

공시일	2024-03-28
기준일	2024-03-27

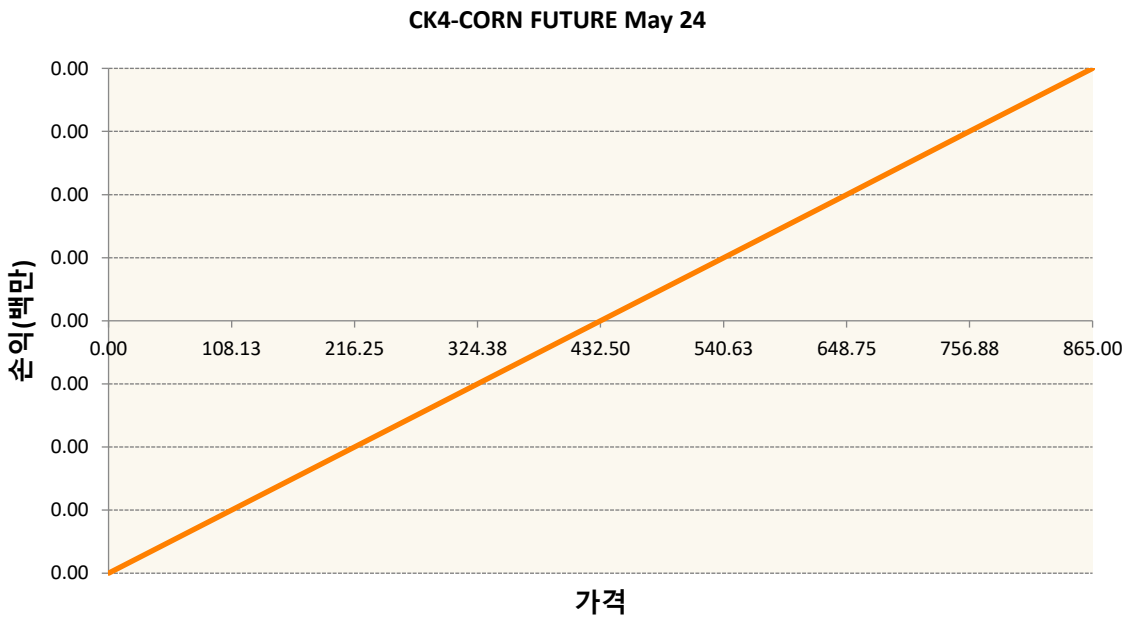
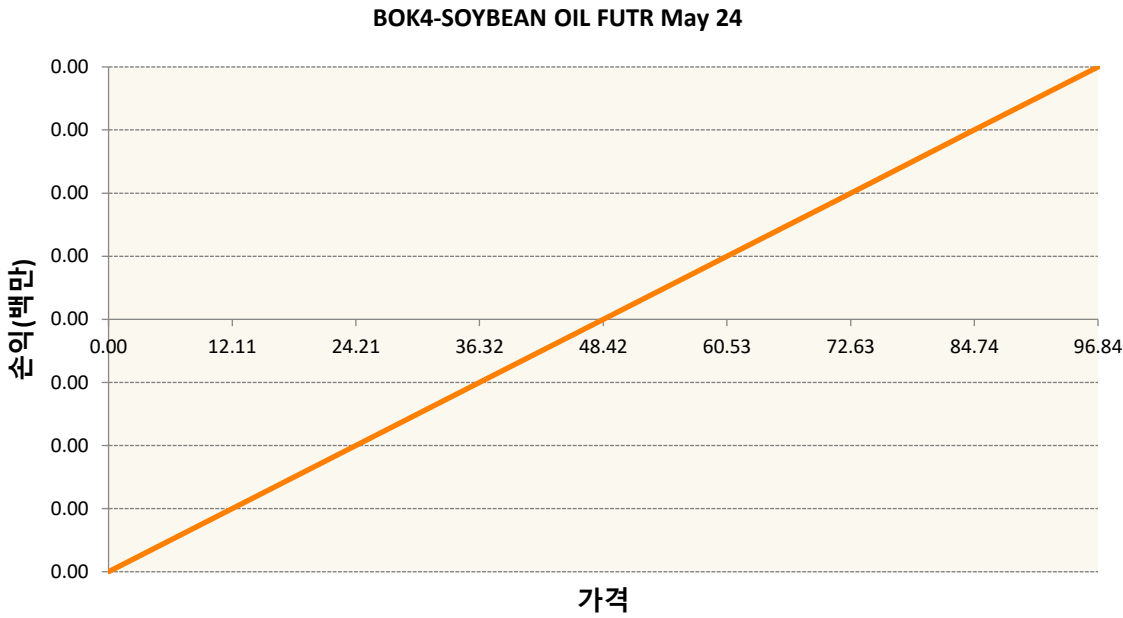
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

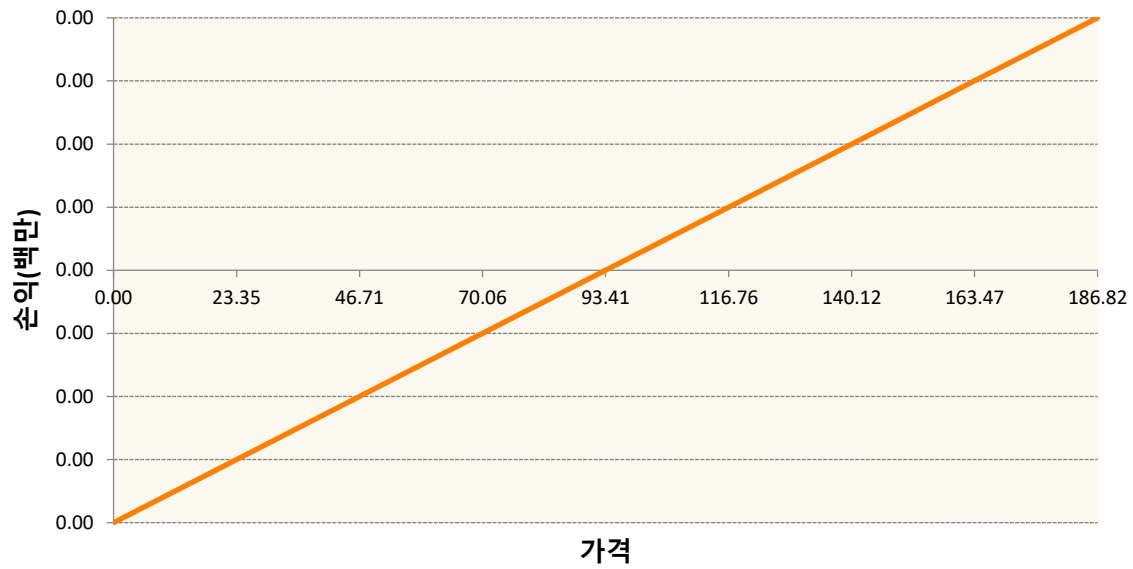
(단위:USD 백만)

