

공시일	2024-02-07
기준일	2024-02-06

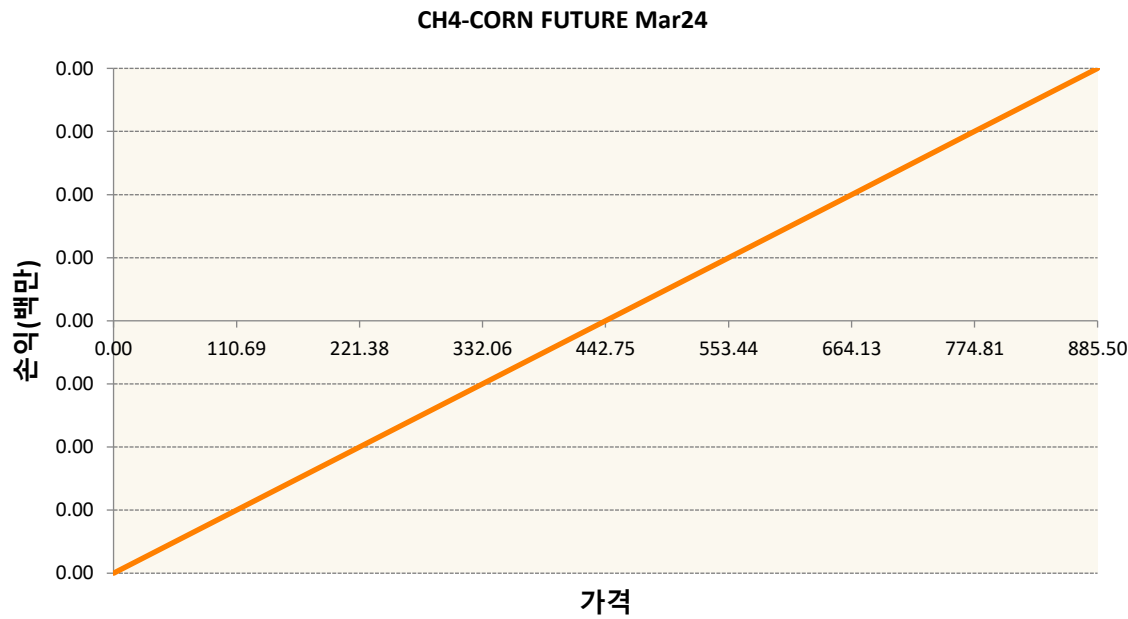
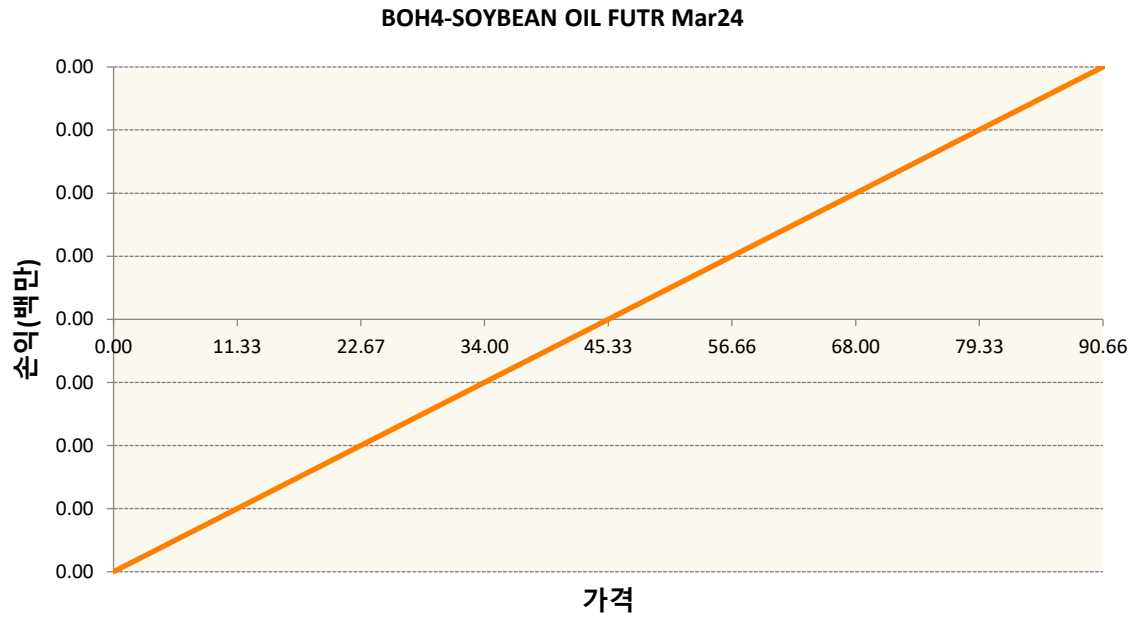
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

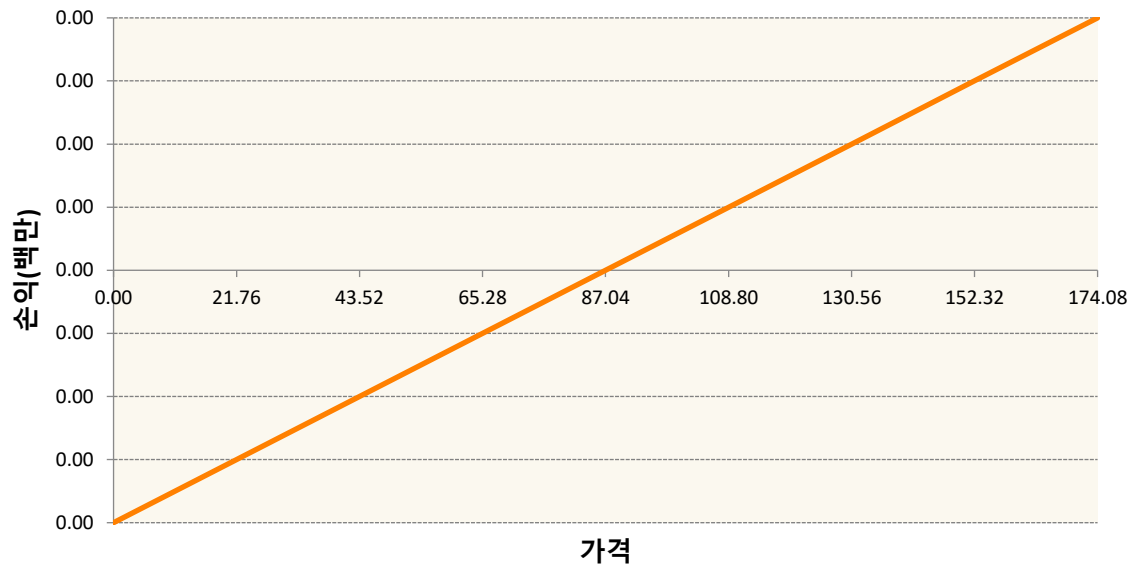
(단위:USD 백만)

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	4,384	0	4,384	
누계	통화	선물	0	478	-478	장내

