

공시일	2024-02-29
기준일	2024-02-28

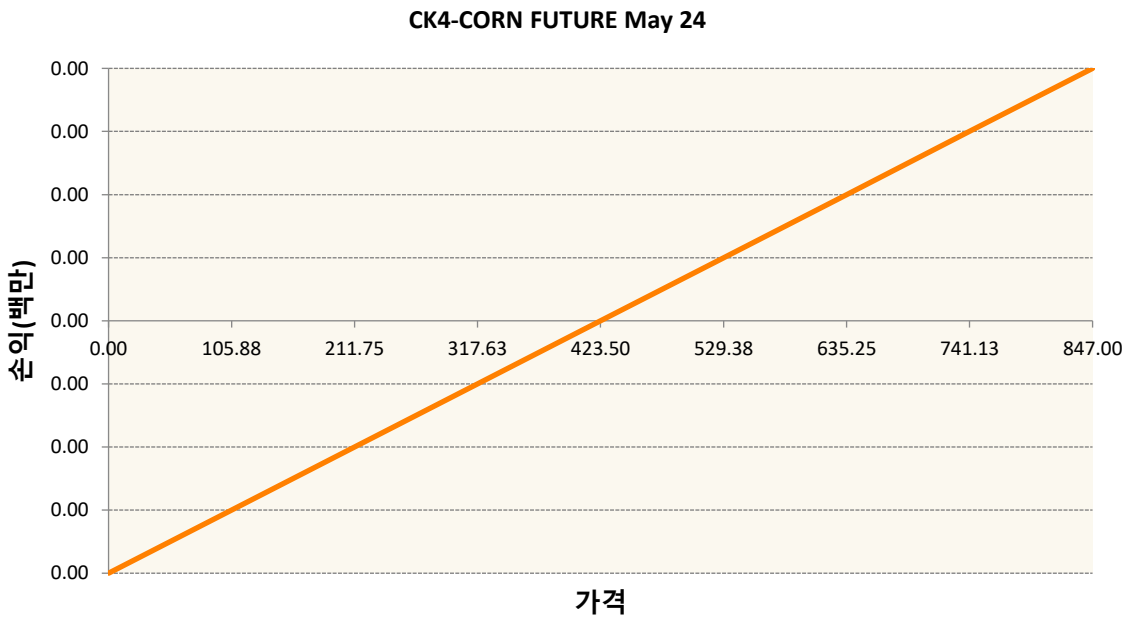
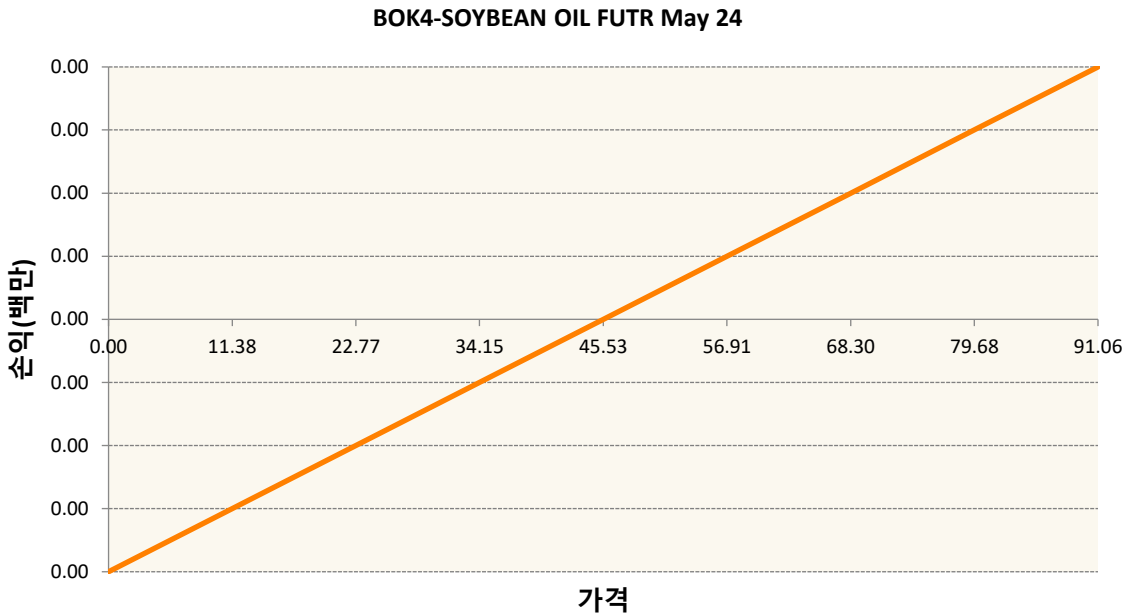
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

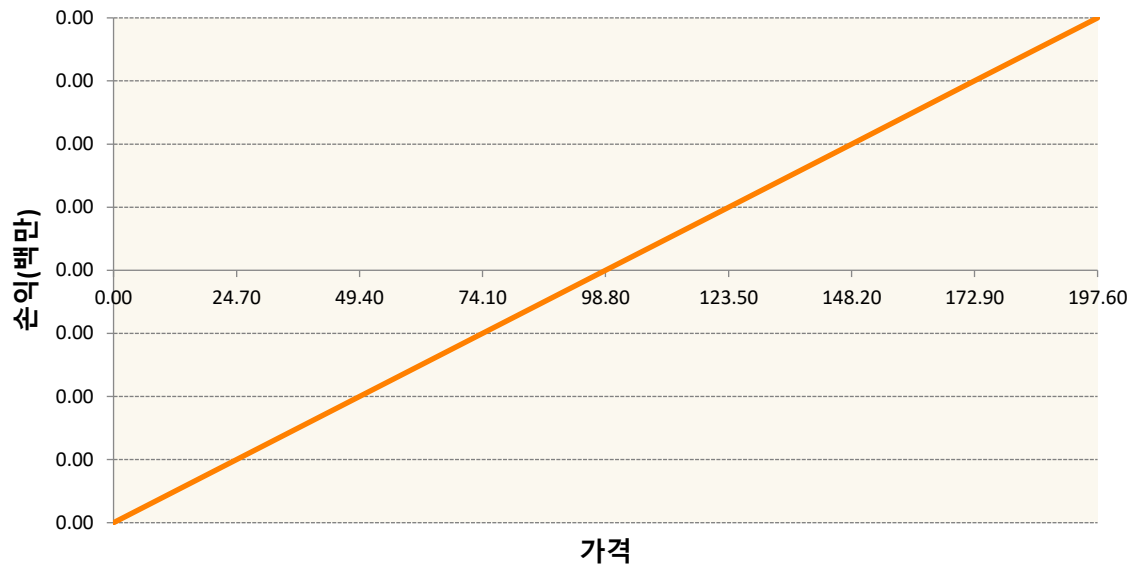
(단위:USD 백만)

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	4,336	0	4,336	
누계	통화	선물	0	427	-427	장내

