

공시일	2024-04-09
기준일	2024-04-08

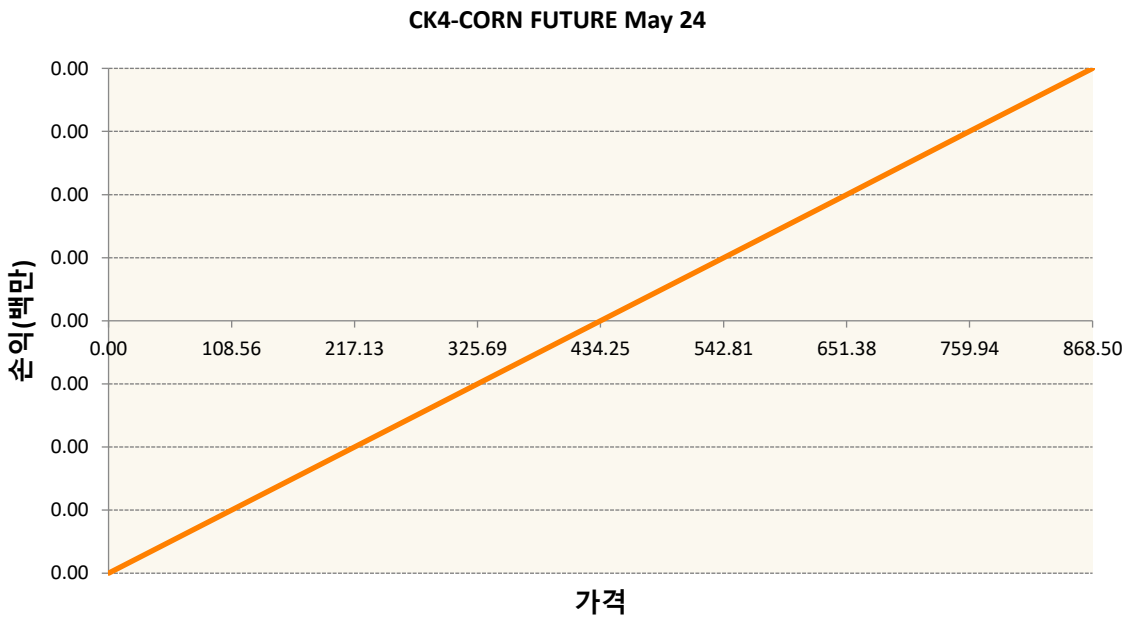
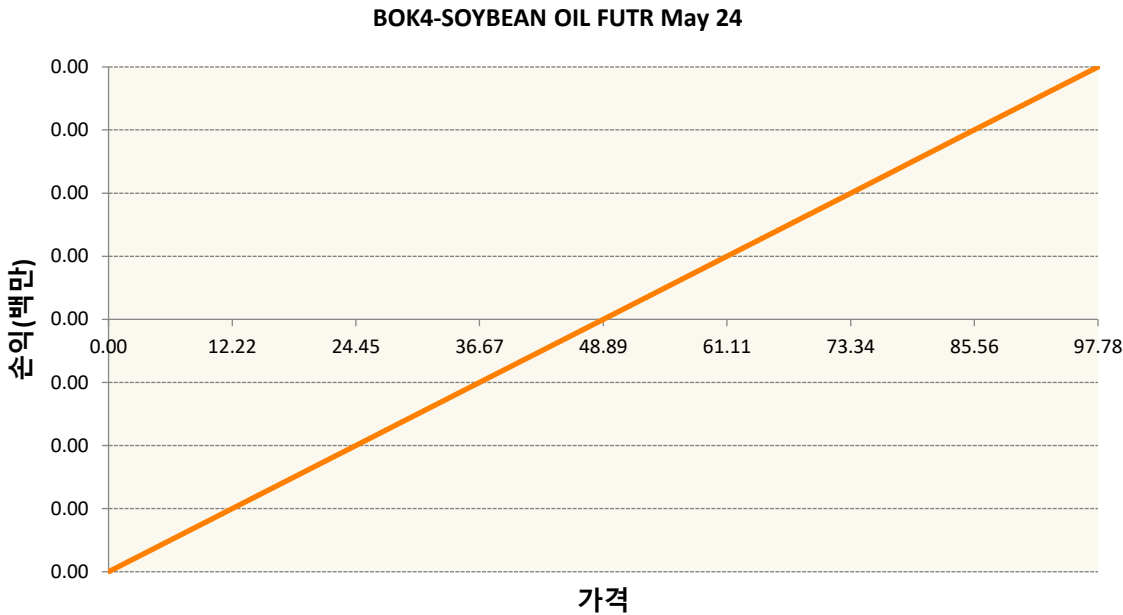
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