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	566	-566	장내

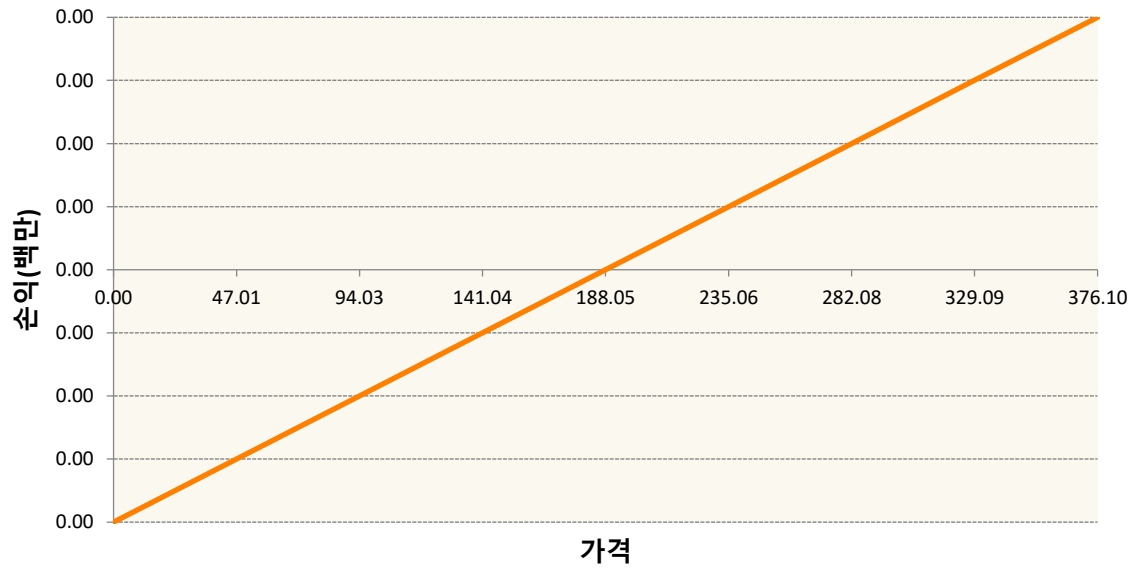
2. 만기시점의 손익구조



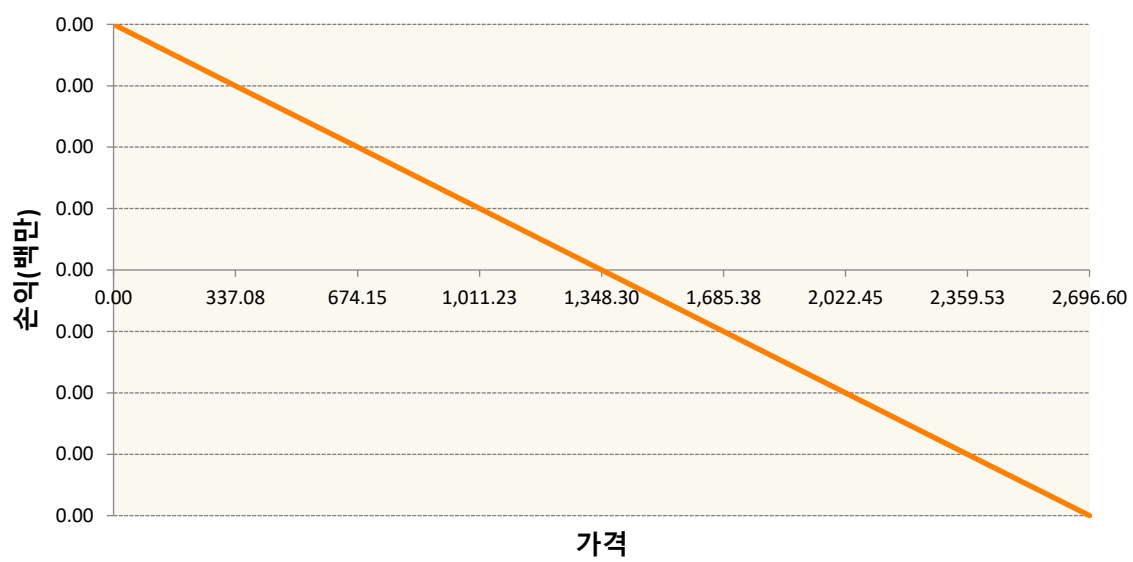
CTK4-COTTON NO.2 FUTR May 24



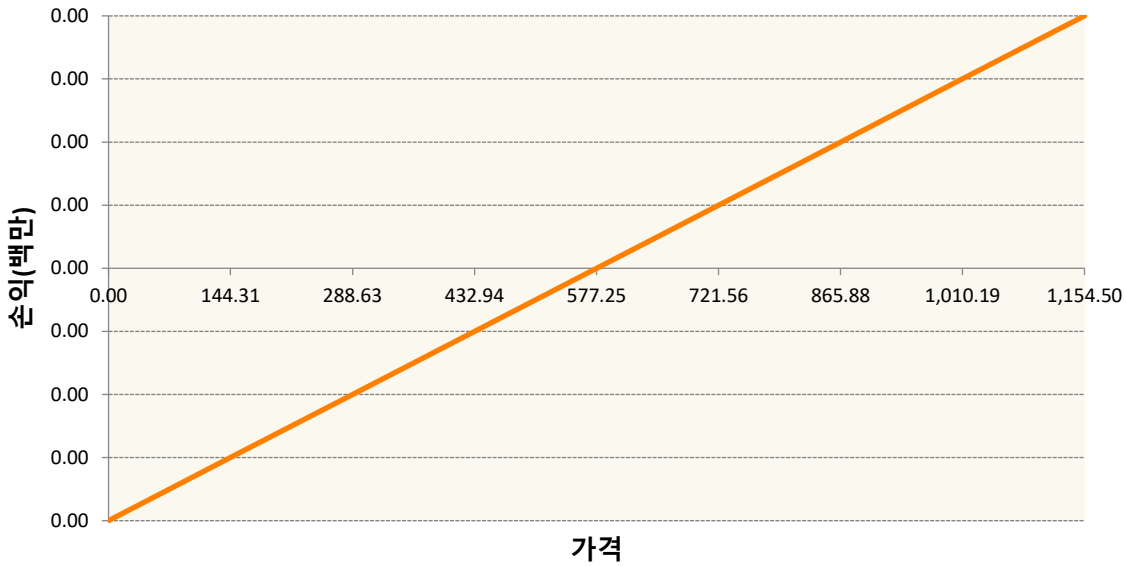
KCK4-COFFEE 'C' FUTURE May 24



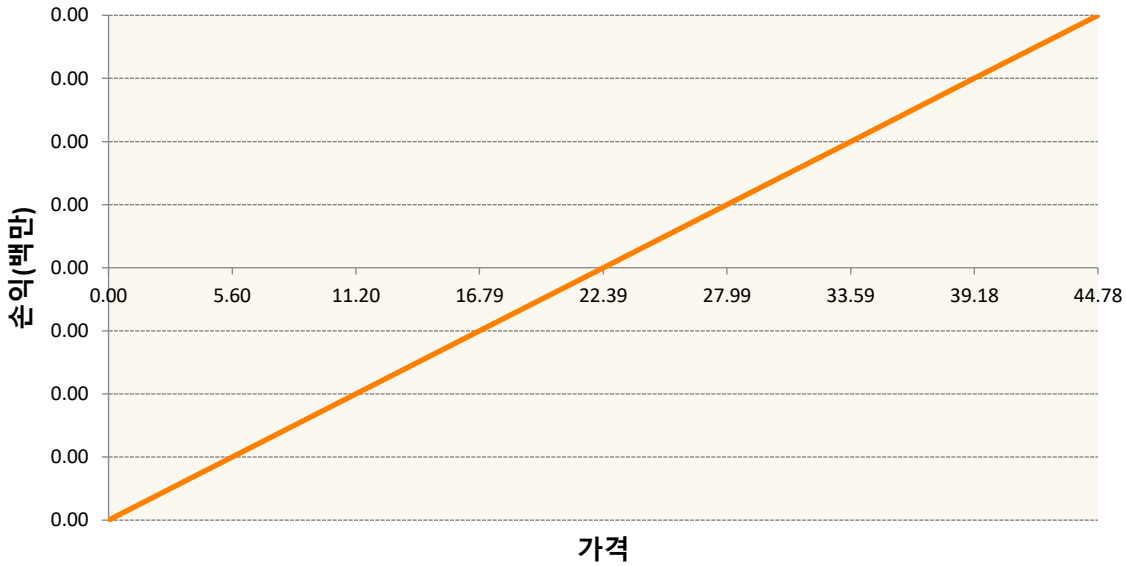
KR4175V40008-2024-04 달러선물



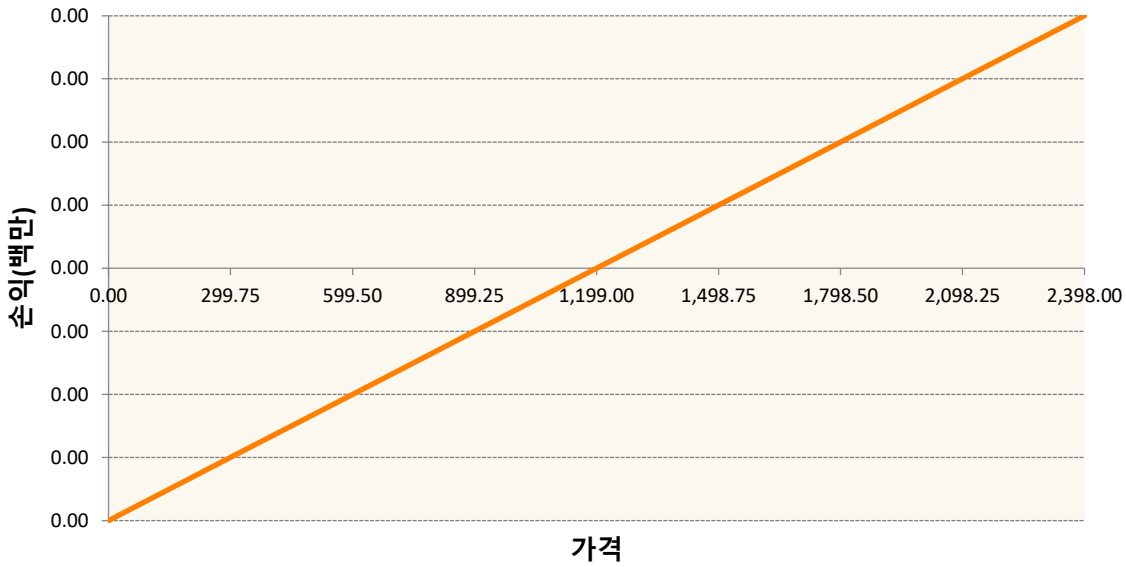
KWK4-KC HRW WHEAT FUT May 24



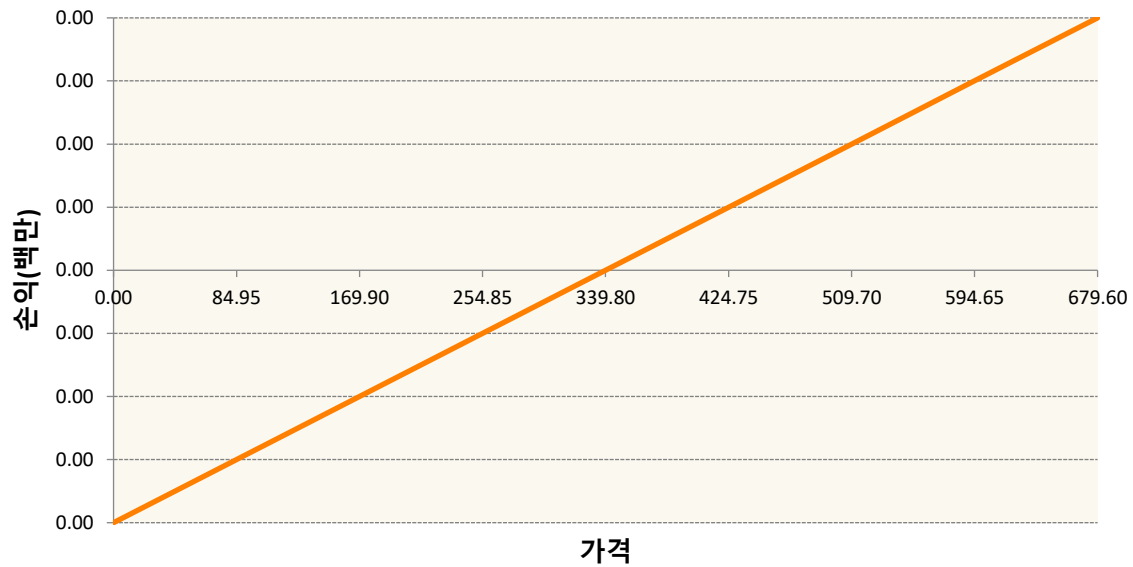
SBK4-Sugar #11 (WORLD) May 24



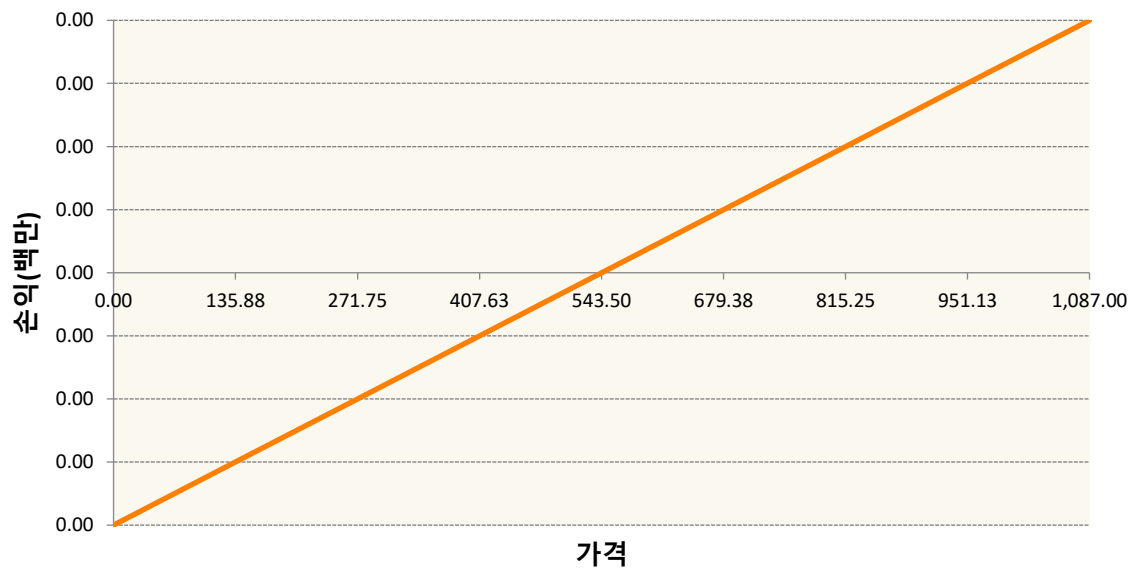
SK4-SOYBEAN FUTURE May 24



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	2024-03-28
기준일	2024-03-27

스마트인덱스모

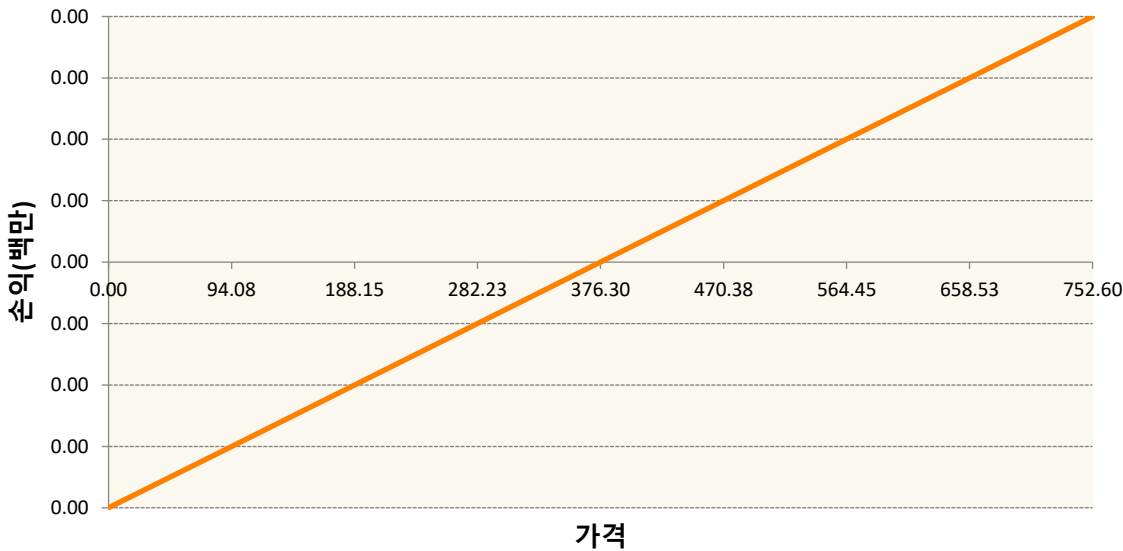
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	188	-188	장내
누계	유가증권	선물	1,976	0	1,976	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101V60002-2024-06 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101V60002		2024-06 코스피200지수선물					157
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-157	-157	-157	-157	-157	-157	-157
-5.33%	-105	-105	-105	-105	-105	-105	-105
-2.67%	-52	-52	-52	-52	-52	-52	-52
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	52	52	52	52	52	52	52
5.33%	105	105	105	105	105	105	105
8.00%	157	157	157	157	157	157	157

공시일	2024-03-28
기준일	2024-03-27

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	3,420	0	3,420	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 신한CSI500미래231226	263
-----------------------------	-----

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

305

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2024-03-28
기준일	2024-03-27

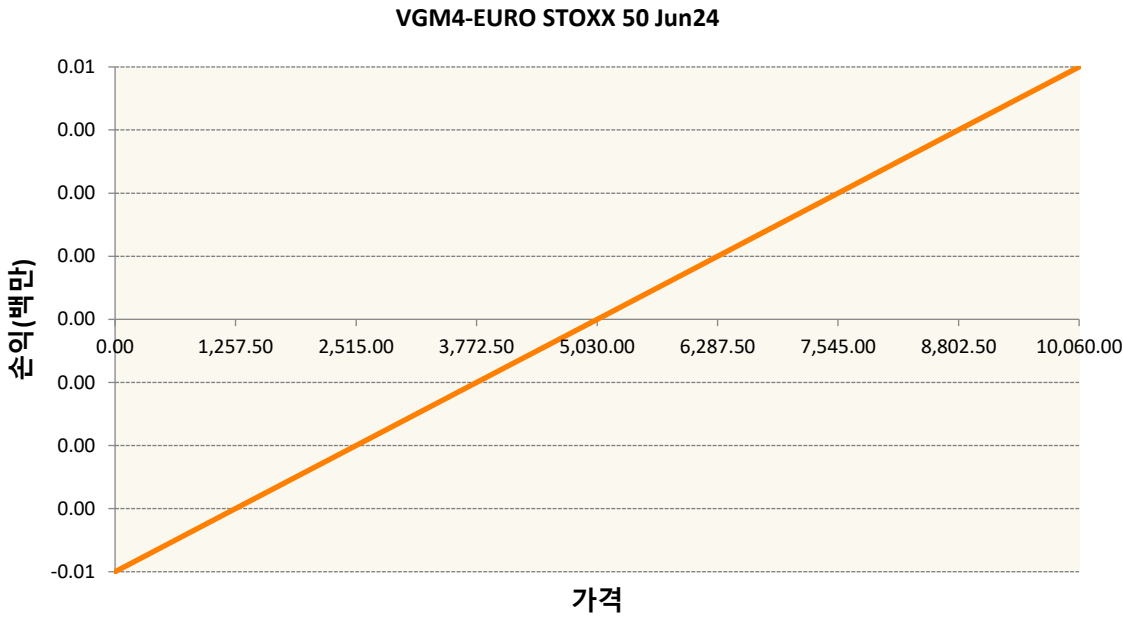
유로인덱스모(주식-파생형)

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	1,010	0	1,010	
누계	통화	선도	219	0	219	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213E3K(EUR/KRW 21-06-24E	18
VGM4 EURO STOXX 50 Jun24	81

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

(단위:백만원)

68

공시일	2024-03-28
기준일	2024-03-27

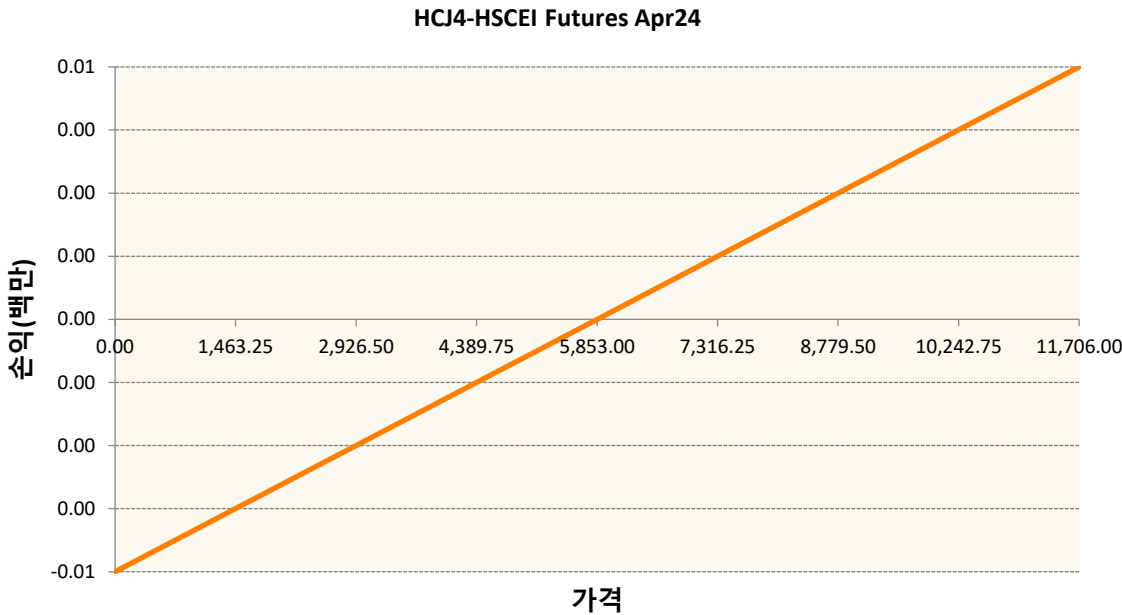
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,203	0	1,203	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCI4	HSCEI Futures Apr24	96
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

