

공시일	2024-03-06
기준일	2024-03-05

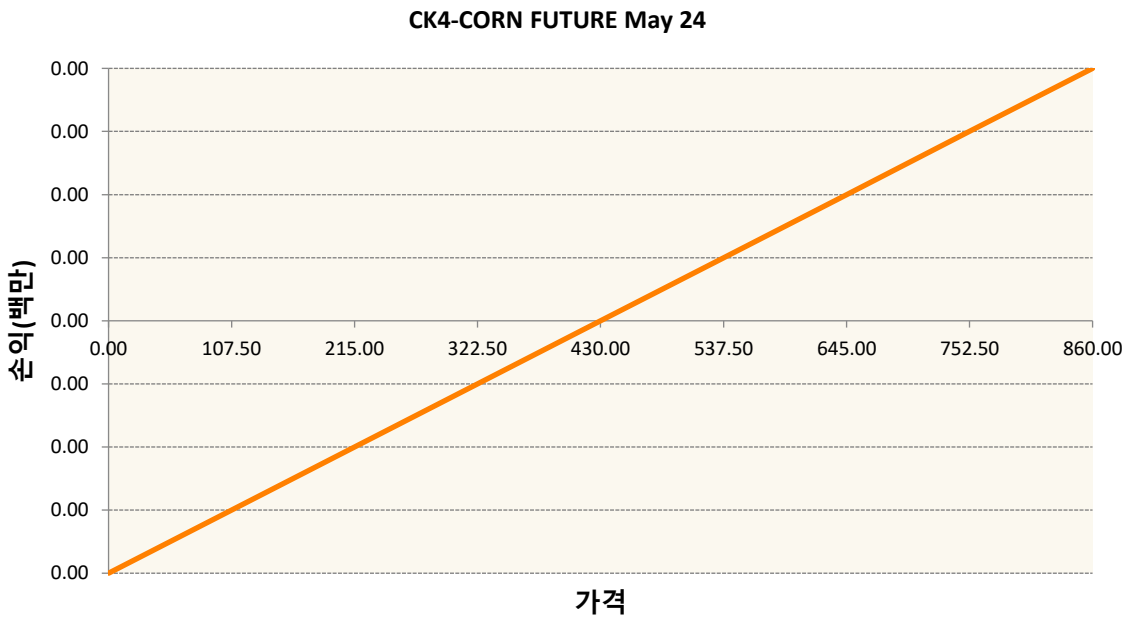
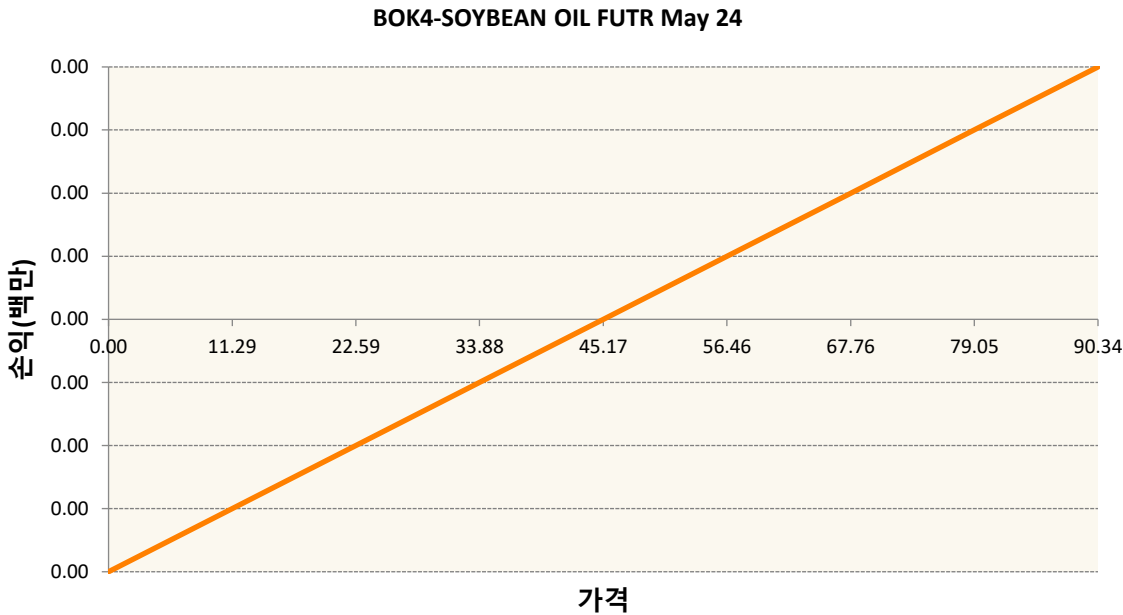
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

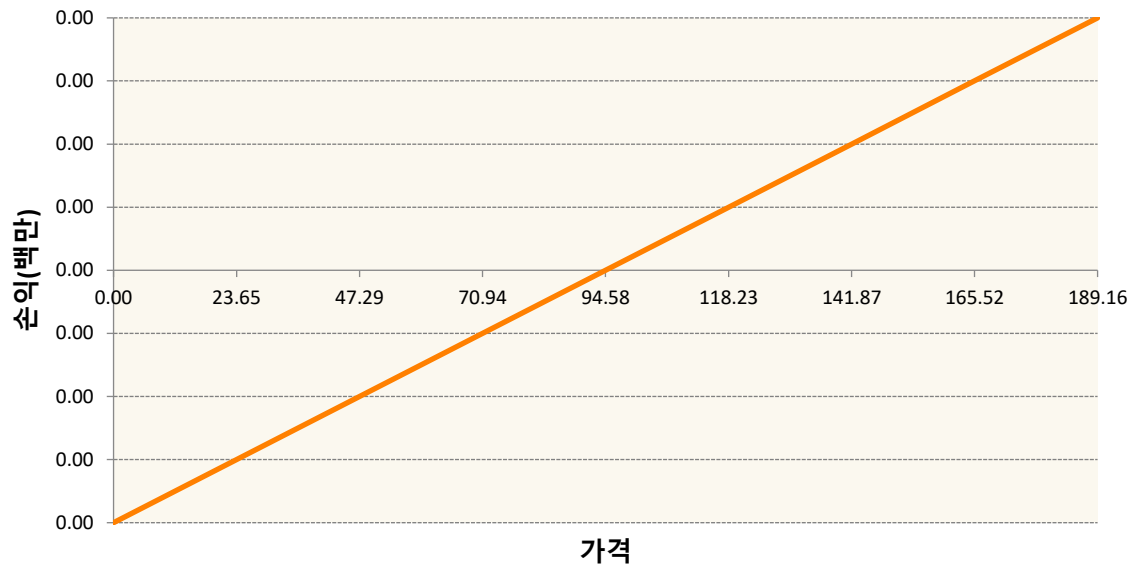
(단위:USD 백만)

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	4,303	0	4,303	
누계	통화	선물	0	427	-427	장내