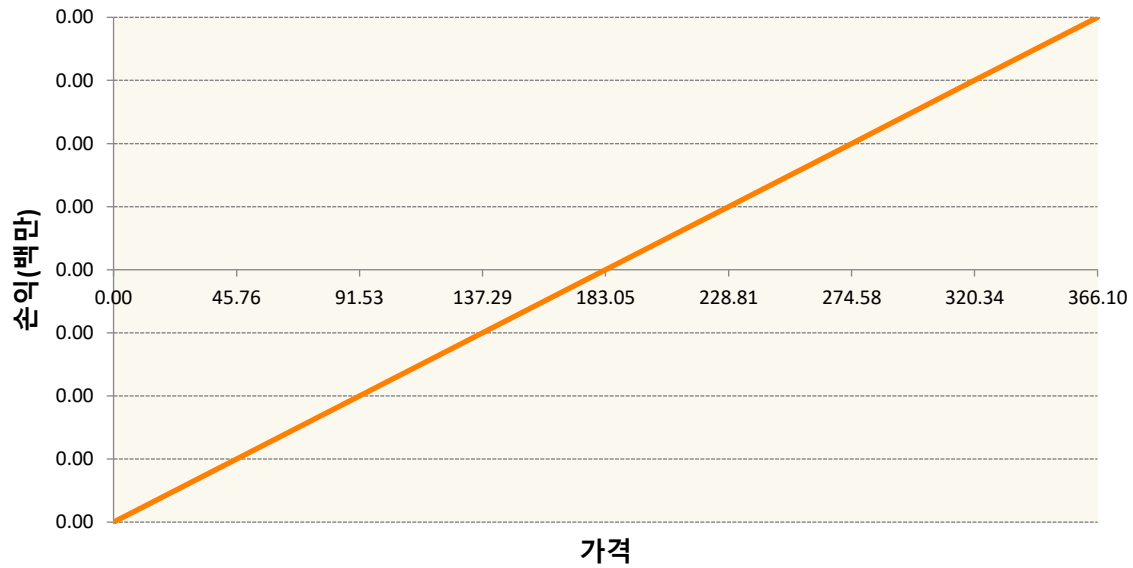
2. 만기시점의 손익구조



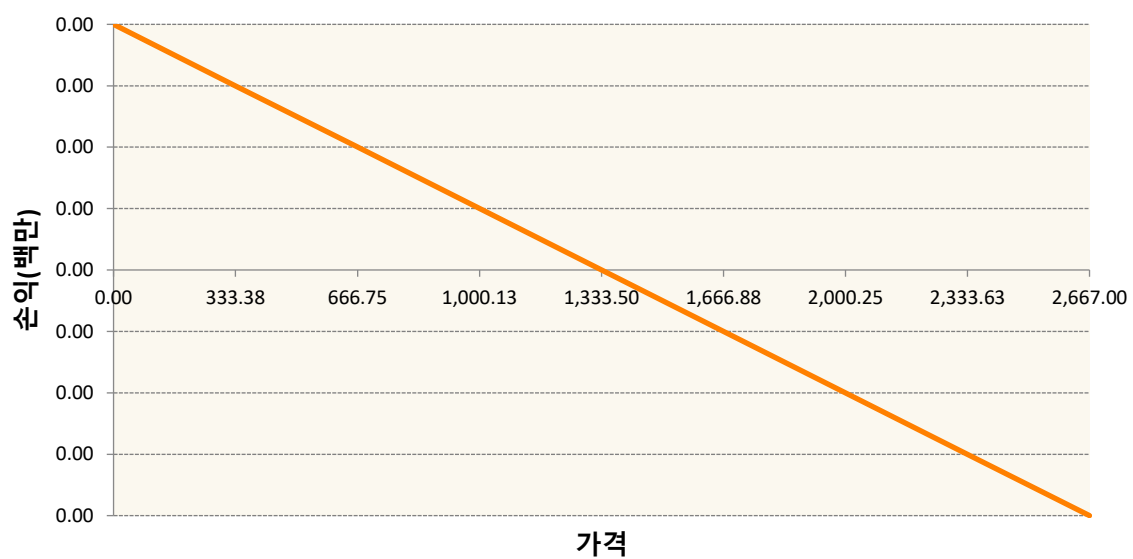
CTK4-COTTON NO.2 FUTR May 24



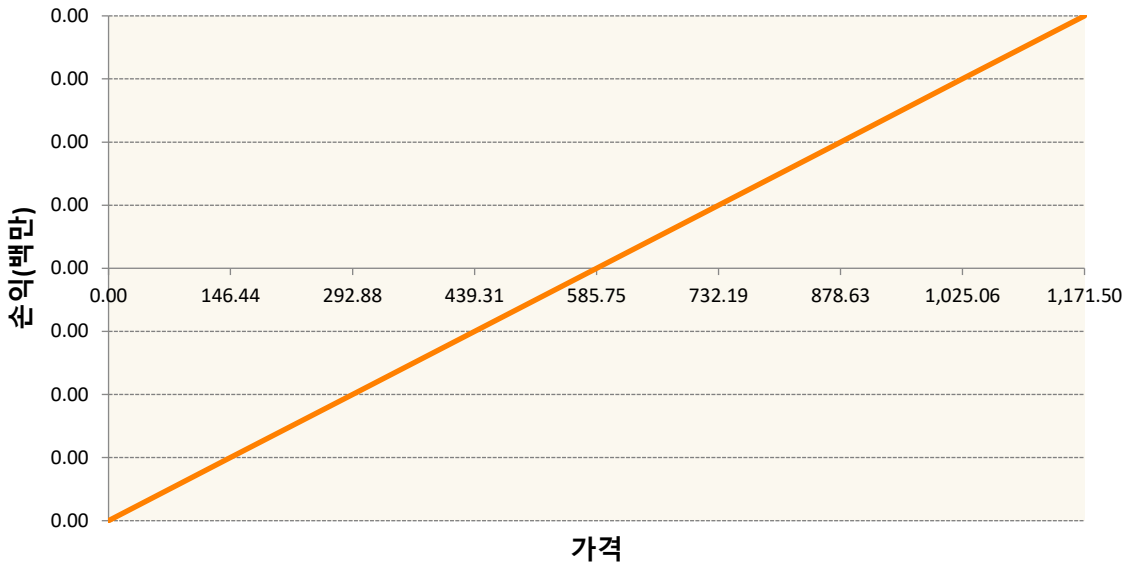
KCK4-COFFEE 'C' FUTURE May 24



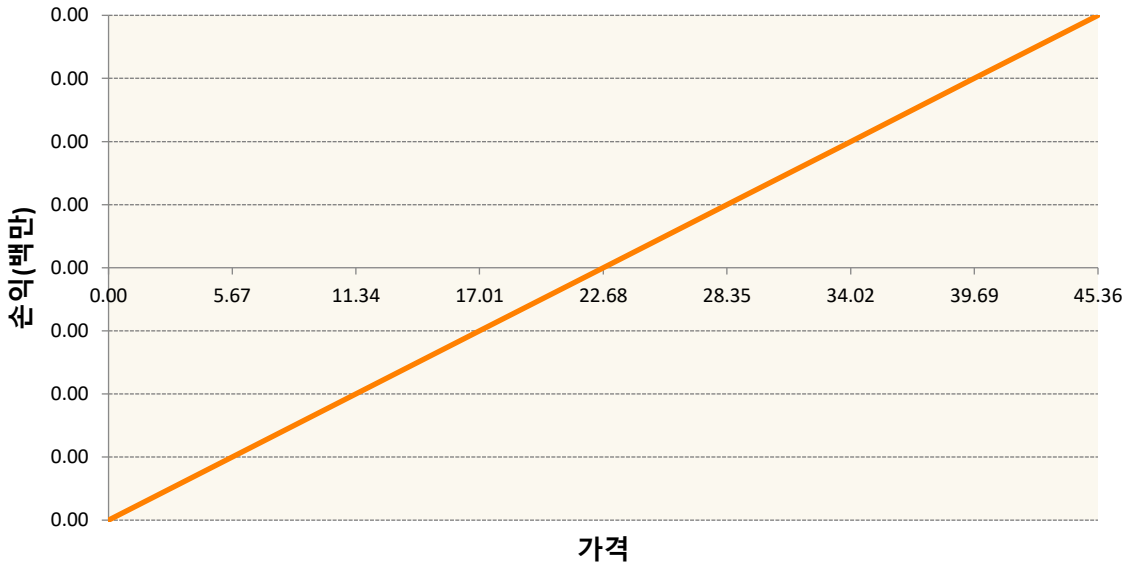
KR4175V30009-2024-03 달러선물



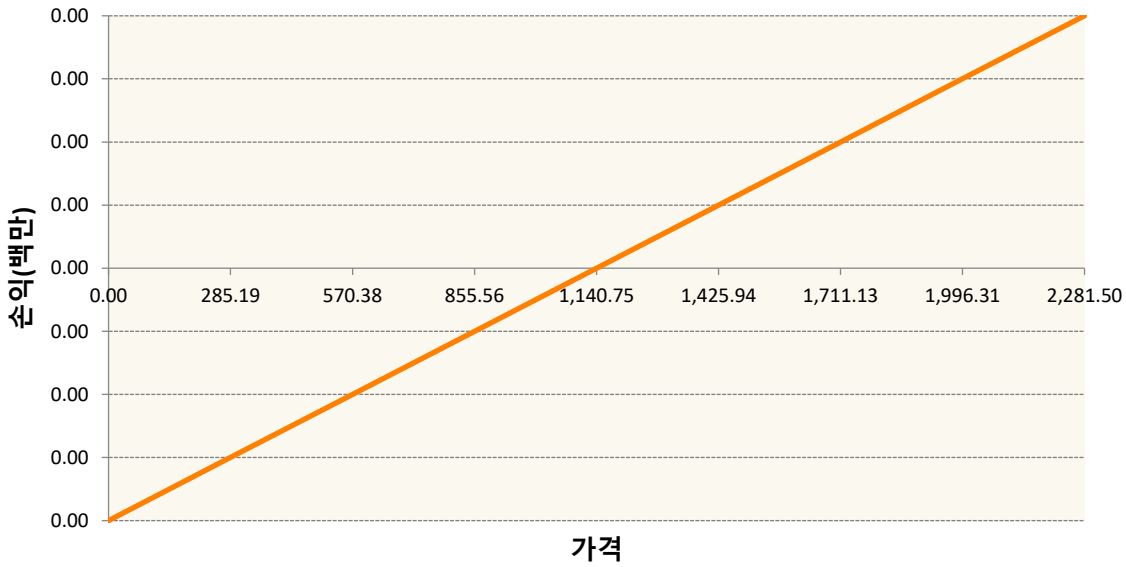
KWK4-KC HRW WHEAT FUT May 24



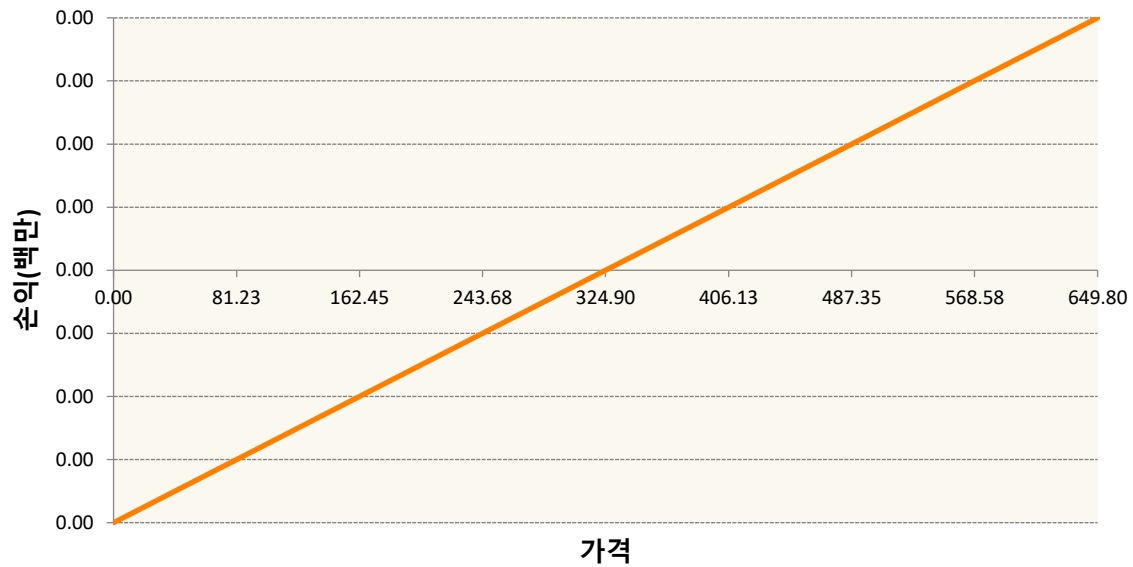
SBK4-Sugar #11 (WORLD) May 24



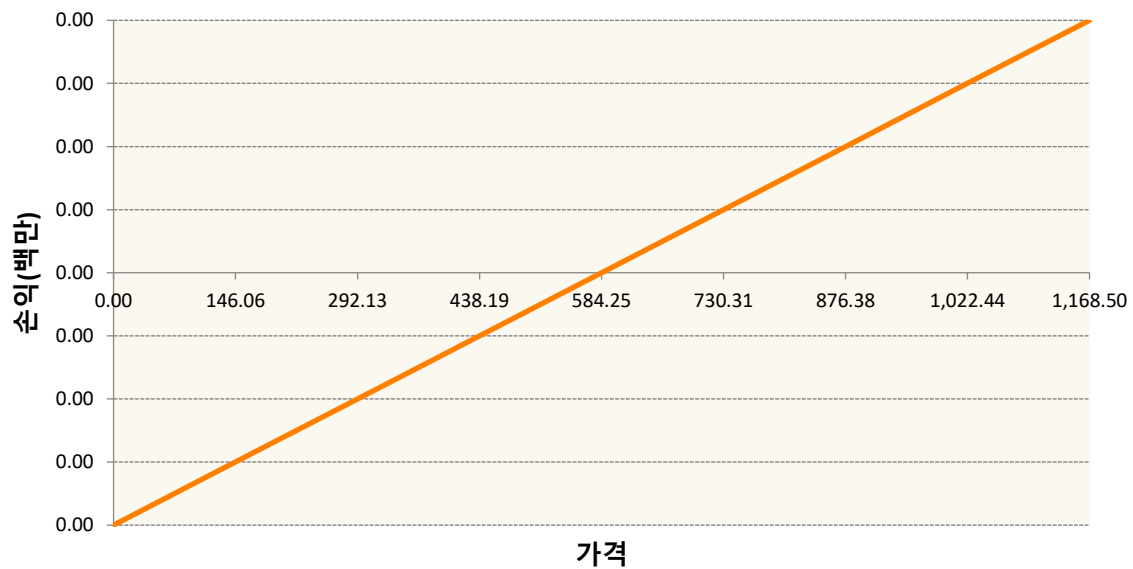
SK4-SOYBEAN FUTURE May 24



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	2024-02-29
기준일	2024-02-28

스마트인덱스모

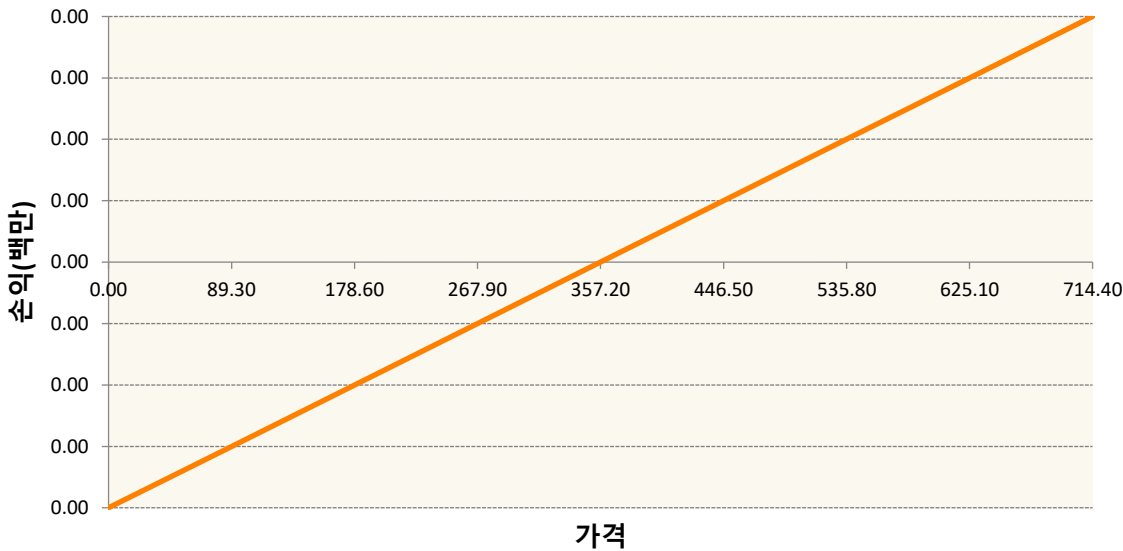
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,161	0	1,161	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101V30005-2024-03 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101V30005		2024-03 코스피200지수선물					93
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-93	-93	-93	-93	-93	-93	-93
-5.33%	-62	-62	-62	-62	-62	-62	-62
-2.67%	-31	-31	-31	-31	-31	-31	-31
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	31	31	31	31	31	31	31
5.33%	62	62	62	62	62	62	62
8.00%	93	93	93	93	93	93	93

공시일	2024-02-29
기준일	2024-02-28

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	265
-----------------------------	-----

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

302

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2024-02-29
기준일	2024-02-28

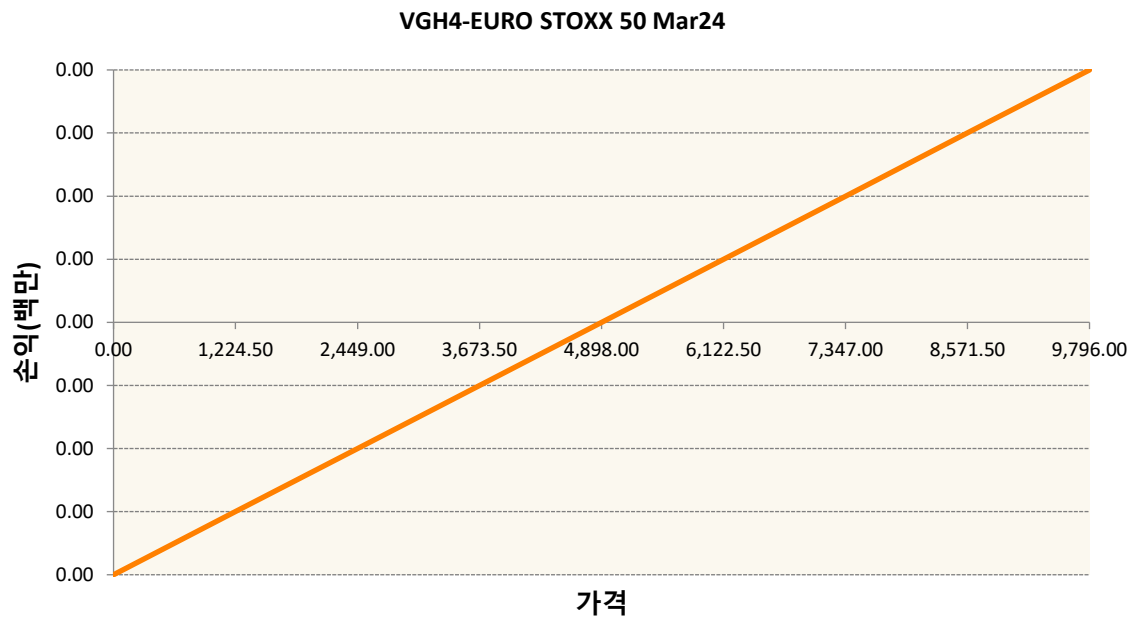
유로인덱스모(주식-파생형)

