

공시일	2024-04-08
기준일	2024-04-05

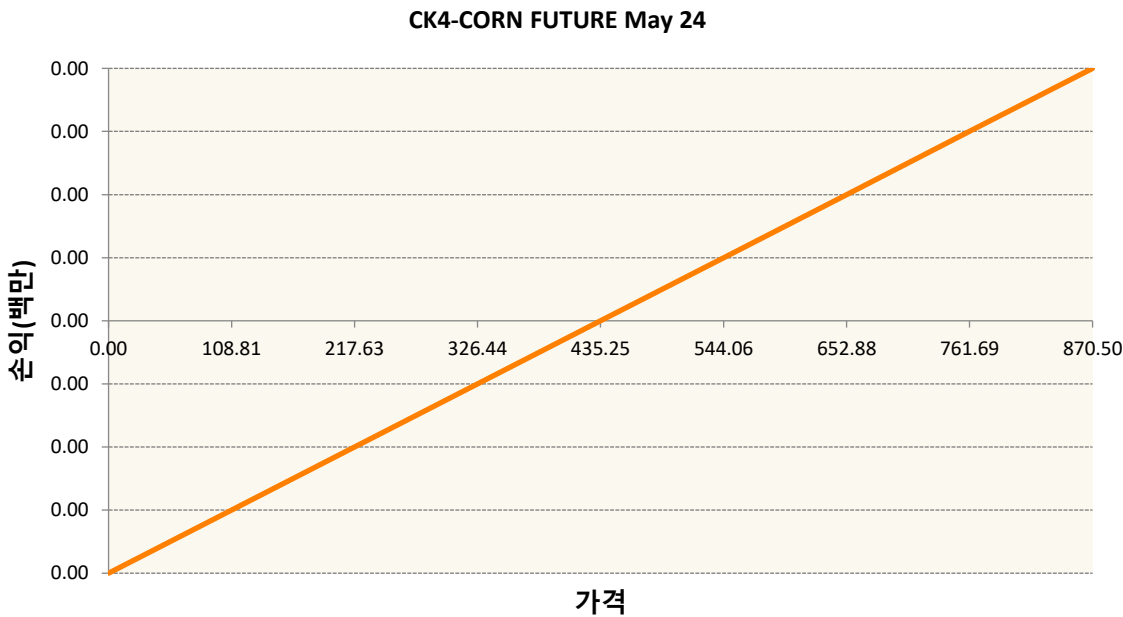
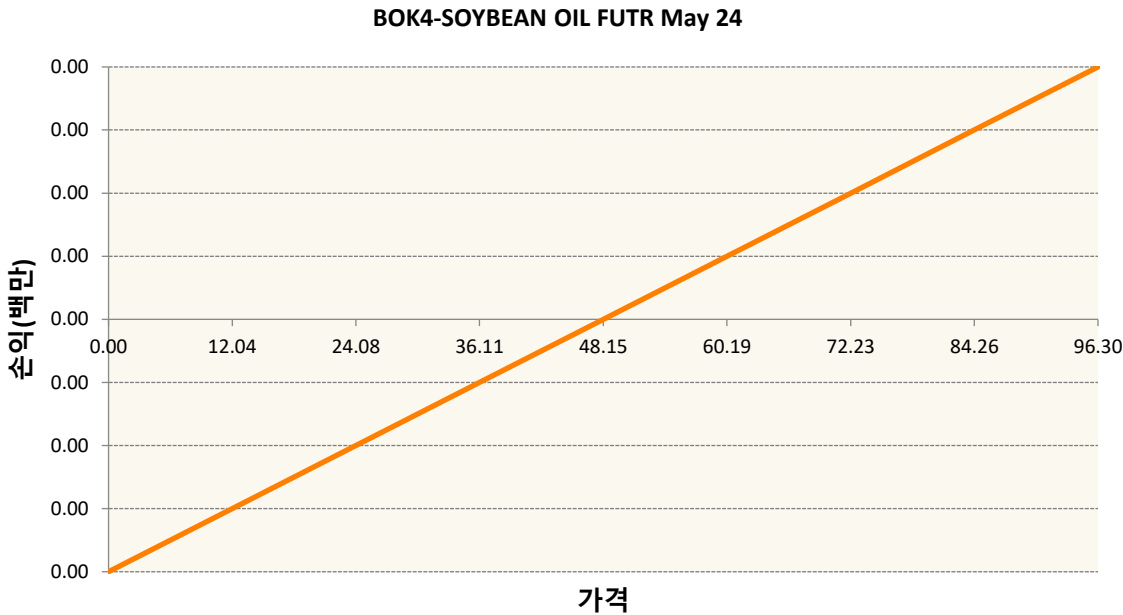
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

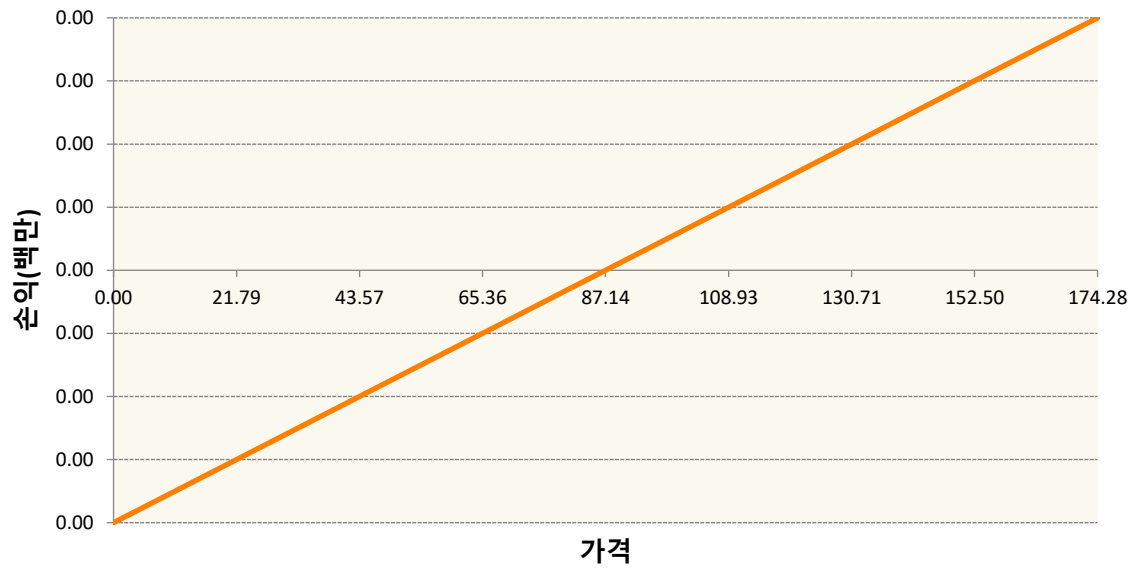
(단위:USD 백만)

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	4,279	0	4,279	
누계	통화	선물	0	527	-527	장내