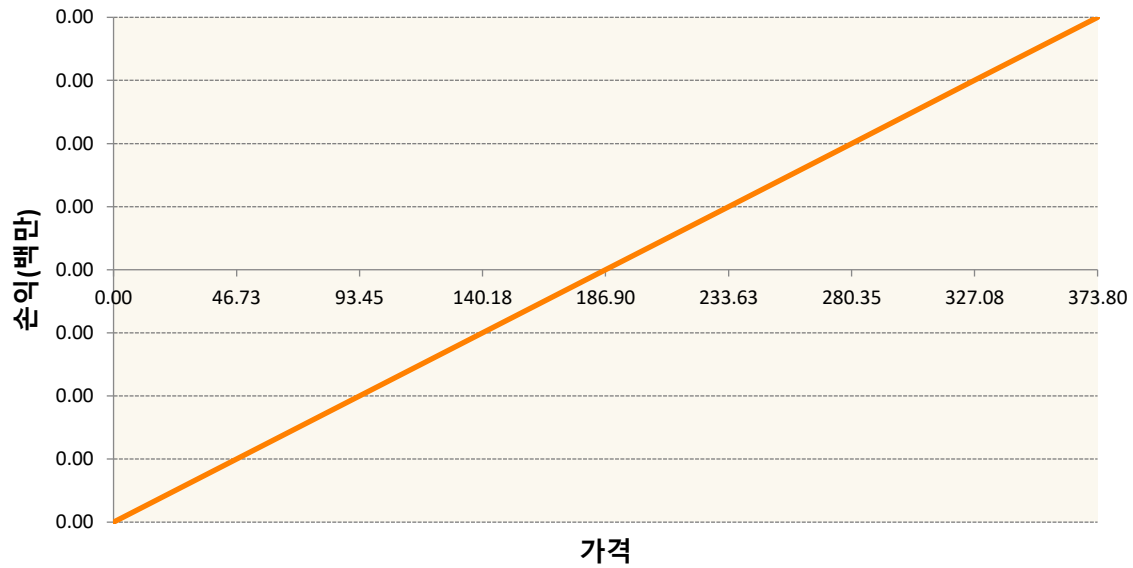
2. 만기시점의 손익구조



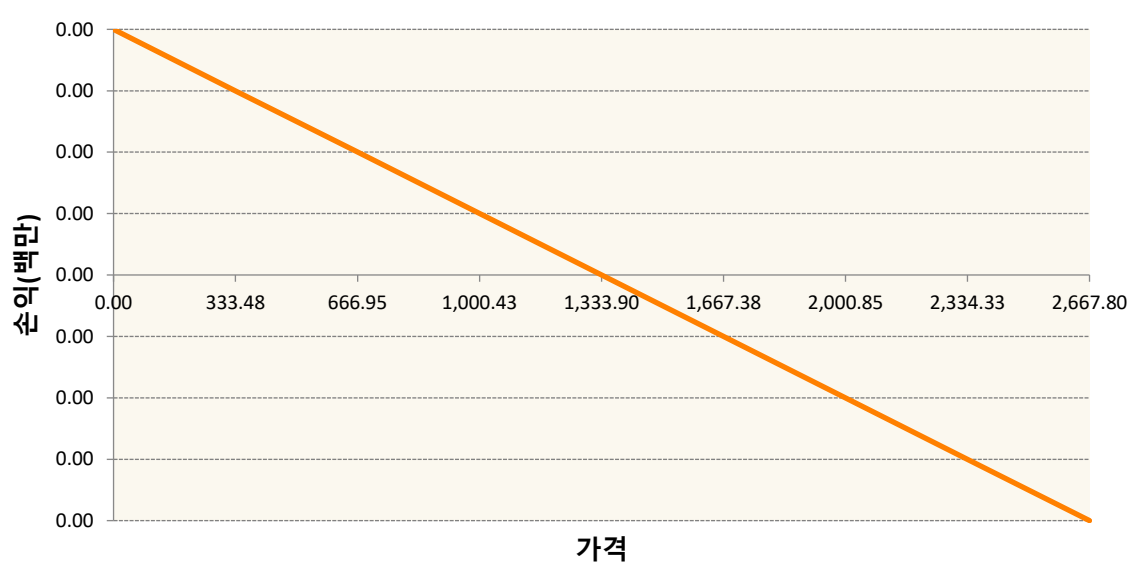
CTK4-COTTON NO.2 FUTR May 24



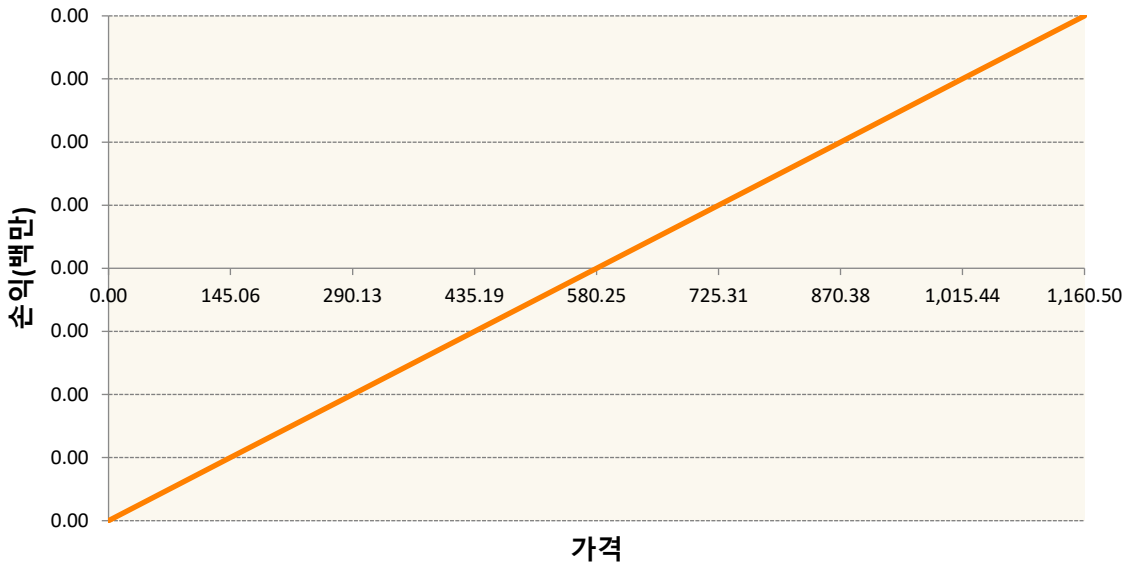
KCK4-COFFEE 'C' FUTURE May 24



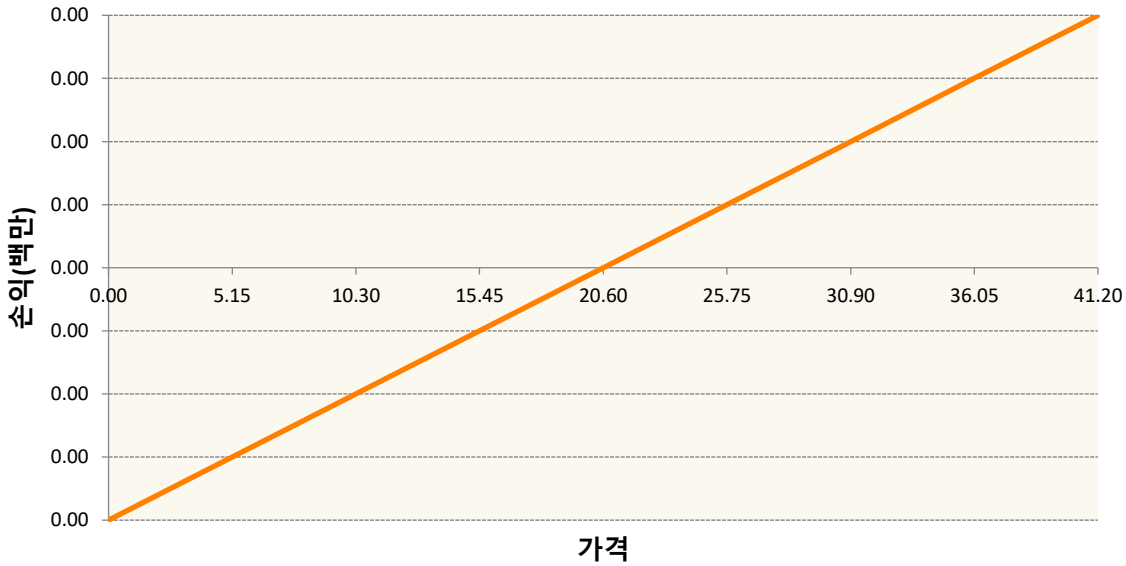
KR4175V30009-2024-03 달러선물



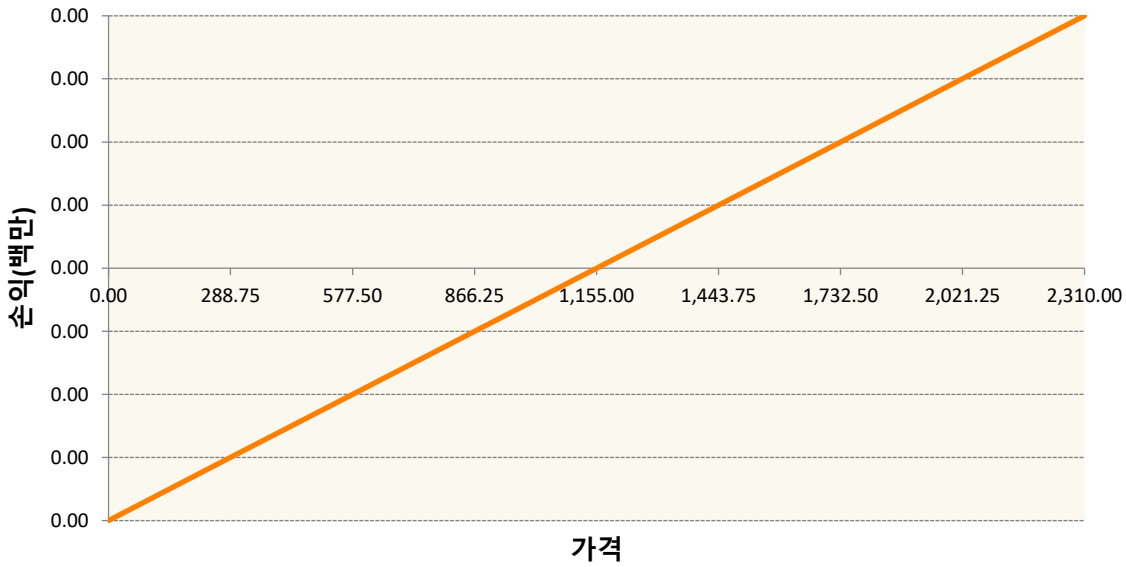
KWK4-KC HRW WHEAT FUT May 24



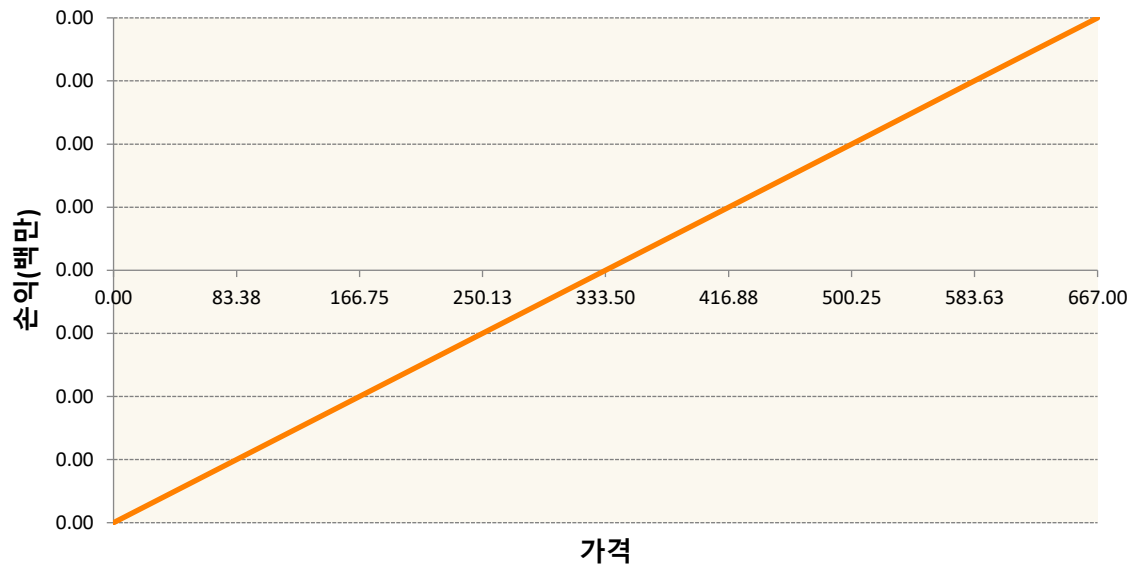
SBK4-Sugar #11 (WORLD) May 24



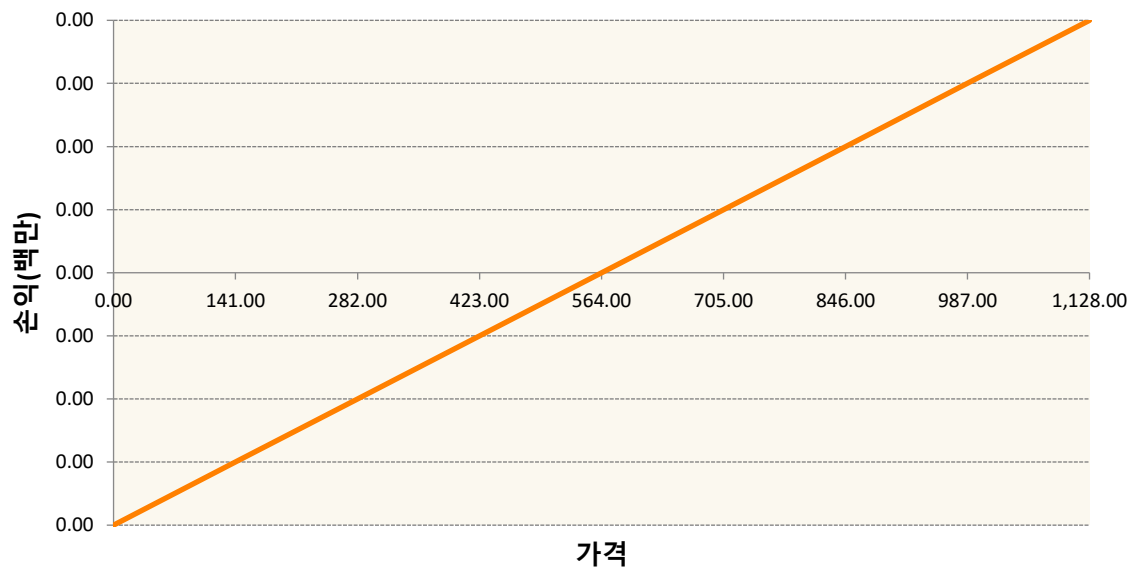
SK4-SOYBEAN FUTURE May 24



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	2024-03-06
기준일	2024-03-05

스마트인덱스모

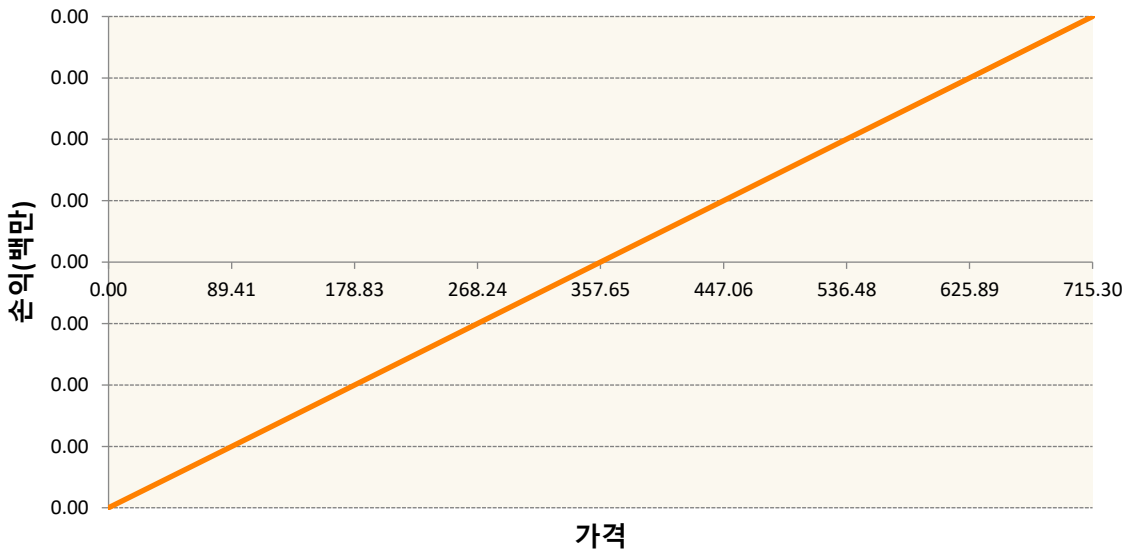
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,162	0	1,162	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	2024-03-06
기준일	2024-03-05

