

공시일	2024-02-06
기준일	2024-02-05

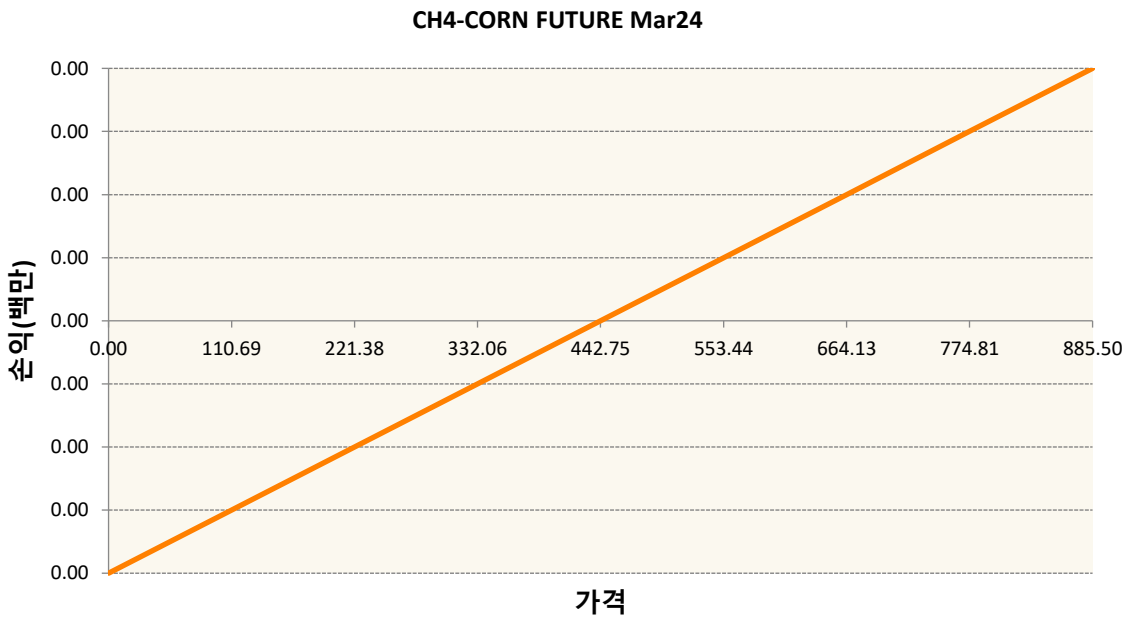
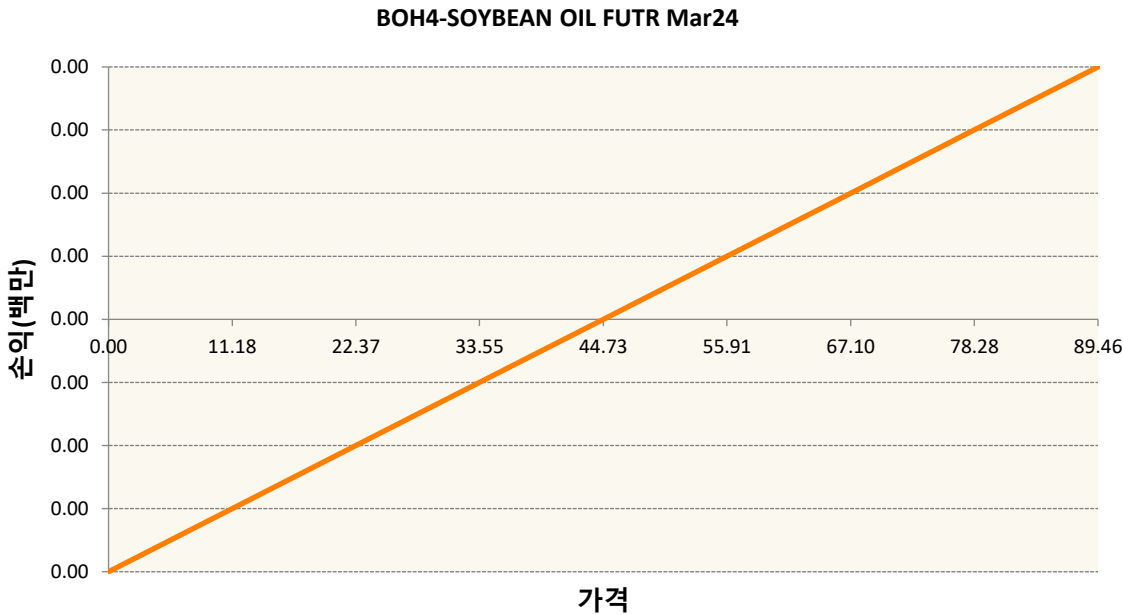
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

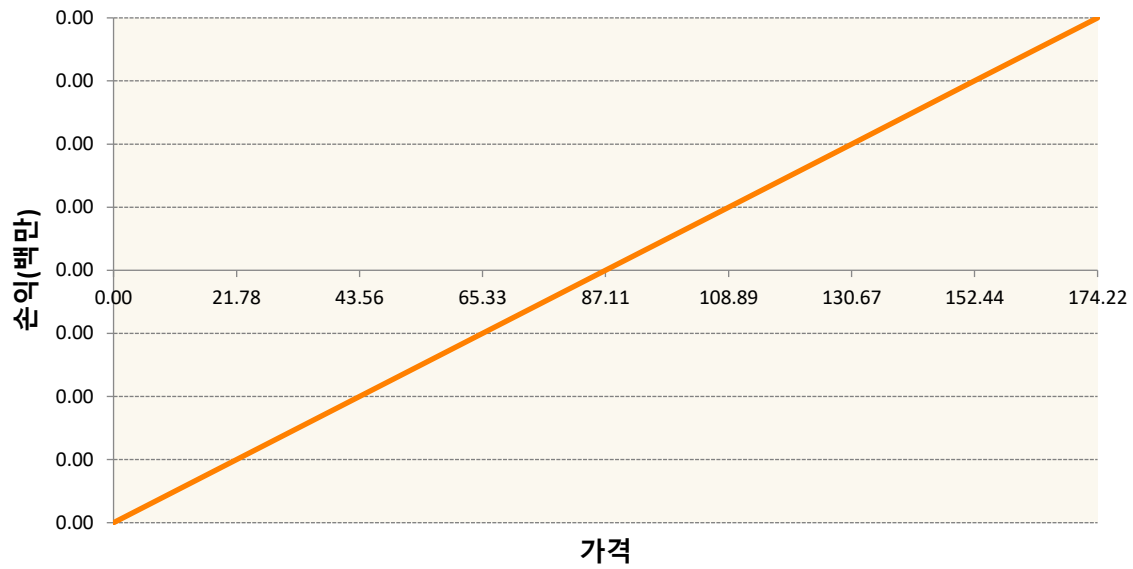
(단위:USD 백만)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	4,390	0	4,390	
누계	통화	선물	0	479	-479	장내

