

공시일	2024-03-22
기준일	2024-03-21

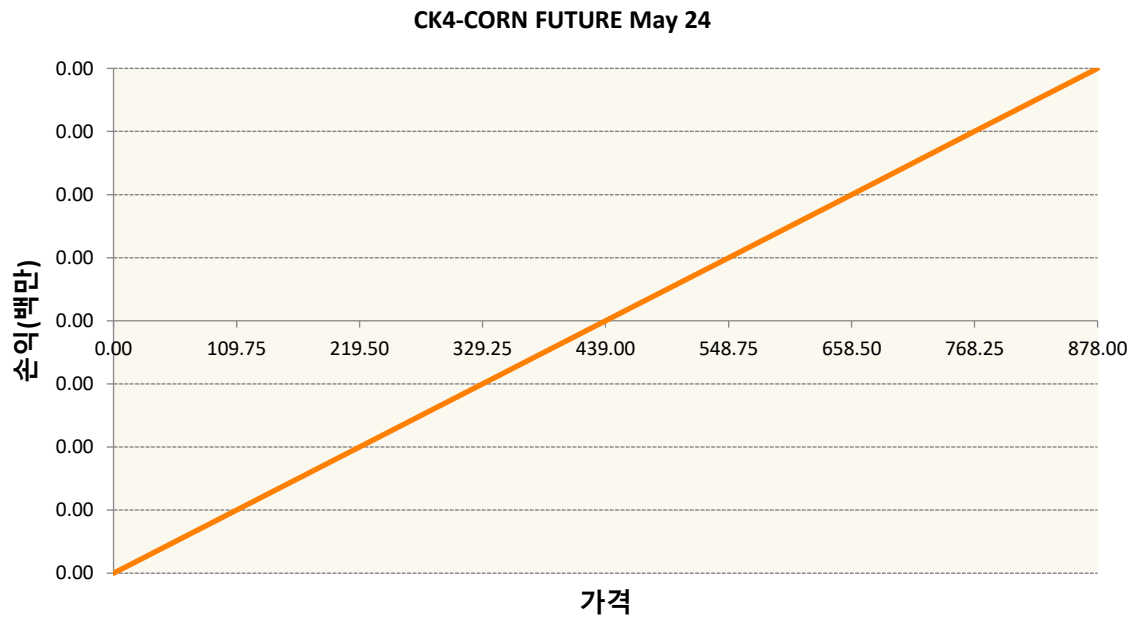
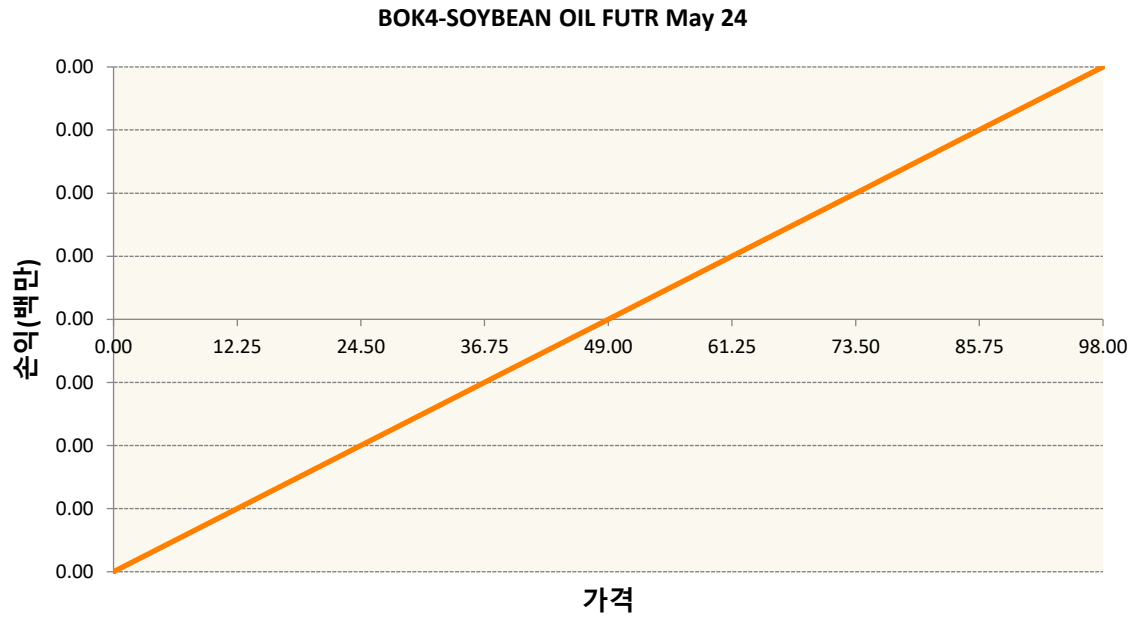
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

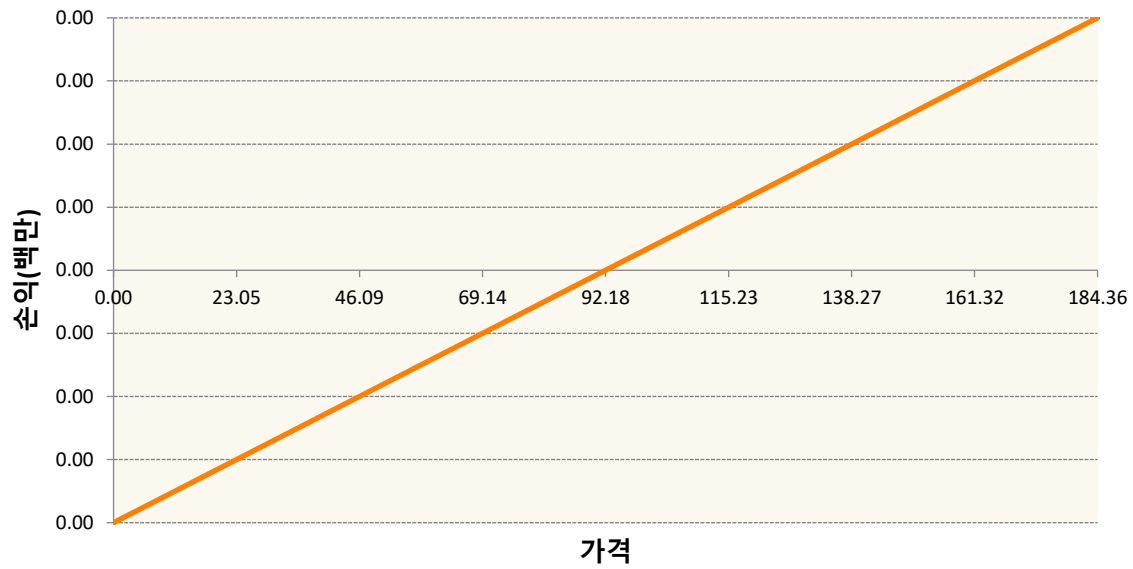
(단위:USD 백만)

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	4,357	0	4,357	
누계	통화	선물	0	529	-529	장내