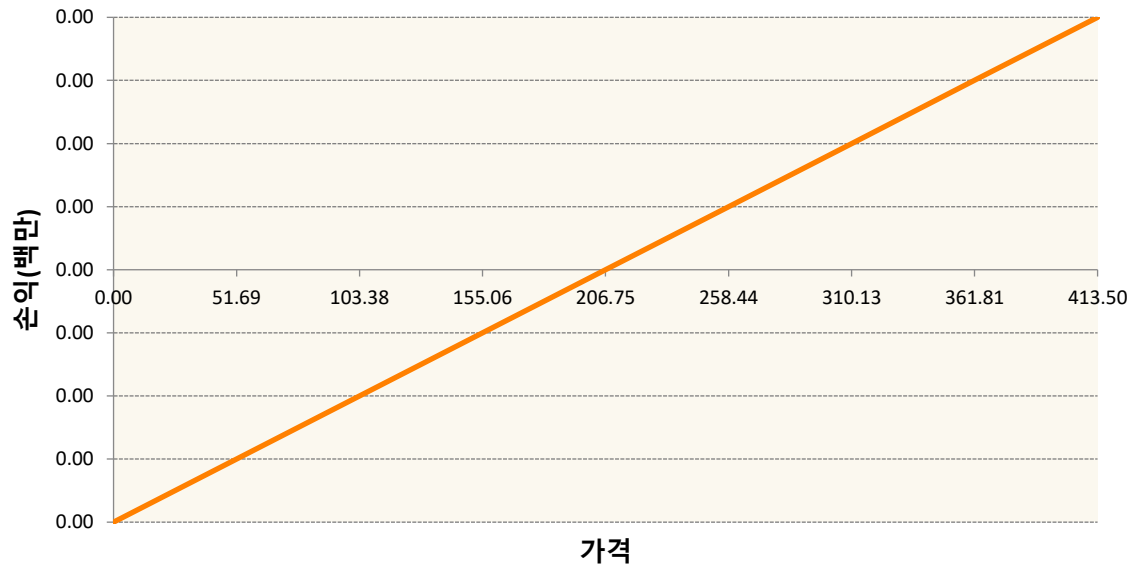
2. 만기시점의 손익구조



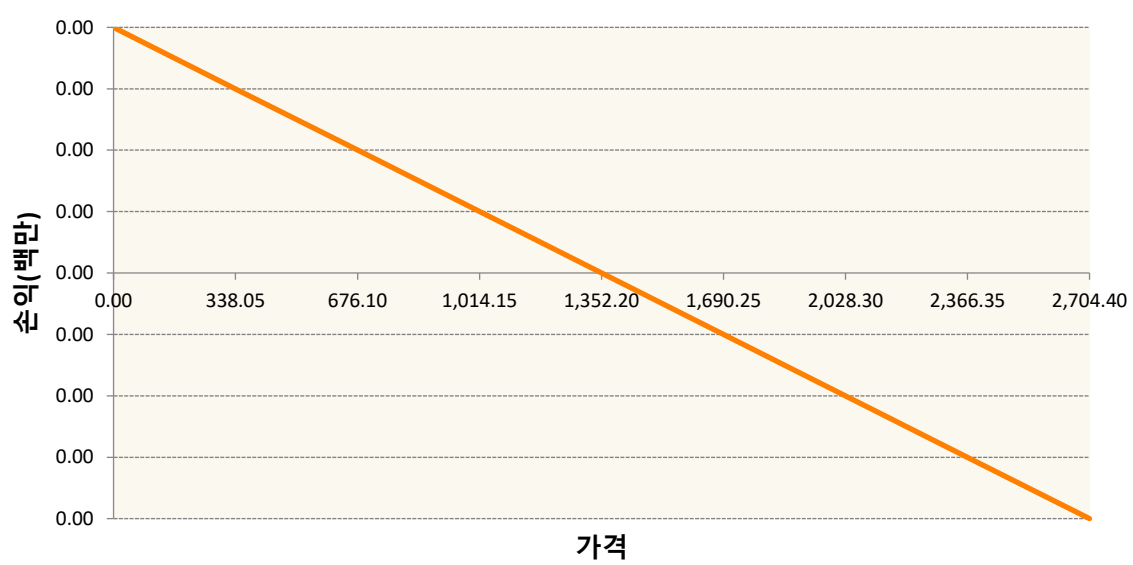
CTK4-COTTON NO.2 FUTR May 24



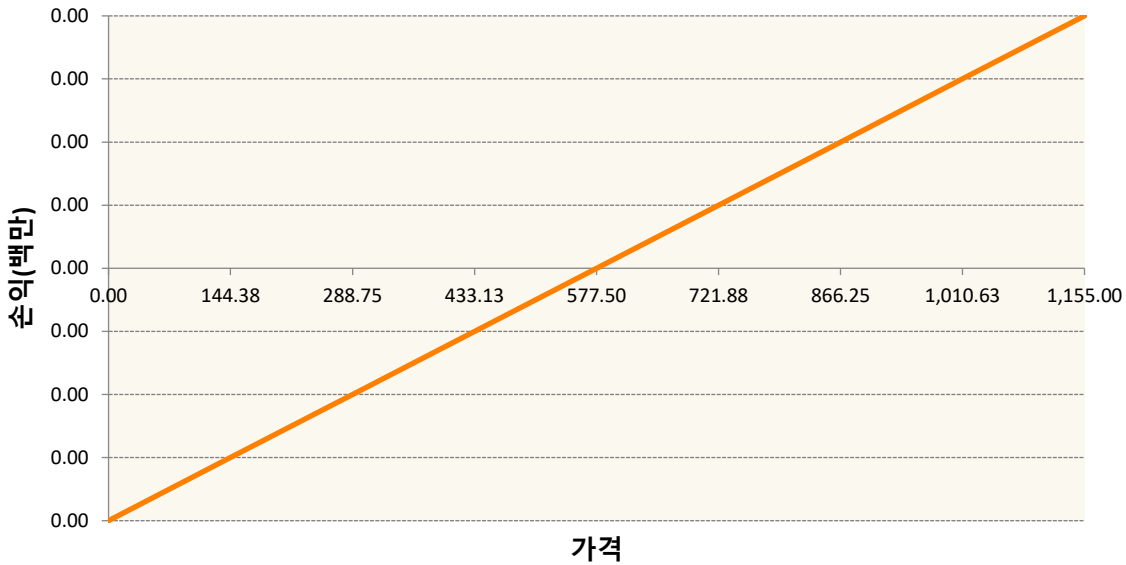
KCK4-COFFEE 'C' FUTURE May 24



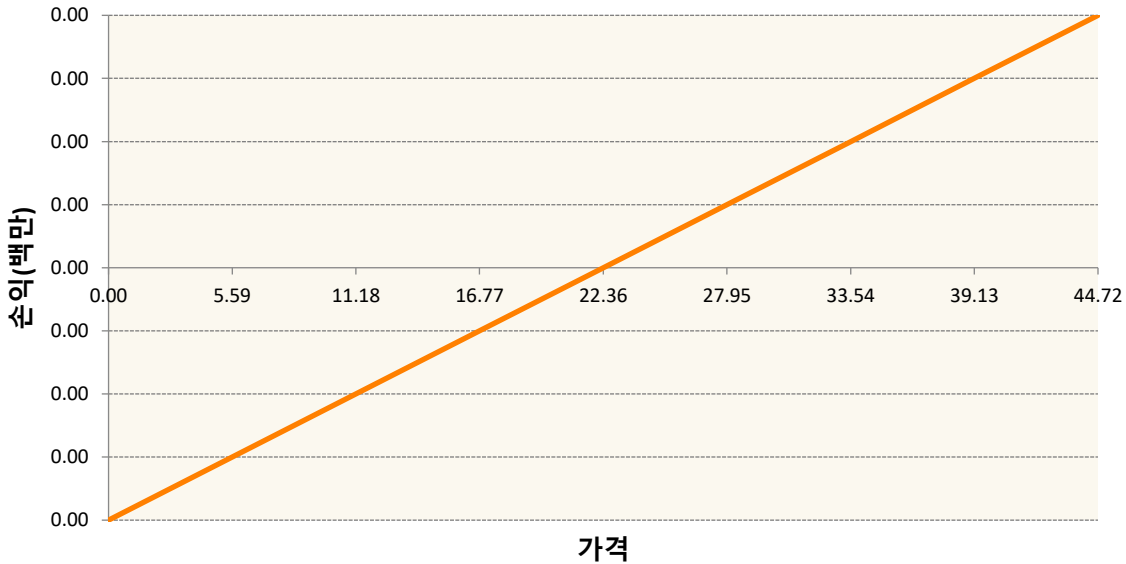
KR4175V40008-2024-04 달러선물



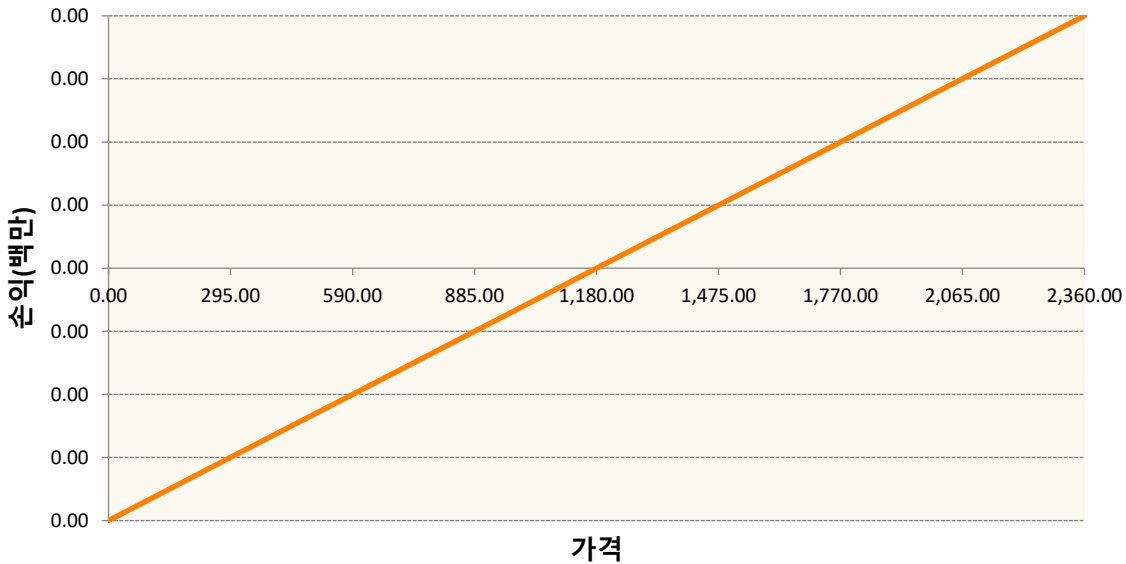
KWK4-KC HRW WHEAT FUT May 24



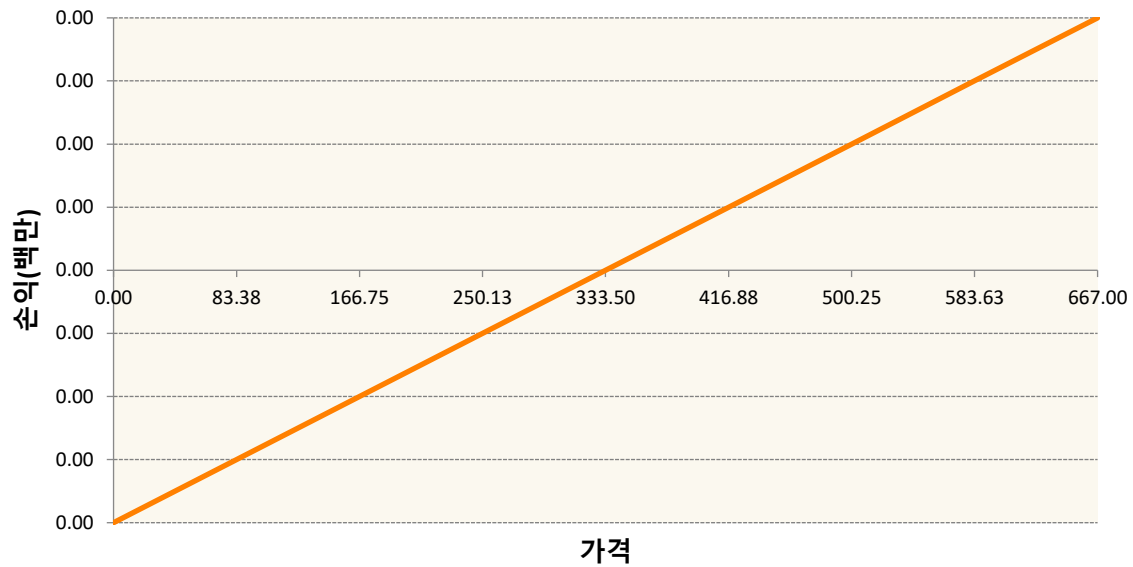
SBK4-Sugar #11 (WORLD) May 24



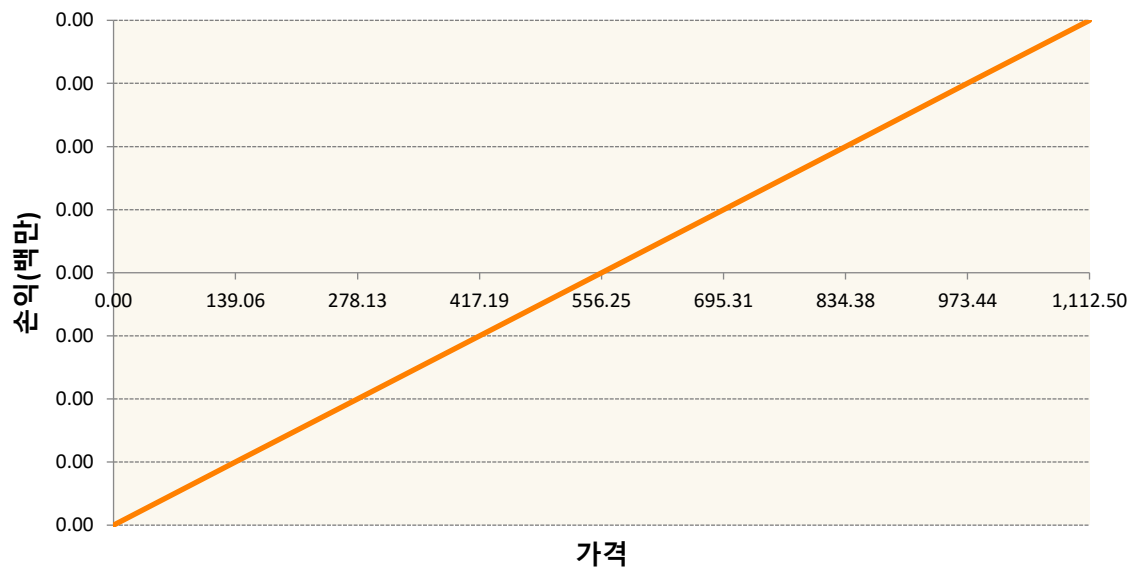
SK4-SOYBEAN FUTURE May 24



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	2024-04-08
기준일	2024-04-05

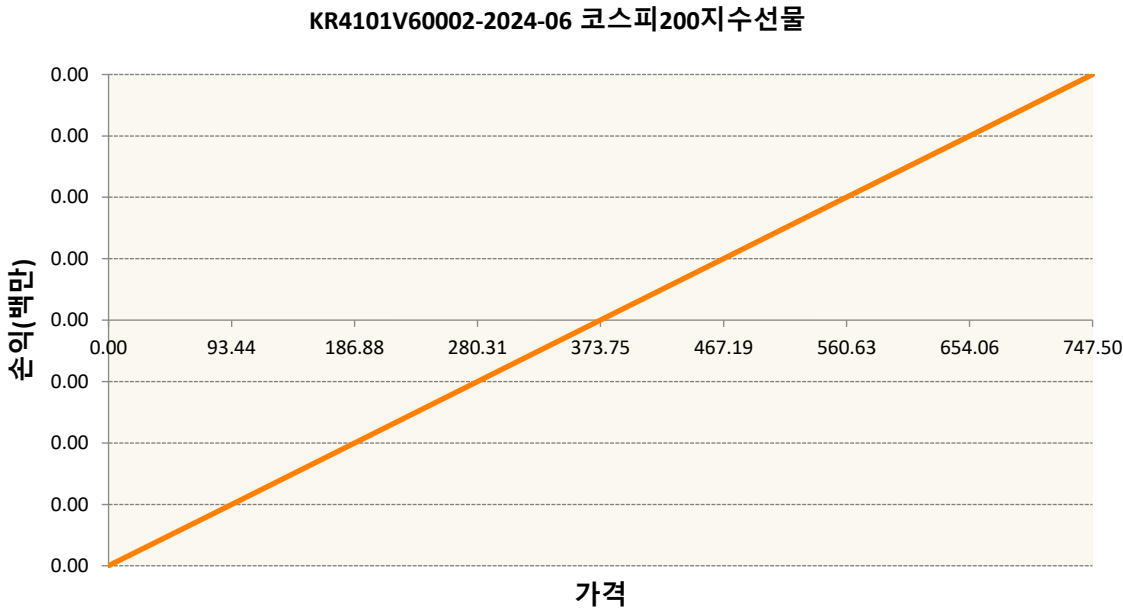
스마트인덱스모

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	2,616	0	2,616	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101V60002			2024-06 코스피200지수선물				208
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-208	-208	-208	-208	-208	-208	-208
-5.33%	-139	-139	-139	-139	-139	-139	-139
-2.67%	-69	-69	-69	-69	-69	-69	-69
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	69	69	69	69	69	69	69
5.33%	139	139	139	139	139	139	139
8.00%	208	208	208	208	208	208	208

공시일	2024-04-08
기준일	2024-04-05

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	3,420	0	3,420	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 신한CSI500미래231226	267
-----------------------------	-----

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

313

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2024-04-08
기준일	2024-04-05

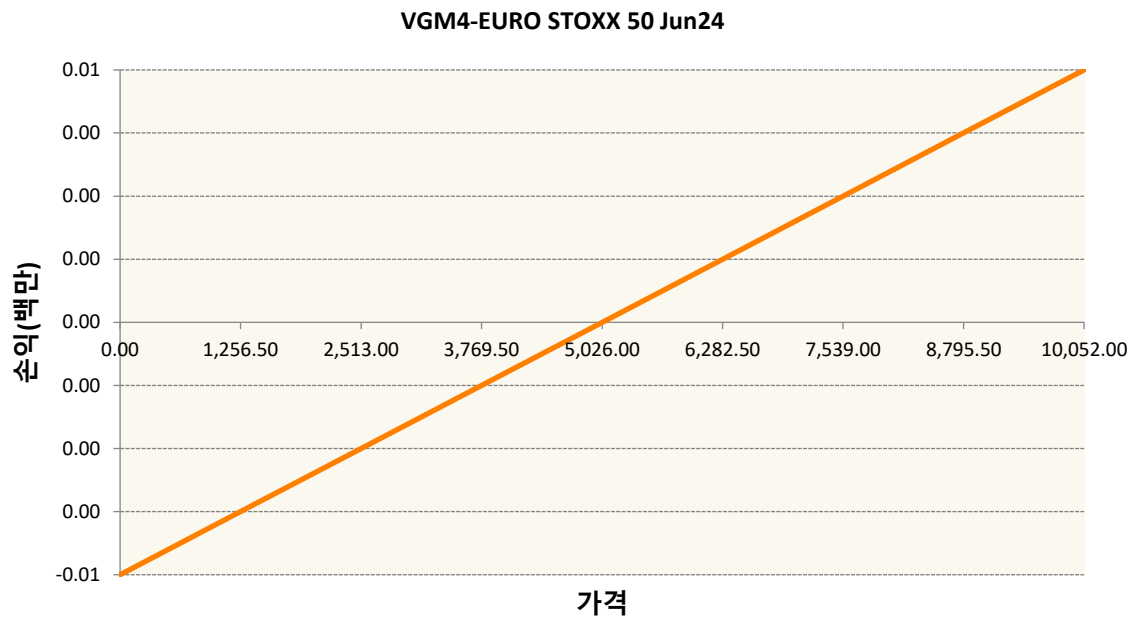
유로인덱스모(주식-파생형)

