

공시일	2024-02-19
기준일	2024-02-16

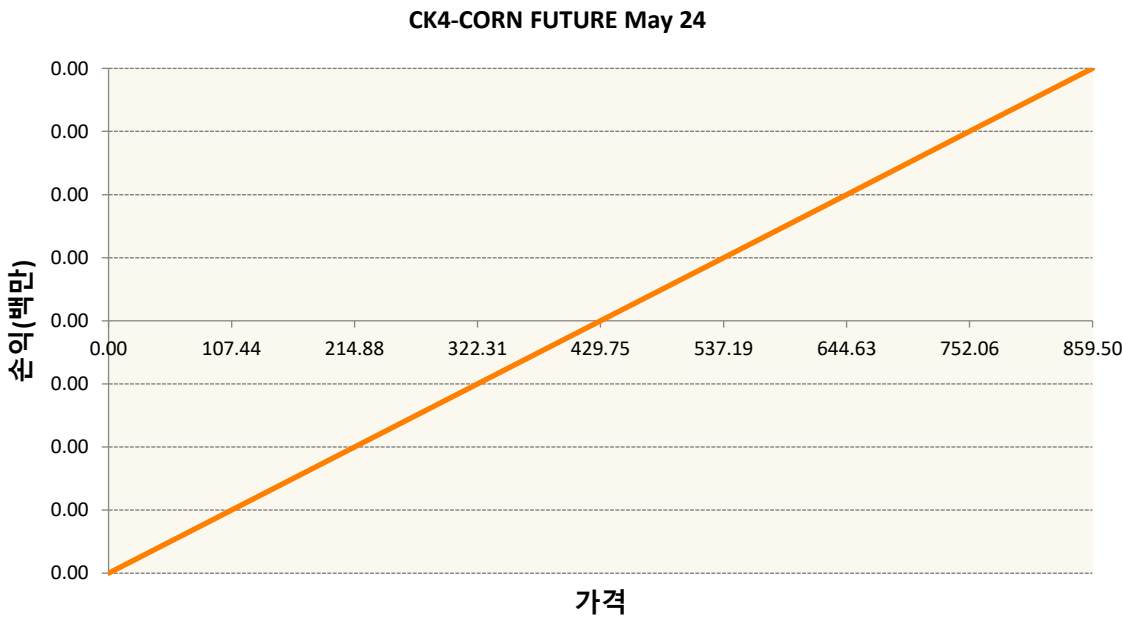
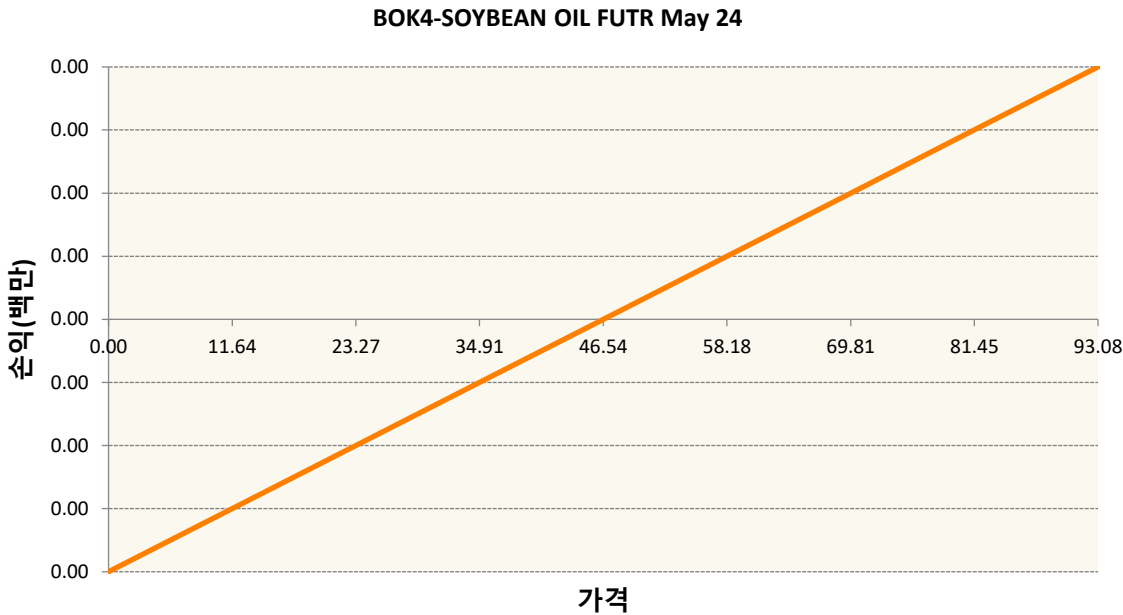
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

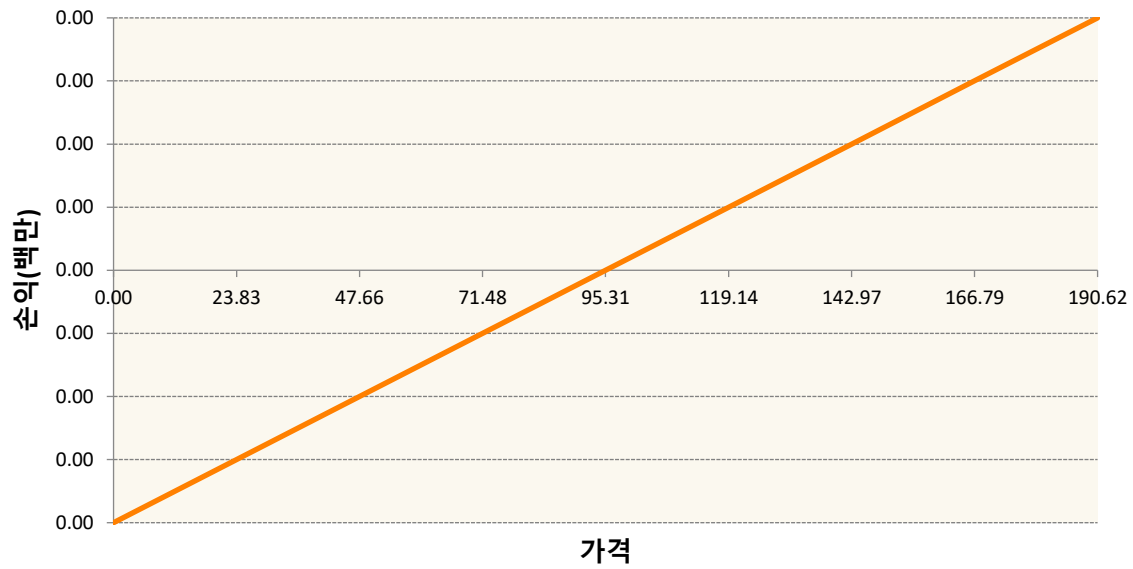
(단위:USD 백만)

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	4,328	0	4,328	
누계	통화	선물	0	427	-427	장내