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

269

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

312

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2024-03-06
기준일	2024-03-05

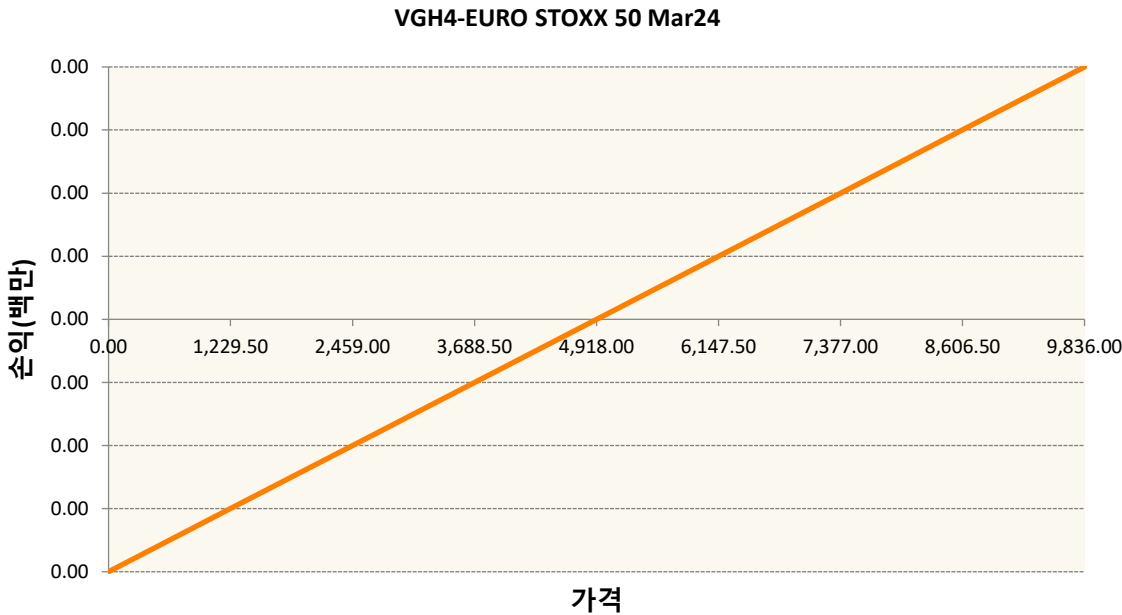
유로인덱스모(주식-파생형)

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	1,052	0	1,052	
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)

71

공시일	2024-03-06
기준일	2024-03-05

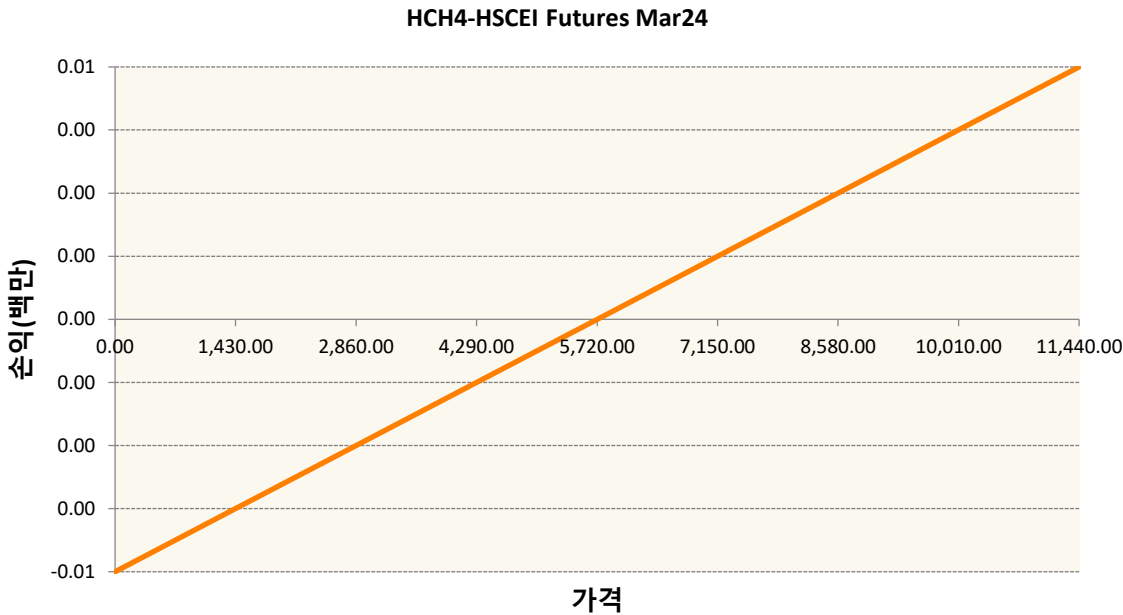
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,119	0	1,119	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCH4	HSCEI Futures Mar24	90
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

130

공시일	2024-03-06
기준일	2024-03-05

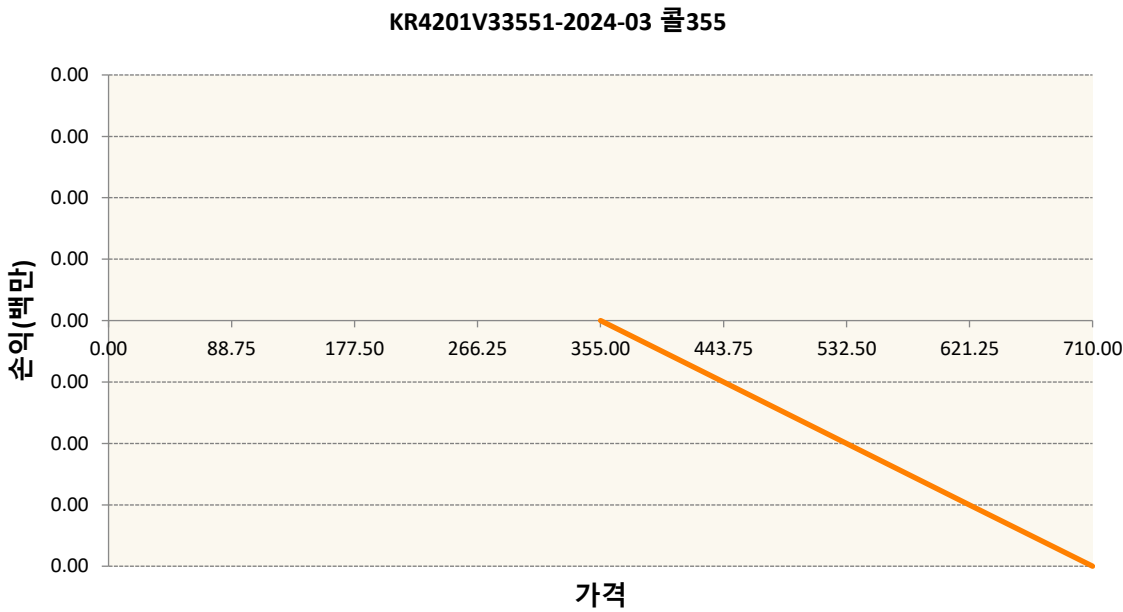
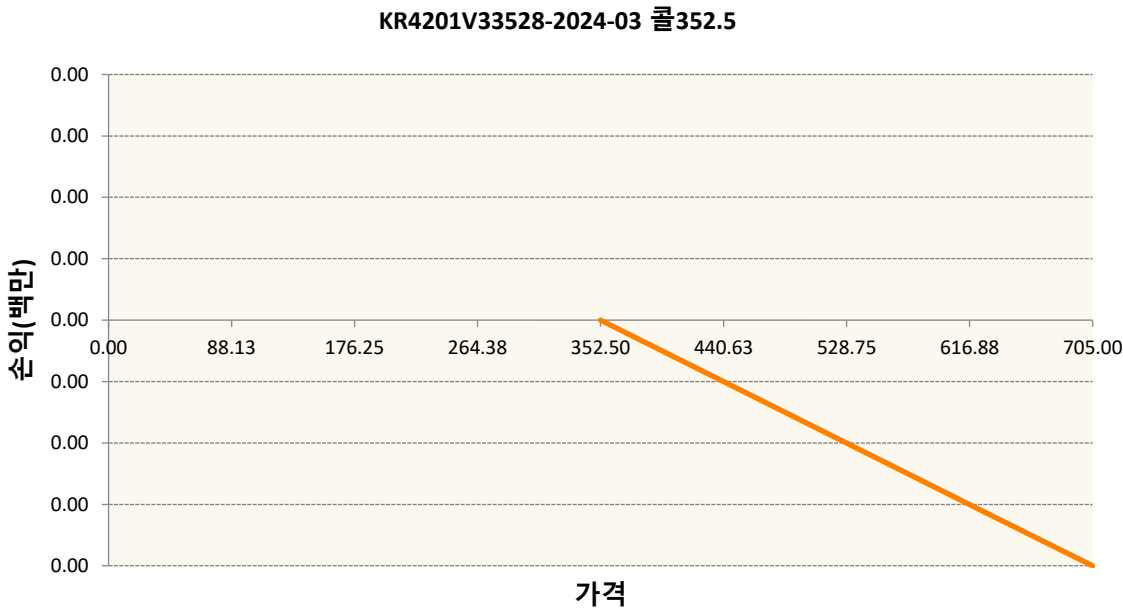
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

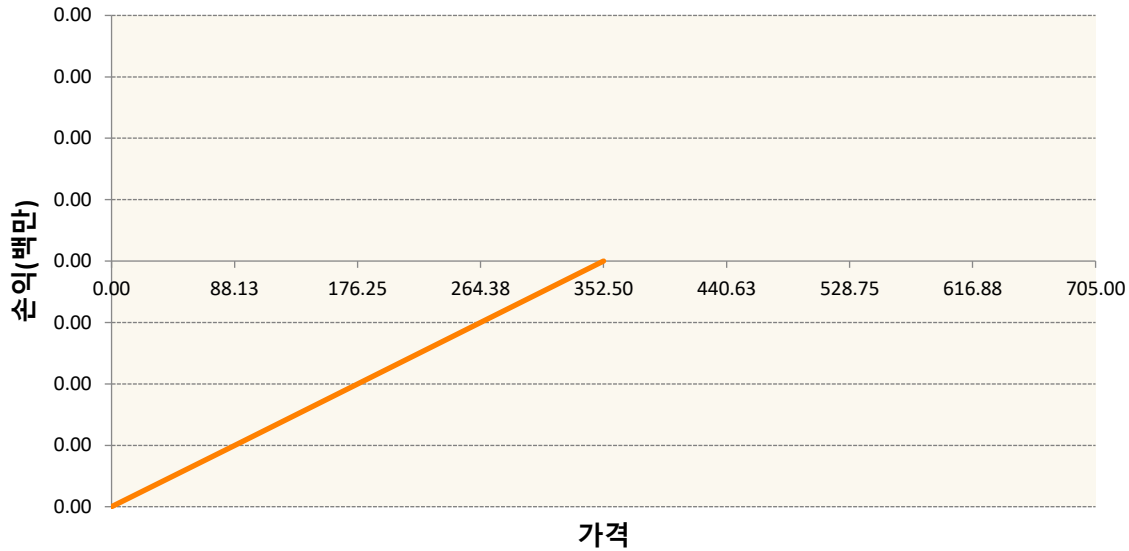
(단위:백만원)

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

2. 만기시점의 손익구조



KR4301V33526-2024-03 풋352.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201V33528			2024-03 콜352.5				1,889
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	486	486	486	485	484	483	481
-5.33%	482	479	474	468	460	452	442
-2.67%	406	388	369	350	330	310	290
0%	54	37	19	0	-19	-39	-58
2.67%	-553	-556	-561	-567	-574	-583	-593
5.33%	-1,219	-1,219	-1,219	-1,220	-1,221	-1,223	-1,226
8.00%	-1,888	-1,888	-1,888	-1,888	-1,888	-1,889	-1,889
KR4201V33551			2024-03 콜355				1,113
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	226	226	226	225	225	225	224
-5.33%	225	224	222	220	217	213	209
-2.67%	200	191	182	172	161	151	140
0%	38	26	13	0	-13	-26	-39
2.67%	-303	-307	-312	-317	-324	-331	-338
5.33%	-705	-705	-706	-707	-708	-710	-713
8.00%	-1,113	-1,113	-1,113	-1,113	-1,113	-1,113	-1,113
KR4301V33526			2024-03 풋352.5				555
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-553	-553	-553	-553	-553	-554	-555
-5.33%	-311	-312	-314	-316	-319	-322	-326
-2.67%	-96	-102	-109	-116	-123	-130	-138
0%	20	13	7	0	-7	-14	-21

2.67%	42	41	39	37	35	31	28
5.33%	44	44	43	43	43	42	41
8.00%	44	44	44	44	44	44	43

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

(단위:백만원)

4,282

공시일	2024-03-06
기준일	2024-03-05

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	1,686	0	1,686	

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	2024-03-06
기준일	2024-03-05

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	4,447	0	4,447	

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	2024-03-06
기준일	2024-03-05

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	15,997	0	15,997	
누계	통화	선도	1,068	16,795	-15,727	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213DCT KRW/USD 29-03-24E	518
FXW213E1W KRW/USD 30-04-24E	249
FXW213E2L0 USD/KRW 29-03-24E	85
FXW213E2TC KRW/USD 31-05-24E	577
IE00BD8RGM75	