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	1,010	0	1,010	
누계	통화	선도	220	0	220	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)

67

공시일	2024-04-08
기준일	2024-04-05

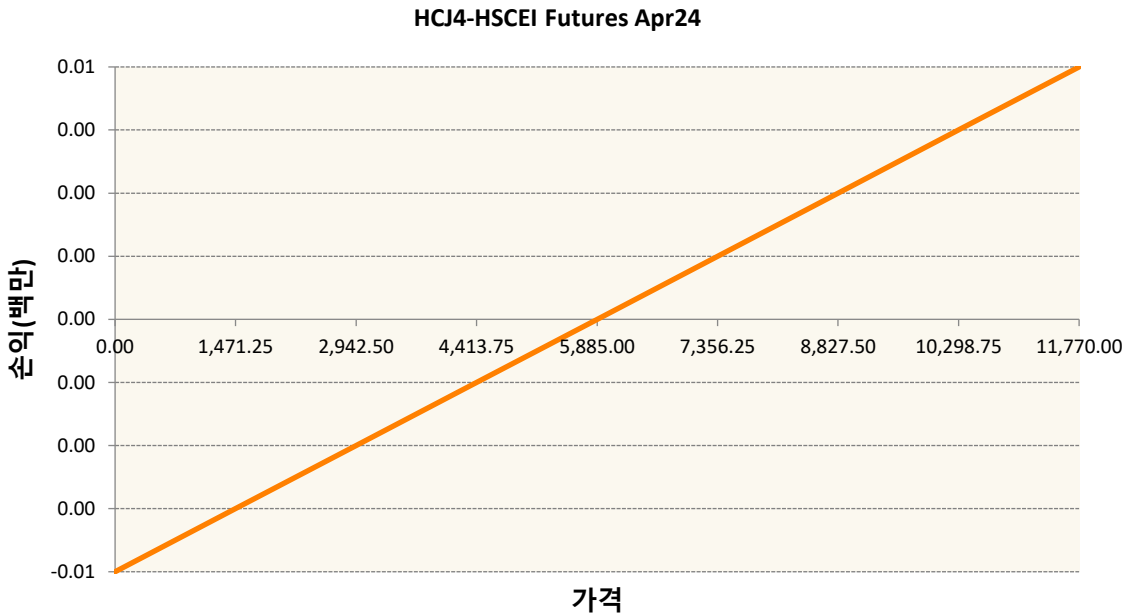
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,209	0	1,209	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCI4	HSCEI Futures Apr24	97
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

127

공시일	2024-04-08
기준일	2024-04-05

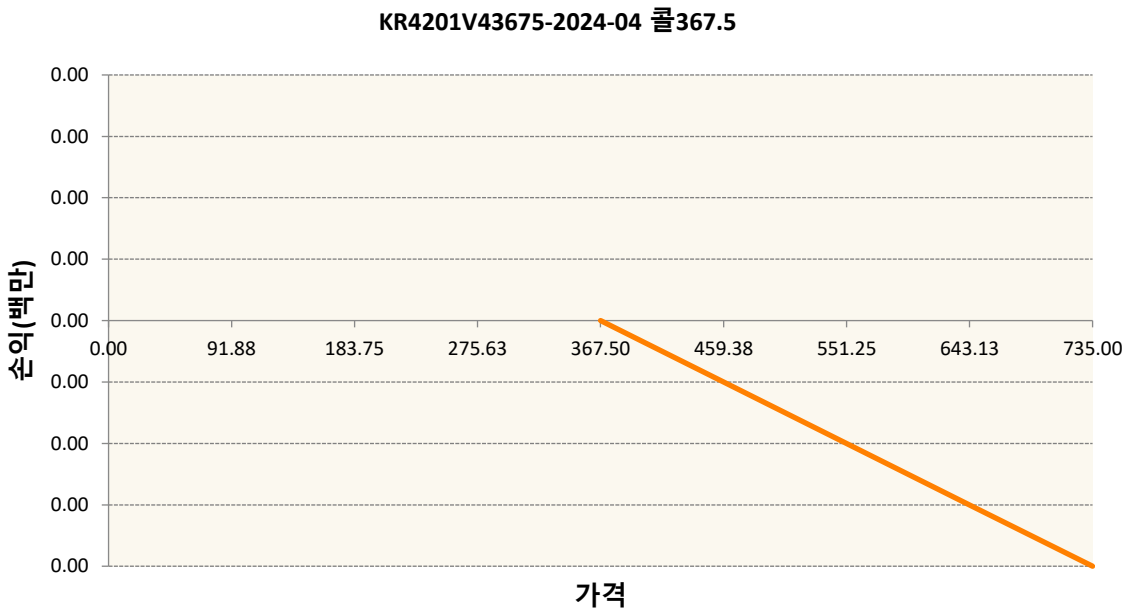
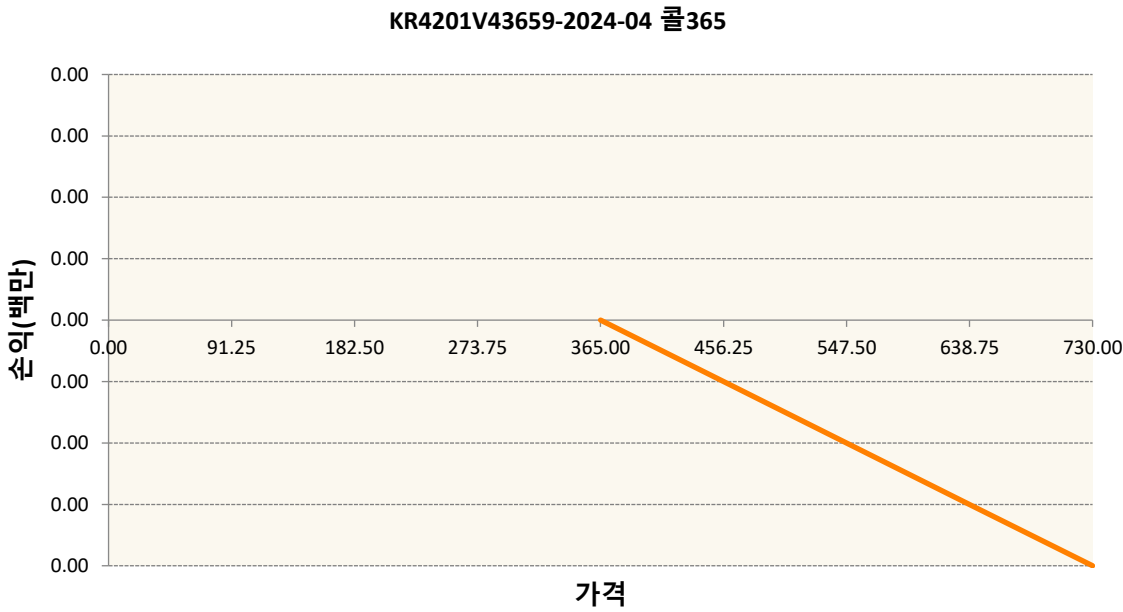
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

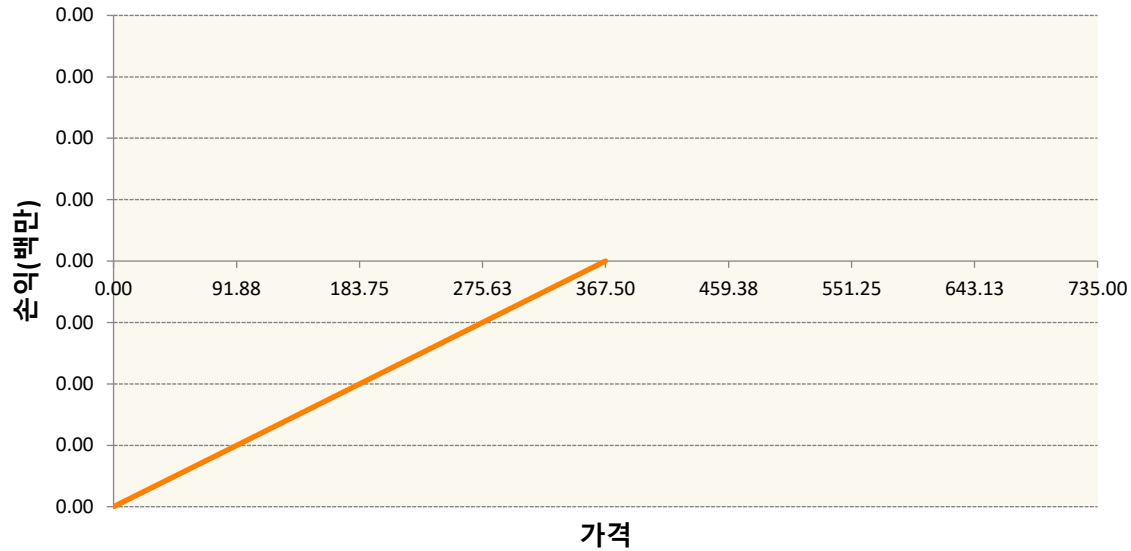
(단위:백만원)

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

2. 만기시점의 손익구조



KR4301V43673-2024-04 풋367.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201V43659			2024-04 콜365				1,113
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	372	371	369	367	363	359	354
-5.33%	359	352	343	334	324	313	301
-2.67%	275	258	242	225	208	192	175
0%	44	30	15	0	-15	-31	-47
2.67%	-309	-314	-321	-328	-337	-346	-356
5.33%	-706	-707	-708	-710	-713	-717	-721
8.00%	-1,109	-1,109	-1,109	-1,110	-1,110	-1,111	-1,113
KR4201V43675			2024-04 콜367.5				1,736
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	492	491	489	486	482	477	471
-5.33%	480	472	462	450	436	421	405
-2.67%	386	362	338	313	288	262	236
0%	79	53	27	0	-27	-54	-81
2.67%	-451	-463	-476	-491	-508	-527	-546
5.33%	-1,079	-1,082	-1,085	-1,090	-1,097	-1,105	-1,114
8.00%	-1,727	-1,727	-1,727	-1,728	-1,730	-1,732	-1,736
KR4301V43673			2024-04 풋367.5				536
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-536	-536	-536	-536	-536	-536	-536
-5.33%	-313	-314	-314	-315	-316	-318	-320
-2.67%	-104	-109	-113	-118	-124	-129	-134
0%	16	11	6	0	-6	-12	-18

2.67%	38	38	36	35	33	31	28
5.33%	39	39	39	39	39	38	38
8.00%	39	39	39	39	39	39	39

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	3,885

공시일	2024-04-08
기준일	2024-04-05

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	1,740	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	2024-04-08
기준일	2024-04-05

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	4,347	0	4,347	

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	2024-04-08
기준일	2024-04-05

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	15,831	0	15,831	
누계	통화	선도	0	15,672	-15,672	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213E1W KRW/USD 30-04-24E	253
FXW213E2TC KRW/USD 31-05-24E	584
FXW213E3TC KRW/USD 28-06-24E	417
IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

590

공시일	2024-04-08
기준일	2024-04-05

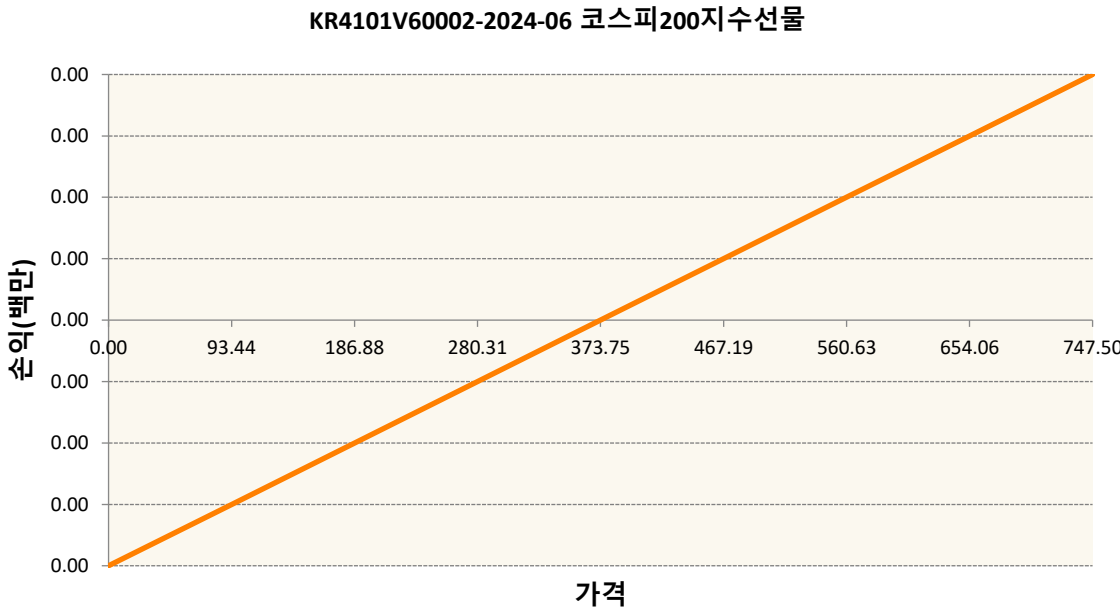
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	93	-93	장내
누계	유가증권	선물	467	0	467	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101V60002		2024-06 코스피200지수선물					37
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-37	-37	-37	-37	-37	-37	-37
-5.33%	-25	-25	-25	-25	-25	-25	-25
-2.67%	-12	-12	-12	-12	-12	-12	-12
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	12	12	12	12	12	12	12
5.33%	25	25	25	25	25	25	25
8.00%	37	37	37	37	37	37	37