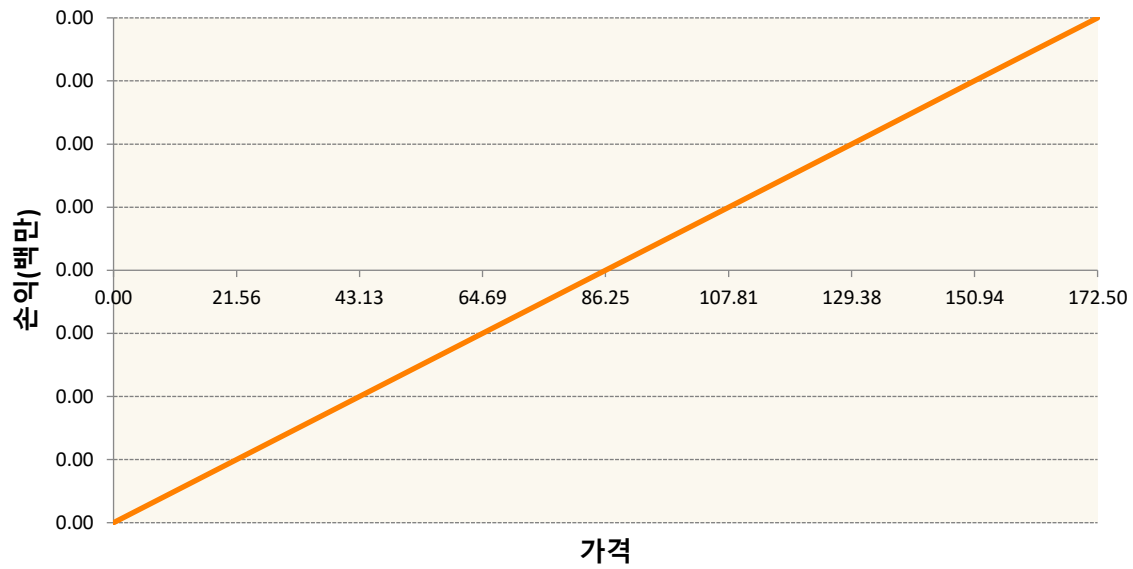
(단위:USD 백만)

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	4,302	0	4,302	
누계	통화	선물	0	528	-528	장내