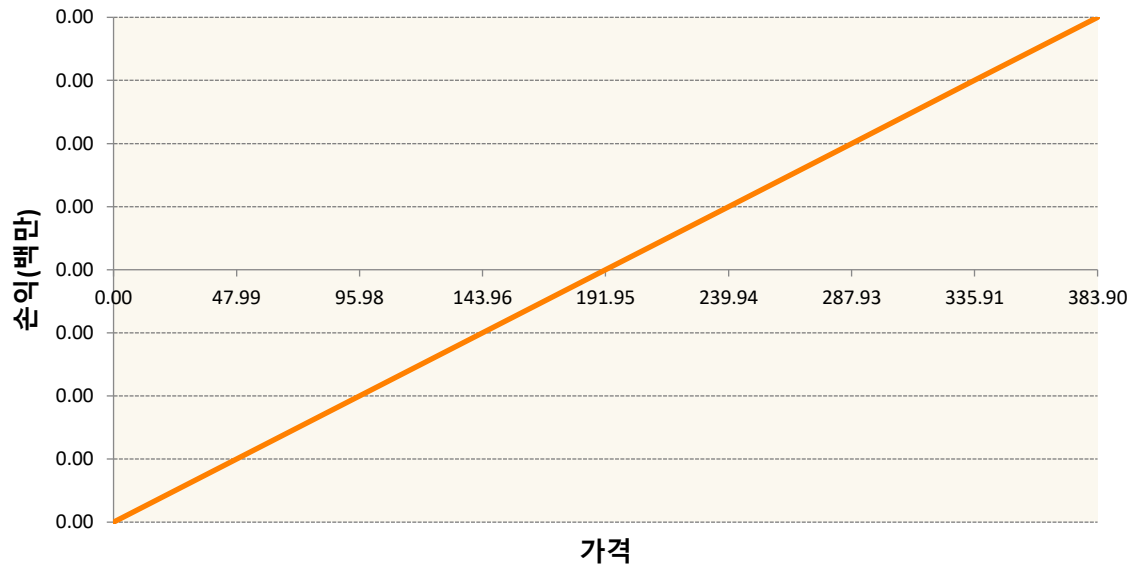
2. 만기시점의 손익구조



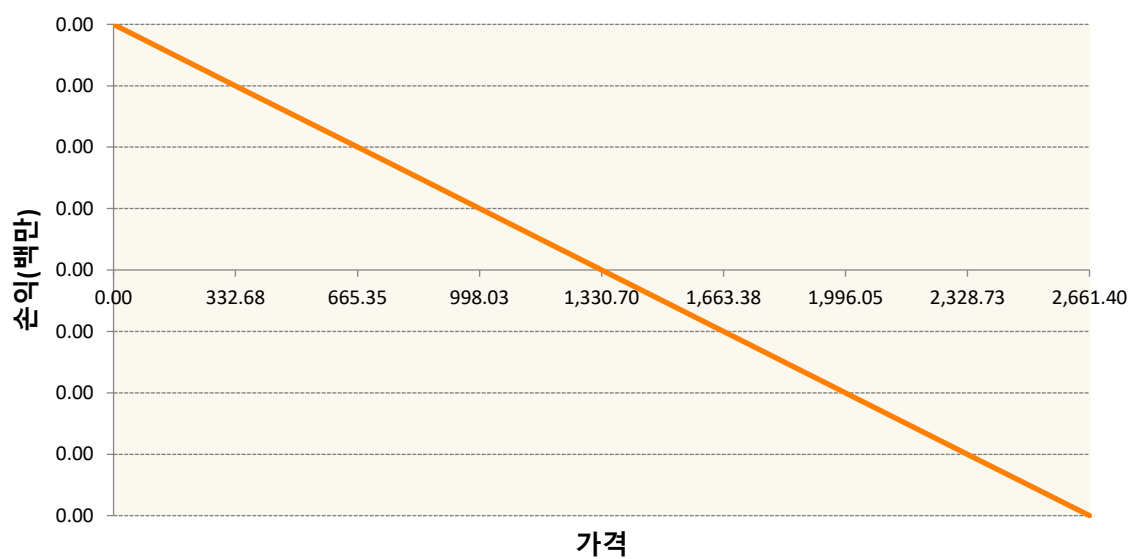
CTH4-COTTON NO.2 FUTR Mar24



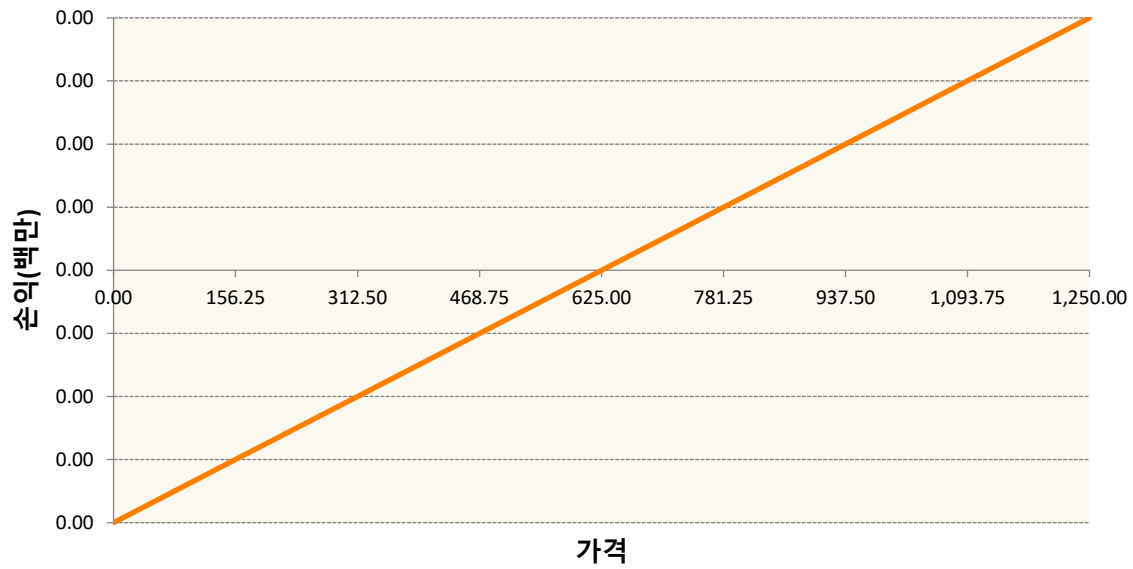
KCH4-COFFEE 'C' FUTURE Mar24



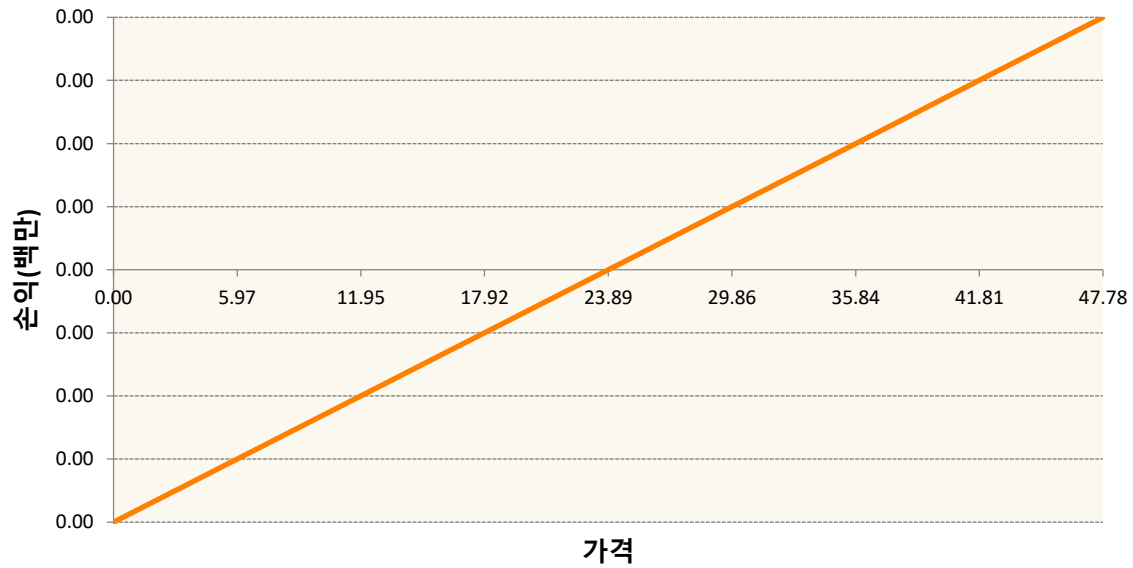
KR4175V20000-2024-02 달러선물



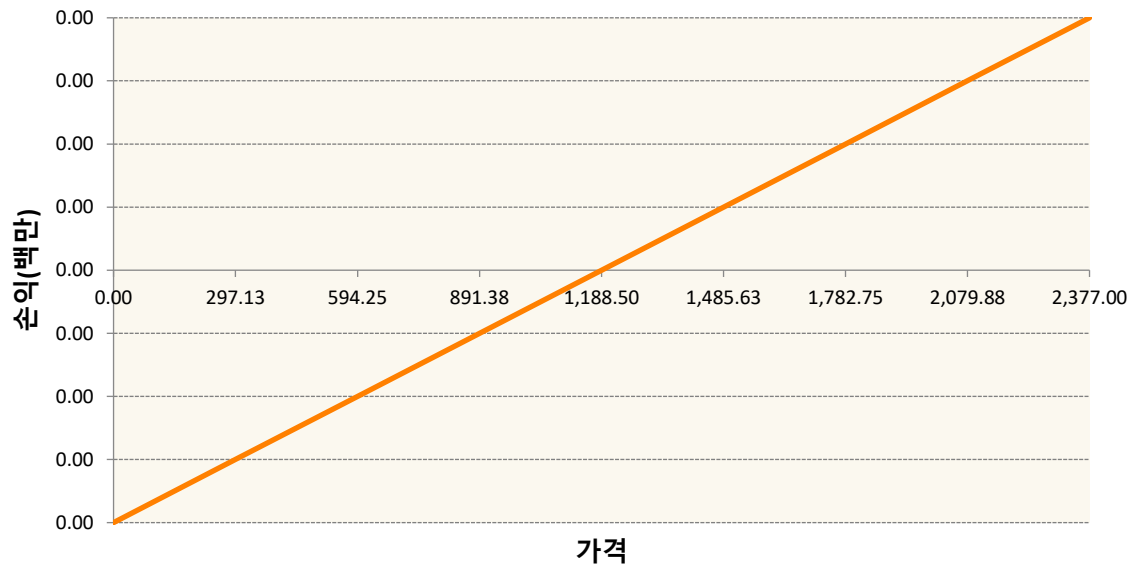
KWH4-KC HRW WHEAT FUT Mar24



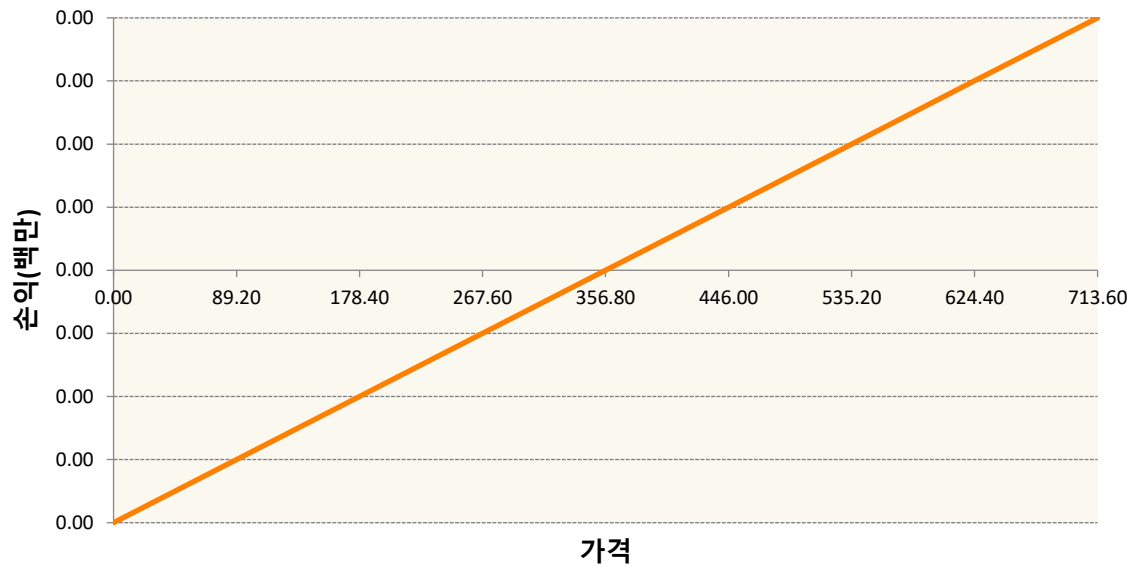
SBH4-Sugar #11 (WORLD) Mar24



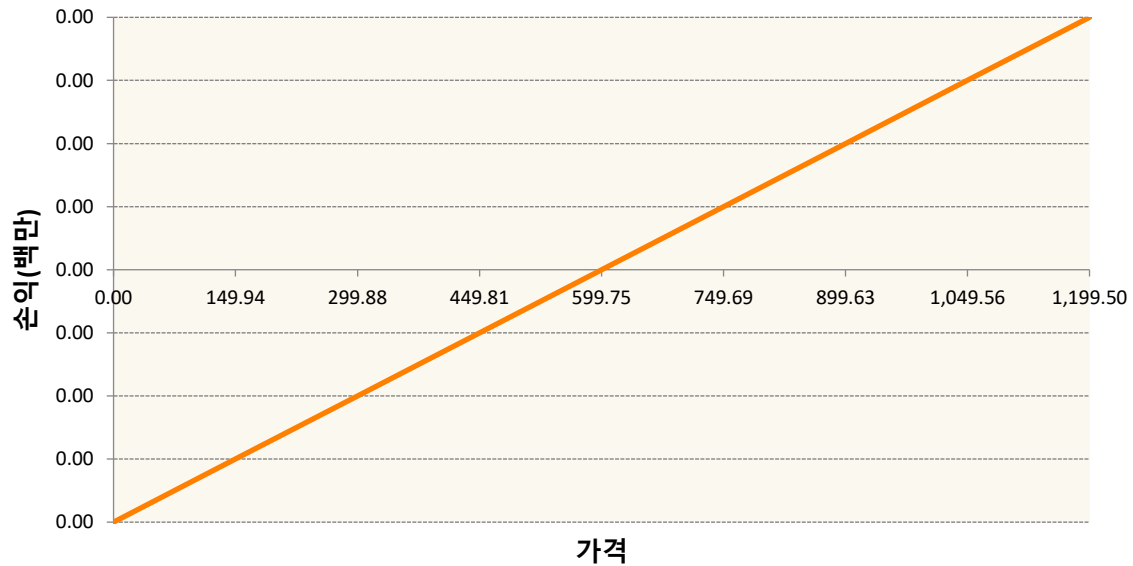
SH4-SOYBEAN FUTURE Mar24



SMH4-SOYBEAN MEAL FUTR Mar24



WH4-WHEAT FUTURE(CBT) Mar24



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

공시일	2024-02-06
기준일	2024-02-05

스마트인덱스모

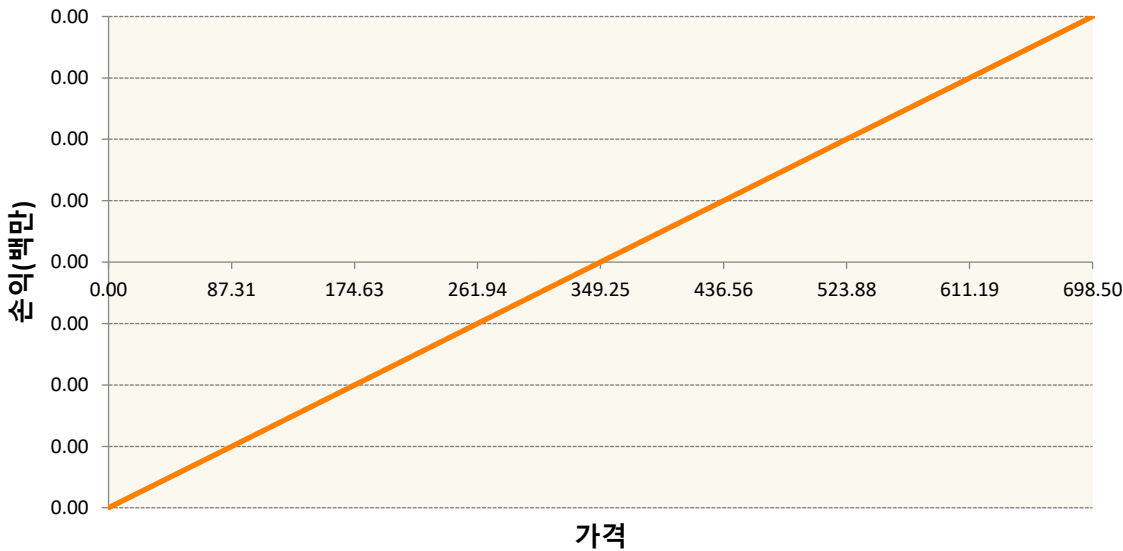
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	87	-87	장내
누계	유가증권	선물	1,397	0	1,397	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101V30005-2024-03 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101V30005		2024-03 코스피200지수선물					112
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-112	-112	-112	-112	-112	-112	-112
-5.33%	-74	-74	-74	-74	-74	-74	-74
-2.67%	-37	-37	-37	-37	-37	-37	-37
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	37	37	37	37	37	37	37
5.33%	74	74	74	74	74	74	74
8.00%	112	112	112	112	112	112	112

공시일	2024-02-06
기준일	2024-02-05

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	3,163	0	3,163	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 신한CSI500미래231226	228
-----------------------------	-----

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

225

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2024-02-06
기준일	2024-02-05

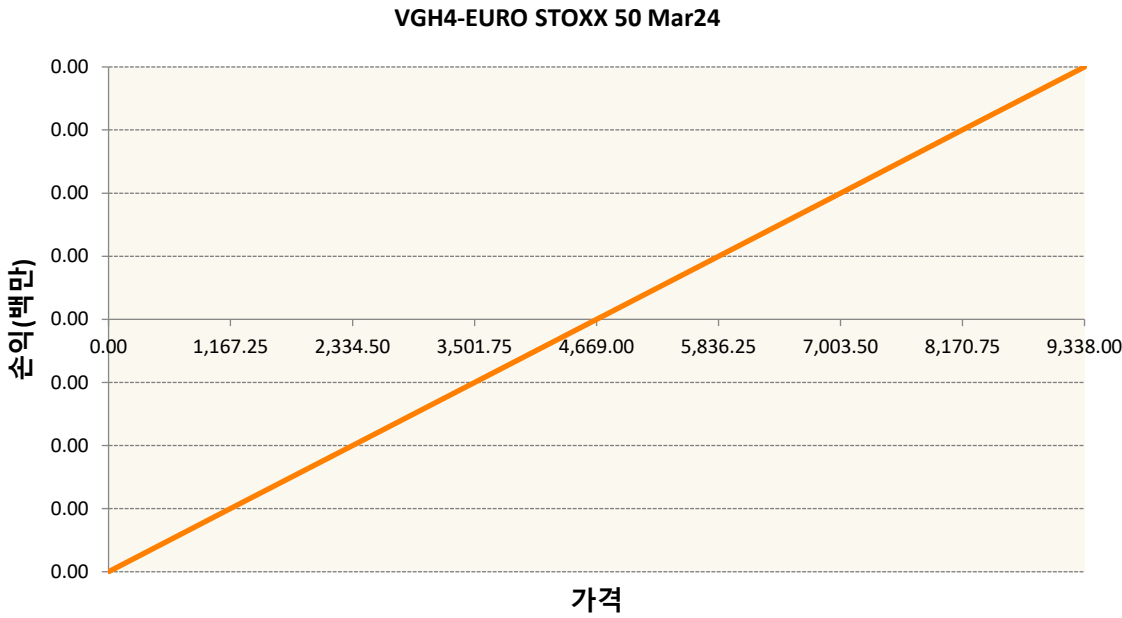
유로인덱스모(주식-파생형)

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	1,064	0	1,064	
누계	통화	선도	215	0	215	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213DCL	EUR/KRW 22-03-24E	17
VGH4	EURO STOXX 50 Mar24	85

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

(단위:백만원)

76

공시일	2024-02-06
기준일	2024-02-05

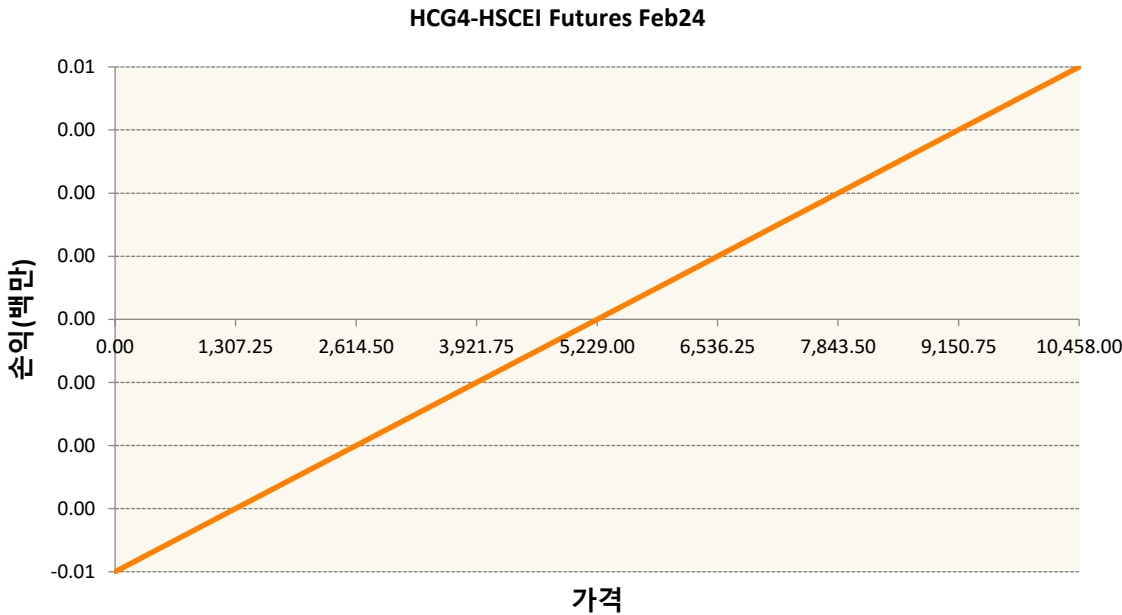
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,028	0	1,028	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCG4	HSCEI Futures Feb24	82
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

