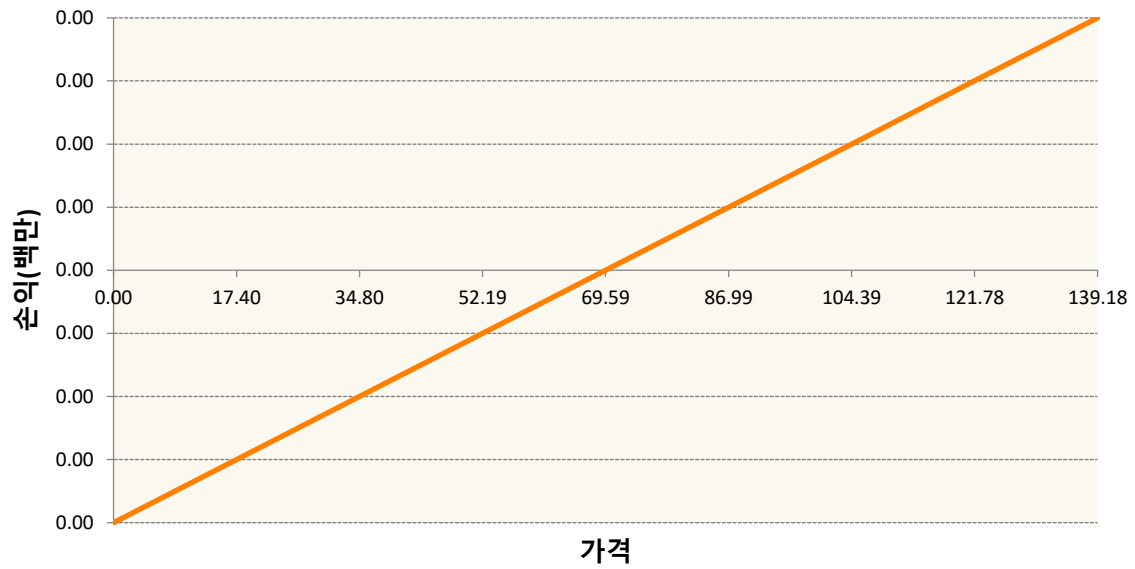
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,288	128	1,160	