공시일	2024-04-08
기준일	2024-04-05

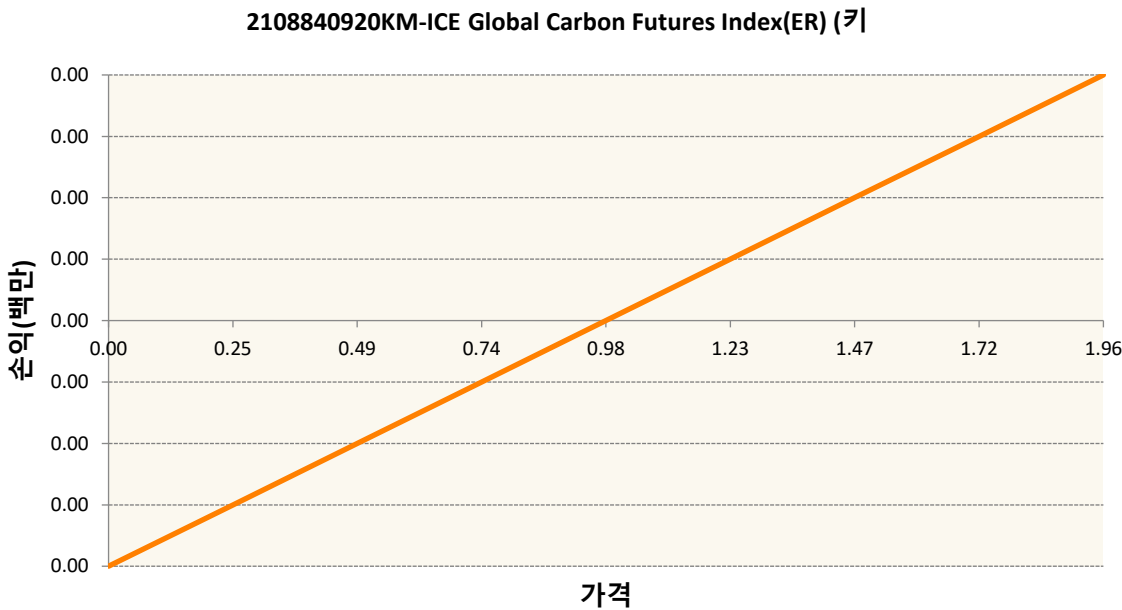
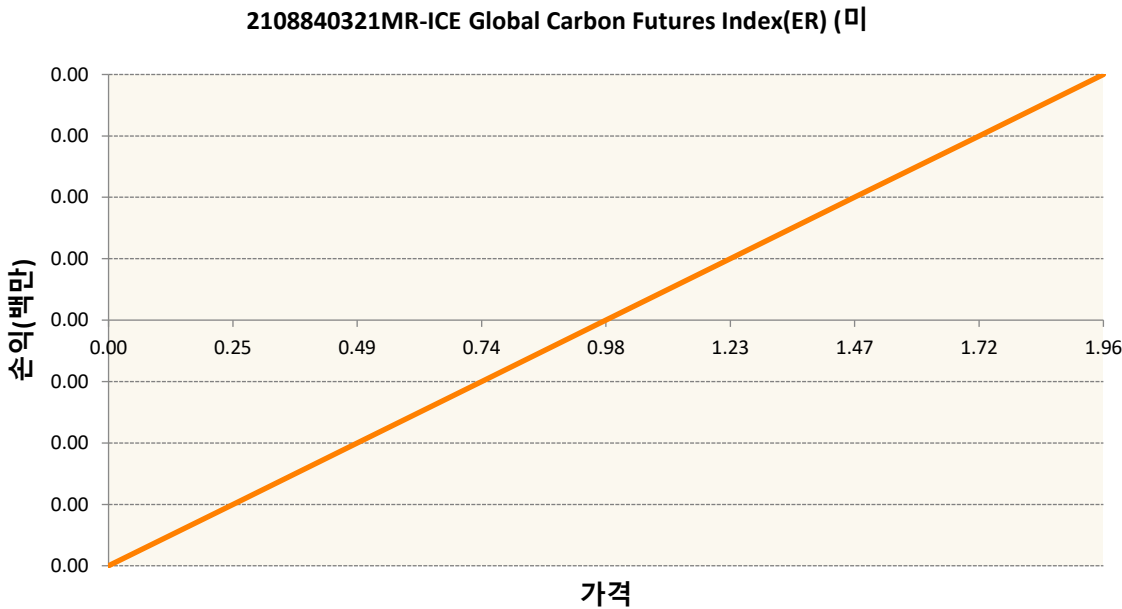
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

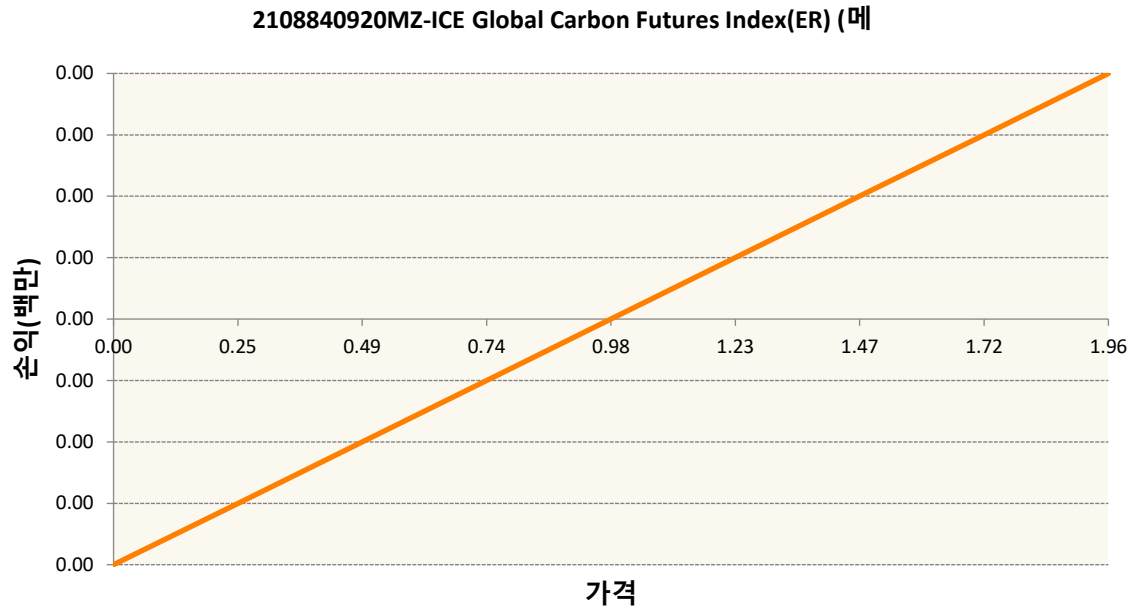
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	18,071	0	18,071	

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108840321IICE Global Carbon Futures Index(ER) (미		426
2108840920IICE Global Carbon Futures Index(ER) (키		853
2108840920IICE Global Carbon Futures Index(ER) (메		171

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,659

공시일	2024-04-08
기준일	2024-04-05

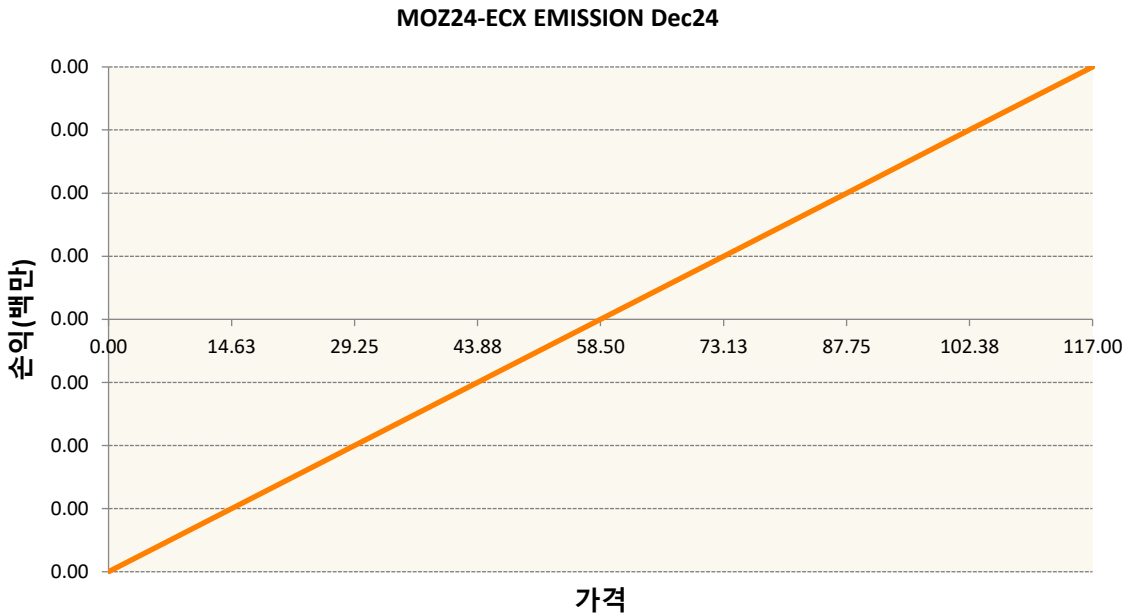
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	8,707	0	8,707	
누계	지수	스왑	331	0	331	장외
누계	통화	선도	0	2,600	-2,600	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213E3SC KRW/EUR 30-04-24E	62
FXW213E3SC KRW/EUR 30-04-24E	146
MOZ24 ECX EMISSION Dec24	697
SWICEUACN ICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX	1

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

(단위:백만원)

1,329

공시일	2024-04-08
기준일	2024-04-05

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	4,948	0	4,948	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI00000 신한CSI Index 230622 (미래)	4
SWCSI00000 신한CSI Index 230622 (메리츠)	4
SWCSI00000 신한CSI Index 230922 (키움)	2
SWCSI00000 신한CSI Index 231013 (NH)	2

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

(단위:백만원)

18

공시일	2024-04-08
기준일	2024-04-05

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	6,101	0	6,101	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(미래)	10
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(NH)	8
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(메리츠)	12
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(키움)	2

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

(단위:백만원)

35

공시일	2024-04-08
기준일	2024-04-05

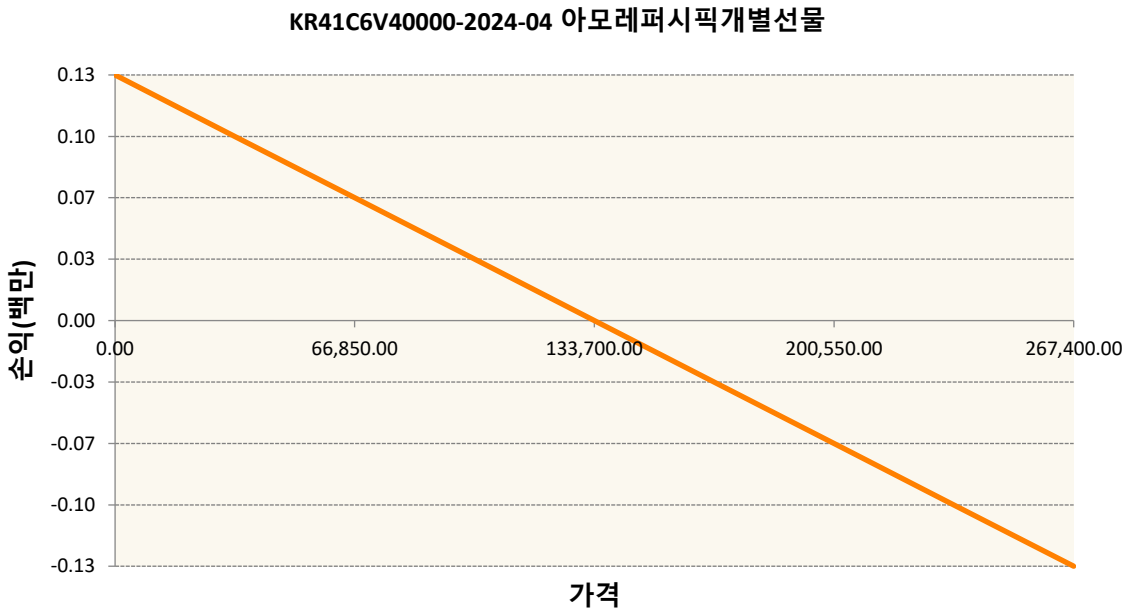
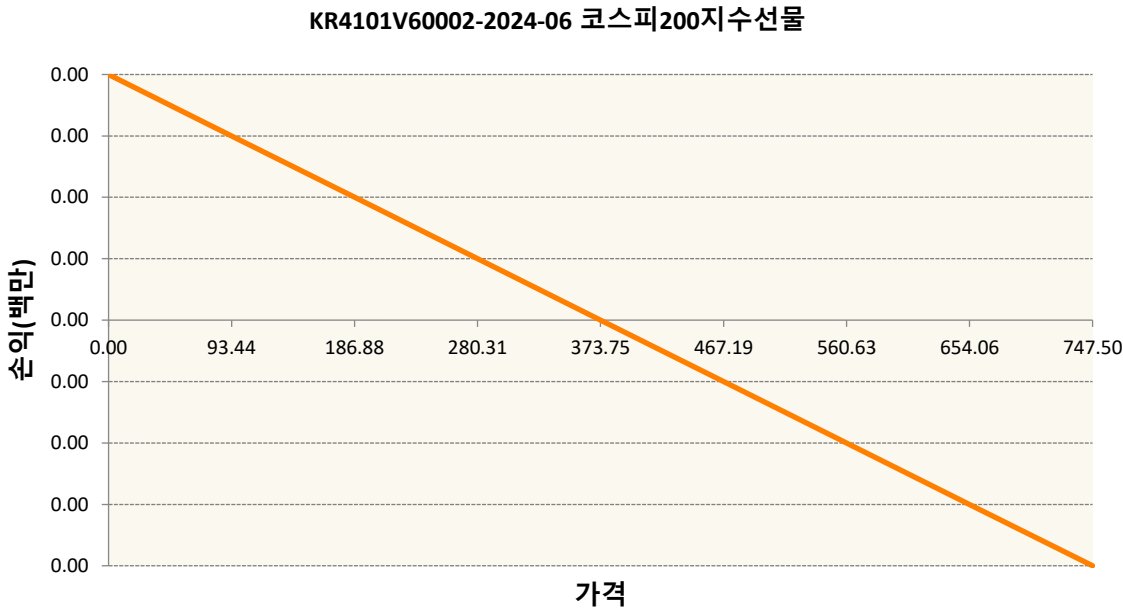
에쿼티알파일반사모혼합자산