121

공시일	2024-02-06
기준일	2024-02-05

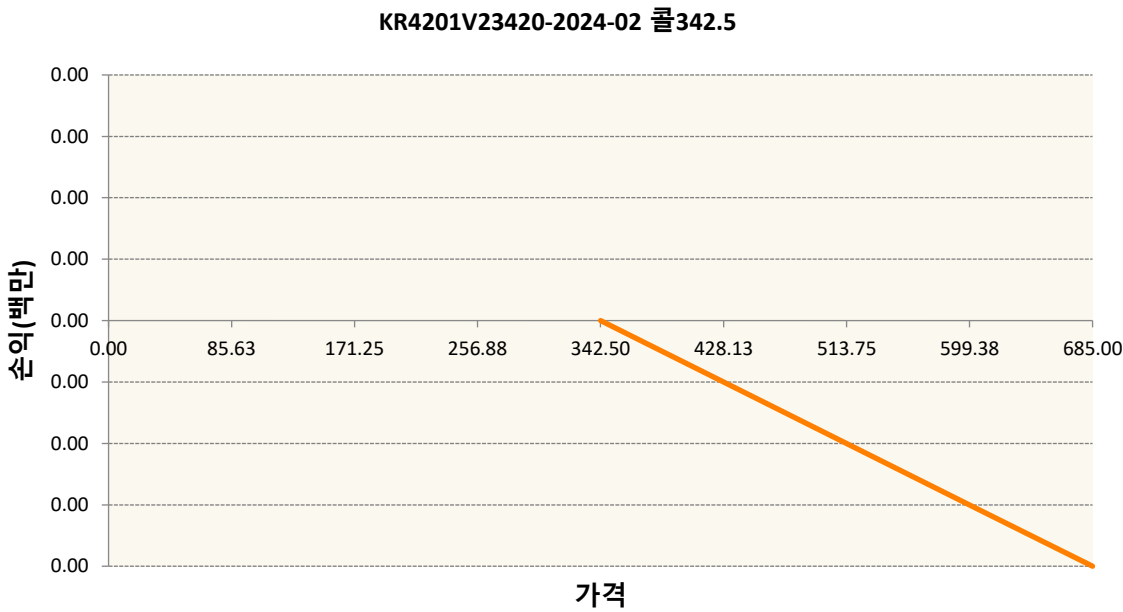
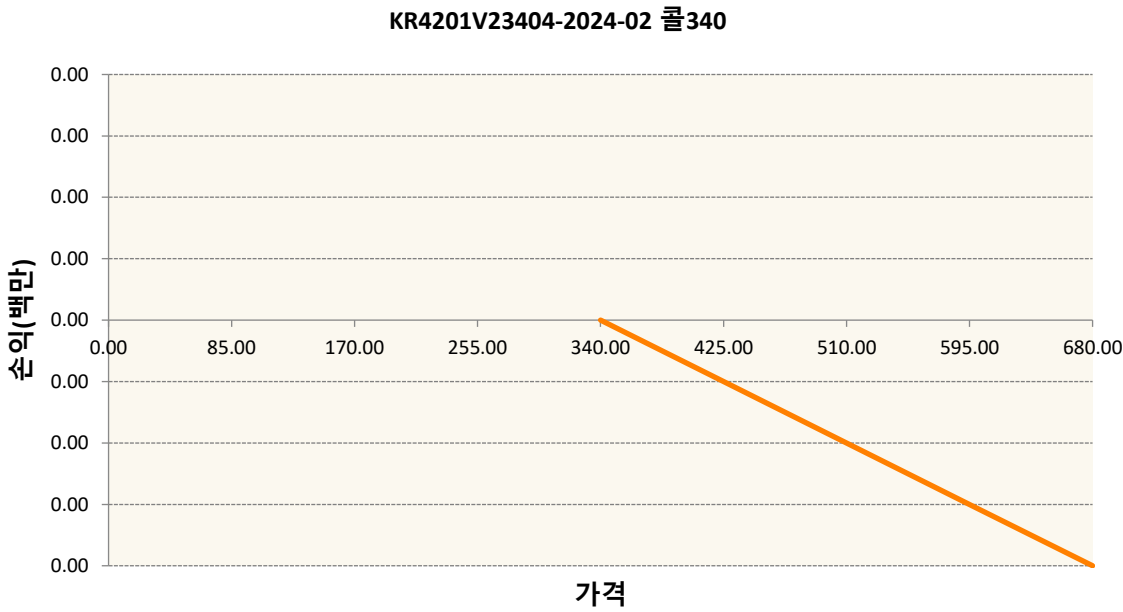
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

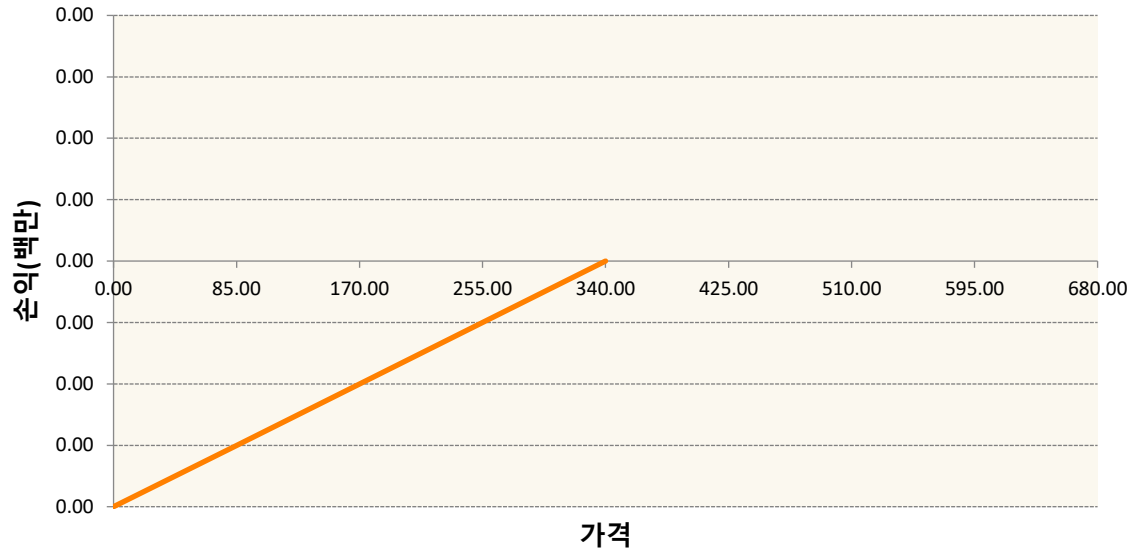
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	49,597	-49,597	장내

2. 만기시점의 손익구조



KR4301V23402-2024-02 풋340



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201V23404		2024-02 콜340					2,772
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	995	995	994	992	990	986	981
-5.33%	977	967	955	941	925	908	890
-2.67%	745	716	688	659	631	602	574
0%	41	29	15	0	-17	-35	-55
2.67%	-882	-883	-885	-887	-891	-896	-902
5.33%	-1,827	-1,827	-1,827	-1,827	-1,827	-1,828	-1,829
8.00%	-2,772	-2,772	-2,772	-2,772	-2,772	-2,772	-2,772
KR4201V23420		2024-02 콜342.5					450
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	130	130	130	130	130	129	129
-5.33%	129	128	127	125	123	121	119
-2.67%	106	102	97	93	88	84	79
0%	10	7	3	0	-4	-7	-11
2.67%	-138	-138	-139	-140	-141	-142	-144
5.33%	-294	-294	-294	-294	-294	-294	-295
8.00%	-450	-450	-450	-450	-450	-450	-450
KR4301V23402		2024-02 풋340					512
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-512	-512	-512	-512	-512	-512	-512
-5.33%	-257	-257	-258	-259	-260	-261	-263
-2.67%	-44	-49	-54	-59	-64	-69	-74
0%	3	2	1	0	-1	-3	-5

2.67%	3	3	3	3	3	3	3
5.33%	3	3	3	3	3	3	3
8.00%	3	3	3	3	3	3	3

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

(단위:백만원)

4,240

공시일	2024-02-06
기준일	2024-02-05

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	1,839	0	1,839	

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	2024-02-06
기준일	2024-02-05

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	4,490	0	4,490	

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	2024-02-06
기준일	2024-02-05

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	17,738	0	17,738	
누계	통화	선도	0	17,733	-17,733	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213DBV KRW/USD 29-02-24E	654
FXW213DCT KRW/USD 29-03-24E	516
FXW213E1W KRW/USD 30-04-24E	249
IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

734

공시일	2024-02-06
기준일	2024-02-05

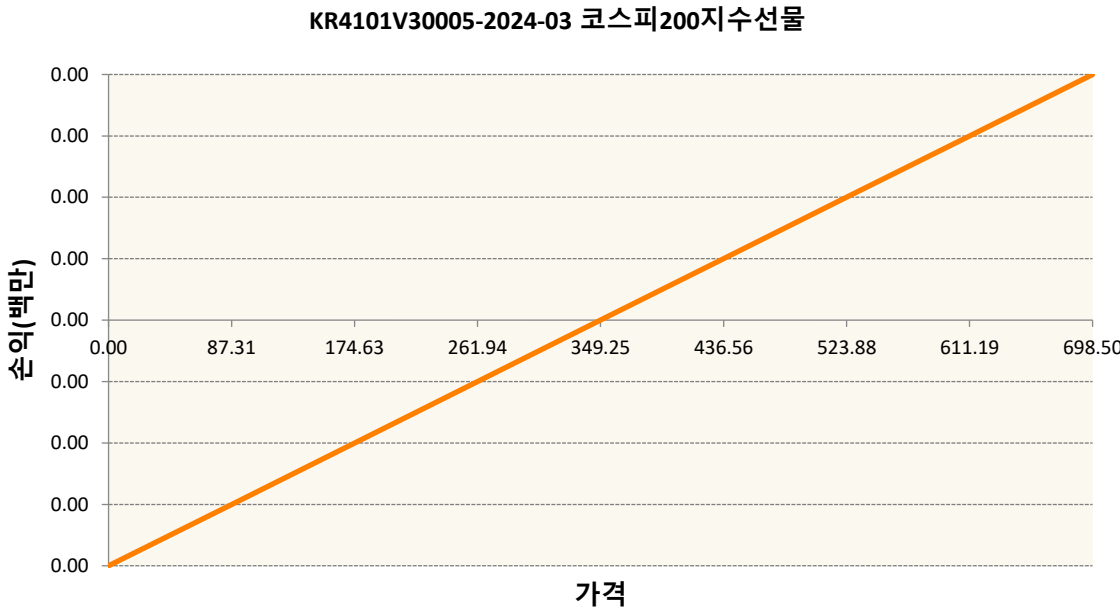
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

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	699	0	699	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101V30005		2024-03 코스피200지수선물					56
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-56	-56	-56	-56	-56	-56	-56
-5.33%	-37	-37	-37	-37	-37	-37	-37
-2.67%	-19	-19	-19	-19	-19	-19	-19
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	19	19	19	19	19	19	19
5.33%	37	37	37	37	37	37	37
8.00%	56	56	56	56	56	56	56

공시일	2024-02-06
기준일	2024-02-05

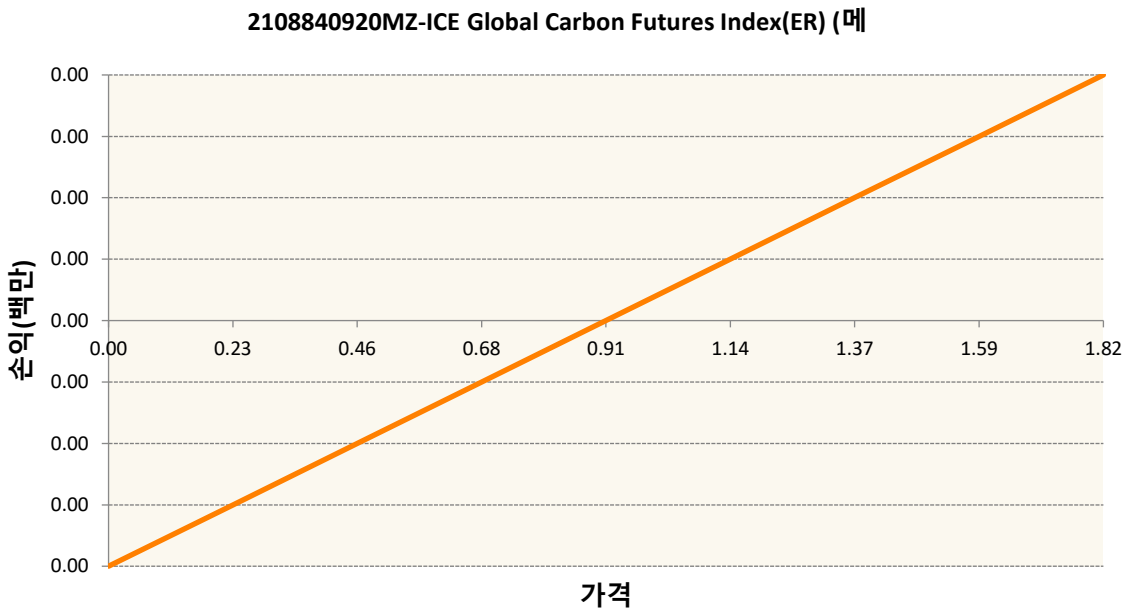
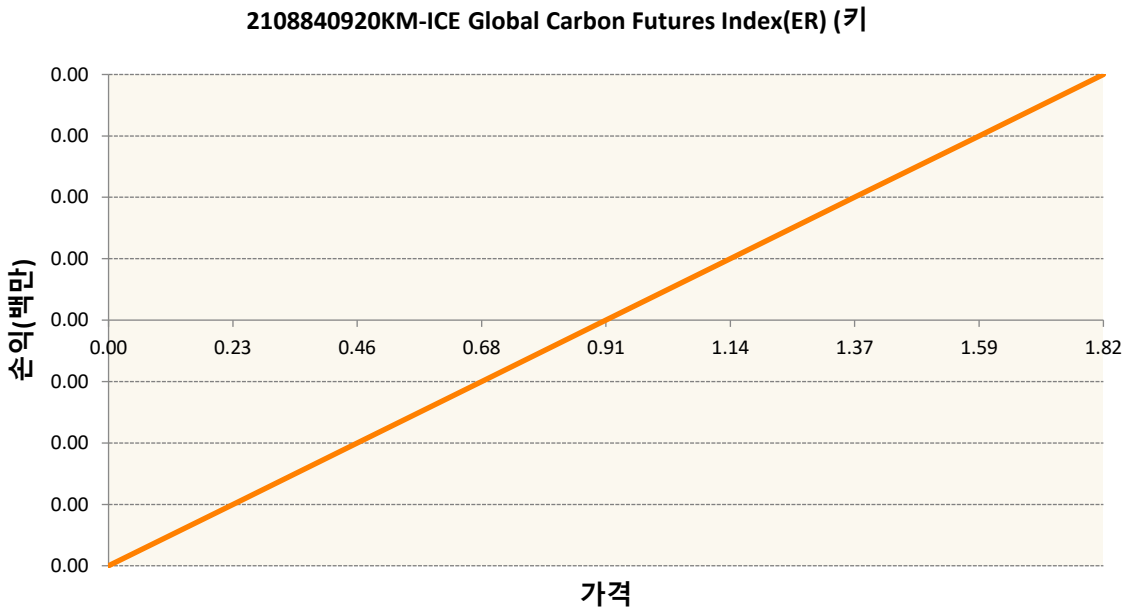
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

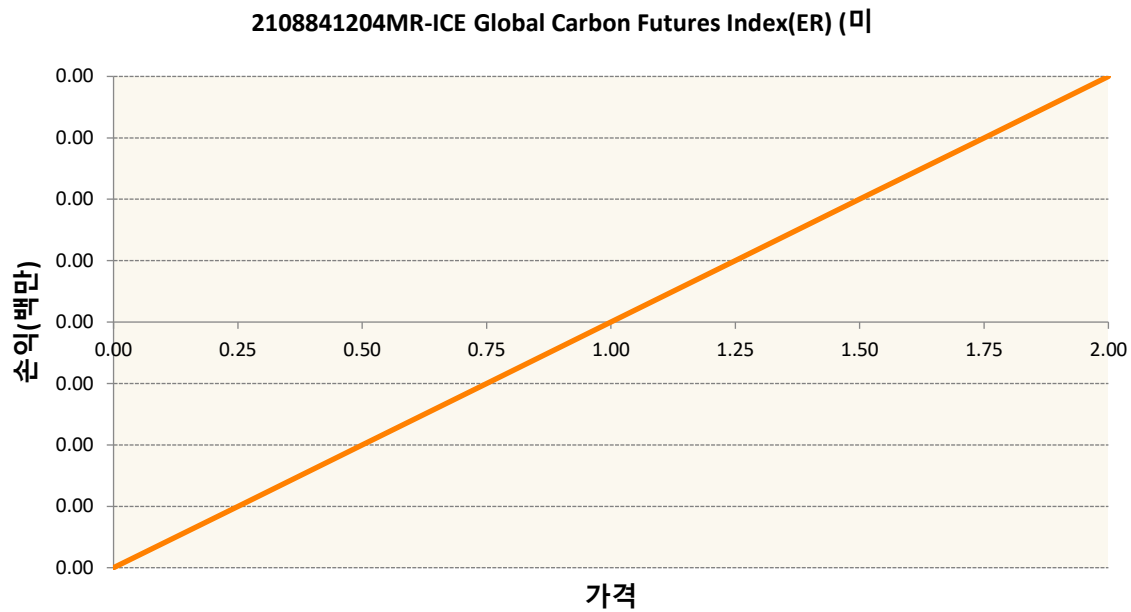
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	19,212	0	19,212	