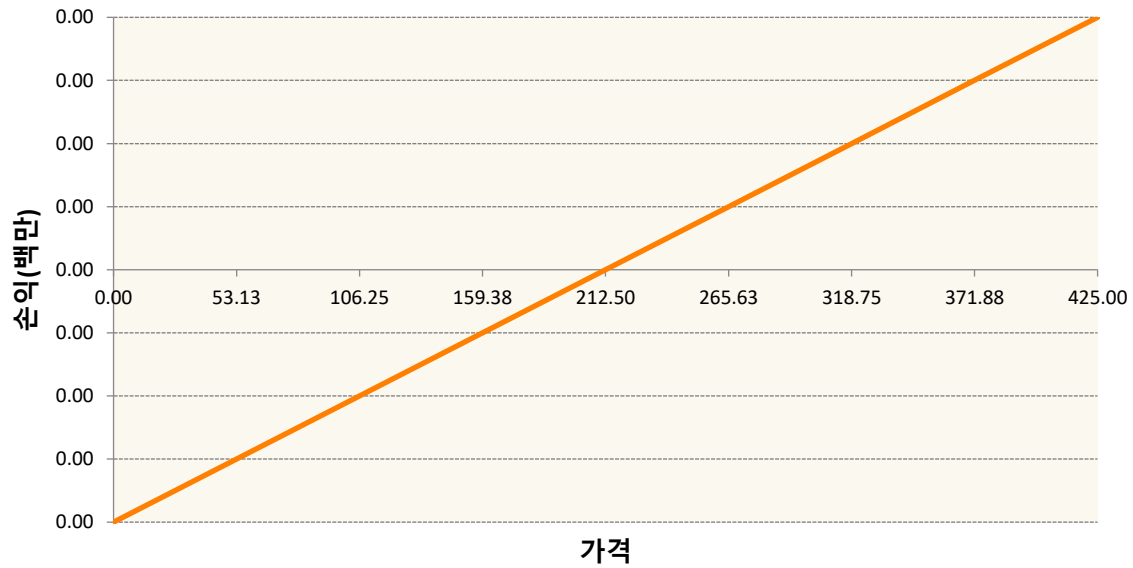
2. 만기시점의 손익구조



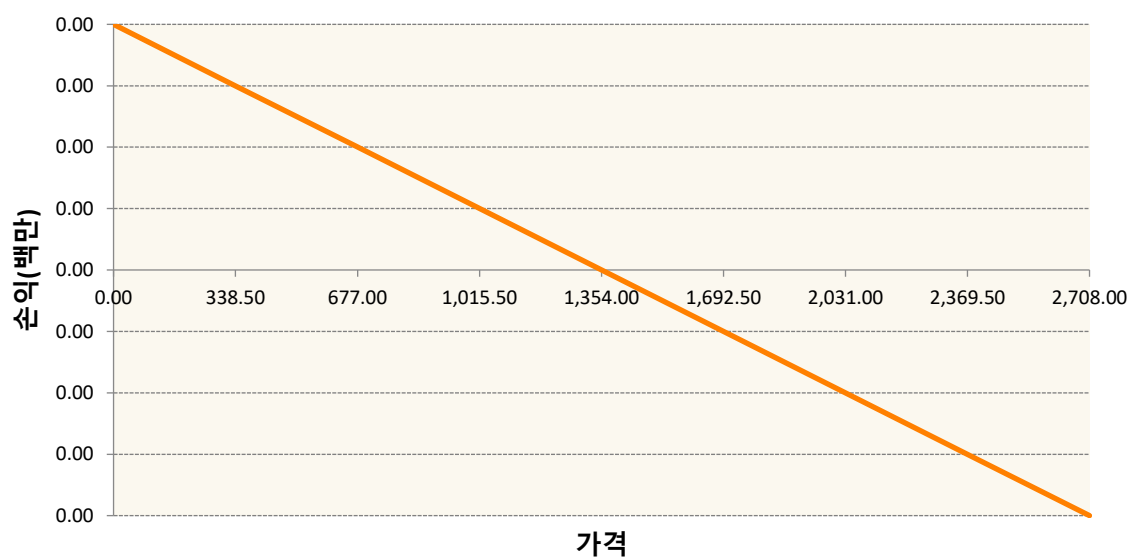
CTK4-COTTON NO.2 FUTR May 24



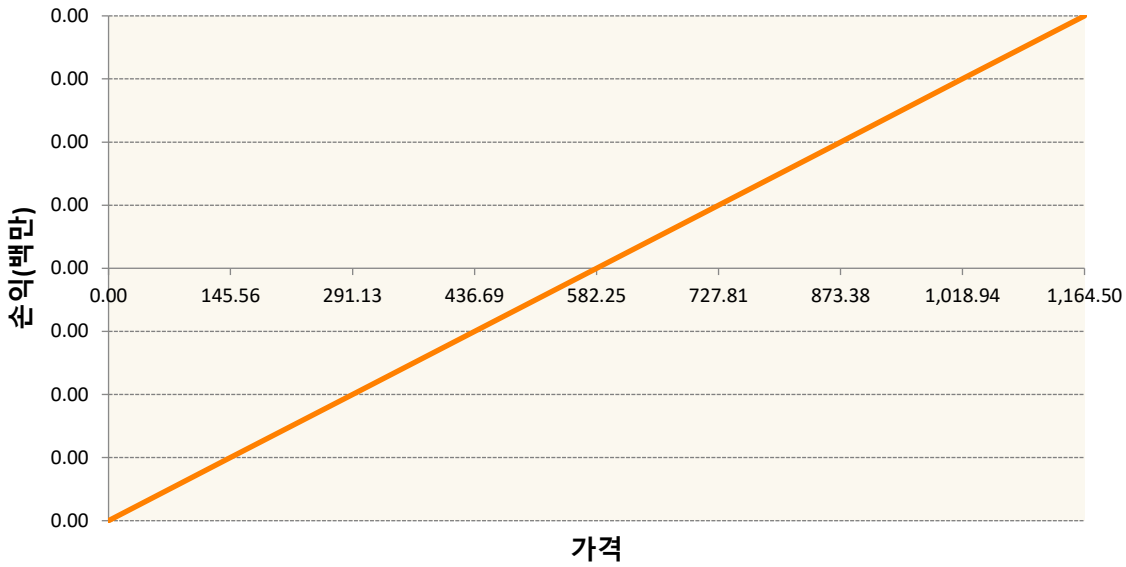
KCK4-COFFEE 'C' FUTURE May 24



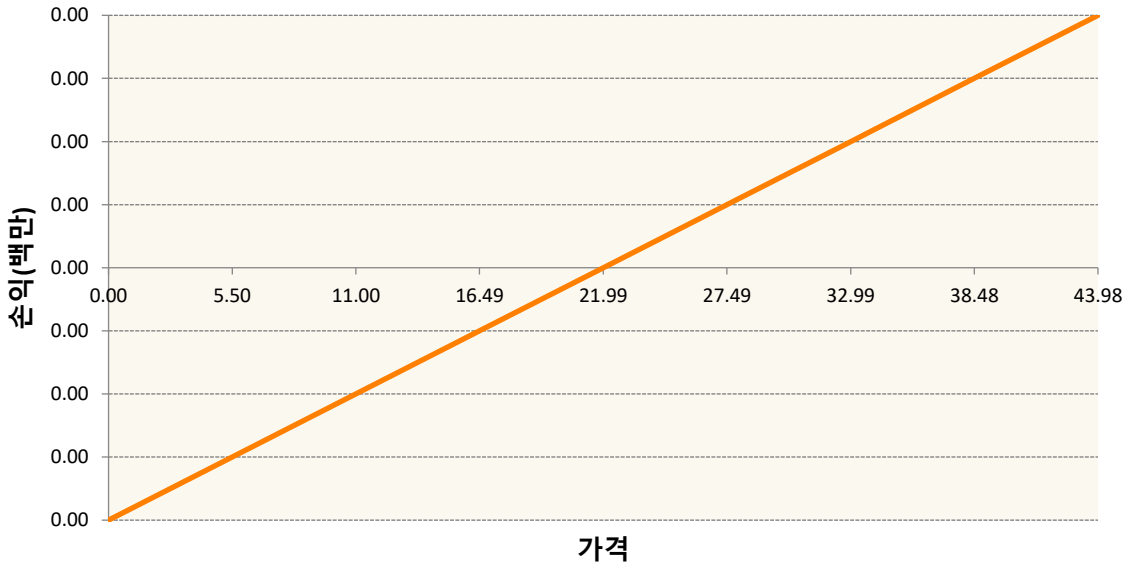
KR4175V40008-2024-04 달러선물