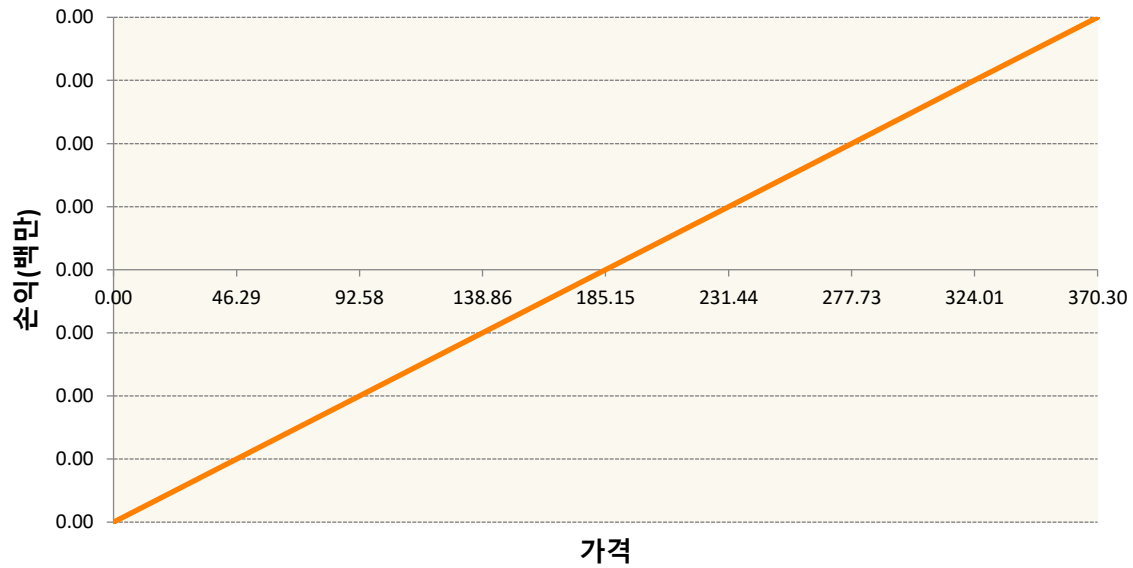
2. 만기시점의 손익구조



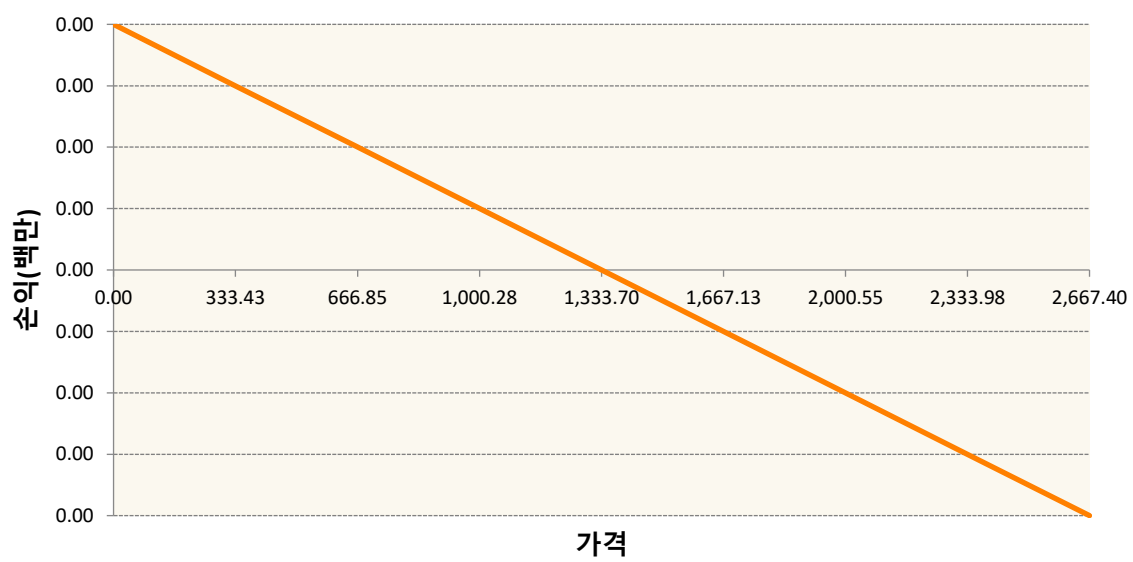
CTK4-COTTON NO.2 FUTR May 24



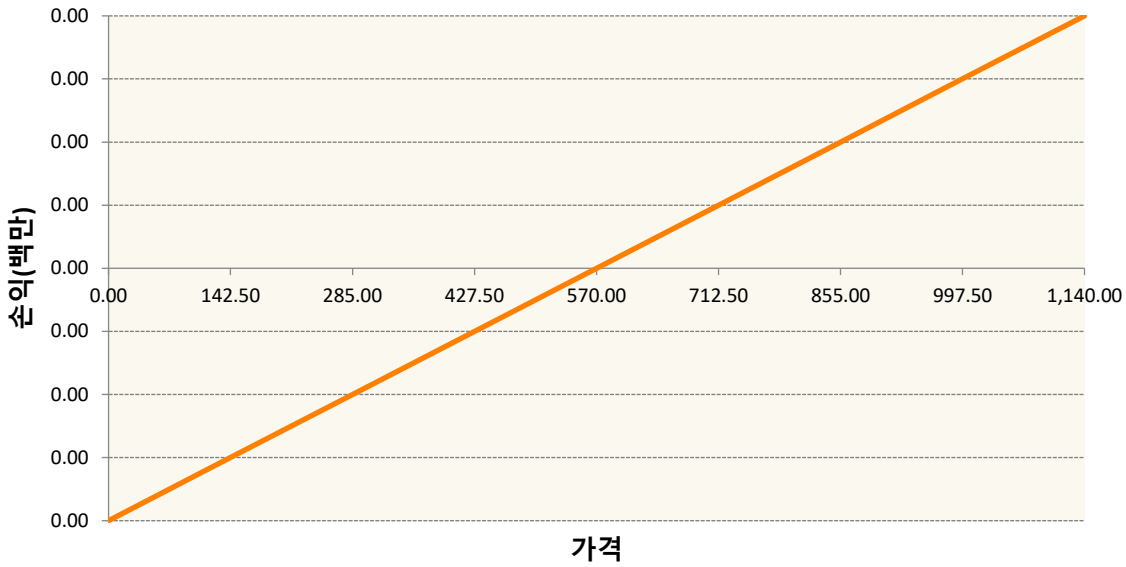
KCK4-COFFEE 'C' FUTURE May 24



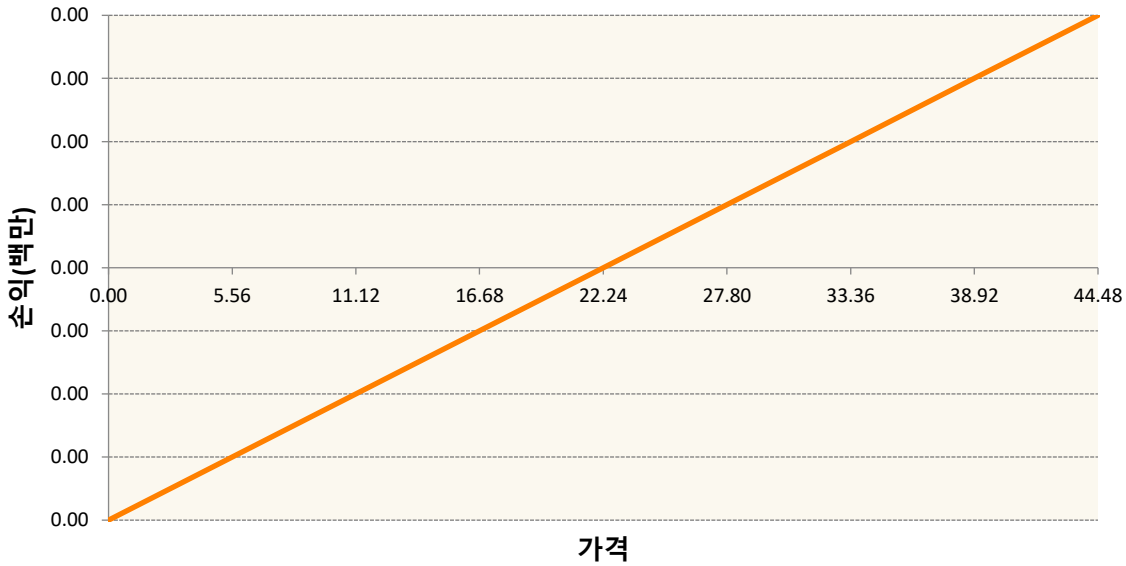
KR4175V30009-2024-03 달러선물



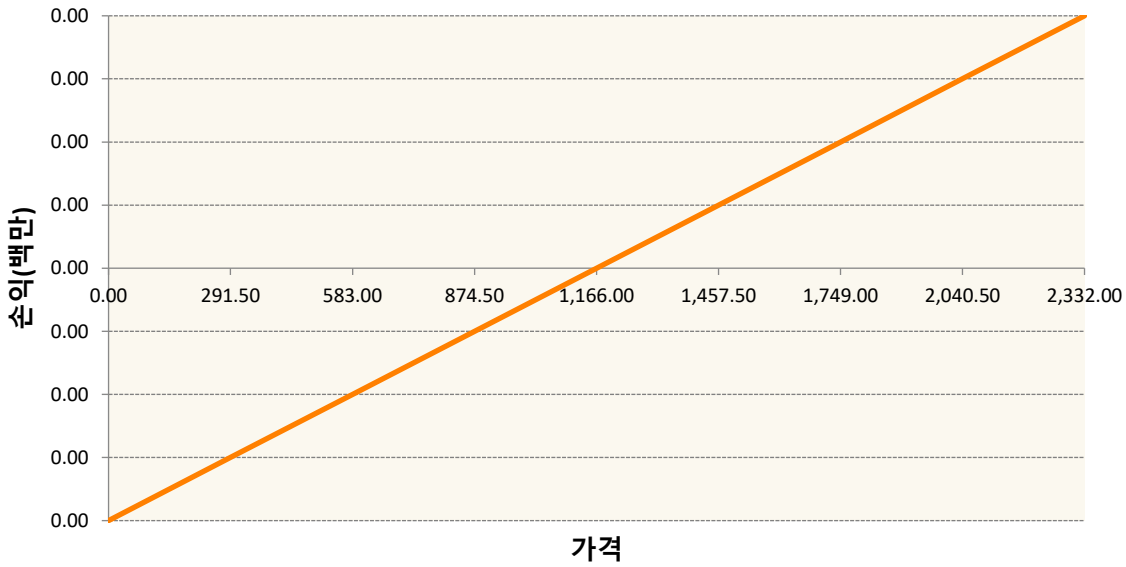
KWK4-KC HRW WHEAT FUT May 24



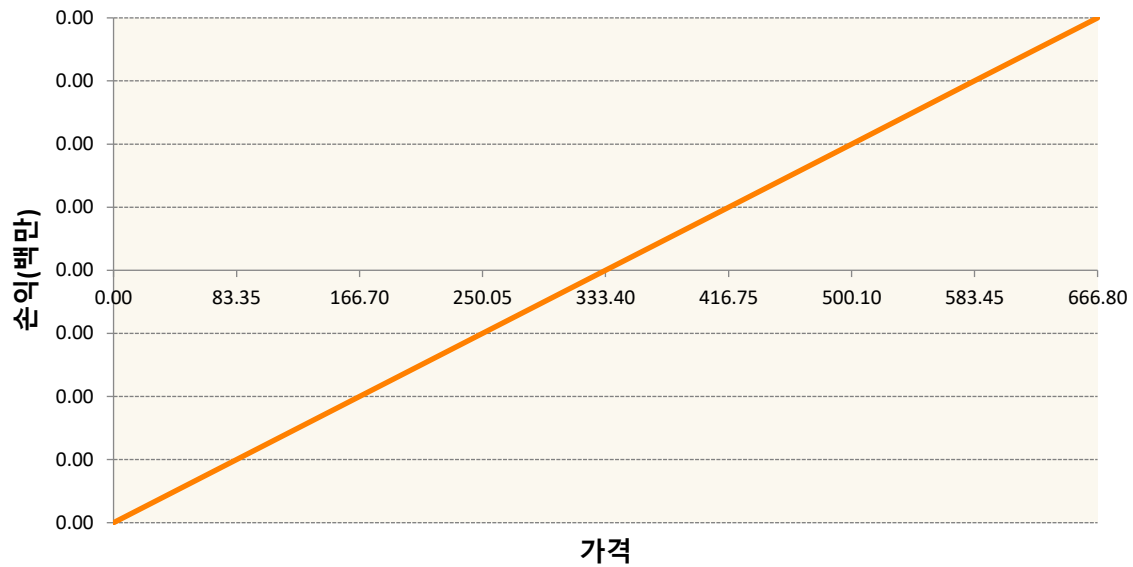
SBK4-Sugar #11 (WORLD) May 24



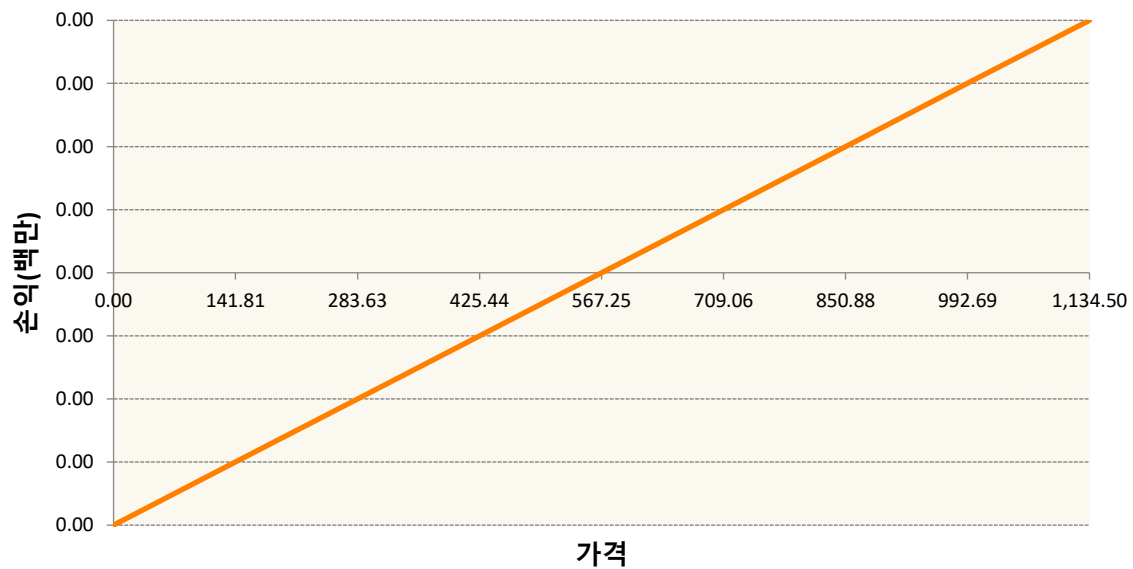
SK4-SOYBEAN FUTURE May 24



SMK4-SOYBEAN MEAL FUTR May 24



WK4-WHEAT FUTURE(CBT) May 24



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

공시일	2024-02-19
기준일	2024-02-16

스마트인덱스모

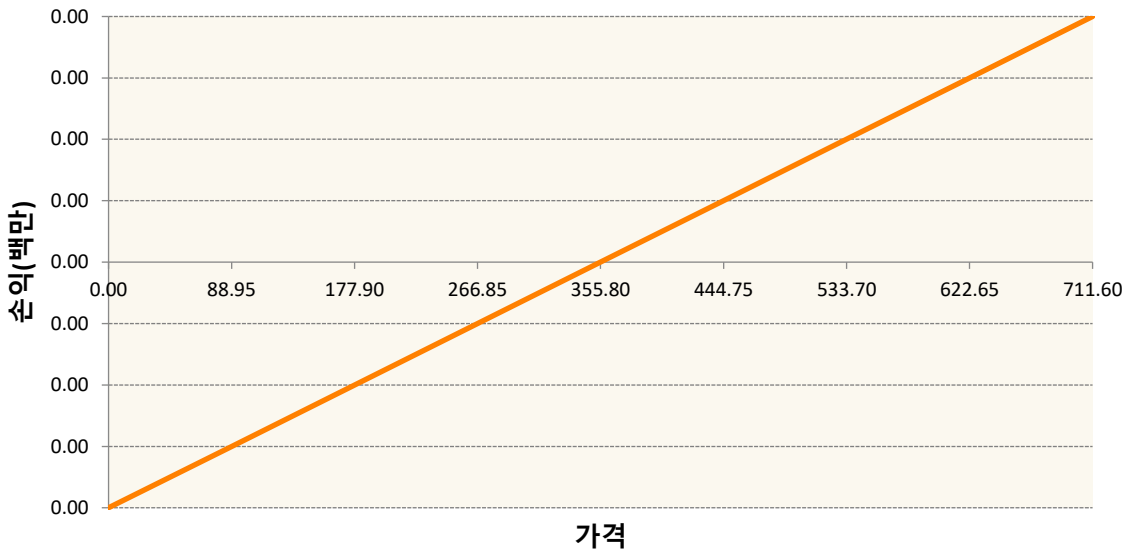
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,334	0	1,334	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101V30005-2024-03 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101V30005		2024-03 코스피200지수선물					107
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-107	-107	-107	-107	-107	-107	-107
-5.33%	-71	-71	-71	-71	-71	-71	-71
-2.67%	-36	-36	-36	-36	-36	-36	-36
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	36	36	36	36	36	36	36
5.33%	71	71	71	71	71	71	71
8.00%	107	107	107	107	107	107	107

공시일	2024-02-19
기준일	2024-02-16

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	257
-----------------------------	-----