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

710

공시일	2024-03-06
기준일	2024-03-05

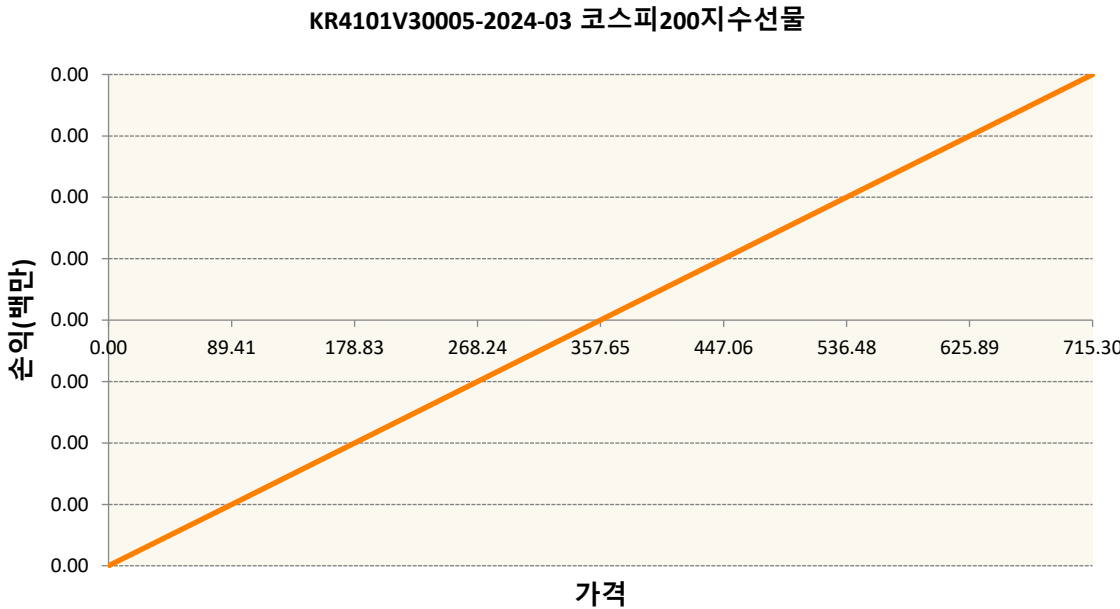
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

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	358	0	358	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	2024-03-06
기준일	2024-03-05

SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

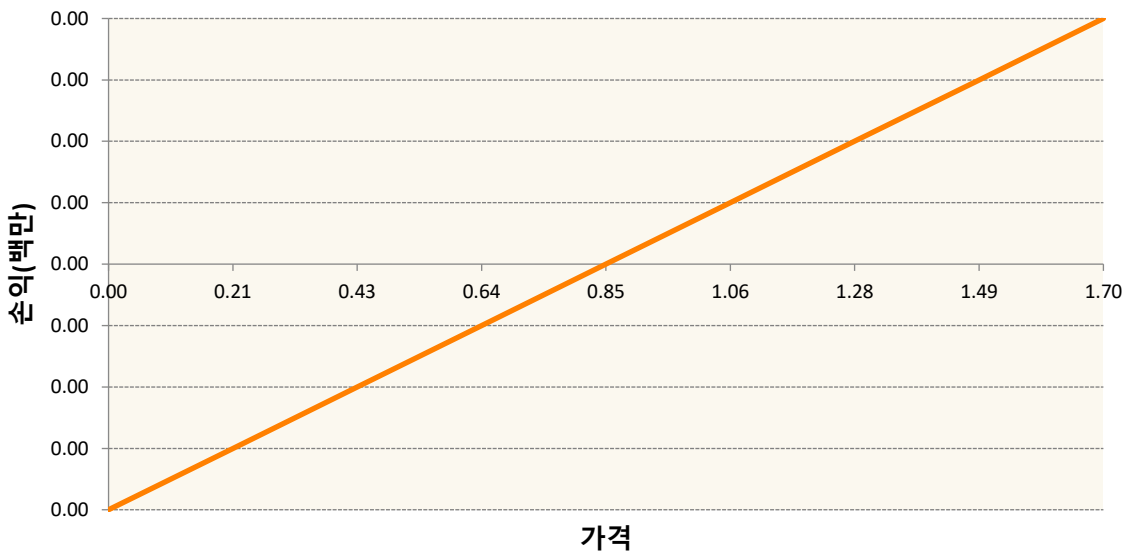
1. 계약금액

(단위:백만원)

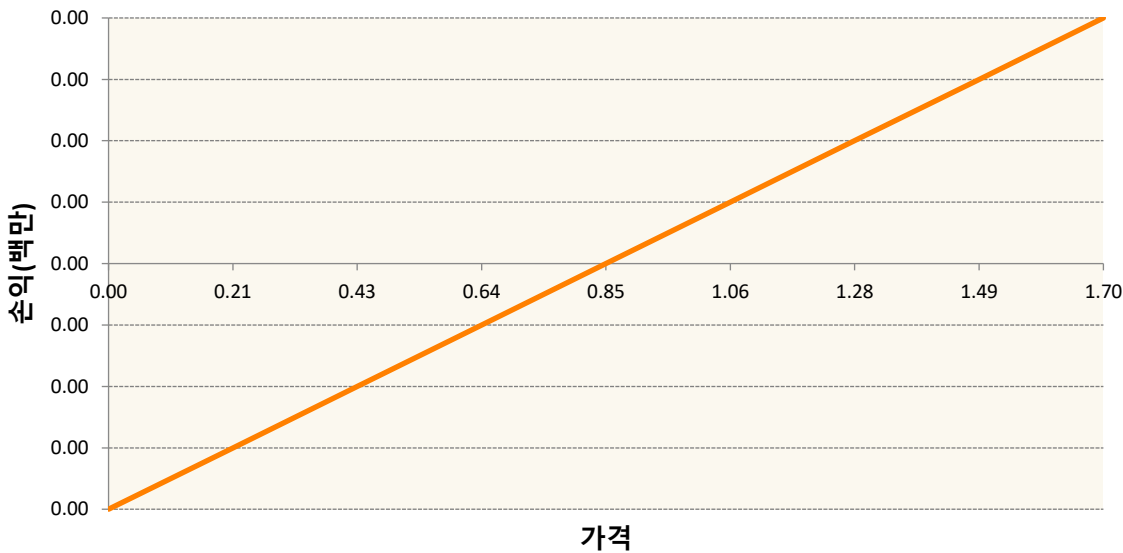
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	17,922	0	17,922	

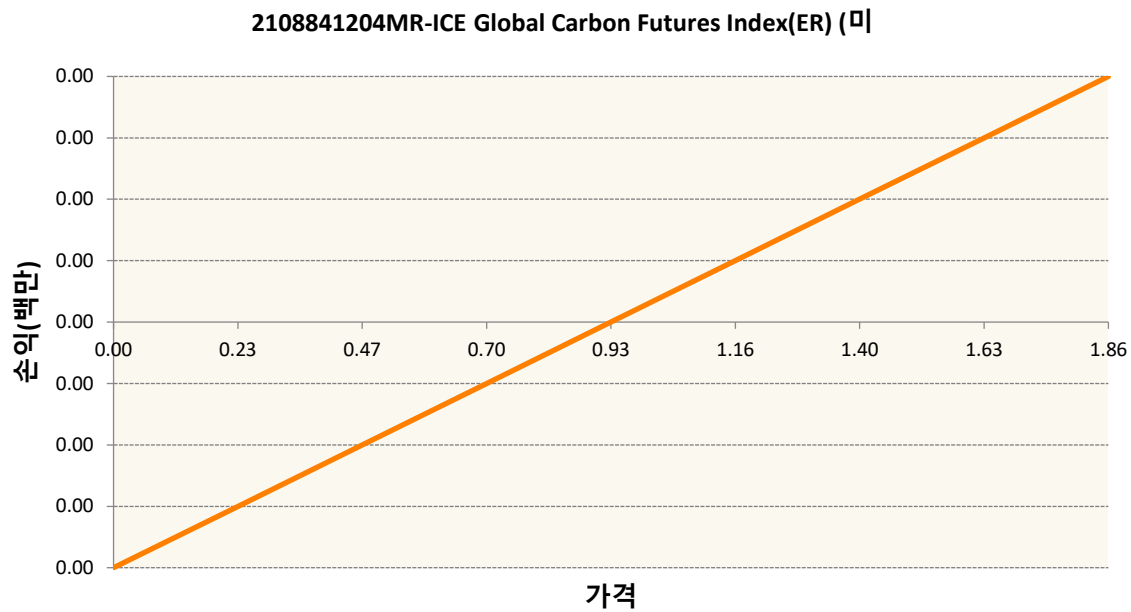
2. 만기시점의 손익구조

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		840
2108840920ICE Global Carbon Futures Index(ER) (메		168
2108841204ICE Global Carbon Futures Index(ER) (미		420

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,643

공시일	2024-03-06
기준일	2024-03-05

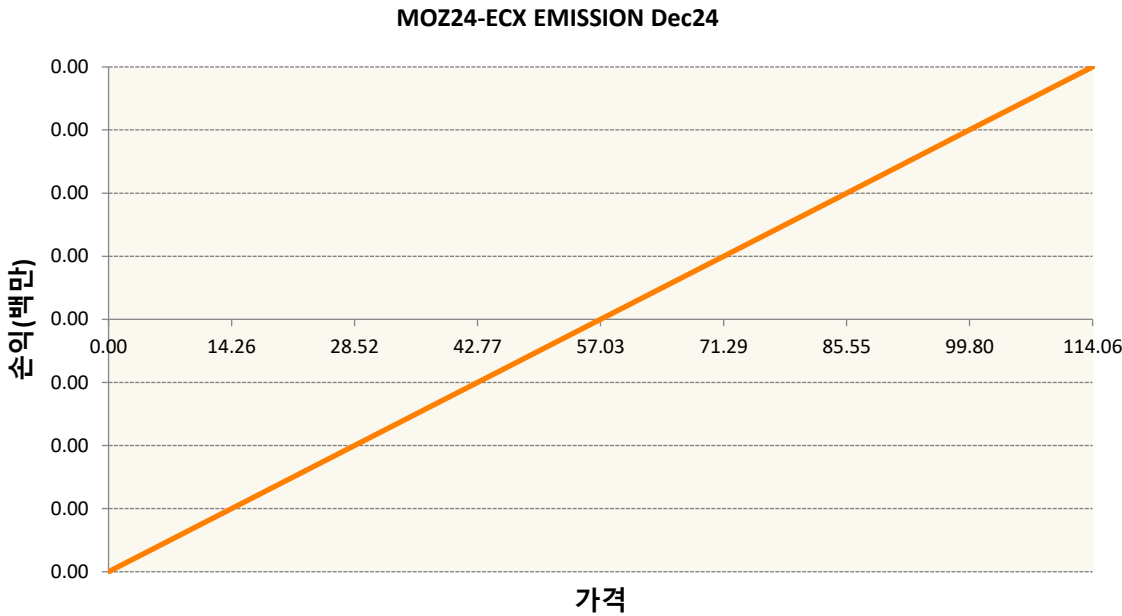
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	7,767	0	7,767	
누계	지수	스왑	424	0	424	장외
누계	통화	선도	0	2,243	-2,243	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213E2TC KRW/EUR 28-03-24E	179
MOZ24 ECX EMISSION Dec24	621
SWICEUACN ICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX	9

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

(단위:백만원)

1,200

공시일	2024-03-06
기준일	2024-03-05

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)	9
SWCSI00000 신한CSI Index 230622 (메리츠)	9
SWCSI00000 신한CSI Index 230922 (키움)	6
SWCSI00000 신한CSI Index 231013 (NH)	6

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

(단위:백만원)

45

공시일	2024-03-06
기준일	2024-03-05

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)	4
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(NH)	4
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(메리츠)	5
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(키움)	1

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

(단위:백만원)