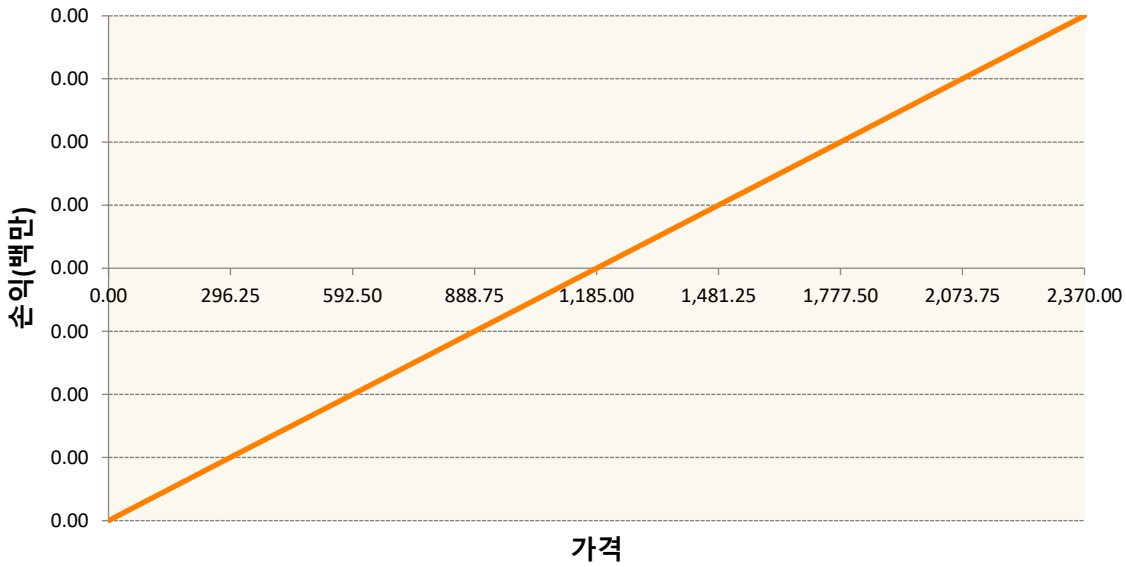
KWK4-KC HRW WHEAT FUT May 24



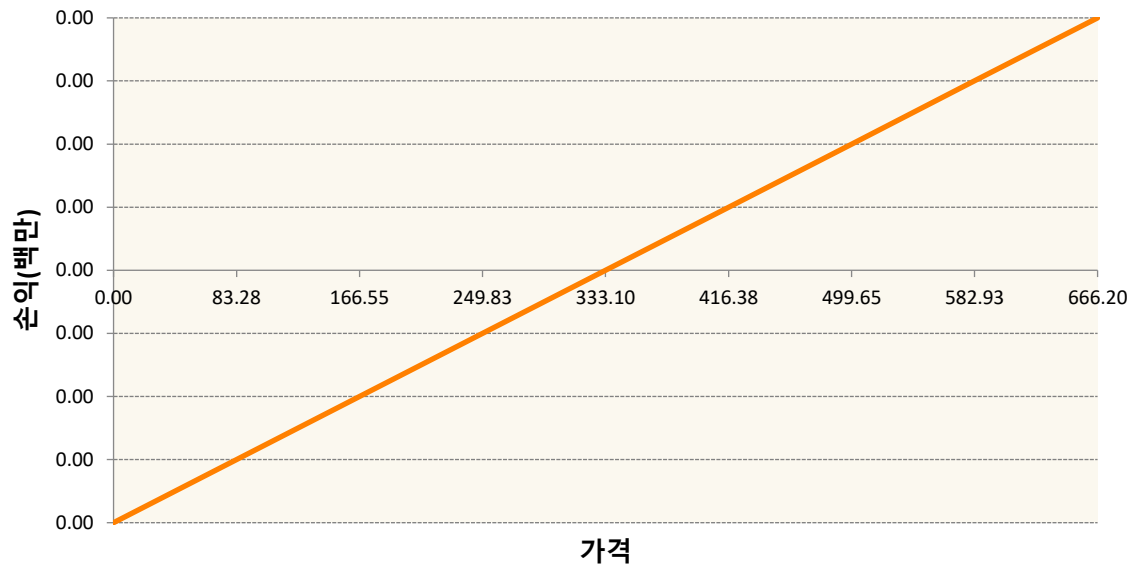
SBK4-Sugar #11 (WORLD) May 24



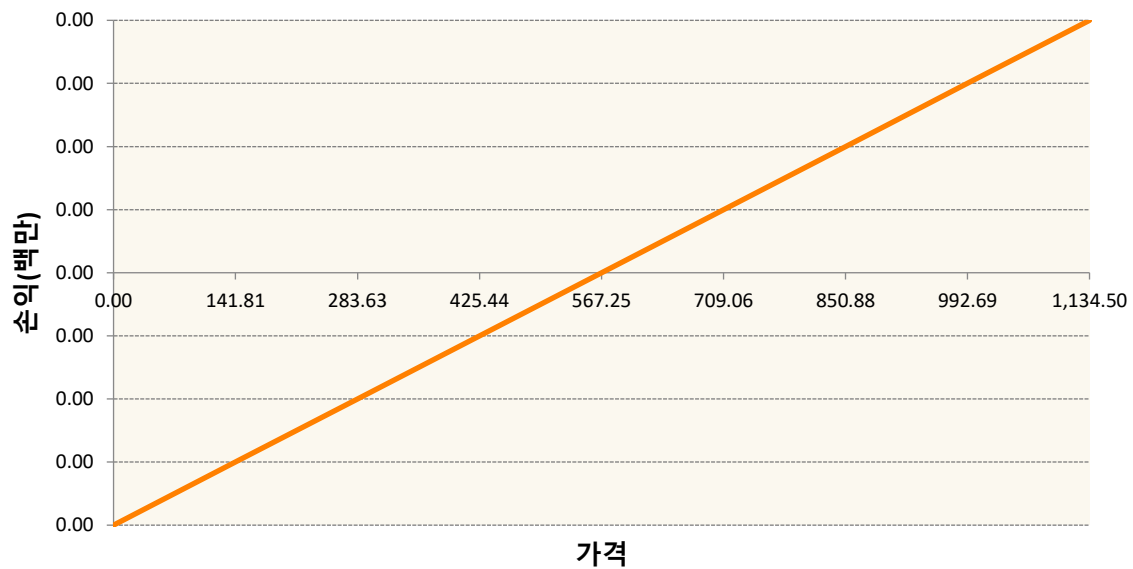
SK4-SOYBEAN FUTURE May 24



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	2024-04-09
기준일	2024-04-08

스마트인덱스모