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108840920ICE Global Carbon Futures Index(ER) (키		900
2108840920ICE Global Carbon Futures Index(ER) (메		180
2108841204ICE Global Carbon Futures Index(ER) (미		450

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,946

공시일	2024-02-06
기준일	2024-02-05

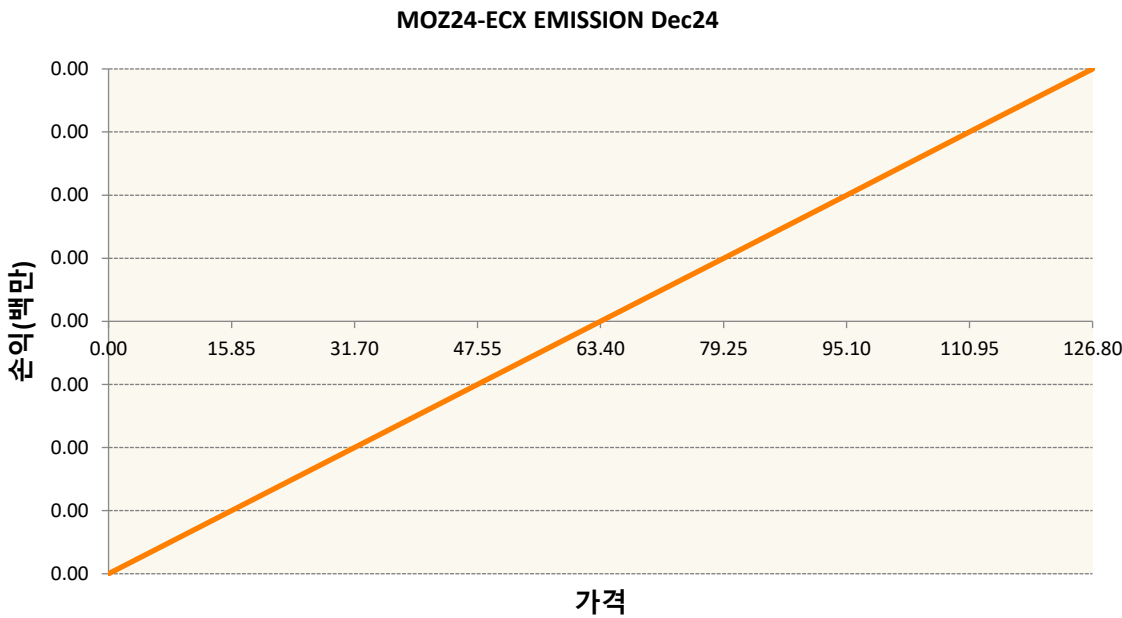
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	8,587	0	8,587	
누계	지수	스왑	424	0	424	장외
누계	통화	선도	0	1,993	-1,993	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213E1W KRW/EUR 29-02-24E	14
FXW213E1W KRW/EUR 29-02-24E	146
MOZ24 ECX EMISSION Dec24	687
SWICEUACN ICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX	6

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

(단위:백만원)

1,313

공시일	2024-02-06
기준일	2024-02-05

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	4,370	0	4,370	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI00000 신한CSI Index 230622 (미래)	7
SWCSI00000 신한CSI Index 230622 (메리츠)	7
SWCSI00000 신한CSI Index 230922 (키움)	5
SWCSI00000 신한CSI Index 231013 (NH)	5

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

(단위:백만원)

35

공시일	2024-02-06
기준일	2024-02-05

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	6,244	0	6,244	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(미래)	30
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(NH)	26
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(메리츠)	36
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(키움)	8

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

(단위:백만원)

107

공시일	2024-02-06
기준일	2024-02-05

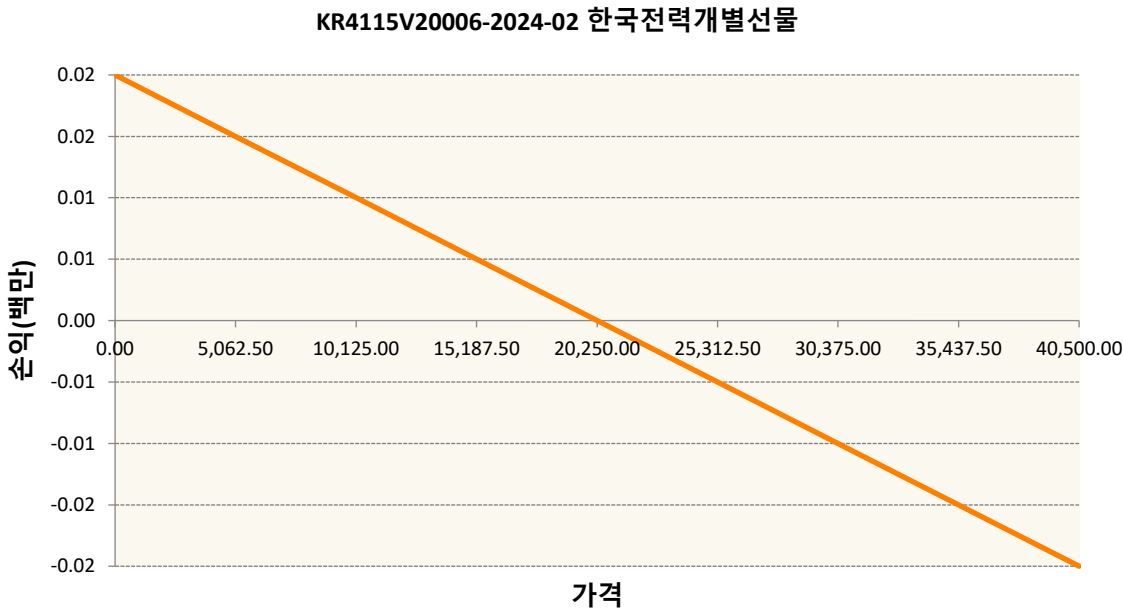
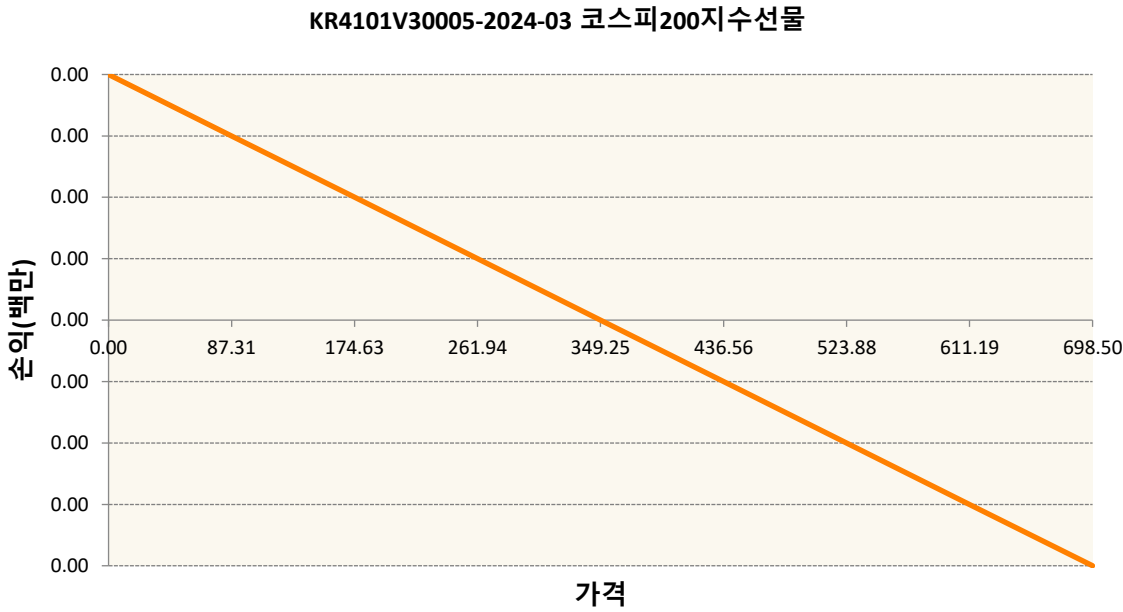
에퀴티알파일반사모혼합자산

1. 계약금액

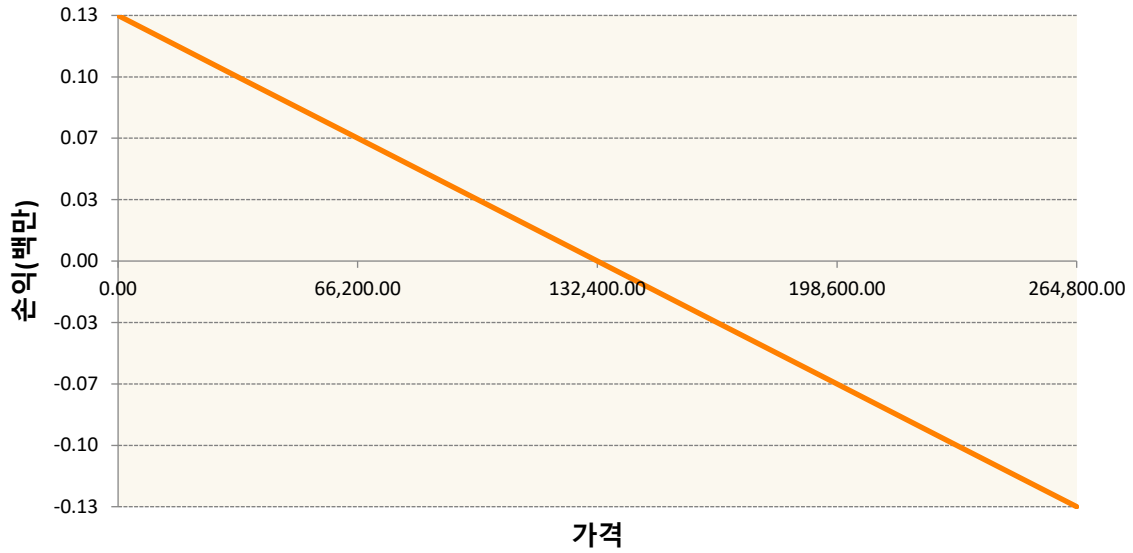
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	23	13	11	장내
누계	유가증권	선물	22	1,008	-986	장내