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	1,047	0	1,047	
누계	통화	선도	217	0	217	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213DCL	EUR/KRW 22-03-24E	17
VGH4	EURO STOXX 50 Mar24	84

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

(단위:백만원)

72

공시일	2024-02-29
기준일	2024-02-28

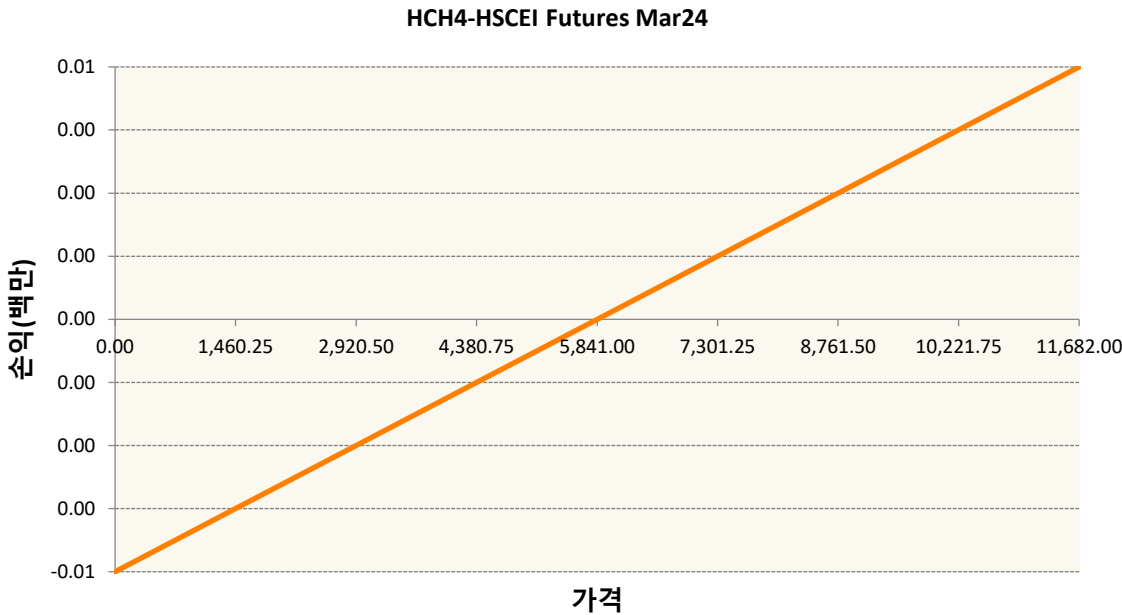
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,143	0	1,143	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCH4	HSCEI Futures Mar24	91
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

133

공시일	2024-02-29
기준일	2024-02-28

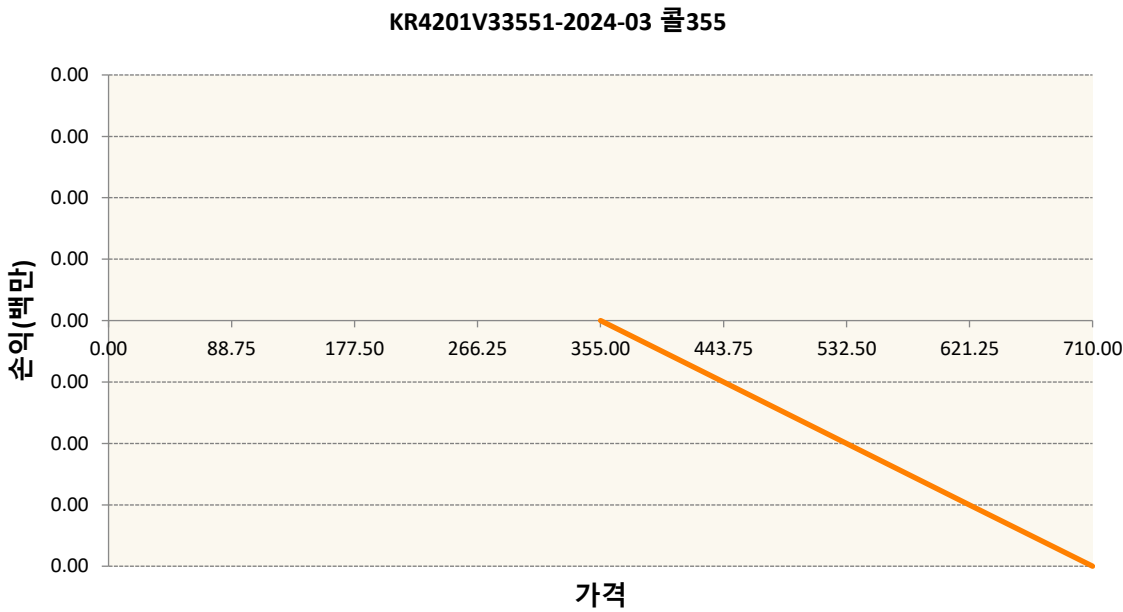
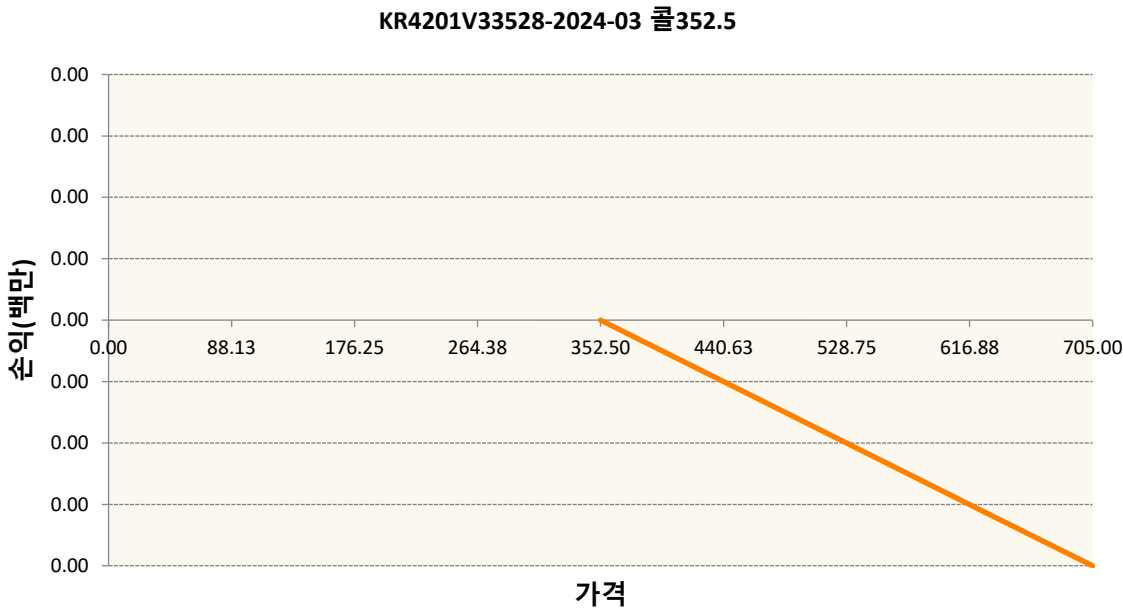
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

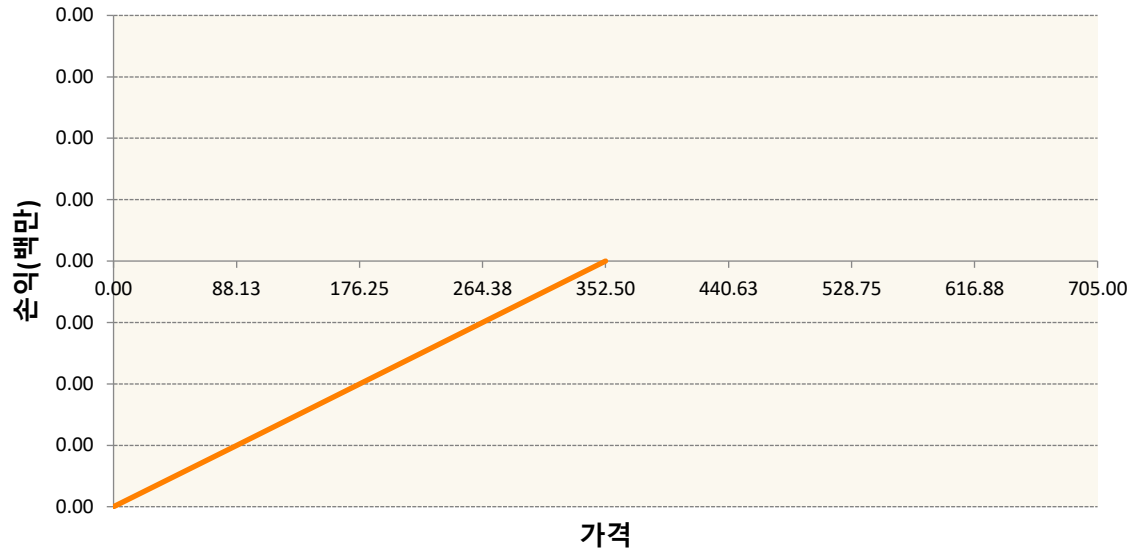
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	48,928	-48,928	장내

2. 만기시점의 손익구조



KR4301V33526-2024-03 풋352.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201V33528			2024-03 콜352.5				1,681
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	708	696	681	662	641	618	593
-5.33%	644	615	584	552	517	482	445
-2.67%	469	426	382	339	295	250	206
0%	133	89	45	0	-45	-90	-135
2.67%	-360	-391	-425	-460	-497	-535	-575
5.33%	-957	-973	-993	-1,015	-1,040	-1,068	-1,097
8.00%	-1,604	-1,610	-1,619	-1,630	-1,644	-1,661	-1,681
KR4201V33551			2024-03 콜355				988
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	375	370	362	353	342	330	316
-5.33%	347	332	315	298	279	258	238
-2.67%	261	236	211	186	160	134	107
0%	84	56	28	0	-28	-56	-84
2.67%	-193	-215	-238	-261	-286	-311	-336
5.33%	-543	-555	-569	-585	-603	-622	-642
8.00%	-931	-936	-943	-951	-962	-974	-988
KR4301V33526			2024-03 풋352.5				545
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-538	-539	-539	-540	-541	-543	-545
-5.33%	-300	-303	-307	-311	-316	-322	-327
-2.67%	-94	-103	-112	-121	-130	-140	-149
0%	28	19	9	0	-10	-19	-29

2.67%	67	63	59	54	48	42	36
5.33%	72	72	71	69	68	65	62
8.00%	73	73	73	72	72	71	70

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

(단위:백만원)

3,318

공시일	2024-02-29
기준일	2024-02-28

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	1,792	0	1,792	

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	2024-02-29
기준일	2024-02-28

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	4,409	0	4,409	

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	2024-02-29
기준일	2024-02-28

H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	173	-173	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	15,860	0	15,860	
누계	통화	선도	1,334	24,972	-23,638	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213DBV KRW/USD 29-02-24E	655
FXW213DCT KRW/USD 29-03-24E	517
FXW213E1W KRW/USD 30-04-24E	249
FXW213E28C USD/KRW 29-02-24E	21
FXW213E2L0 USD/KRW 29-03-24E	85
FXW213E2TC KRW/USD 31-05-24E	576
IE00BD8RGM75	

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

1,049

공시일	2024-02-29
기준일	2024-02-28

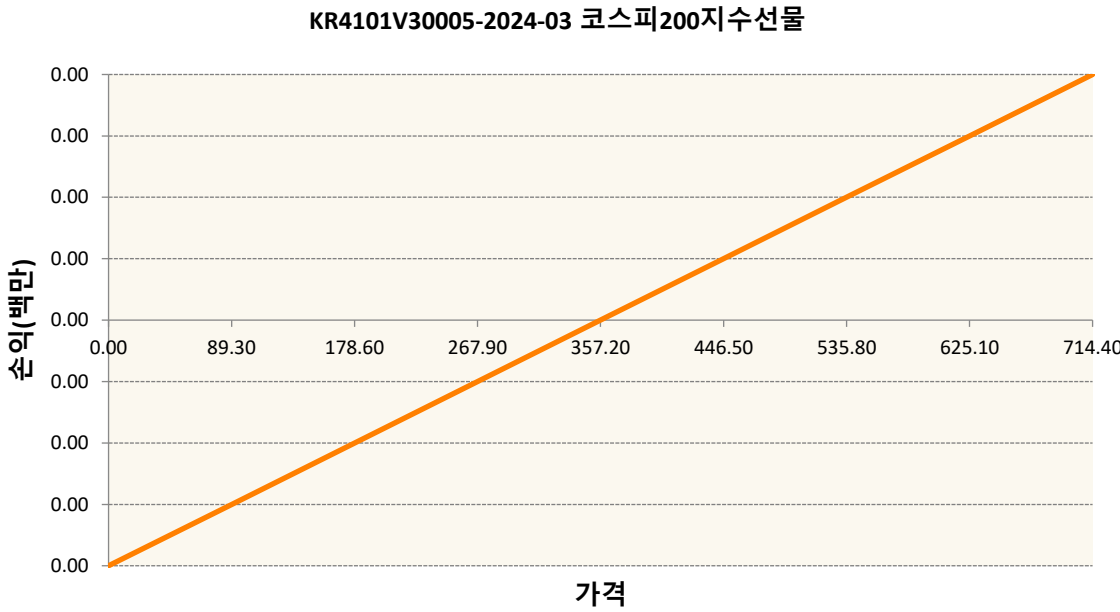
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