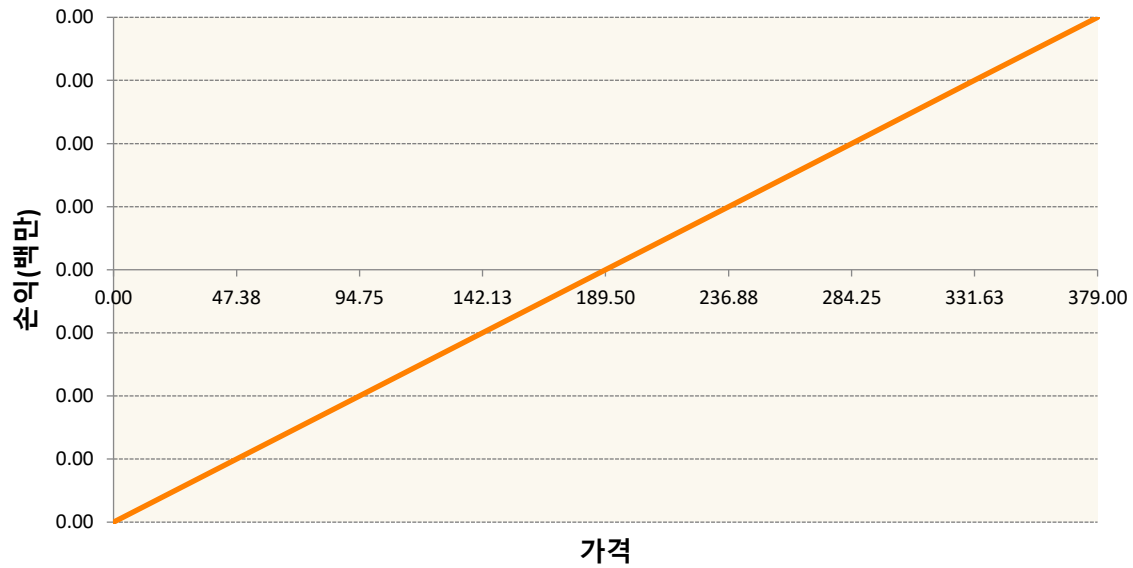
2. 만기시점의 손익구조



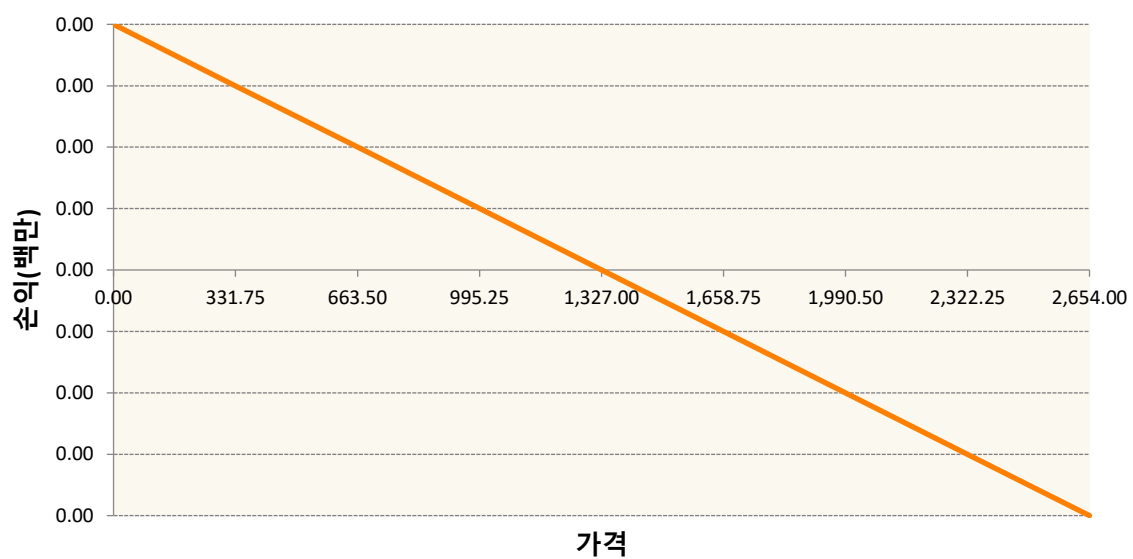
CTH4-COTTON NO.2 FUTR Mar24



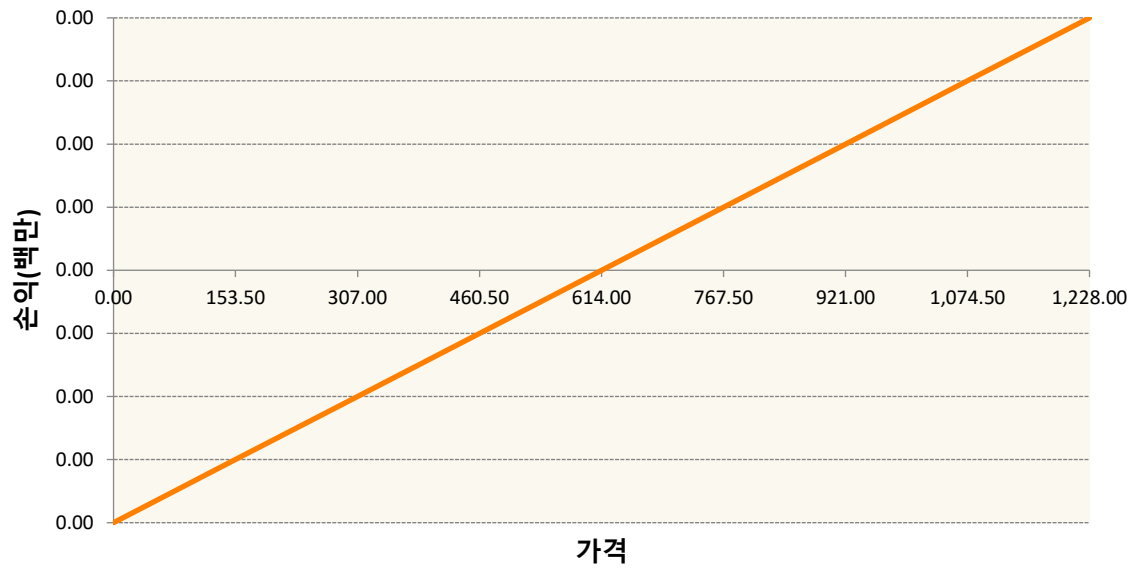
KCH4-COFFEE 'C' FUTURE Mar24



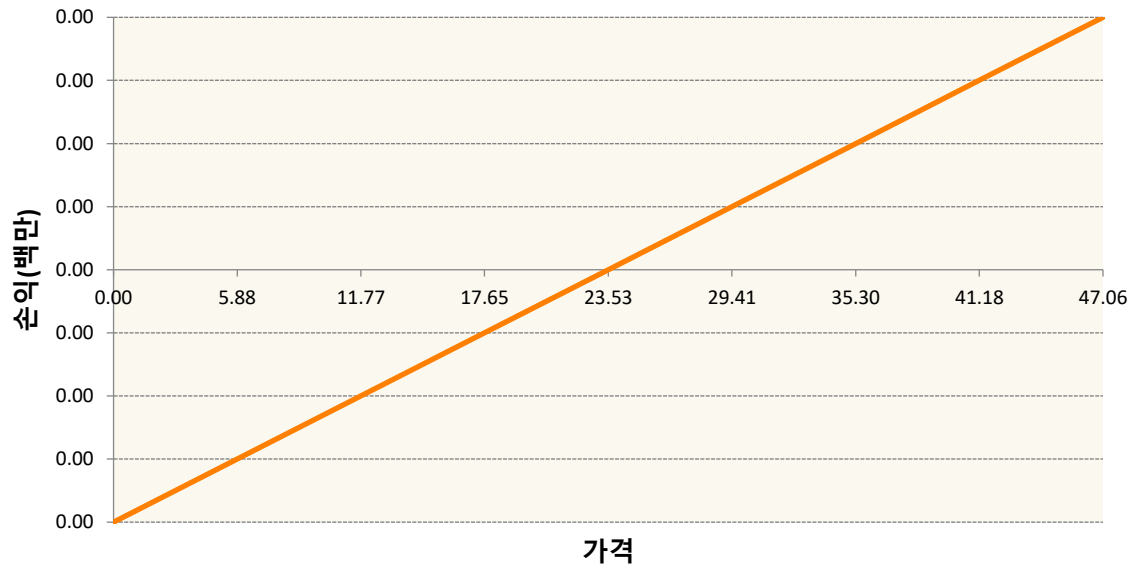
KR4175V20000-2024-02 달러선물



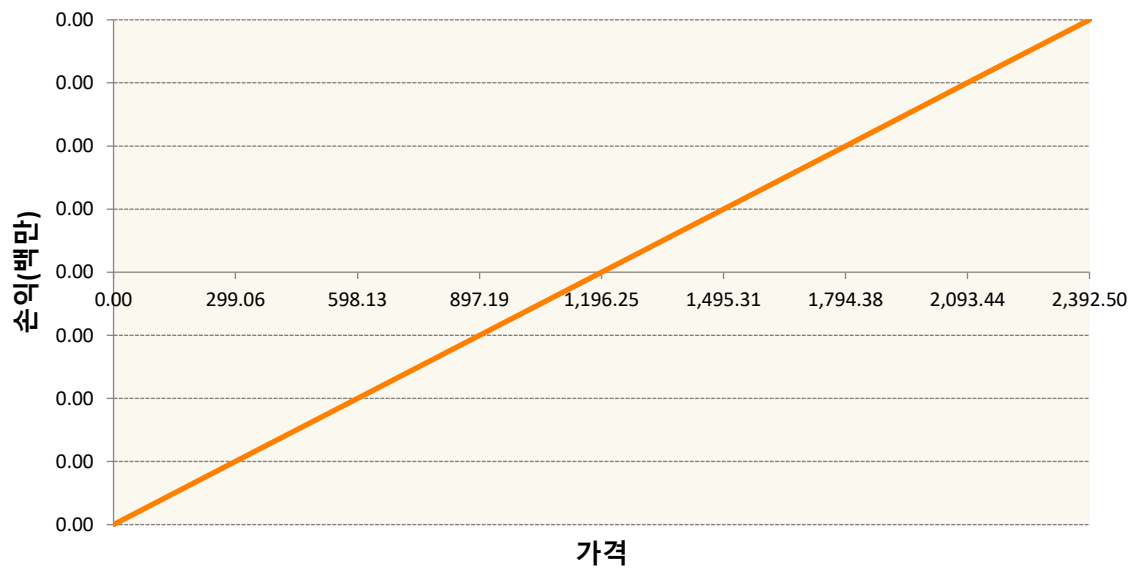
KWH4-KC HRW WHEAT FUT Mar24



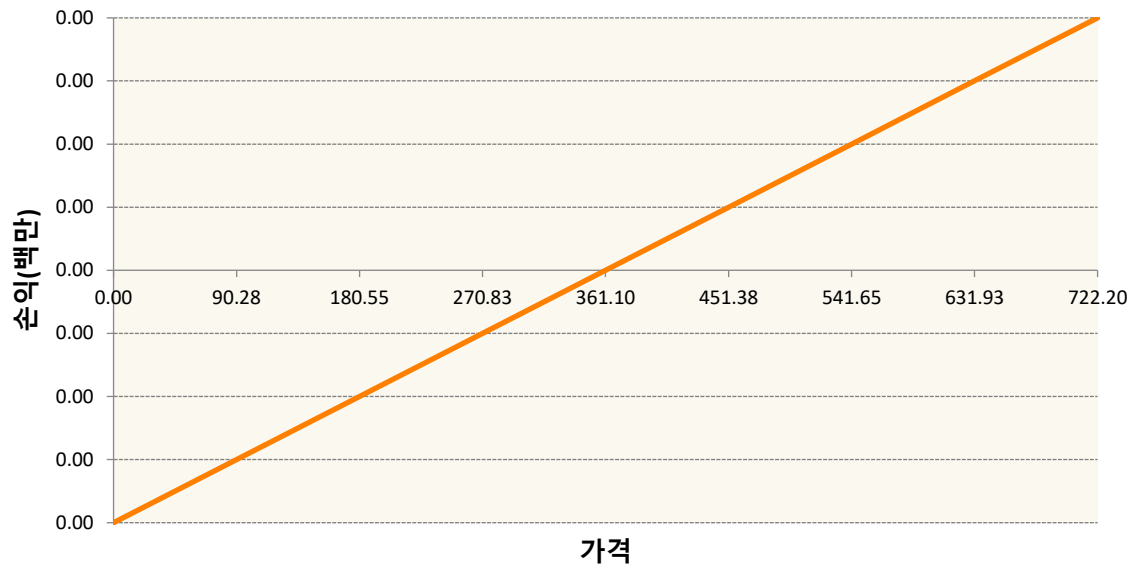
SBH4-Sugar #11 (WORLD) Mar24



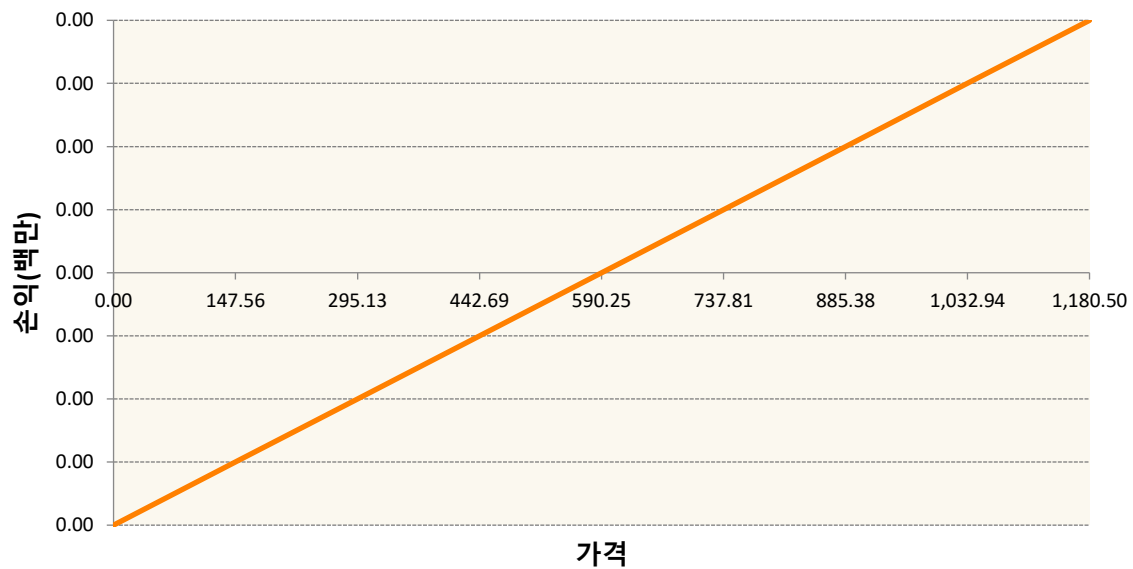
SH4-SOYBEAN FUTURE Mar24



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	2024-02-07
기준일	2024-02-06

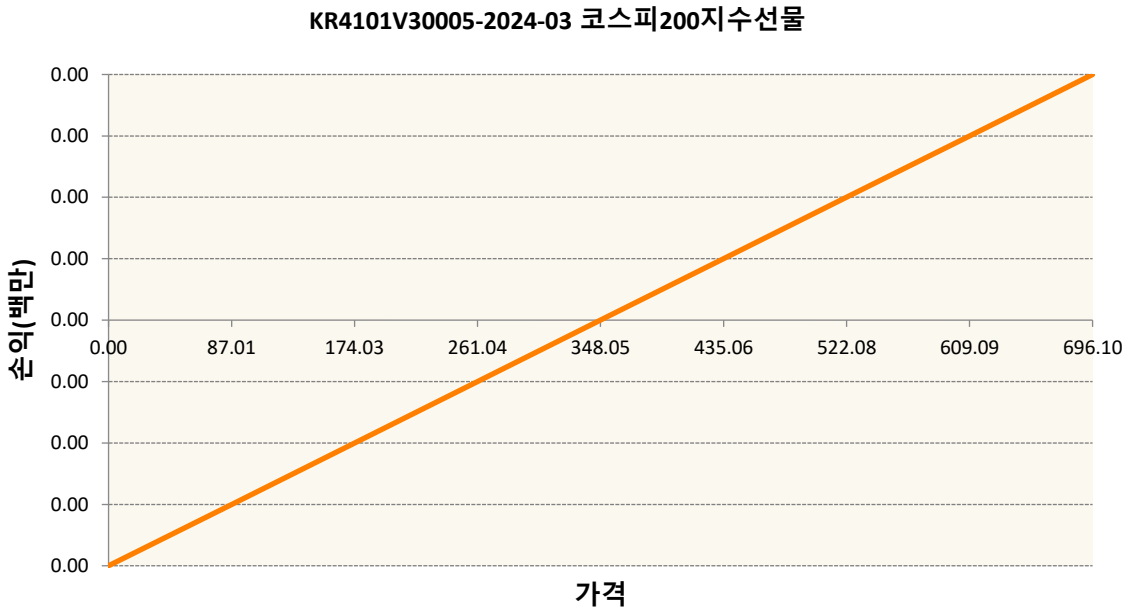
스마트인덱스모

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	1,392	0	1,392	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101V30005		2024-03 코스피200지수선물					111
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-111	-111	-111	-111	-111	-111	-111
-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%	111	111	111	111	111	111	111

공시일	2024-02-07
기준일	2024-02-06

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	223
-----------------------------	-----

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

221

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2024-02-07
기준일	2024-02-06

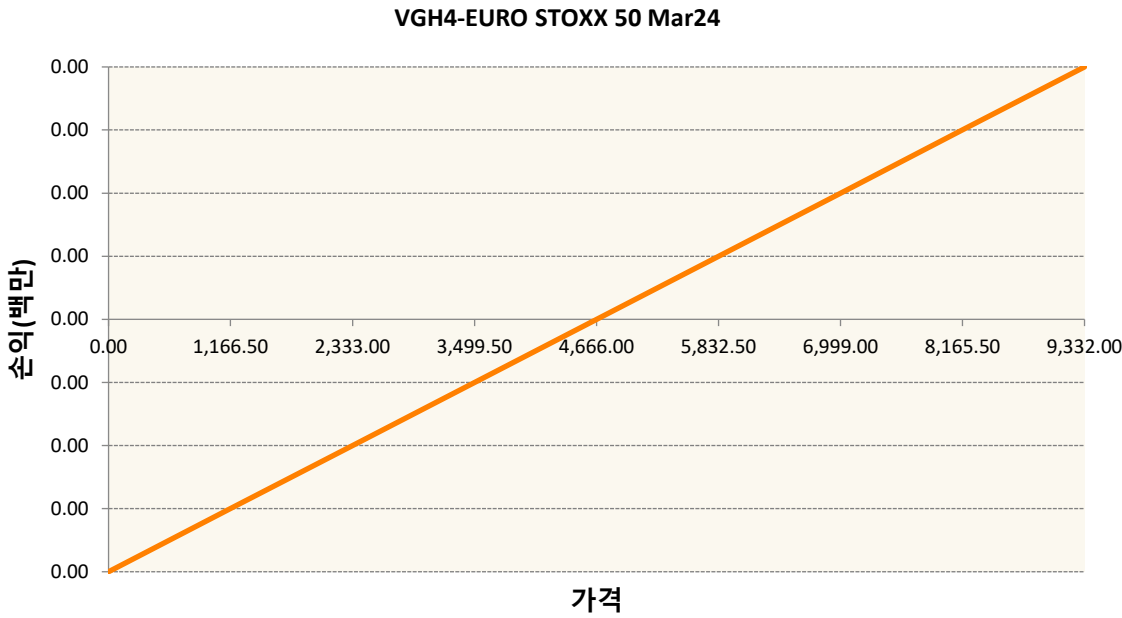
유로인덱스모(주식-파생형)

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	1,063	0	1,063	
누계	통화	선도	214	0	214	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	2024-02-07
기준일	2024-02-06

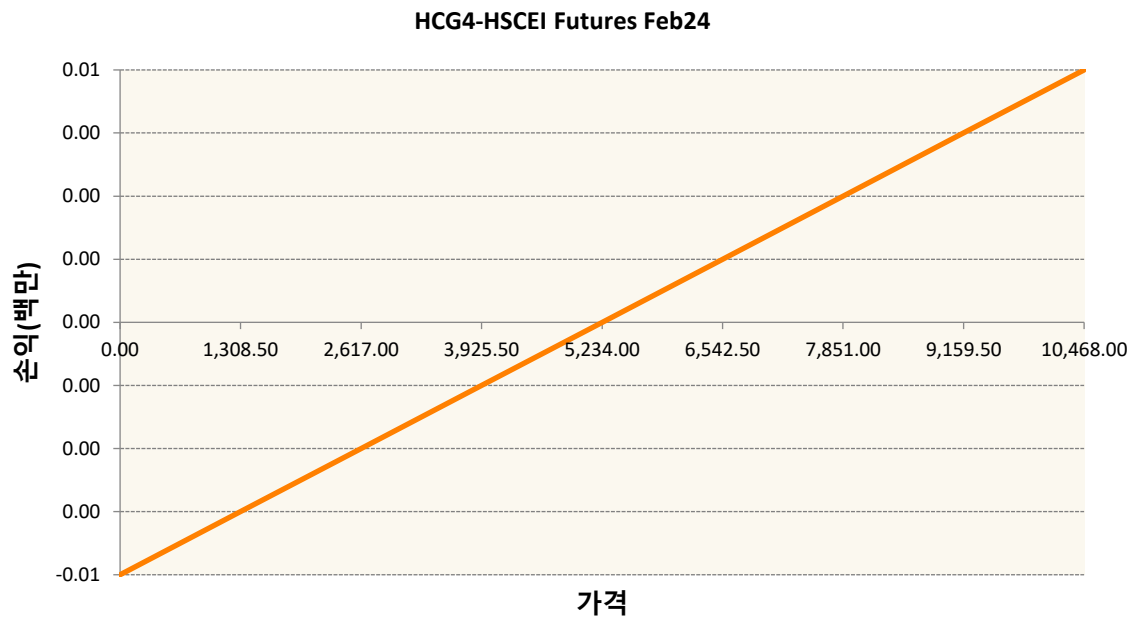
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,029	0	1,029	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	2024-02-07
기준일	2024-02-06