131

공시일	2024-03-28
기준일	2024-03-27

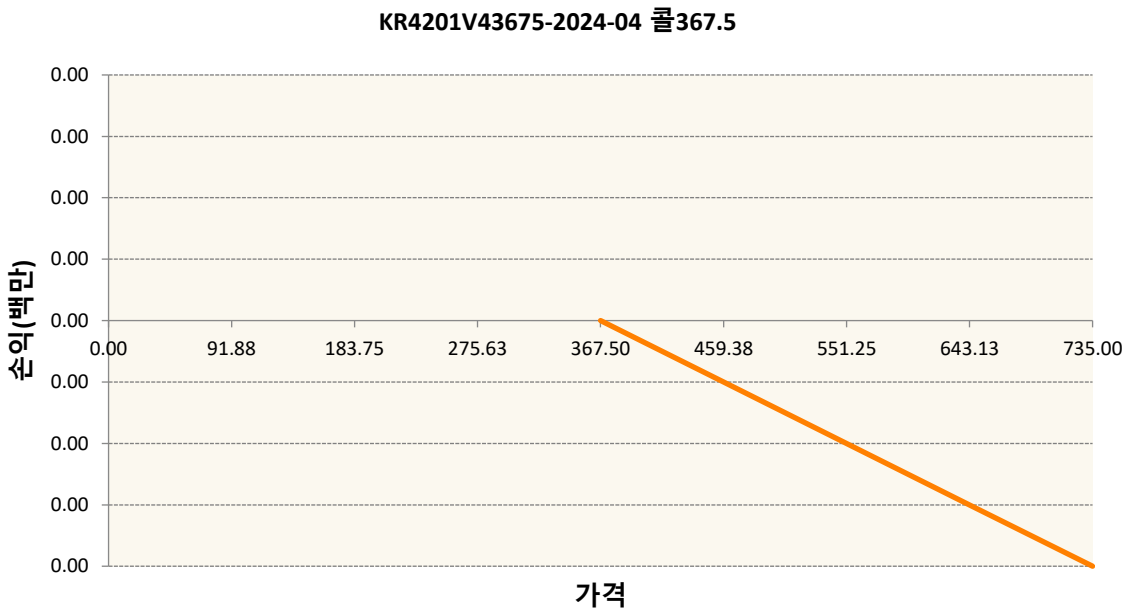
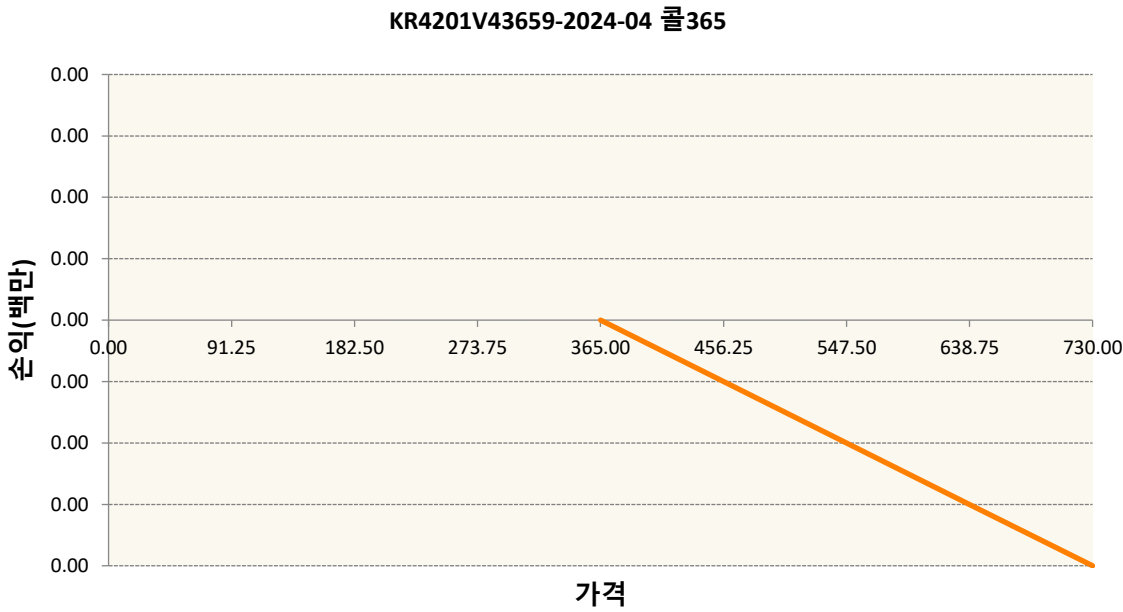
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

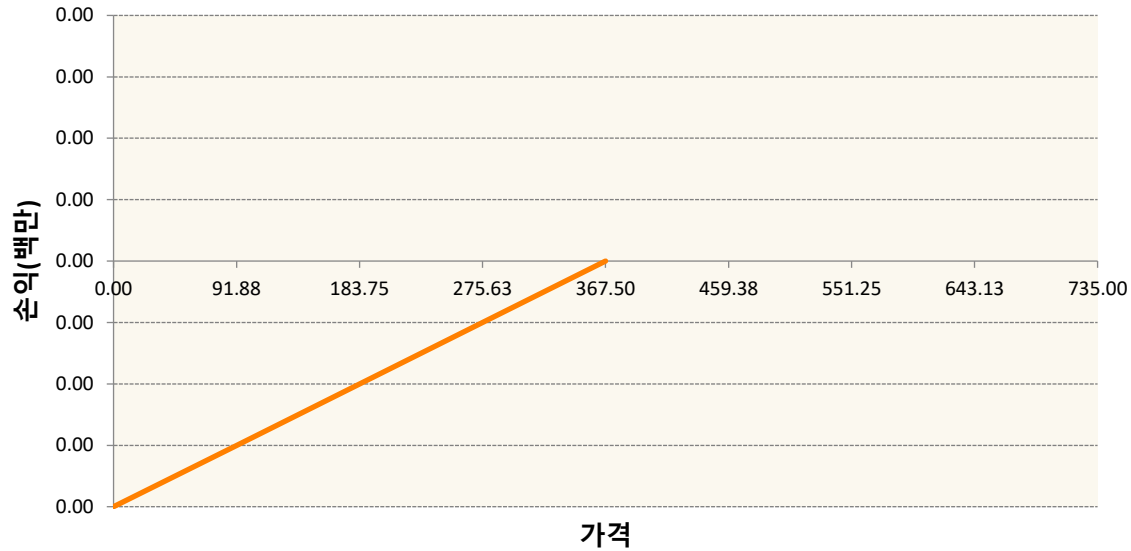
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	47,214	-47,214	장내

2. 만기시점의 손익구조



KR4301V43673-2024-04 풋367.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201V43659 2024-04 콜365 1,076

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	530	520	507	493	477	461	443
-5.33%	469	448	426	403	380	356	332
-2.67%	322	295	268	241	214	187	160
0%	72	48	24	0	-25	-50	-76
2.67%	-263	-277	-293	-310	-329	-348	-369
5.33%	-645	-651	-659	-669	-680	-693	-707
8.00%	-1,045	-1,047	-1,050	-1,054	-1,060	-1,067	-1,076

KR4201V43675 2024-04 콜367.5 1,685

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	758	744	727	708	686	661	635
-5.33%	682	651	619	585	550	514	477
-2.67%	485	442	399	356	313	270	226
0%	123	83	42	0	-42	-84	-127
2.67%	-386	-412	-441	-473	-506	-540	-576
5.33%	-985	-997	-1,013	-1,032	-1,053	-1,077	-1,103
8.00%	-1,623	-1,627	-1,634	-1,643	-1,654	-1,668	-1,685

KR4301V43673 2024-04 풋367.5 455

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-412	-417	-423	-430	-437	-446	-455
-5.33%	-214	-225	-236	-247	-259	-272	-285
-2.67%	-58	-72	-87	-102	-117	-132	-147
0%	42	28	14	0	-14	-29	-44

2.67%	92	83	73	62	51	39	26
5.33%	110	106	101	94	87	79	70
8.00%	115	114	112	108	105	100	94

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	3,326

공시일	2024-03-28
기준일	2024-03-27

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	1,740	0	1,740	

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	2024-03-28
기준일	2024-03-27

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	4,549	0	4,549	

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	2024-03-28
기준일	2024-03-27

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	16,105	0	16,105	
누계	통화	선도	1,079	22,166	-21,087	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
FXW213DCT KRW/USD 29-03-24E		523
FXW213E1W KRW/USD 30-04-24E		252
FXW213E2L0 USD/KRW 29-03-24E		86
FXW213E2TC KRW/USD 31-05-24E		583
FXW213E3TC KRW/USD 28-06-24E		415
IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	893

공시일	2024-03-28
기준일	2024-03-27

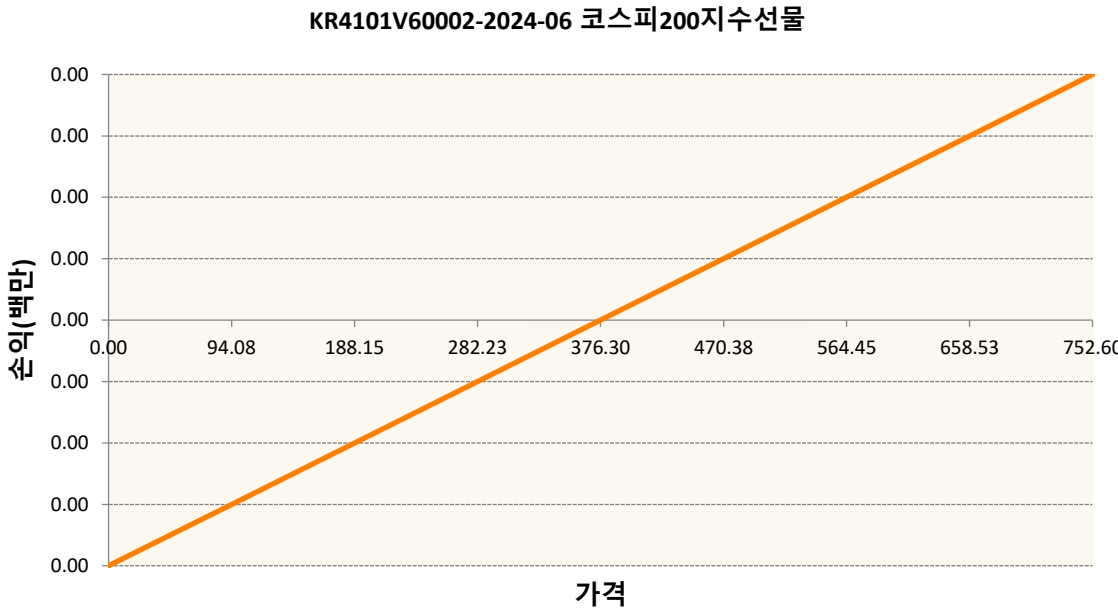
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

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	564	0	564	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101V60002		2024-06 코스피200지수선물					45
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-45	-45	-45	-45	-45	-45	-45
-5.33%	-30	-30	-30	-30	-30	-30	-30
-2.67%	-15	-15	-15	-15	-15	-15	-15
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	15	15	15	15	15	15	15
5.33%	30	30	30	30	30	30	30
8.00%	45	45	45	45	45	45	45