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

294

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2024-02-19
기준일	2024-02-16

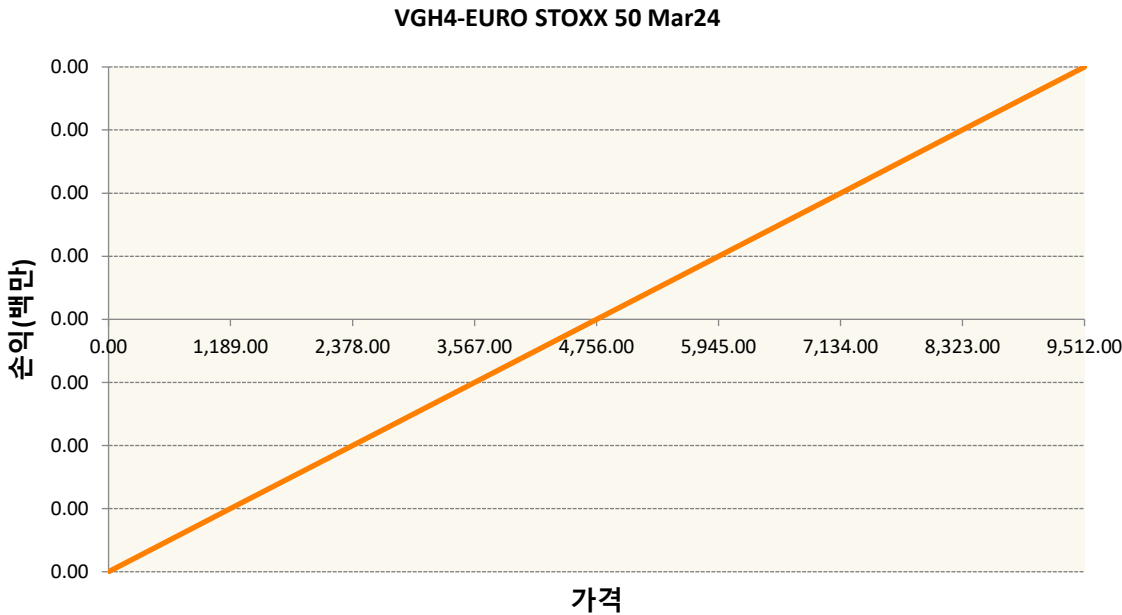
유로인덱스모(주식-파생형)

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	1,016	0	1,016	
누계	통화	선도	216	0	216	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213DCLI EUR/KRW 22-03-24E	17
VGH4 EURO STOXX 50 Mar24	81

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

(단위:백만원)

72

공시일	2024-02-19
기준일	2024-02-16

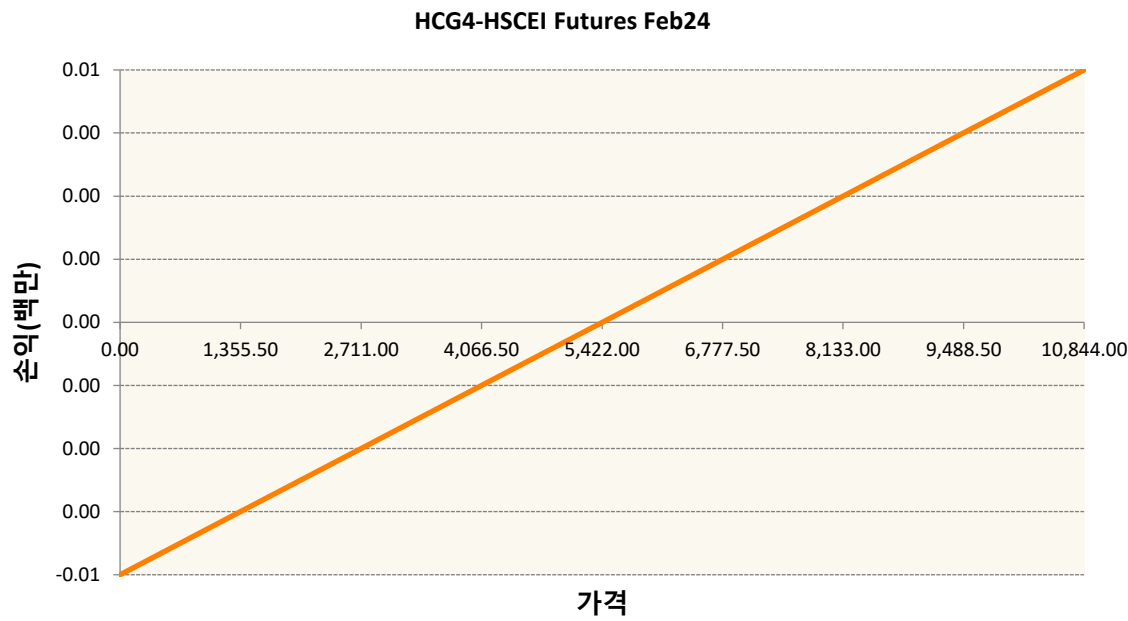
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,065	0	1,065	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCG4	HSCEI Futures Feb24	85
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

126

공시일	2024-02-19
기준일	2024-02-16

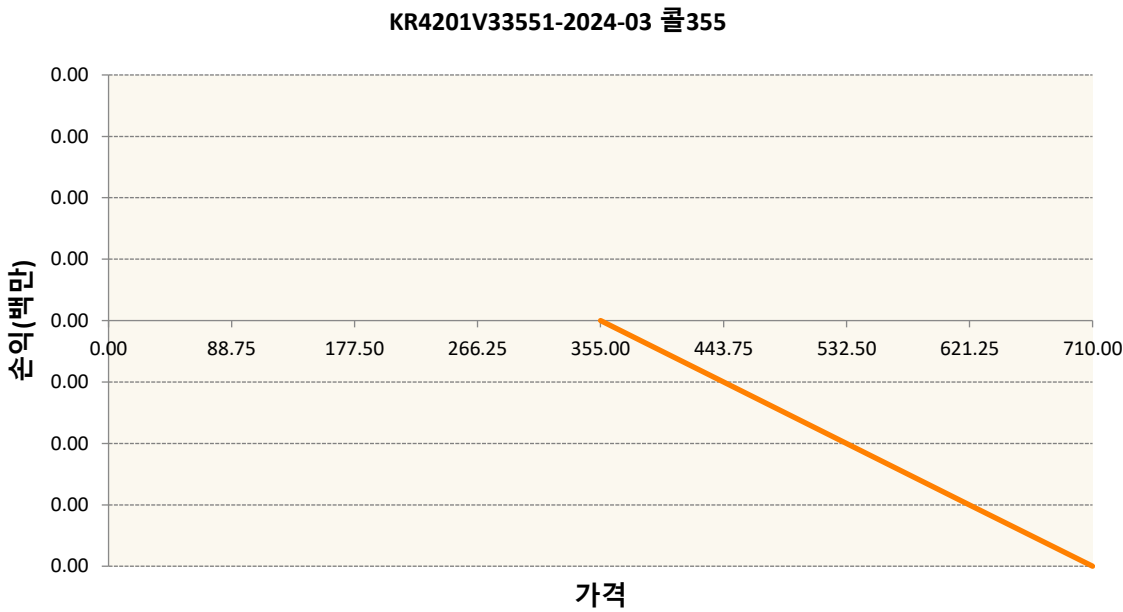
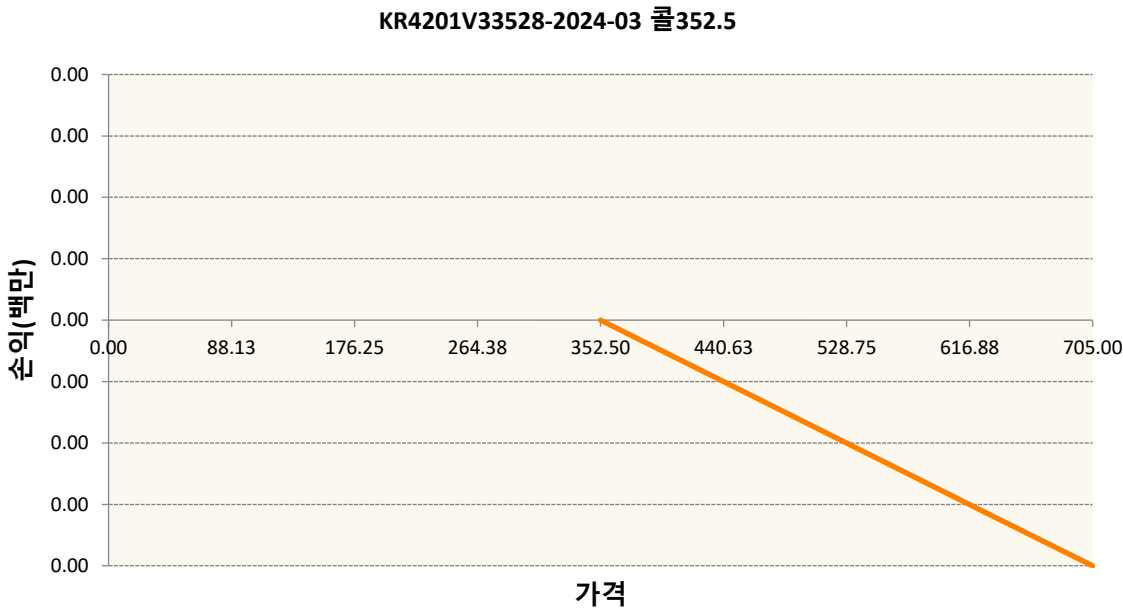
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

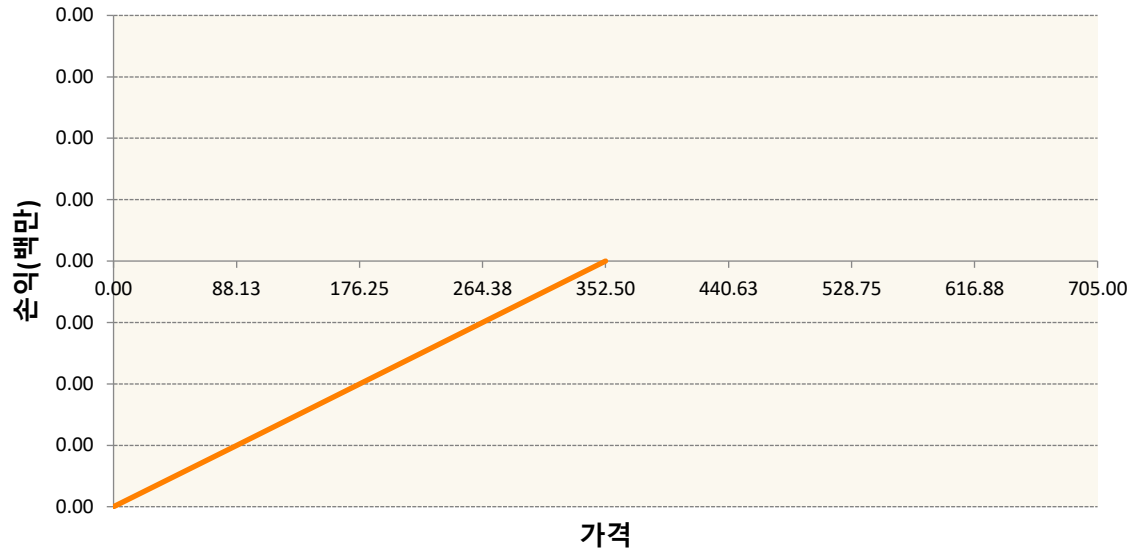
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	50,520	-50,520	장내

2. 만기시점의 손익구조



KR4301V33526-2024-03 풋352.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201V33528			2024-03 콜352.5				1,752
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	612	607	599	589	576	562	545
-5.33%	576	557	536	512	486	459	430
-2.67%	439	403	367	330	292	254	216
0%	118	79	39	0	-40	-79	-119
2.67%	-395	-420	-448	-478	-509	-542	-575
5.33%	-1,027	-1,037	-1,051	-1,067	-1,086	-1,107	-1,130
8.00%	-1,704	-1,707	-1,712	-1,719	-1,727	-1,739	-1,752
KR4201V33551			2024-03 콜355				1,038
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	318	316	312	308	301	294	285
-5.33%	303	294	283	271	257	242	226
-2.67%	240	220	200	178	157	134	112
0%	75	50	25	0	-25	-50	-75
2.67%	-213	-231	-251	-272	-293	-315	-337
5.33%	-587	-596	-607	-619	-633	-648	-664
8.00%	-1,000	-1,003	-1,007	-1,013	-1,020	-1,028	-1,038
KR4301V33526			2024-03 풋352.5				523
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-500	-502	-505	-508	-513	-518	-523
-5.33%	-276	-282	-290	-298	-307	-316	-326
-2.67%	-86	-99	-111	-124	-137	-150	-163
0%	40	27	14	0	-14	-27	-41