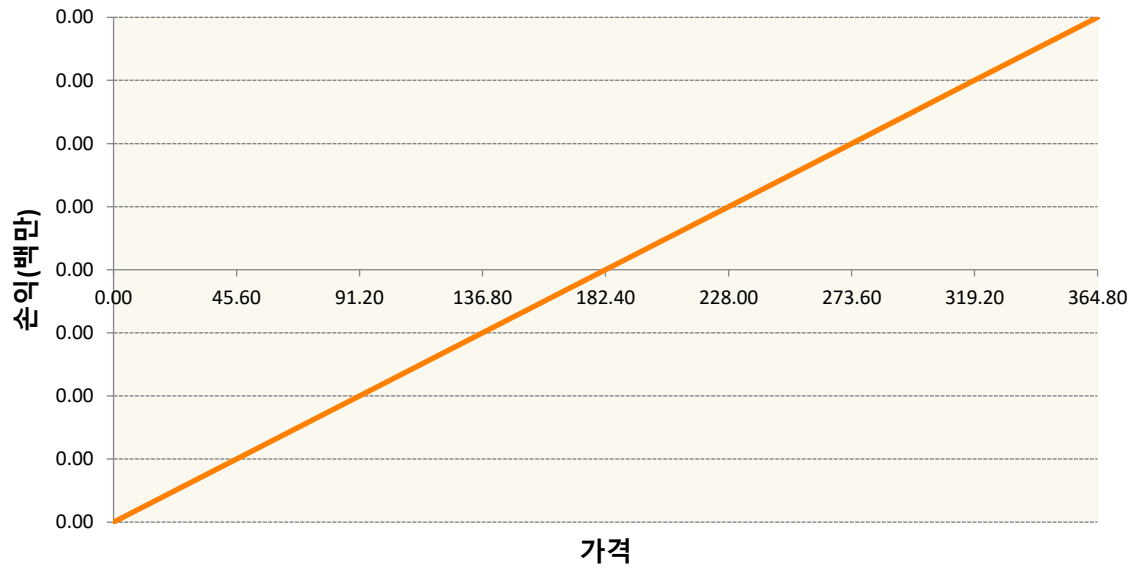
2. 만기시점의 손익구조



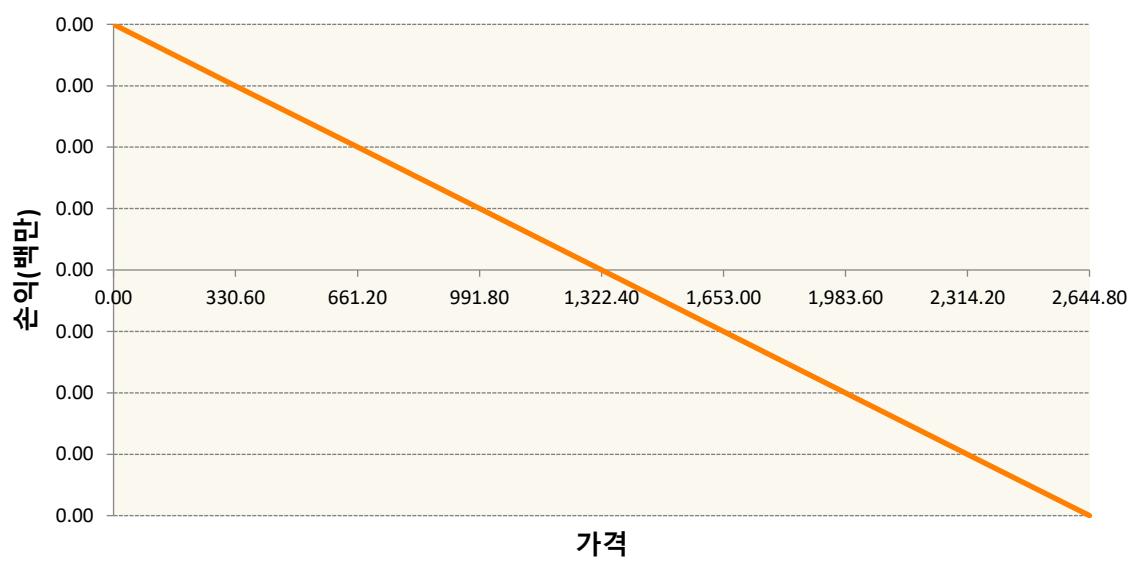
CTK4-COTTON NO.2 FUTR May 24



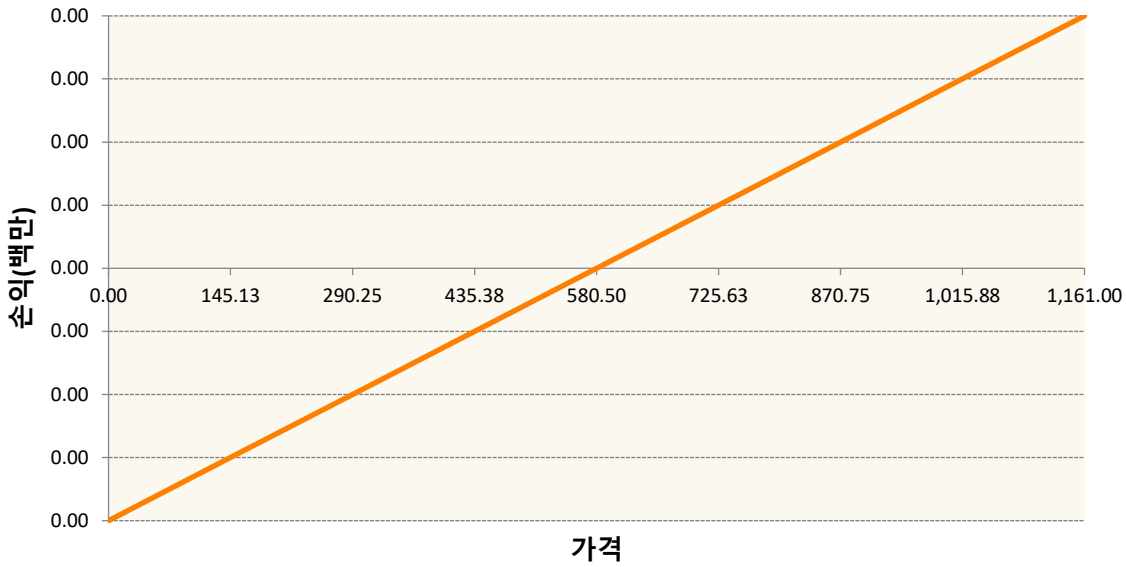
KCK4-COFFEE 'C' FUTURE May 24



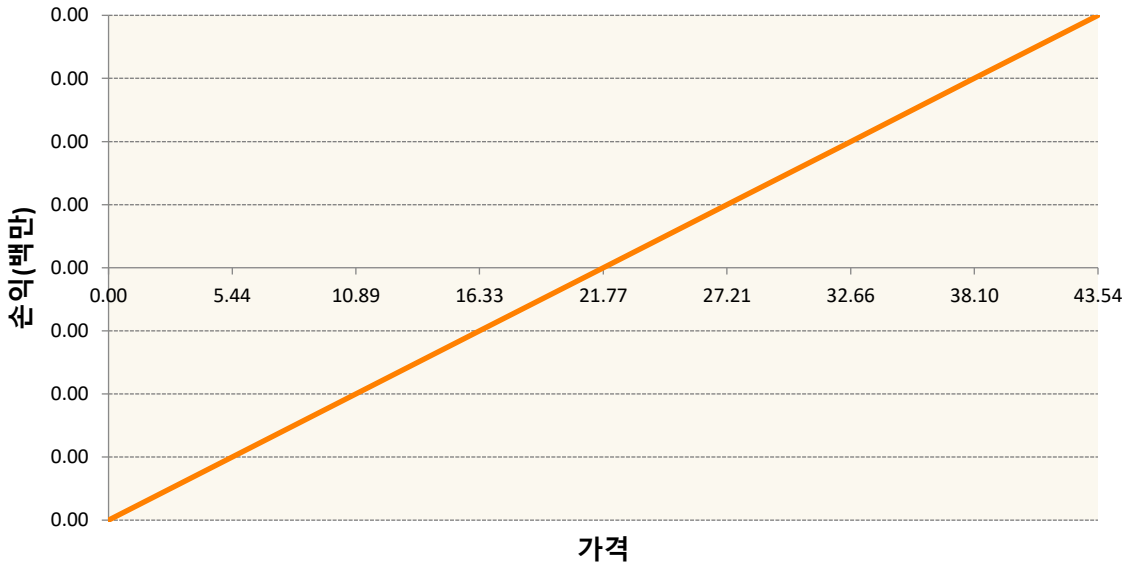
KR4175V40008-2024-04 달러선물



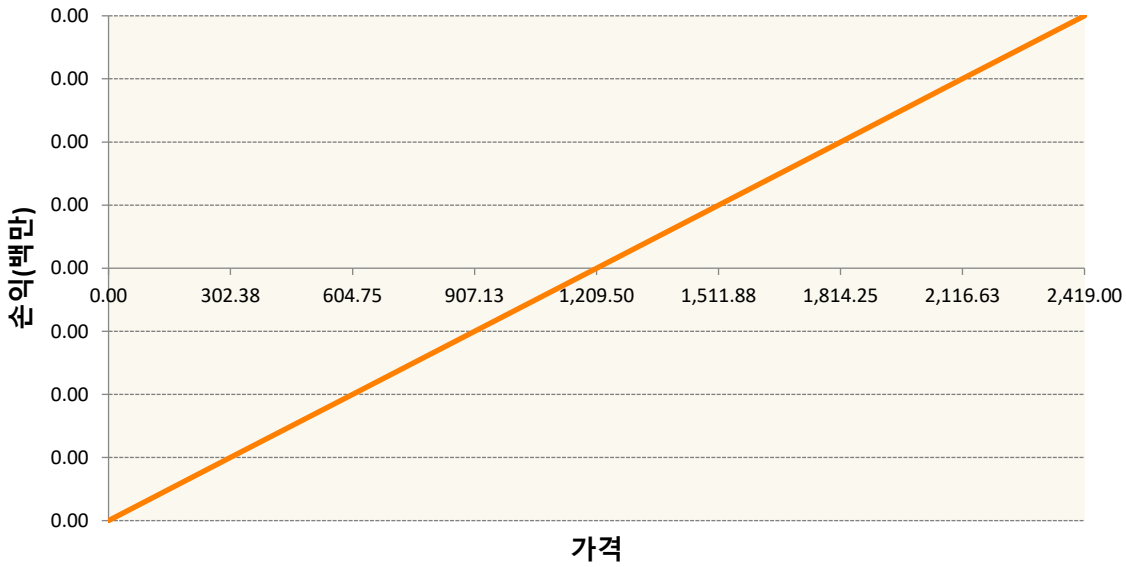
KWK4-KC HRW WHEAT FUT May 24



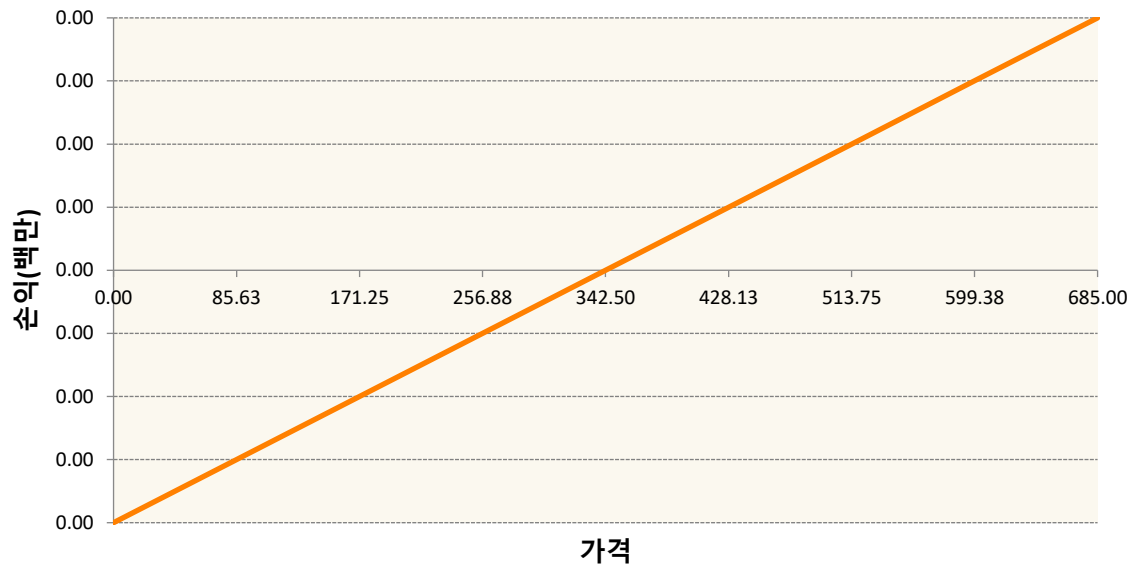
SBK4-Sugar #11 (WORLD) May 24



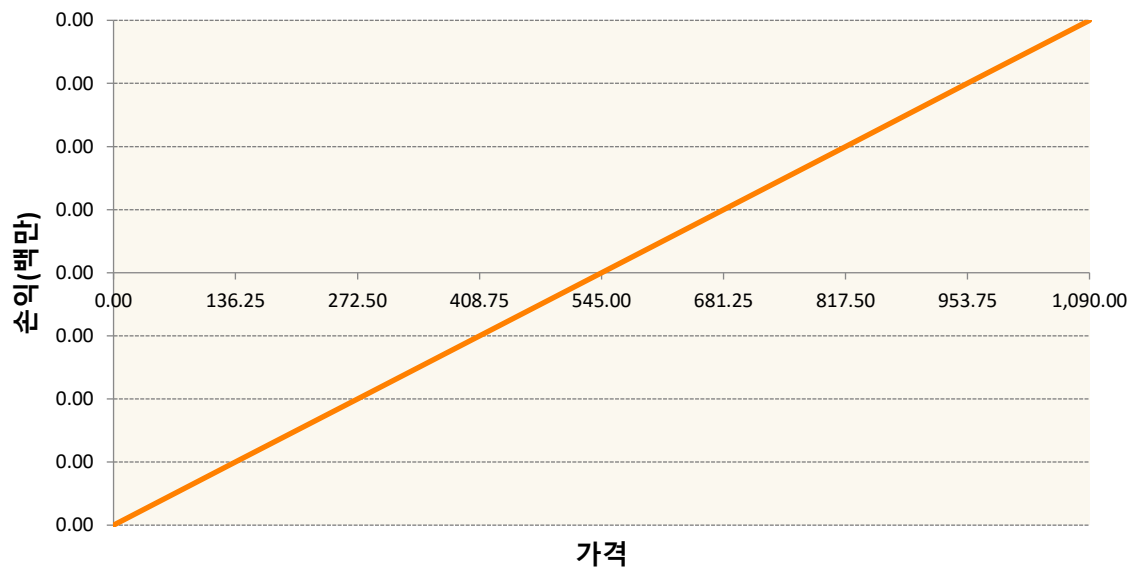
SK4-SOYBEAN FUTURE May 24



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	2024-03-22
기준일	2024-03-21

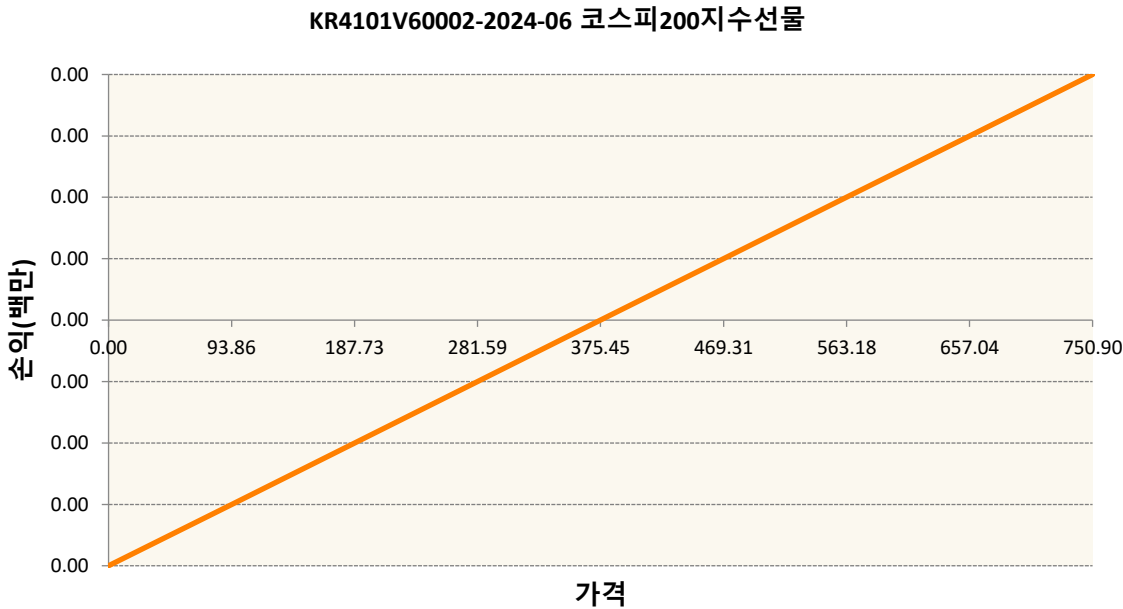
스마트인덱스모

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	2,440	0	2,440	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101V60002		2024-06 코스피200지수선물					194
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-194	-194	-194	-194	-194	-194	-194
-5.33%	-130	-130	-130	-130	-130	-130	-130
-2.67%	-65	-65	-65	-65	-65	-65	-65
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	65	65	65	65	65	65	65
5.33%	130	130	130	130	130	130	130
8.00%	194	194	194	194	194	194	194

공시일	2024-03-22
기준일	2024-03-21

SOL차이나강소기업CSI500상장

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	3,420	3,163	257	장외
누계	지수	스왑	3,420	0	3,420	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 신한CSI500미래231226	274
-----------------------------	-----

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

317

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2024-03-22
기준일	2024-03-21

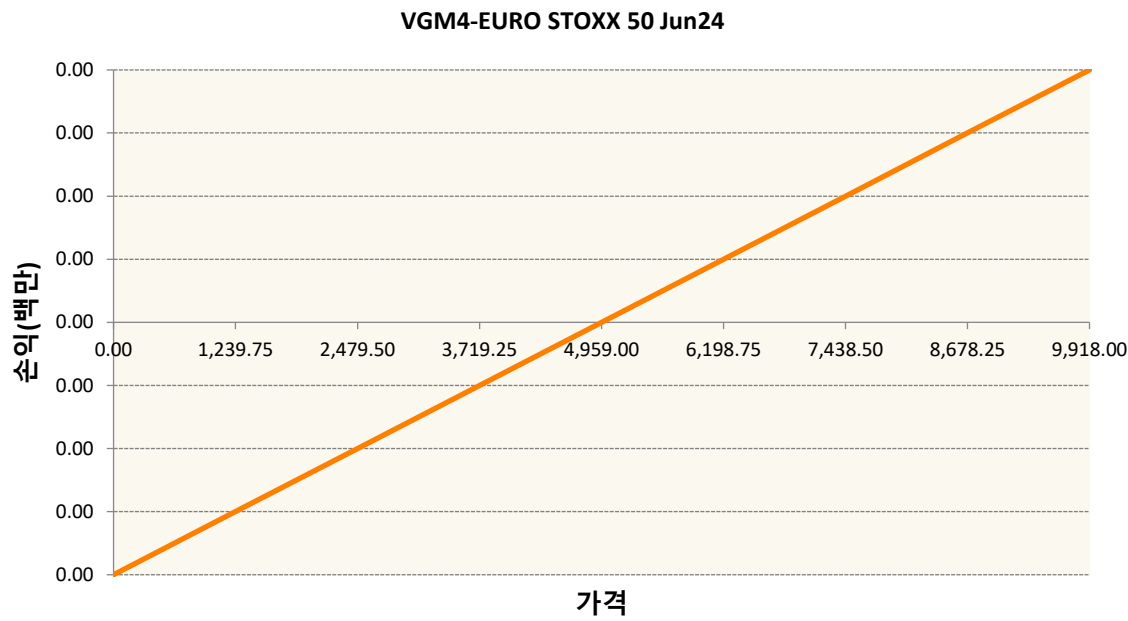
유로인덱스모(주식-파생형)

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	996	0	996	
누계	통화	선도	434	217	217	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213DCL	EUR/KRW 22-03-24E	17
FXW213E3K	EUR/KRW 21-06-24E	17
FXW213E3K	KRW/EUR 22-03-24E	17
VGM4	EURO STOXX 50 Jun24	80

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

(단위:백만원)