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	357	0	357	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101V30005			2024-03 코스피200지수선물				29
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-29	-29	-29	-29	-29	-29	-29
-5.33%	-19	-19	-19	-19	-19	-19	-19
-2.67%	-10	-10	-10	-10	-10	-10	-10
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	10	10	10	10	10	10	10
5.33%	19	19	19	19	19	19	19
8.00%	29	29	29	29	29	29	29

공시일	2024-02-29
기준일	2024-02-28

SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

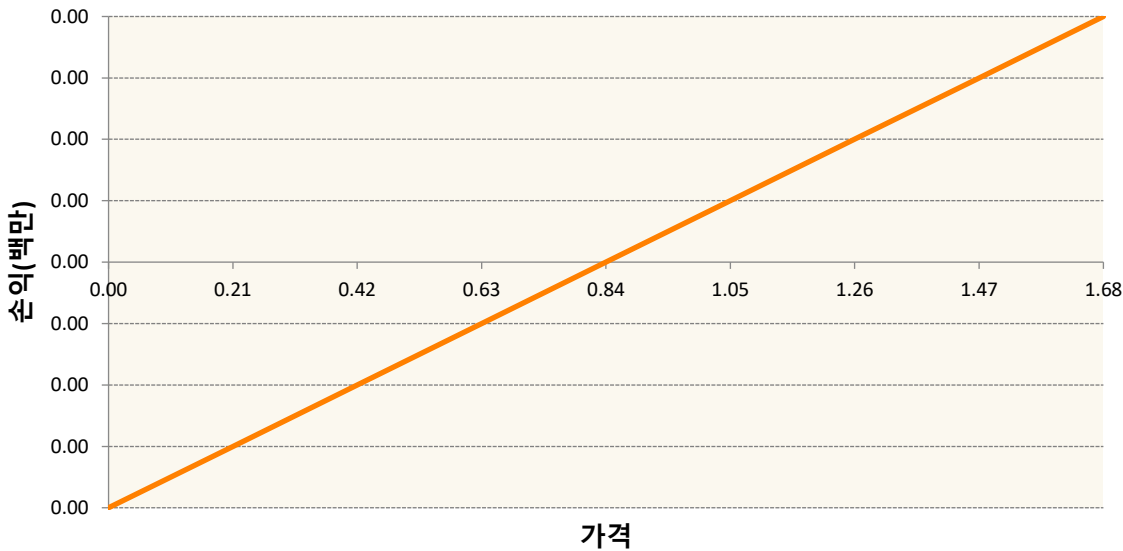
1. 계약금액

(단위:백만원)

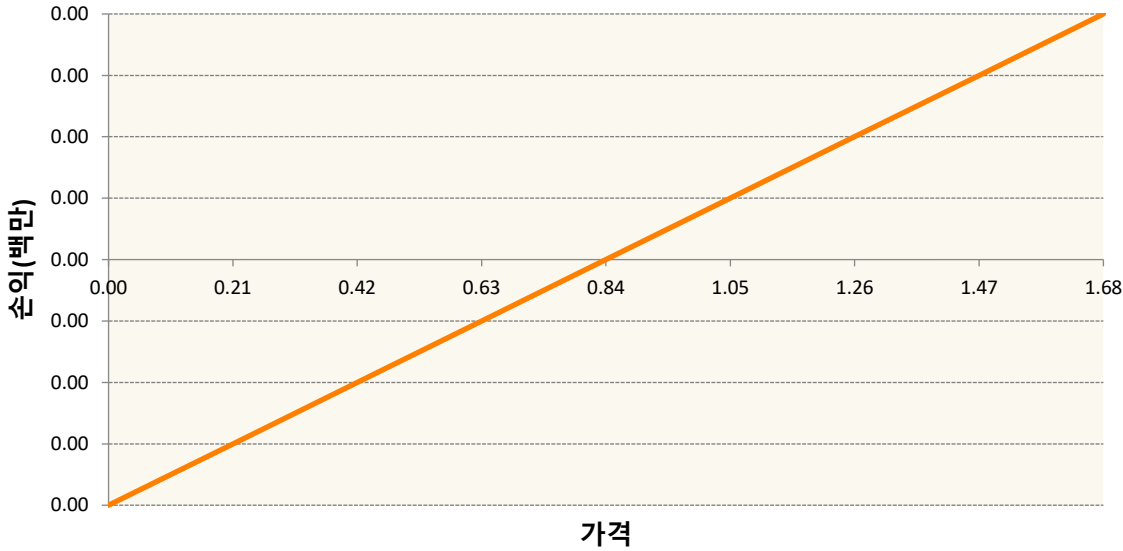
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	17,717	0	17,717	

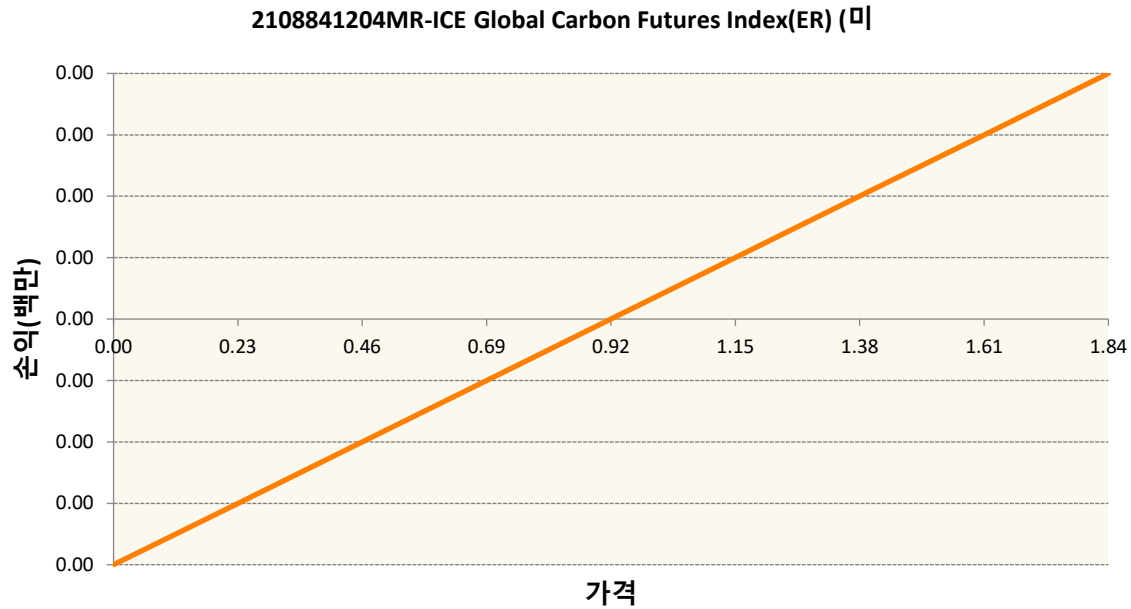
2. 만기시점의 손익구조

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		833
2108840920ICE Global Carbon Futures Index(ER) (메		167
2108841204ICE Global Carbon Futures Index(ER) (미		416

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)		(단위:백만원)
		1,672

공시일	2024-02-29
기준일	2024-02-28

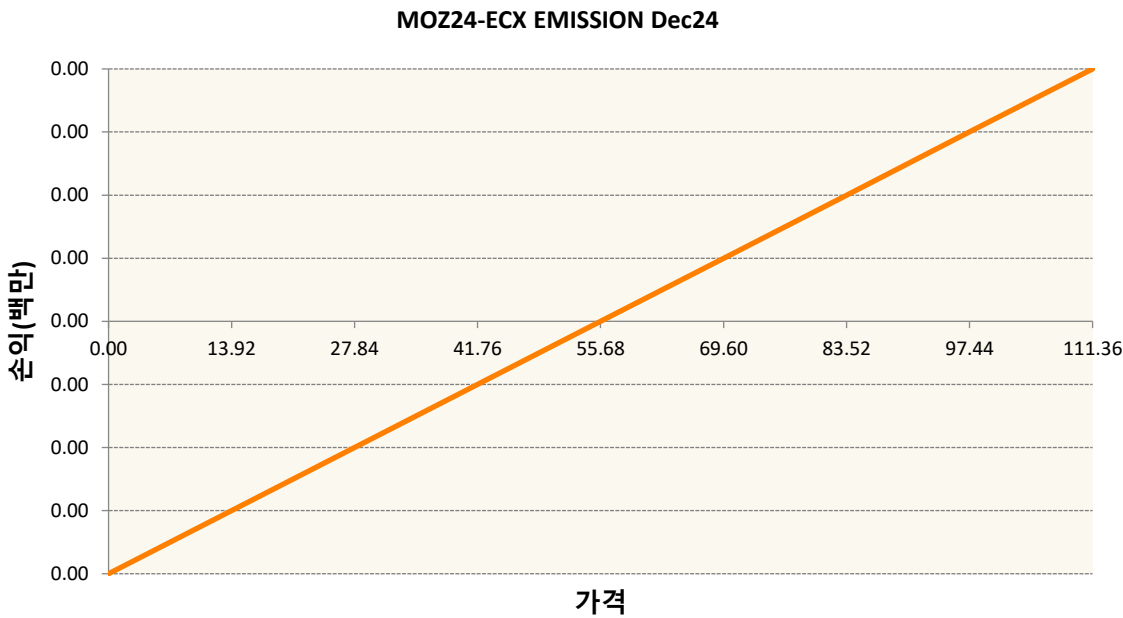
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	7,585	0	7,585	
누계	지수	스왑	424	0	424	장외
누계	통화	선도	0	4,243	-4,243	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213E1W KRW/EUR 29-02-24E	14
FXW213E1W KRW/EUR 29-02-24E	147
FXW213E2TC KRW/EUR 28-03-24E	179
MOZ24 ECX EMISSION Dec24	607
SWICEUACN ICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX	10

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

(단위:백만원)

1,279

공시일	2024-02-29
기준일	2024-02-28

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)	5
SWCSI00000 신한CSI Index 230622 (메리츠)	5
SWCSI00000 신한CSI Index 230922 (키움)	3
SWCSI00000 신한CSI Index 231013 (NH)	3

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

(단위:백만원)

25

공시일	2024-02-29
기준일	2024-02-28

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)	8
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(NH)	7
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(메리츠)	10
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(키움)	2

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

(단위:백만원)

29

공시일	2024-02-29
기준일	2024-02-28

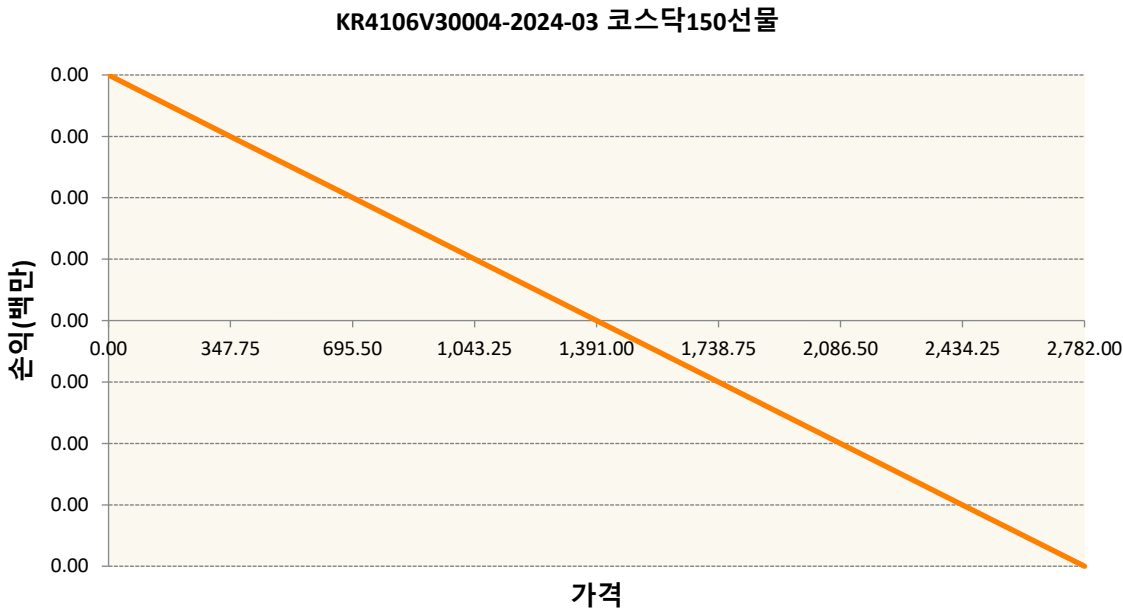
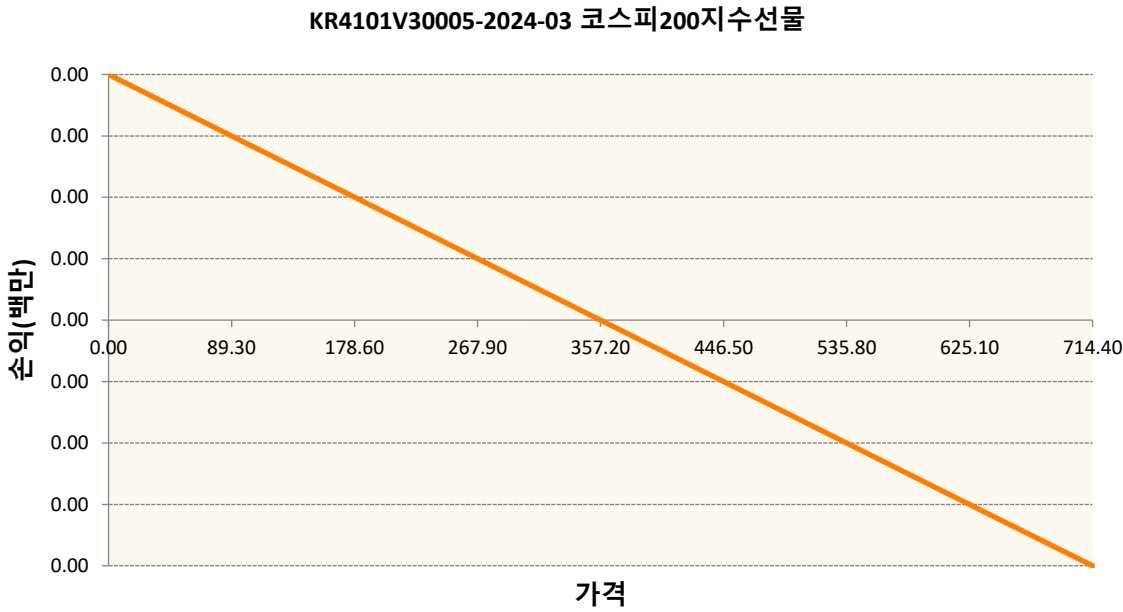
에퀴티알파일반사모혼합자산