2.67%	102	93	83	73	62	51	40
5.33%	122	118	113	108	101	94	86
8.00%	126	125	124	121	118	115	110

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

(단위:백만원)

3,491

공시일	2024-02-19
기준일	2024-02-16

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	1,831	0	1,831	

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	2024-02-19
기준일	2024-02-16

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	4,470	0	4,470	

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	2024-02-19
기준일	2024-02-16

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	17,662	0	17,662	
누계	통화	선도	267	17,794	-17,527	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213DBV KRW/USD 29-02-24E	656
FXW213DCT KRW/USD 29-03-24E	518
FXW213E1W KRW/USD 30-04-24E	249
FXW213E28C USD/KRW 29-02-24E	21
IE00BD8RGM75	

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

731

공시일	2024-02-19
기준일	2024-02-16

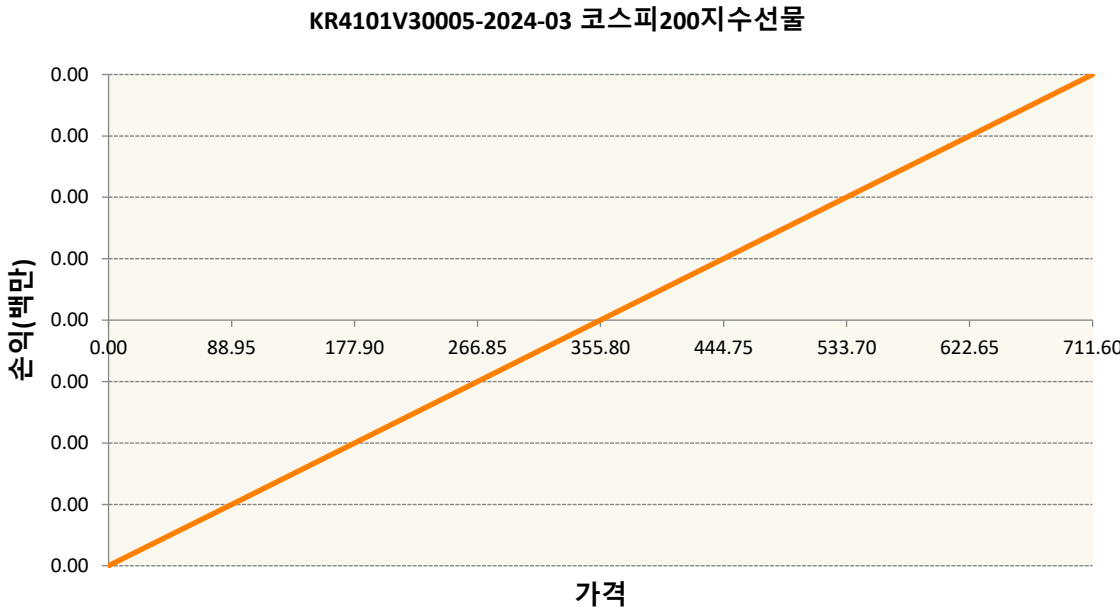
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

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	534	0	534	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101V30005			2024-03 코스피200지수선물				43
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-43	-43	-43	-43	-43	-43	-43
-5.33%	-28	-28	-28	-28	-28	-28	-28
-2.67%	-14	-14	-14	-14	-14	-14	-14
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	14	14	14	14	14	14	14
5.33%	28	28	28	28	28	28	28
8.00%	43	43	43	43	43	43	43

공시일	2024-02-19
기준일	2024-02-16

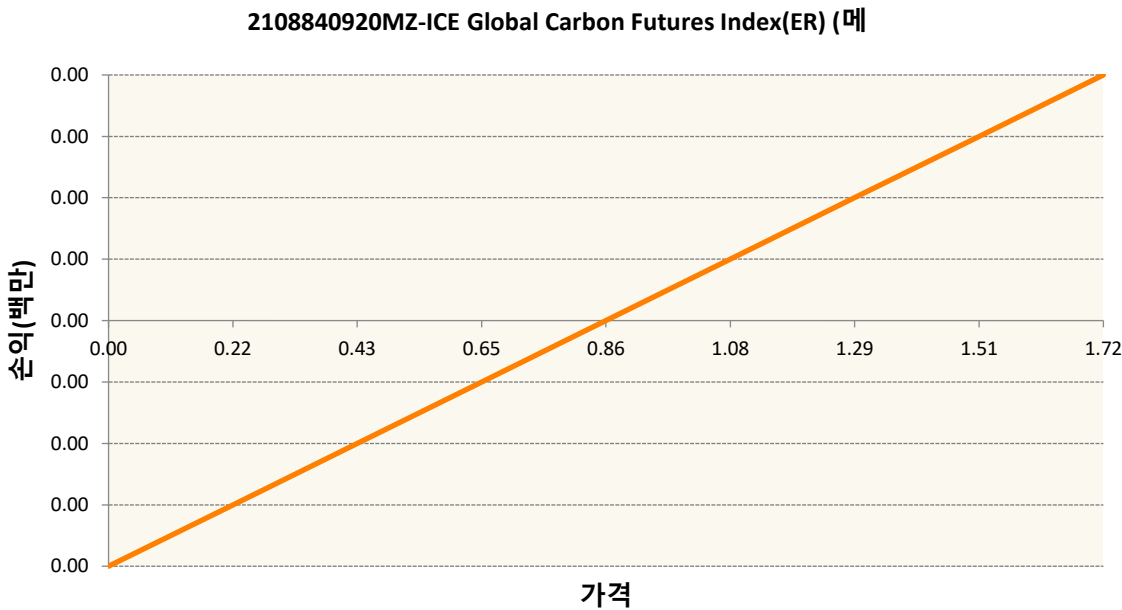
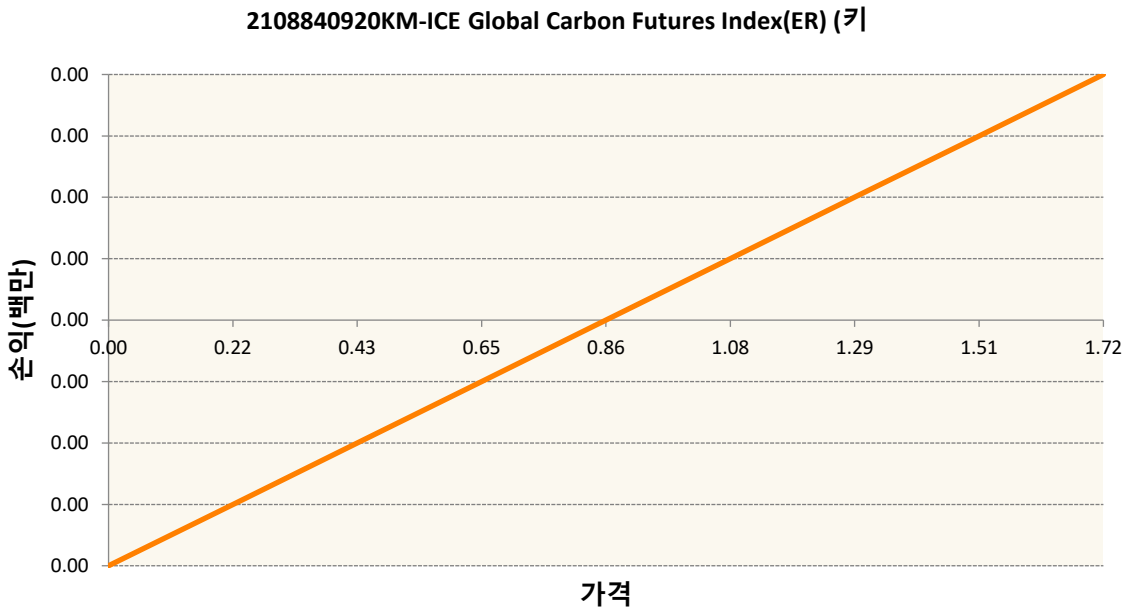
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

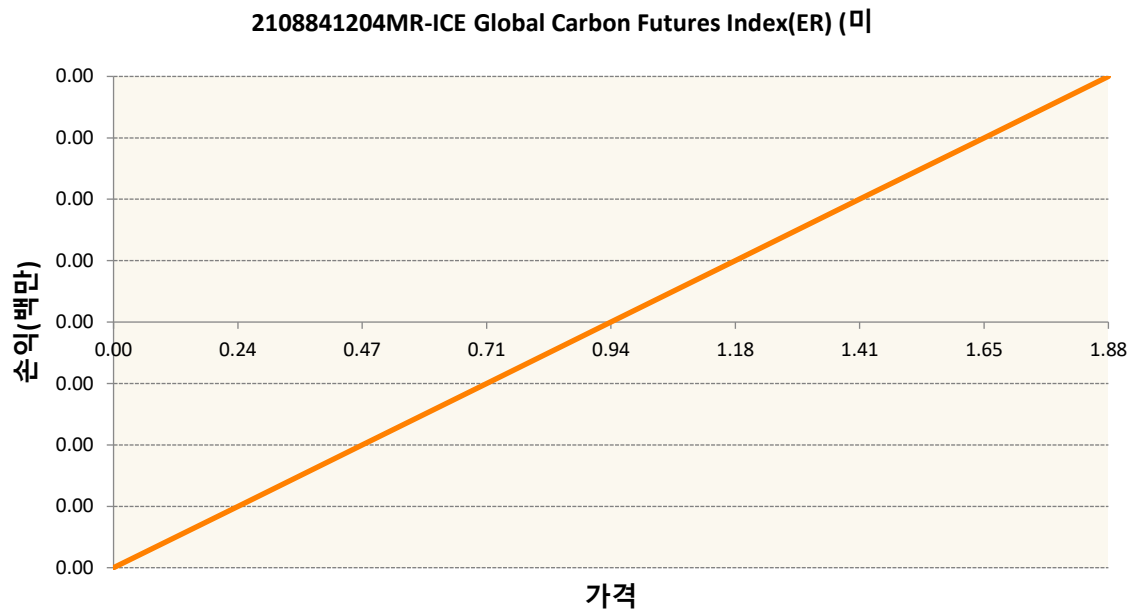
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	18,128	0	18,128	

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108840920ICE Global Carbon Futures Index(ER) (키		853
2108840920ICE Global Carbon Futures Index(ER) (메		171
2108841204ICE Global Carbon Futures Index(ER) (미		426

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,727

공시일	2024-02-19
기준일	2024-02-16

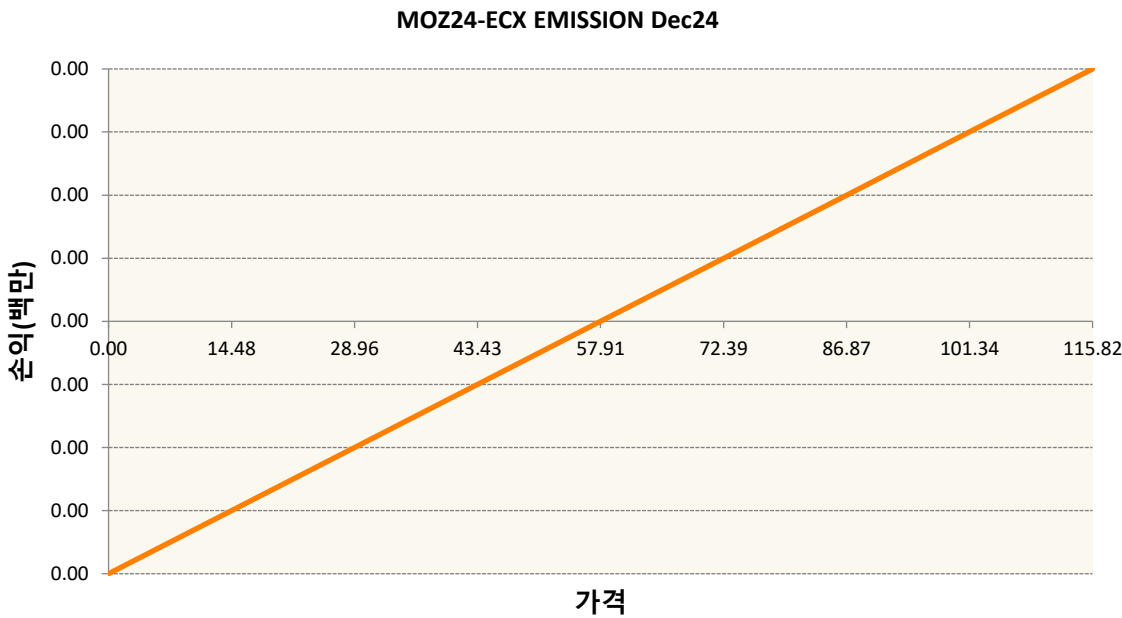
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	7,826	0	7,826	
누계	지수	스왑	424	0	424	장외
누계	통화	선도	0	1,997	-1,997	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	626
SWICEUACN ICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX	9