88

공시일	2024-03-22
기준일	2024-03-21

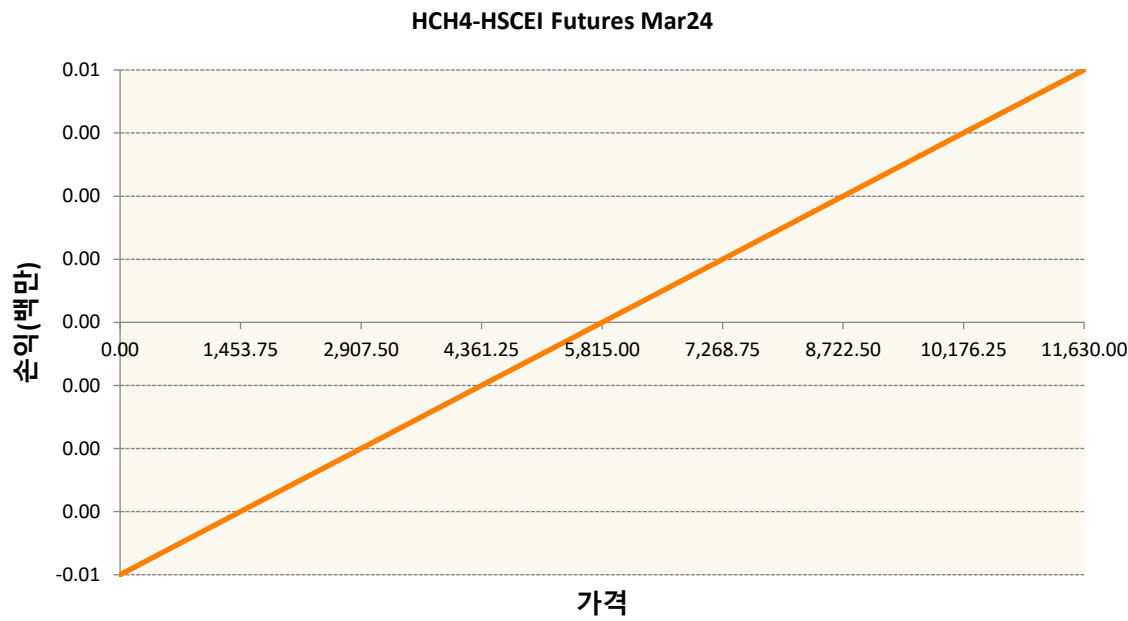
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,087	0	1,087	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCH4	HSCEI Futures Mar24	87
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

122

공시일	2024-03-22
기준일	2024-03-21

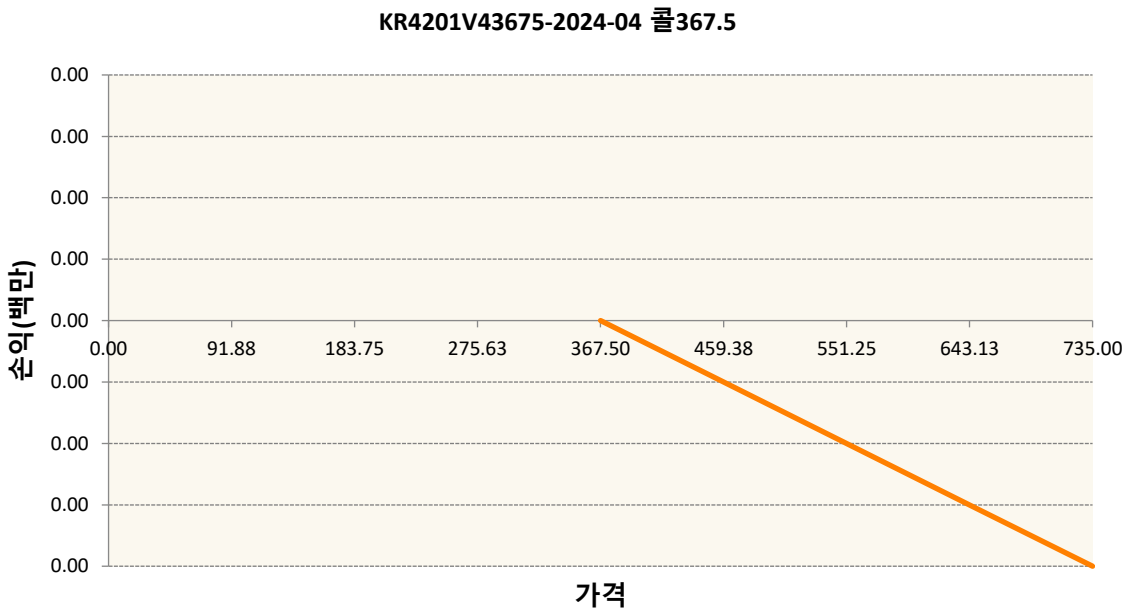
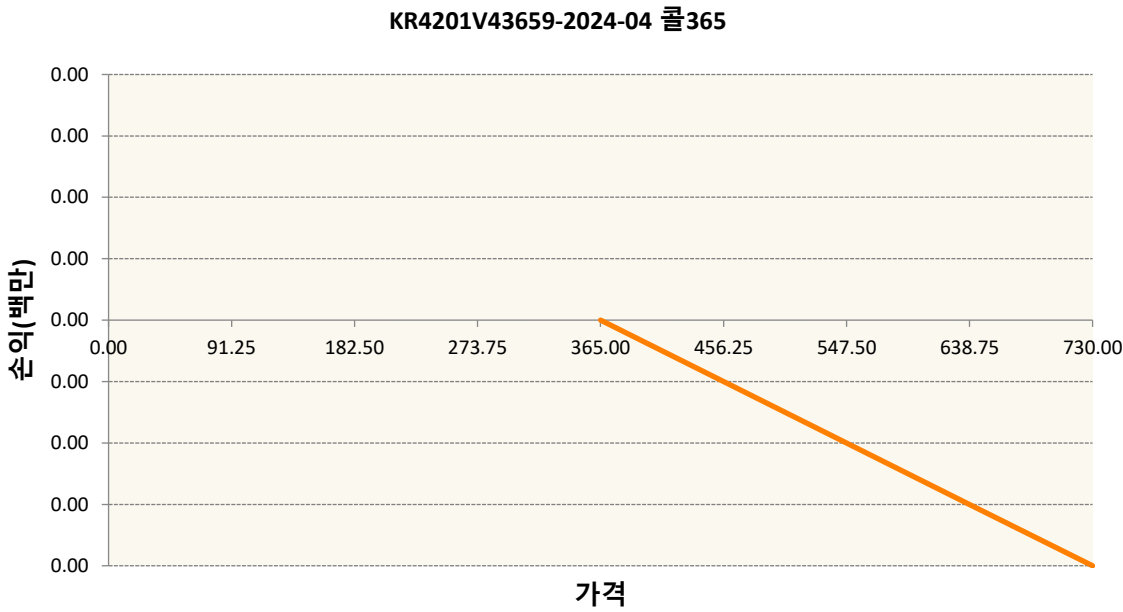
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

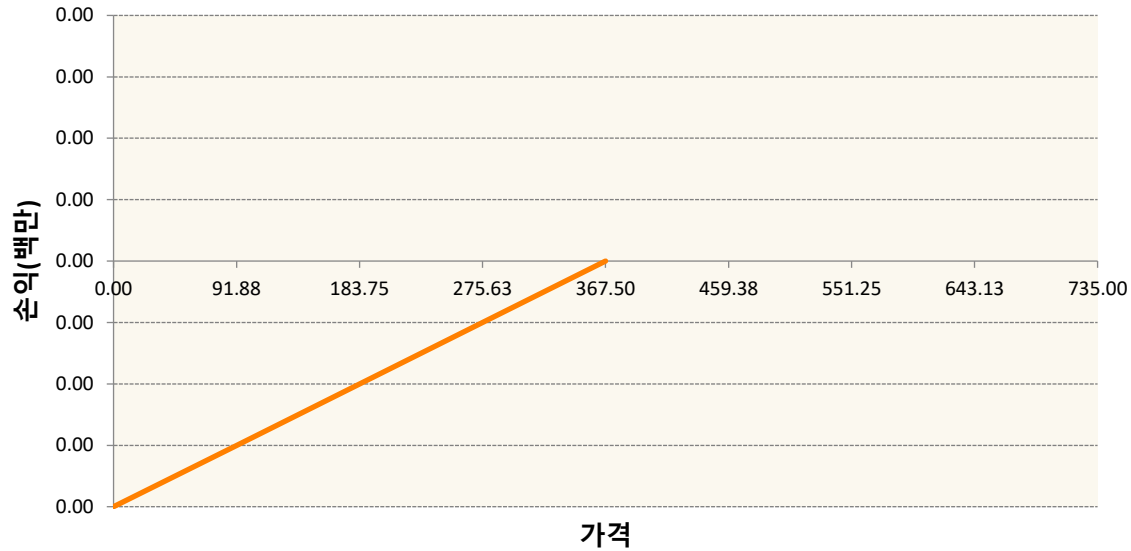
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	443	0	443	장내
누계	유가증권	옵션	0	47,856	-47,856	장내

2. 만기시점의 손익구조



KR4301V43673-2024-04 풋367.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201V43659		2024-04 콜365					1,131
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	470	467	461	455	447	438	429
-5.33%	437	424	410	395	379	363	346
-2.67%	311	291	270	250	229	209	188
0%	50	34	17	0	-18	-36	-54
2.67%	-313	-319	-327	-336	-347	-359	-371
5.33%	-714	-716	-718	-721	-726	-731	-738
8.00%	-1,124	-1,124	-1,125	-1,125	-1,127	-1,129	-1,131
KR4201V43675		2024-04 콜367.5					1,784
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	650	646	640	632	622	611	597
-5.33%	614	597	578	557	535	511	487
-2.67%	458	426	394	362	330	297	264
0%	90	61	31	0	-31	-63	-94
2.67%	-465	-479	-495	-514	-534	-556	-579
5.33%	-1,105	-1,109	-1,114	-1,122	-1,131	-1,142	-1,156
8.00%	-1,767	-1,767	-1,768	-1,770	-1,773	-1,778	-1,784
KR4301V43673		2024-04 풋367.5					470
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-453	-454	-456	-459	-462	-466	-470
-5.33%	-241	-247	-253	-260	-268	-275	-284
-2.67%	-69	-80	-91	-102	-113	-124	-135
0%	30	20	10	0	-10	-21	-32

2.67%	67	62	57	51	44	36	29
5.33%	75	74	72	70	67	63	58
8.00%	76	76	76	75	74	73	71

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

(단위:백만원)

3,712

공시일	2024-03-22
기준일	2024-03-21

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	1,691	0	1,691	

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	2024-03-22
기준일	2024-03-21

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	4,420	0	4,420	

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	2024-03-22
기준일	2024-03-21

H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	394	-394	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	15,647	0	15,647	
누계	통화	선도	1,058	16,642	-15,584	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213DCT KRW/USD 29-03-24E	513
FXW213E1W KRW/USD 30-04-24E	247
FXW213E2L0 USD/KRW 29-03-24E	85
FXW213E2TC KRW/USD 31-05-24E	571
IE00BD8RGM75	

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

678

공시일	2024-03-22
기준일	2024-03-21

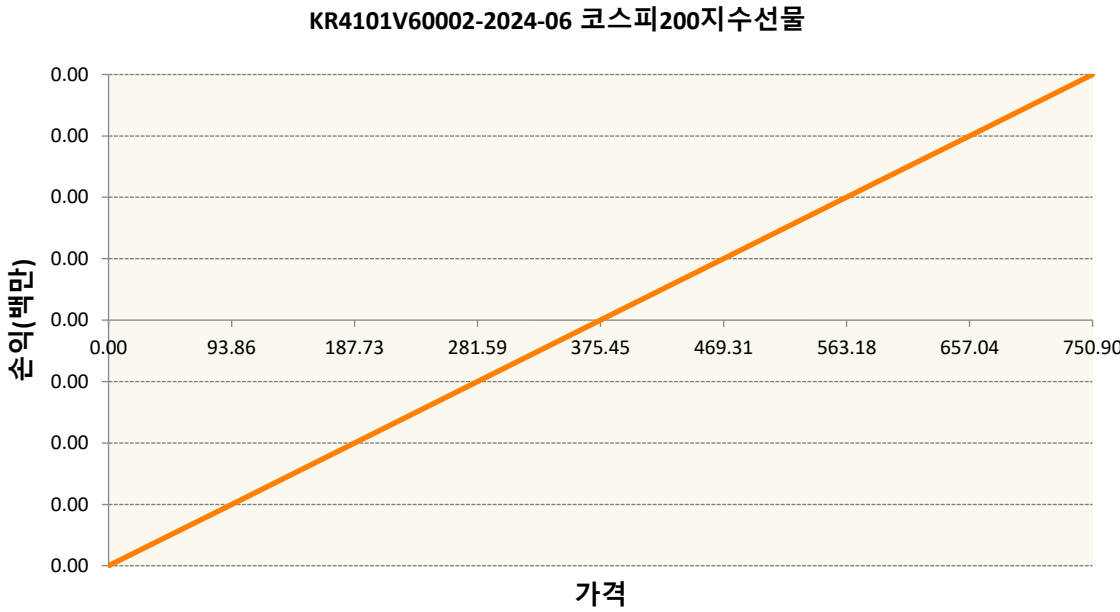
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	94	-94	장내
누계	유가증권	선물	845	0	845	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101V60002		2024-06 코스피200지수선물					67
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-67	-67	-67	-67	-67	-67	-67
-5.33%	-45	-45	-45	-45	-45	-45	-45
-2.67%	-22	-22	-22	-22	-22	-22	-22
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	22	22	22	22	22	22	22
5.33%	45	45	45	45	45	45	45
8.00%	67	67	67	67	67	67	67