공시일	2024-03-28
기준일	2024-03-27

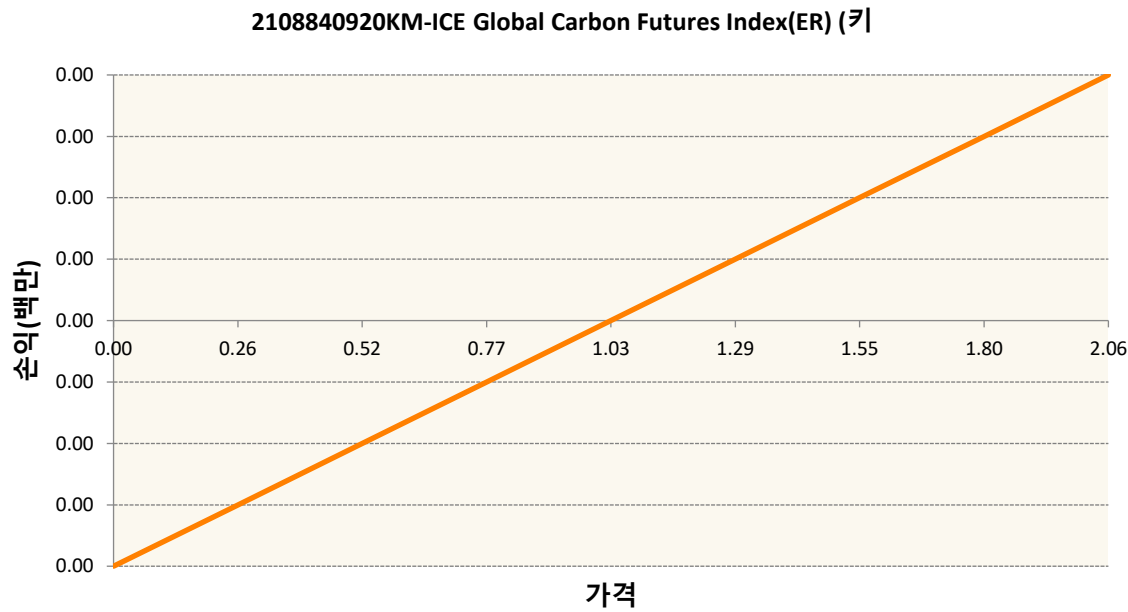
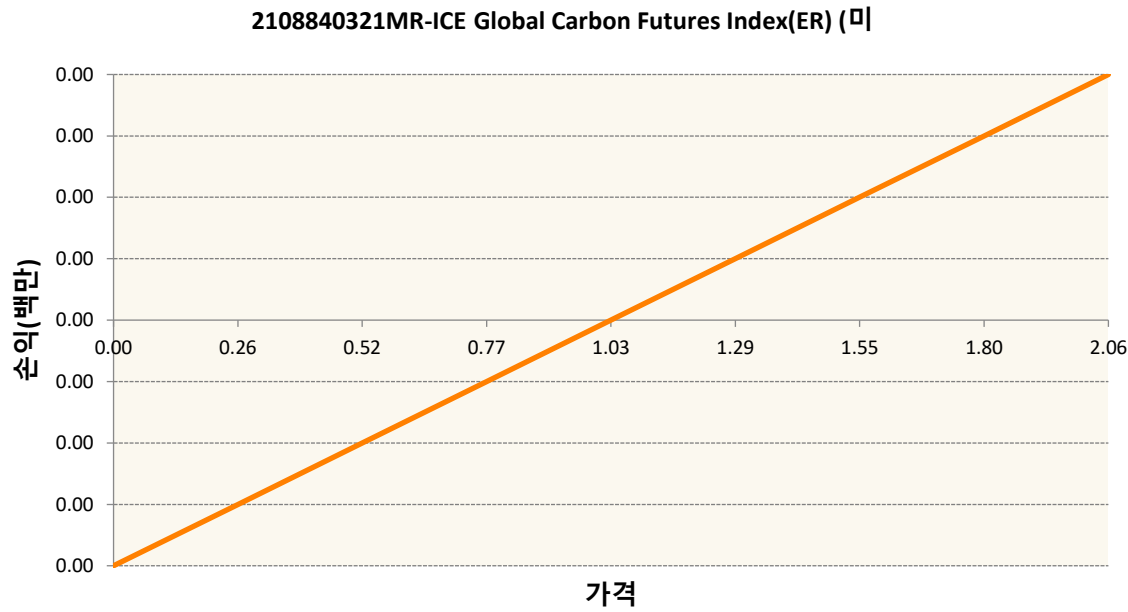
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

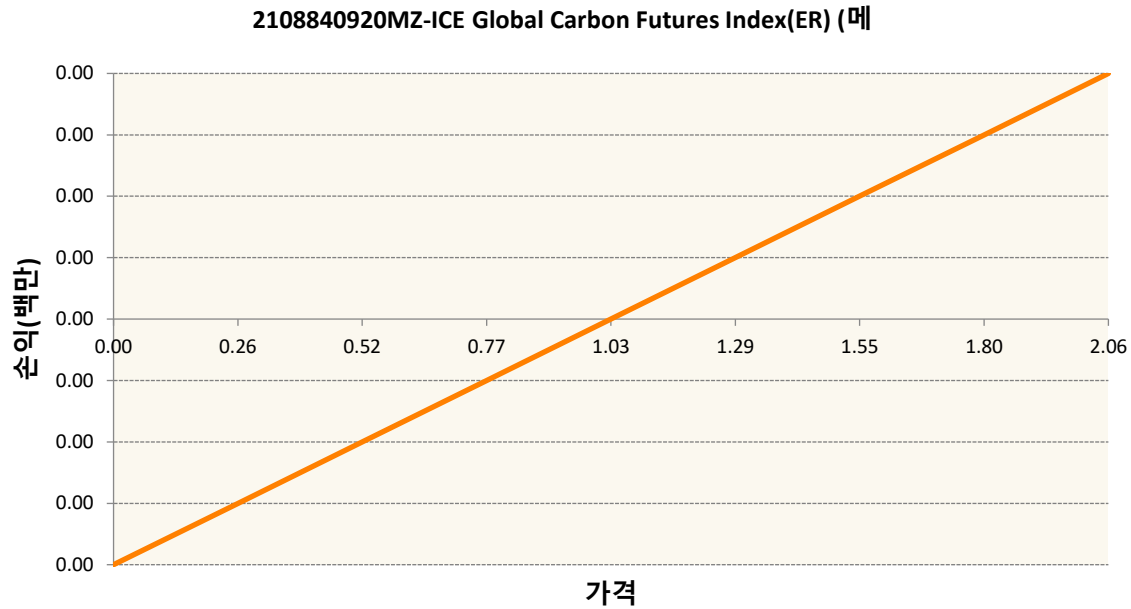
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	18,993	0	18,993	

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108840321IICE Global Carbon Futures Index(ER) (미		446
2108840920IICE Global Carbon Futures Index(ER) (키		891
2108840920IICE Global Carbon Futures Index(ER) (메		178

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,781

공시일	2024-03-28
기준일	2024-03-27

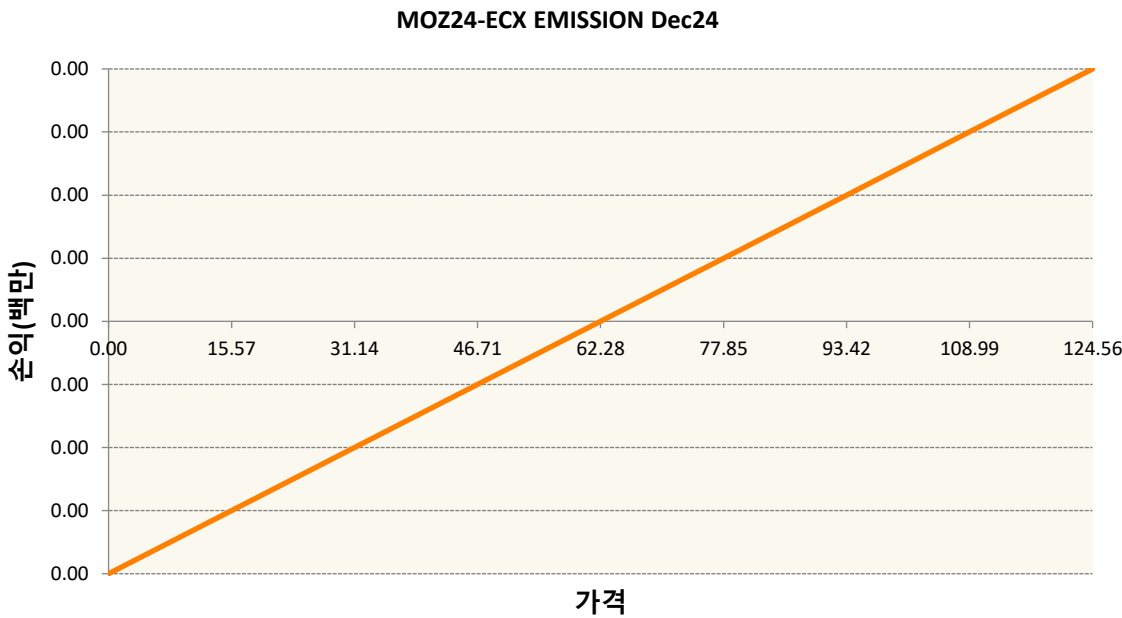
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	9,301	0	9,301	
누계	지수	스왑	331	0	331	장외
누계	통화	선도	0	4,855	-4,855	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213E2TC KRW/EUR 28-03-24E	181
FXW213E3SC KRW/EUR 30-04-24E	61
FXW213E3SC KRW/EUR 30-04-24E	146
MOZ24 ECX EMISSION Dec24	744
SWICEUACN ICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX	1

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

(단위:백만원)

1,526

공시일	2024-03-28
기준일	2024-03-27

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	4,948	0	4,948	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)

22

공시일	2024-03-28
기준일	2024-03-27

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	6,101	0	6,101	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(미래)	7
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(NH)	6
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(메리츠)	8
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(키움)	2

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

(단위:백만원)

26

공시일	2024-03-28
기준일	2024-03-27

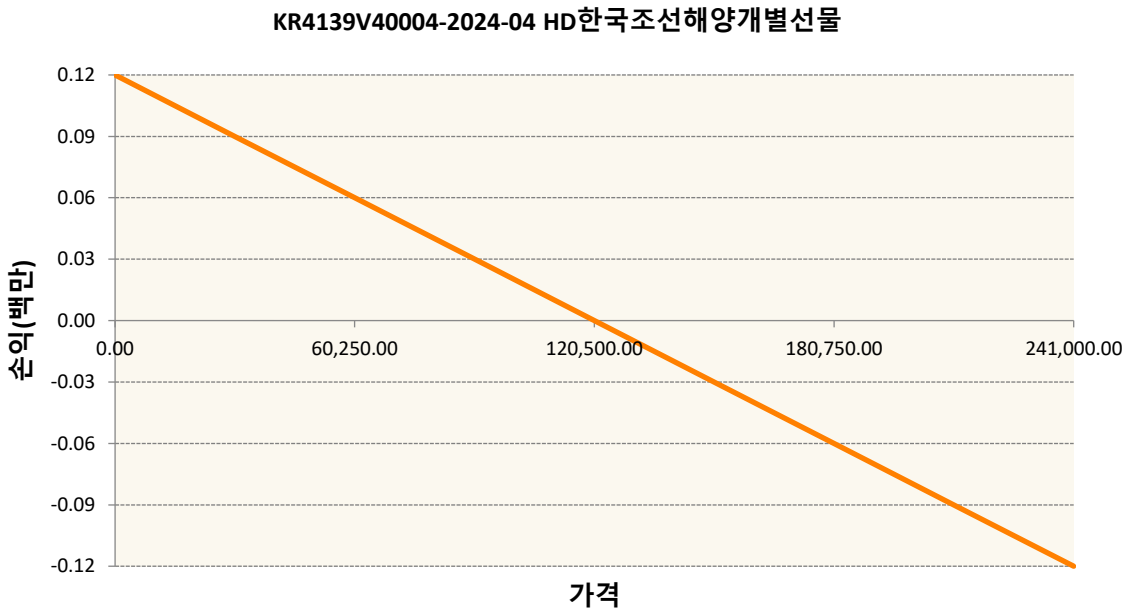
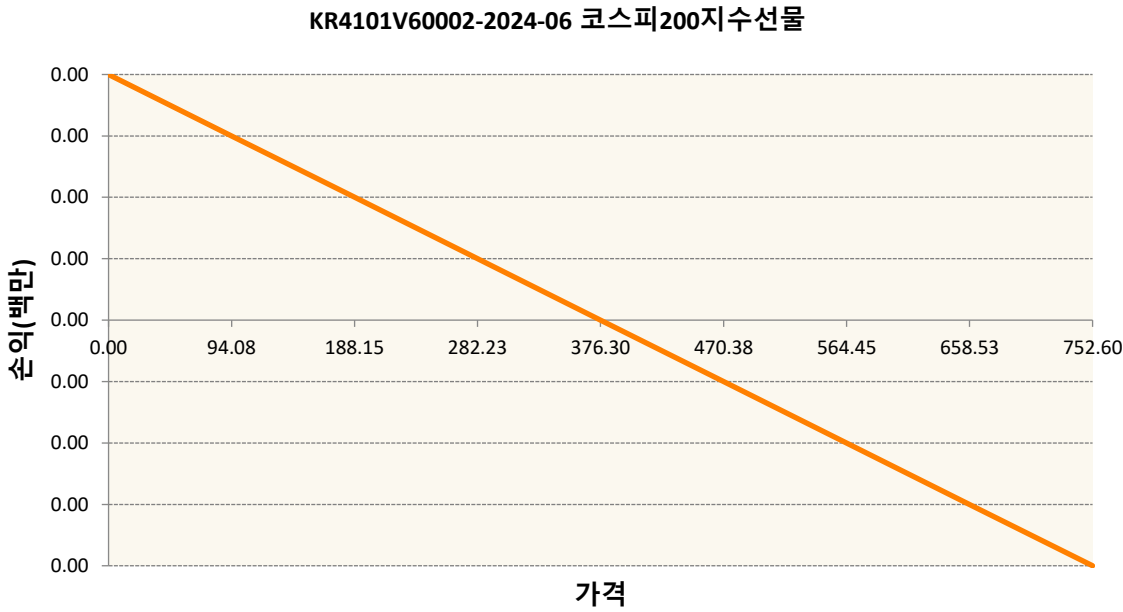
에퀴티알파일반사모혼합자산

1. 계약금액

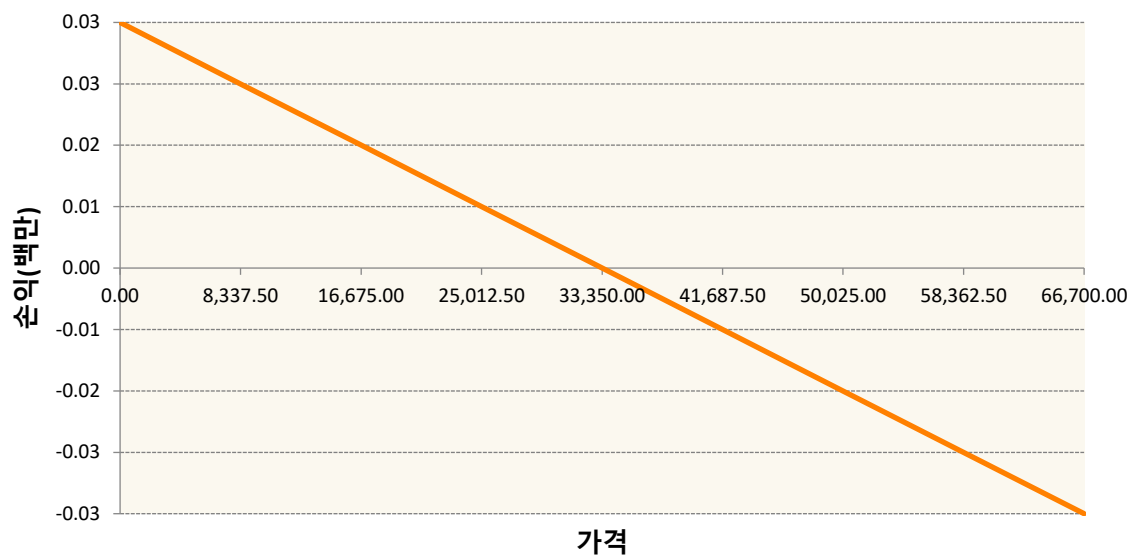
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	11	209	-199	장내
누계	유가증권	선물	25	1,036	-1,010	장내