1. 계약금액

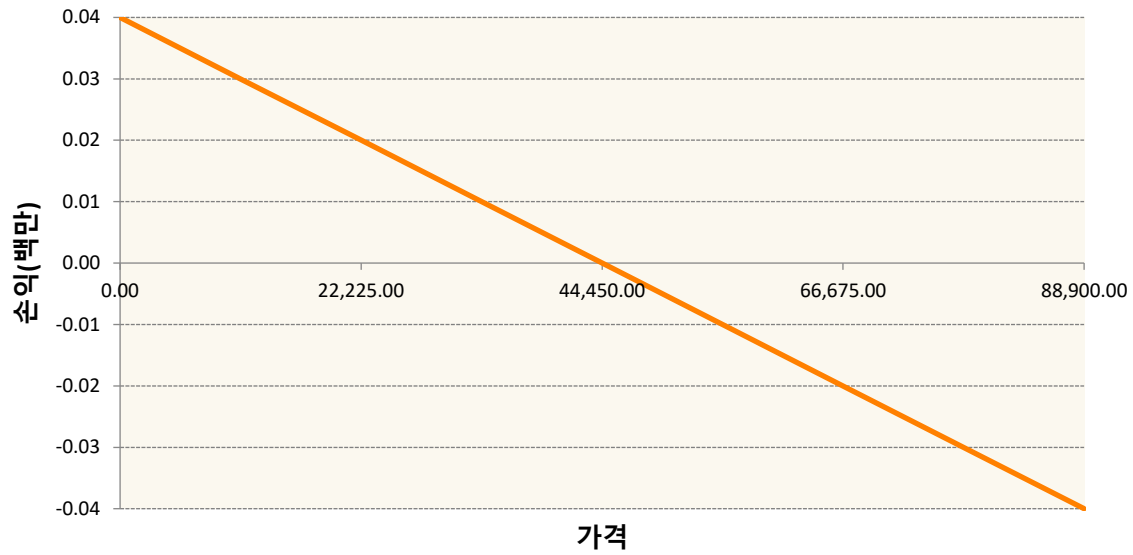
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	45	-45	장내
누계	유가증권	선물	21	770	-749	장내