공시일	2024-03-22
기준일	2024-03-21

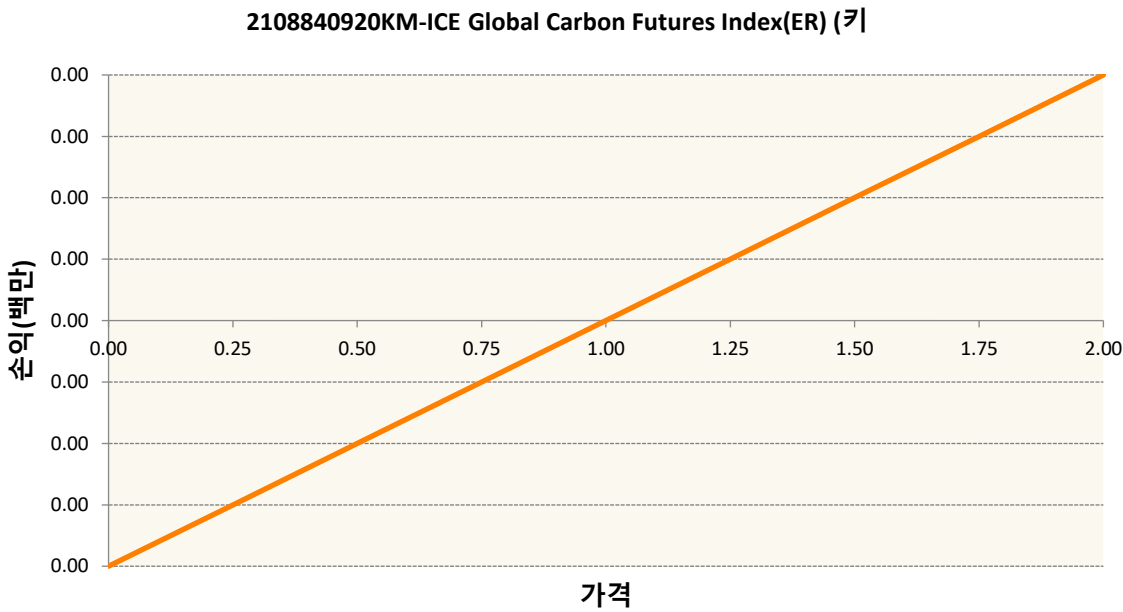
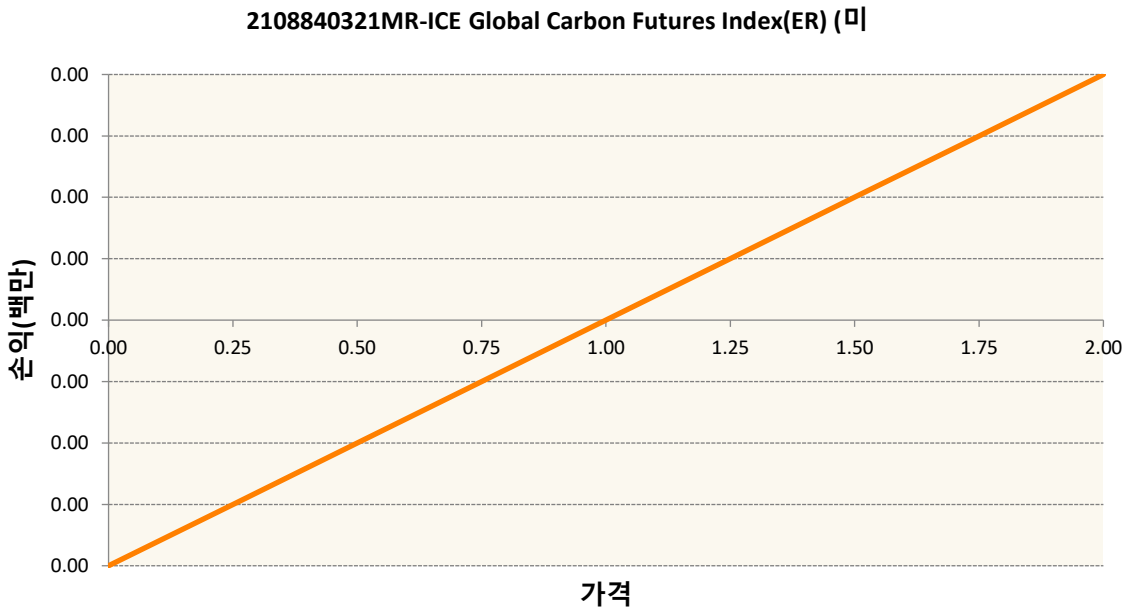
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

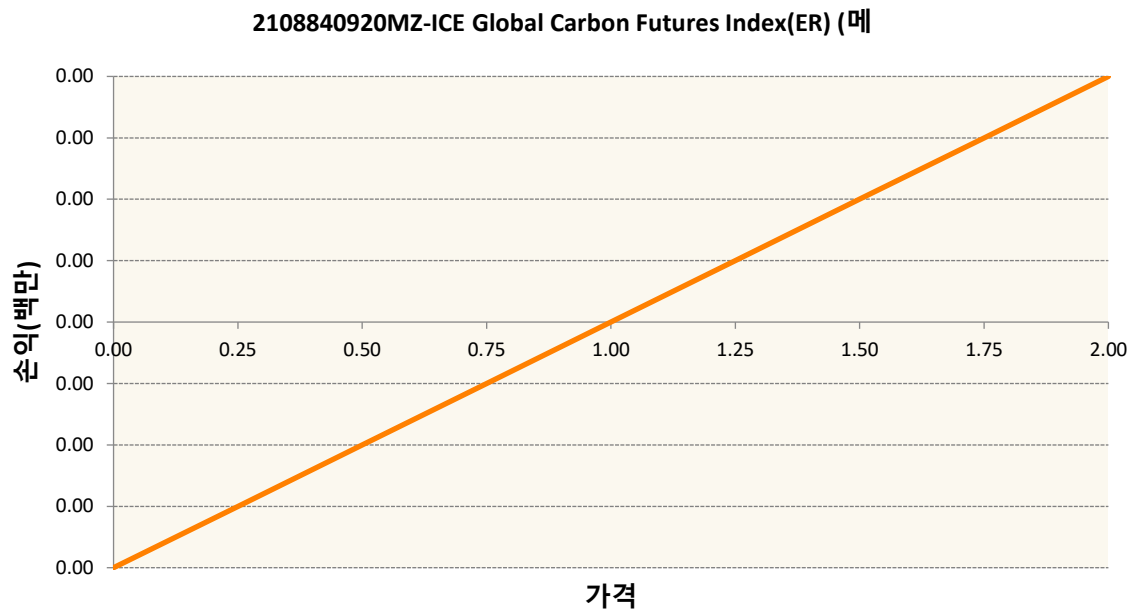
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	18,440	12,965	5,475	
누계	유가증권	선물	18,440	0	18,440	

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108840321IICE Global Carbon Futures Index(ER) (미		432
2108840920IICE Global Carbon Futures Index(ER) (키		864
2108840920IICE Global Carbon Futures Index(ER) (메		173

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,706

공시일	2024-03-22
기준일	2024-03-21

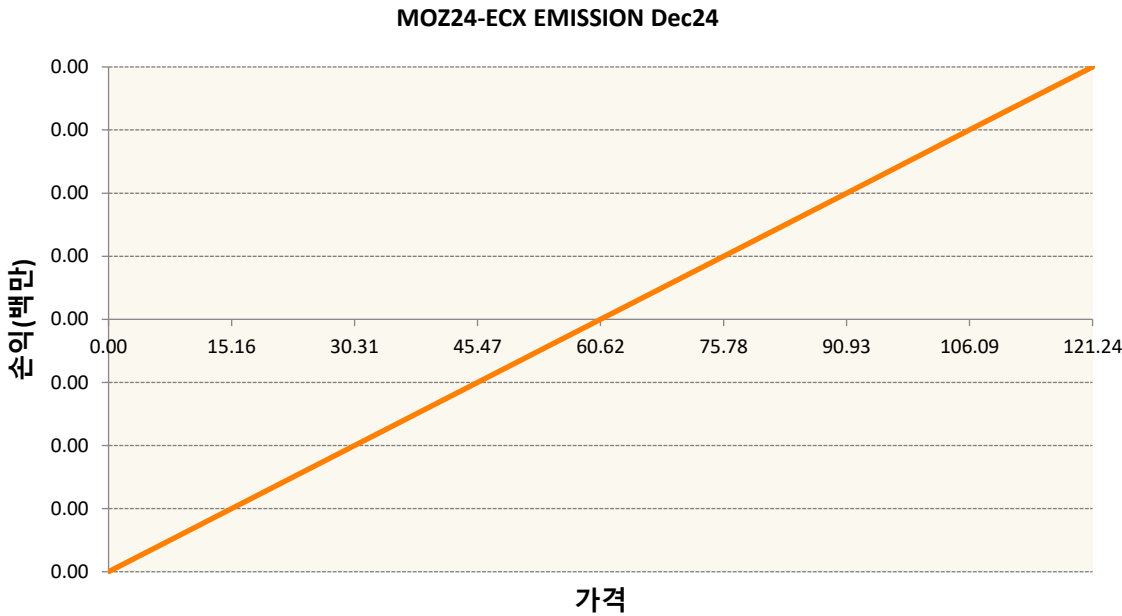
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	93	-93	장외
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	9,067	0	9,067	
누계	지수	스왑	331	0	331	장외
누계	통화	선도	0	2,241	-2,241	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213E2TC KRW/EUR 28-03-24E	179
MOZ24 ECX EMISSION Dec24	725
SWICEUACN ICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX	0.1

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

(단위:백만원)

1,344

공시일	2024-03-22
기준일	2024-03-21

신한SOL차이나태양광CSI증권상장

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	578	0	578	장외
누계	지수	스왑	4,948	0	4,948	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)

7

공시일	2024-03-22
기준일	2024-03-21

SOL차이나육성산업액티브상장지

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	142	-142	장외
누계	지수	스왑	6,101	0	6,101	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(미래)	2
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(NH)	1
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(메리츠)	2
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(키움)	0.38

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

(단위:백만원)

6

공시일	2024-03-22
기준일	2024-03-21

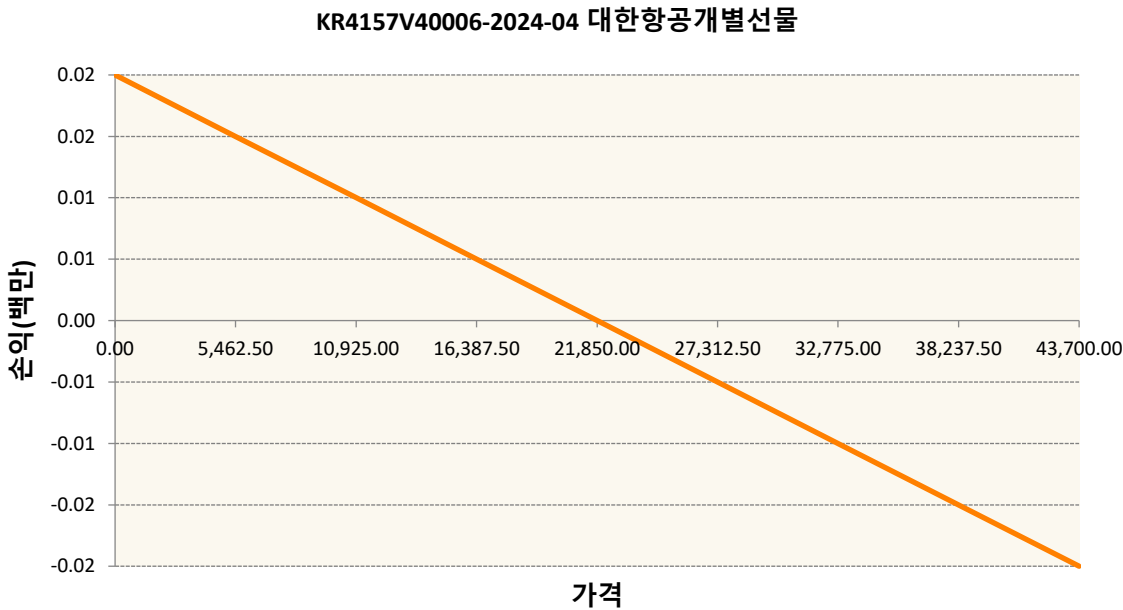
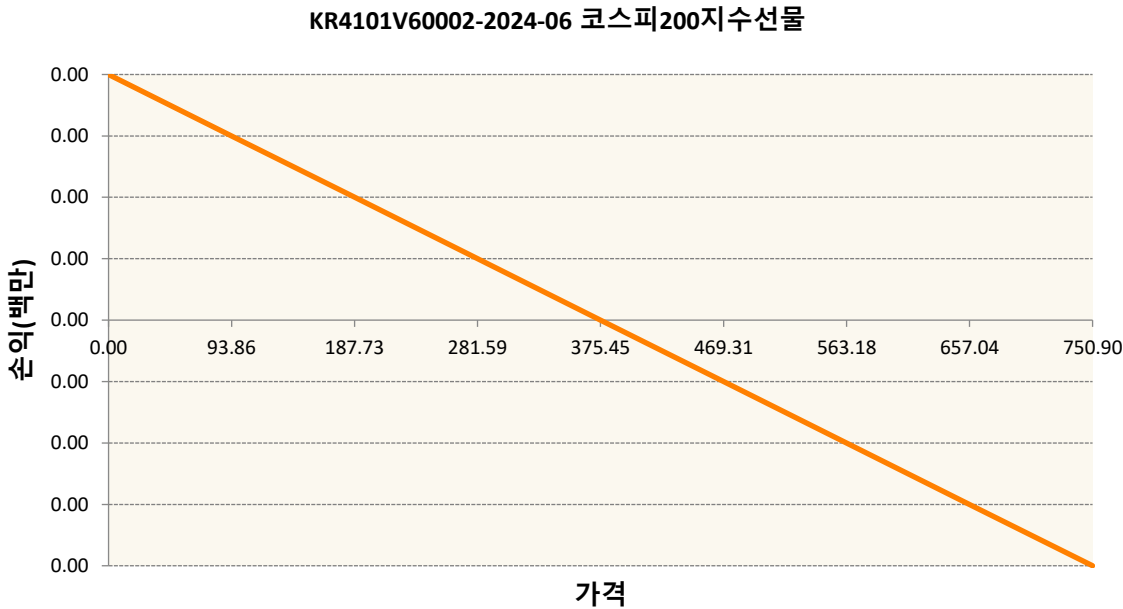
에퀴티알파일반사모혼합자산