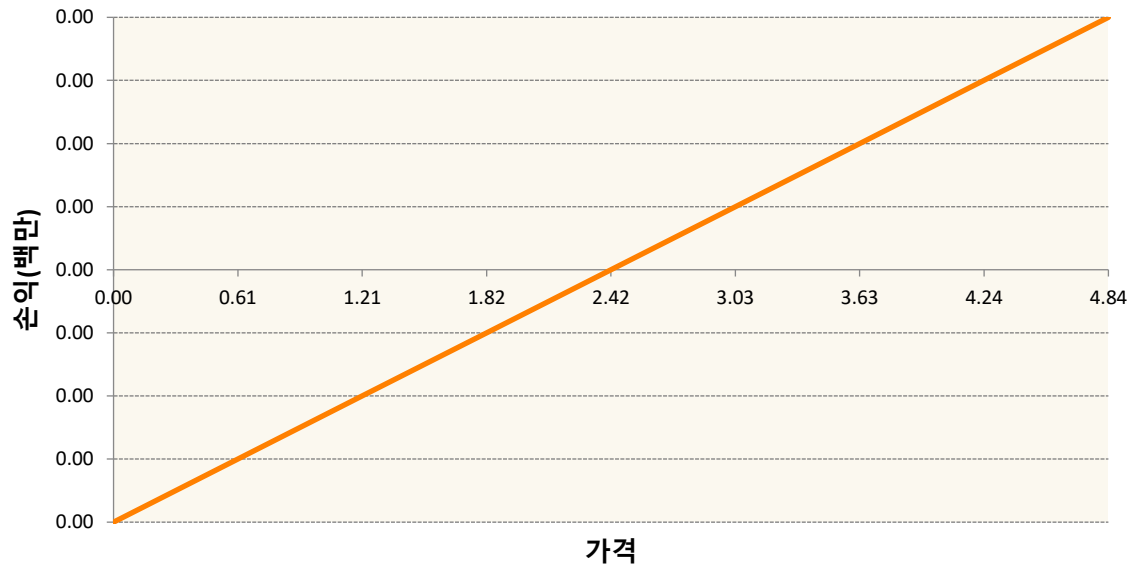
2. 만기시점의 손익구조



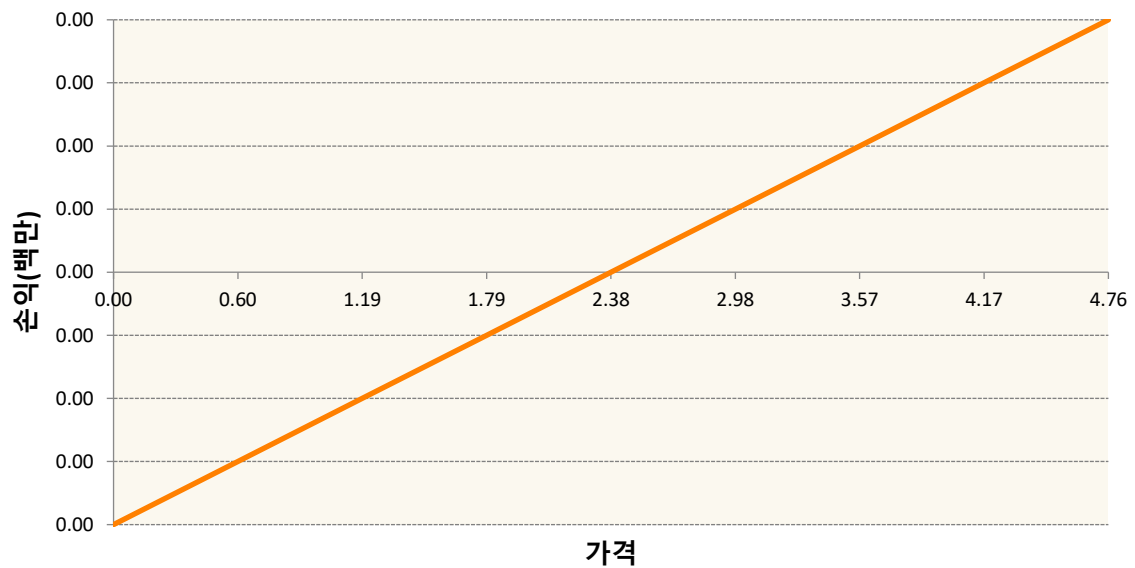
ECU3-E-mini Crude Oil Sep23



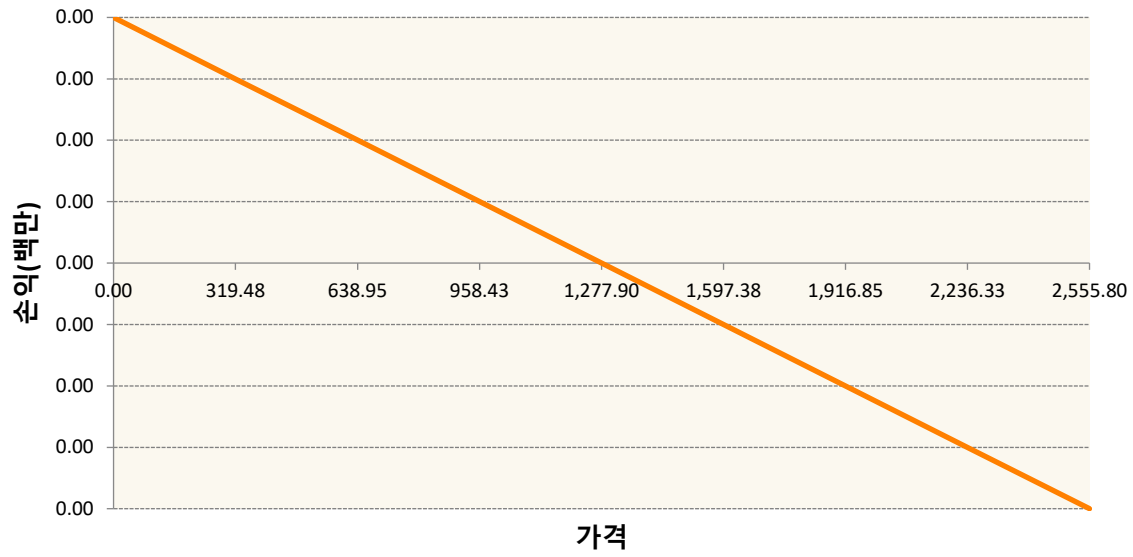
EOU3-E-MINI NATURAL GAS Sep23



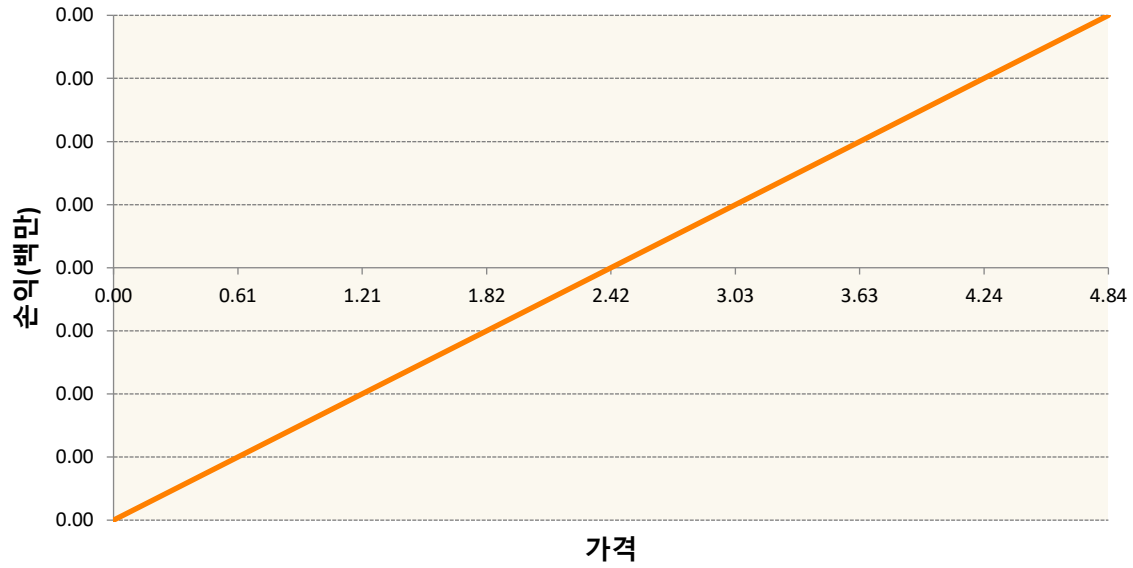
HOU3-NY Harb ULSD Fut Sep23