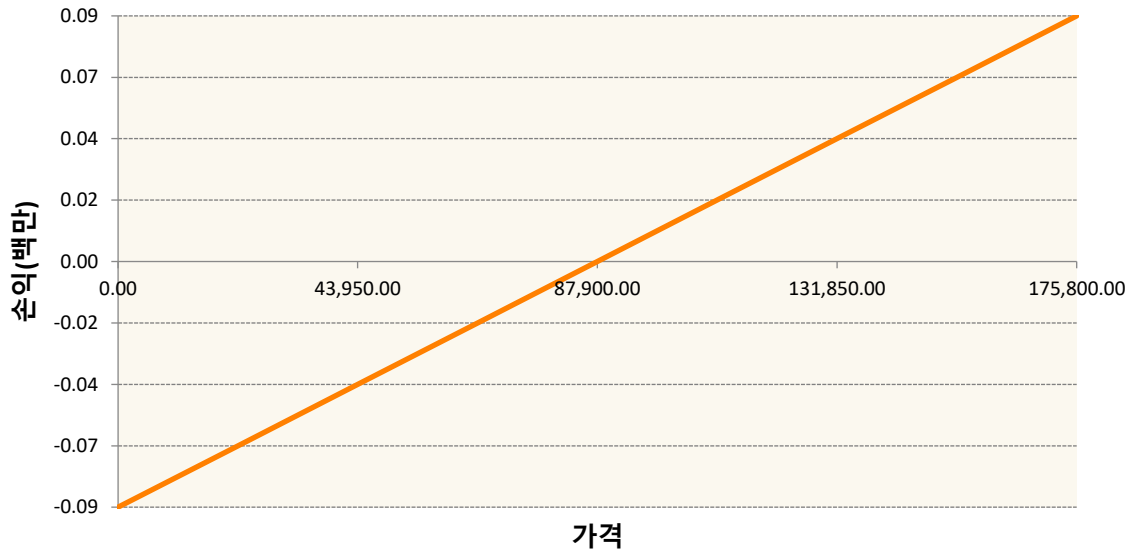
2. 만기시점의 손익구조



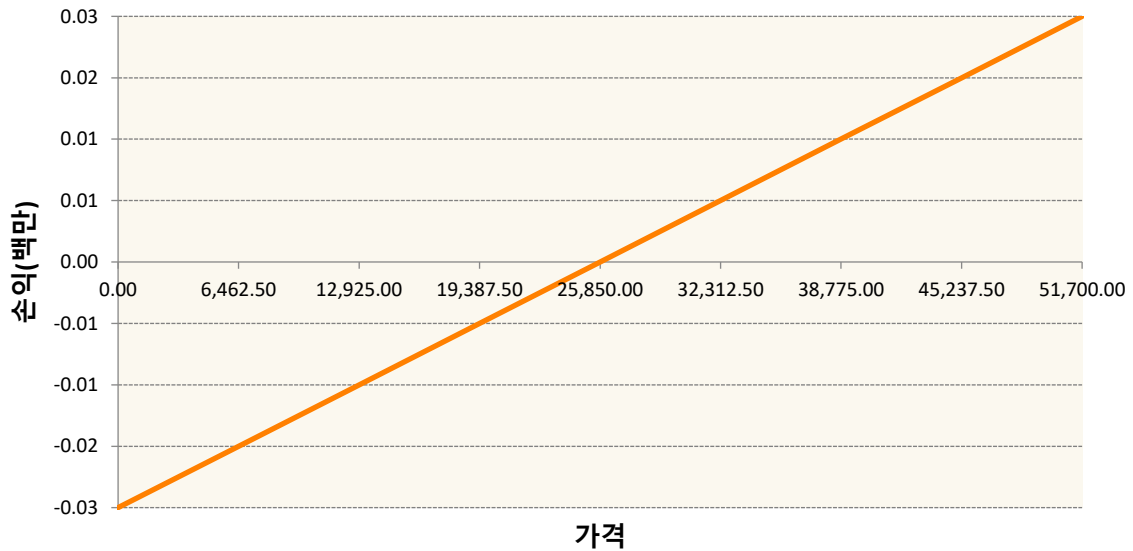
KR4150V20003-2024-02 SK하이닉스개별선물



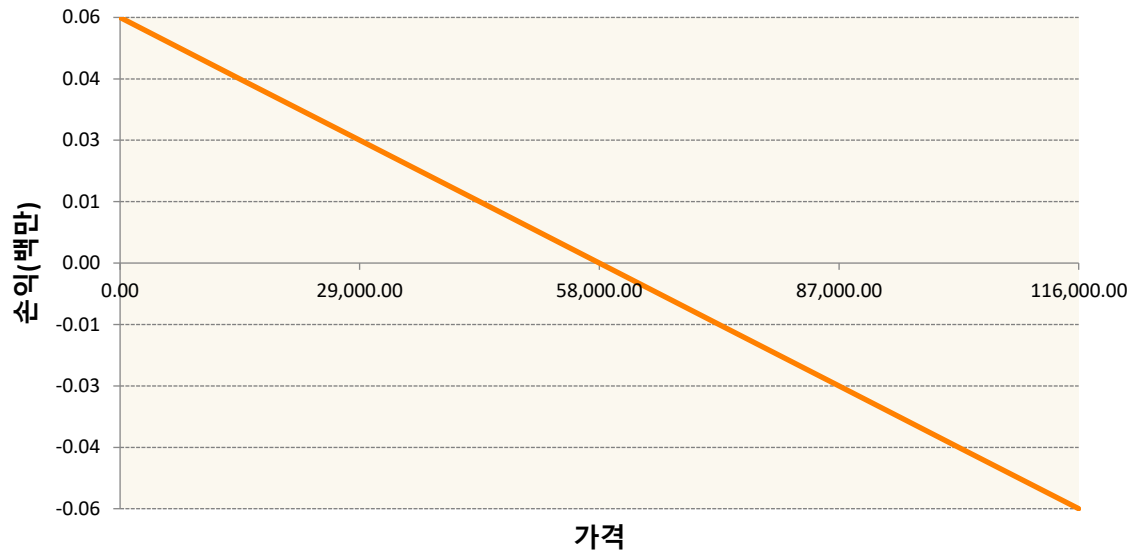
KR4154V20005-2024-02 이마트개별선물



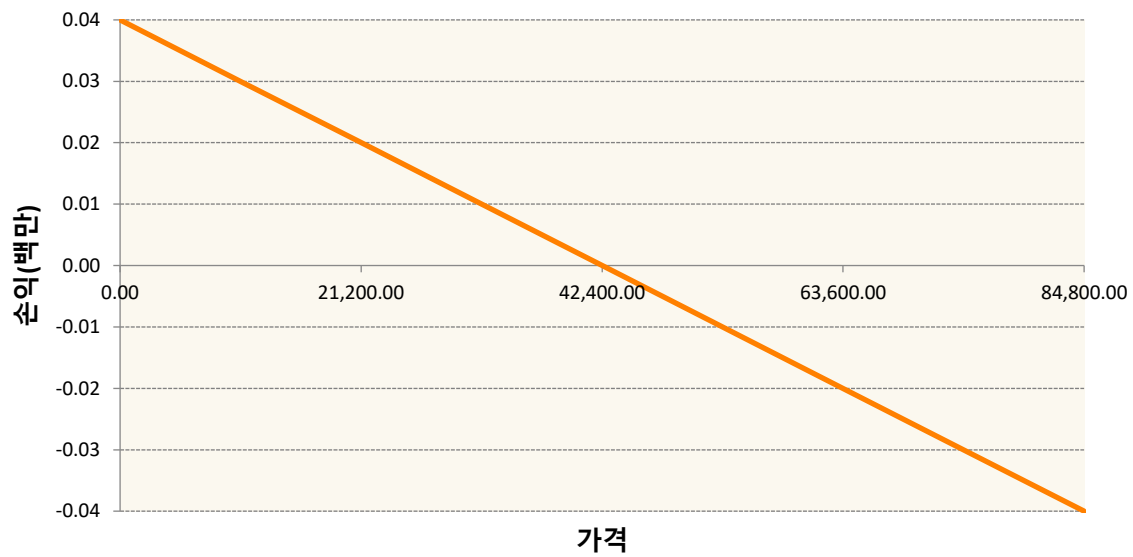
KR41CLV20009-2024-02 씨젠개별선물



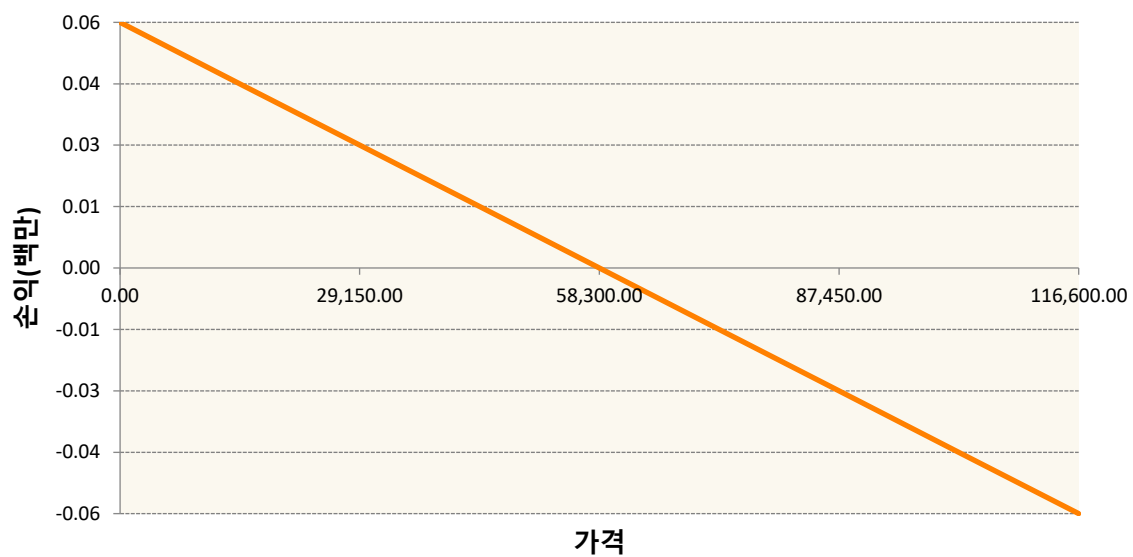
KR41CNV20005-2024-02 포스코DX개별선물



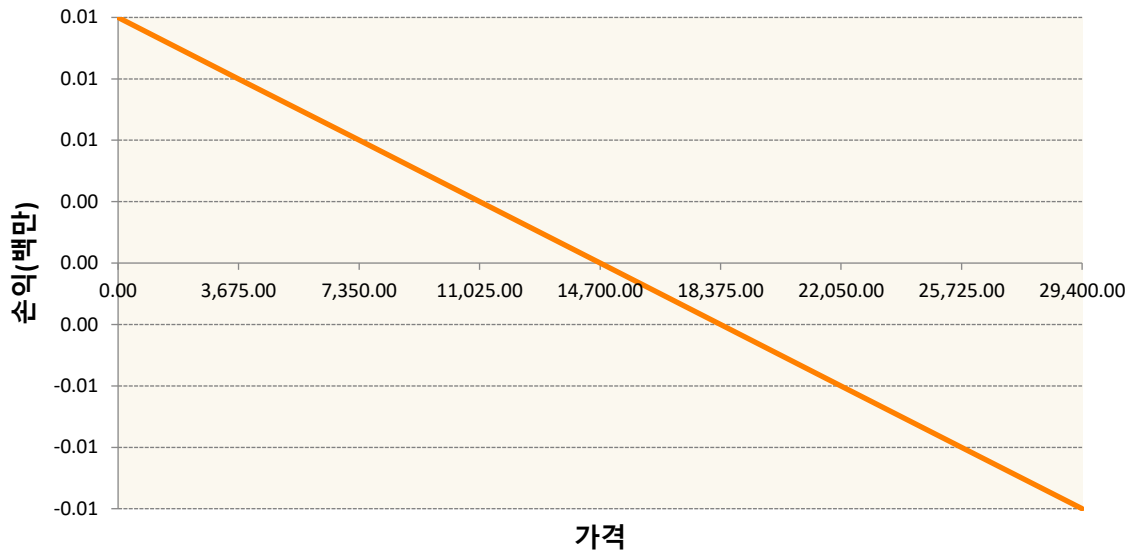
KR41CQV20008-2024-02 와이지엔터테인먼트개별선물



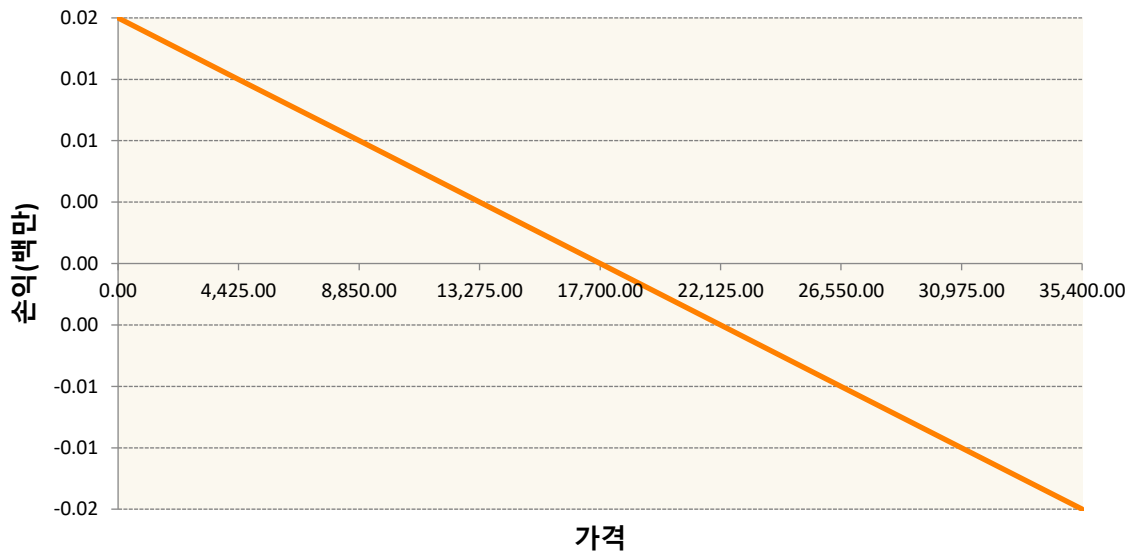
KR41CWV20006-2024-02 코웨이개별선물



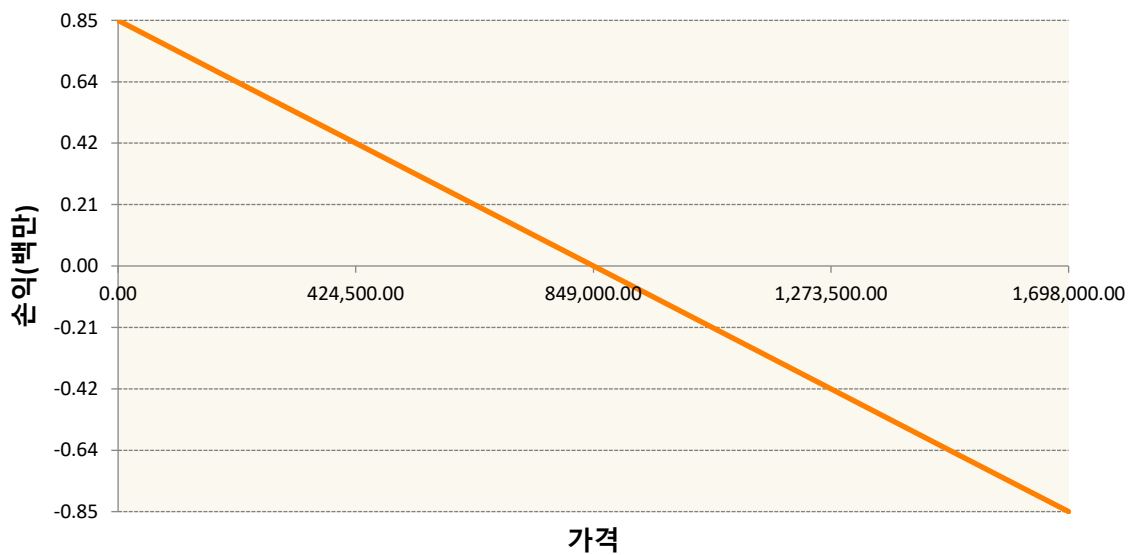
KR41EBV20006-2024-02 우리금융지주개별선물



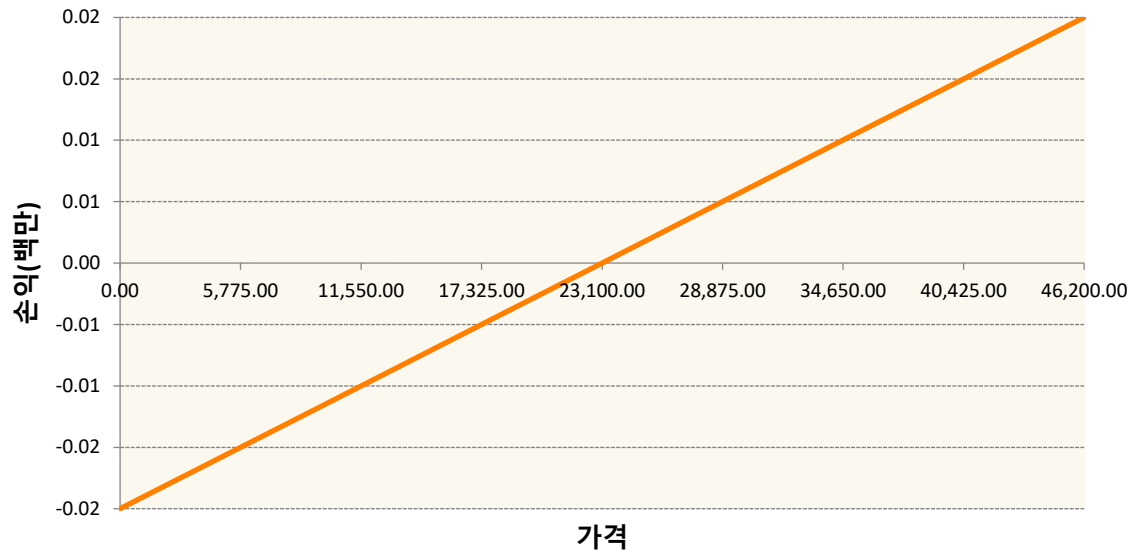
KR41ECV20004-2024-02 HDC현대산업개발개별선물



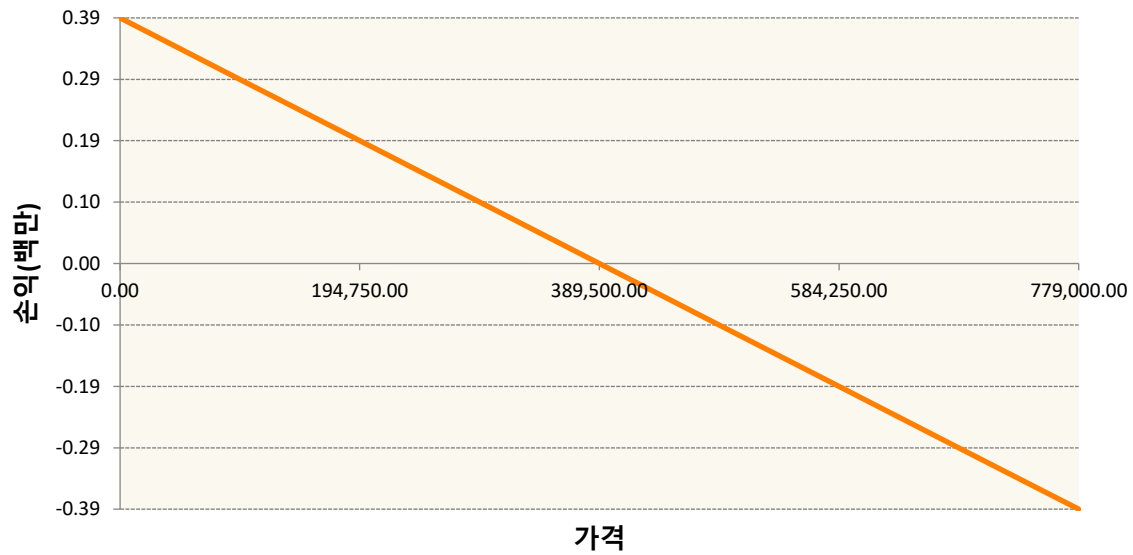
KR41ESV20000-2024-02 삼성바이오로직스개별선물



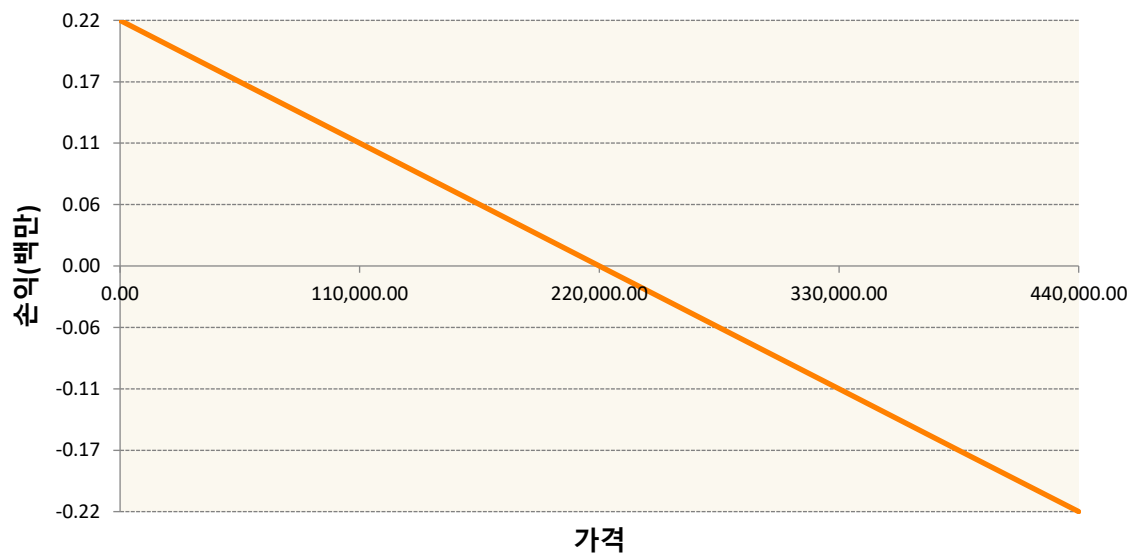
KR41ETV20008-2024-02 삼성엔지니어링개별선물



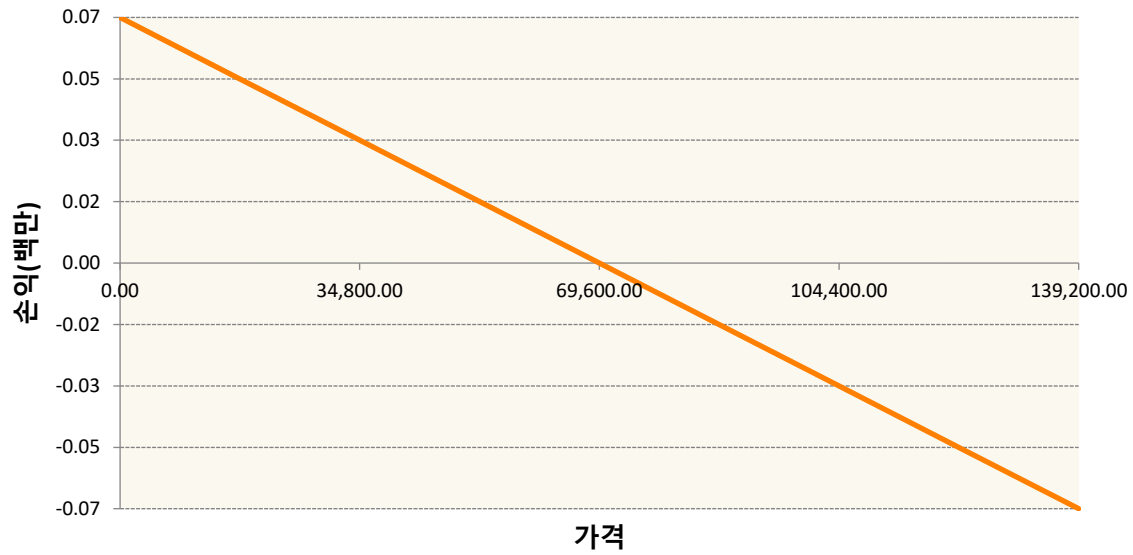
KR41F5V20001-2024-02 LG에너지솔루션개별선물



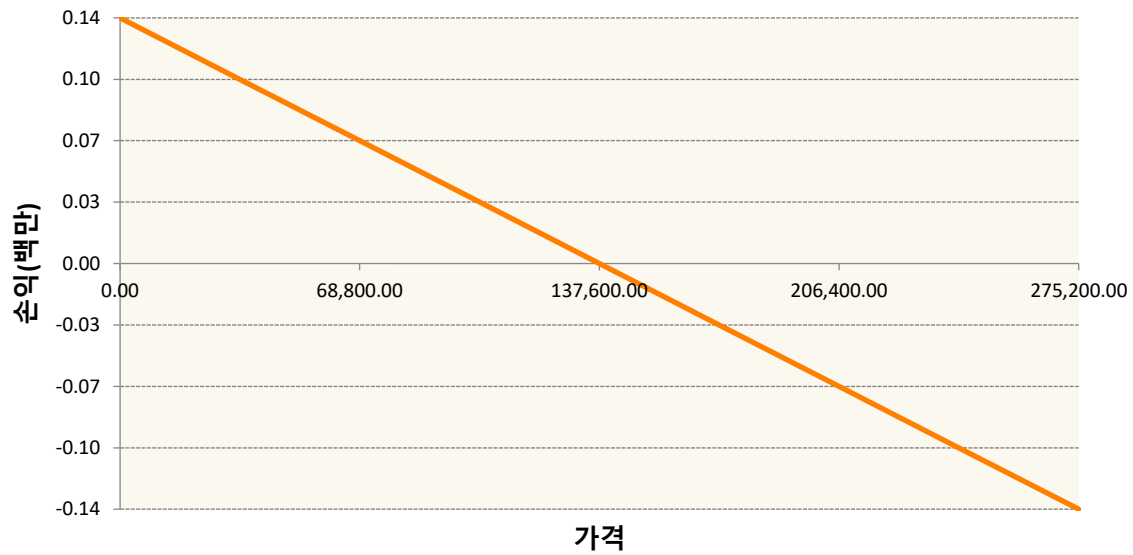
KR41F8V20005-2024-02 크래프톤개별선물



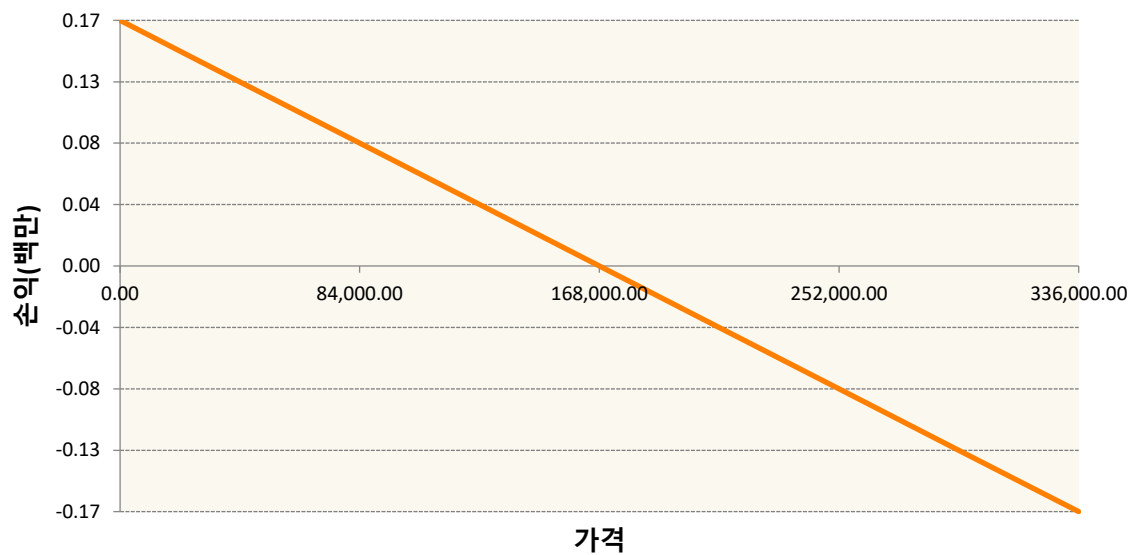
KR41FKV20004-2024-02 메리츠금융지주개별선물



KR41FRV20009-2024-02 BGF리테일개별선물



KR41GCV20009-2024-02 이오테크닉스개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
KR4101V300 2024-03 코스피200지수선물		70
KR4115V200 2024-02 한국전력개별선물		1
KR4150V200 2024-02 SK하이닉스개별선물		2
KR4154V200 2024-02 이마트개별선물		1
KR41CLV200 2024-02 씨젠개별선물		0.06
KR41CNV20(2024-02 포스코DX개별선물		1
KR41CQV20(2024-02 와이지엔터테인먼트개별선물		2
KR41CWV20 2024-02 코웨이개별선물		1