1. 계약금액

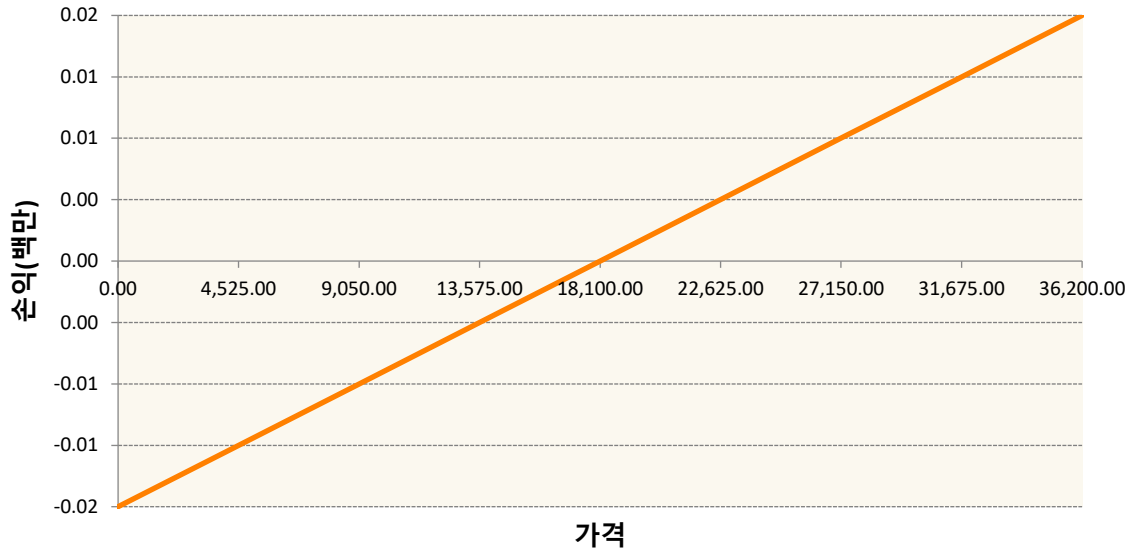
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	44	-44	장내
누계	유가증권	선물	49	1,026	-976	장내