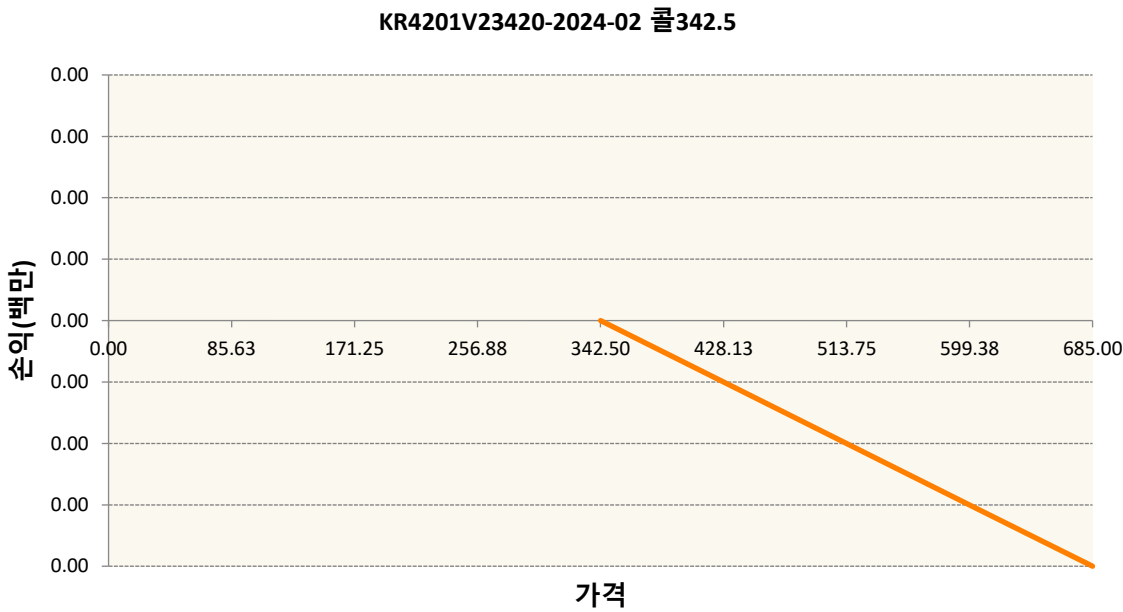
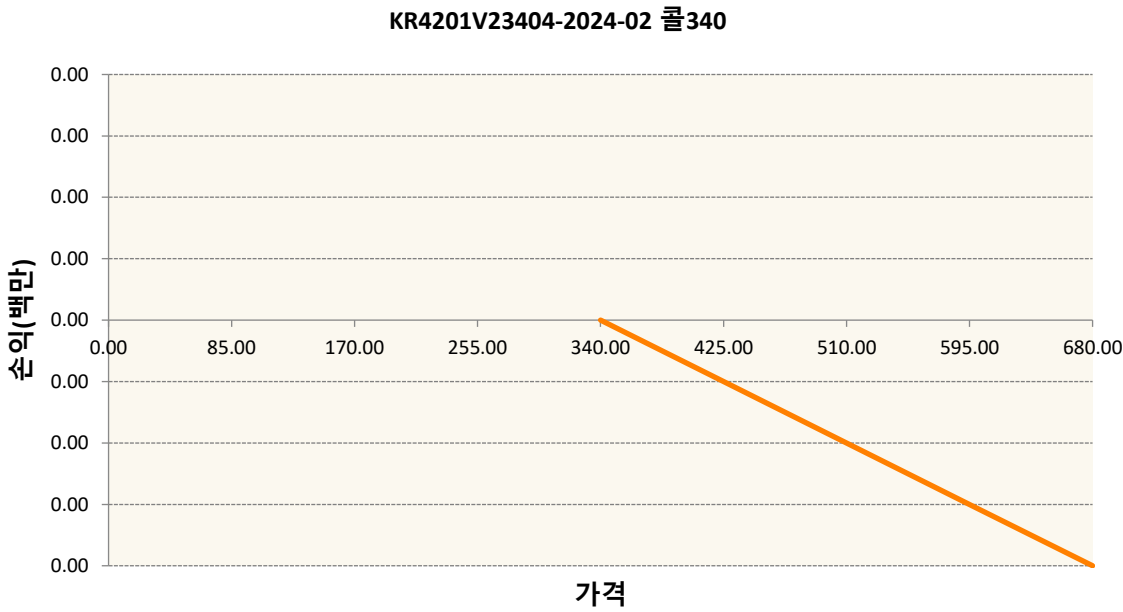
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

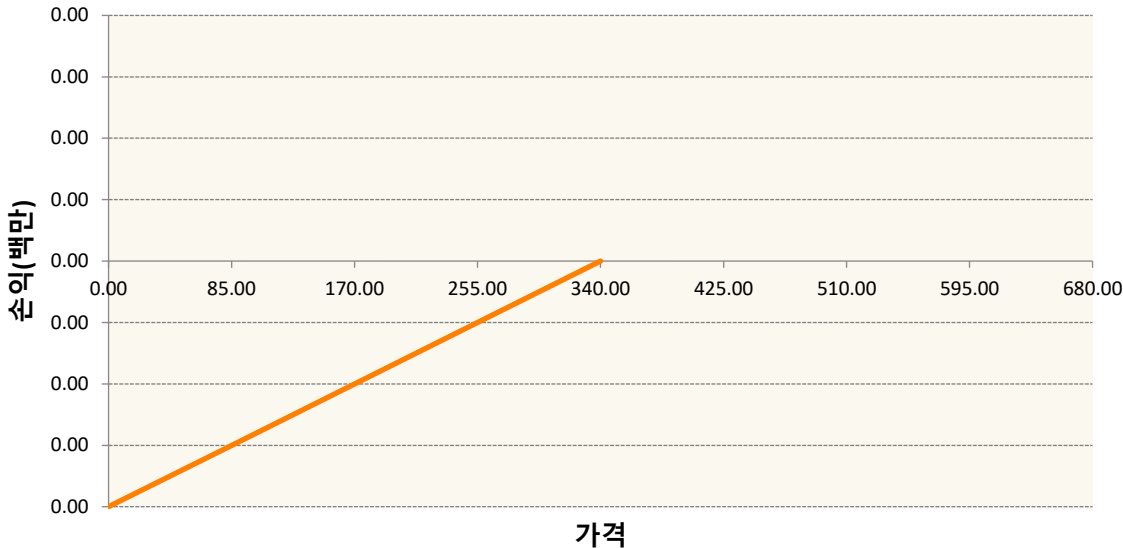
(단위:백만원)

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					2,777
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	841	841	841	841	840	840	839
-5.33%	838	835	830	824	817	808	798
-2.67%	697	674	652	629	606	583	561
0%	31	22	12	0	-13	-28	-43
2.67%	-894	-895	-895	-896	-898	-900	-904
5.33%	-1,836	-1,836	-1,836	-1,836	-1,836	-1,836	-1,836
8.00%	-2,777	-2,777	-2,777	-2,777	-2,777	-2,777	-2,777
KR4201V23420		2024-02 콜342.5					451
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	104	104	104	104	104	104	104
-5.33%	104	104	104	103	103	102	101
-2.67%	93	90	87	84	81	77	74
0%	8	6	3	0	-3	-6	-9
2.67%	-140	-140	-141	-141	-142	-142	-143
5.33%	-295	-295	-295	-296	-296	-296	-296
8.00%	-451	-451	-451	-451	-451	-451	-451
KR4301V23402		2024-02 풋340					548
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-548	-548	-548	-548	-548	-548	-548
-5.33%	-293	-293	-293	-293	-293	-294	-294
-2.67%	-58	-62	-65	-69	-73	-77	-81
0%	2	1	1	0	-1	-2	-4

2.67%	2	2	2	2	2	2	2
5.33%	2	2	2	2	2	2	2
8.00%	2	2	2	2	2	2	2

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

(단위:백만원)

4,478

공시일	2024-02-07
기준일	2024-02-06

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	1,834	0	1,834	

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	2024-02-07
기준일	2024-02-06

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	4,479	0	4,479	

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	2024-02-07
기준일	2024-02-06

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	17,696	0	17,696	
누계	통화	선도	0	17,690	-17,690	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213DBV KRW/USD 29-02-24E	652
FXW213DCT KRW/USD 29-03-24E	515
FXW213E1W KRW/USD 30-04-24E	248
IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

734

공시일	2024-02-07
기준일	2024-02-06

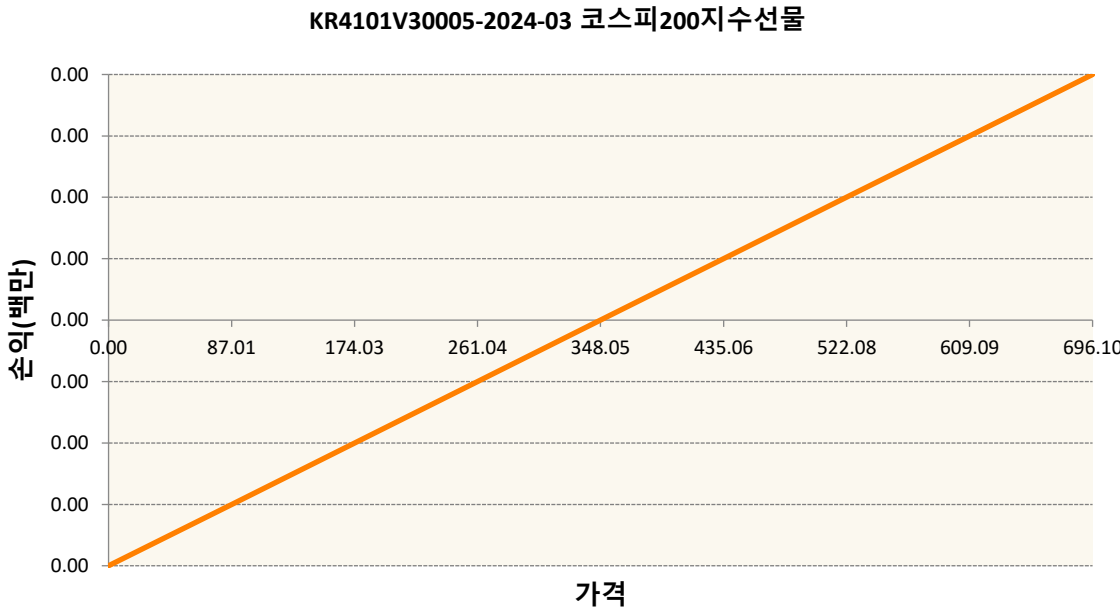
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

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	696	0	696	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	2024-02-07
기준일	2024-02-06

SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

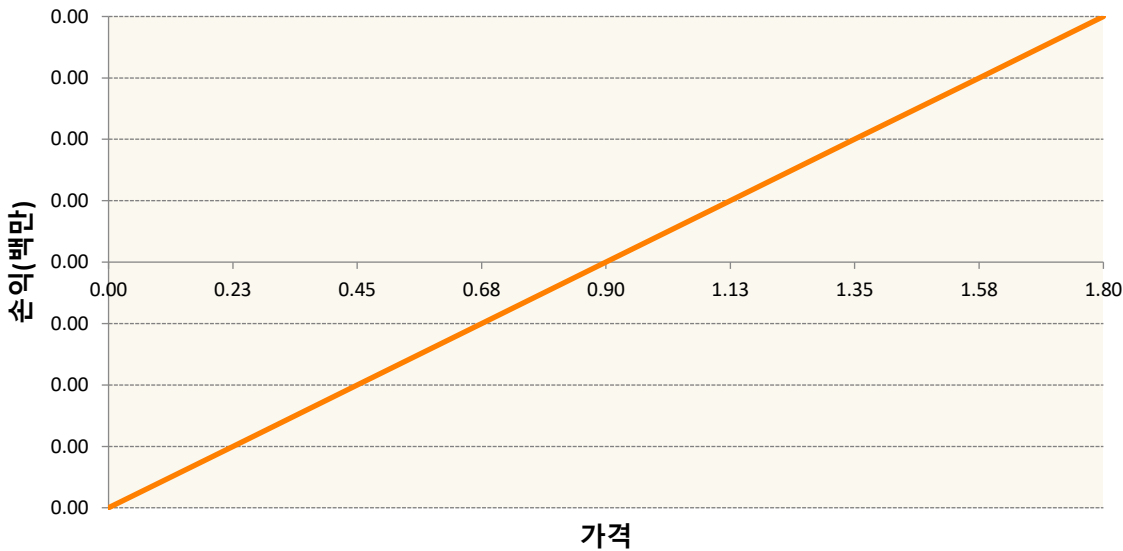
1. 계약금액

(단위:백만원)

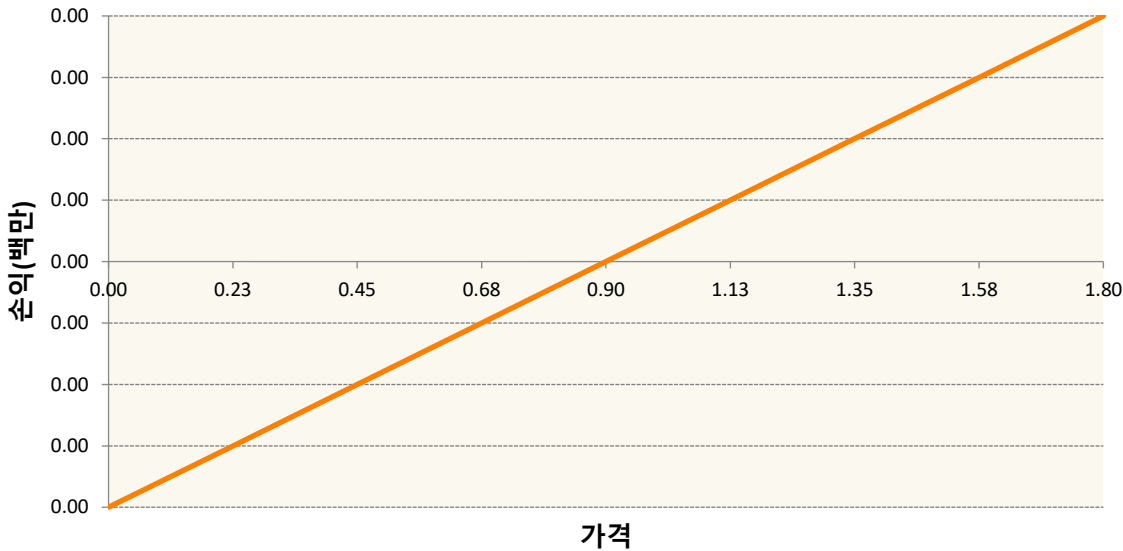
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	19,006	0	19,006	