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

(단위:백만원)

1,182

공시일	2024-02-19
기준일	2024-02-16

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)	1
SWCSI00000 신한CSI Index 230622 (메리츠)	1
SWCSI00000 신한CSI Index 230922 (키움)	1
SWCSI00000 신한CSI Index 231013 (NH)	1

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

(단위:백만원)

6

공시일	2024-02-19
기준일	2024-02-16

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)	16
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(NH)	13
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(메리츠)	19
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(키움)	4

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

(단위:백만원)

57

공시일	2024-02-19
기준일	2024-02-16

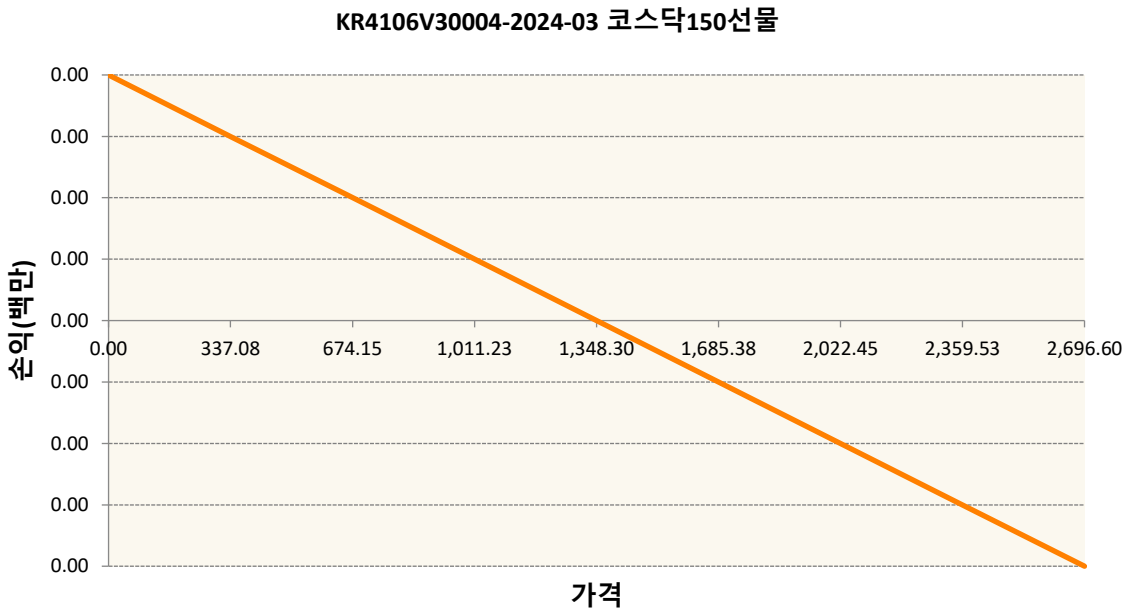
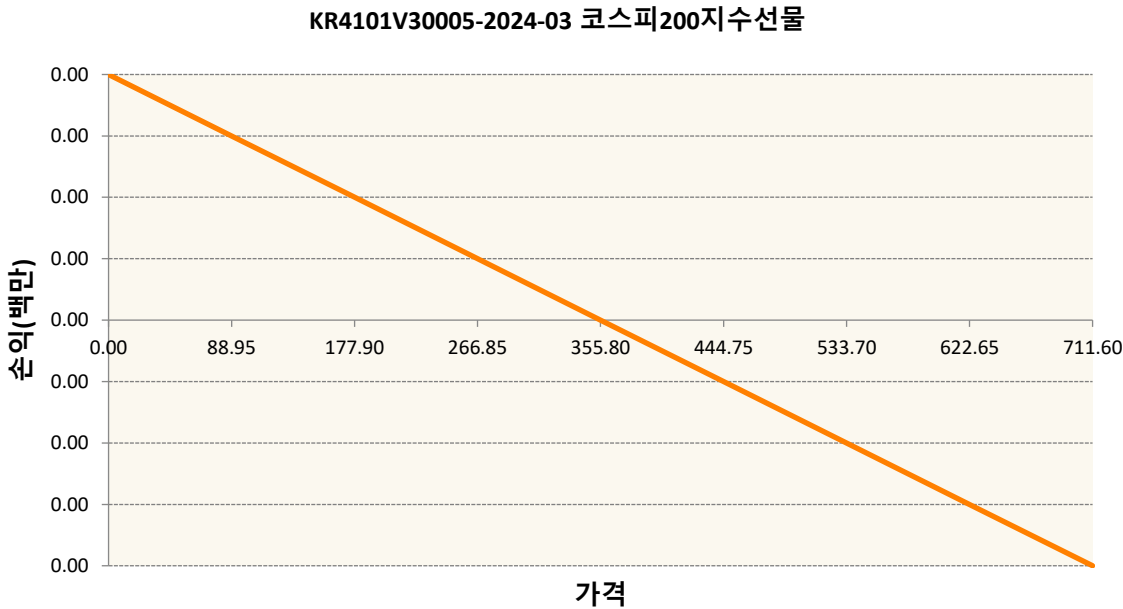
에퀴티알파일반사모혼합자산

1. 계약금액

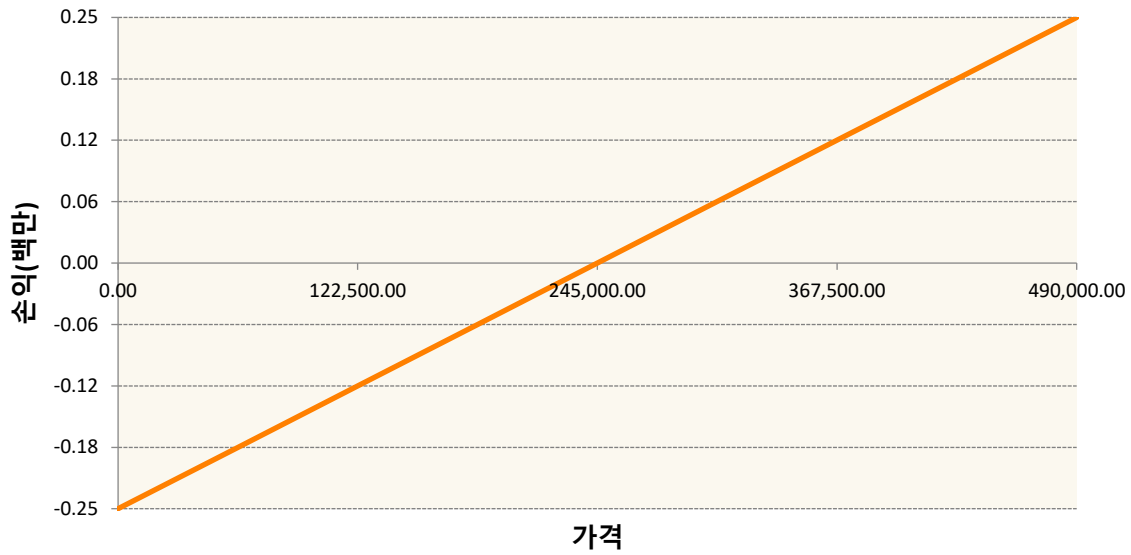
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	3	20	-17	장내
누계	유가증권	선물	35	1,022	-987	장내

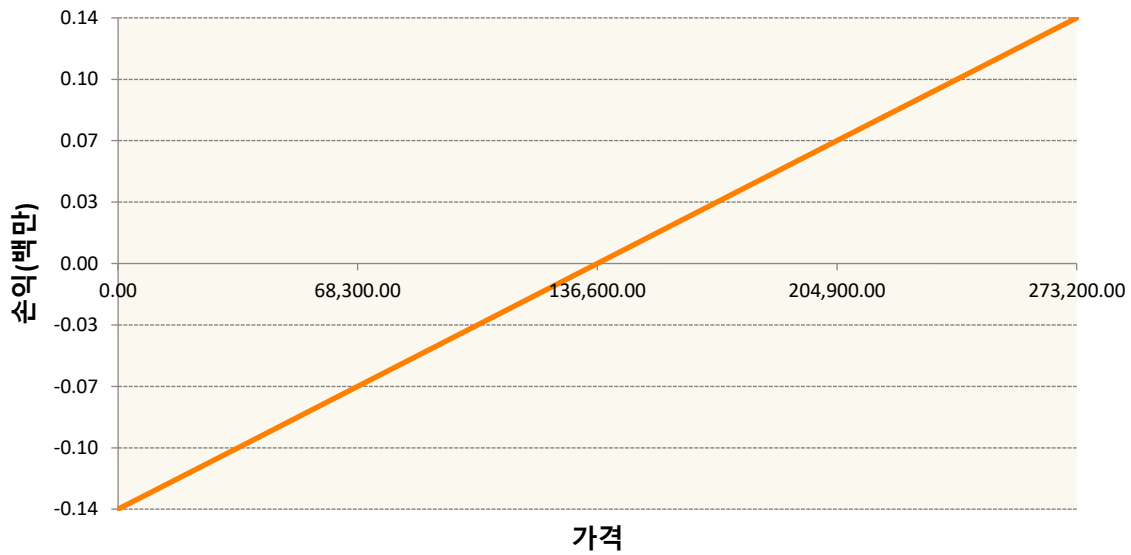
2. 만기시점의 손익구조



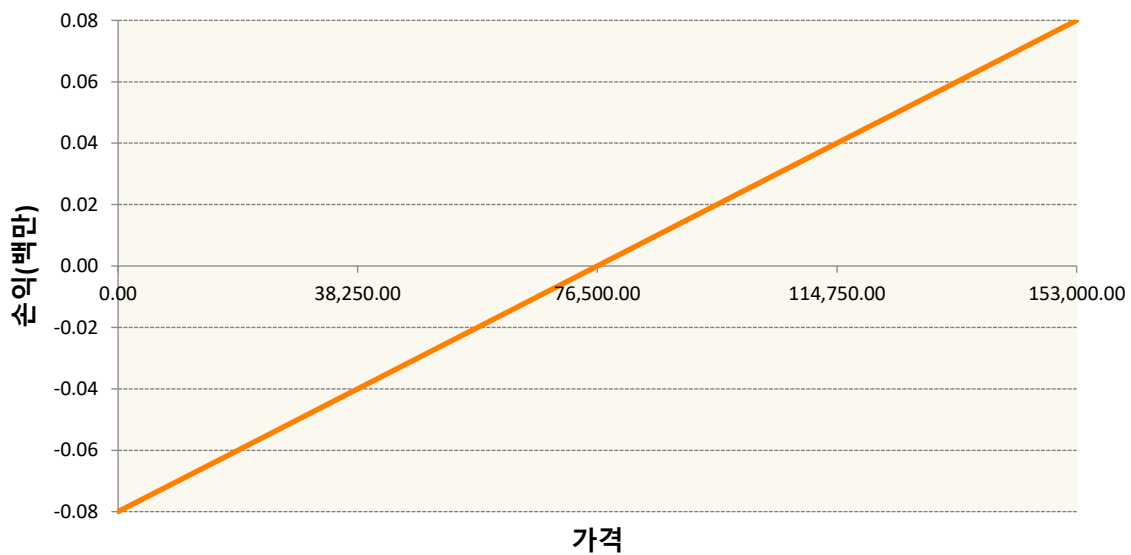
KR4116V30003-2024-03 현대차개별선물



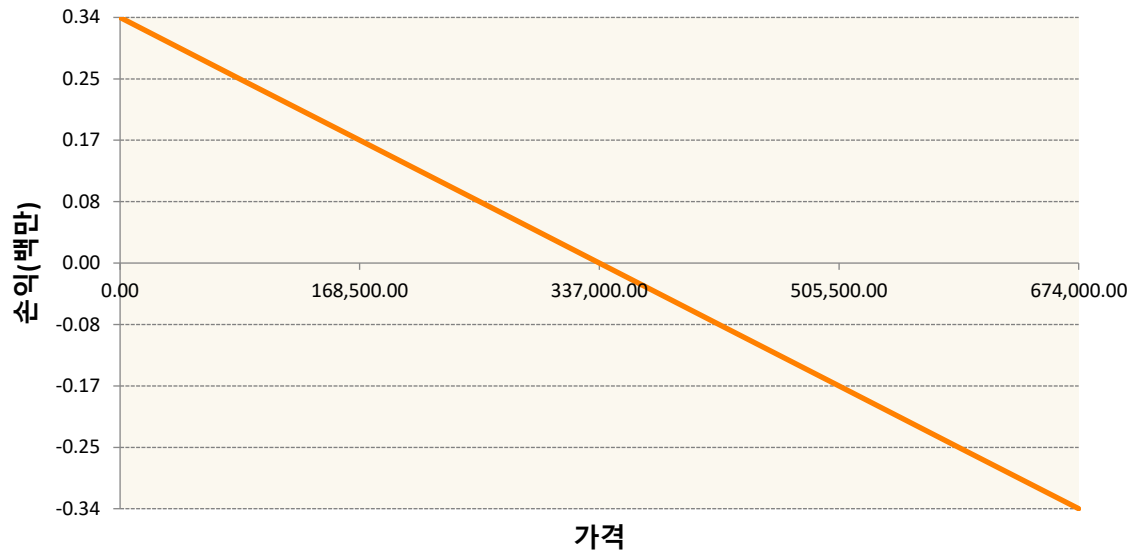
KR4123V30009-2024-03 삼성전기개별선물



KR4154V30004-2024-03 이마트개별선물



KR41CRV30005-2024-03 LG생활건강개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101V300 2024-03 코스피200지수선물	78
KR4106V300 2024-03 코스닥150선물	3
KR4116V300 2024-03 현대차개별선물	2
KR4123V300 2024-03 삼성전기개별선물	0.44
KR4154V300 2024-03 이마트개별선물	1
KR41CRV30C 2024-03 LG생활건강개별선물	0.27