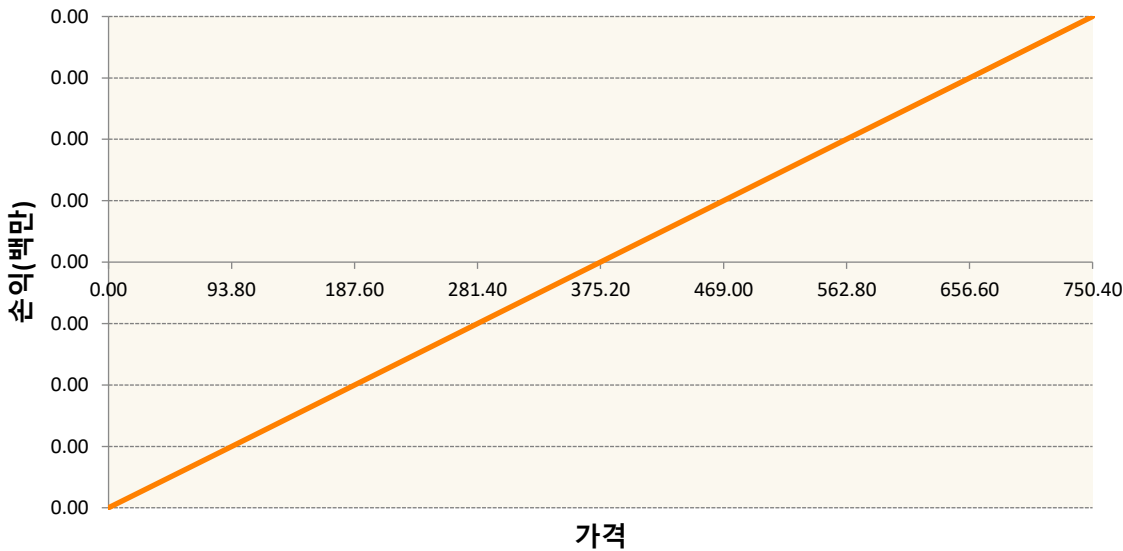
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,626	0	2,626	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101V60002-2024-06 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101V60002			2024-06 코스피200지수선물				209
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-209	-209	-209	-209	-209	-209	-209
-5.33%	-139	-139	-139	-139	-139	-139	-139
-2.67%	-70	-70	-70	-70	-70	-70	-70
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	70	70	70	70	70	70	70
5.33%	139	139	139	139	139	139	139
8.00%	209	209	209	209	209	209	209