15

공시일	2024-03-06
기준일	2024-03-05

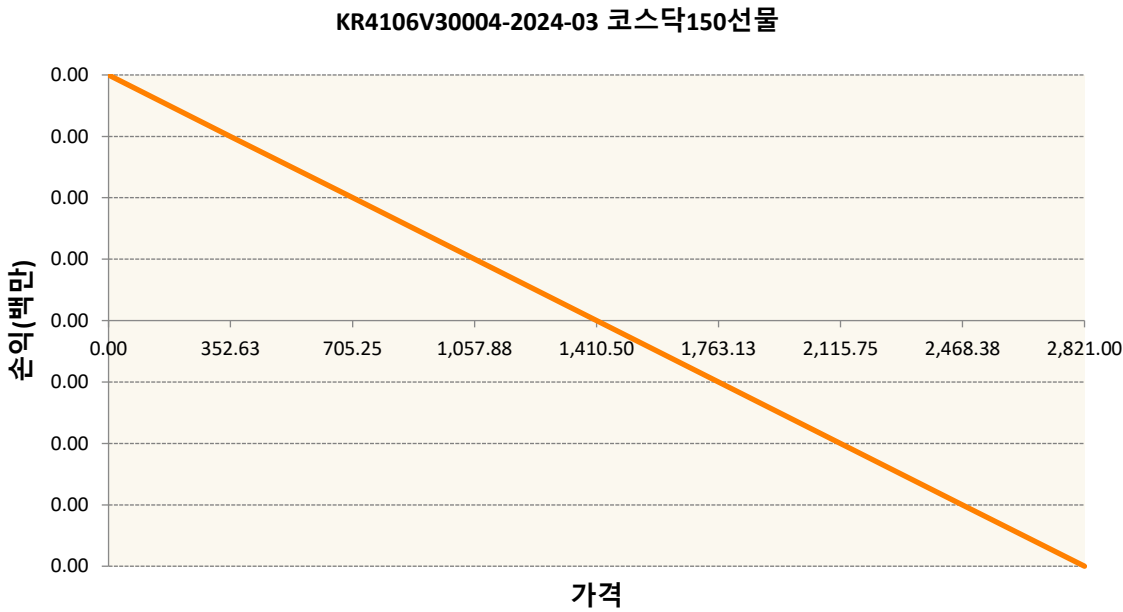
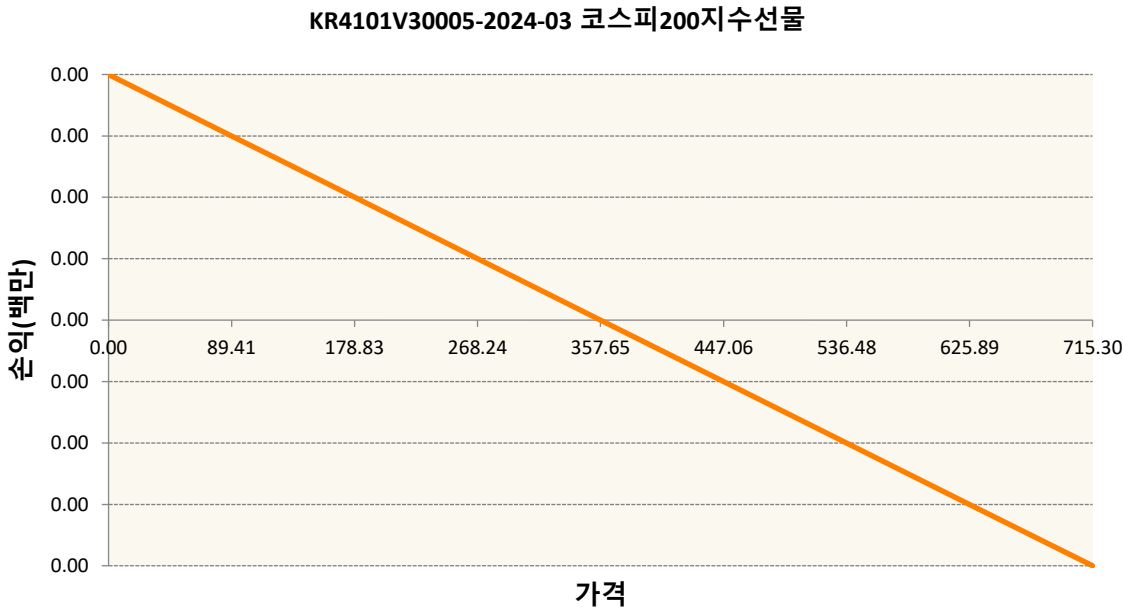
에쿼티알파일반사모혼합자산

1. 계약금액

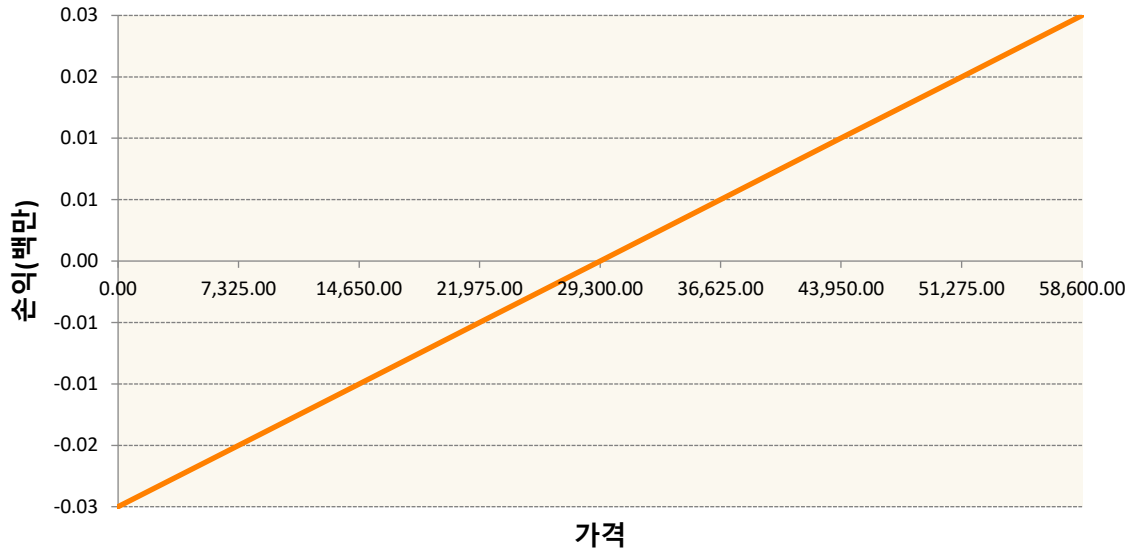
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	15	12	3	장내
누계	유가증권	선물	73	1,029	-956	장내