1. 계약금액

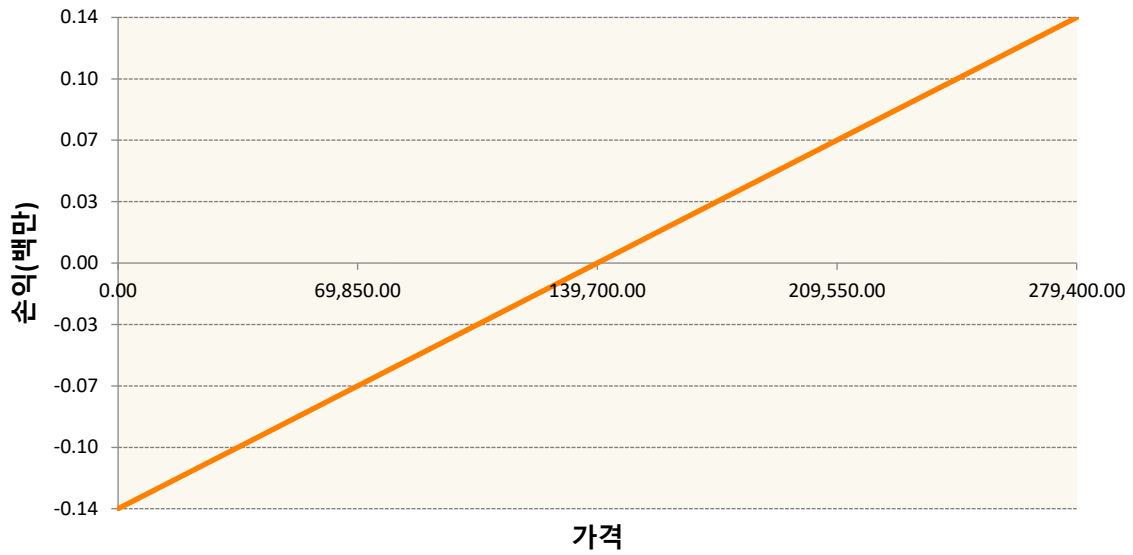
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	21	8	12	장내
누계	유가증권	선물	143	1,036	-893	장내