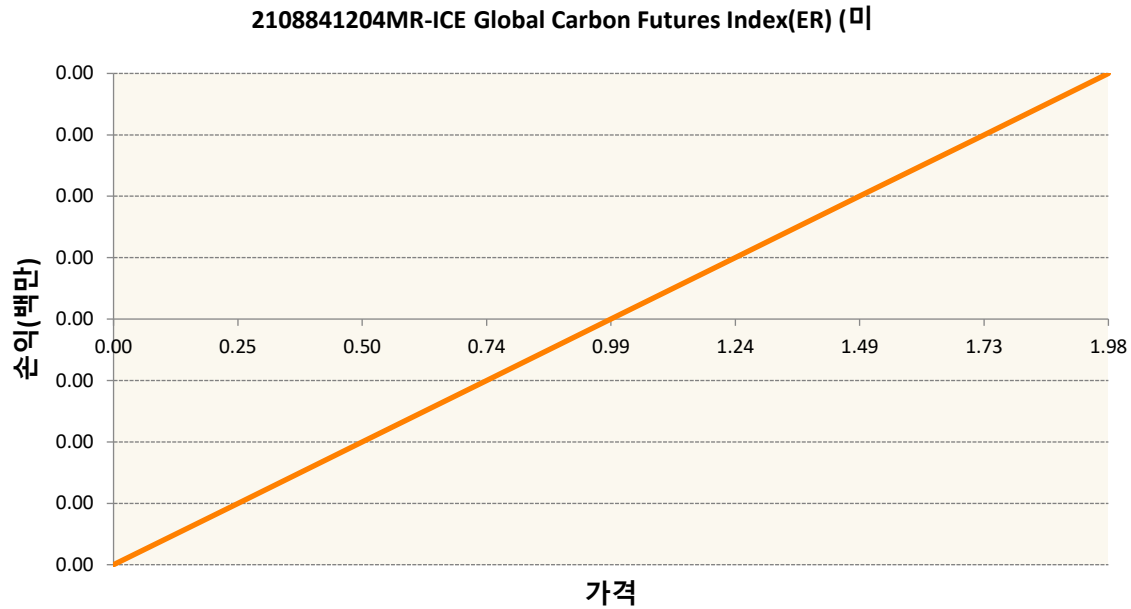
2. 만기시점의 손익구조

2108840920KM-ICE Global Carbon Futures Index(ER) (키



2108840920MZ-ICE Global Carbon Futures Index(ER) (메





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108840920ICE Global Carbon Futures Index(ER) (키		893
2108840920ICE Global Carbon Futures Index(ER) (메		179
2108841204ICE Global Carbon Futures Index(ER) (미		446

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,909

공시일	2024-02-07
기준일	2024-02-06

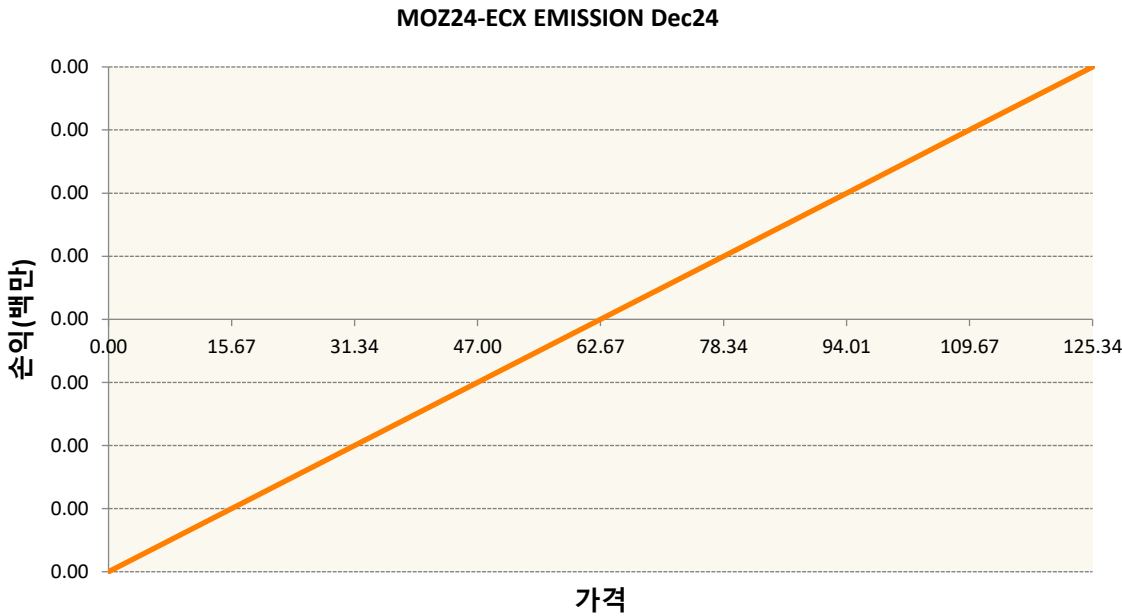
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	8,497	0	8,497	
누계	지수	스왑	424	0	424	장외
누계	통화	선도	0	1,983	-1,983	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213E1W KRW/EUR 29-02-24E	13
FXW213E1W KRW/EUR 29-02-24E	145
MOZ24 ECX EMISSION Dec24	680
SWICEUACN ICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX	7

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

(단위:백만원)

1,295

공시일	2024-02-07
기준일	2024-02-06

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)	10
SWCSI00000 신한CSI Index 230622 (메리츠)	10
SWCSI00000 신한CSI Index 230922 (키움)	7
SWCSI00000 신한CSI Index 231013 (NH)	7

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

(단위:백만원)

49

공시일	2024-02-07
기준일	2024-02-06

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)	25
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(메리츠)	36
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(키움)	7

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

(단위:백만원)

105

공시일	2024-02-07
기준일	2024-02-06

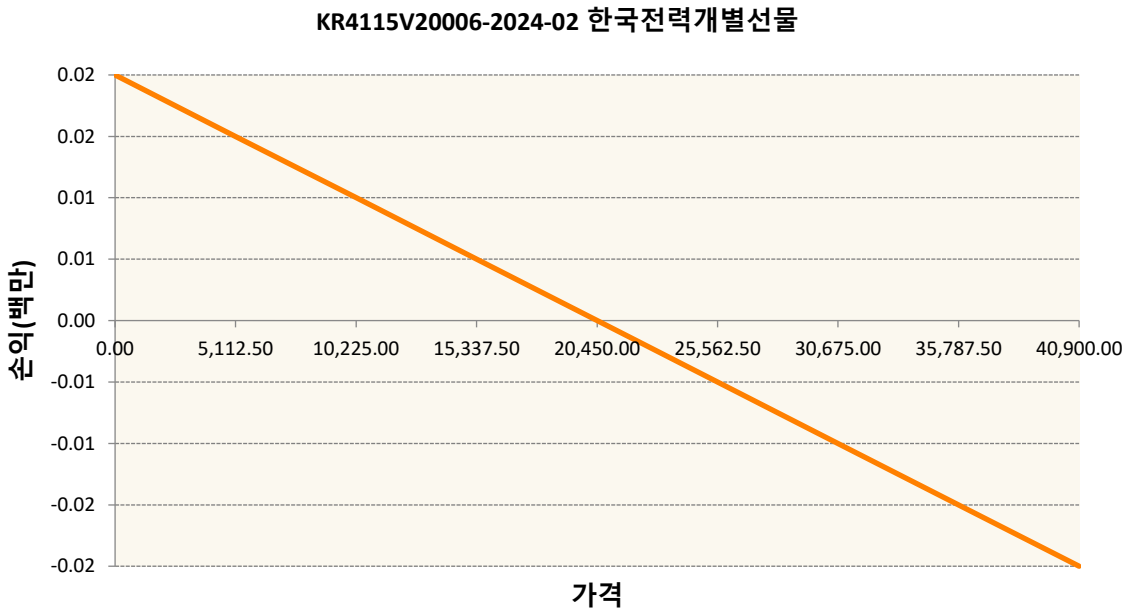
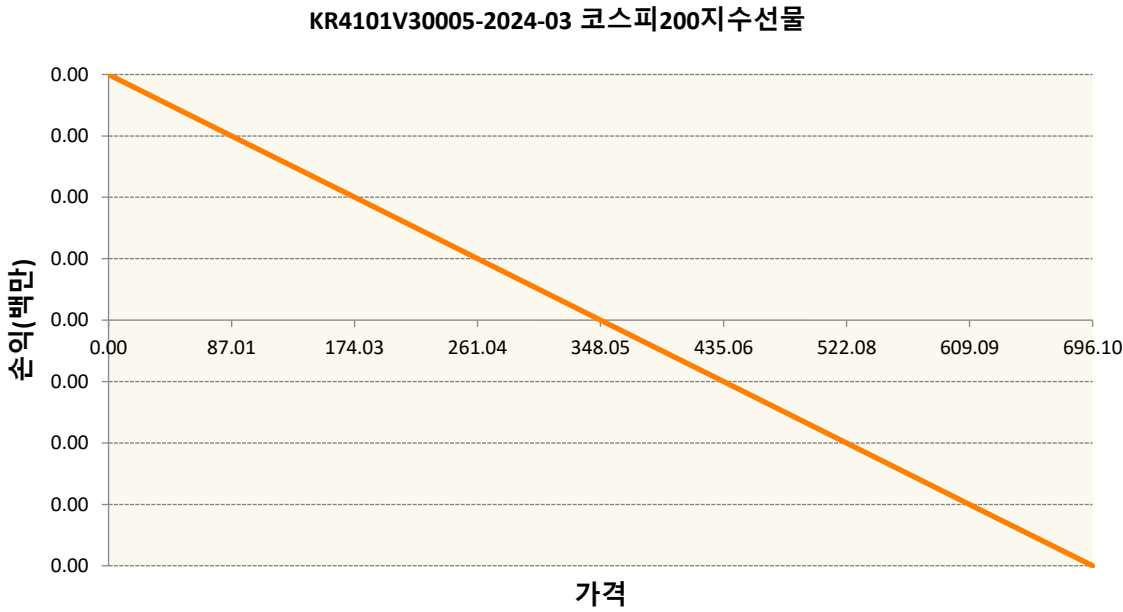
에퀴티알파일반사모혼합자산

1. 계약금액

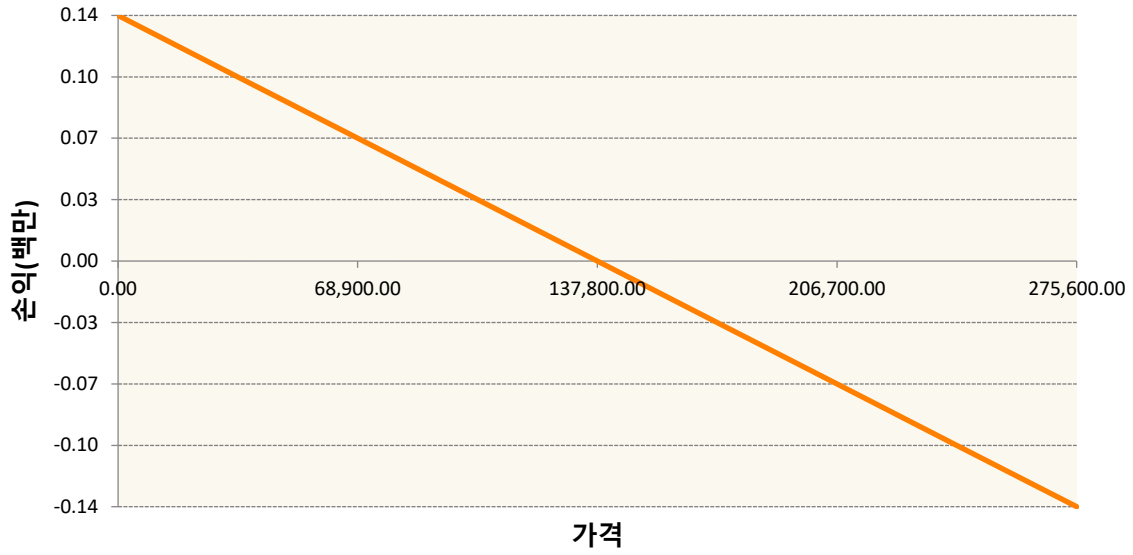
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	13	-13	장내
누계	유가증권	선물	13	1,004	-991	장내