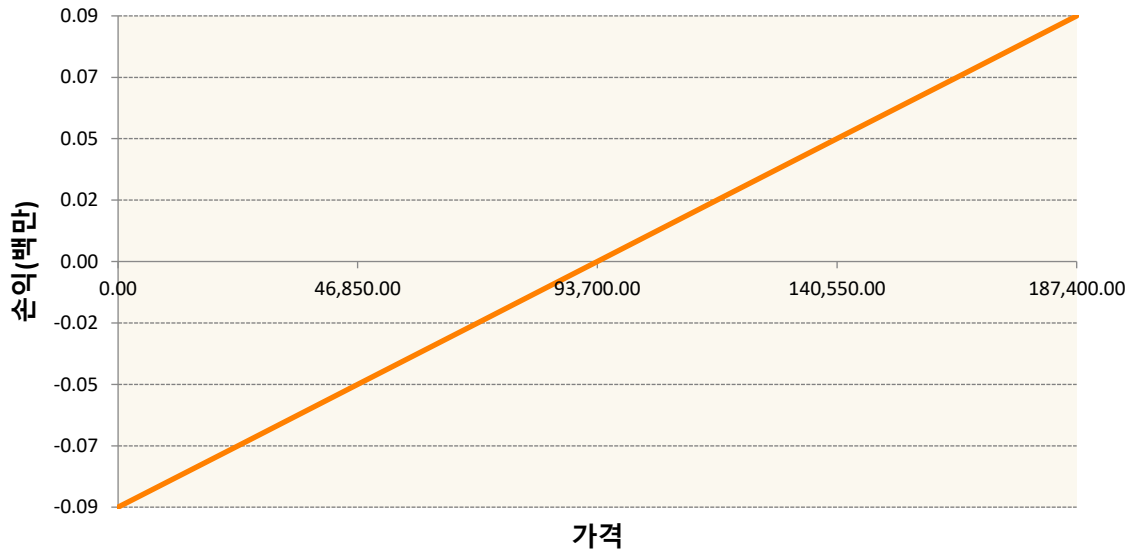
2. 만기시점의 손익구조



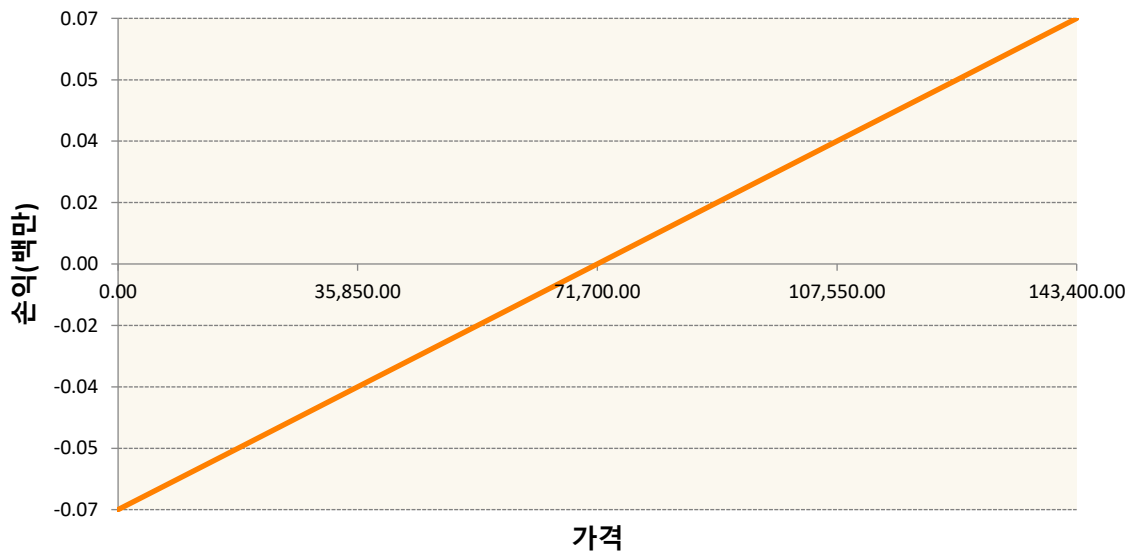
KR4128V30008-2024-03 한국가스공사개별선물



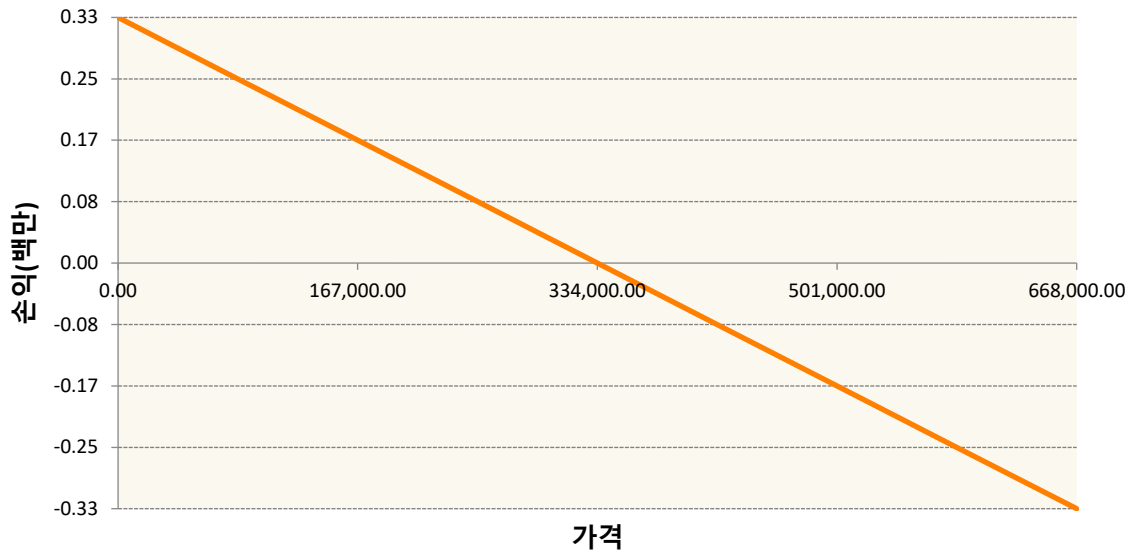
KR4134V30006-2024-03 LG개별선물



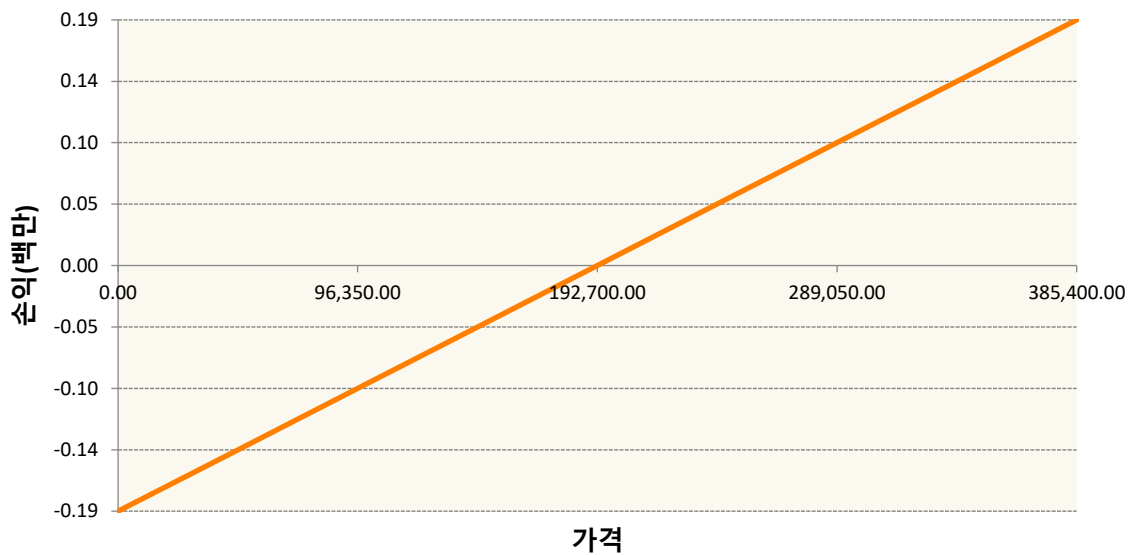
KR4154V30004-2024-03 이마트개별선물



KR41CRV30005-2024-03 LG생활건강개별선물



KR41FPV30002-2024-03 알테오젠개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101V300 2024-03 코스피200지수선물	79
KR4106V300 2024-03 코스닥150선물	3
KR4128V300 2024-03 한국가스공사개별선물	3
KR4134V300 2024-03 LG개별선물	1
KR4154V300 2024-03 이마트개별선물	1
KR41CRV300 2024-03 LG생활건강개별선물	0.27
KR41FPV300 2024-03 알테오젠개별선물	1

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

(단위:백만원)

90

공시일	2024-03-06
기준일	2024-03-05

코리아인덱스(주식-파생형)(종)

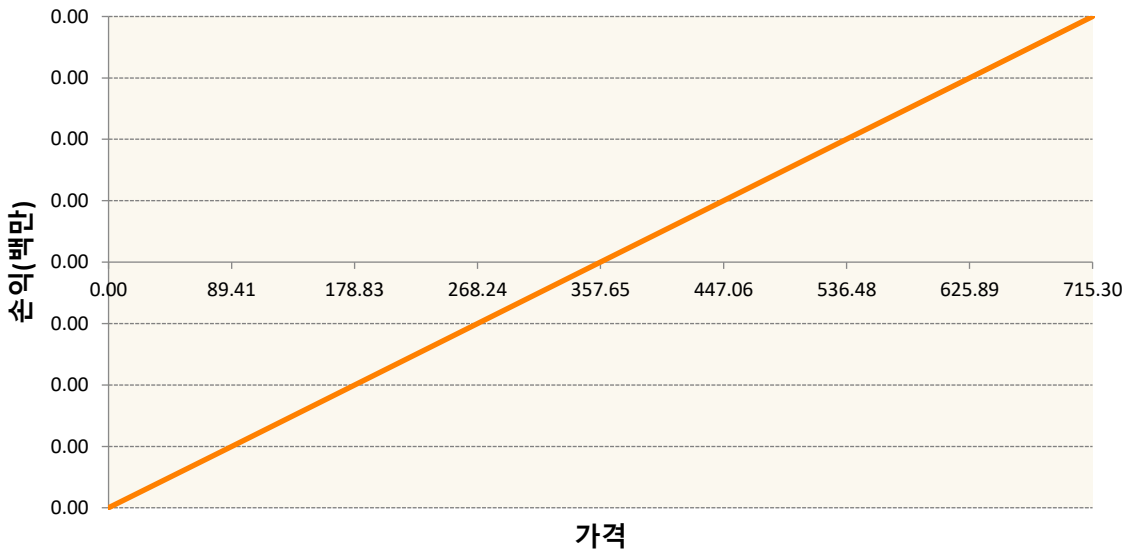
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,308	0	3,308	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%	-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%	265	265	265	265	265	265	265

공시일	2024-03-06
기준일	2024-03-05

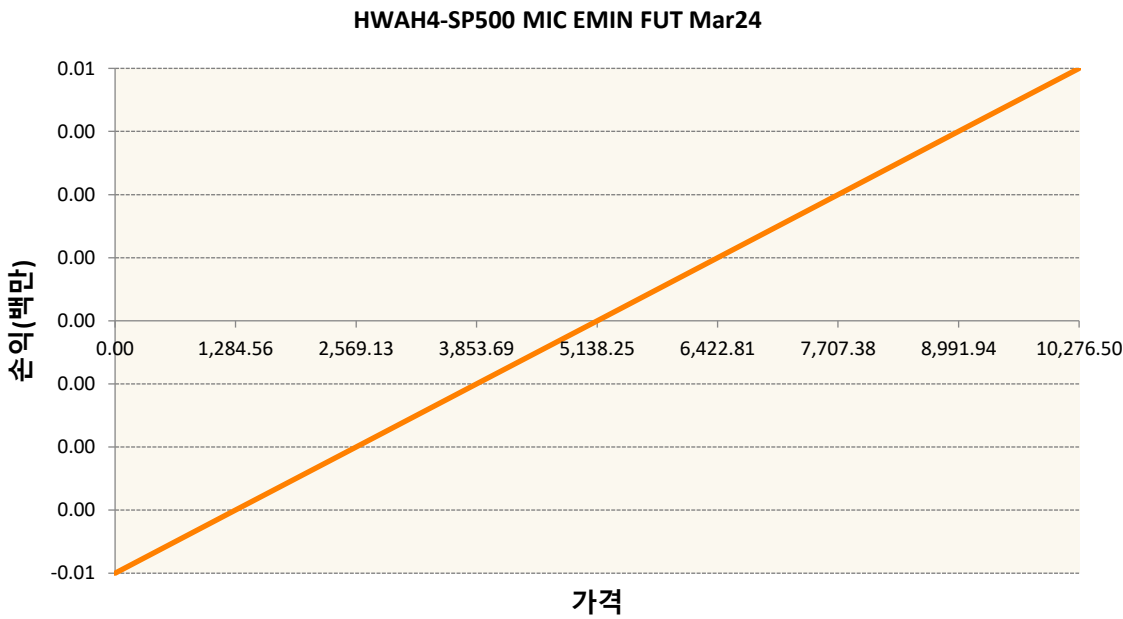
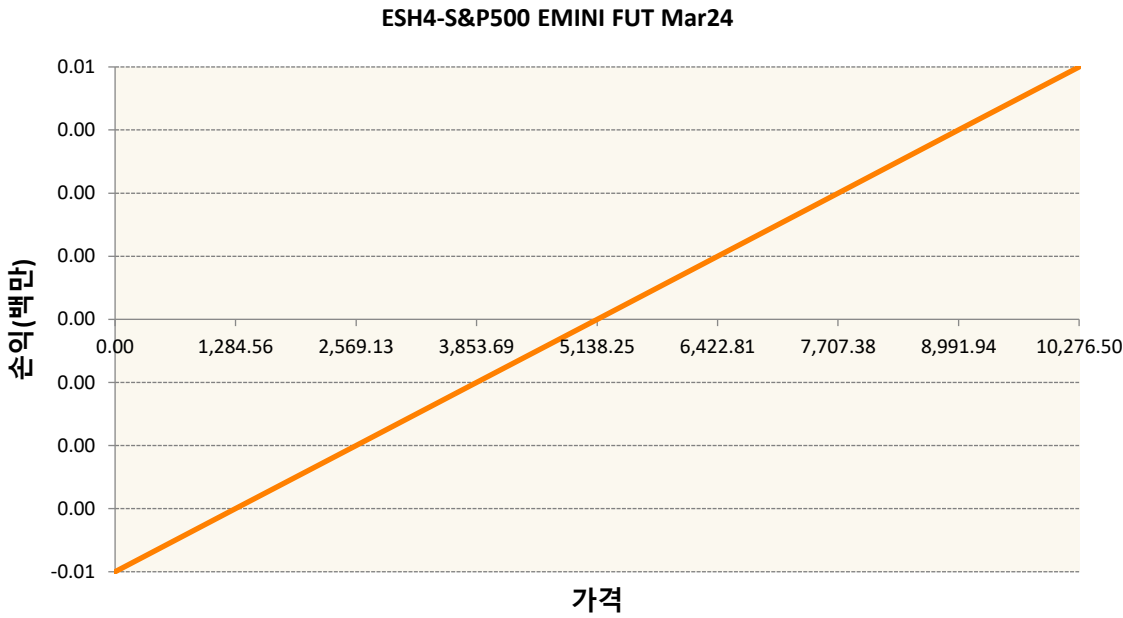
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

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	3,426	0	3,426	
누계	유가증권	선물	1,727	0	1,727	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESH4	S&P500 EMINI FUT Mar24	274
HWAH4	SP500 MIC EMIN FUT Mar24	138

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

공시일	2024-03-06
기준일	2024-03-05

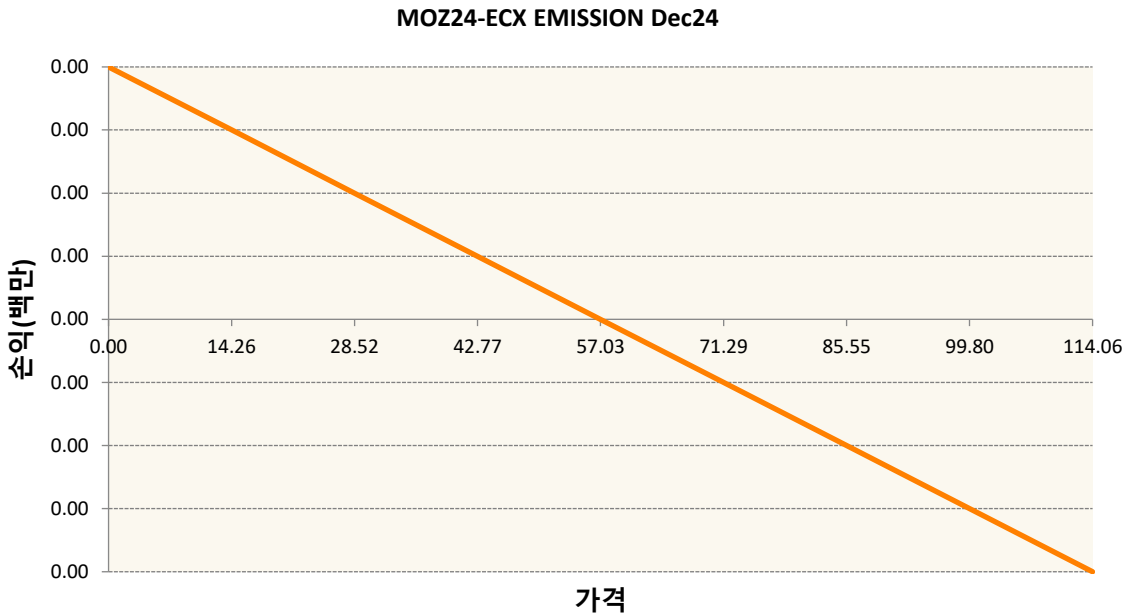
SOL유럽탄소배출권선물인버스ICE특별자산상

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	7,830	-7,830	
누계	지수	스왑	424	0	424	장외
누계	통화	선도	0	2,889	-2,889	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213E2TC KRW/EUR 28-03-24E	84
FXW213E2TC KRW/EUR 28-03-24E	147
MOZ24 ECX EMISSION Dec24	626
SWICEUACN ICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX	9

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

(단위:백만원)