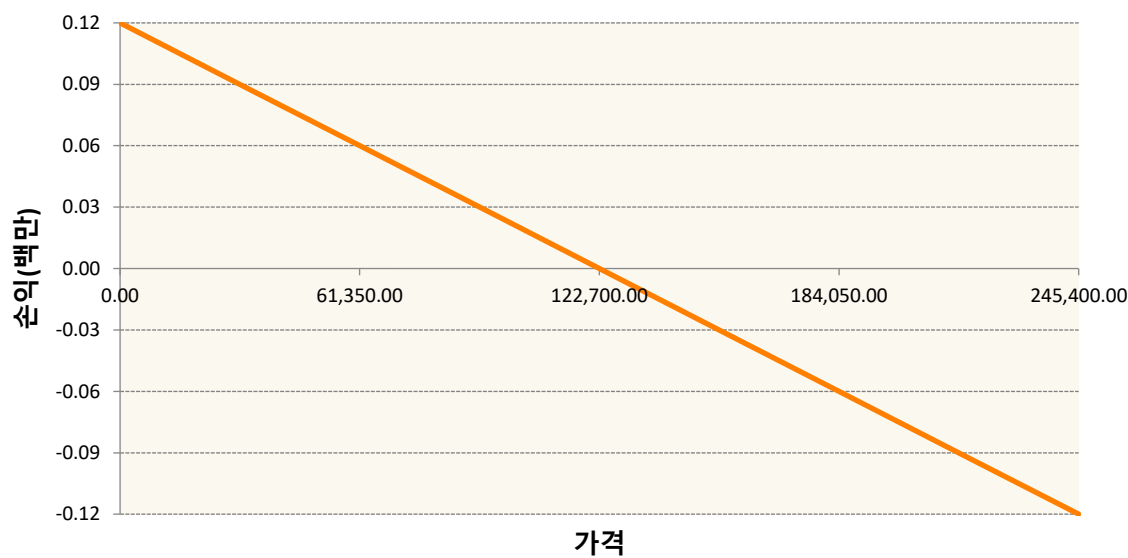
2. 만기시점의 손익구조



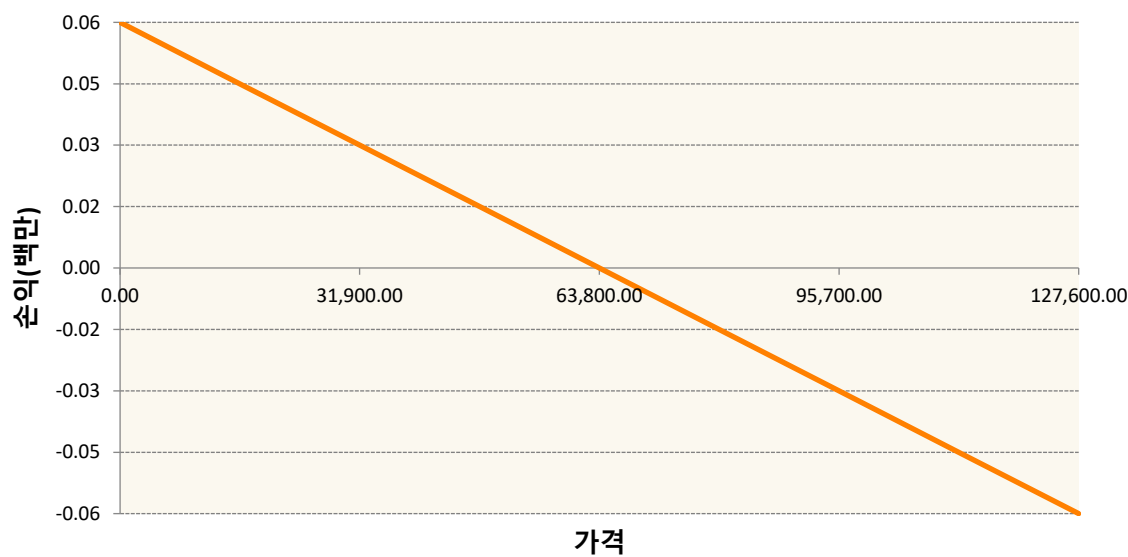
KR41BNV40005-2024-04 현대건설개별선물



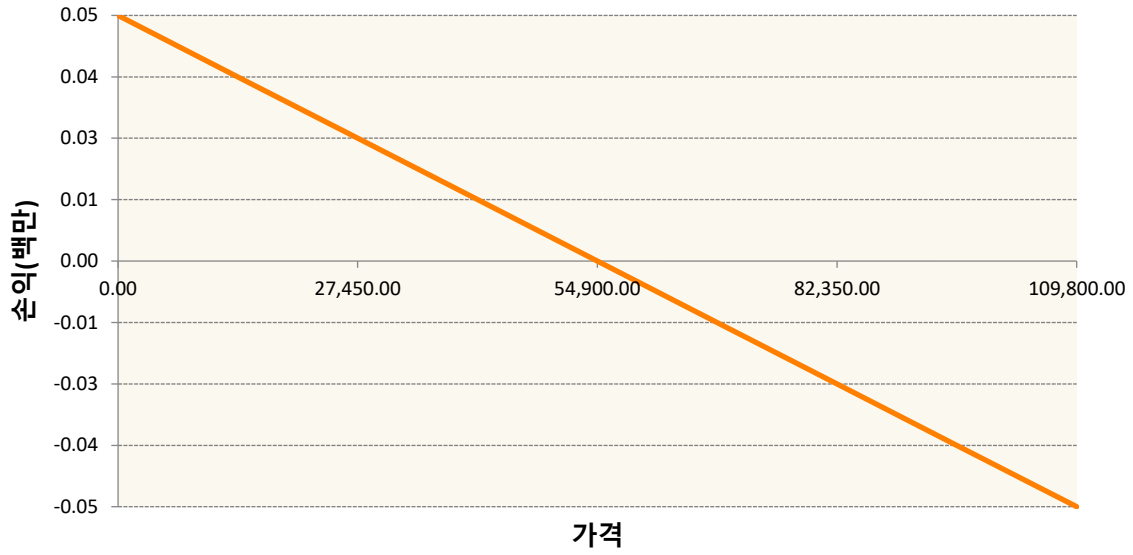
KR41C6V40000-2024-04 아모레퍼시픽개별선물



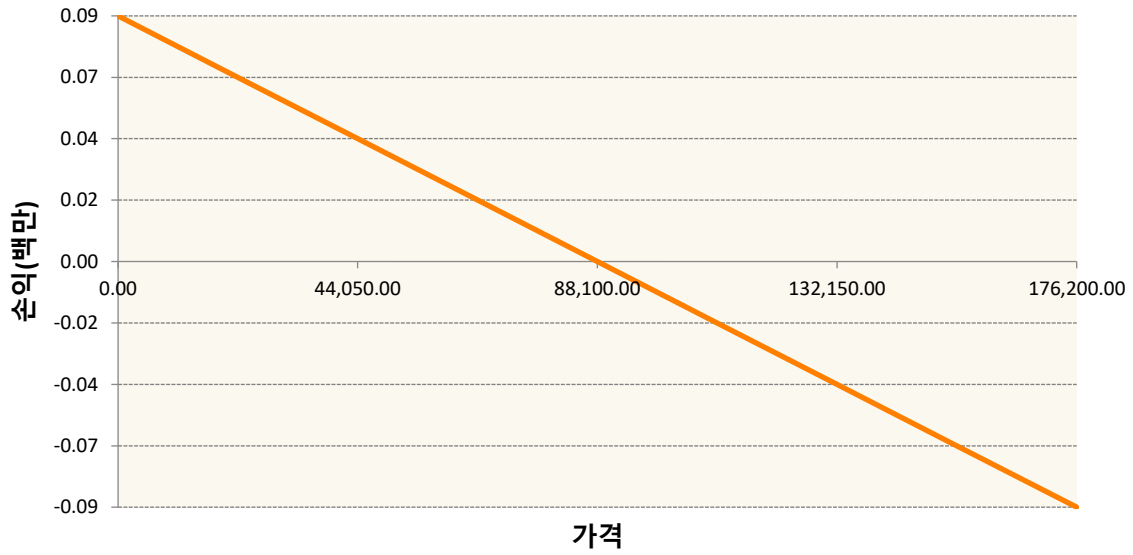
KR41CDV40004-2024-04 현대미포조선개별선물



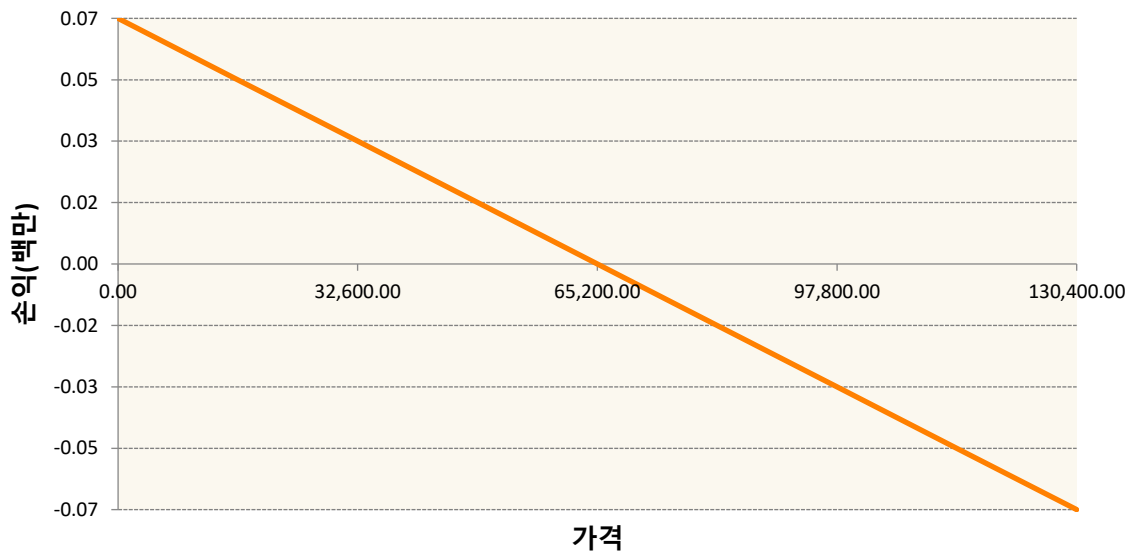
KR41CFV40009-2024-04 카카오개별선물



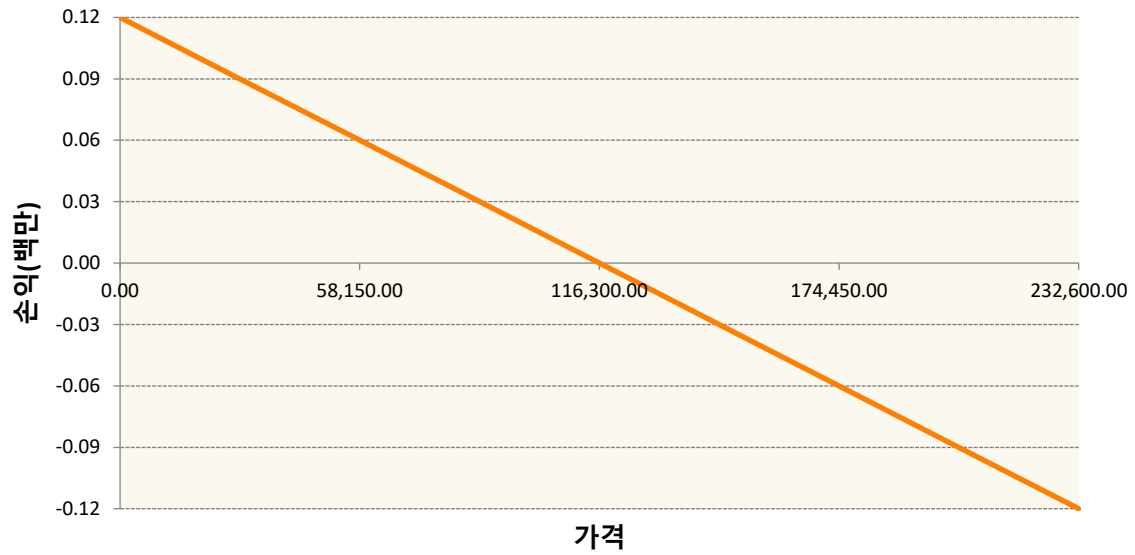
KR41E4V40003-2024-04 에스엠개별선물



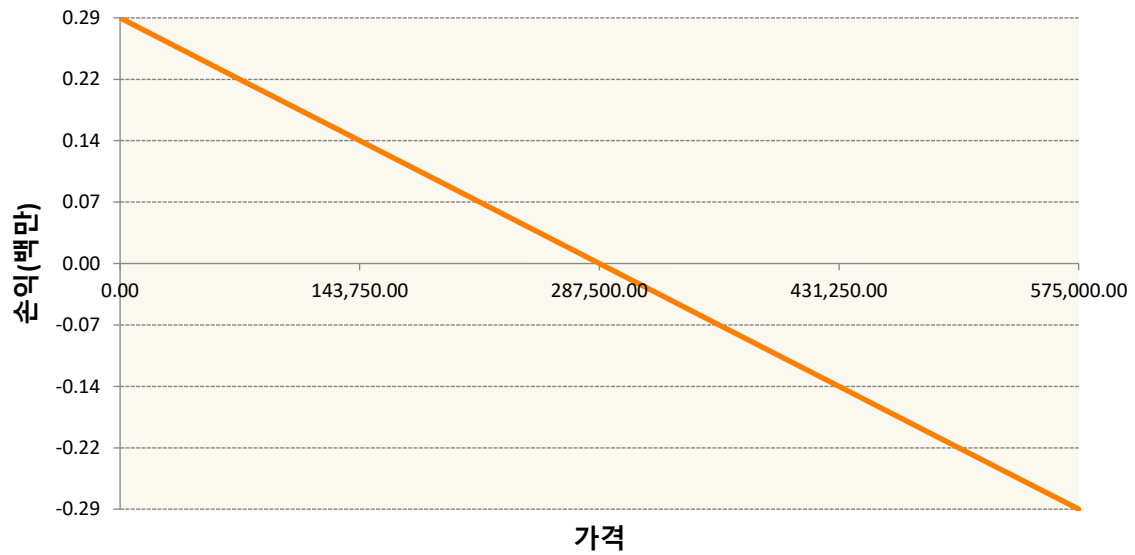
KR41E5V40000-2024-04 넷마블개별선물



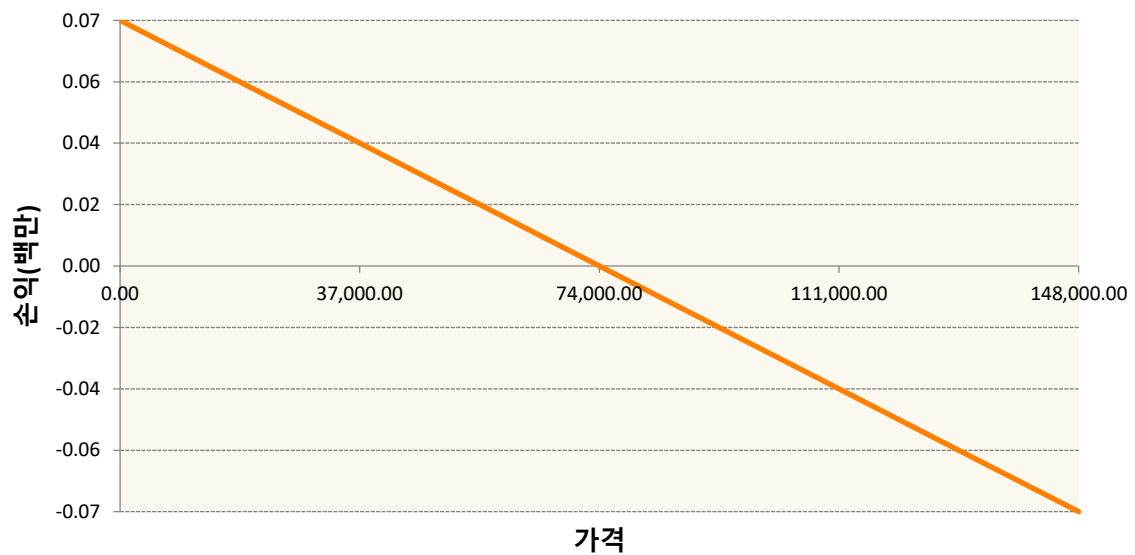
KR41EJV40007-2024-04 SKC개별선물



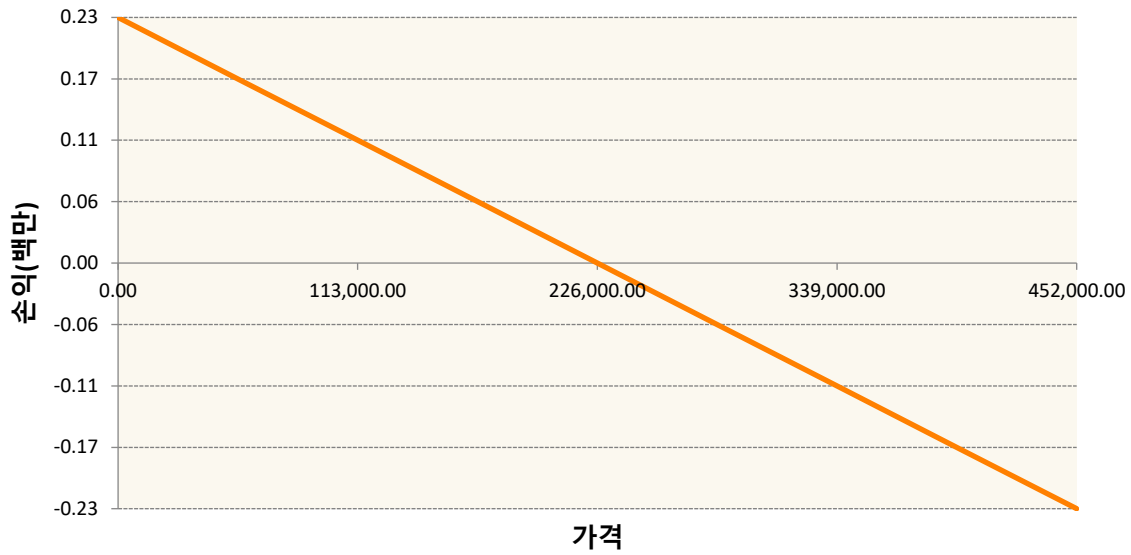
KR41EYV40006-2024-04 에코프로비엠개별선물



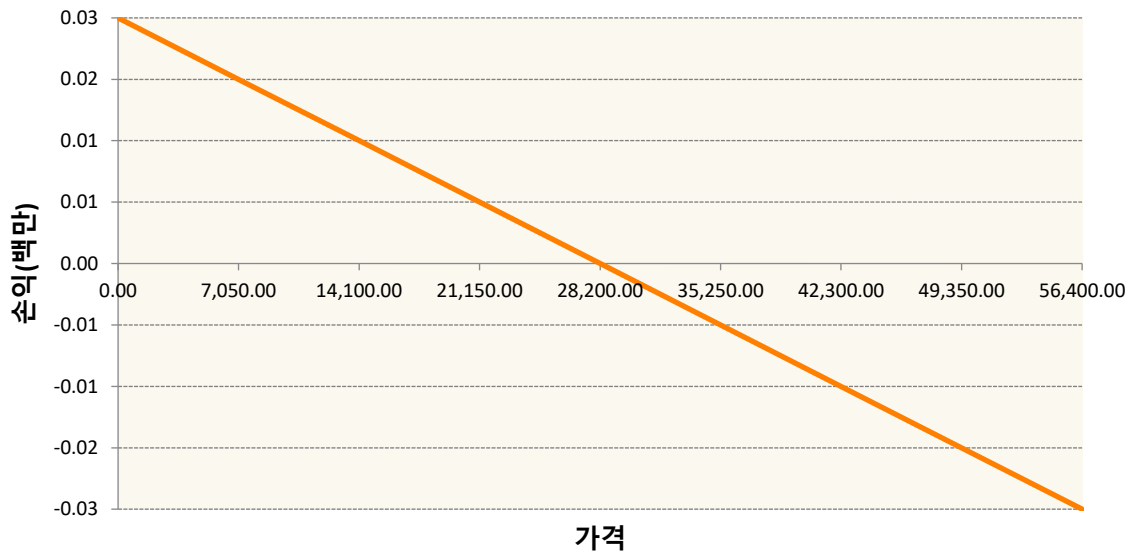
KR41FBV40001-2024-04 SK아이이테크놀로지개별선물



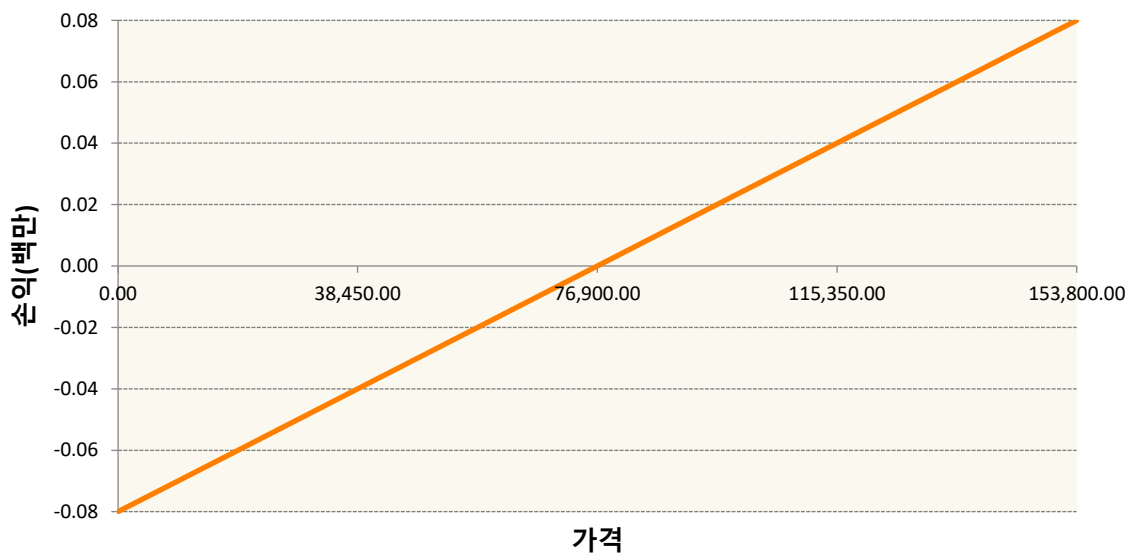
KR41FCV40009-2024-04 하이브개별선물



KR41FVV40009-2024-04 한화오션개별선물



KR41G9V40000-2024-04 레고캠바이오개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
KR4101V600 2024-06 코스피200지수선물		45
KR4139V400 2024-04 HD한국조선해양개별선물		1