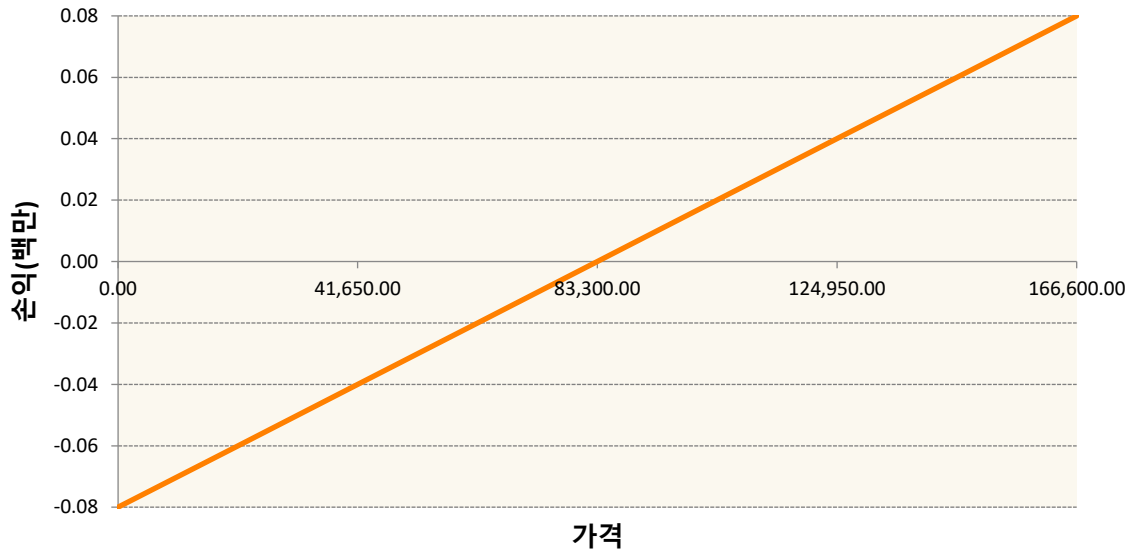
2. 만기시점의 손익구조



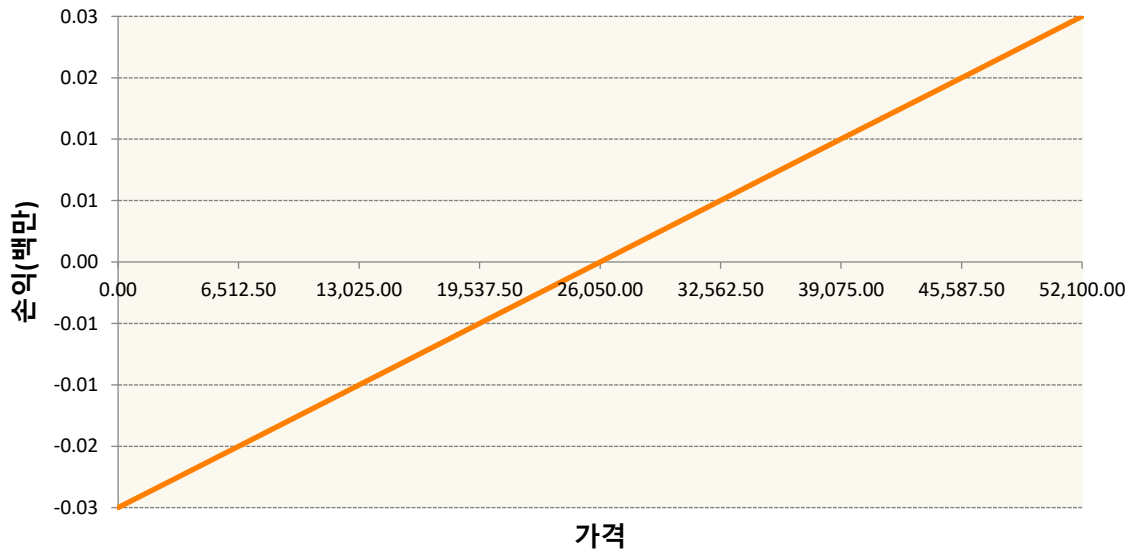
KR4150V20003-2024-02 SK하이닉스개별선물



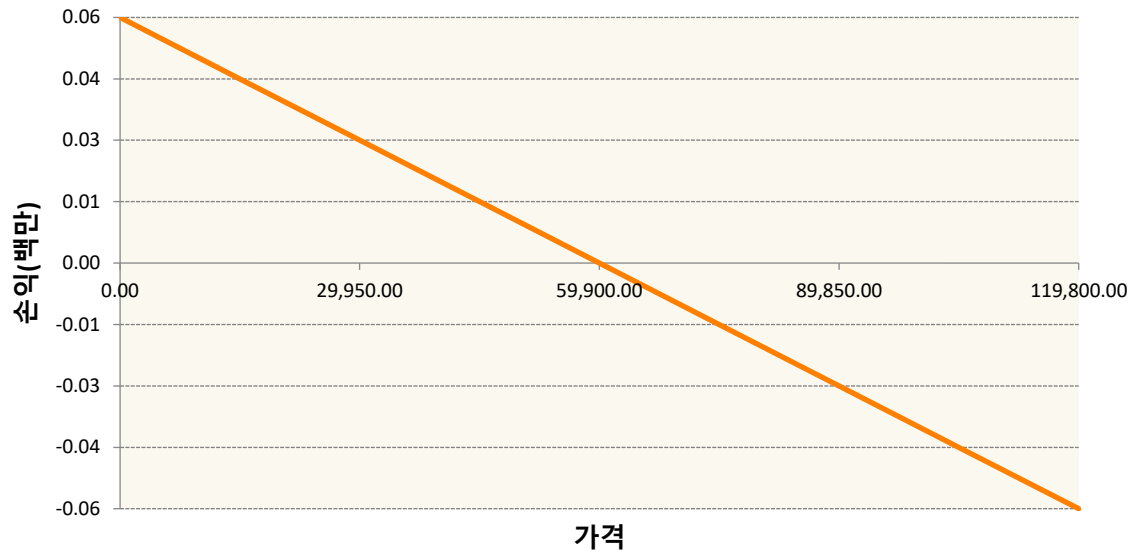
KR4154V20005-2024-02 이마트개별선물



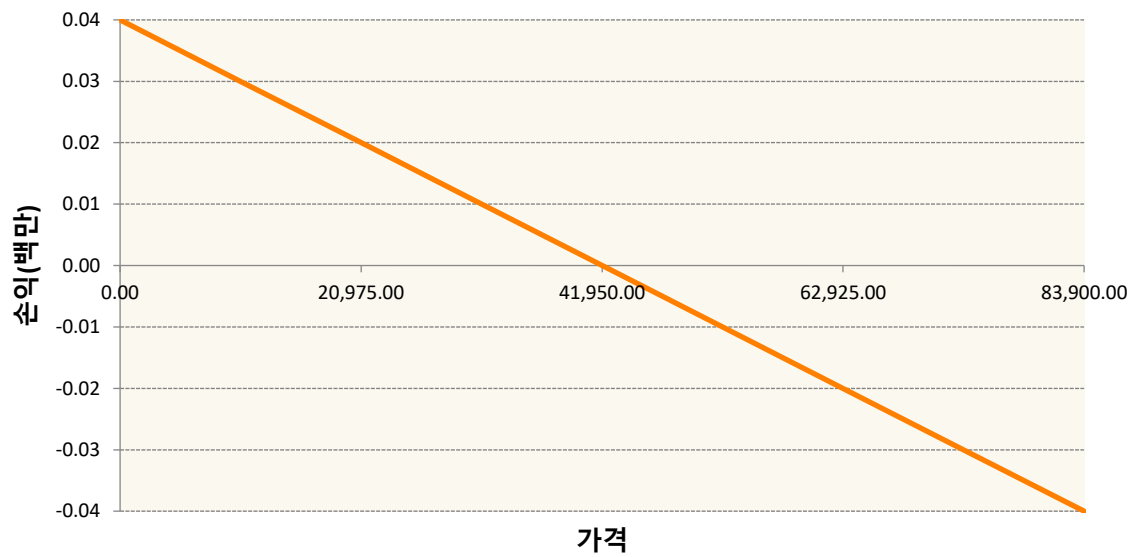
KR41CLV20009-2024-02 씨젠개별선물



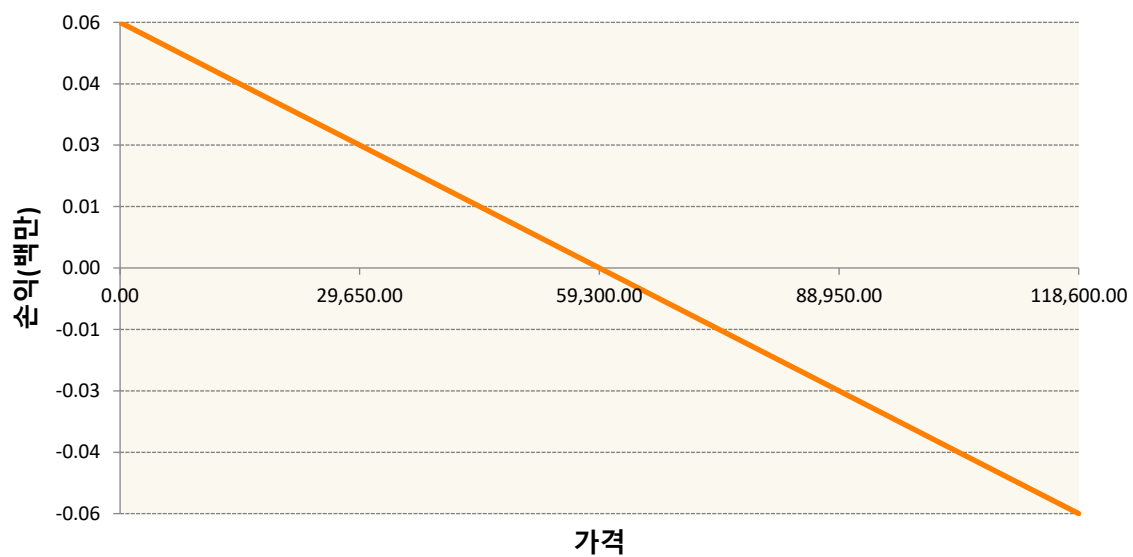
KR41CNV20005-2024-02 포스코DX개별선물



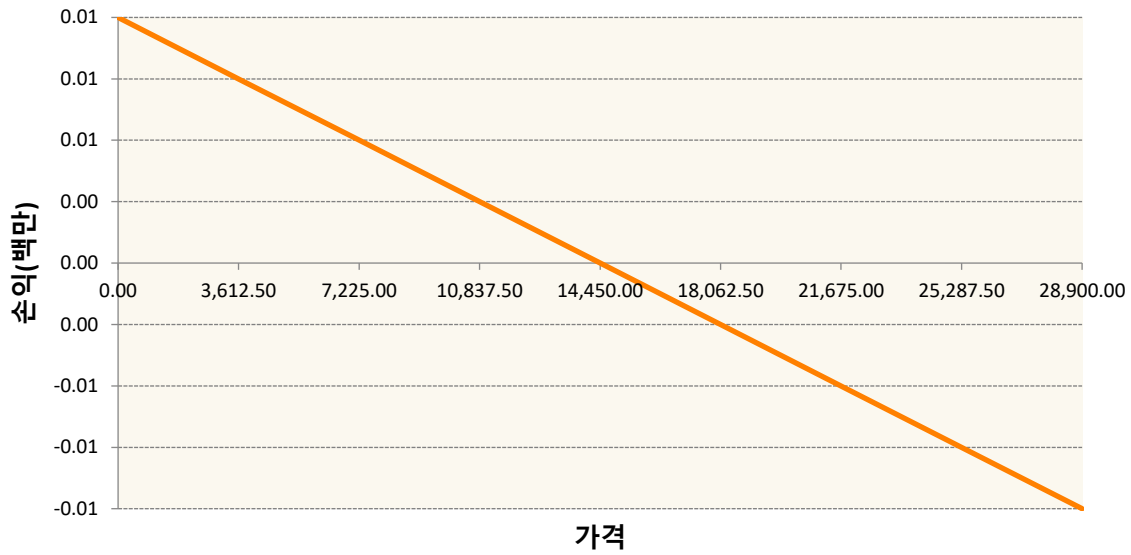
KR41CQV20008-2024-02 와이지엔터테인먼트개별선물



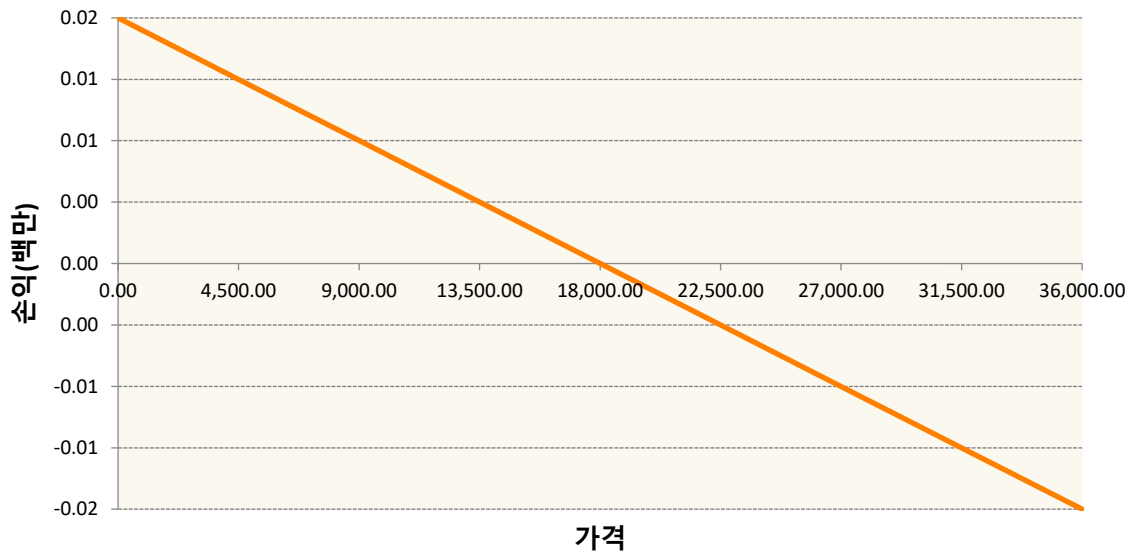
KR41CWV20006-2024-02 코웨이개별선물



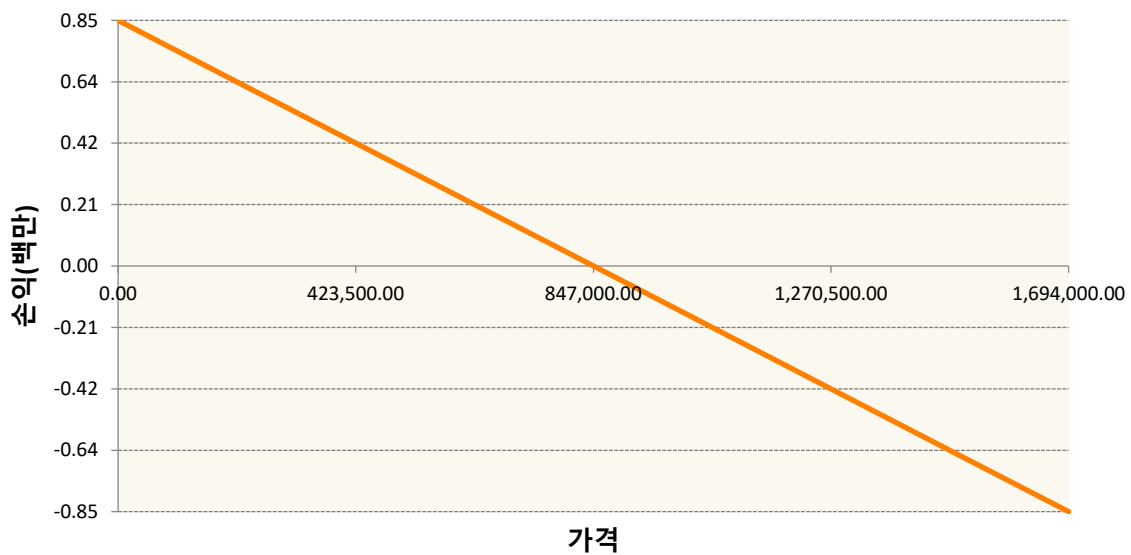
KR41EBV20006-2024-02 우리금융지주개별선물



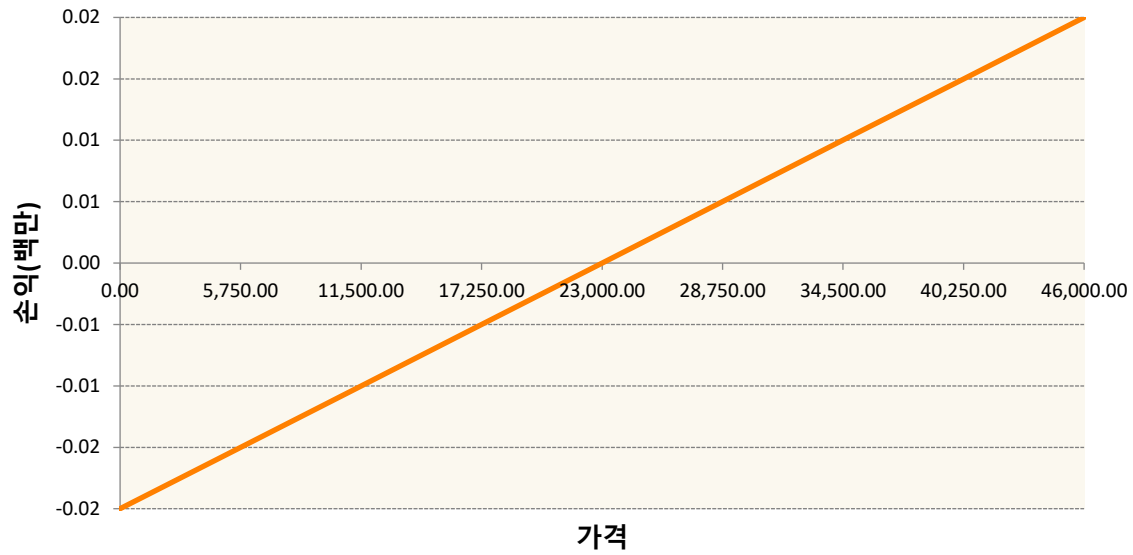
KR41ECV20004-2024-02 HDC현대산업개발개별선물



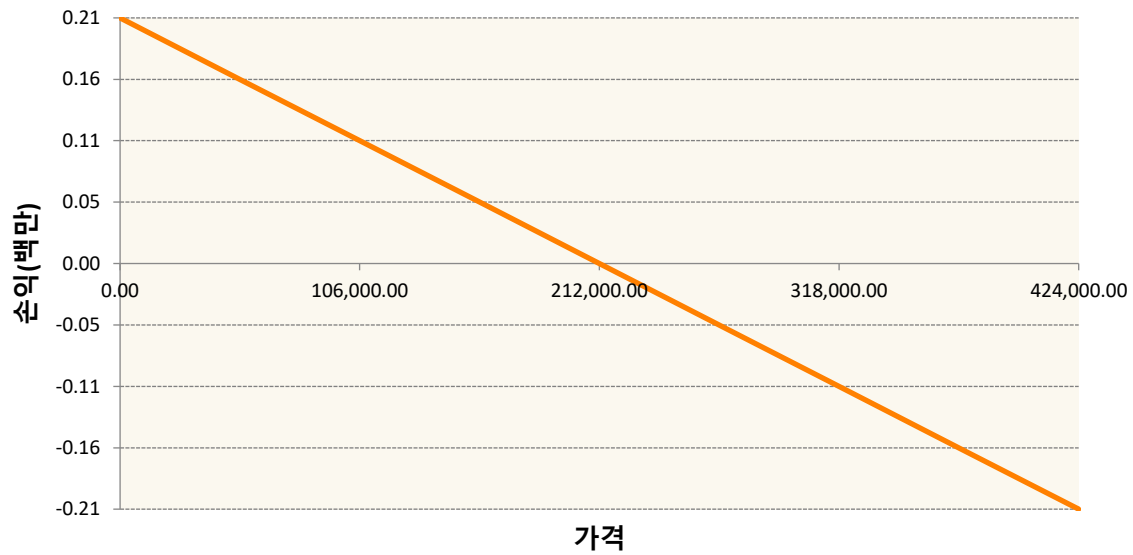
KR41ESV20000-2024-02 삼성바이오로직스개별선물



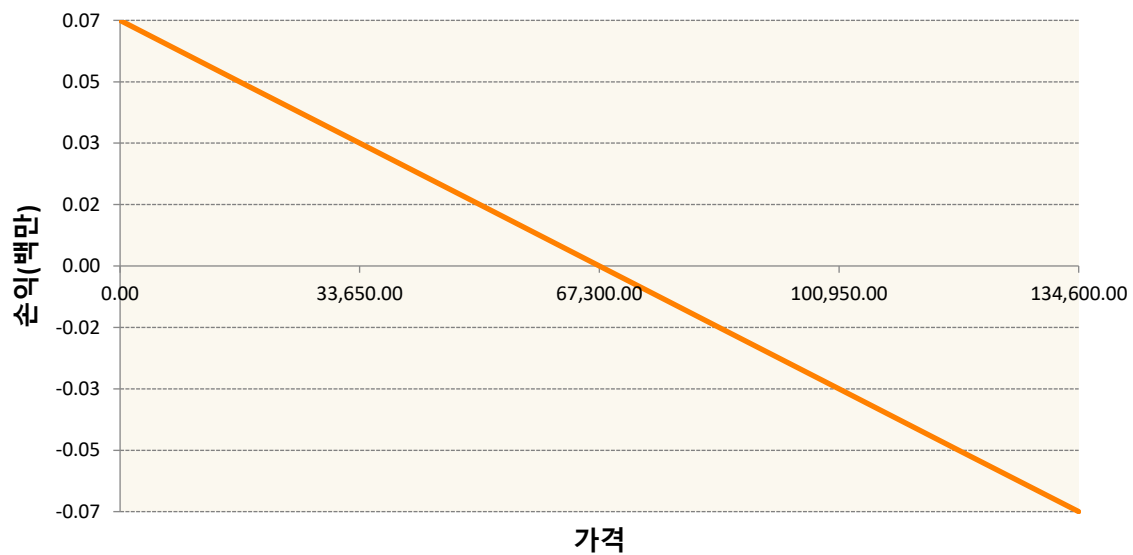
KR41ETV20008-2024-02 삼성엔지니어링개별선물



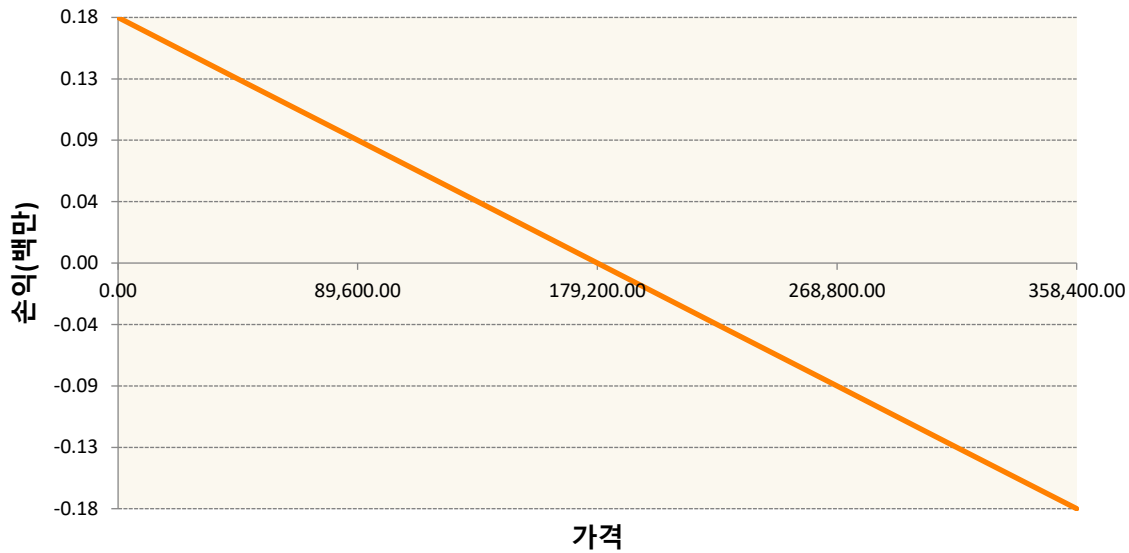
KR41F8V20005-2024-02 크래프톤개별선물



KR41FKV20004-2024-02 메리츠금융지주개별선물



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	0.33
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	1