1,242

공시일	2024-03-06
기준일	2024-03-05

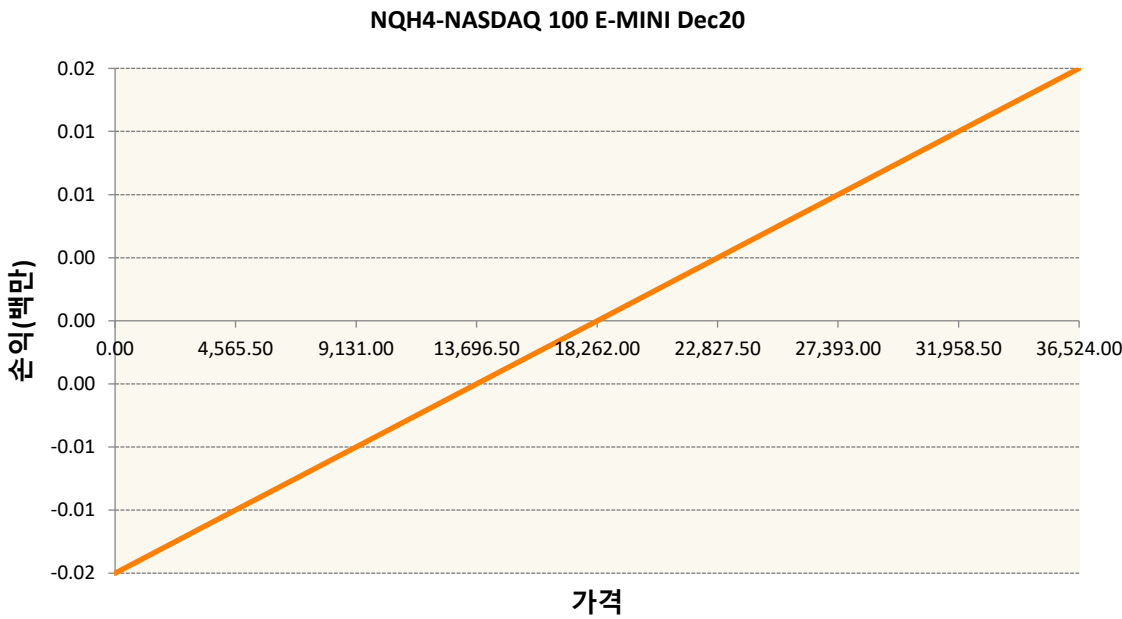
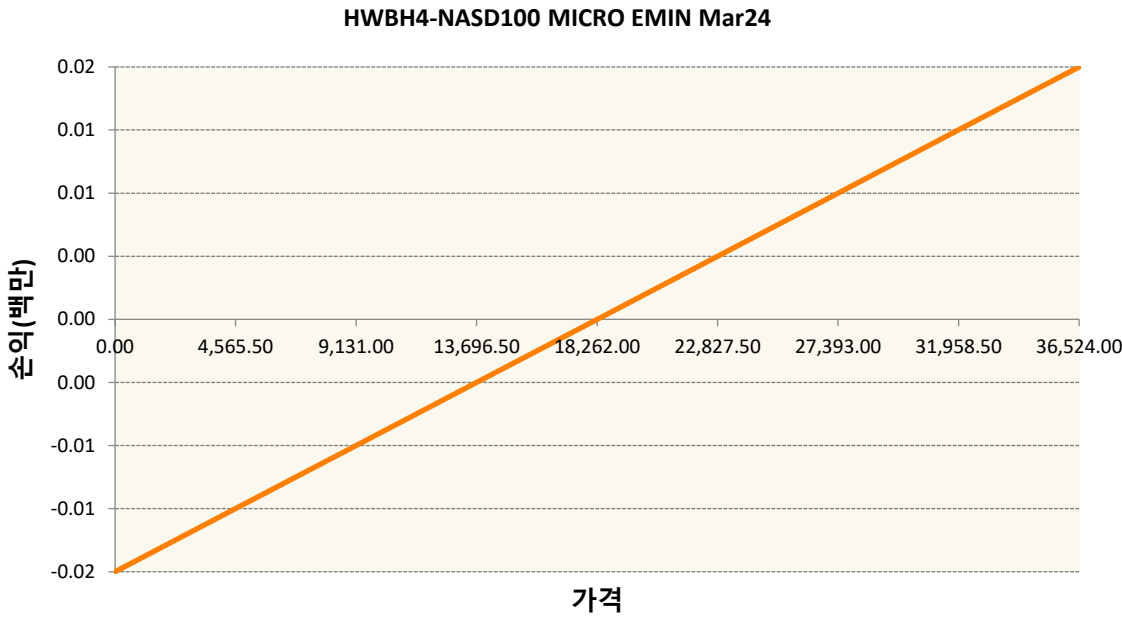
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

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	1,943	0	1,943	
누계	유가증권	선물	2,515	0	2,515	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
HWBH4	NASD100 MICRO EMIN Mar24		201
NQH4	NASDAQ 100 E-MINI Dec20		155

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)			(단위:백만원)
			316

공시일	2024-03-06
기준일	2024-03-05

SOL미국30년국채커버드콜(합성)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	996	0	996	장외
누계	지수	스왑	75,276	0	75,276	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWKEDI0000 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	444
SWKEDI0000 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	1,147
SWKEDI0000 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	4,407
SWKEDI0000 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	80

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

(단위:백만원)

3,942

공시일	2024-03-06
기준일	2024-03-05

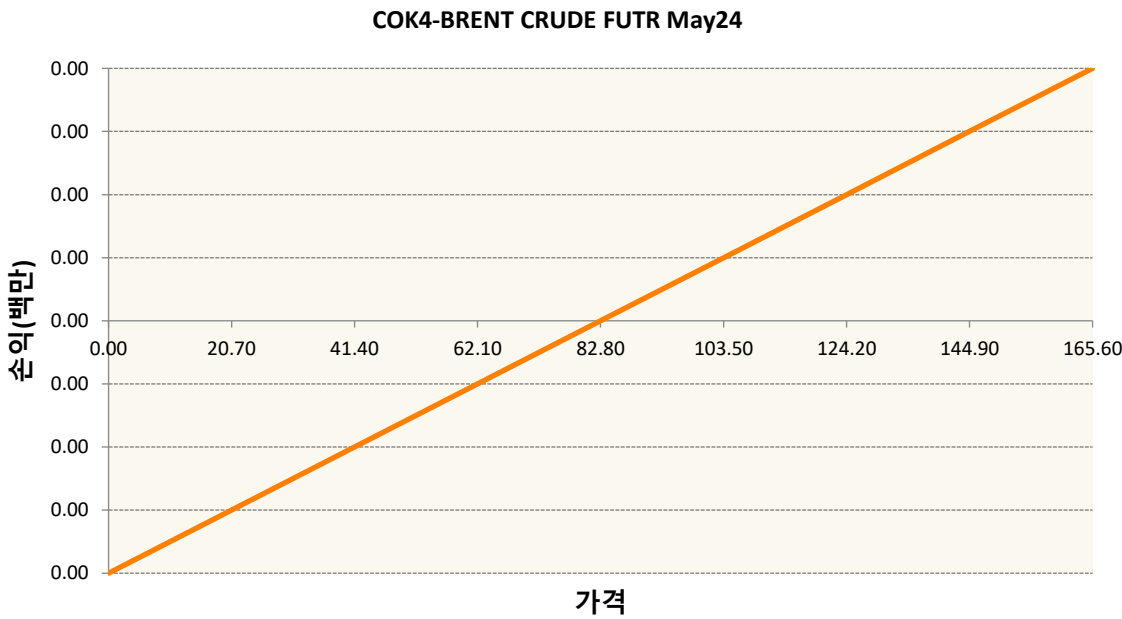
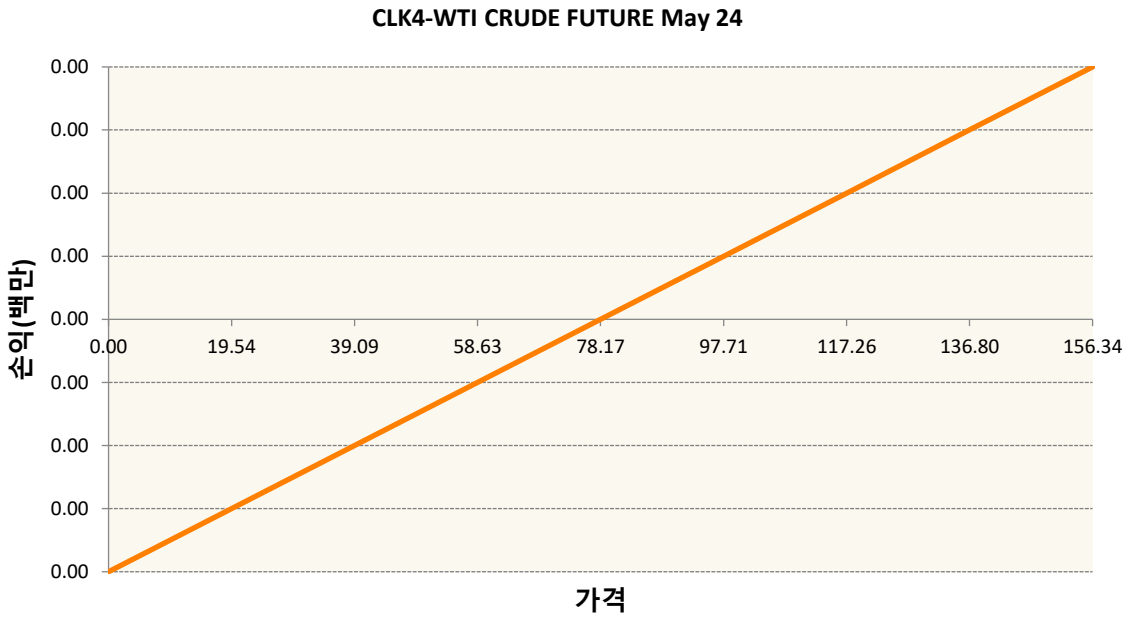
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

1. 계약금액

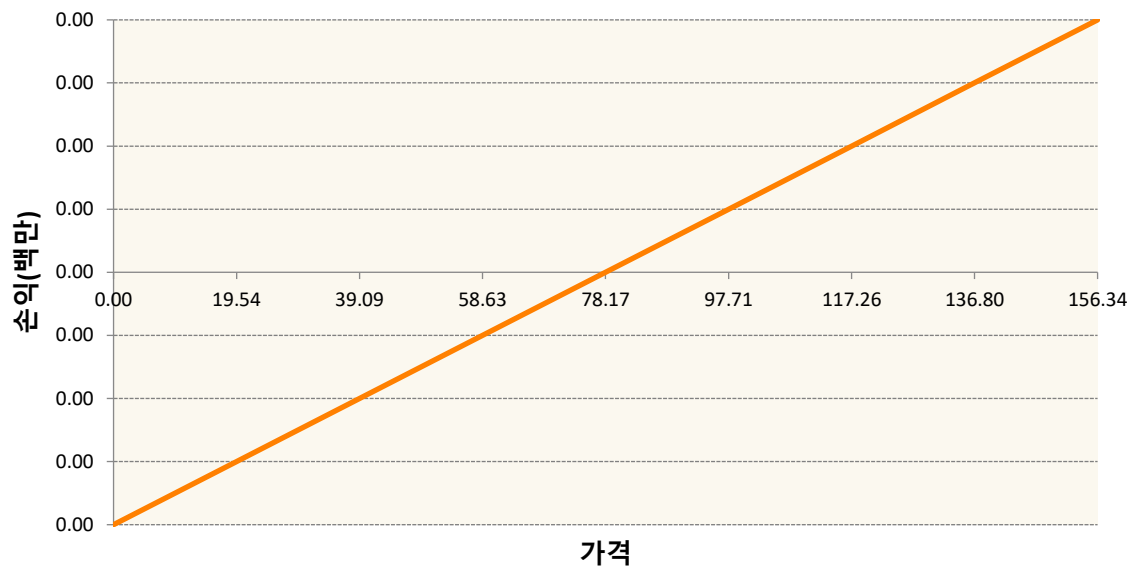
(단위:백만원)

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	1,184	0	1,184	
누계	통화	선물	0	173	-173	장내