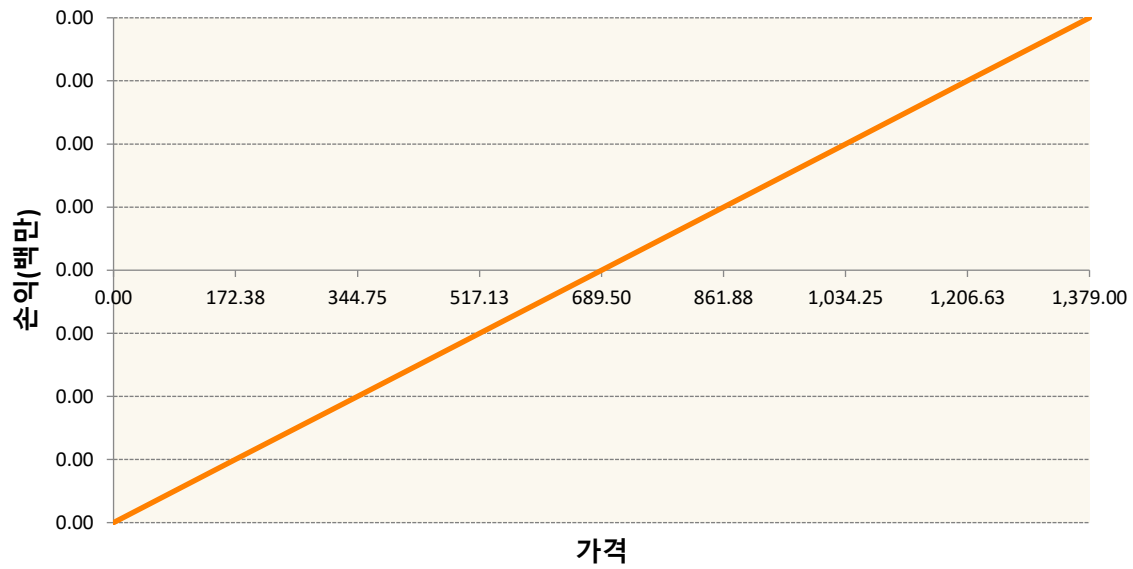
KR4175T60000-2023-06 달러선물

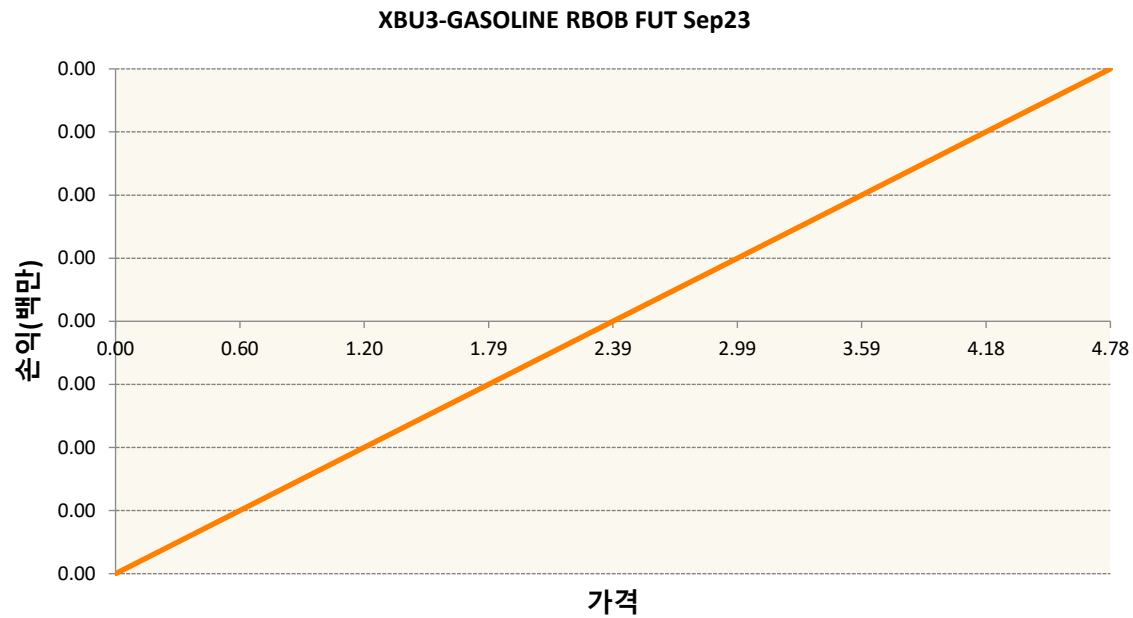


NGU23-NATURAL GAS FUTR Sep23



QSU3-Low Su Gasoil G Sep23





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
CLU3	WTI CRUDE FUTURE Sep23	22
COU3	BRENT CRUDE FUTR Sep23	24
ECU3	E-mini Crude Oil Sep23	7
EOU3	E-MINI NATURAL GAS Sep23	3
HOU3	NY Harb ULSD Fut Sep23	10
KR4175T600 2023-06 달러선물		10
NGU23	NATURAL GAS FUTR Sep23	20
QSU3	Low Su Gasoil G Sep23	7
XBU3	GASOLINE RBOB FUT Sep23	10

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