KR41ECV200 2024-02 HDC현대산업개발개별선물	0.33
KR41ESV200 2024-02 삼성바이오로직스개별선물	1
KR41ETV200 2024-02 삼성엔지니어링개별선물	1
KR41F8V200 2024-02 크래프톤개별선물	1
KR41FKV200 2024-02 메리츠금융지주개별선물	1
KR41GCV20(2024-02 이오테크닉스개별선물	0.43

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

(단위:백만원)

90

공시일	2024-02-07
기준일	2024-02-06

코리아인덱스(주식-파생형)(종)

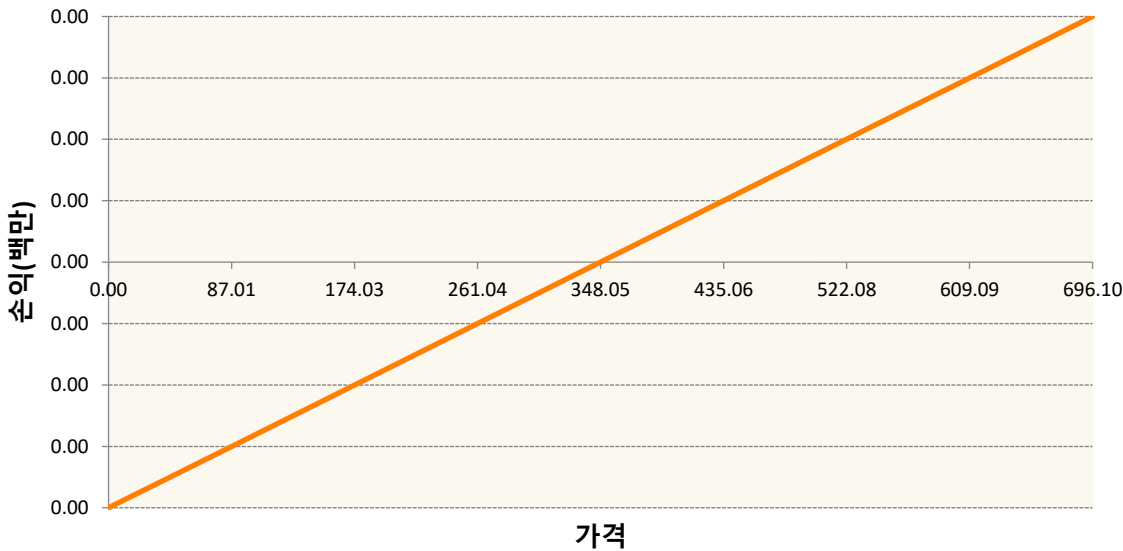
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,306	0	3,306	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101V30005-2024-03 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101V30005		2024-03 코스피200지수선물					264
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-264	-264	-264	-264	-264	-264	-264
-5.33%	-176	-176	-176	-176	-176	-176	-176
-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%	176	176	176	176	176	176	176
8.00%	264	264	264	264	264	264	264

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

(단위:백만원)

242

공시일	2024-02-07
기준일	2024-02-06

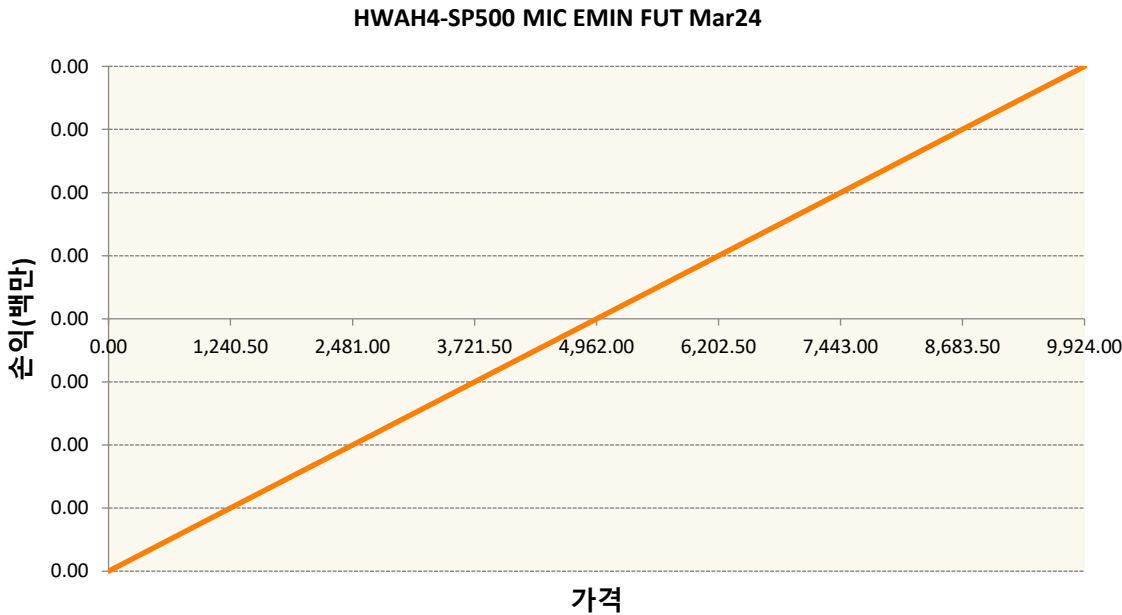
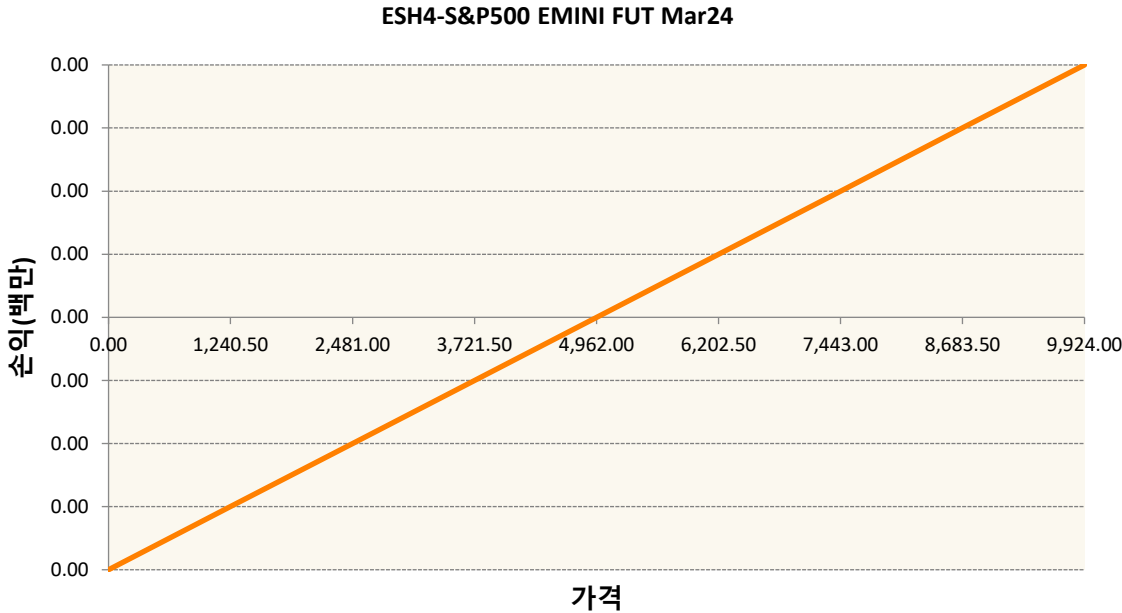
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