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

(단위:백만원)

82

공시일	2024-02-19
기준일	2024-02-16

코리아인덱스(주식-파생형)(종)

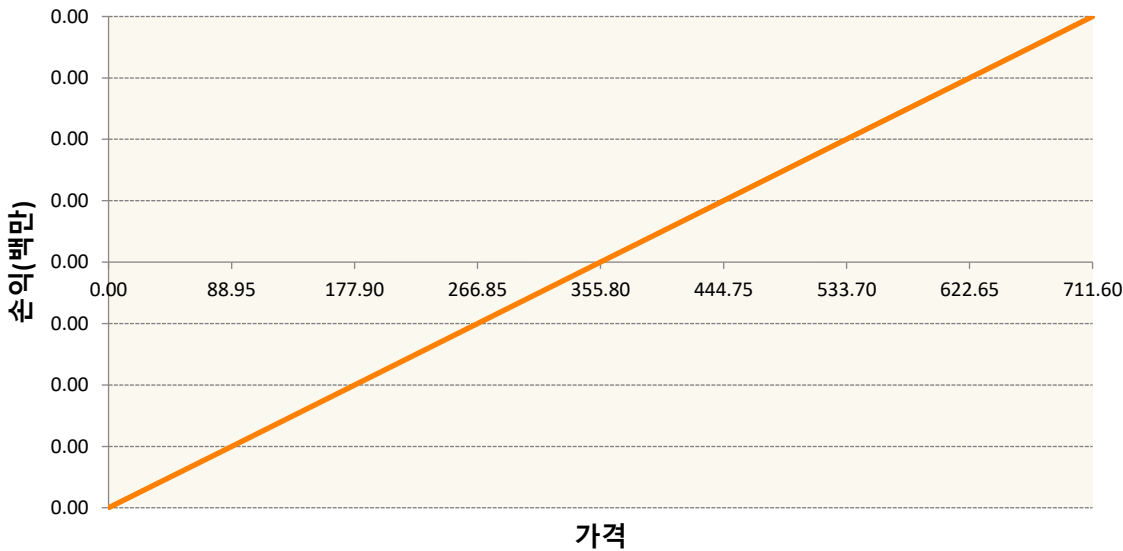
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,380	0	3,380	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101V30005-2024-03 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101V30005		2024-03 코스피200지수선물					270
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-270	-270	-270	-270	-270	-270	-270
-5.33%	-180	-180	-180	-180	-180	-180	-180
-2.67%	-90	-90	-90	-90	-90	-90	-90
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	90	90	90	90	90	90	90
5.33%	180	180	180	180	180	180	180
8.00%	270	270	270	270	270	270	270

공시일	2024-02-19
기준일	2024-02-16

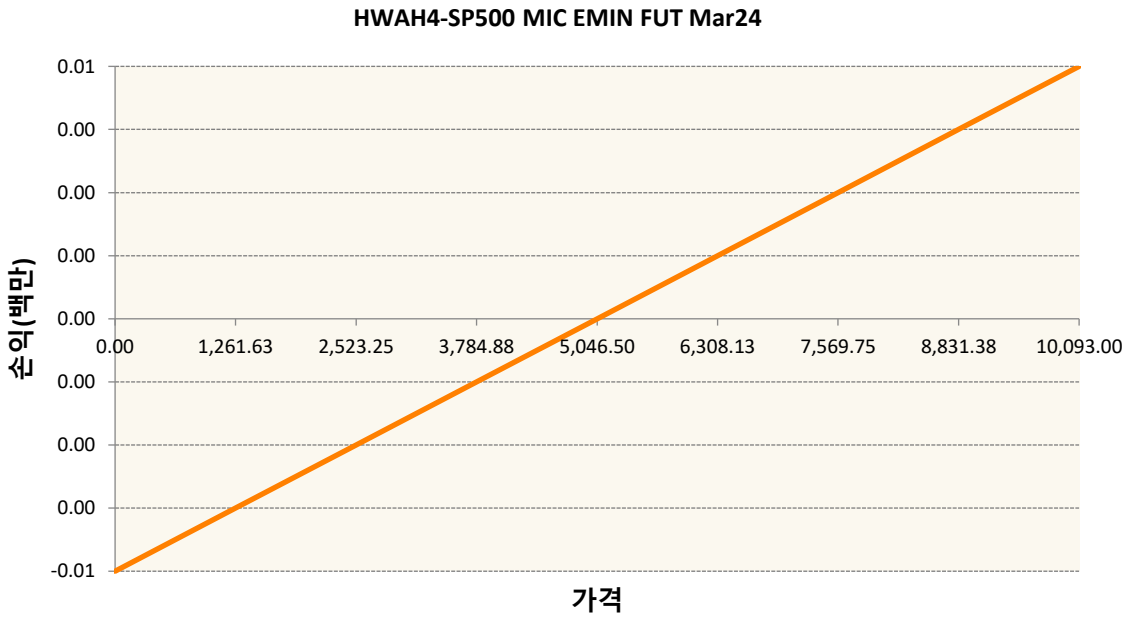
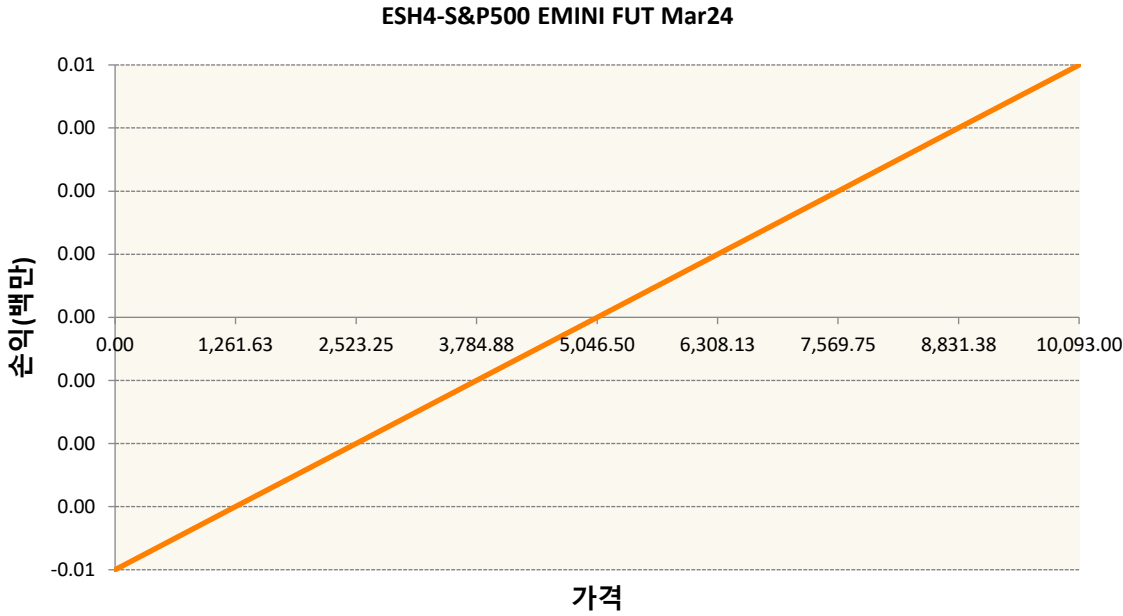
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

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	2,352	0	2,352	
누계	유가증권	선물	2,590	0	2,590	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESH4	S&P500 EMINI FUT Mar24	188
HWAH4	SP500 MIC EMIN FUT Mar24	207

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	310

공시일	2024-02-19
기준일	2024-02-16

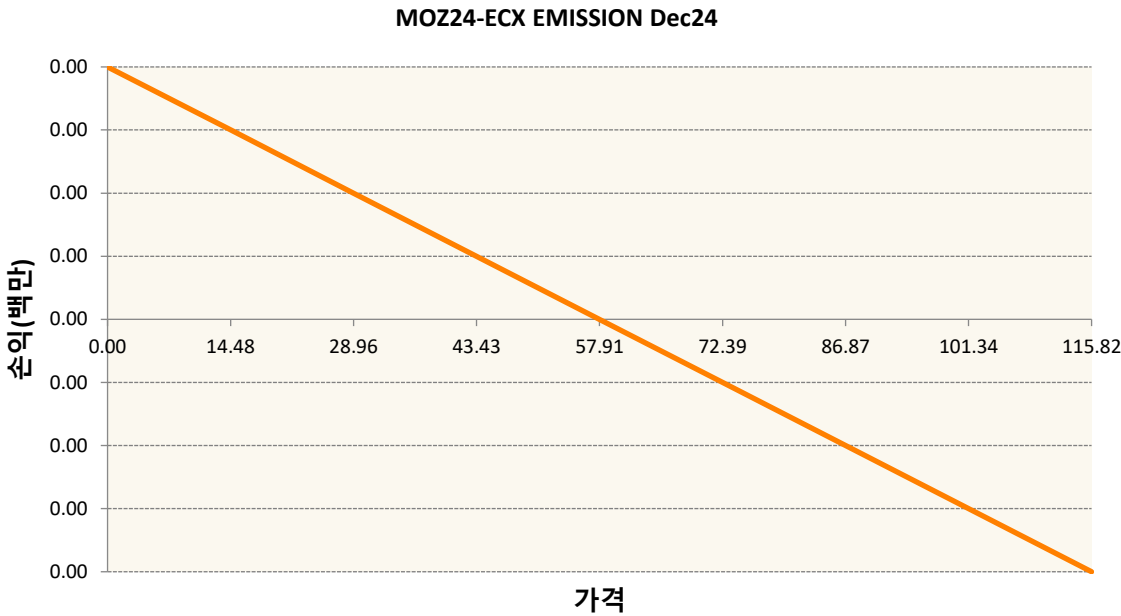
SOL유럽탄소배출권선물인버스ICE특별자산상

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	9,054	-9,054	
누계	지수	스왑	424	0	424	장외
누계	통화	선도	0	1,825	-1,825	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213E1W KRW/EUR 29-02-24E	27
FXW213E1W KRW/EUR 29-02-24E	119
MOZ24 ECX EMISSION Dec24	724
SWICEUACN ICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX	9

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

(단위:백만원)