KR41EBV200 2024-02 우리금융지주개별선물		0.38
KR41ECV200 2024-02 HDC현대산업개발개별선물		0.33
KR41ESV200 2024-02 삼성바이오로직스개별선물		1
KR41ETV200 2024-02 삼성엔지니어링개별선물		1
KR41F5V200 2024-02 LG에너지솔루션개별선물		0.31
KR41F8V200 2024-02 크래프톤개별선물		1
KR41FKV200 2024-02 메리츠금융지주개별선물		1
KR41FRV200 2024-02 BGF리테일개별선물		0.22
KR41GCV20(2024-02 이오테크닉스개별선물		0.4

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	92

공시일	2024-02-06
기준일	2024-02-05

코리아인덱스(주식-파생형)(종)

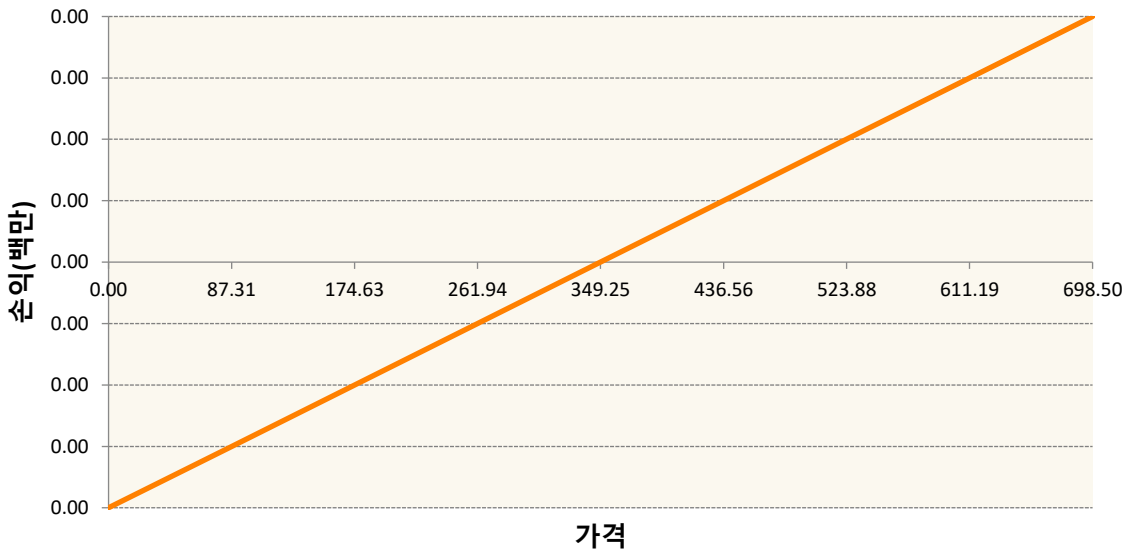
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,318	0	3,318	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101V30005-2024-03 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101V30005		2024-03 코스피200지수선물					265
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-265	-265	-265	-265	-265	-265	-265
-5.33%	-177	-177	-177	-177	-177	-177	-177
-2.67%	-88	-88	-88	-88	-88	-88	-88
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	88	88	88	88	88	88	88
5.33%	177	177	177	177	177	177	177
8.00%	265	265	265	265	265	265	265

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

(단위:백만원)

244

공시일	2024-02-06
기준일	2024-02-05

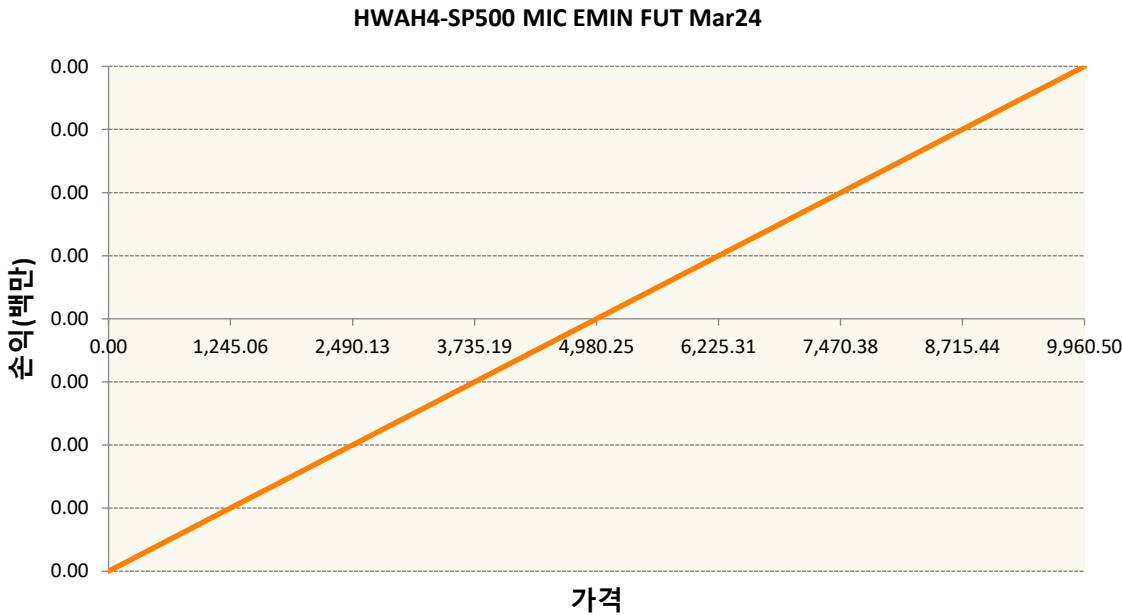
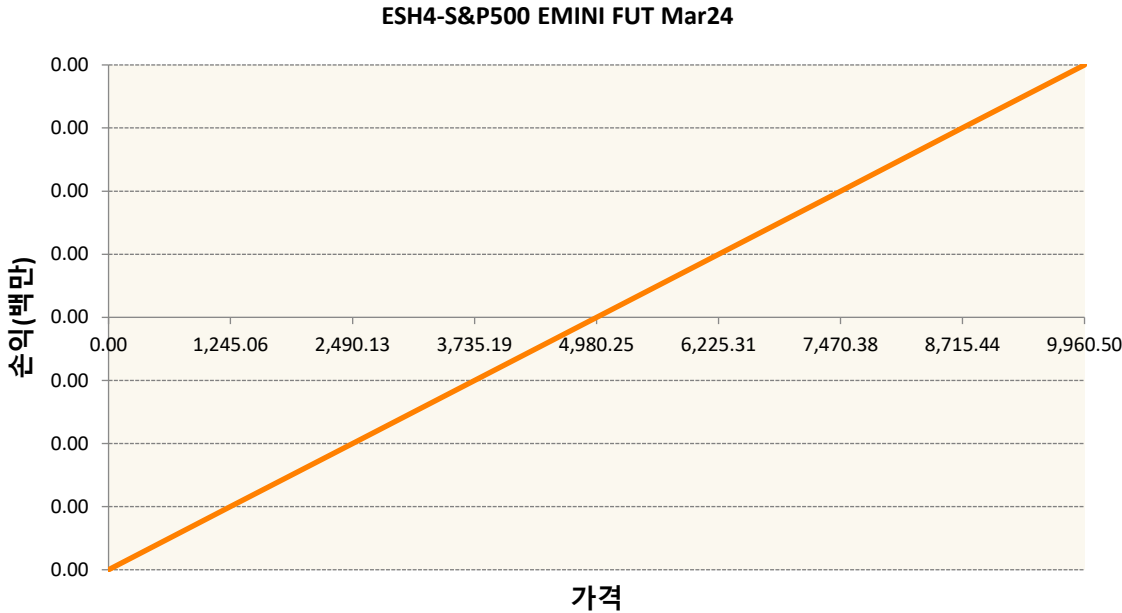
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	994	0	994	
누계	유가증권	선물	2,520	0	2,520	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESH4	S&P500 EMINI FUT Mar24	80
HWAH4	SP500 MIC EMIN FUT Mar24	202