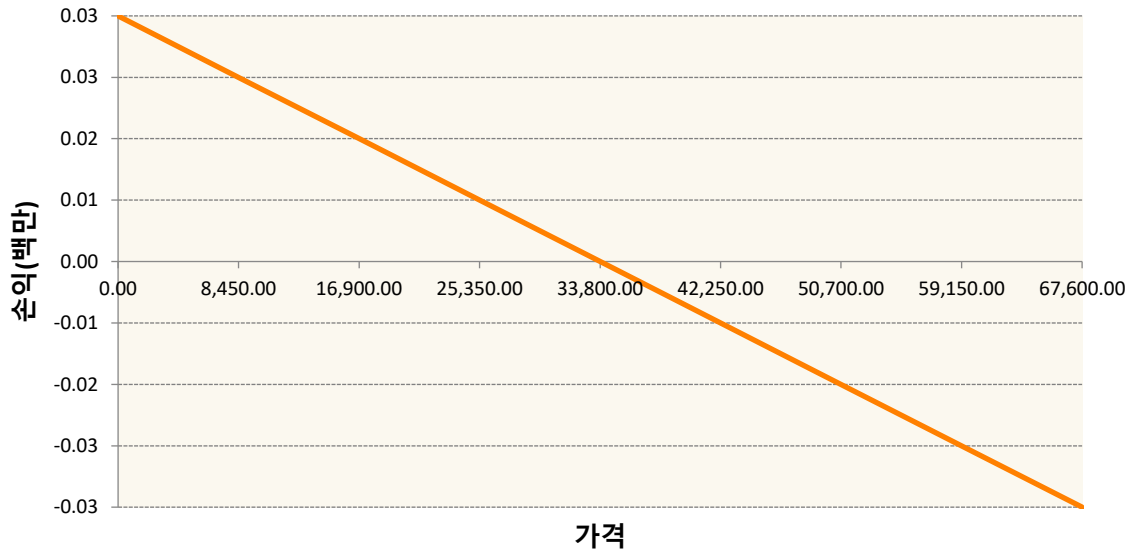
2. 만기시점의 손익구조



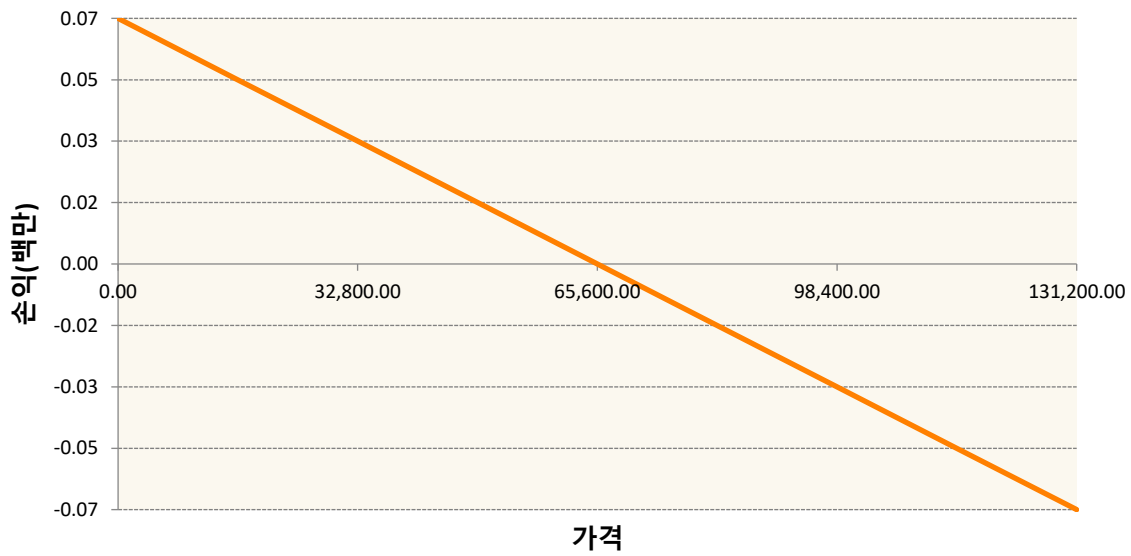
KR41B9V40005-2024-04 두산에너빌리티개별선물



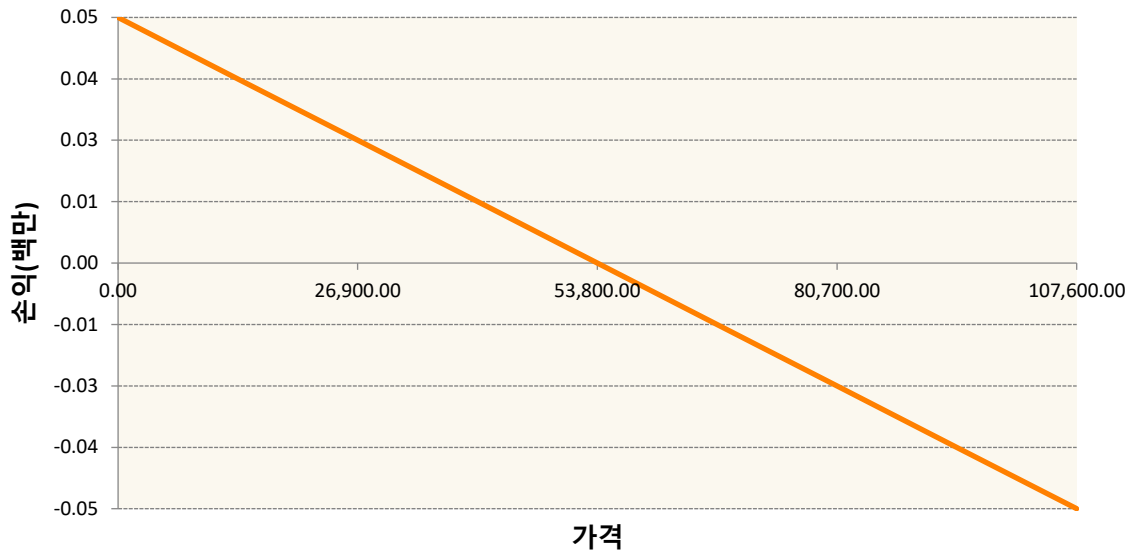
KR41BNV40005-2024-04 현대건설개별선물



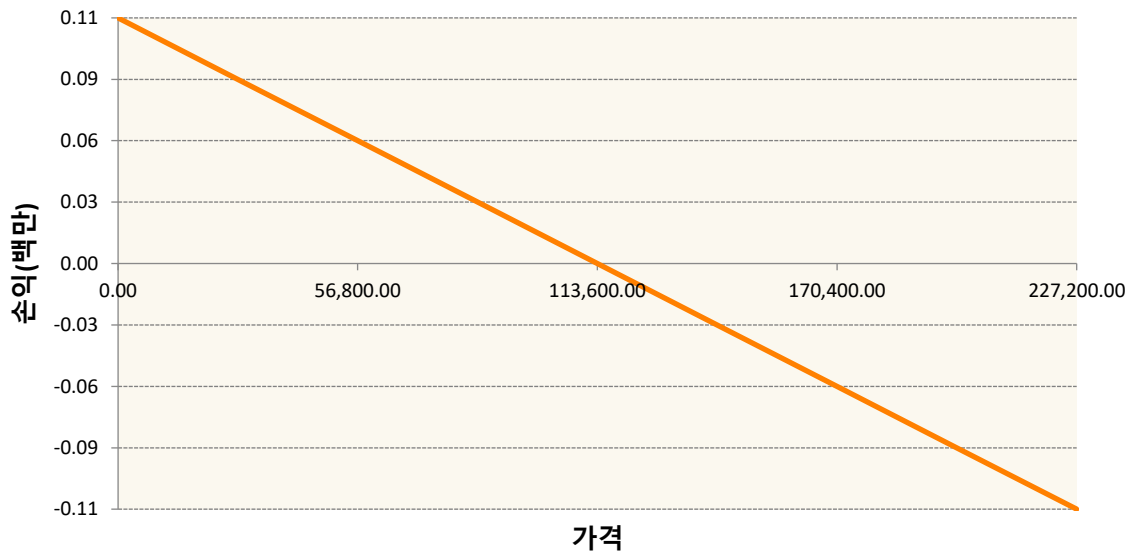
KR41CDV40004-2024-04 현대미포조선개별선물



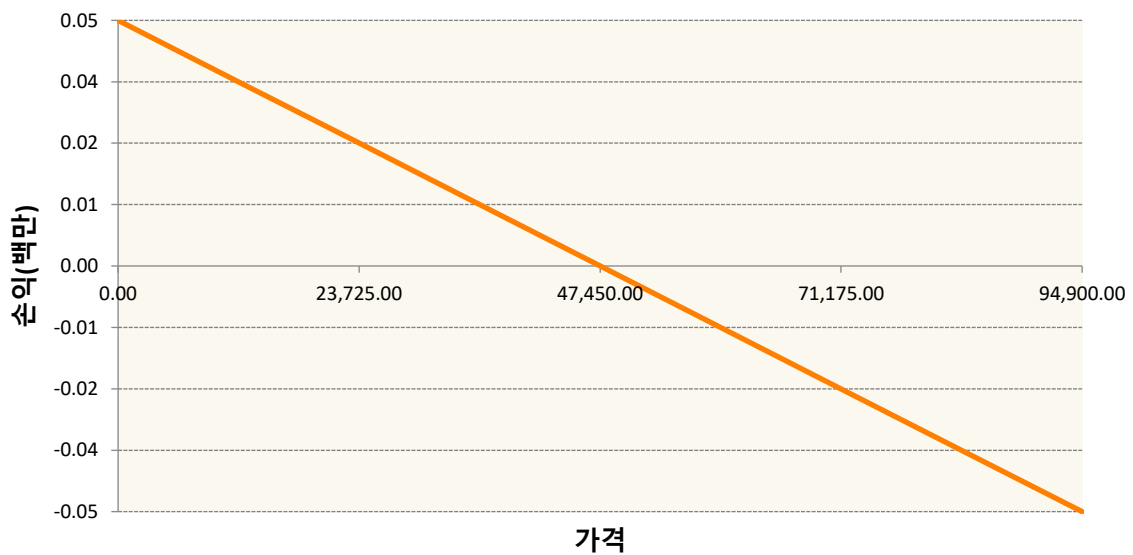
KR41CFV40009-2024-04 카카오개별선물



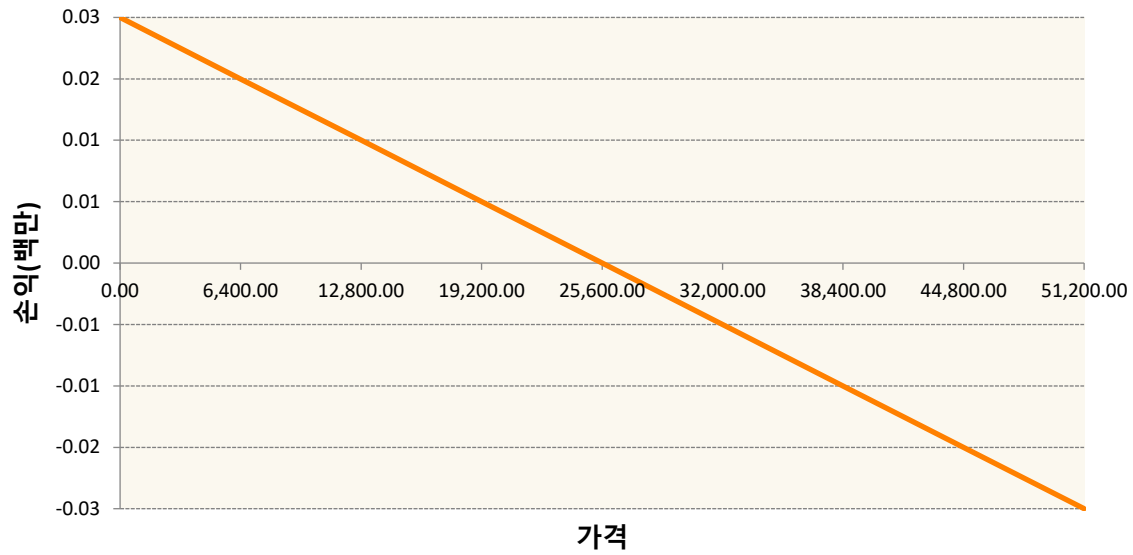
KR41EJV40007-2024-04 SKC개별선물



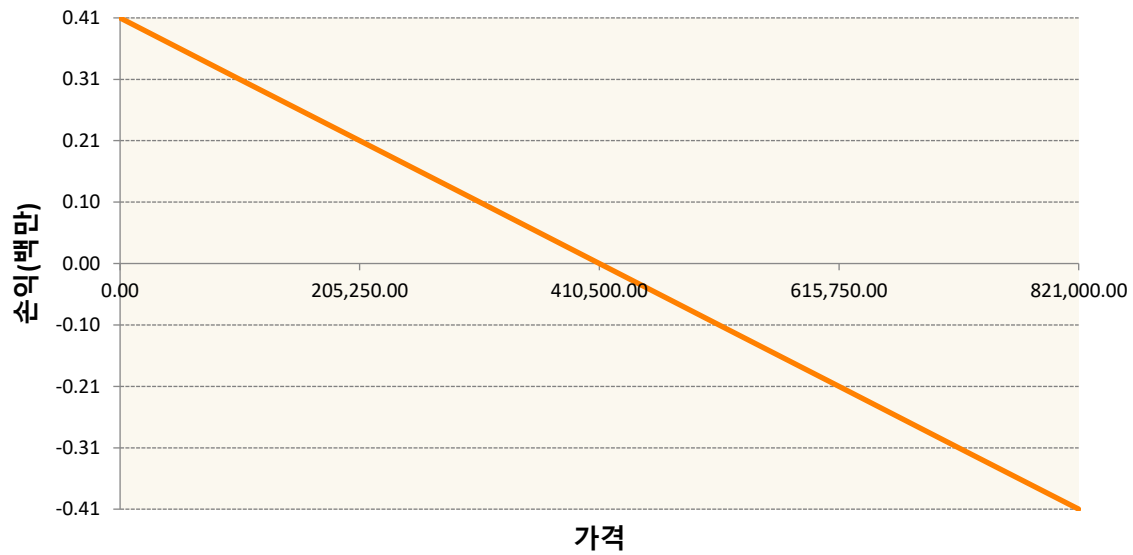
KR41ENV40009-2024-04 동진세미캠개별선물



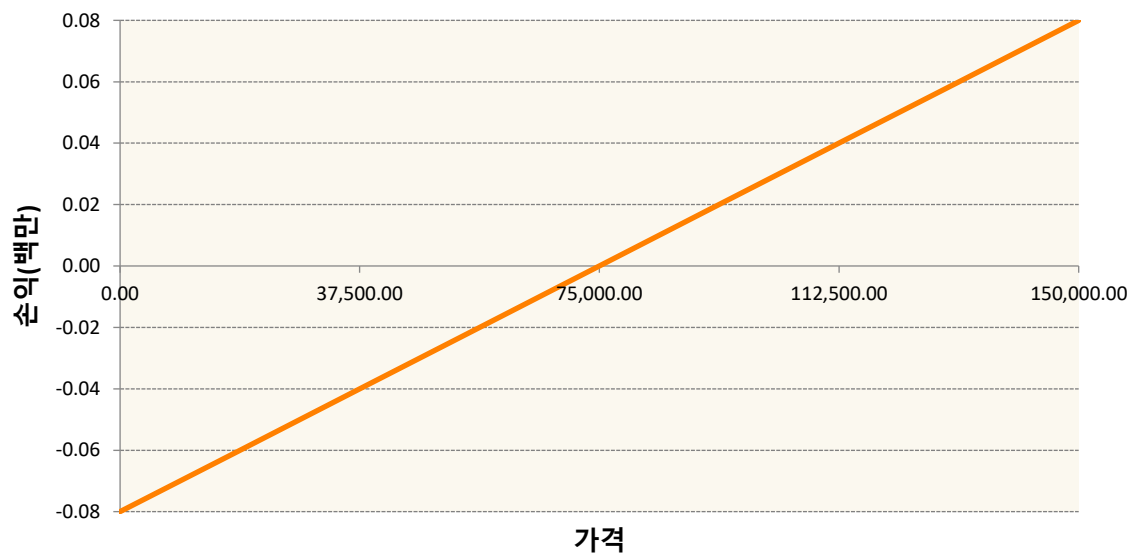
KR41ETV40006-2024-04 삼성엔지니어링개별선물



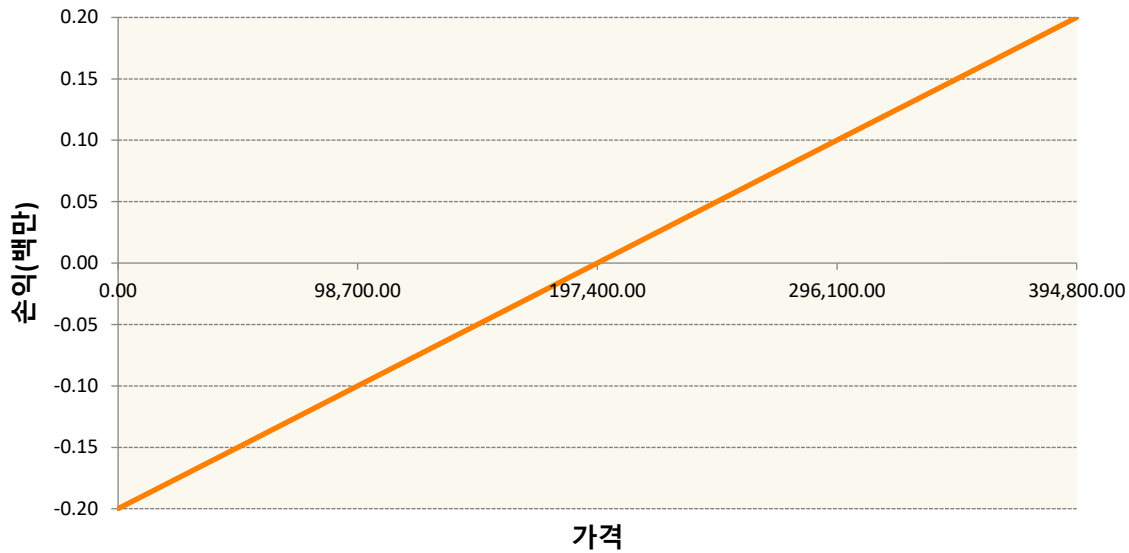
KR41F5V40009-2024-04 LG에너지솔루션개별선물



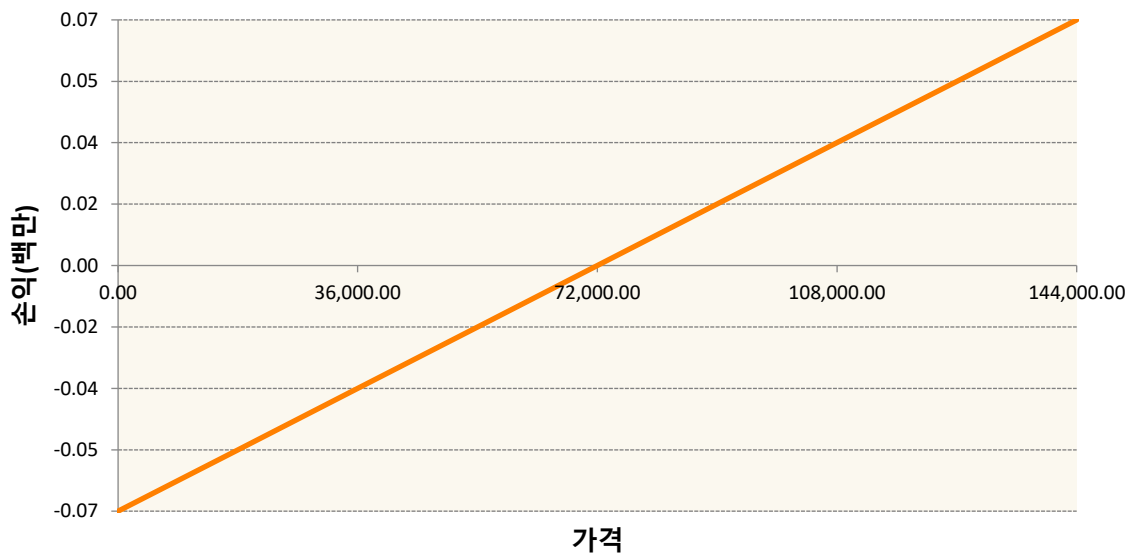
KR41FNV40006-2024-04 위메이드개별선물



KR41FPV40001-2024-04 알테오젠개별선물



KR41G9V40000-2024-04 레고캠바이오개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101V600 2024-06 코스피200지수선물	75
KR4157V400 2024-04 대한항공개별선물	1
KR41B9V400 2024-04 두산에너지개별선물	1
KR41BNV40C 2024-04 현대건설개별선물	0.27
KR41CDV40C 2024-04 현대미포조선개별선물	1
KR41CFV400 2024-04 카카오개별선물	0.43
KR41EJV400C 2024-04 SKC개별선물	2
KR41ENV40C 2024-04 동진세미캠개별선물	1
KR41ETV400 2024-04 삼성엔지니어링개별선물	0.04
KR41F5V400 2024-04 LG에너지솔루션개별선물	1
KR41FNV40C 2024-04 위메이드개별선물	1
KR41FPV400 2024-04 알테오젠개별선물	0.32

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

(단위:백만원)

94

공시일	2024-03-22
기준일	2024-03-21

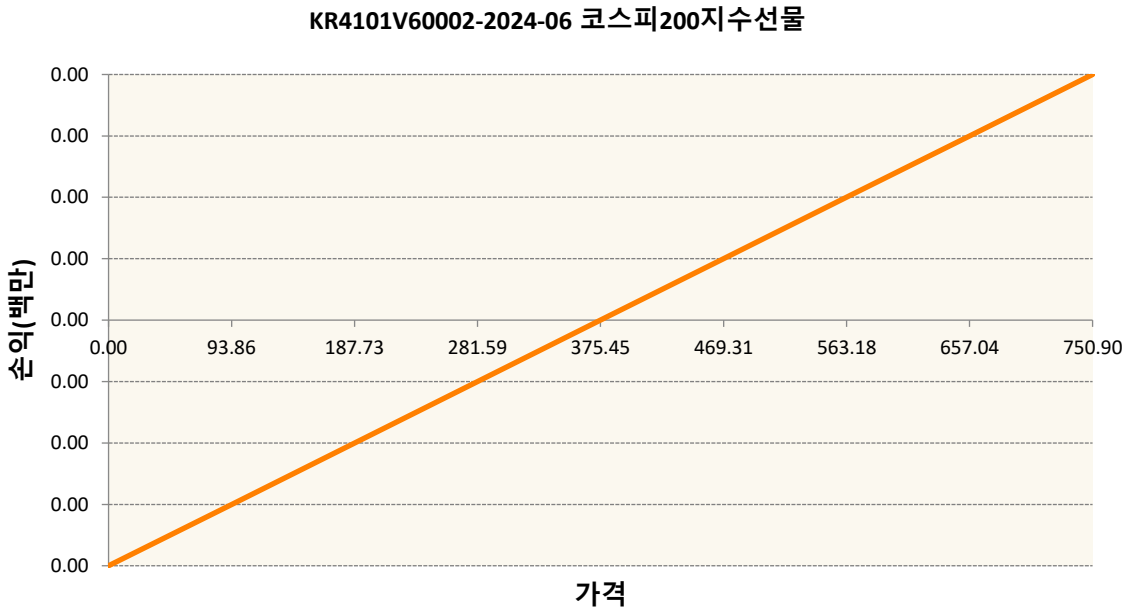
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

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	4,505	0	4,505	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101V60002		2024-06 코스피200지수선물					359
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-359	-359	-359	-359	-359	-359	-359
-5.33%	-239	-239	-239	-239	-239	-239	-239
-2.67%	-120	-120	-120	-120	-120	-120	-120
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	120	120	120	120	120	120	120
5.33%	239	239	239	239	239	239	239
8.00%	359	359	359	359	359	359	359

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

(단위:백만원)

329

공시일	2024-03-22
기준일	2024-03-21

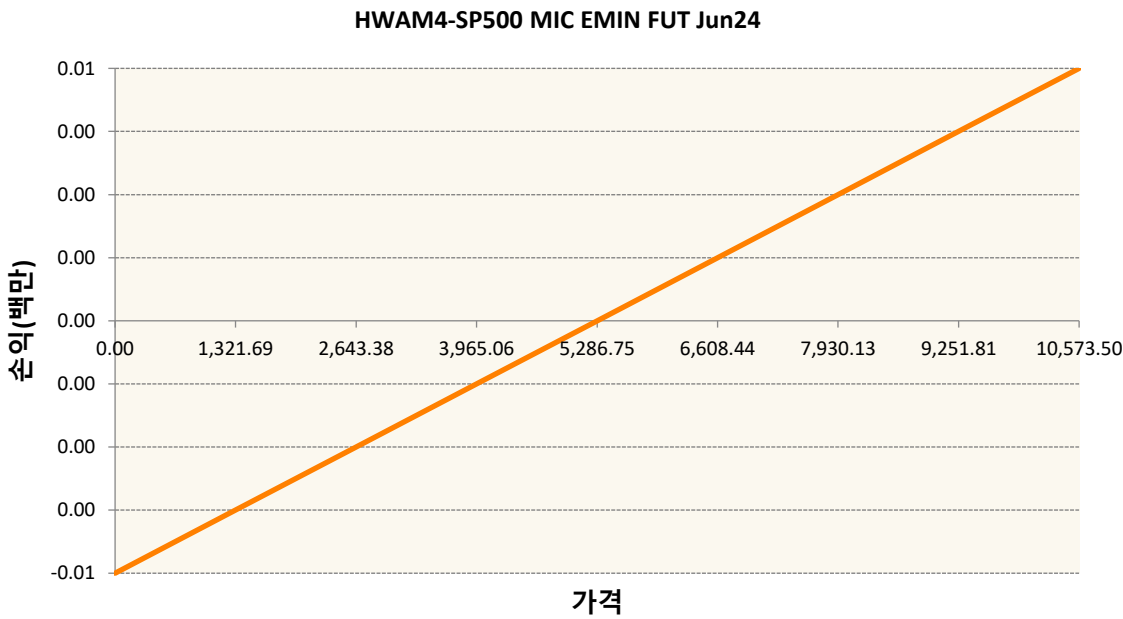
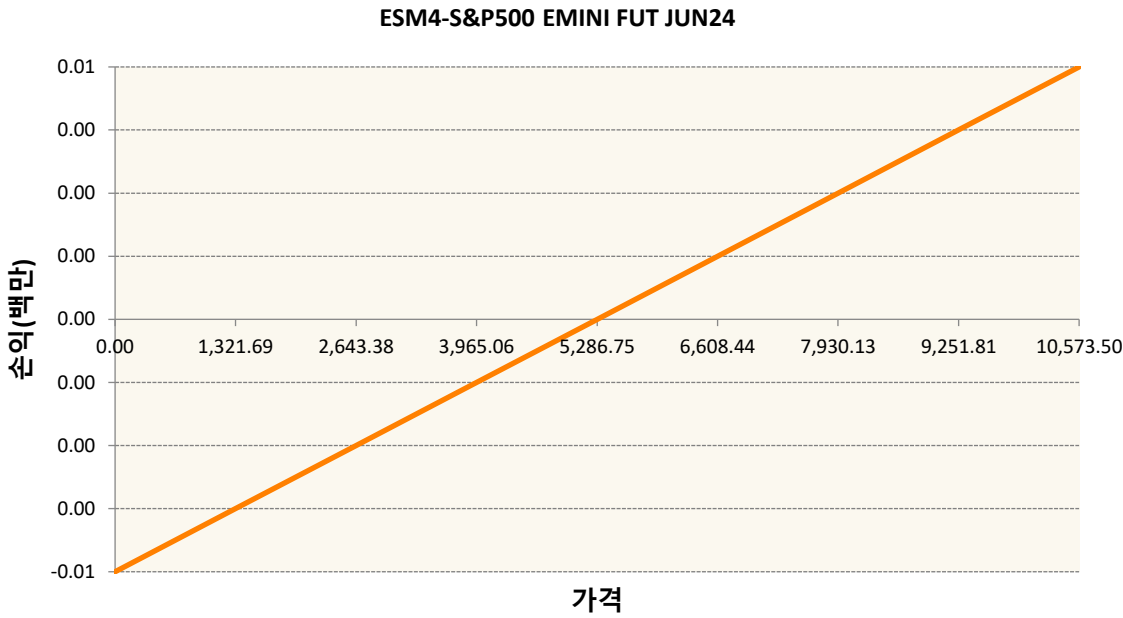
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