1,339

공시일	2024-02-19
기준일	2024-02-16

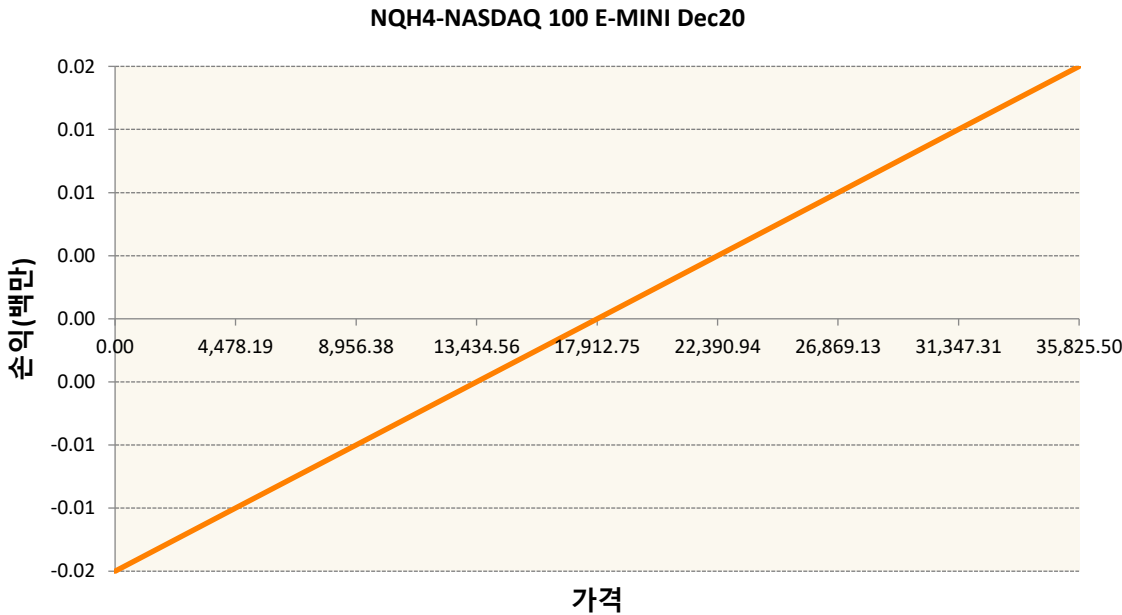
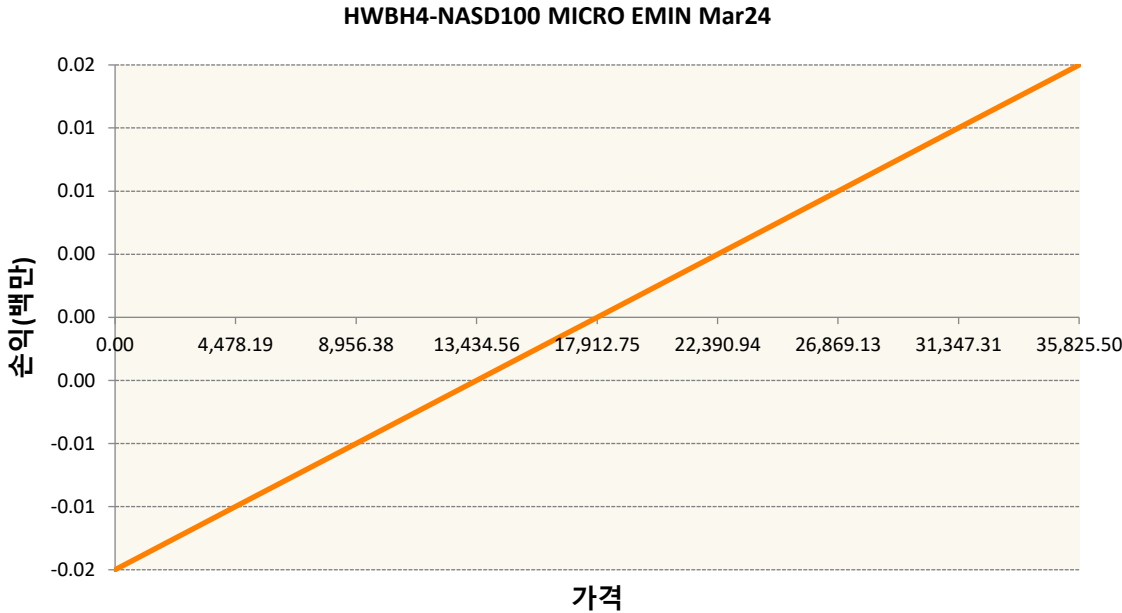
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

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	2,351	0	2,351	
누계	유가증권	선물	3,598	0	3,598	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
HWBH4	NASD100 MICRO EMIN Mar24		288
NQH4	NASDAQ 100 E-MINI Dec20		188

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)			(단위:백만원)
			421

공시일	2024-02-19
기준일	2024-02-16

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	48,190	0	48,190	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWKEDI0000 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	439
SWKEDI0000 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	523
SWKEDI0000 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	2,910

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

(단위:백만원)

2,547

공시일	2024-02-19
기준일	2024-02-16

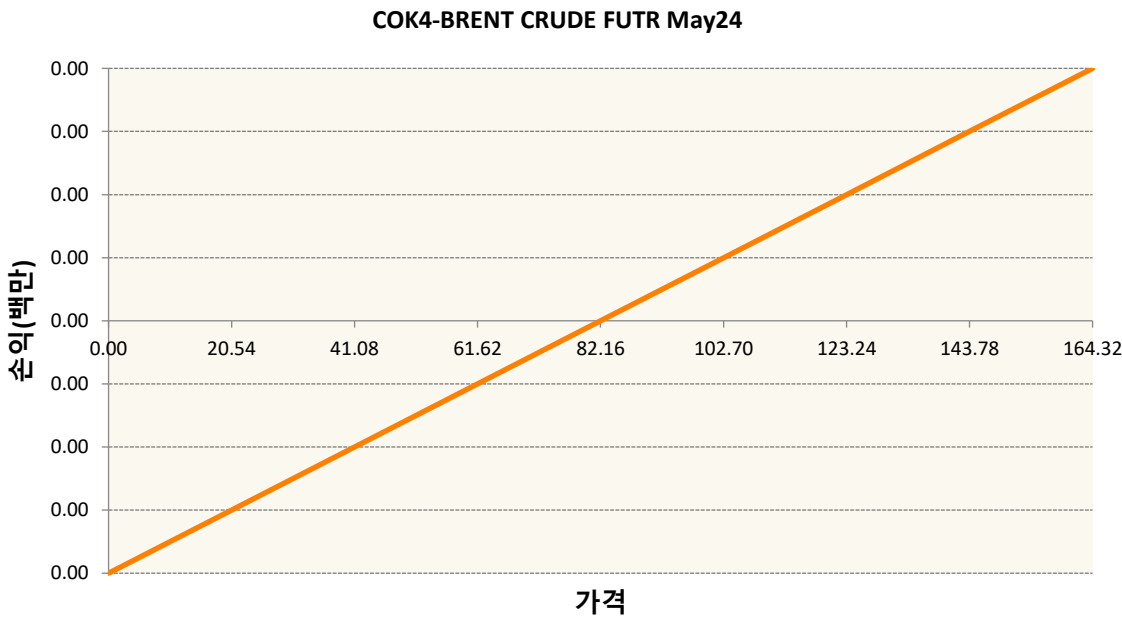
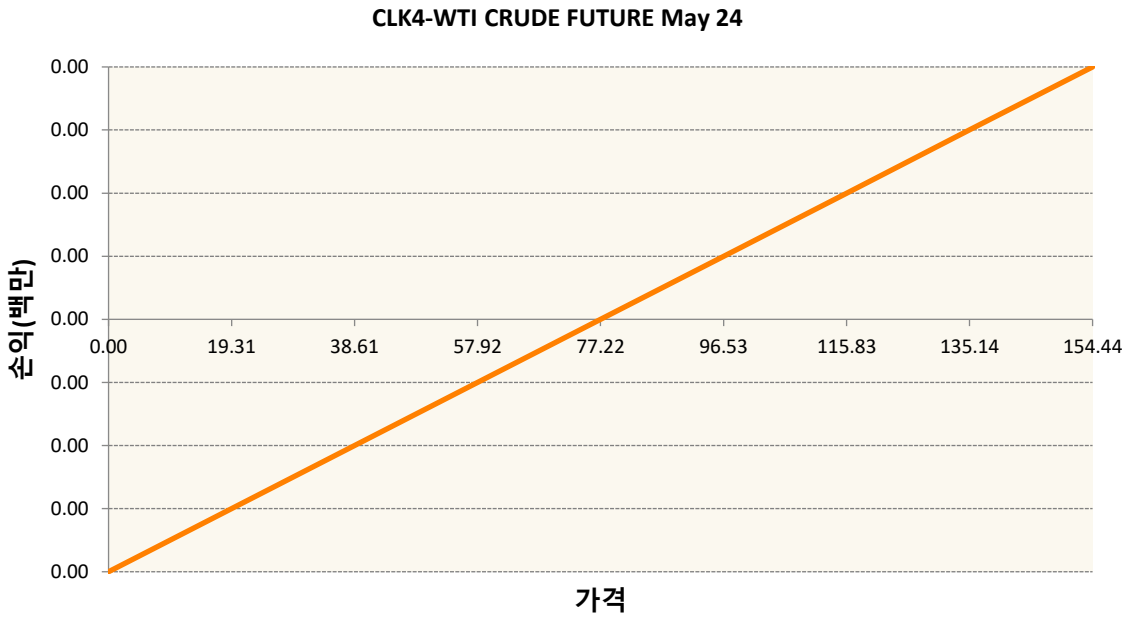
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

1. 계약금액

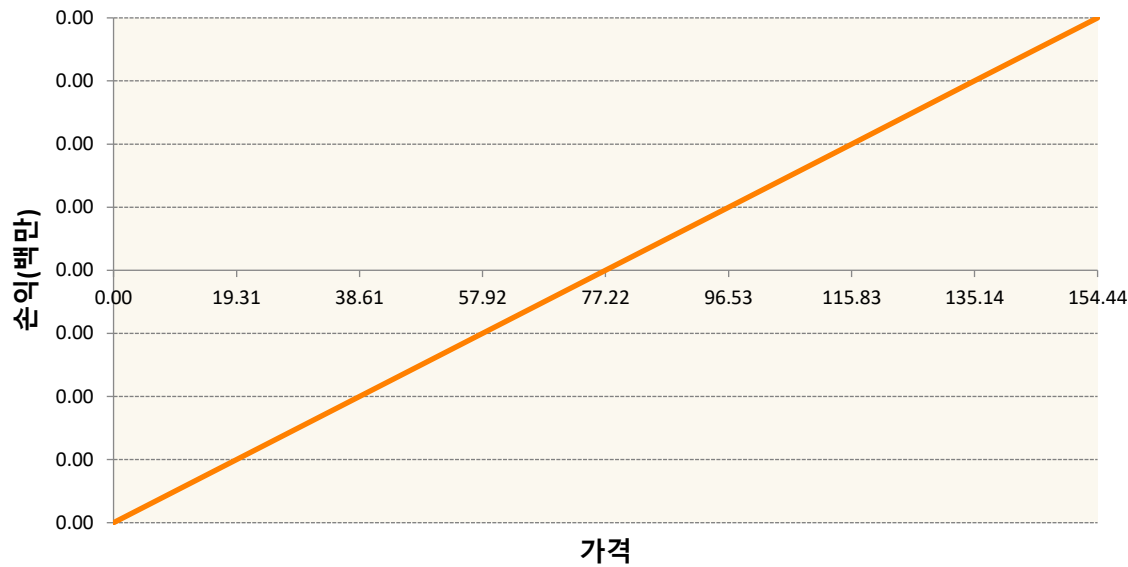
(단위:백만원)

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	1,156	0	1,156	
누계	통화	선물	0	173	-173	장내