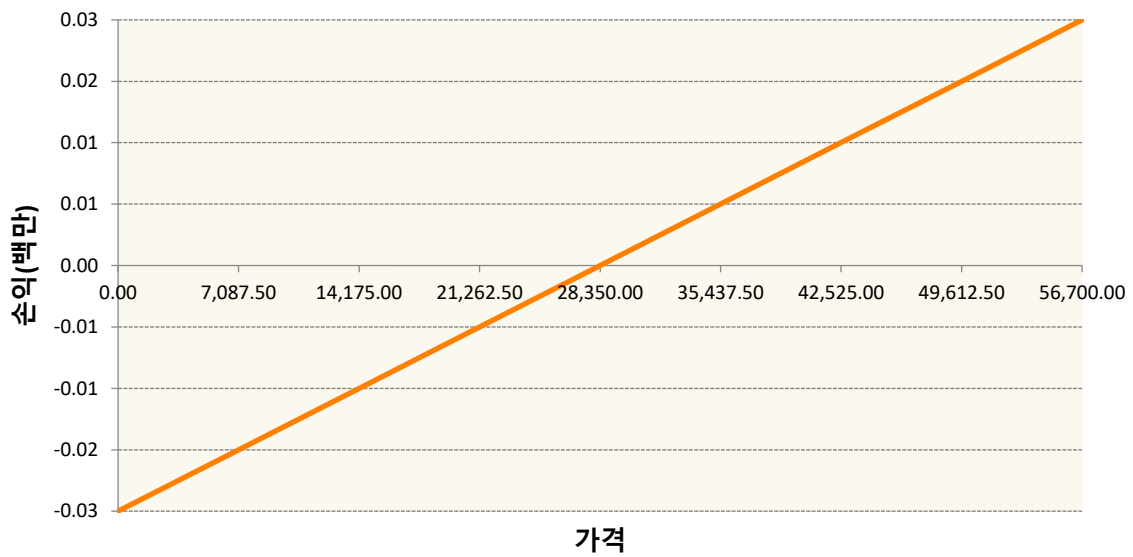
2. 만기시점의 손익구조



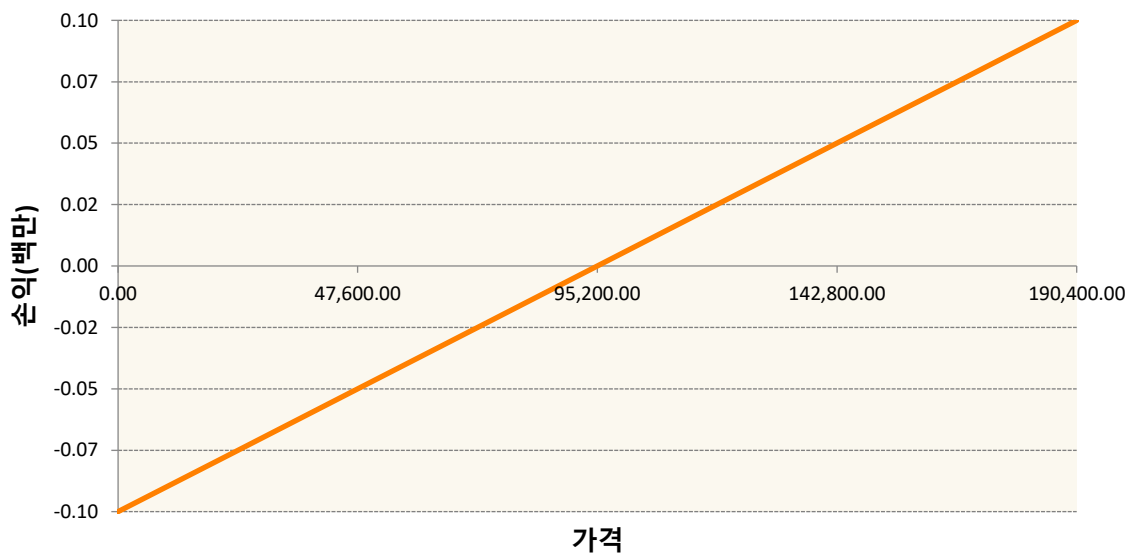
KR4123V30009-2024-03 삼성전기개별선물



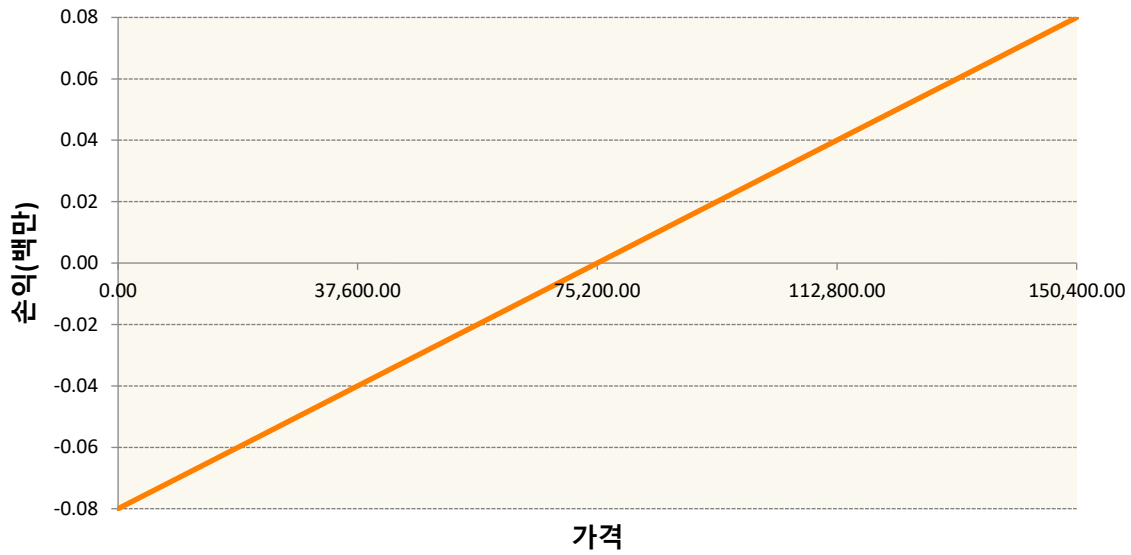
KR4128V30008-2024-03 한국가스공사개별선물



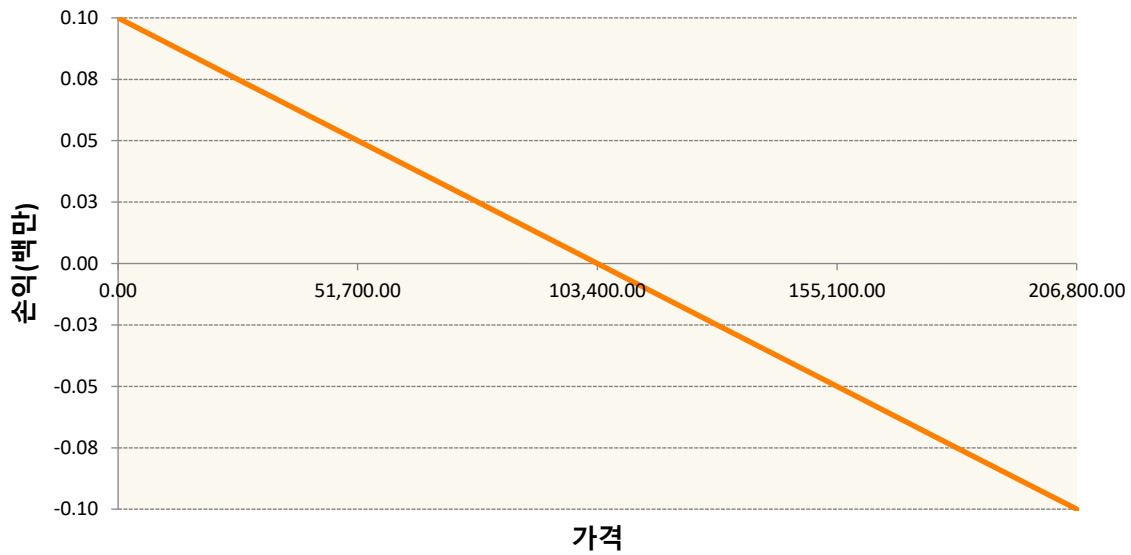
KR4134V30006-2024-03 LG개별선물



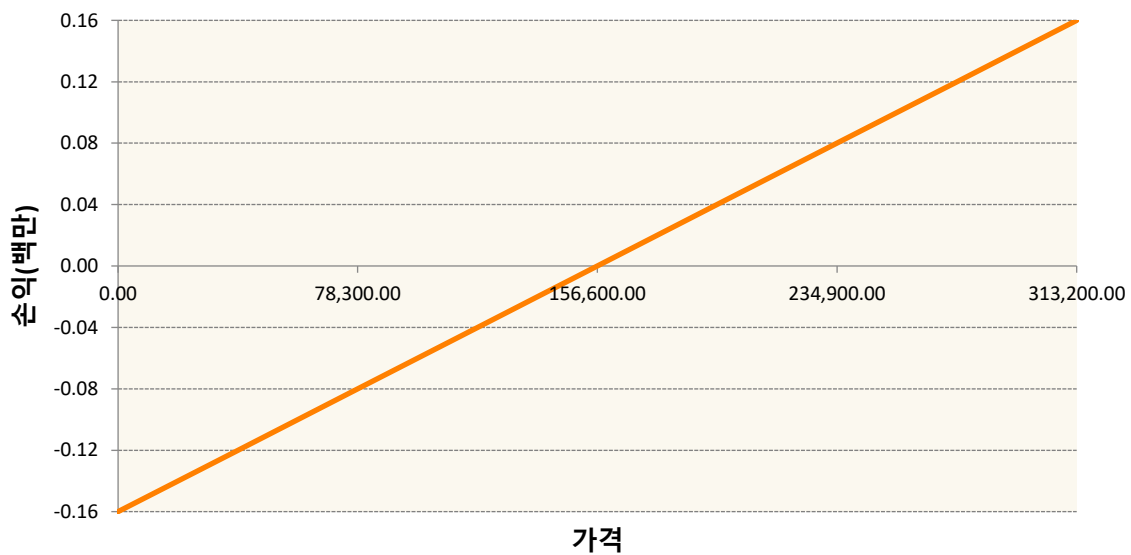
KR4154V30004-2024-03 이마트개별선물



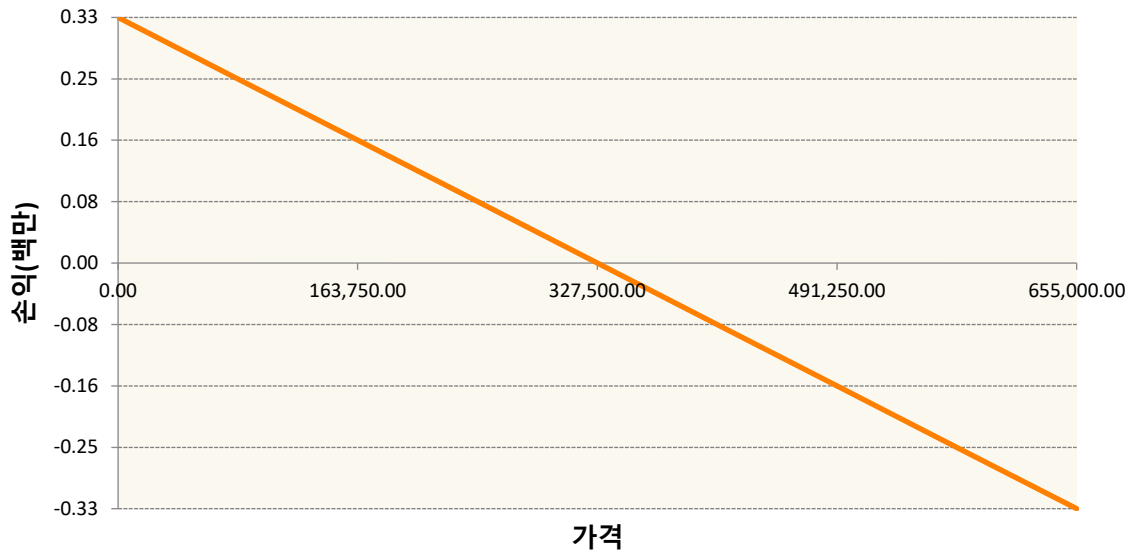
KR41BDV30007-2024-03 삼성생명개별선물



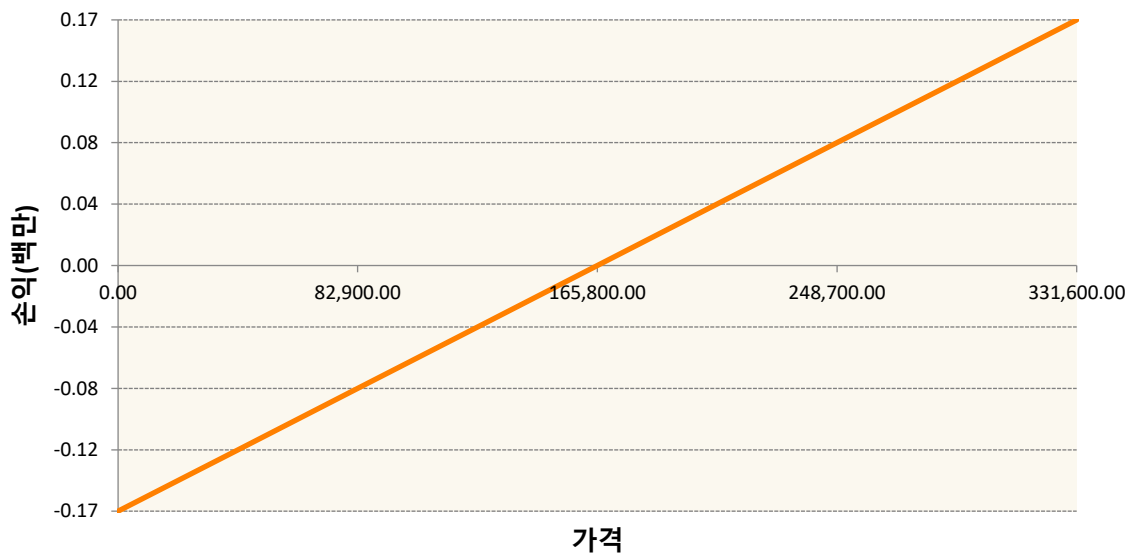
KR41C8V30007-2024-03 삼성물산개별선물



KR41CRV30005-2024-03 LG생활건강개별선물



KR41FPV30002-2024-03 알테오젠개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101V300 2024-03 코스피200지수선물	79
KR4106V300 2024-03 코스닥150선물	3
KR4123V300 2024-03 삼성전기개별선물	1
KR4128V300 2024-03 한국가스공사개별선물	3
KR4134V300 2024-03 LG개별선물	1
KR4154V300 2024-03 이마트개별선물	1
KR41BDV300 2024-03 삼성생명개별선물	1
KR41C8V300 2024-03 삼성물산개별선물	2
KR41CRV300 2024-03 LG생활건강개별선물	0.26
KR41FPV300 2024-03 알테오젠개별선물	4

공시일	2024-02-29
기준일	2024-02-28

코리아인덱스(주식-파생형)(종)

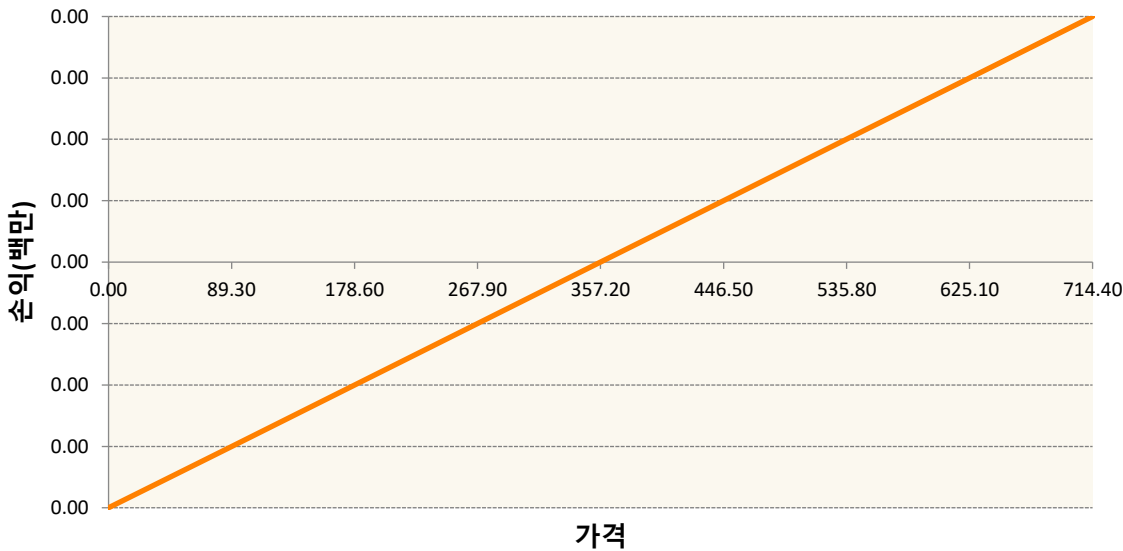
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,304	0	3,304	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

공시일	2024-02-29
기준일	2024-02-28

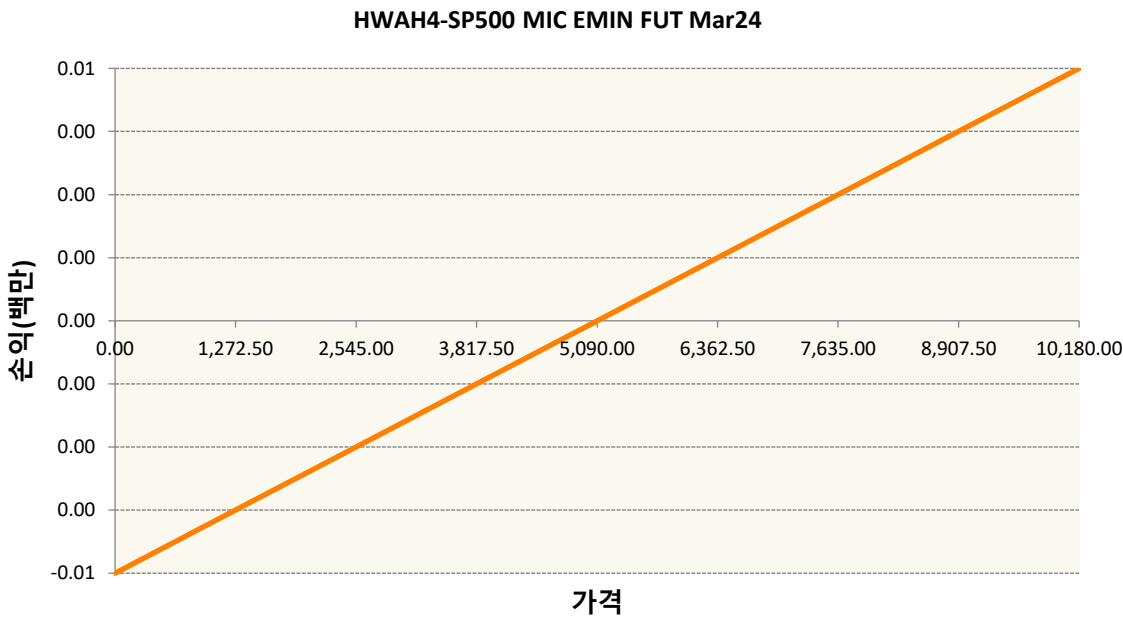
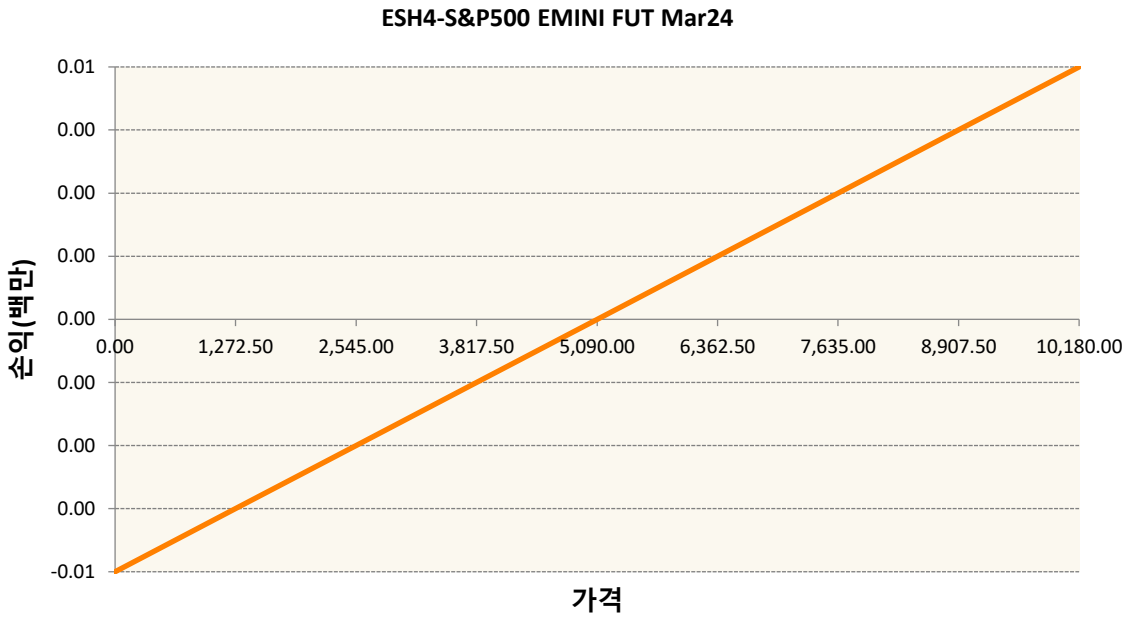
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

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	3,393	0	3,393	
누계	유가증권	선물	1,710	0	1,710	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESH4	S&P500 EMINI FUT Mar24	271
HWAH4	SP500 MIC EMIN FUT Mar24	137