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	4,185	0	4,185	
누계	유가증권	선물	1,707	0	1,707	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESM4	S&P500 EMINI FUT JUN24	335
HWAM4	SP500 MIC EMIN FUT Jun24	137

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	345

공시일	2024-03-22
기준일	2024-03-21

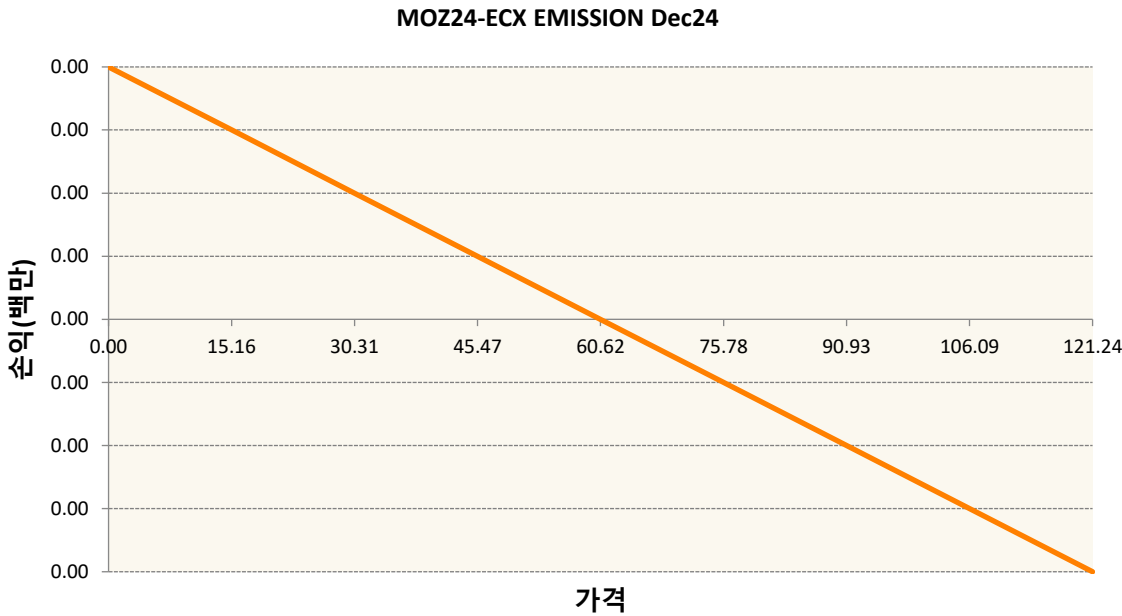
SOL유럽탄소배출권선물인버스ICE특별자산상

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	93	-93	장외
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	0	5,963	-5,963	
누계	지수	스왑	331	0	331	장외
누계	통화	선도	1,188	2,887	-1,699	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213E2TC KRW/EUR 28-03-24E	84
FXW213E2TC KRW/EUR 28-03-24E	147
FXW213E3C(EUR/KRW 28-03-24E	95
MOZ24 ECX EMISSION Dec24	477
SWICEUACN ICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX	0.1

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

(단위:백만원)

1,012

공시일	2024-03-22
기준일	2024-03-21

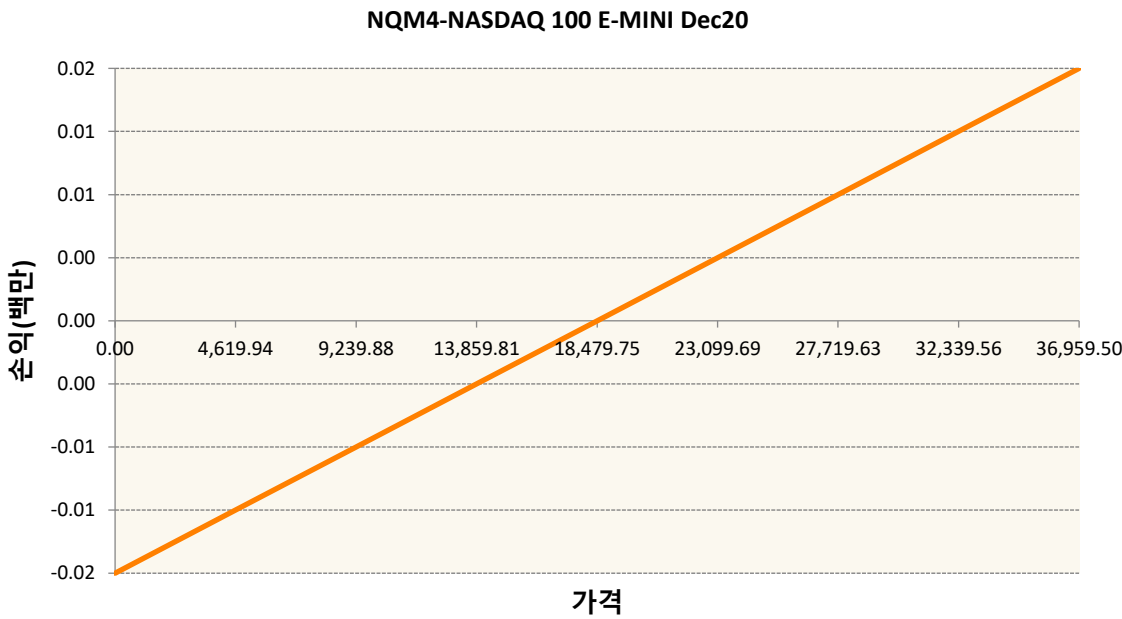
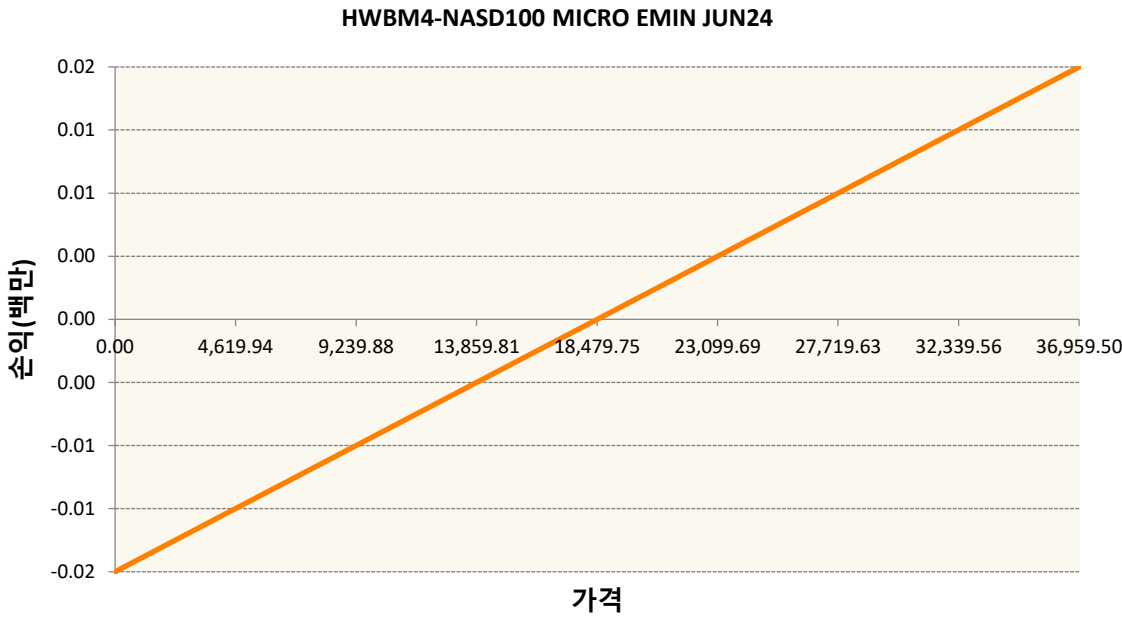
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

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	1,948	0	1,948	
누계	유가증권	선물	2,629	0	2,629	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
HWBM4	NASD100 MICRO EMIN JUN24		210
NQM4	NASDAQ 100 E-MINI Dec20		156

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)			(단위:백만원)
			309

공시일	2024-03-22
기준일	2024-03-21

SOL미국30년국채커버드콜(합성)

1. 계약금액 (단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	17,310	0	17,310	장외
누계	지수	스왑	92,548	0	92,548	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	472
SWKEDI0000 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	5,054
SWKEDI0000 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	1,367

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	4,620

공시일	2024-03-22
기준일	2024-03-21

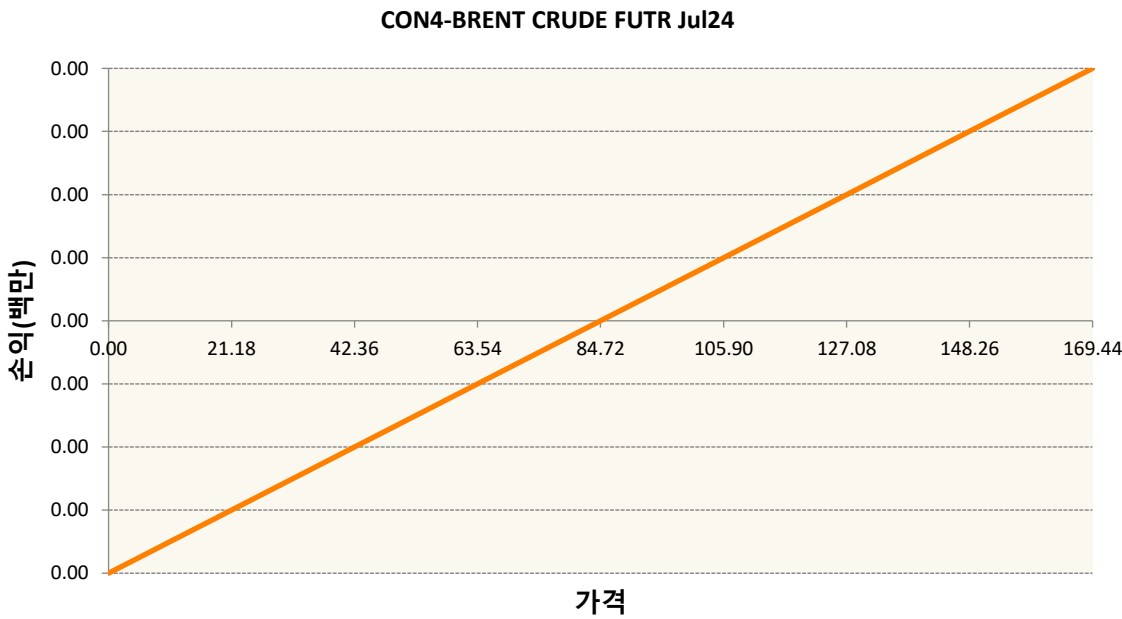
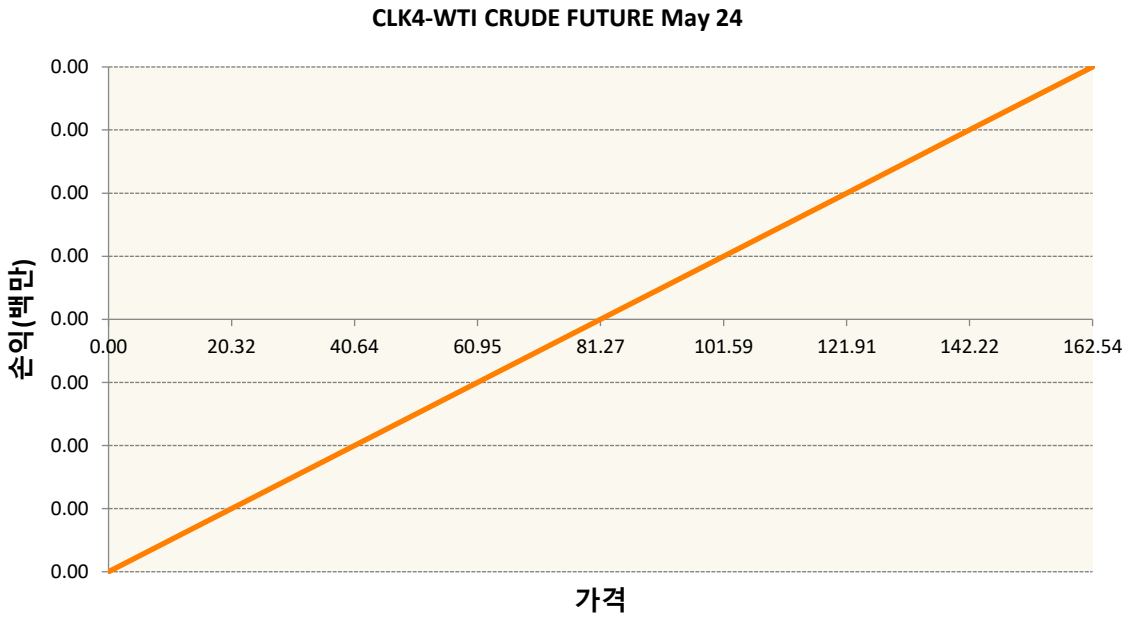
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