KR41BNV400(2024-04 현대건설개별선물		0.27
KR41C6V400 2024-04 아모레퍼시픽개별선물		26
KR41CDV400(2024-04 현대미포조선개별선물		1
KR41CFV400 2024-04 카카오개별선물		0.44
KR41E4V400 2024-04 에스엠개별선물		0.42
KR41E5V400 2024-04 넷마블개별선물		1
KR41EJV400(2024-04 SKC개별선물		2
KR41EYV400 2024-04 에코프로비엠개별선물		1
KR41FBV400 2024-04 SK아이이테크놀로지개별선물		2
KR41FCV400 2024-04 하이브개별선물		2
KR41FVV400 2024-04 한화오션개별선물		1
KR41G9V400 2024-04 레고캠바이오개별선물		2

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	140

공시일	2024-03-28
기준일	2024-03-27

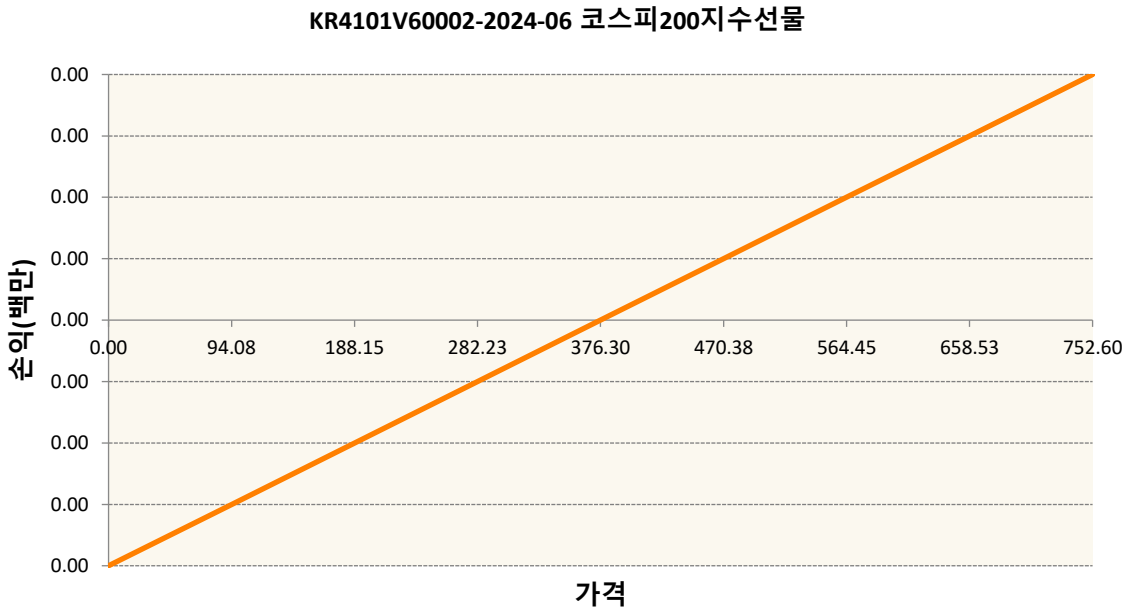
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	564	-564	장내
누계	유가증권	선물	3,199	0	3,199	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101V60002		2024-06 코스피200지수선물					254
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-254	-254	-254	-254	-254	-254	-254
-5.33%	-170	-170	-170	-170	-170	-170	-170
-2.67%	-85	-85	-85	-85	-85	-85	-85
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	85	85	85	85	85	85	85
5.33%	170	170	170	170	170	170	170
8.00%	254	254	254	254	254	254	254