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	318

공시일	2024-02-29
기준일	2024-02-28

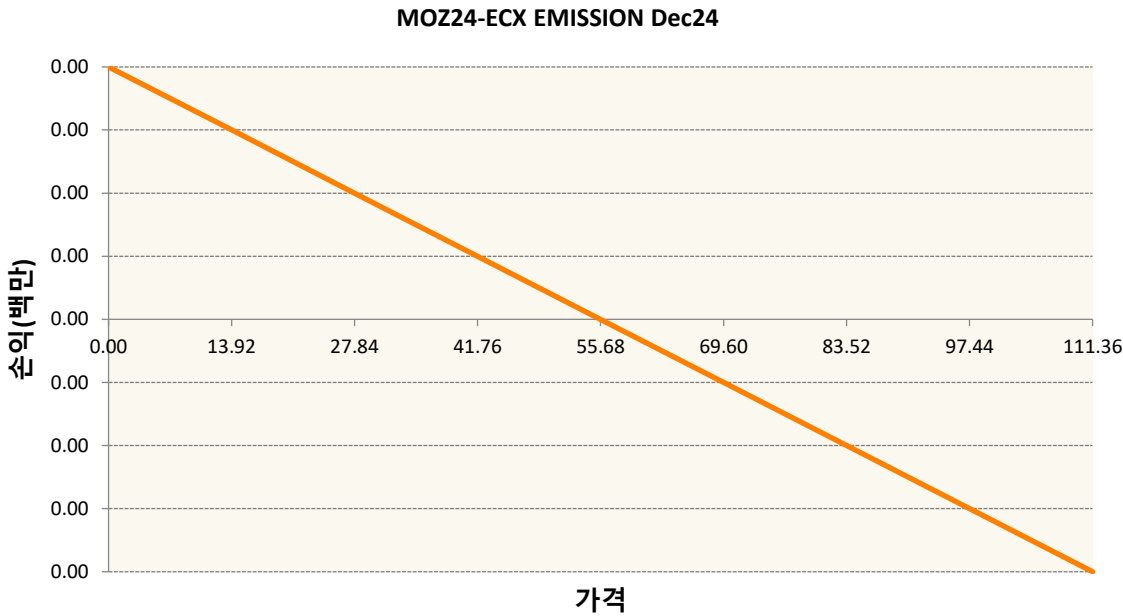
SOL유럽탄소배출권선물인버스ICE특별자산상

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	9,040	-9,040	
누계	지수	스왑	424	0	424	장외
누계	통화	선도	0	4,715	-4,715	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213E1W KRW/EUR 29-02-24E	28
FXW213E1W KRW/EUR 29-02-24E	119
FXW213E2TC KRW/EUR 28-03-24E	84
FXW213E2TC KRW/EUR 28-03-24E	147
MOZ24 ECX EMISSION Dec24	723
SWICEUACN ICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX	10

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

(단위:백만원)

공시일	2024-02-29
기준일	2024-02-28

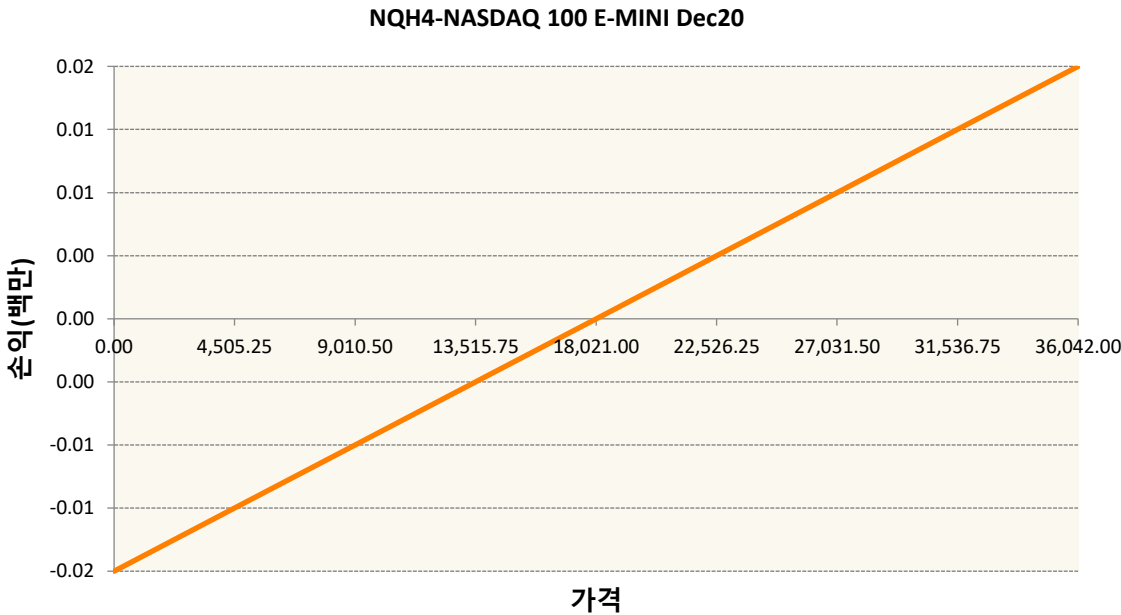
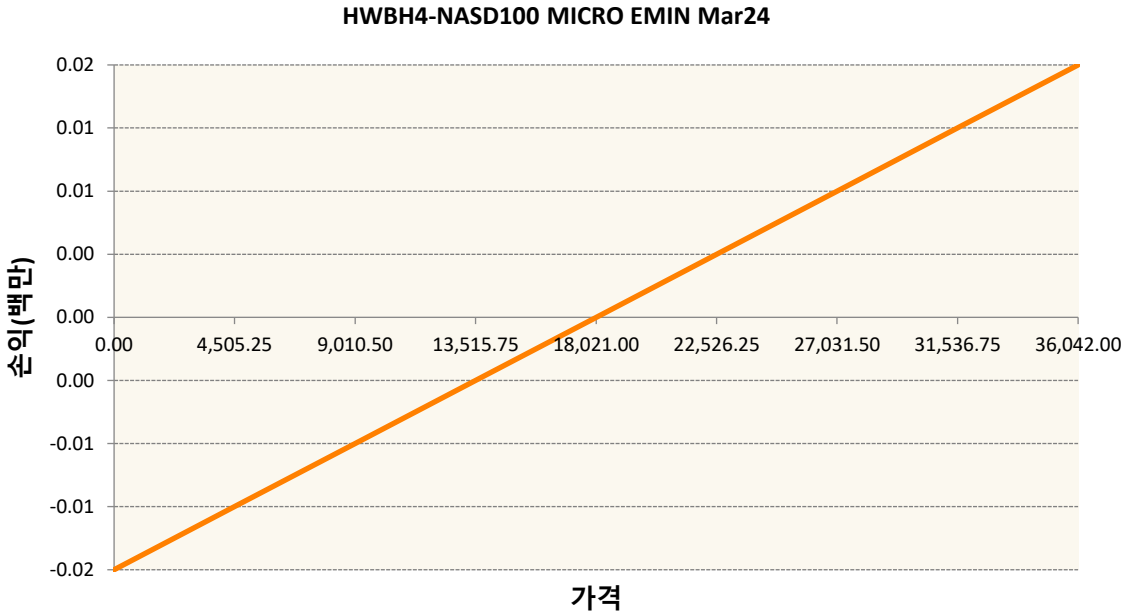
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

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	1,917	0	1,917	
누계	유가증권	선물	2,336	0	2,336	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
HWBH4	NASD100 MICRO EMIN Mar24		187
NQH4	NASDAQ 100 E-MINI Dec20		153

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)			(단위:백만원)
			305

공시일	2024-02-29
기준일	2024-02-28

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	68,931	0	68,931	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWKEDI0000 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	438
SWKEDI0000 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	3,916
SWKEDI0000 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	1,132

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

(단위:백만원)

3,568

공시일	2024-02-29
기준일	2024-02-28

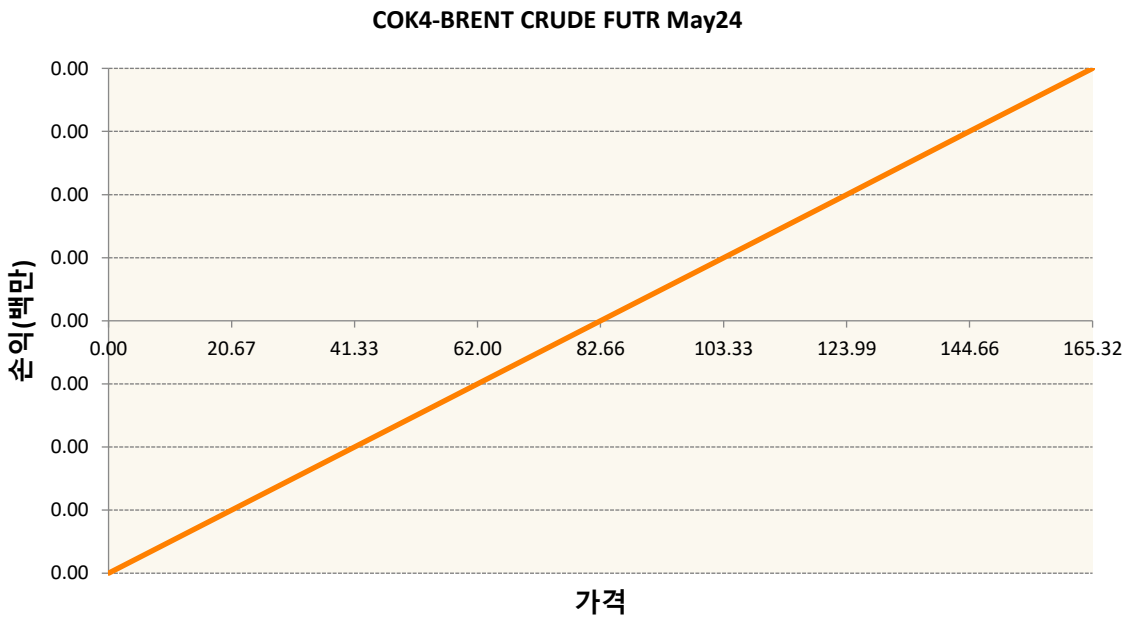
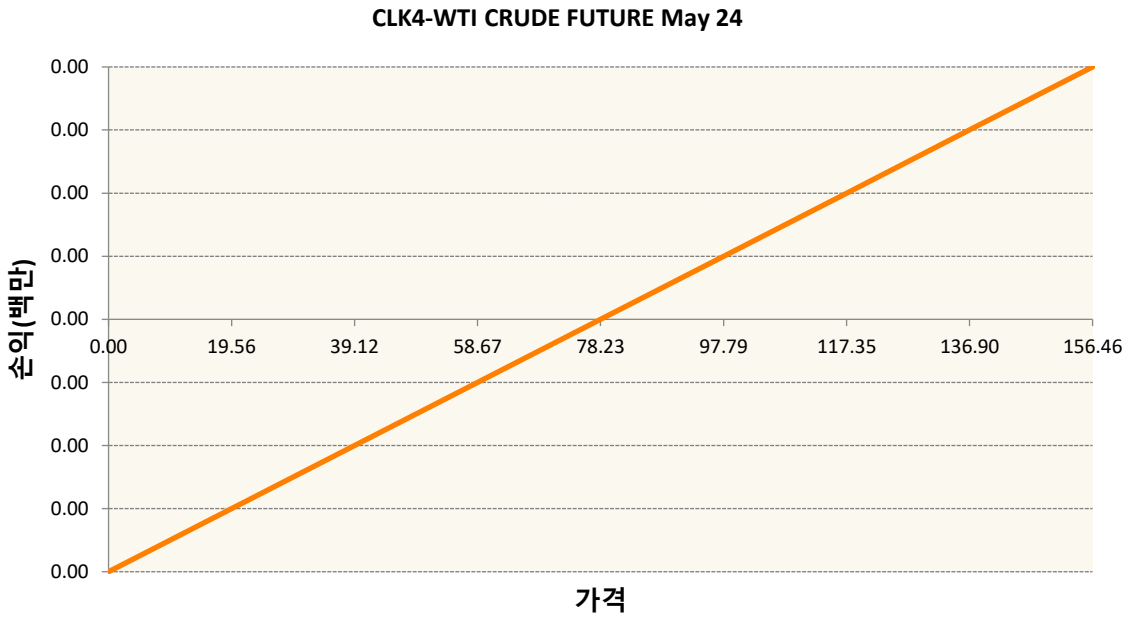
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

1. 계약금액

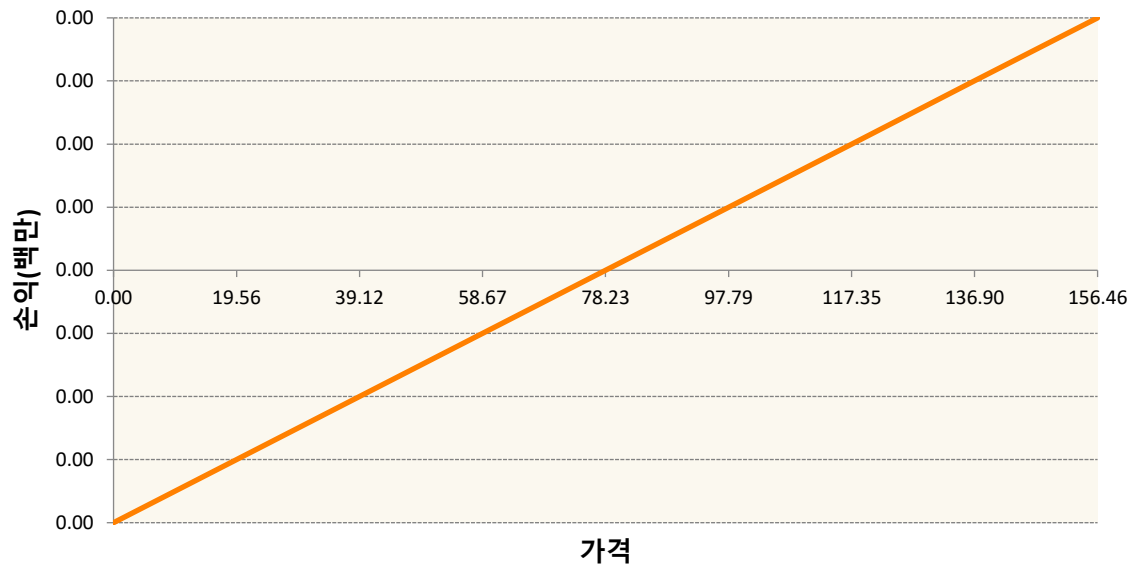
(단위:백만원)

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	1,177	0	1,177	
누계	통화	선물	0	173	-173	장내