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	228

공시일	2024-02-06
기준일	2024-02-05

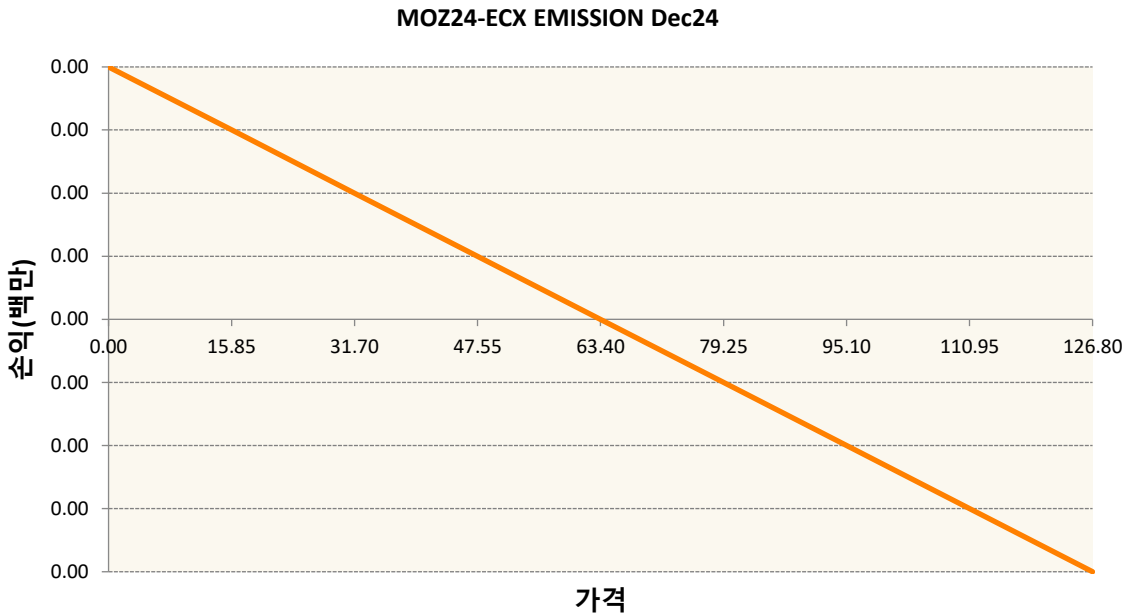
SOL유럽탄소배출권선물인버스ICE특별자산상

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	0	7,760	-7,760	
누계	지수	스왑	424	0	424	장외
누계	통화	선도	0	1,822	-1,822	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213E1W KRW/EUR 29-02-24E	27
FXW213E1W KRW/EUR 29-02-24E	118
MOZ24 ECX EMISSION Dec24	621
SWICEUACN ICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX	6

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

(단위:백만원)

1,188

공시일	2024-02-06
기준일	2024-02-05

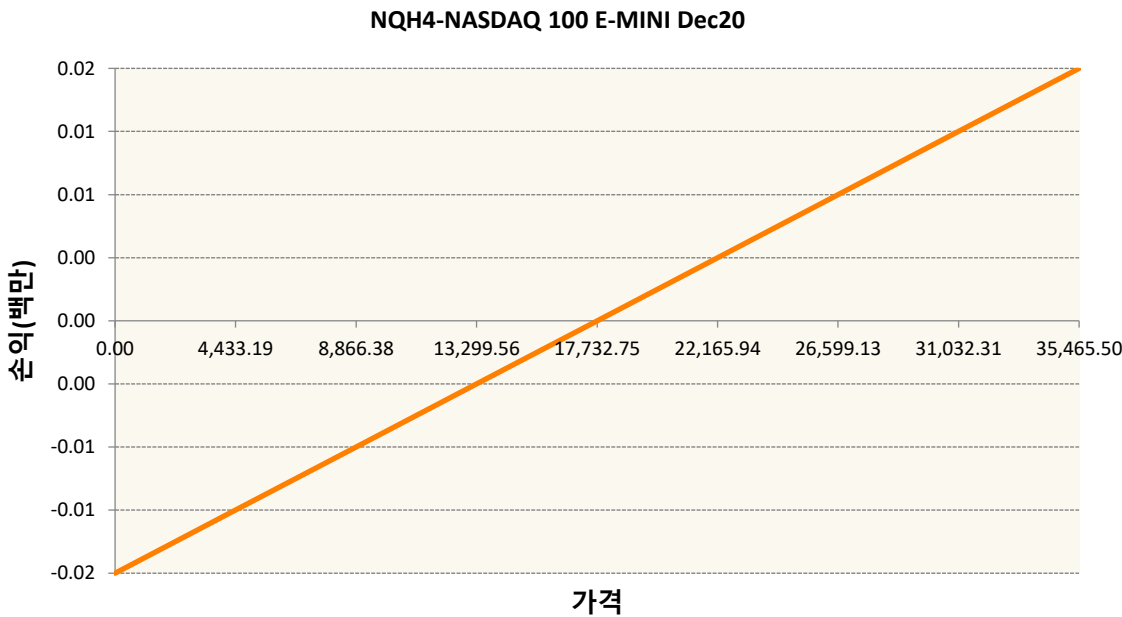
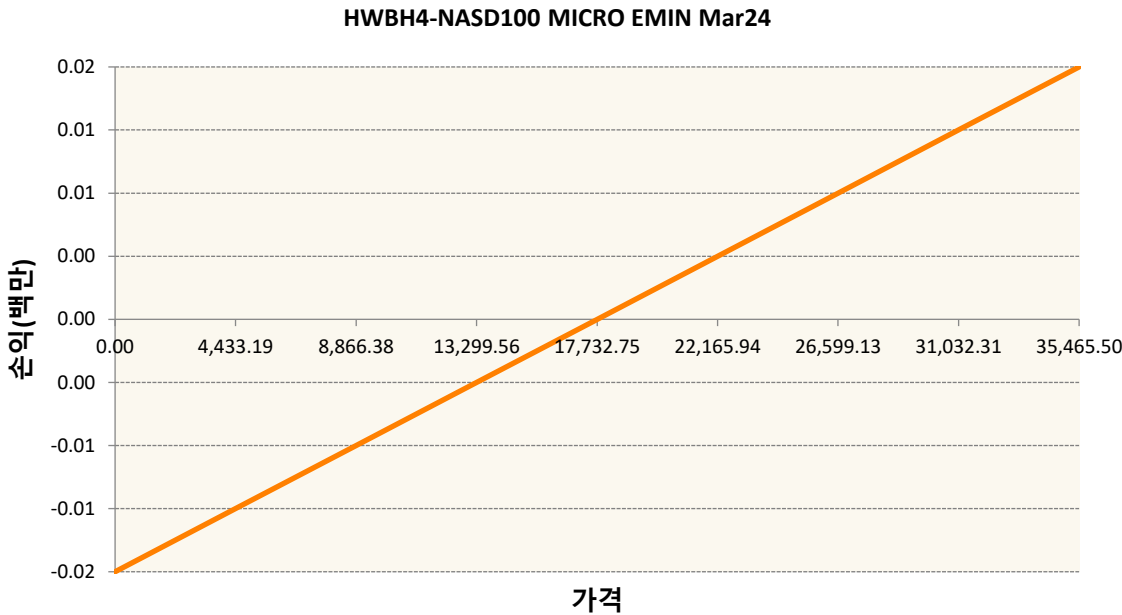
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,382	0	1,382	
누계	유가증권	선물	3,650	0	3,650	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
HWBH4	NASD100 MICRO EMIN Mar24		292
NQH4	NASDAQ 100 E-MINI Dec20		111

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)			(단위:백만원)
			355

공시일	2024-02-06
기준일	2024-02-05

SOL미국30년국채커버드콜(합성)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	6,673	0	6,673	장외
누계	지수	스왑	34,161	0	34,161	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWKEDI0000 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	447
SWKEDI0000 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	1,788
SWKEDI0000 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	532

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

(단위:백만원)

1,881

공시일	2024-02-06
기준일	2024-02-05

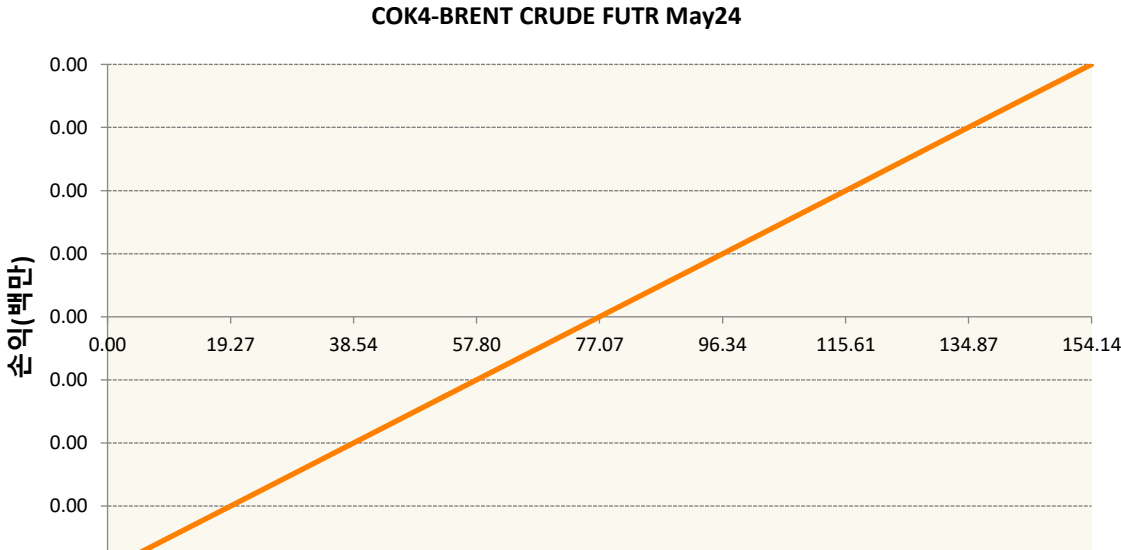
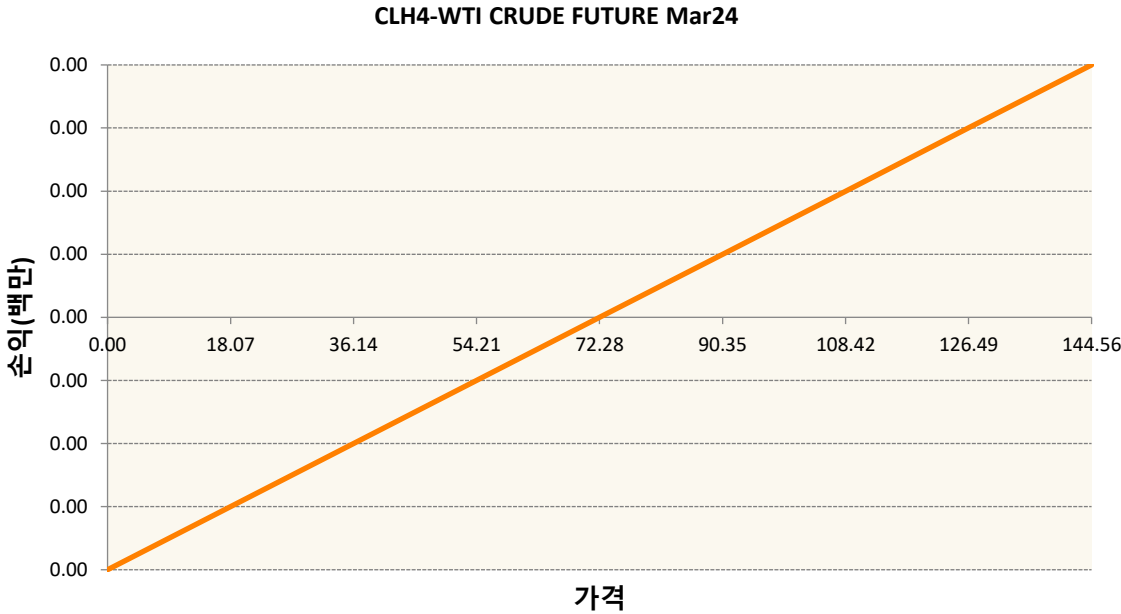
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