1. 계약금액

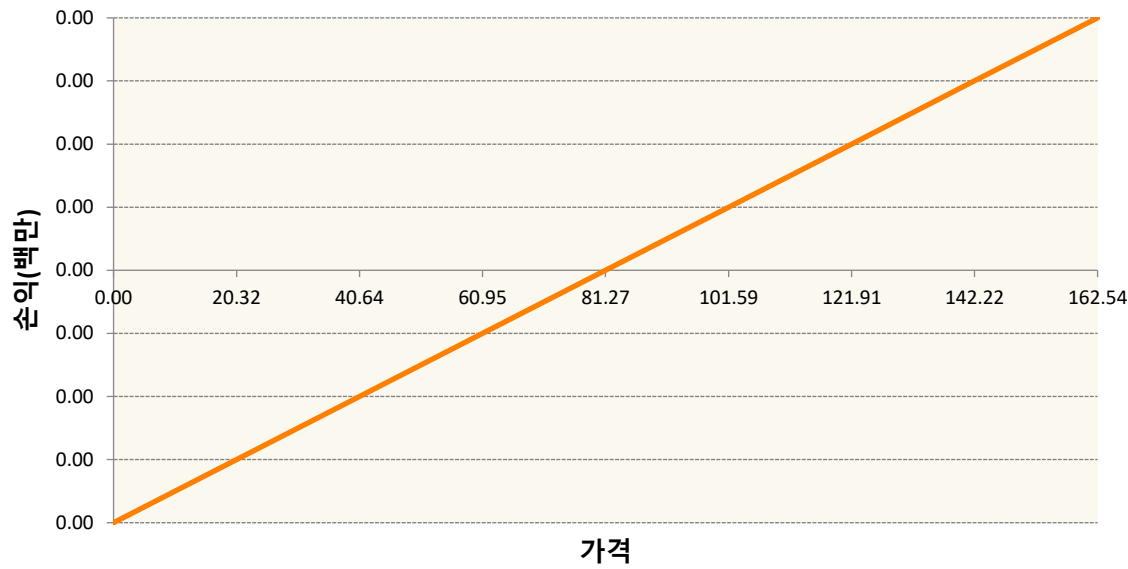
(단위:백만원)

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	1,189	0	1,189	
누계	통화	선물	0	225	-225	장내

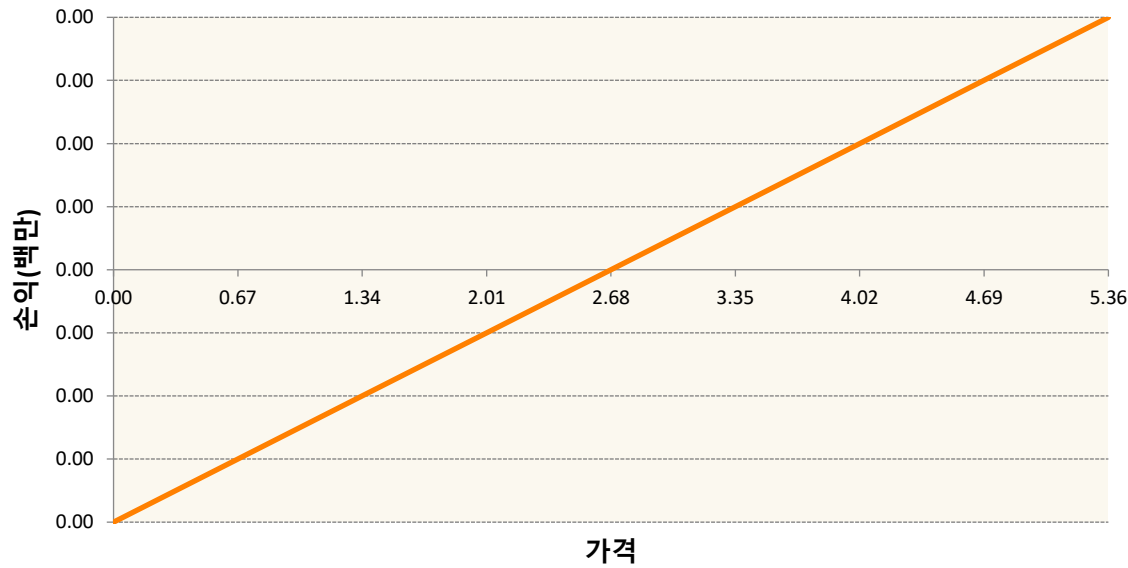
2. 만기시점의 손익구조



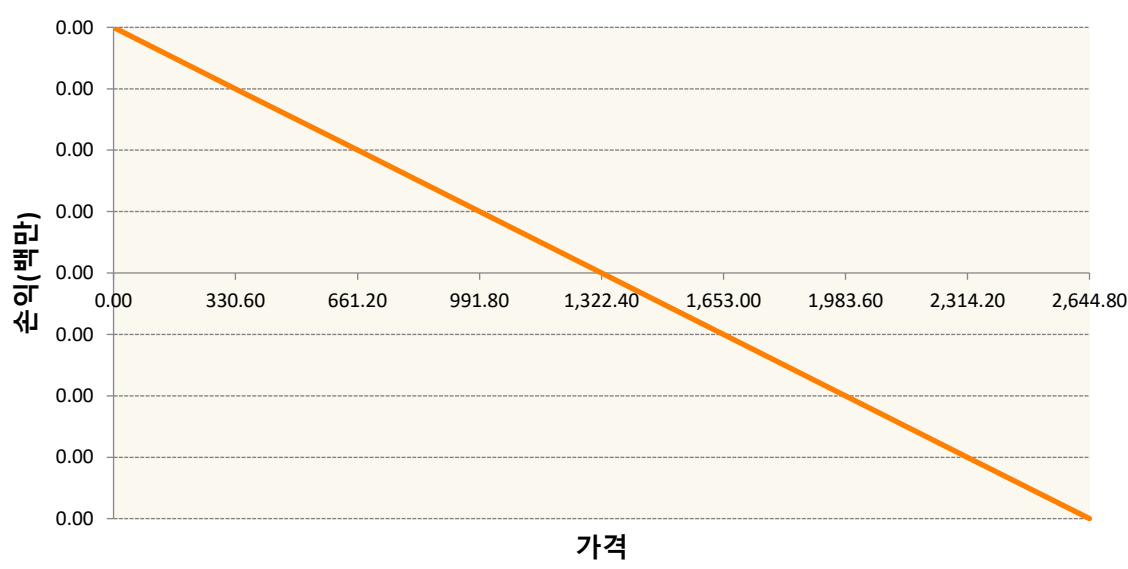
ECK4-E-mini Crude Oil May 24



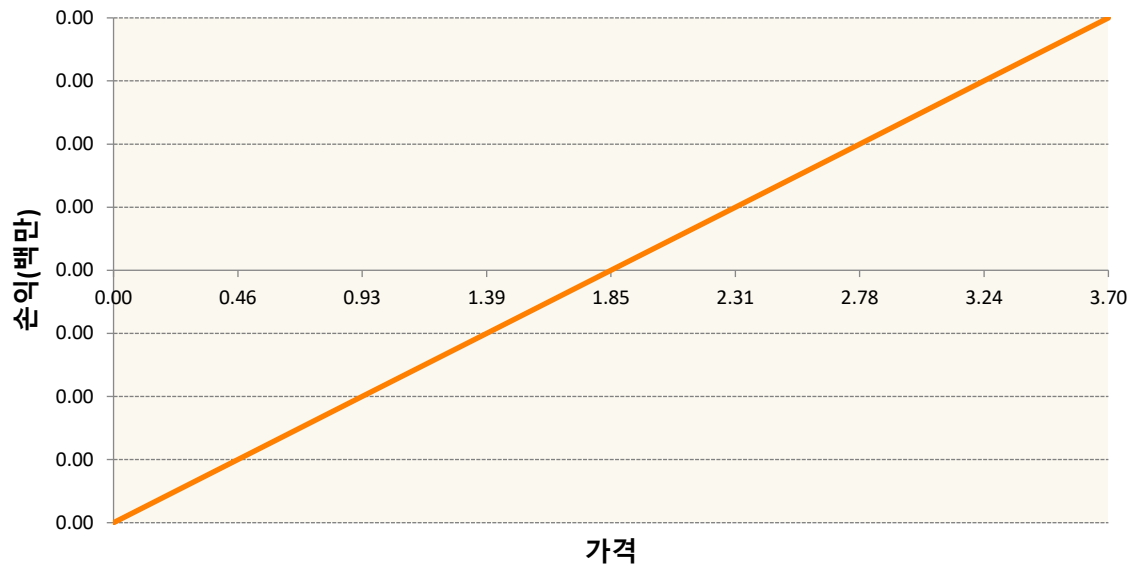
HOK4-NY Harb ULSD Fut May 24



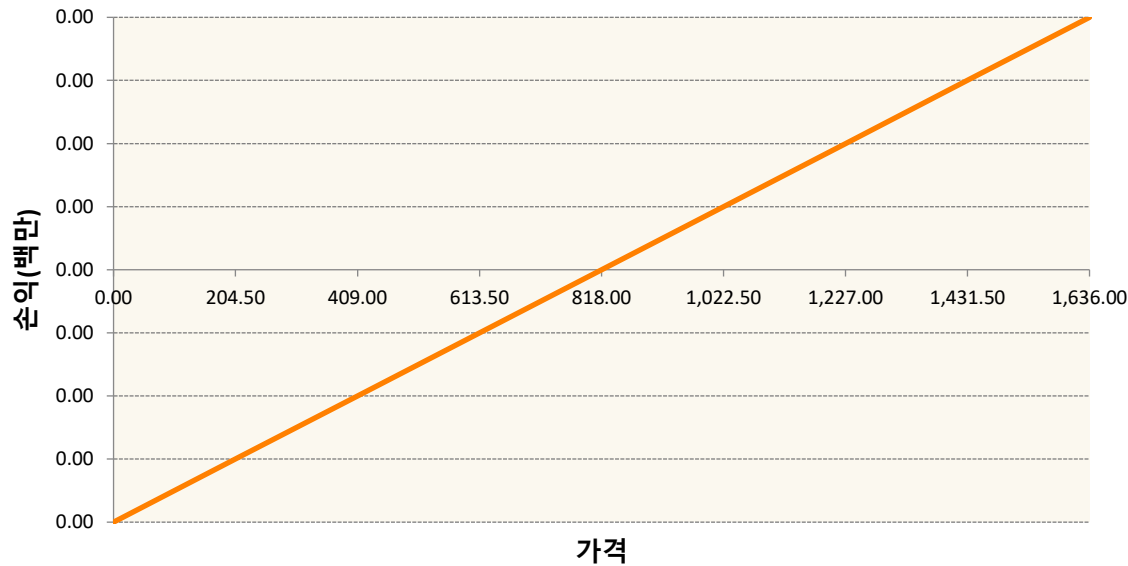
KR4175V40008-2024-04 달러선물



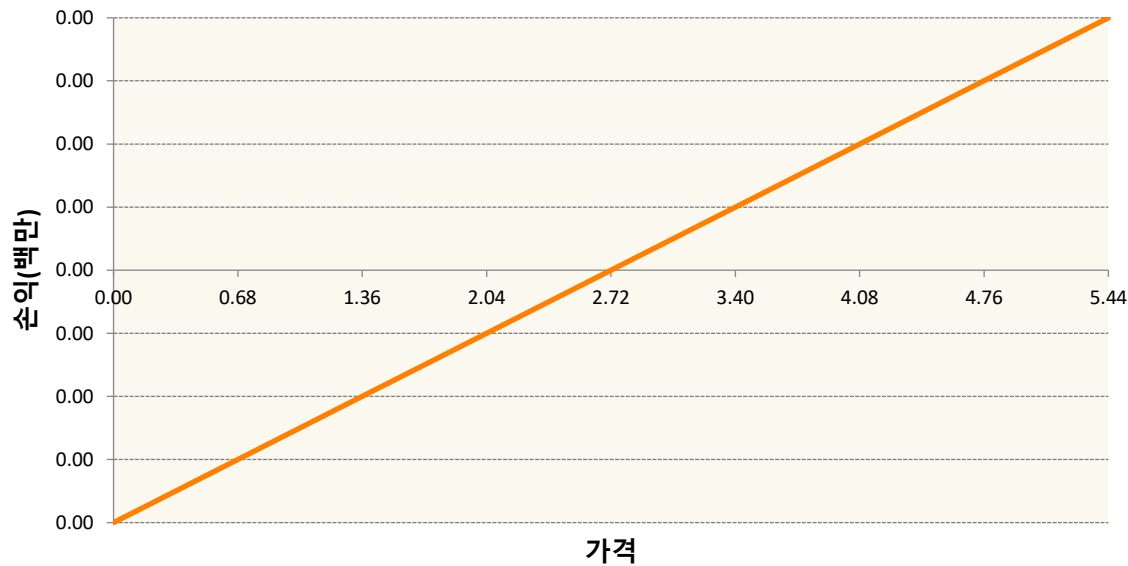
NGK24-NATURAL GAS FUTR May 24



QSK4-Low Su Gasoil G May 24



XBK4-GASOLINE RBOB FUT May 24



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLK4	WTI CRUDE FUTURE May 24	17
CON4	BRENT CRUDE FUTR Jul24	27
ECK4	E-mini Crude Oil May 24	4
HOK4	NY Harb ULSD Fut May 24	12
KR4175V400 2024-04 달러선물		18
NGK24	NATURAL GAS FUTR May 24	14
QSK4	Low Su Gasoil G May 24	9
XBK4	GASOLINE RBOB FUT May 24	12

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

215