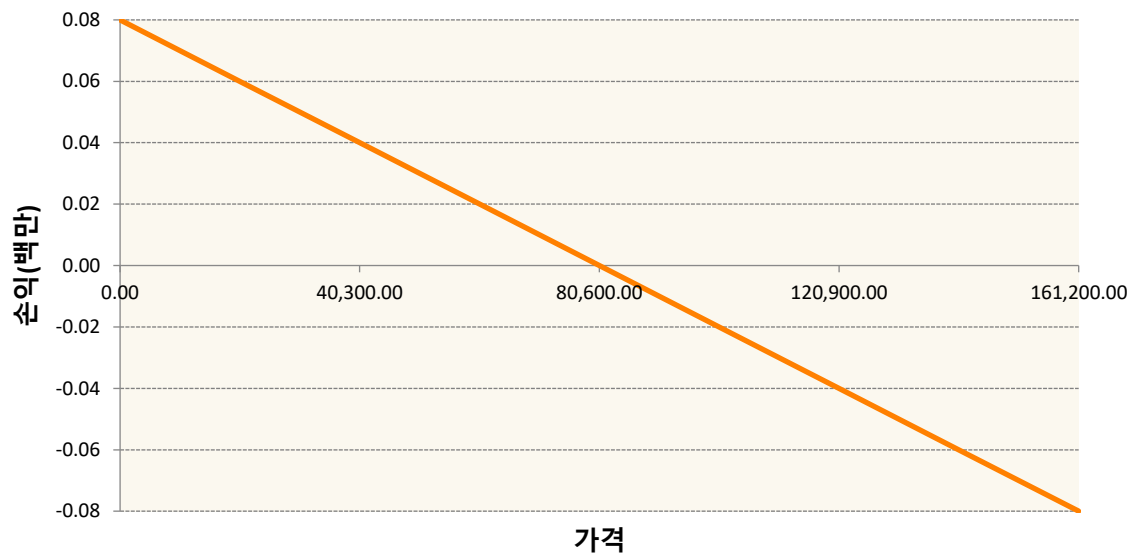
2. 만기시점의 손익구조



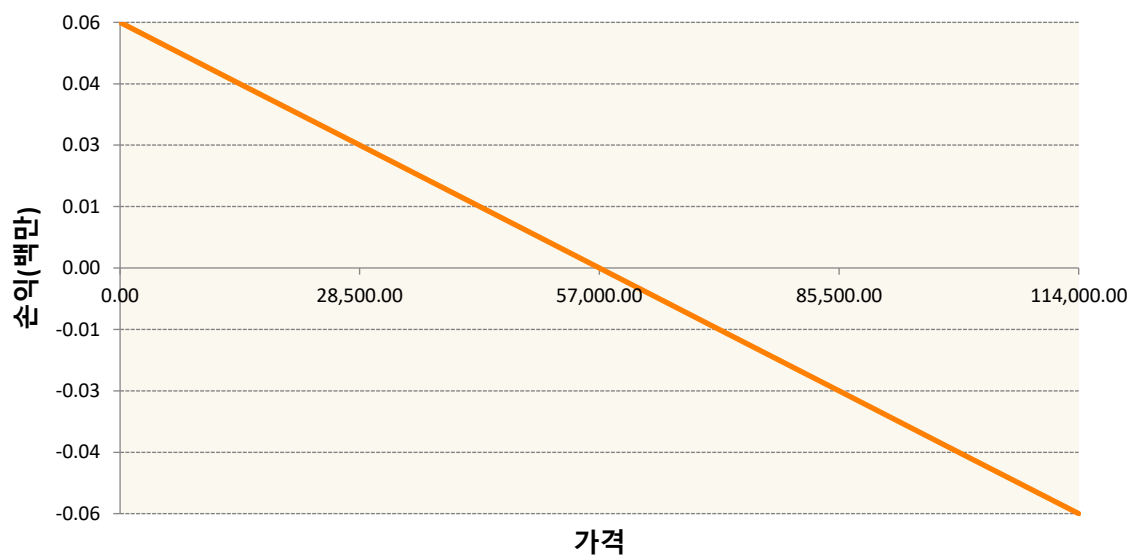
KR41CNV40003-2024-04 포스코DX개별선물



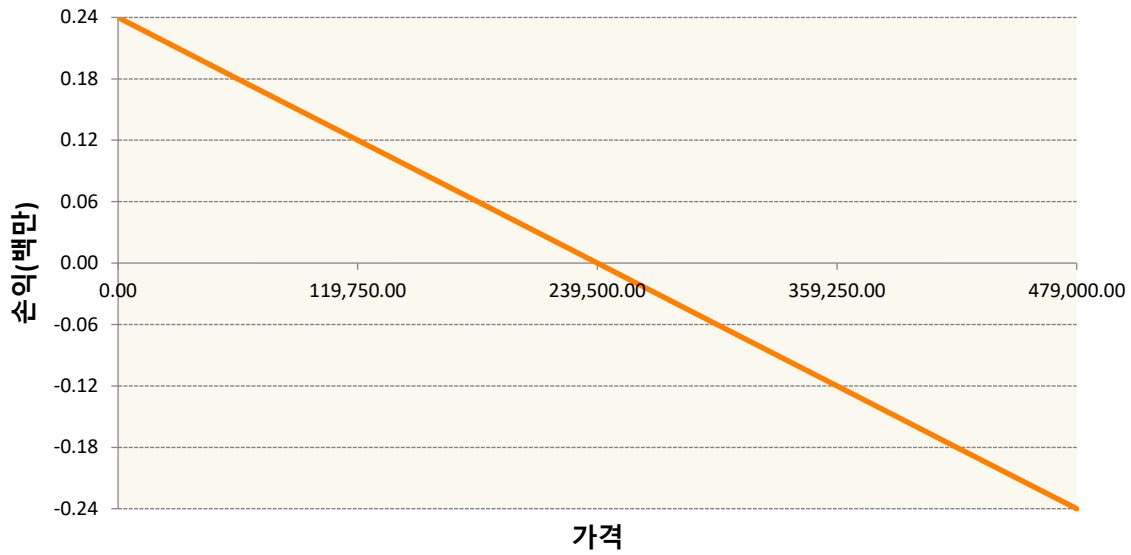
KR41E4V40003-2024-04 에스엠개별선물



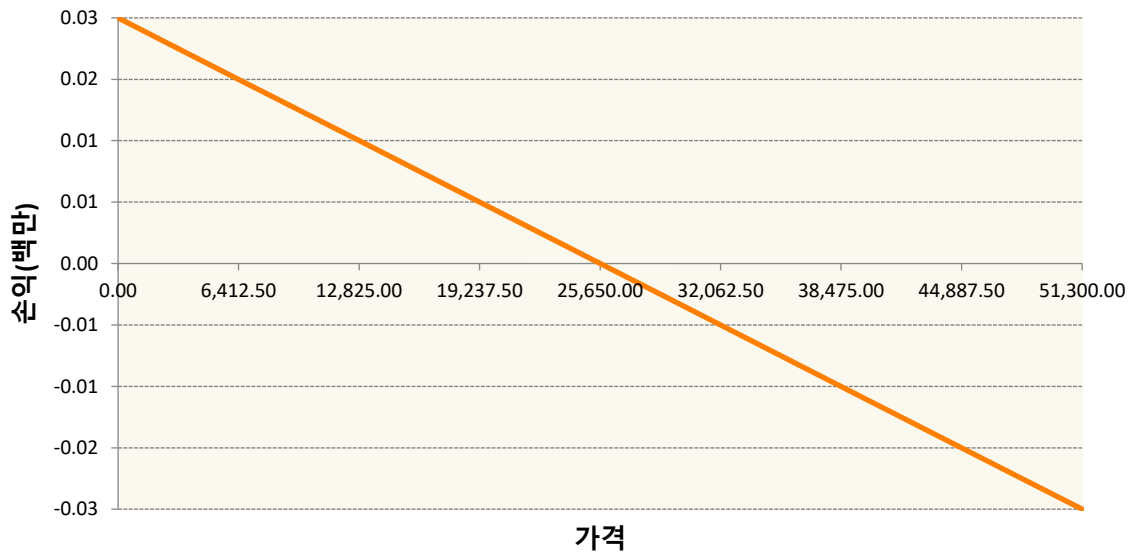
KR41E5V40000-2024-04 넷마블개별선물



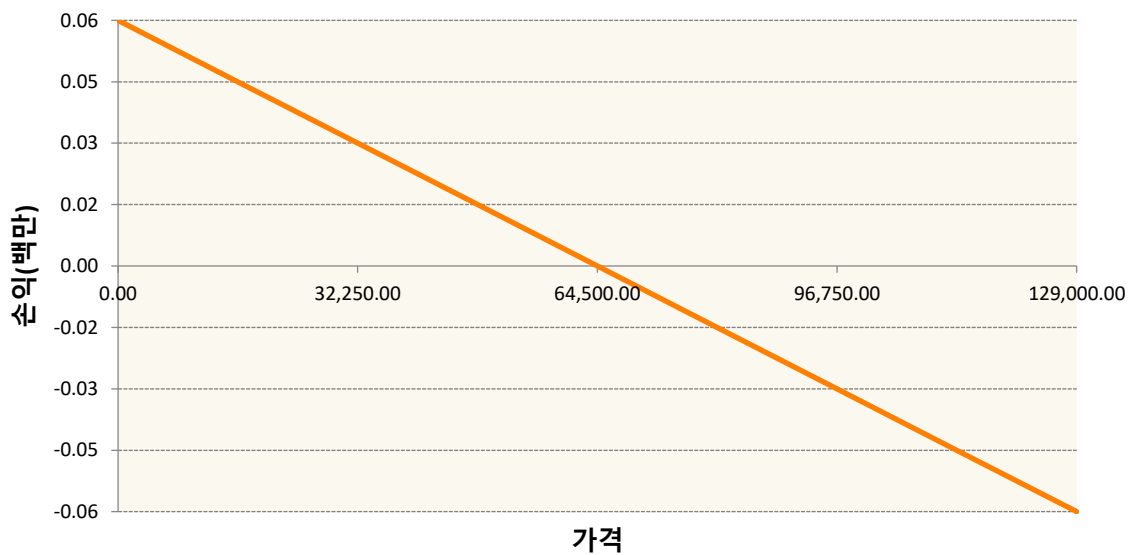
KR41EYV40006-2024-04 에코프로비엠개별선물



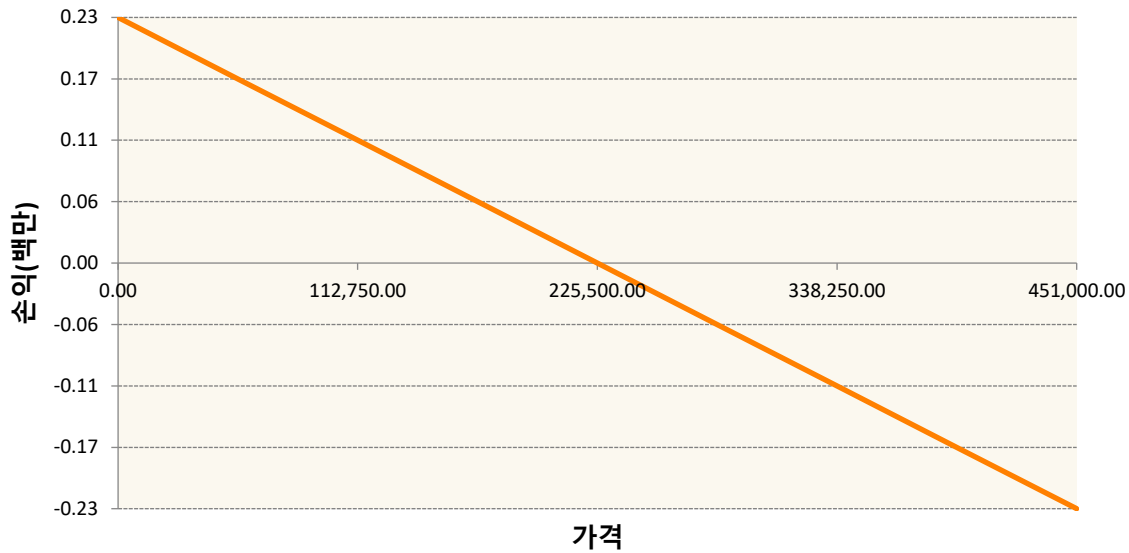
KR41F6V40007-2024-04 카카오뱅크개별선물



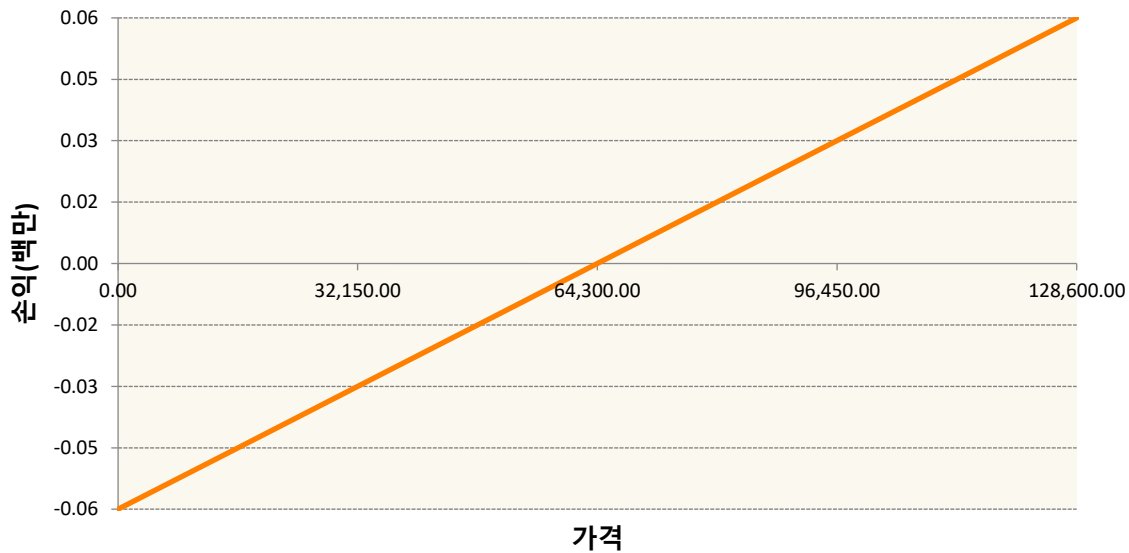
KR41FBV40001-2024-04 SK아이이테크놀로지개별선물



KR41FCV40009-2024-04 하이브개별선물



KR41G9V40000-2024-04 레고캠바이오개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101V600 2024-06 코스피200지수선물	45
KR41C6V400 2024-04 아모레퍼시픽개별선물	3
KR41CNV400 2024-04 포스코DX개별선물	3
KR41E4V400 2024-04 에스엠개별선물	0.06
KR41E5V400 2024-04 넷마블개별선물	1
KR41EYV400 2024-04 에코프로비엠개별선물	2
KR41F6V400 2024-04 카카오뱅크개별선물	2
KR41FBV400 2024-04 SK아이이테크놀로지개별선물	2
KR41FCV400 2024-04 하이브개별선물	3
KR41G9V400 2024-04 레고캠바이오개별선물	2

공시일	2024-04-08
기준일	2024-04-05

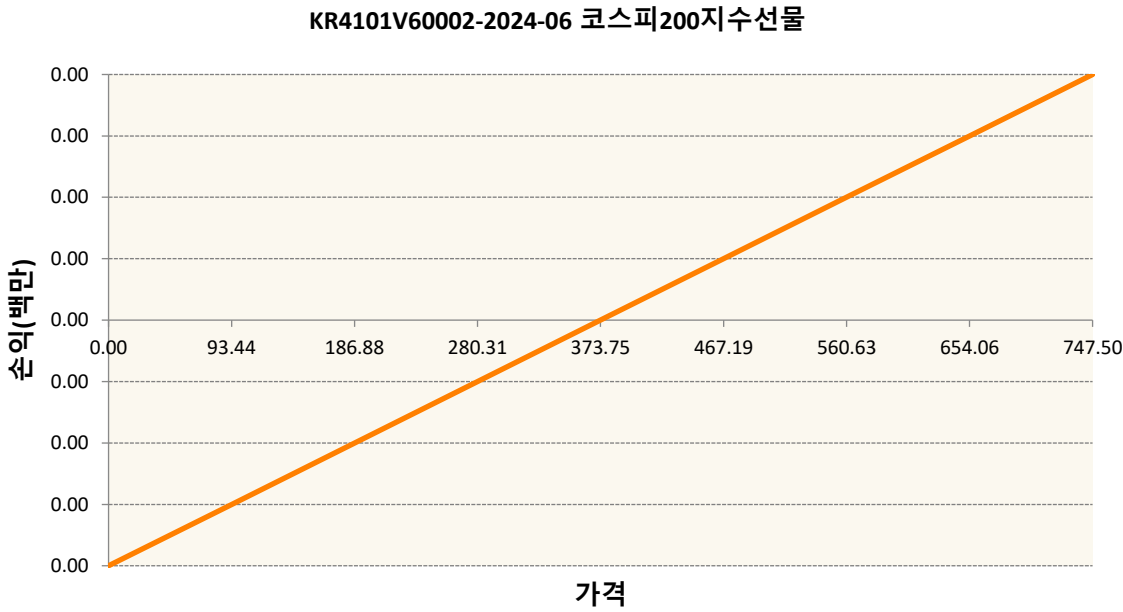
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	93	-93	장내
누계	유가증권	선물	2,990	0	2,990	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101V60002		2024-06 코스피200지수선물					238
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-238	-238	-238	-238	-238	-238	-238
-5.33%	-159	-159	-159	-159	-159	-159	-159
-2.67%	-79	-79	-79	-79	-79	-79	-79
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	79	79	79	79	79	79	79
5.33%	159	159	159	159	159	159	159
8.00%	238	238	238	238	238	238	238

공시일	2024-04-08
기준일	2024-04-05

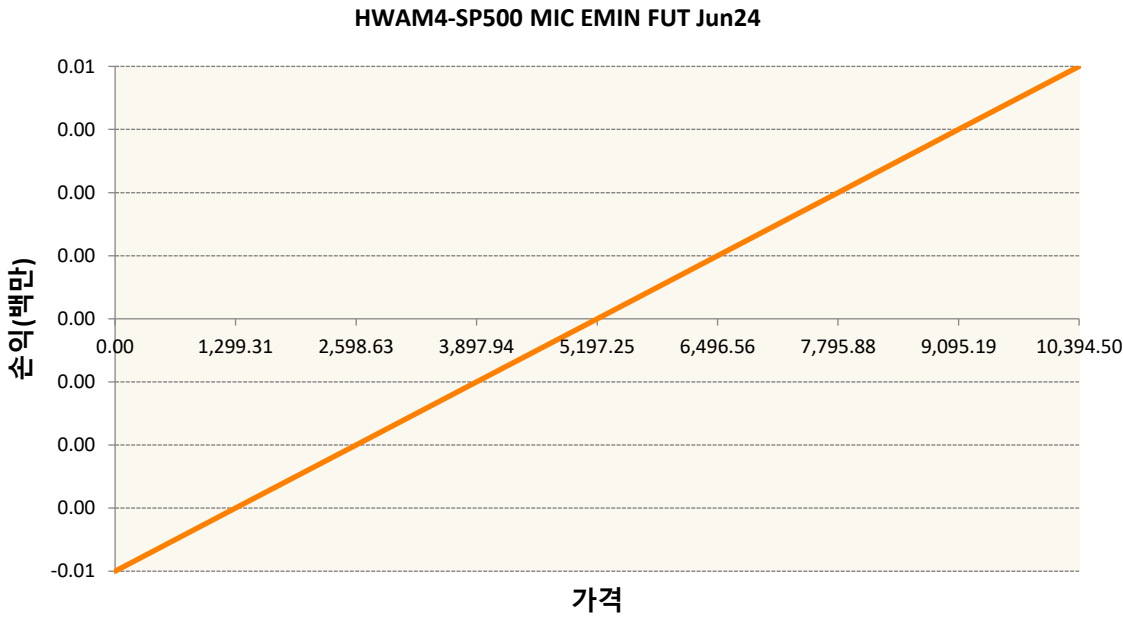
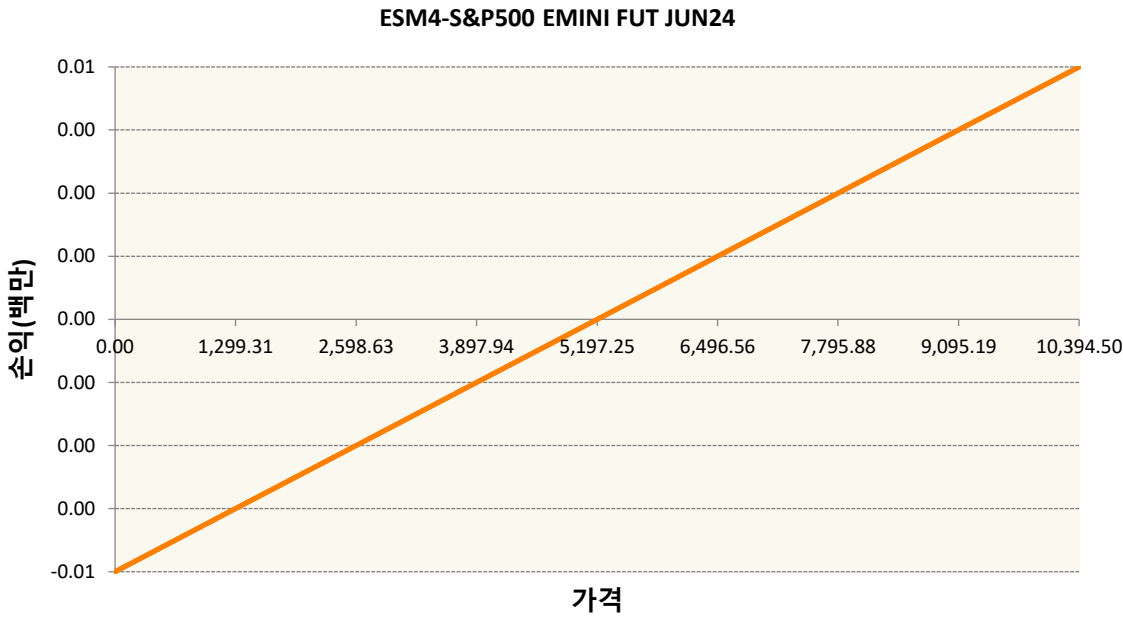
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