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	990	0	990	
누계	유가증권	선물	2,511	0	2,511	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESH4	S&P500 EMINI FUT Mar24	79
HWAH4	SP500 MIC EMIN FUT Mar24	201

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	227

공시일	2024-02-07
기준일	2024-02-06

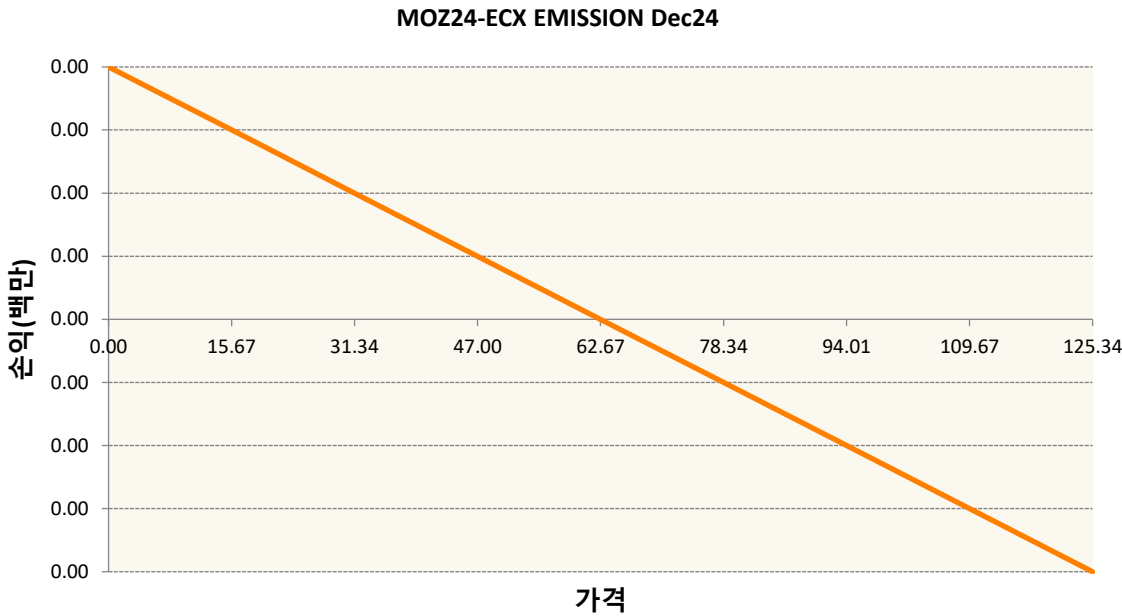
SOL유럽탄소배출권선물인버스ICE특별자산상

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	8,101	-8,101	
누계	지수	스왑	424	0	424	장외
누계	통화	선도	0	1,813	-1,813	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	648
SWICEUACN ICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX	7

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

(단위:백만원)

1,231

공시일	2024-02-07
기준일	2024-02-06

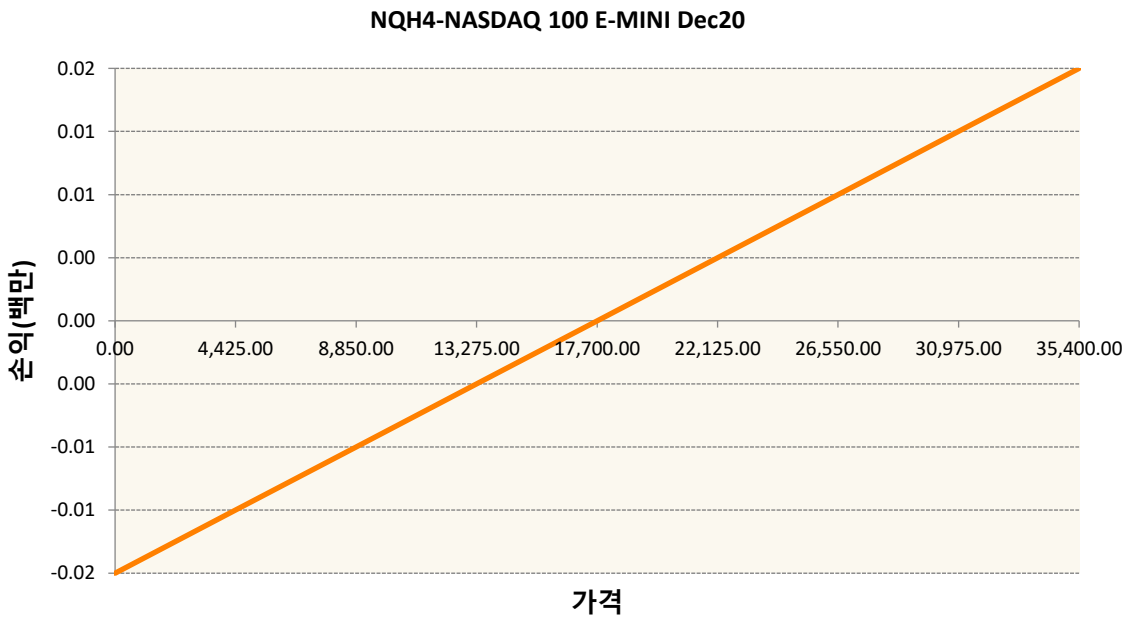
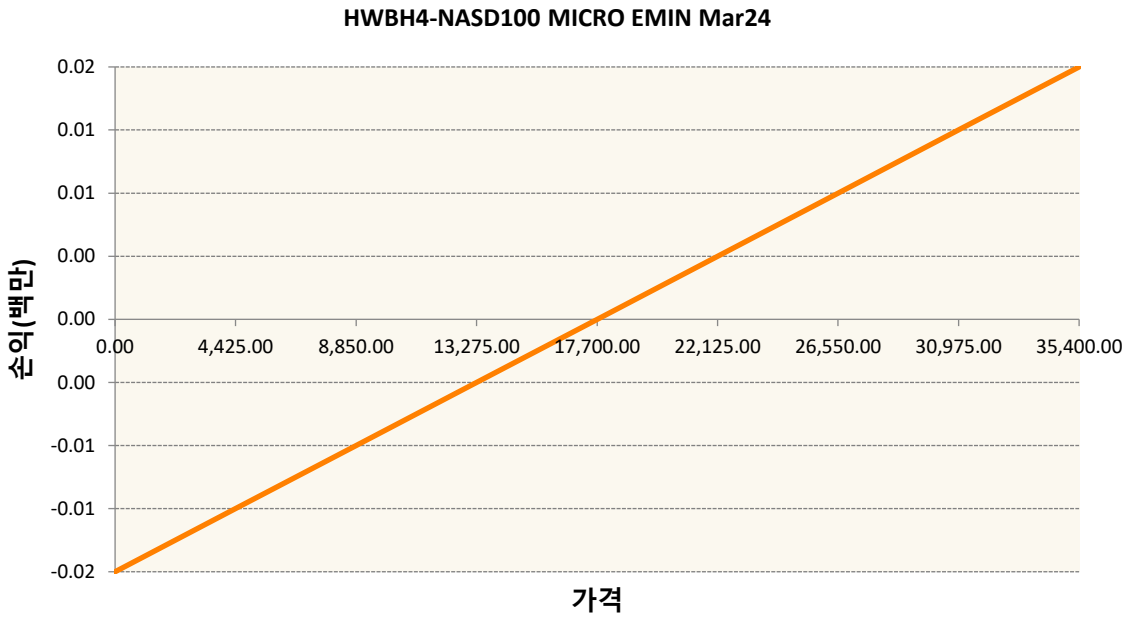
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

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	1,379	0	1,379	
누계	유가증권	선물	3,643	0	3,643	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
HWBH4	NASD100 MICRO EMIN Mar24		291
NQH4	NASDAQ 100 E-MINI Dec20		110

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)			(단위:백만원)
			354

공시일	2024-02-07
기준일	2024-02-06

SOL미국30년국채커버드콜(합성)

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	34,161	0	34,161	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWKEDI0000 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	440
SWKEDI0000 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	1,758
SWKEDI0000 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	523

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

(단위:백만원)

1,856

공시일	2024-02-07
기준일	2024-02-06

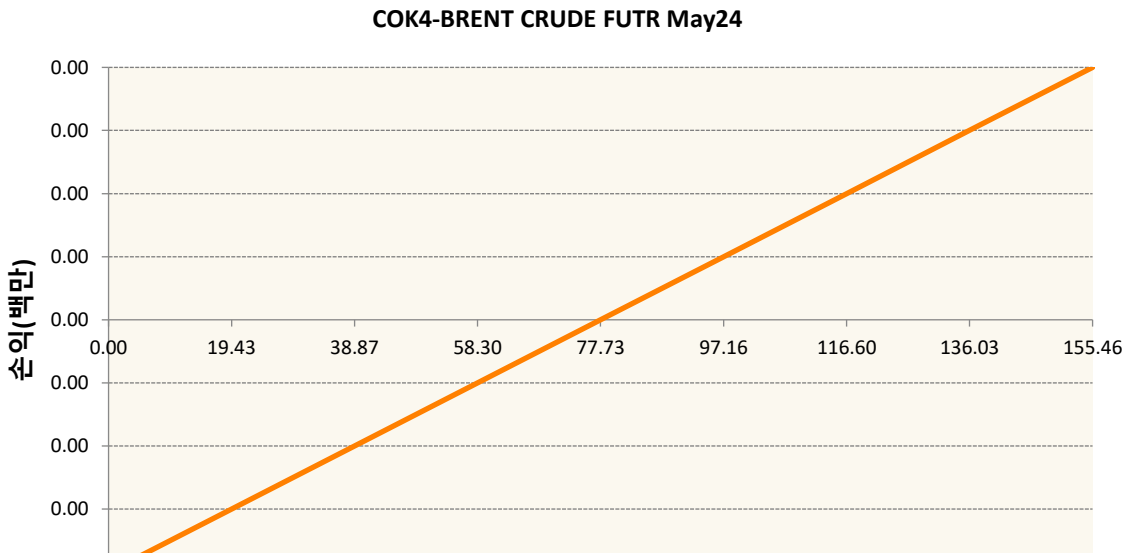
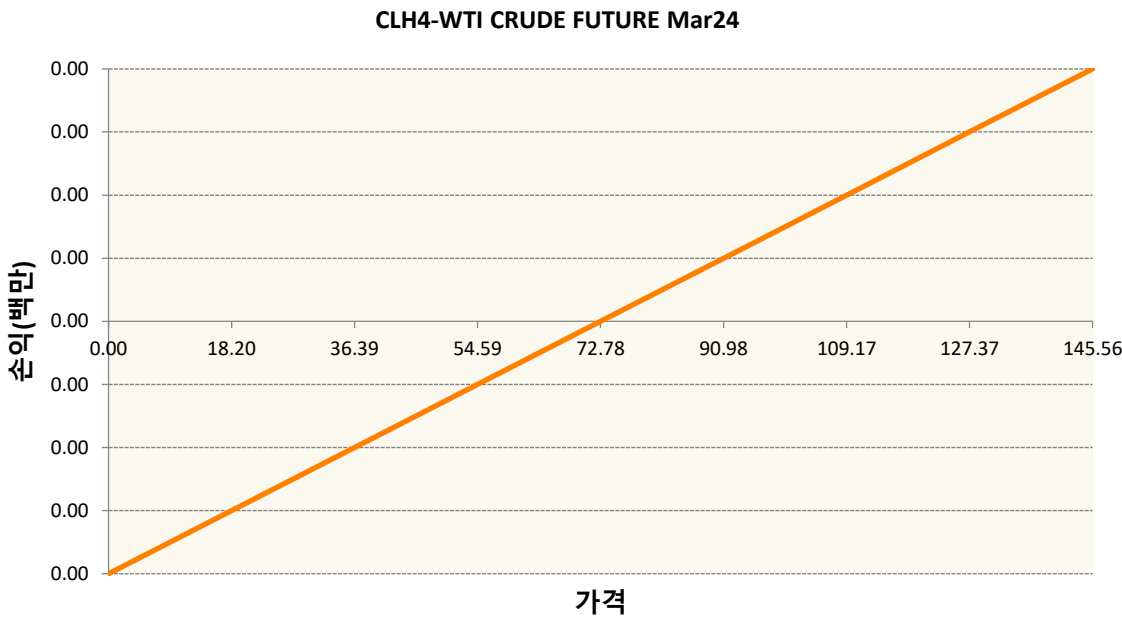
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