공시일	2024-03-28
기준일	2024-03-27

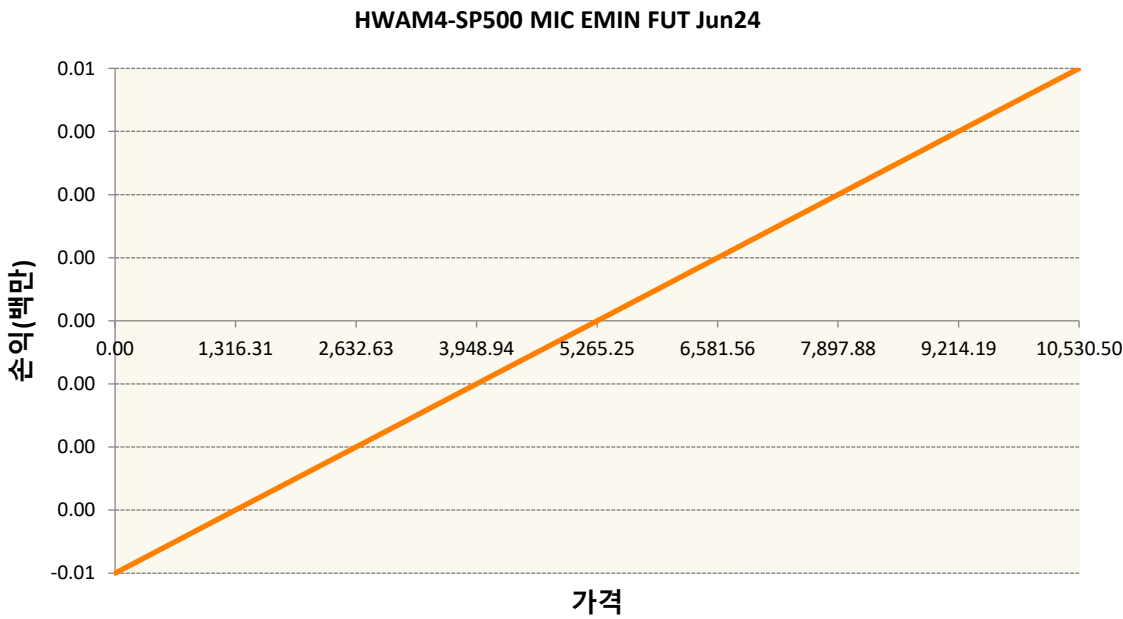
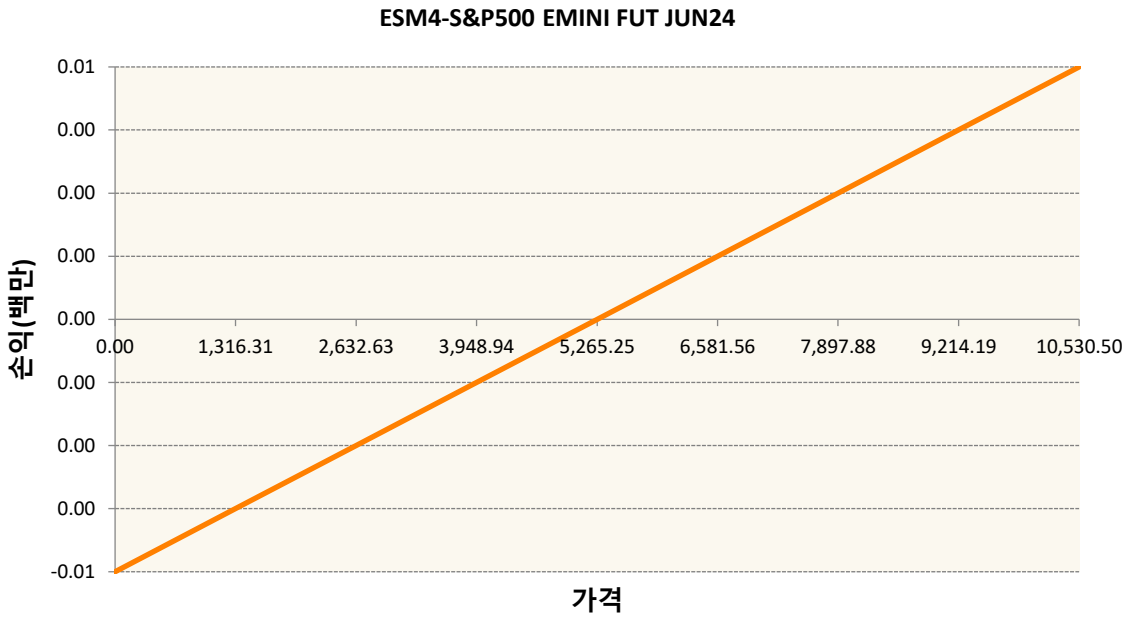
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

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	4,169	0	4,169	
누계	유가증권	선물	1,700	0	1,700	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESM4	S&P500 EMINI FUT JUN24	334
HWAM4	SP500 MIC EMIN FUT Jun24	136

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	339

공시일	2024-03-28
기준일	2024-03-27

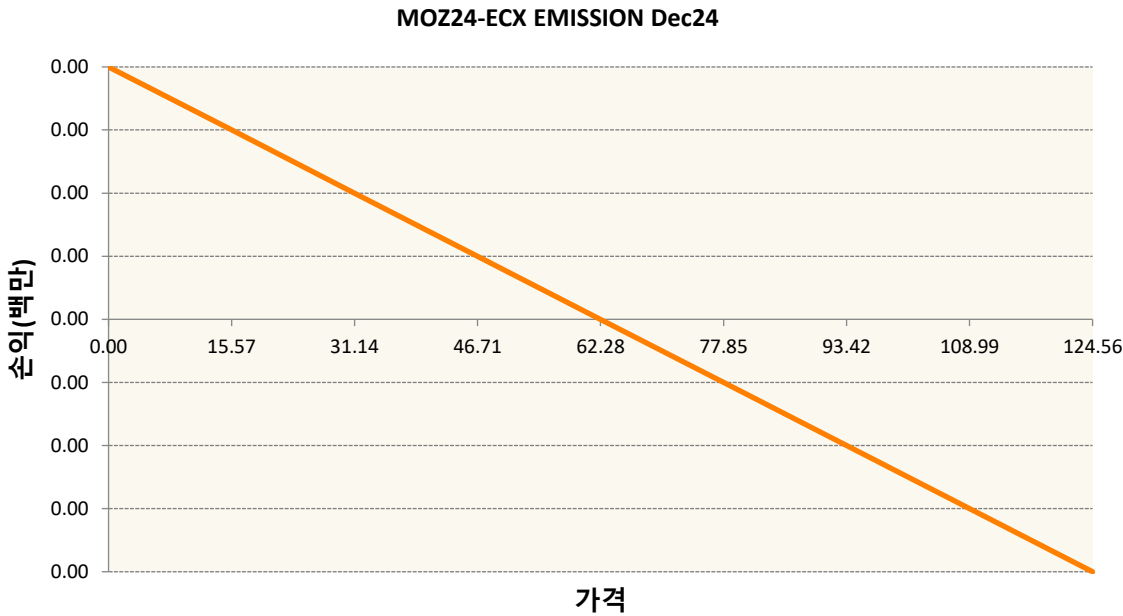
SOL유럽탄소배출권선물인버스ICE특별자산상

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	5,449	-5,449	
누계	지수	스왑	331	0	331	장외
누계	통화	선도	1,200	4,023	-2,823	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213E2TC KRW/EUR 28-03-24E	85
FXW213E2TC KRW/EUR 28-03-24E	148
FXW213E3C(EUR/KRW 28-03-24E	96
FXW213E3SC KRW/EUR 30-04-24E	89
MOZ24 ECX EMISSION Dec24	436
SWICEUACN ICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX	1

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

(단위:백만원)

공시일	2024-03-28
기준일	2024-03-27

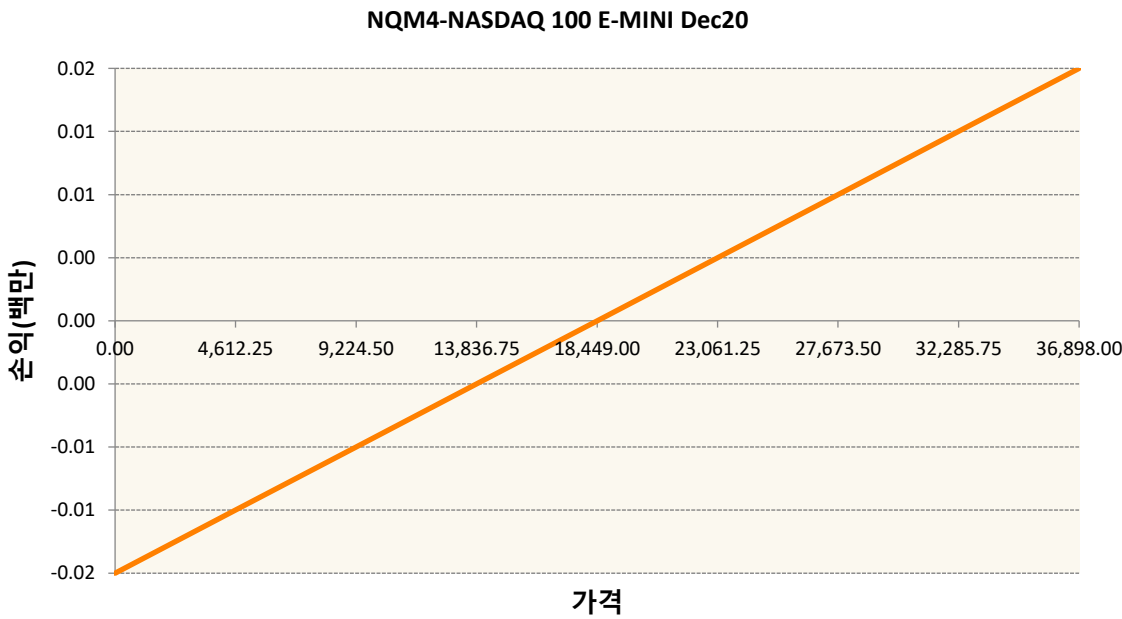
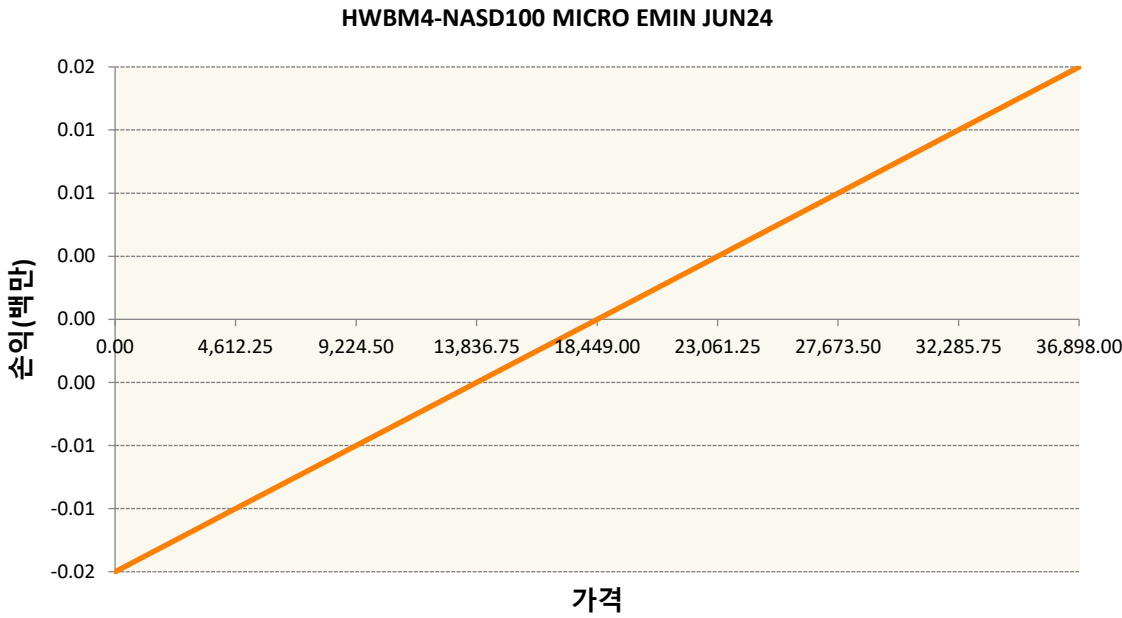
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

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	2,438	0	2,438	
누계	유가증권	선물	2,382	0	2,382	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
HWBM4	NASD100 MICRO EMIN JUN24		191
NQM4	NASDAQ 100 E-MINI Dec20		195

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)			(단위:백만원)
			330

공시일	2024-03-28
기준일	2024-03-27

SOL미국30년국채커버드콜(합성)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	101,245	0	101,245	장외
누계	지수	스왑	106,800	0	106,800	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWKEDI0000 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	447
SWKEDI0000 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	5,826
SWKEDI0000 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	1,634
SWKEDI0000 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	722

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

(단위:백만원)

5,412

공시일	2024-03-28
기준일	2024-03-27

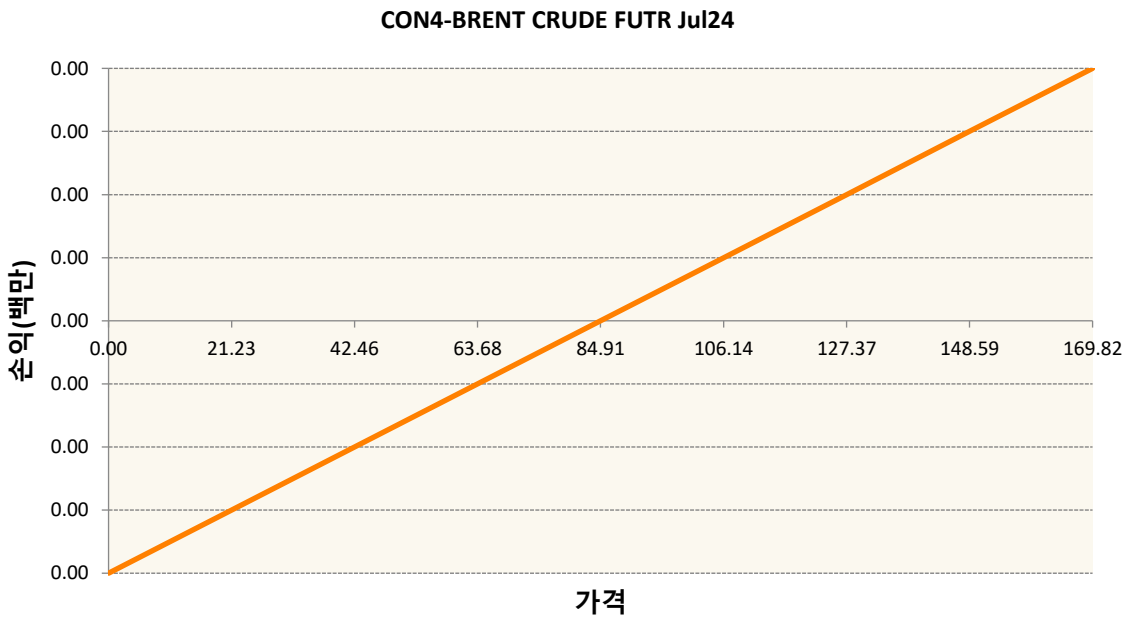
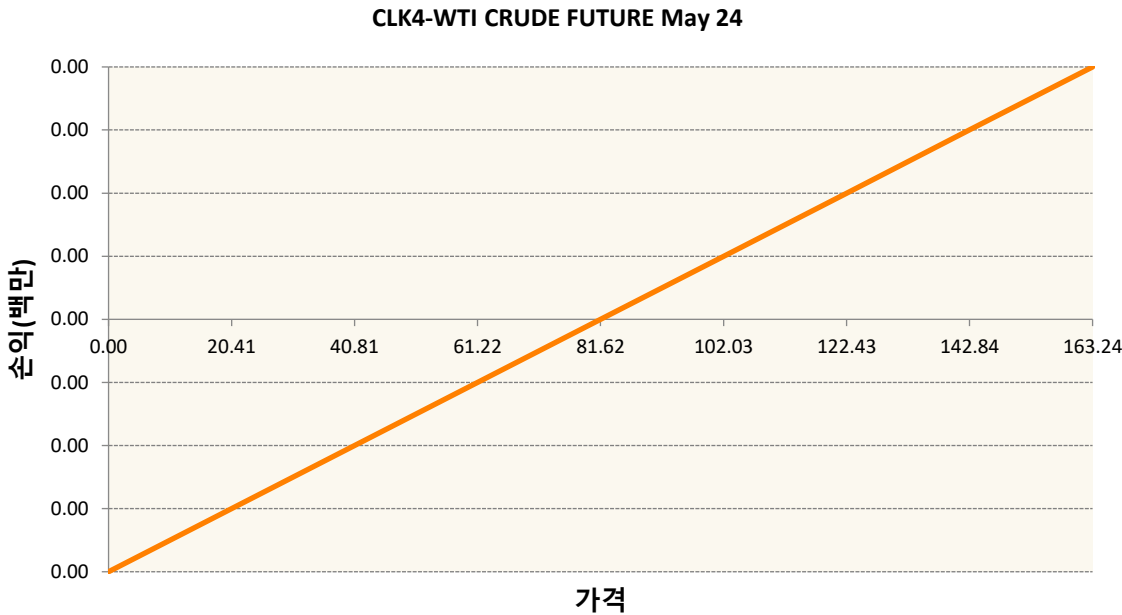
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