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	4,114	0	4,114	
누계	유가증권	선물	1,677	0	1,677	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESM4	S&P500 EMINI FUT JUN24	329
HWAM4	SP500 MIC EMIN FUT Jun24	134

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	328

공시일	2024-04-08
기준일	2024-04-05

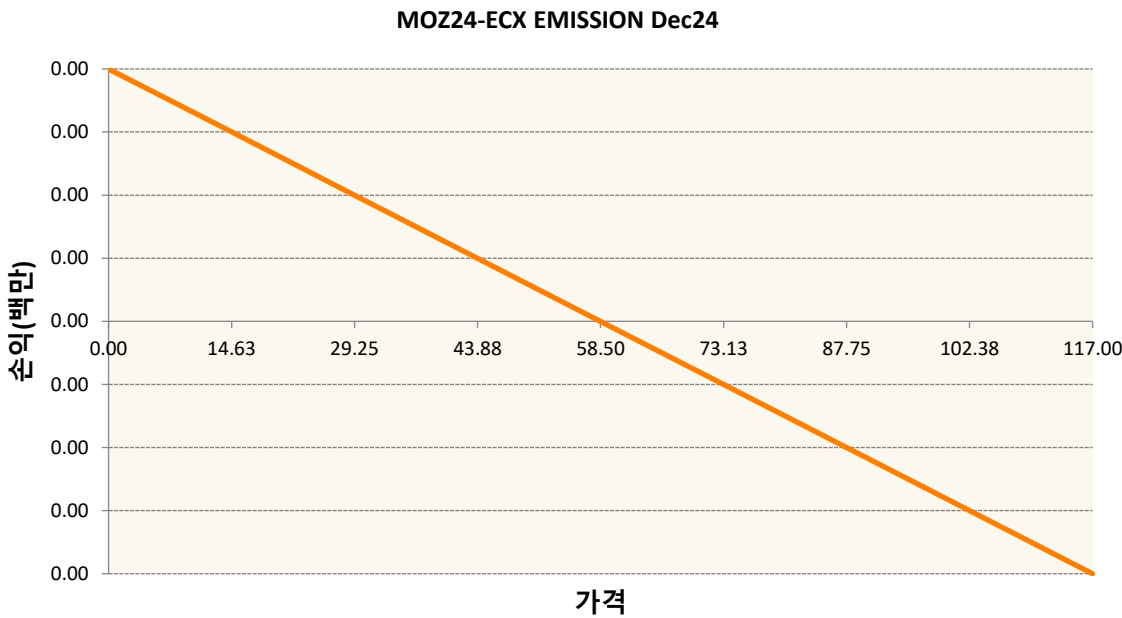
SOL유럽탄소배출권선물인버스ICE특별자산상

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	6,649	-6,649	
누계	지수	스왑	331	0	331	장외
누계	통화	선도	0	1,110	-1,110	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213E3SC KRW/EUR 30-04-24E	89
MOZ24 ECX EMISSION Dec24	532
SWICEUACN ICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX	1

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

(단위:백만원)

973

공시일	2024-04-08
기준일	2024-04-05

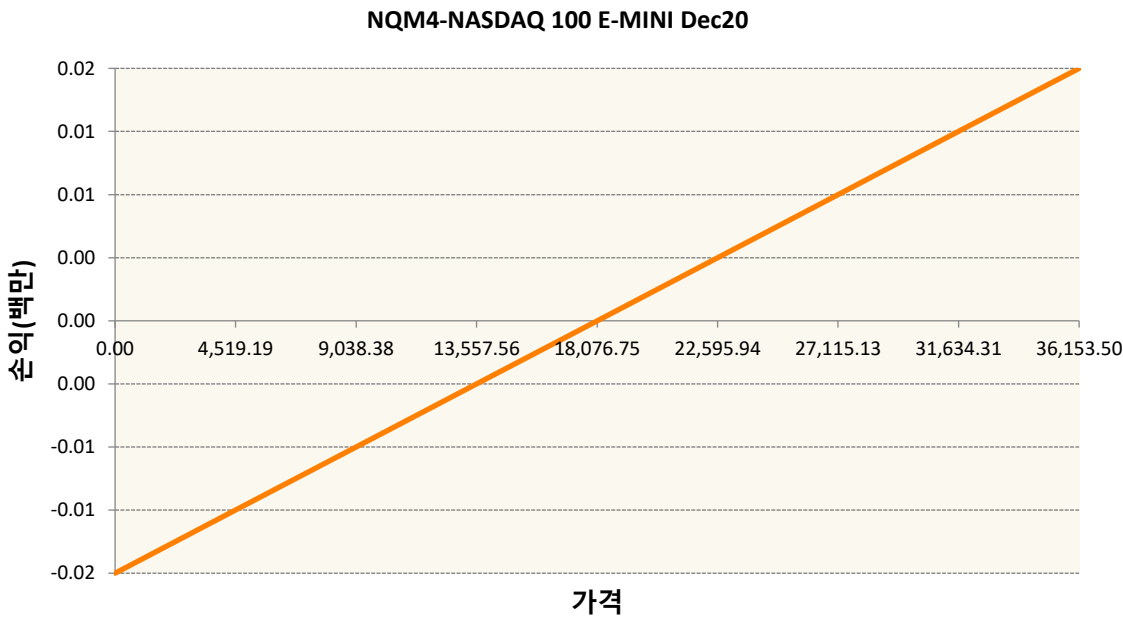
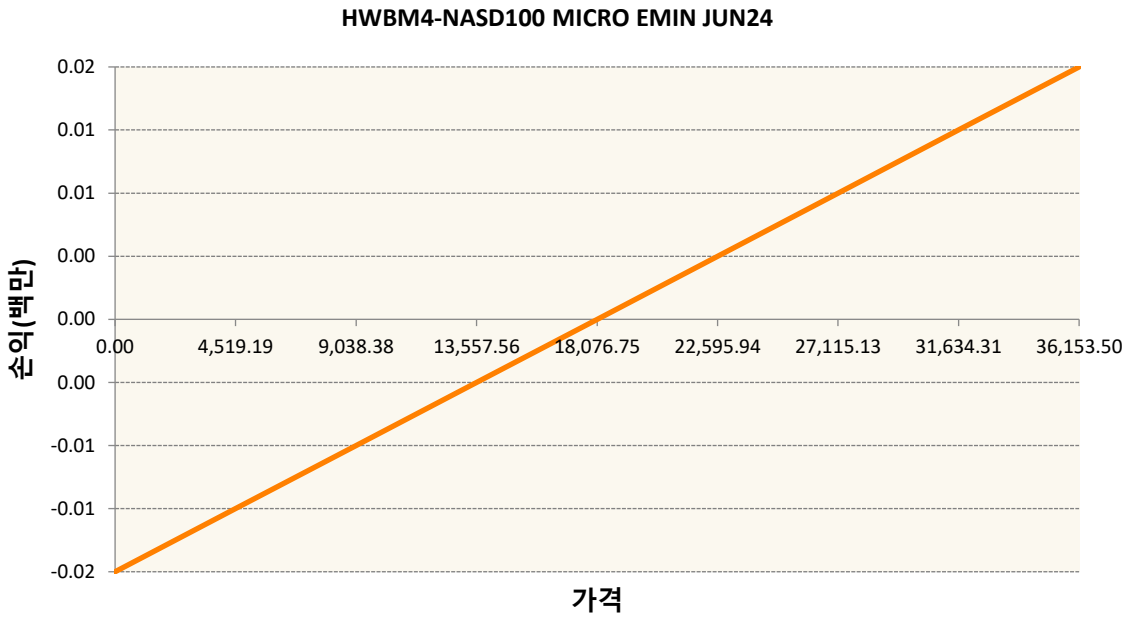
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

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	2,388	0	2,388	
누계	유가증권	선물	2,335	0	2,335	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
HWBM4	NASD100 MICRO EMIN JUN24		187
NQM4	NASDAQ 100 E-MINI Dec20		191

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)			(단위:백만원)
			317

공시일	2024-04-08
기준일	2024-04-05

SOL미국30년국채커버드콜(합성)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	84,018	0	84,018	장외
누계	지수	스왑	118,722	0	118,722	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	1,625
SWKEDI0000 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	718
SWKEDI0000 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	6,791

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

(단위:백만원)

5,950

공시일	2024-04-08
기준일	2024-04-05

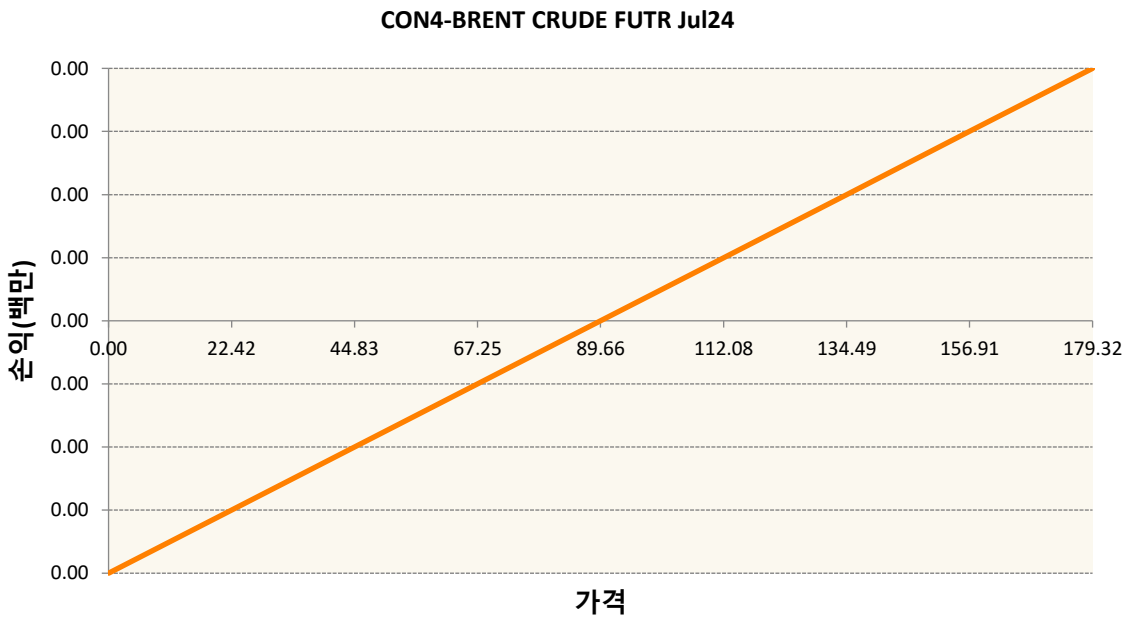
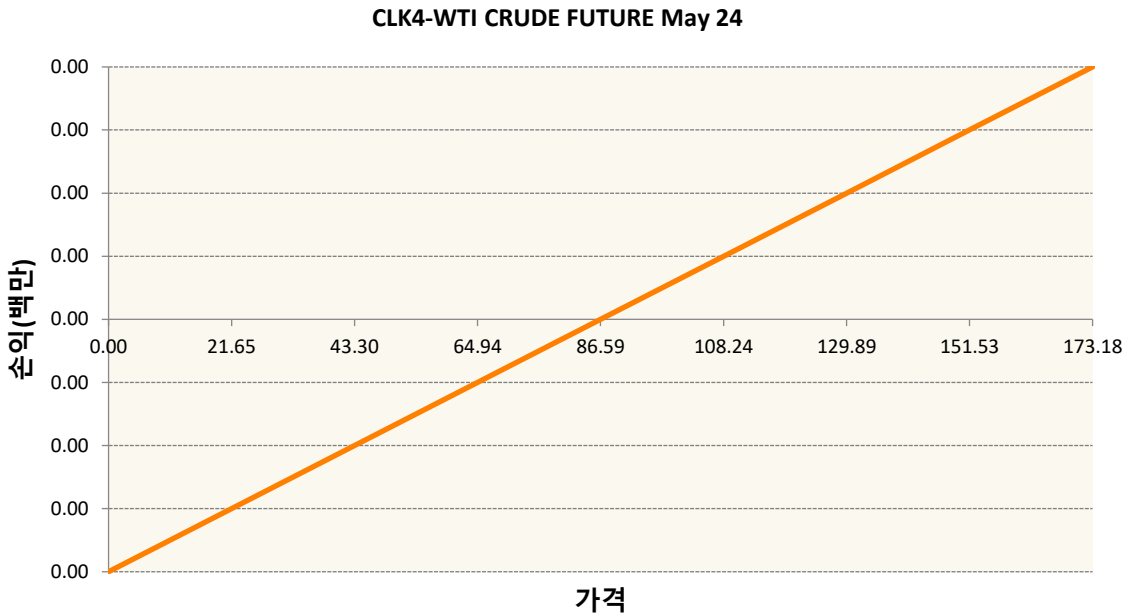
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