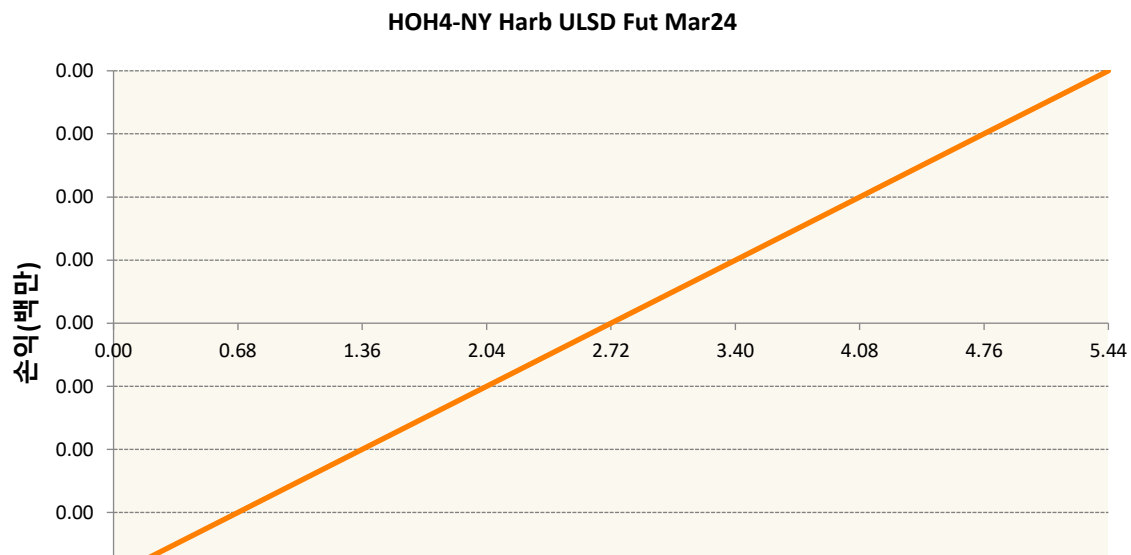
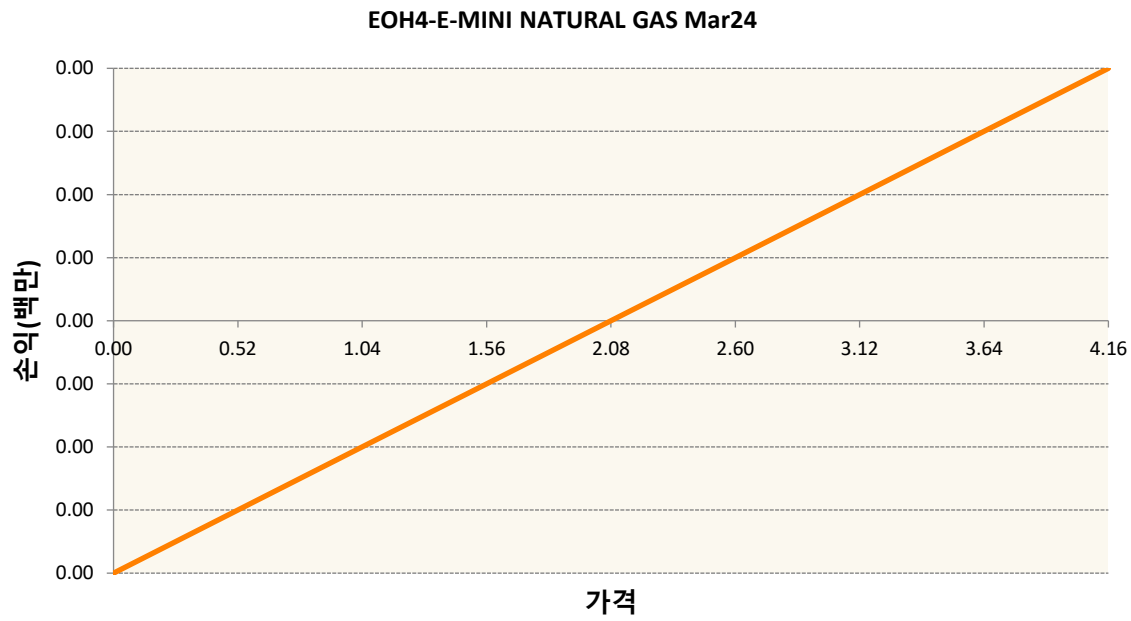
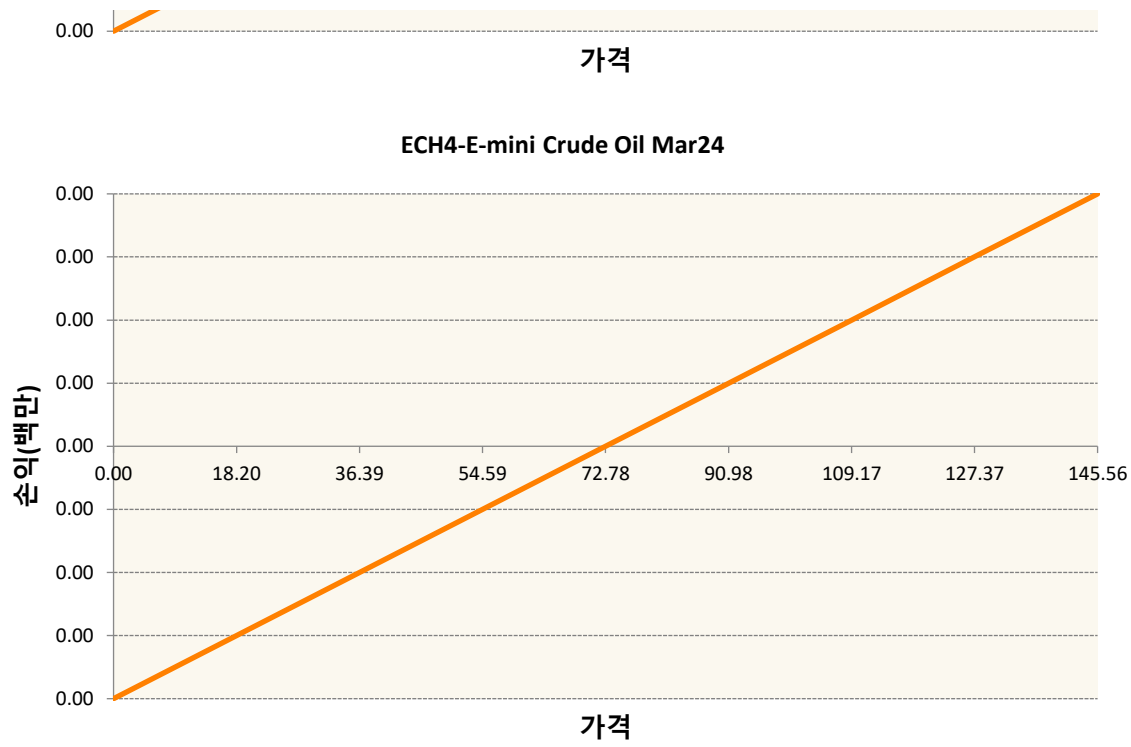
1. 계약금액

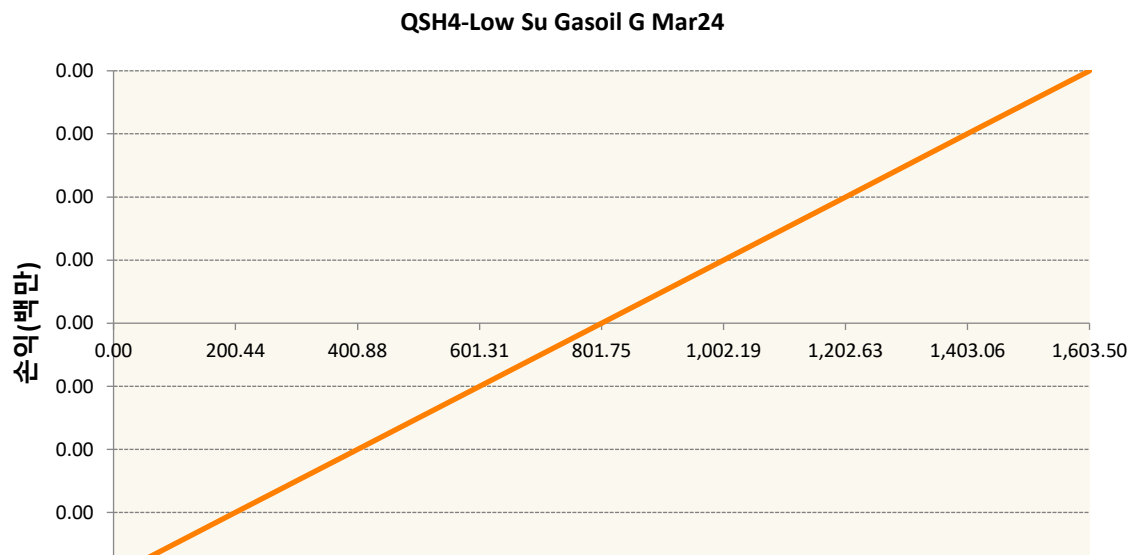
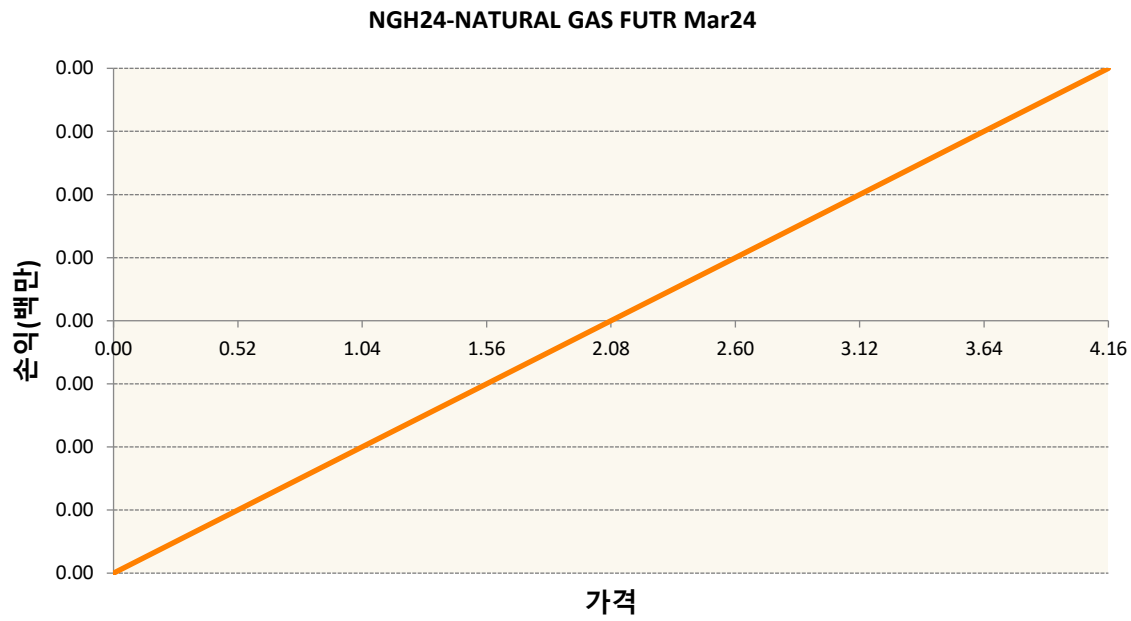
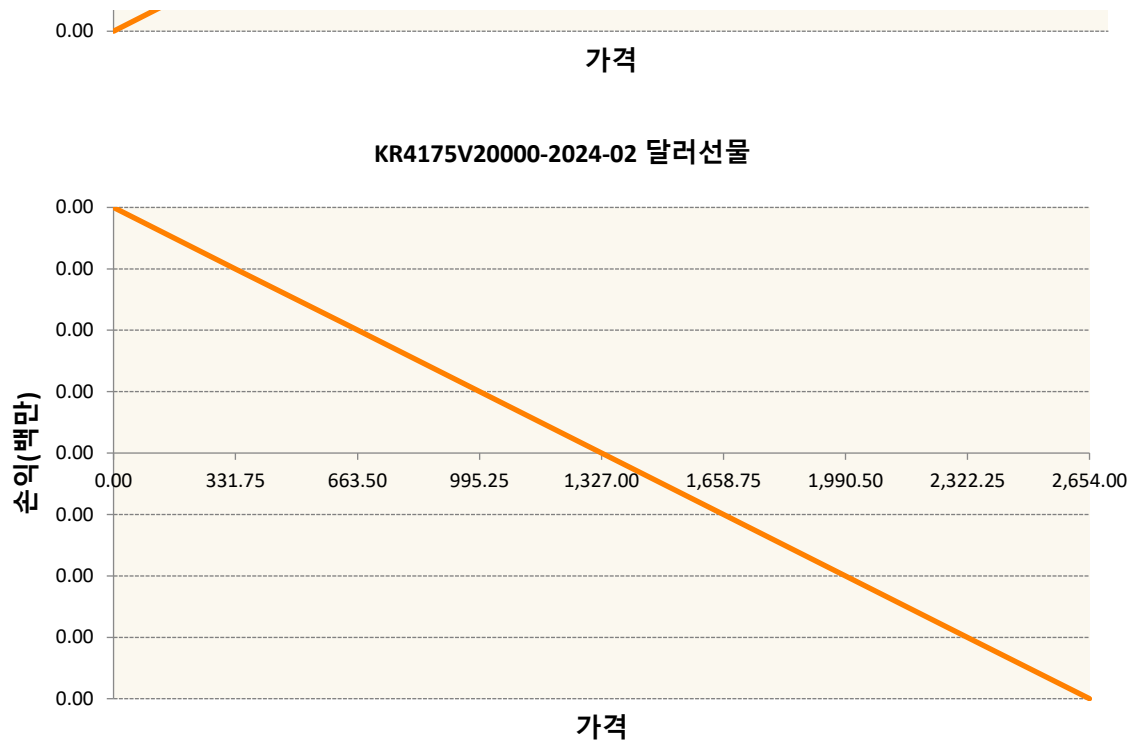
(단위:백만원)

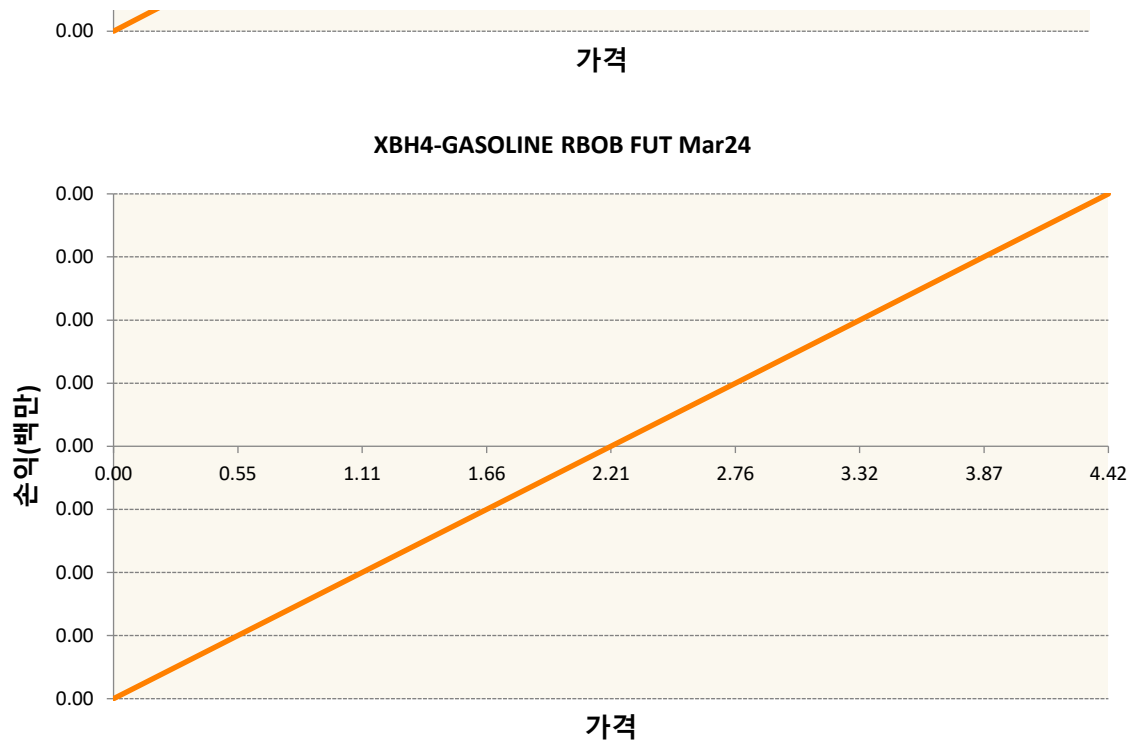
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	13	0	13	장내
누계	선물	유가증권	191	0	191	
누계	유가증권	선물	958	0	958	
누계	통화	선물	0	173	-173	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
CLH4	WTI CRUDE FUTURE Mar24		15
COK4	BRENT CRUDE FUTR May24		25
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			14
NGH24	NATURAL GAS FUTR Mar24		17
QSH4	Low Su Gasoil G Mar24		8
XBH4	GASOLINE RBOB FUT Mar24		10

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)		(단위:백만원)
		221