1. 계약금액

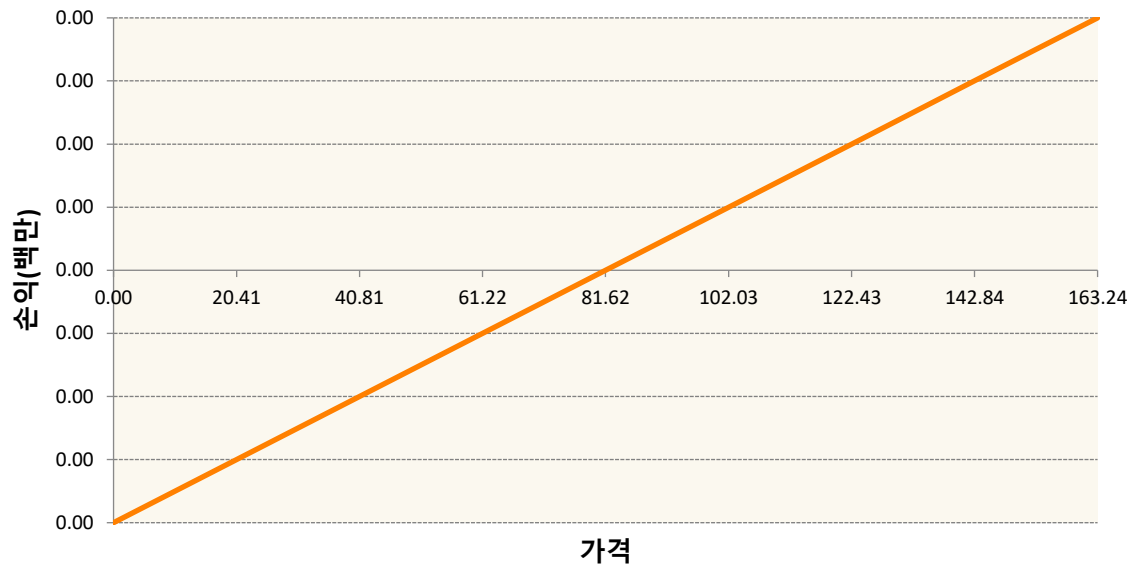
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	13	0	13	장내
누계	유가증권	선물	1,179	0	1,179	
누계	통화	선물	0	216	-216	장내

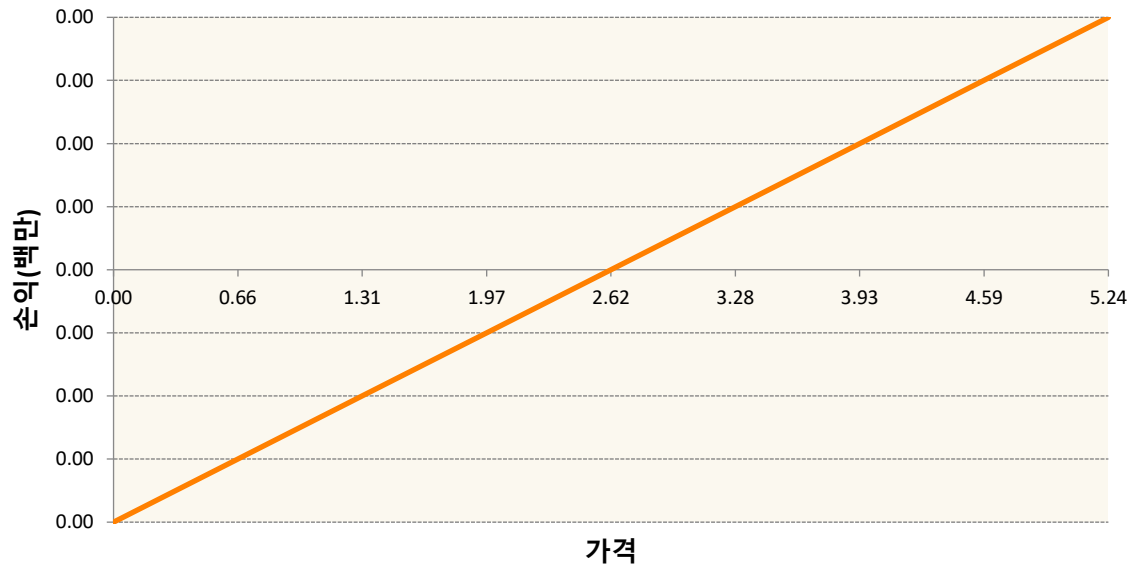
2. 만기시점의 손익구조



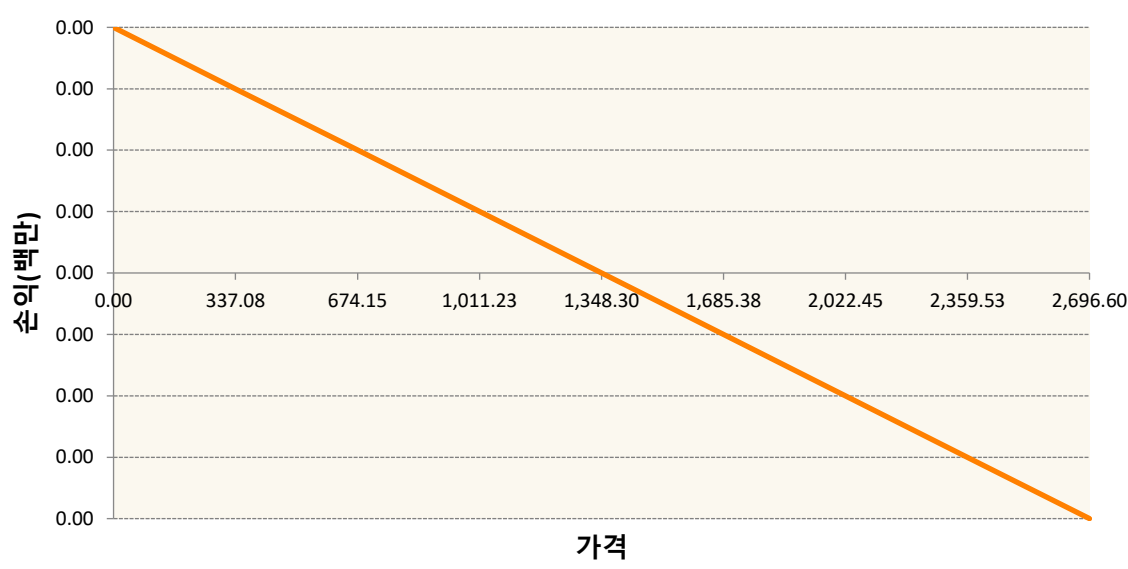
ECK4-E-mini Crude Oil May 24



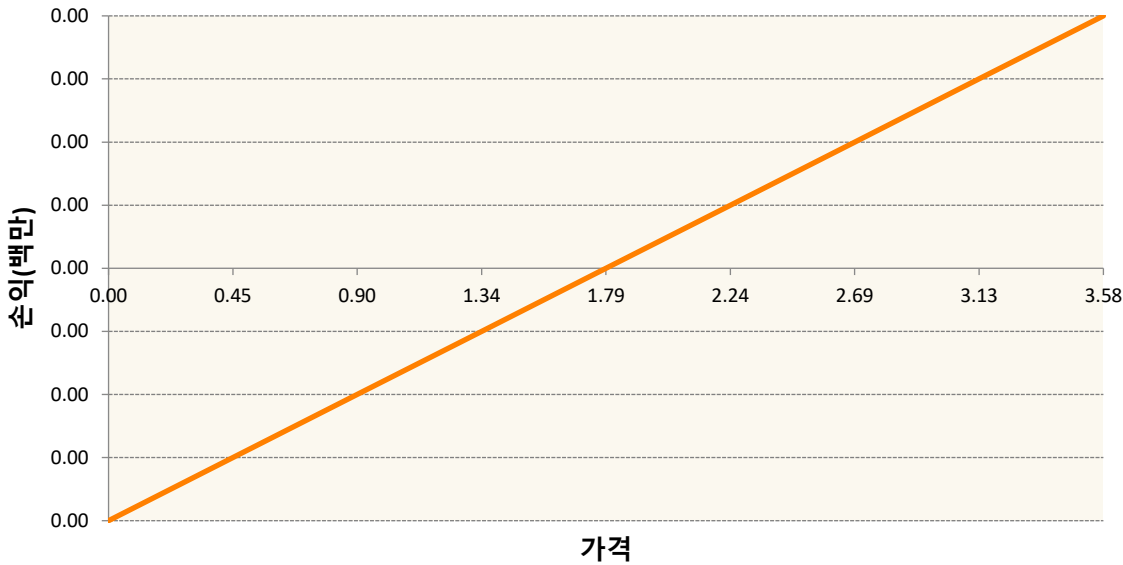
HOK4-NY Harb ULSD Fut May 24



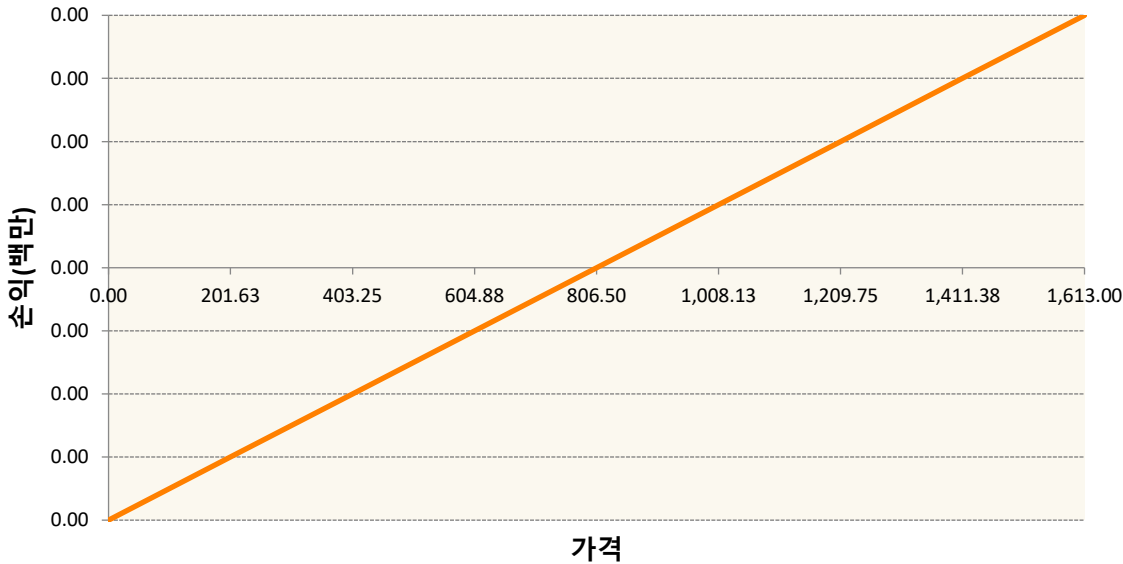
KR4175V40008-2024-04 달러선물



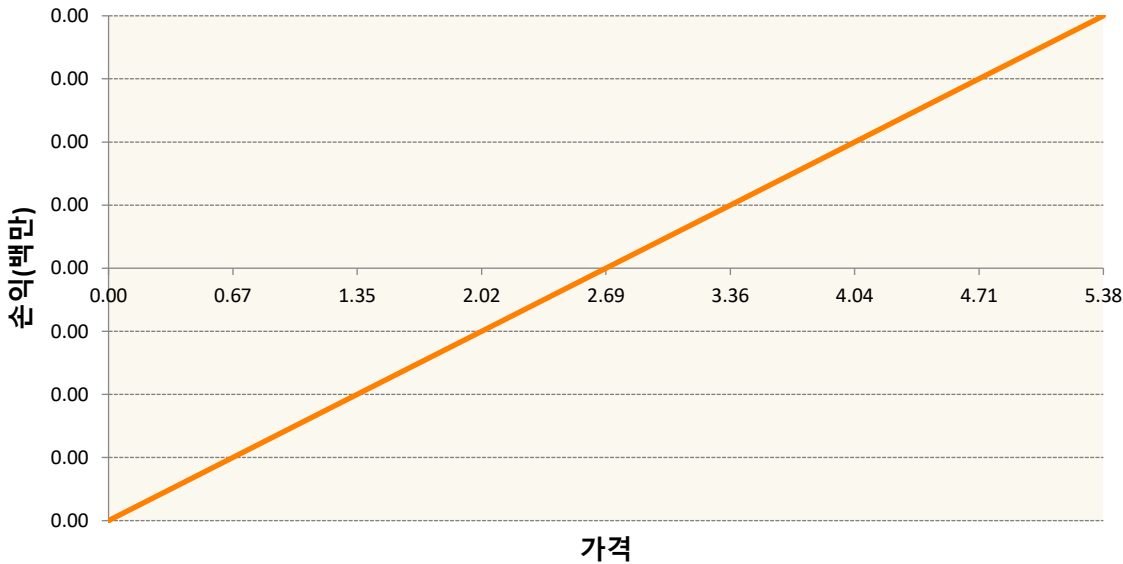
NGK24-NATURAL GAS FUTR May 24



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		17
NGK24	NATURAL GAS FUTR May 24	13
QSK4	Low Su Gasoil G May 24	9
XBK4	GASOLINE RBOB FUT May 24	12

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

211