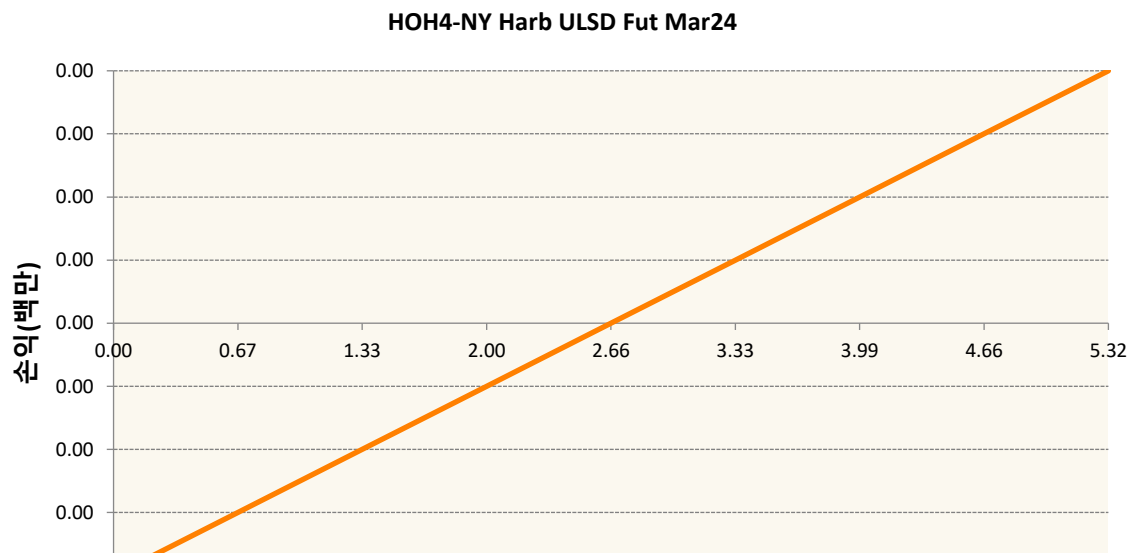
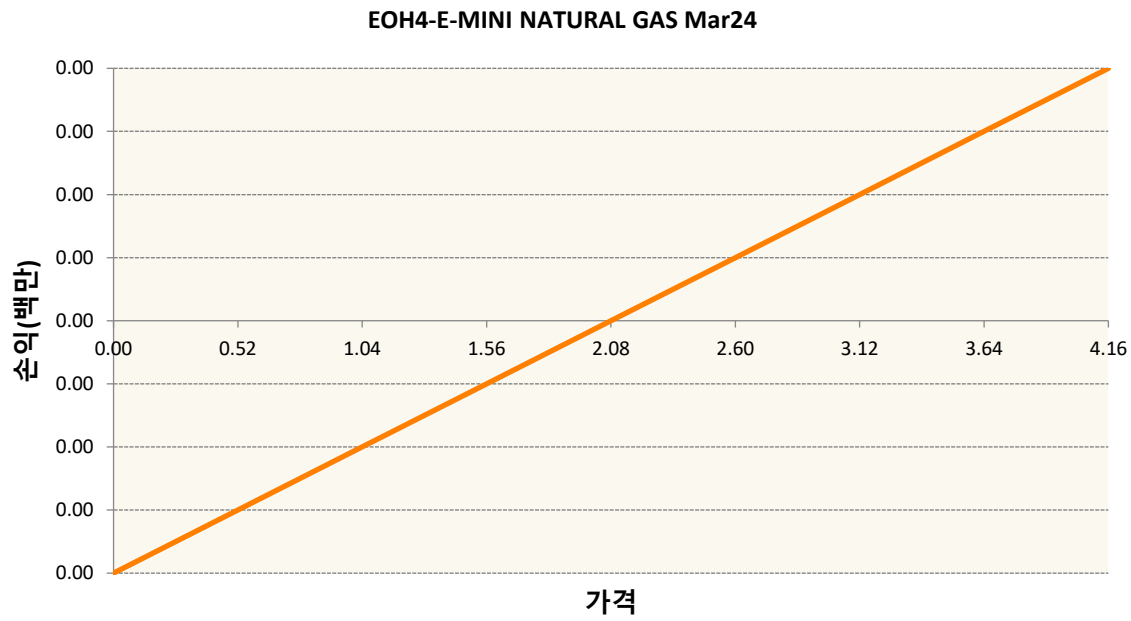
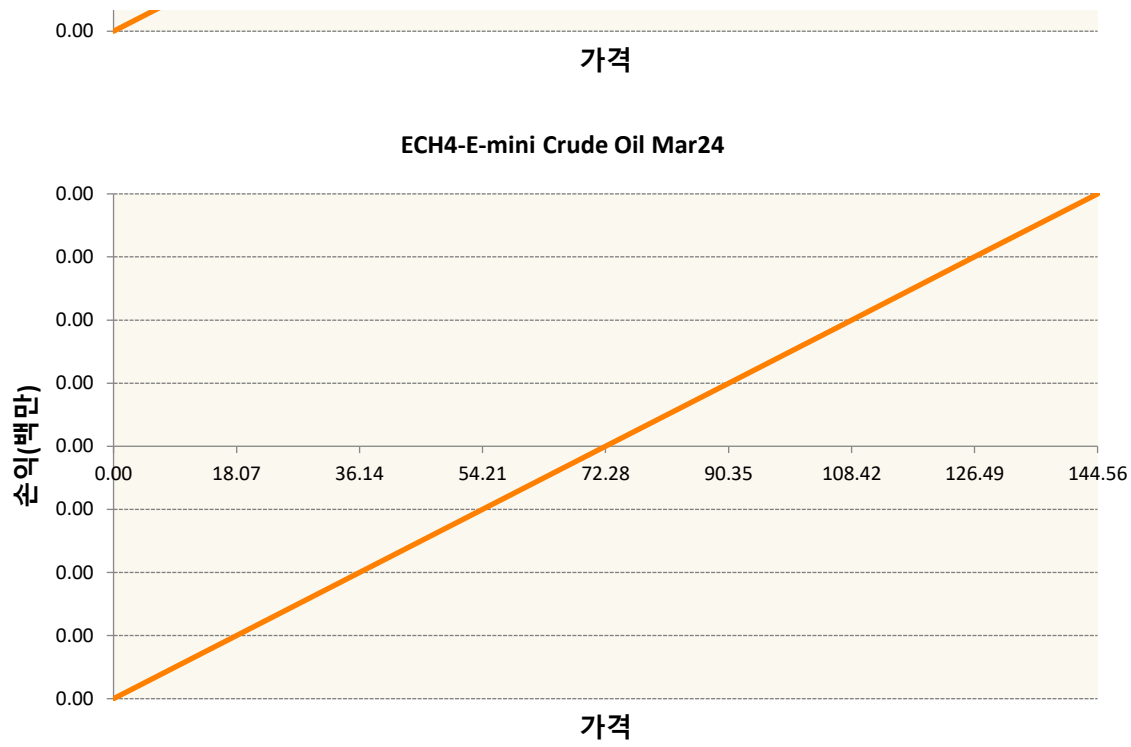
1. 계약금액

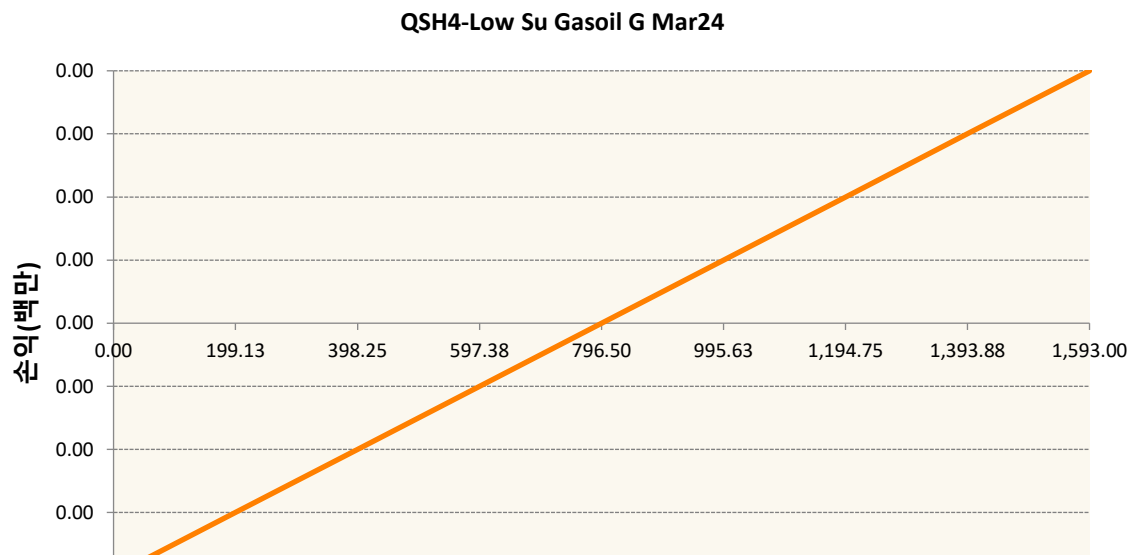
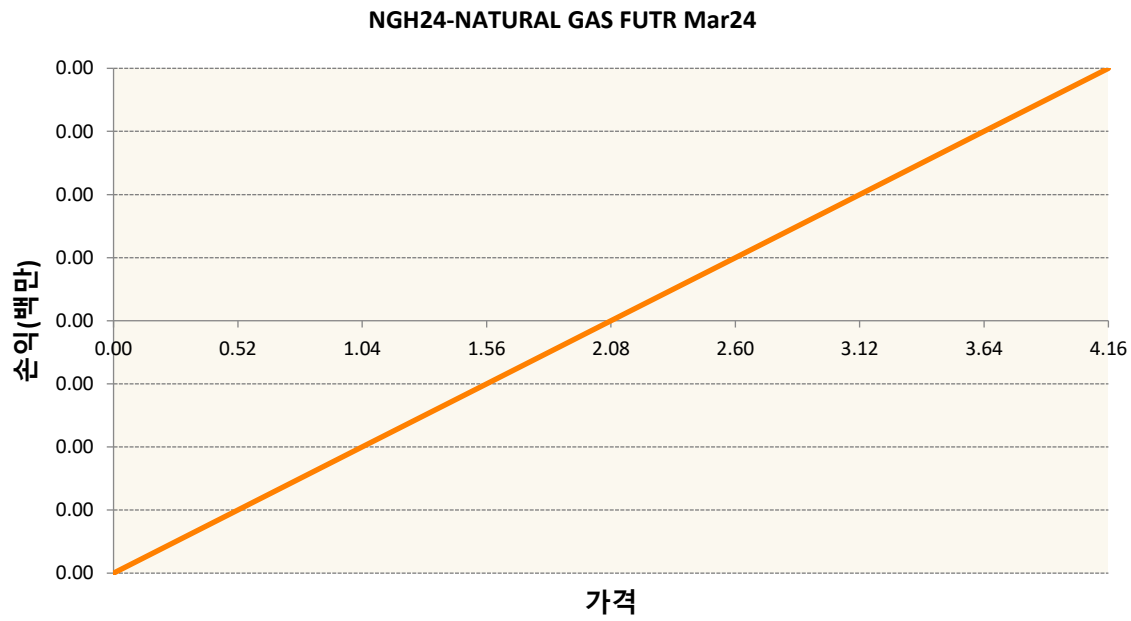
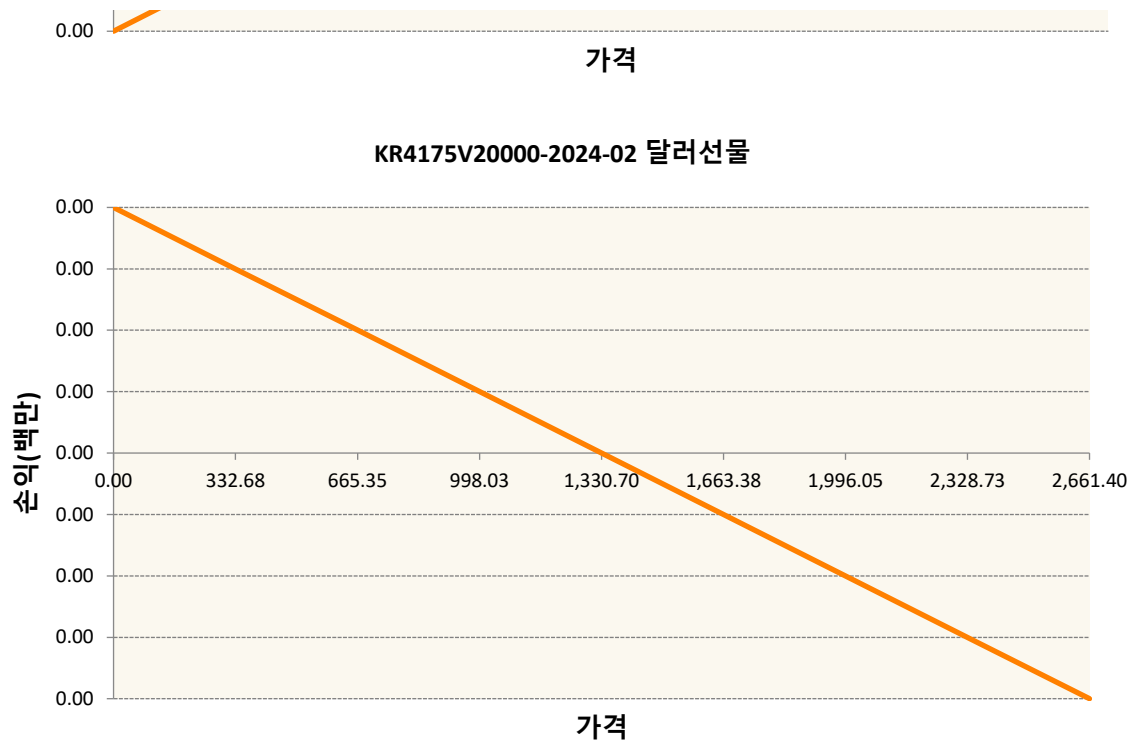
(단위:백만원)

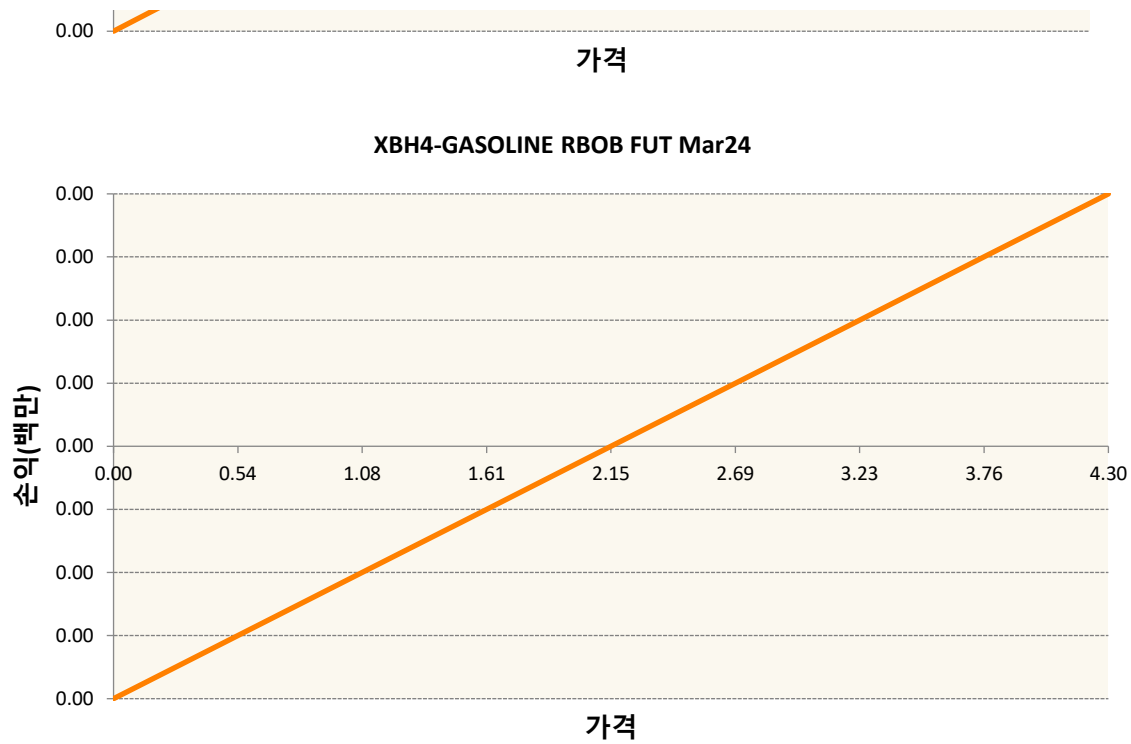
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	선물	유가증권	190	0	190	
누계	유가증권	선물	947	0	947	
누계	통화	선물	0	186	-186	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
CLH4	WTI CRUDE FUTURE Mar24		15
COK4	BRENT CRUDE FUTR May24		24
ECH4	E-mini Crude Oil Mar24		4
EOH4	E-MINI NATURAL GAS Mar24		1
HOH4	NY Harb ULSD Fut Mar24		12
KR4175V200 2024-02 달러선물			15
NGH24	NATURAL GAS FUTR Mar24		17
QSH4	Low Su Gasoil G Mar24		8
XBH4	GASOLINE RBOB FUT Mar24		9

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)		(단위:백만원)
		220