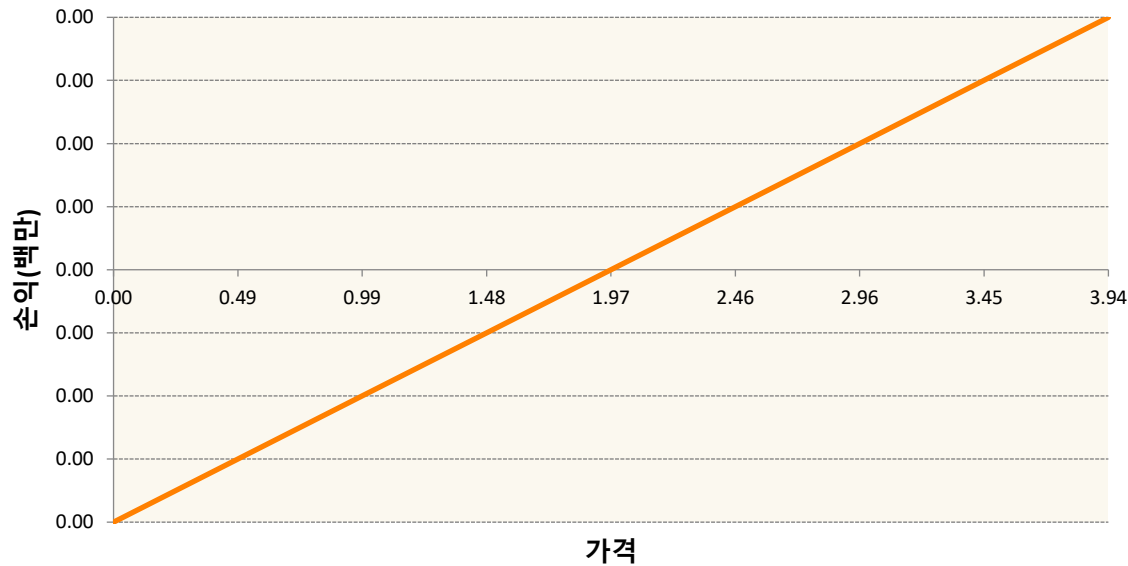
2. 만기시점의 손익구조



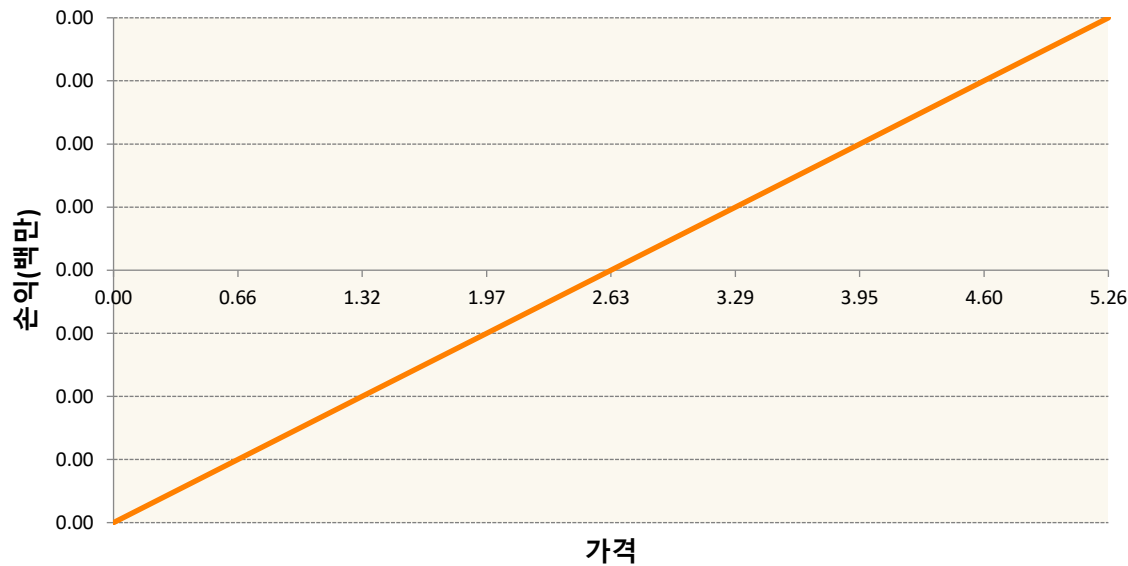
ECK4-E-mini Crude Oil May 24



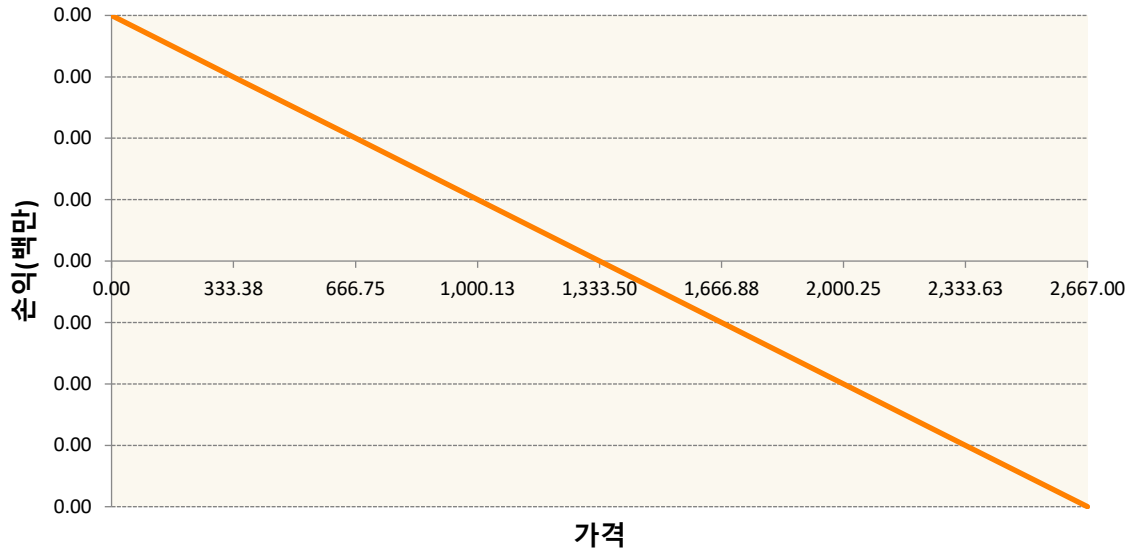
EOK4-E-MINI NATURAL GAS May 24



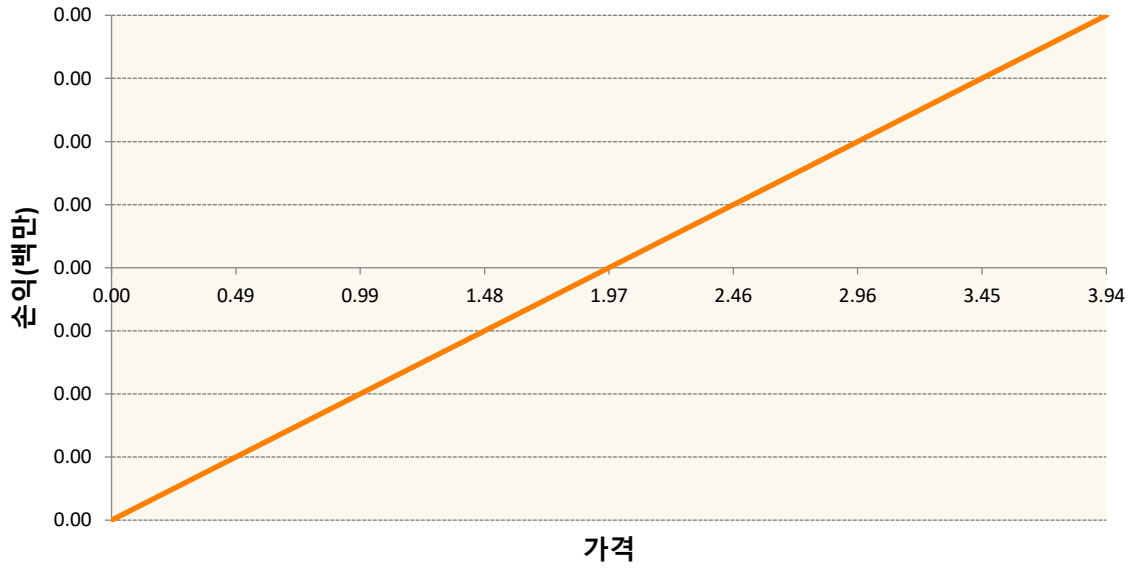
HOK4-NY Harb ULSD Fut May 24



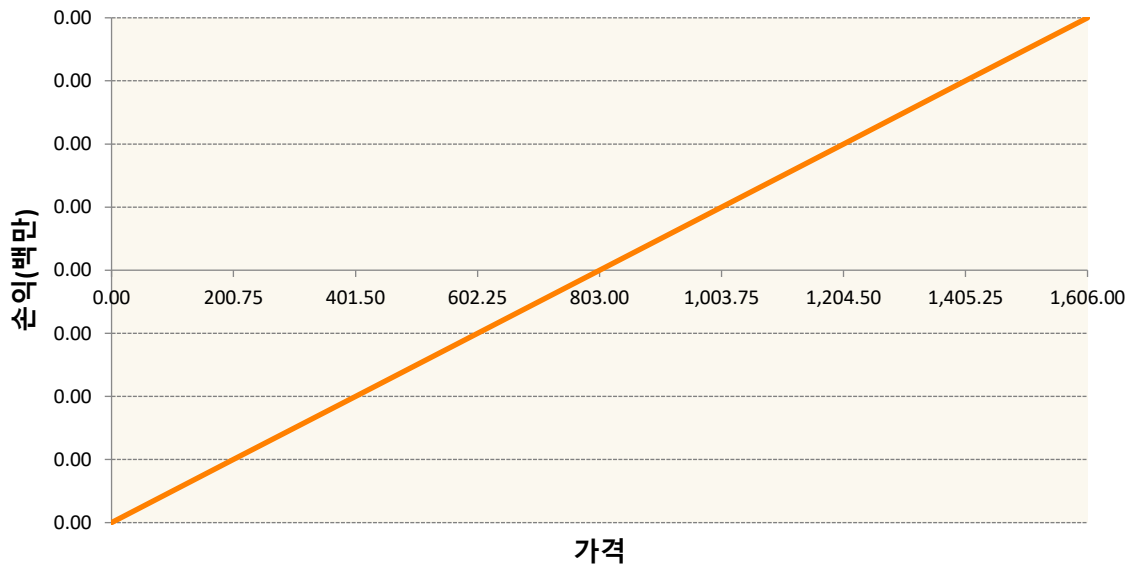
KR4175V30009-2024-03 달러선물

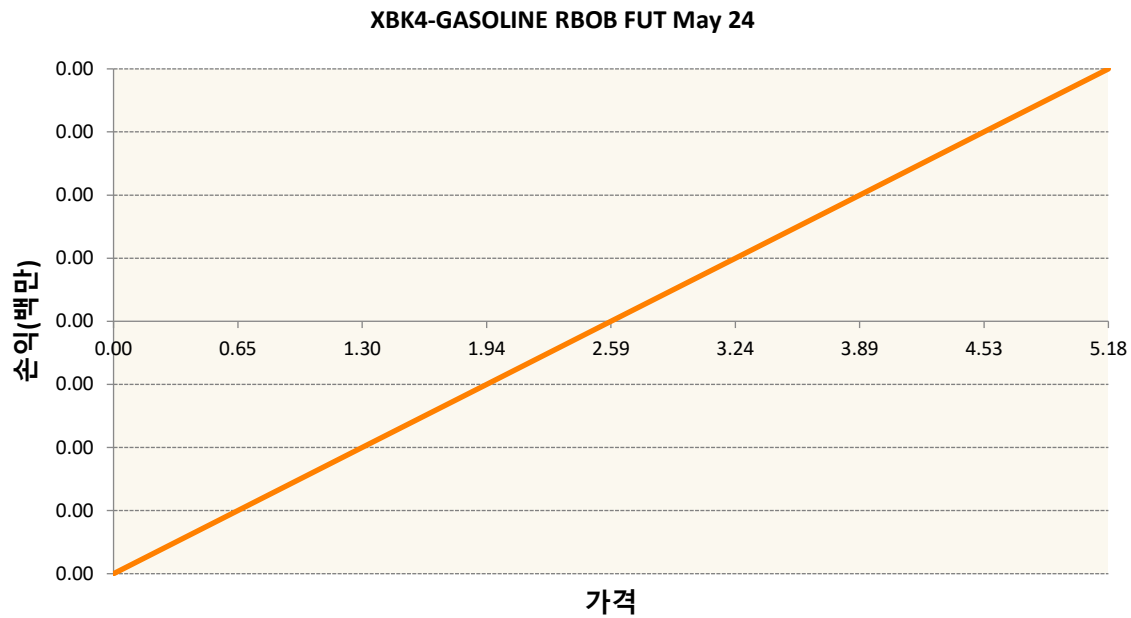


NGK24-NATURAL GAS FUTR May 24



QSK4-Low Su Gasoil G May 24





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
CLK4	WTI CRUDE FUTURE May 24	17
COK4	BRENT CRUDE FUTR May24	26
ECK4	E-mini Crude Oil May 24	4
EOK4	E-MINI NATURAL GAS May 24	1
HOK4	NY Harb ULSD Fut May 24	12
KR4175V300 2024-03 달러선물		14
NGK24	NATURAL GAS FUTR May 24	15
QSK4	Low Su Gasoil G May 24	9
XBK4	GASOLINE RBOB FUT May 24	12

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	217