1. 계약금액

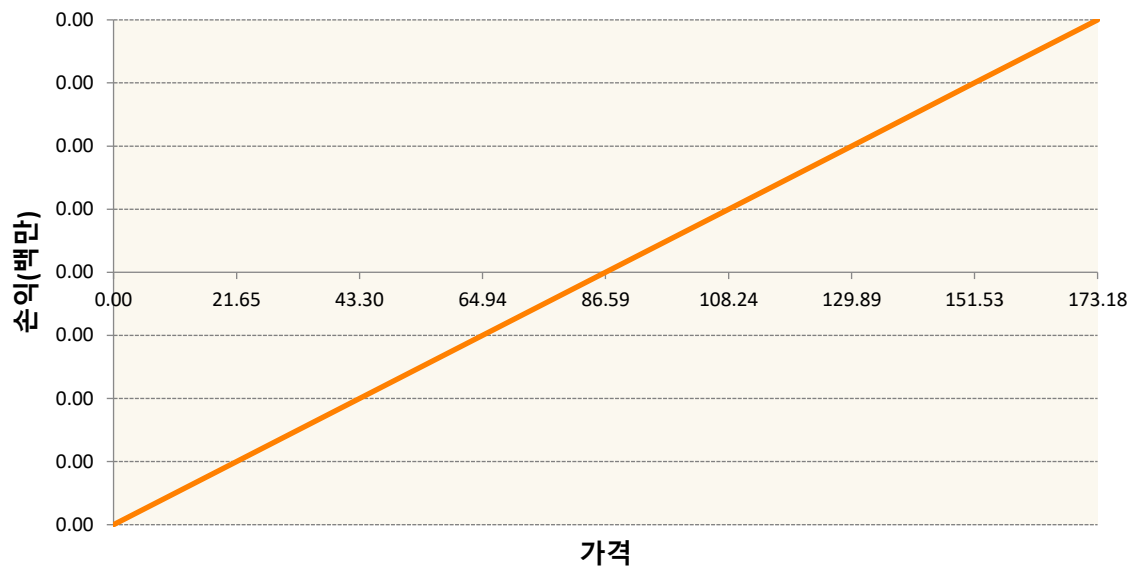
(단위:백만원)

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	1,208	0	1,208	
누계	통화	선물	0	243	-243	장내

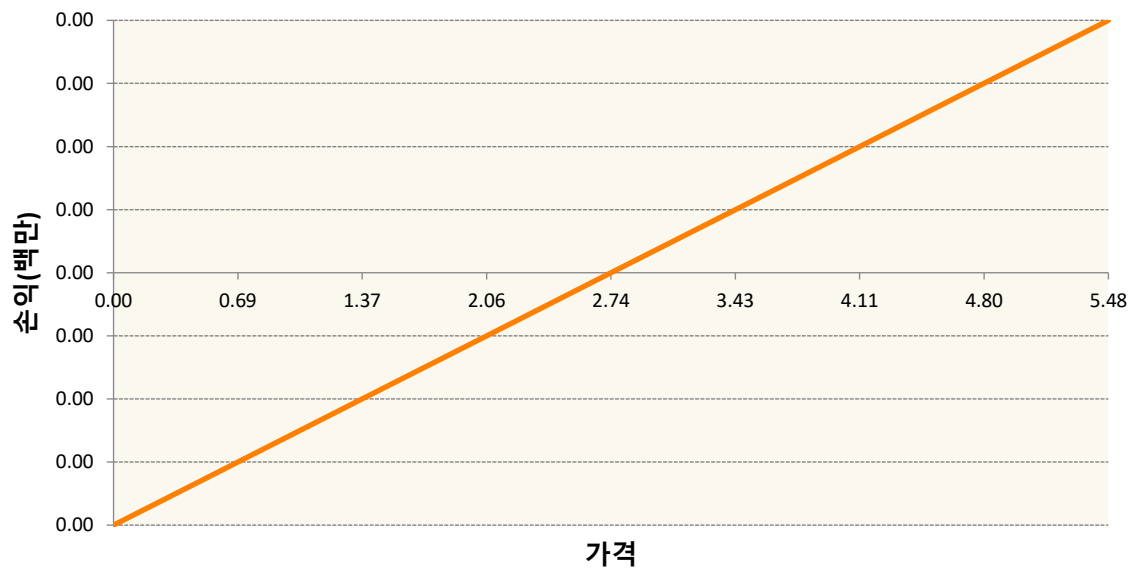
2. 만기시점의 손익구조



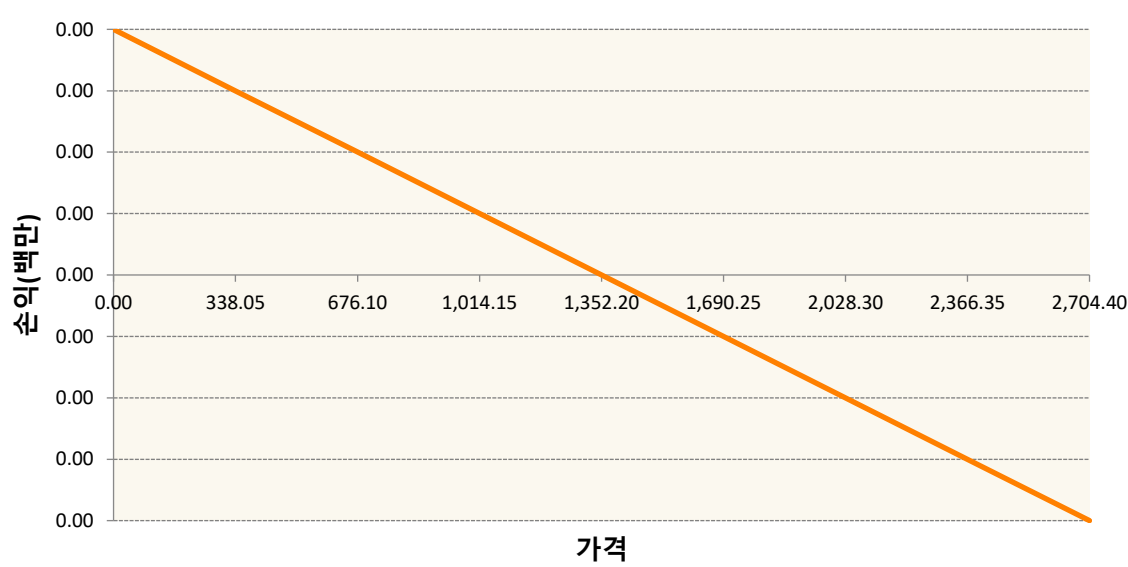
ECK4-E-mini Crude Oil May 24



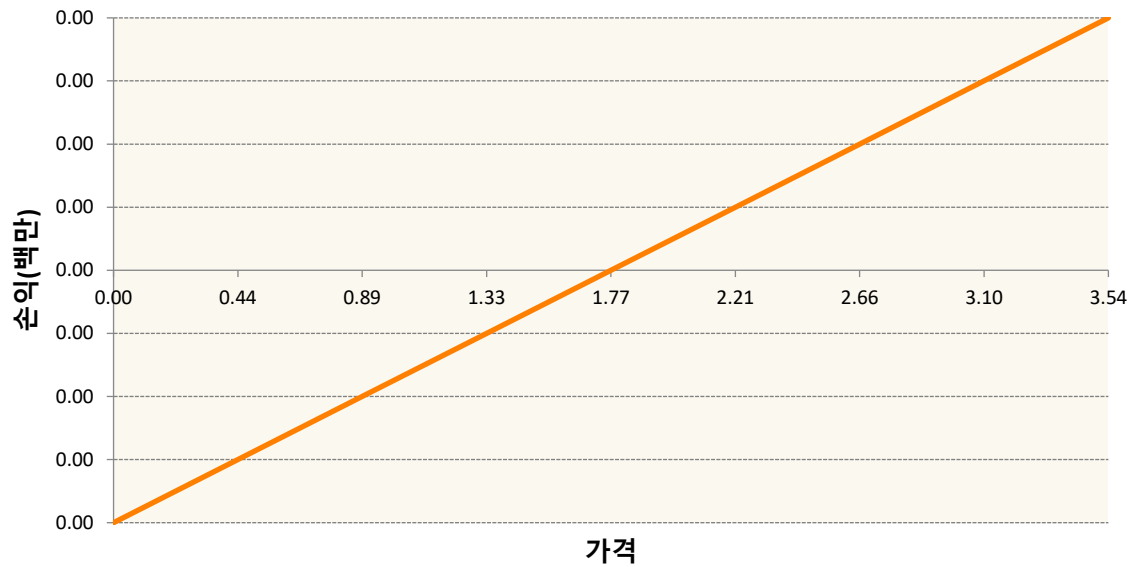
HOK4-NY Harb ULSD Fut May 24



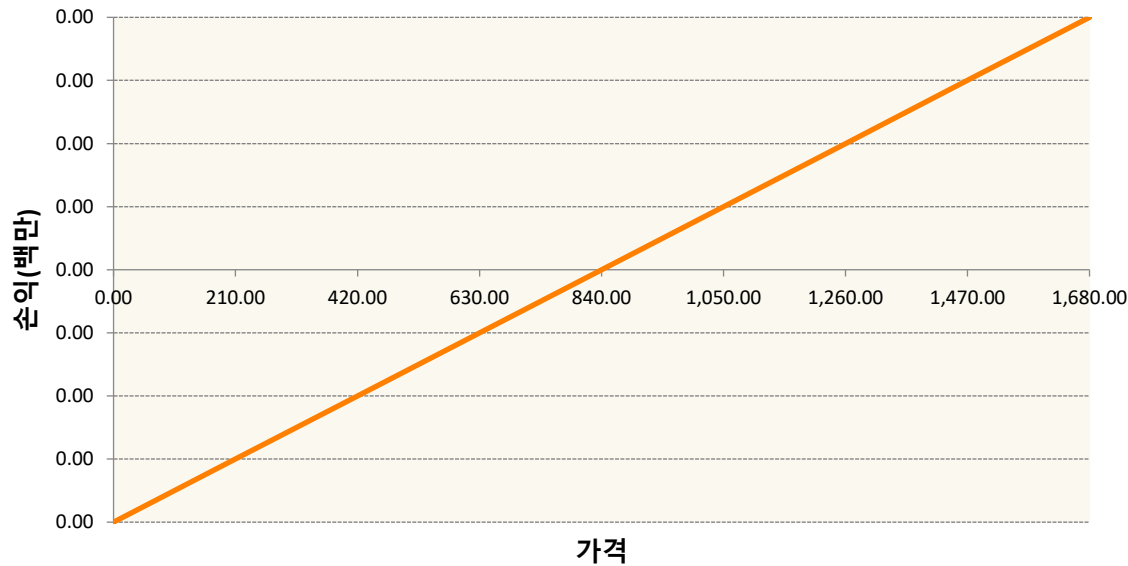
KR4175V40008-2024-04 달러선물



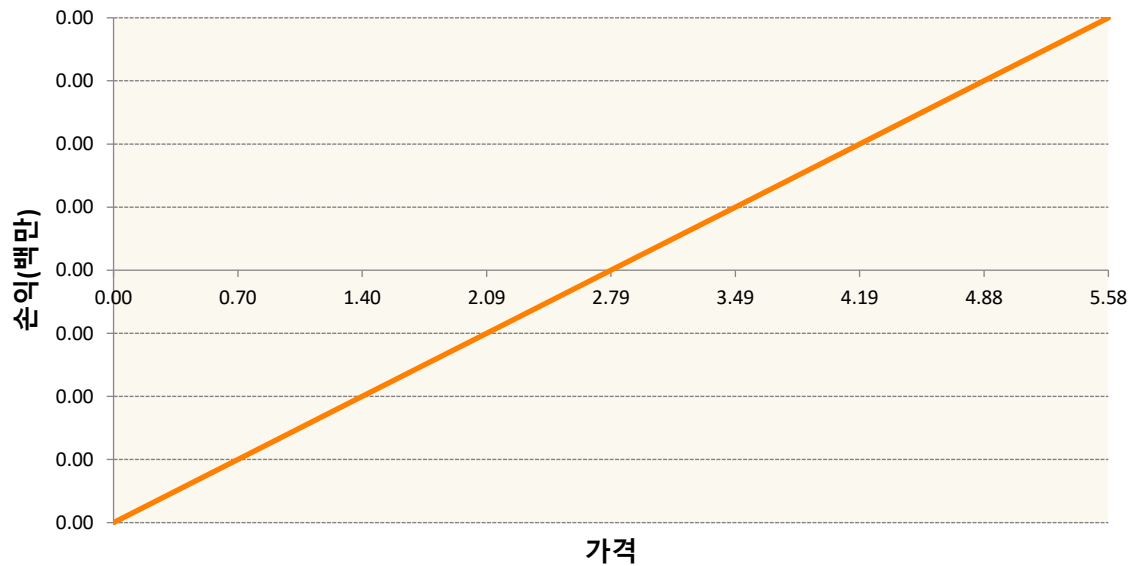
NGK24-NATURAL GAS FUTR May 24



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	19
CON4	BRENT CRUDE FUTR Jul24	28
ECK4	E-mini Crude Oil May 24	5
HOK4	NY Harb ULSD Fut May 24	12
KR4175V400 2024-04 달러선물		19
NGK24	NATURAL GAS FUTR May 24	11
QSK4	Low Su Gasoil G May 24	9
XBK4	GASOLINE RBOB FUT May 24	13

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

211