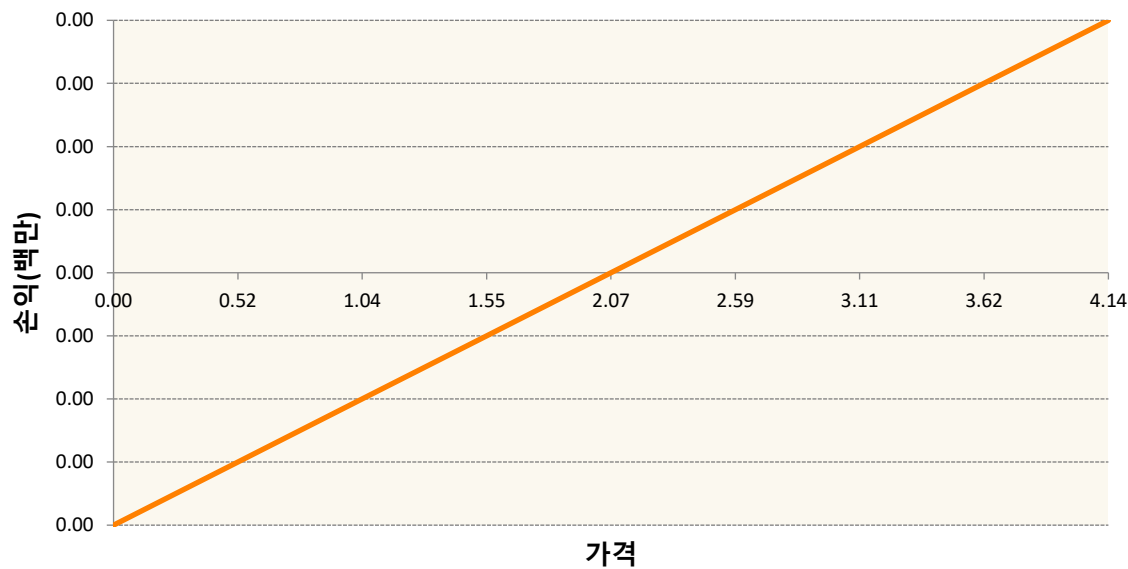
2. 만기시점의 손익구조



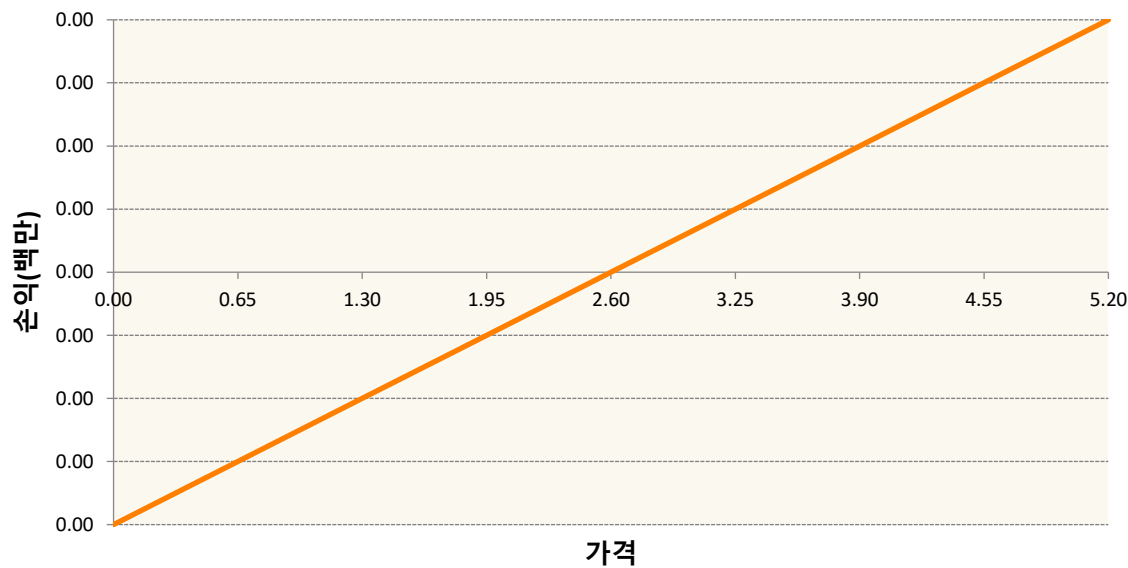
ECK4-E-mini Crude Oil May 24



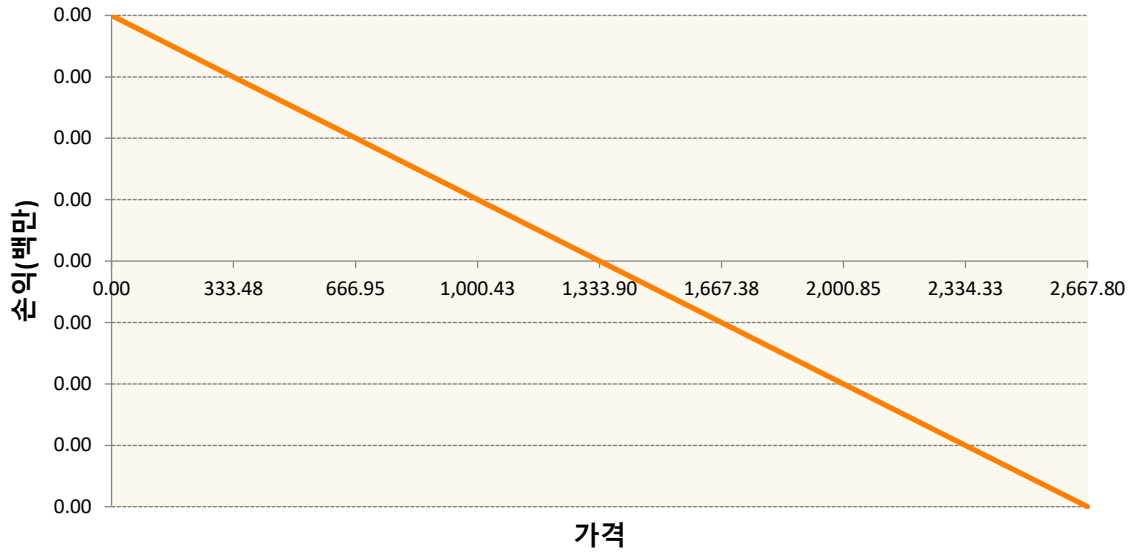
EOK4-E-MINI NATURAL GAS May 24



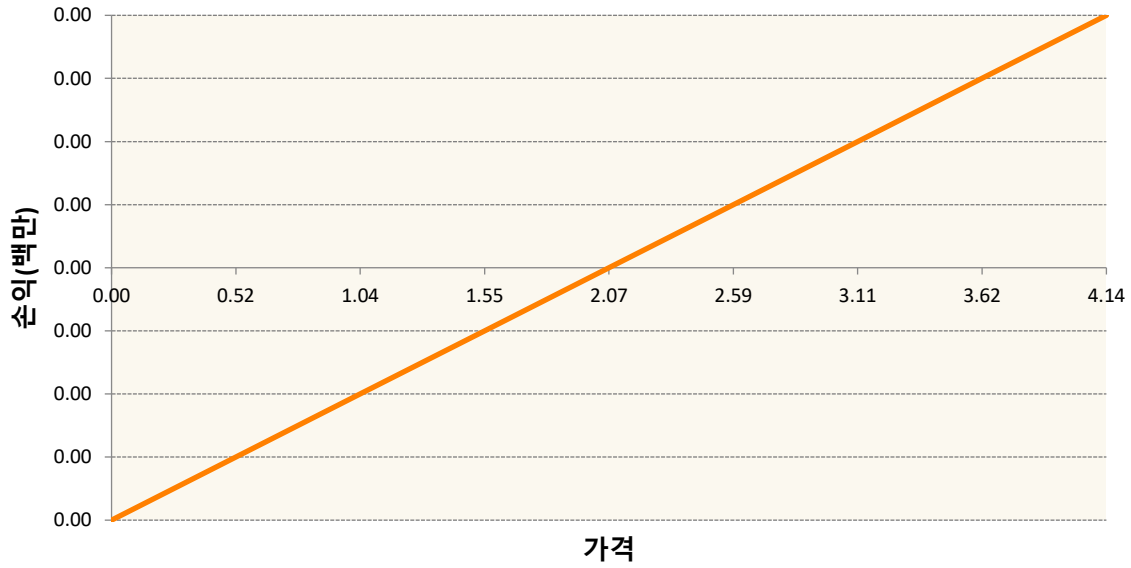
HOK4-NY Harb ULSD Fut May 24



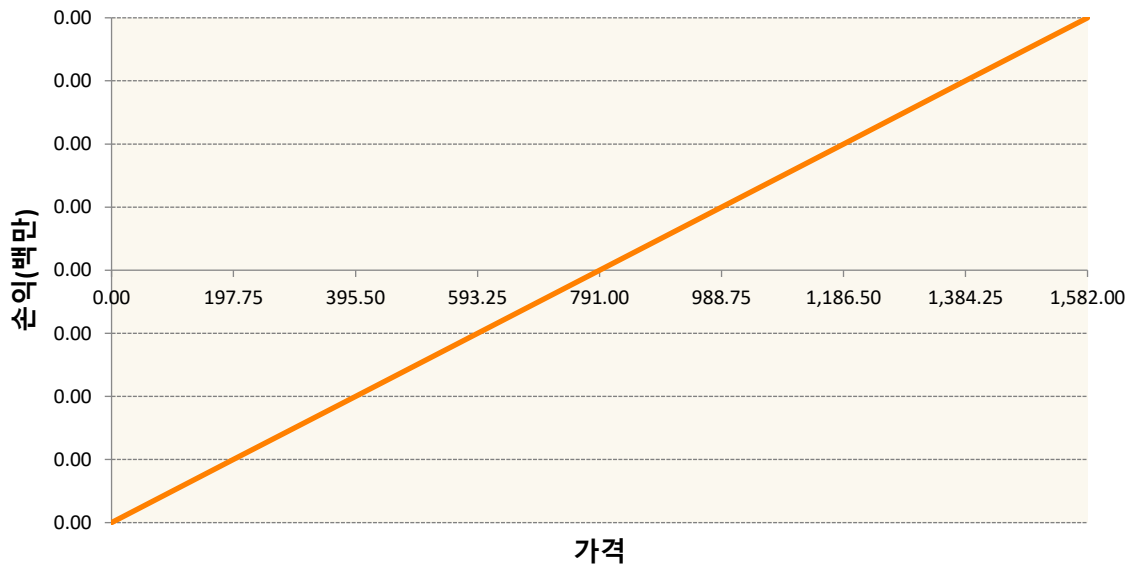
KR4175V30009-2024-03 달러선물

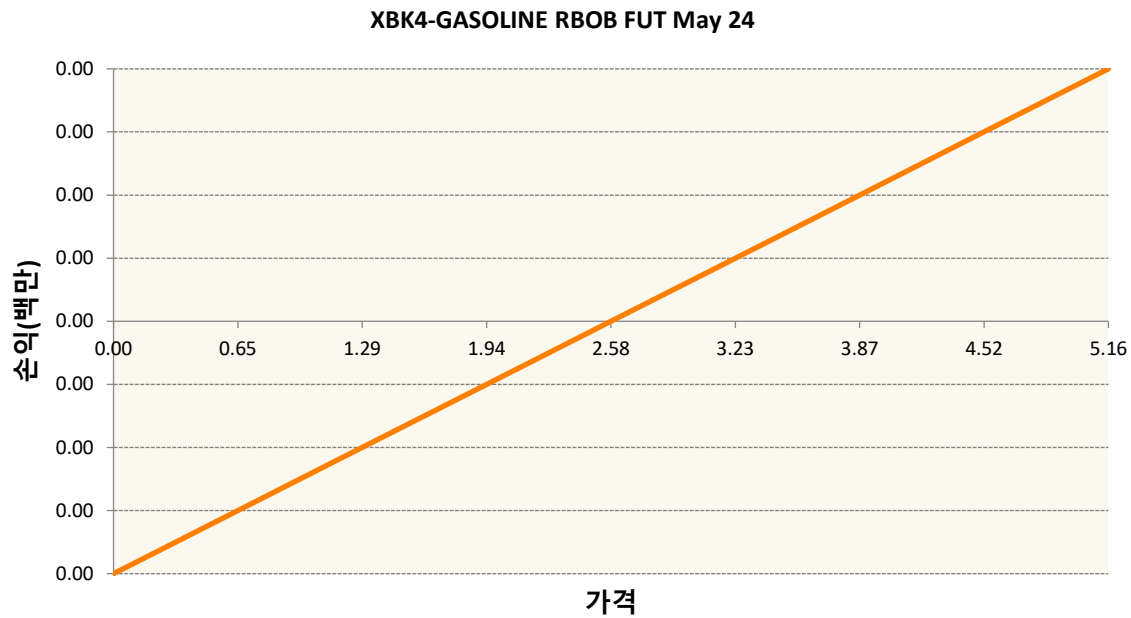


NGK24-NATURAL GAS FUTR May 24



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	16
QSK4	Low Su Gasoil G May 24	8
XBK4	GASOLINE RBOB FUT May 24	12

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