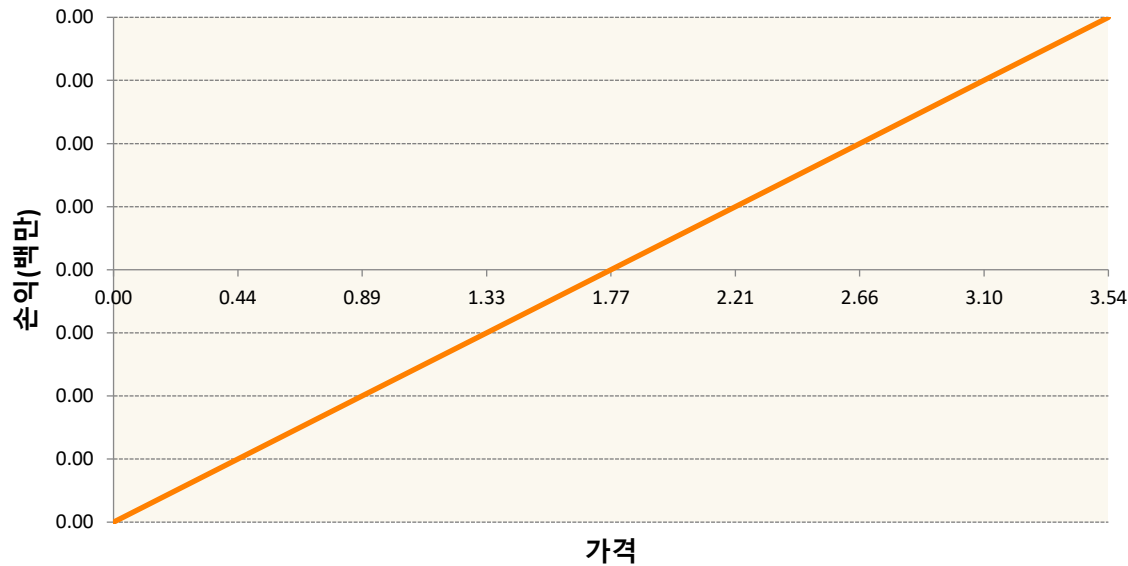
2. 만기시점의 손익구조



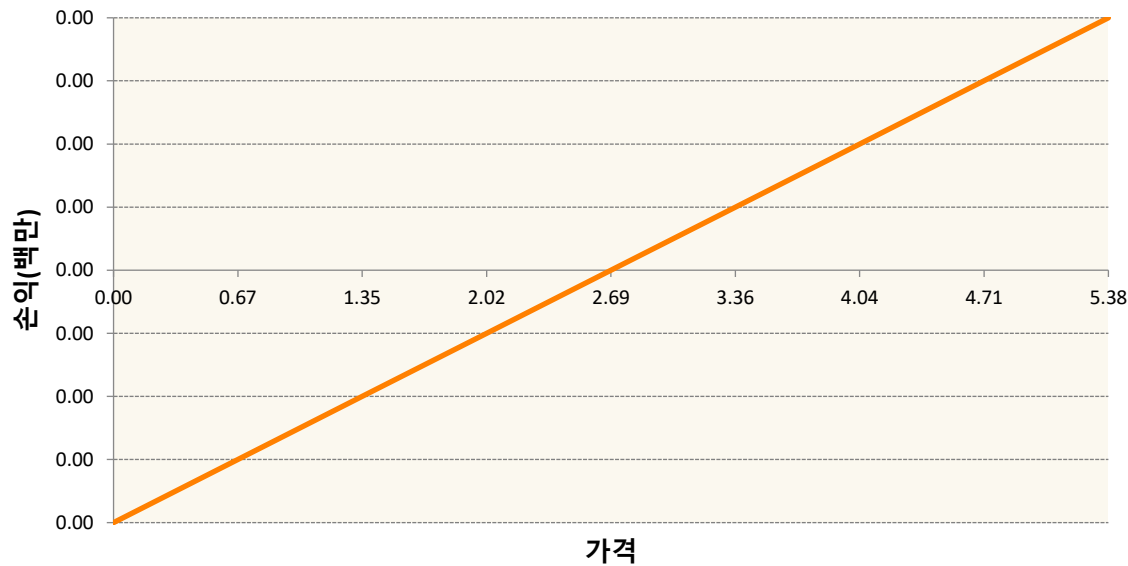
ECK4-E-mini Crude Oil May 24



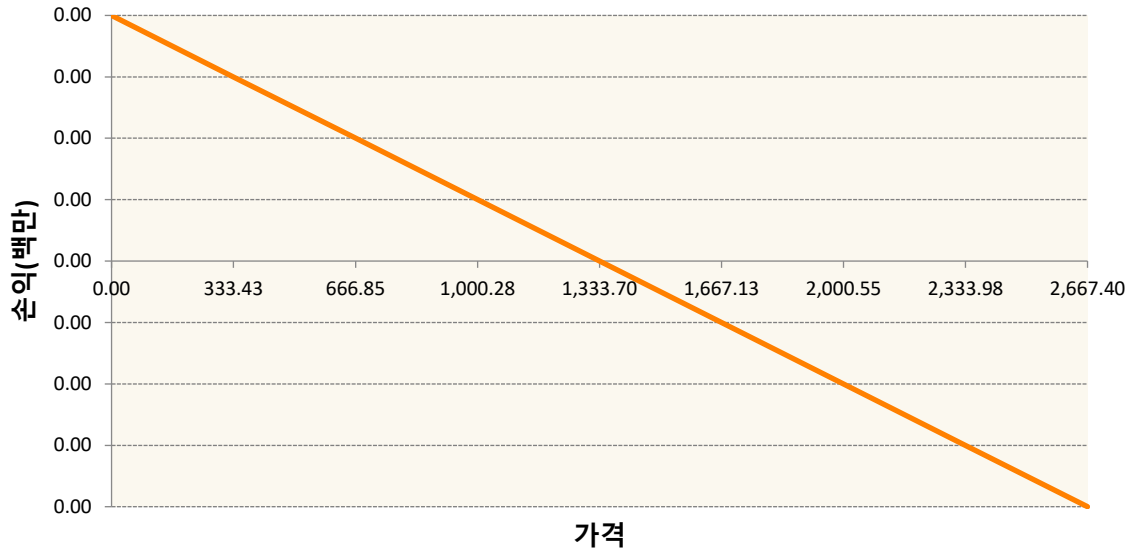
EOK4-E-MINI NATURAL GAS May 24



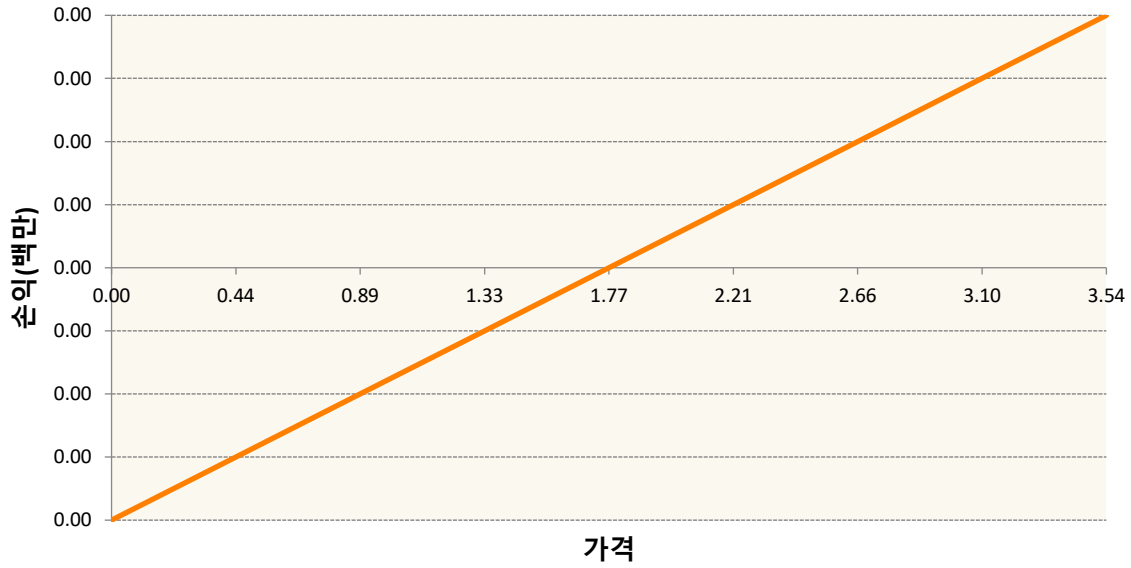
HOK4-NY Harb ULSD Fut May 24



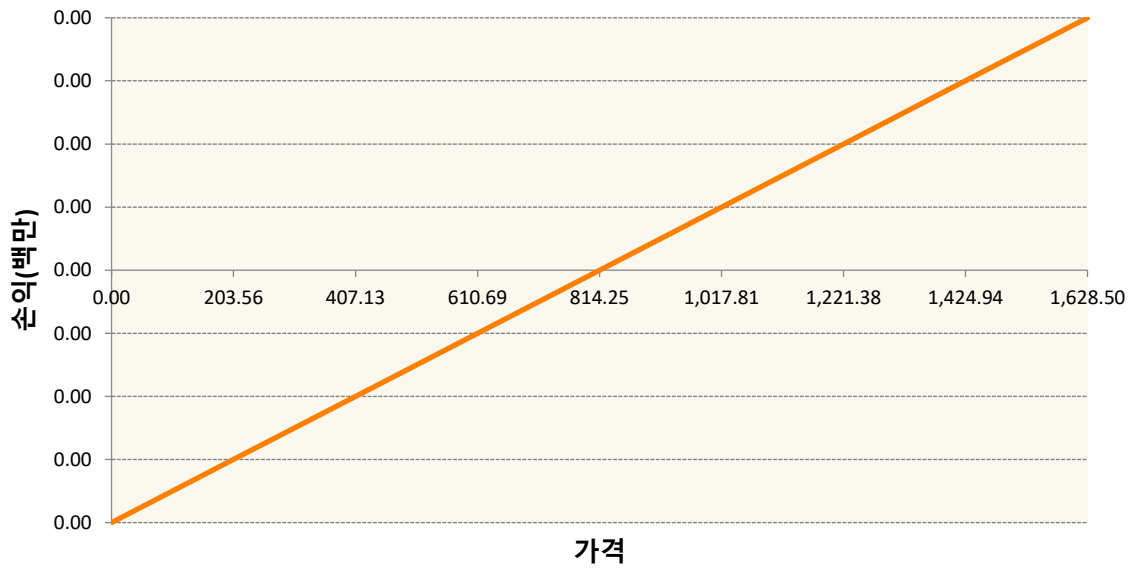
KR4175V30009-2024-03 달러선물

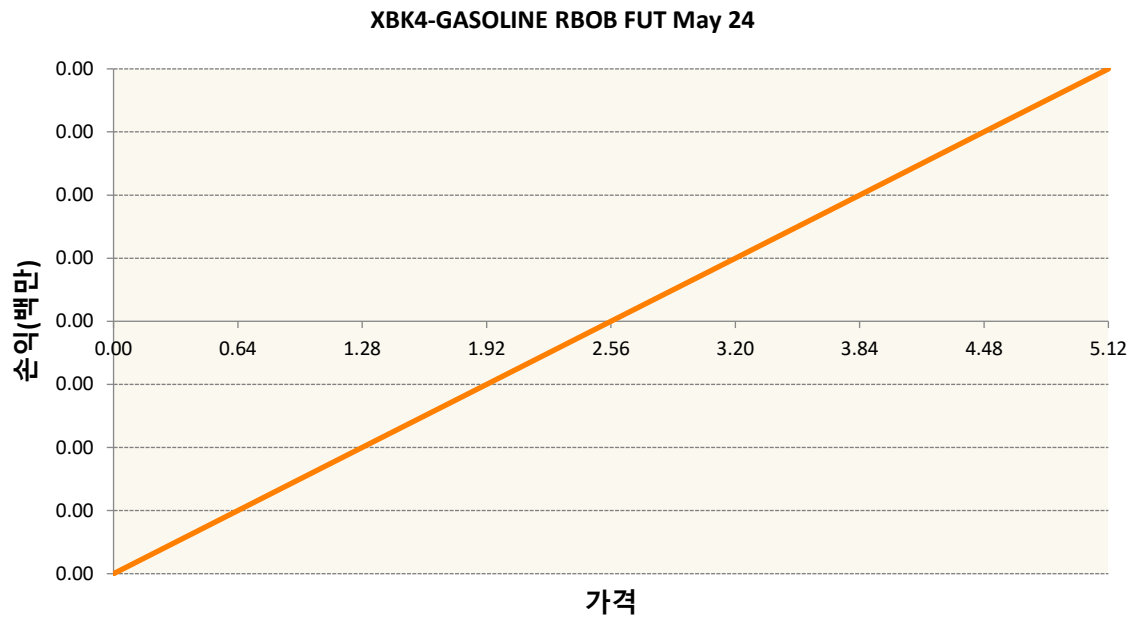


NGK24-NATURAL GAS FUTR May 24



QSK4-Low Su Gasoil G May 24





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
CLK4	WTI CRUDE FUTURE May 24		16
COK4	BRENT CRUDE FUTR May24		26
ECK4	E-mini Crude Oil May 24		4
EOK4	E-MINI NATURAL GAS May 24		0.47
HOK4	NY Harb ULSD Fut May 24		12
KR4175V300 2024-03 달러선물			14
NGK24	NATURAL GAS FUTR May 24		13
QSK4	Low Su Gasoil G May 24		9
XBK4	GASOLINE RBOB FUT May 24		11

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	212