공시일	2024-04-09
기준일	2024-04-08

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	2024-04-09
기준일	2024-04-08

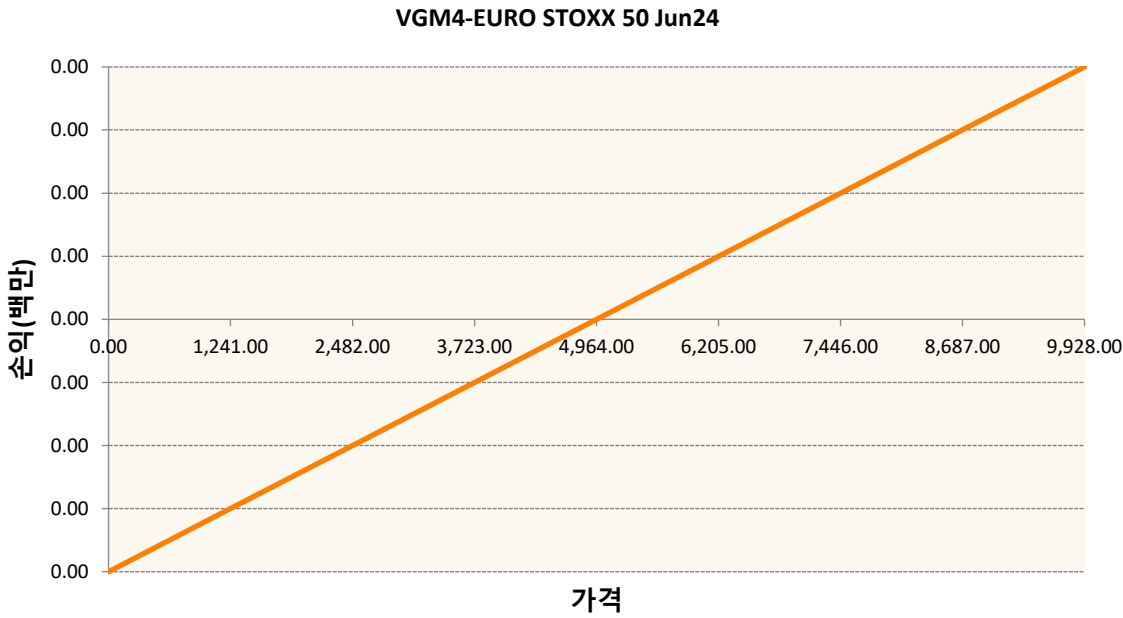
유로인덱스모(주식-파생형)

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	997	0	997	
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	80

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

(단위:백만원)

66

공시일	2024-04-09
기준일	2024-04-08

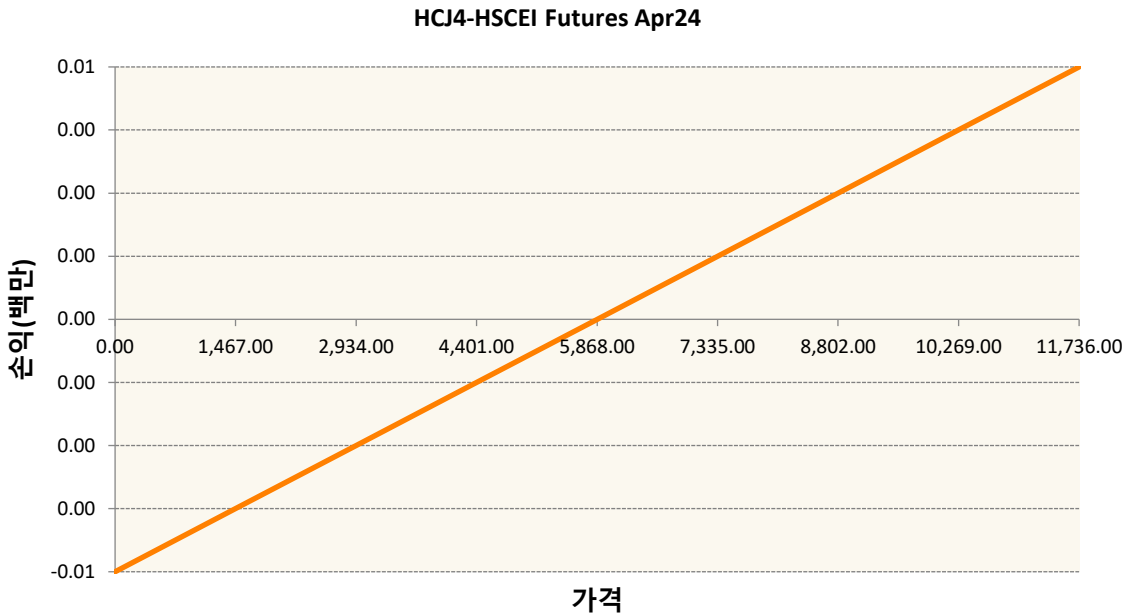
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,206	0	1,206	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

126

공시일	2024-04-09
기준일	2024-04-08

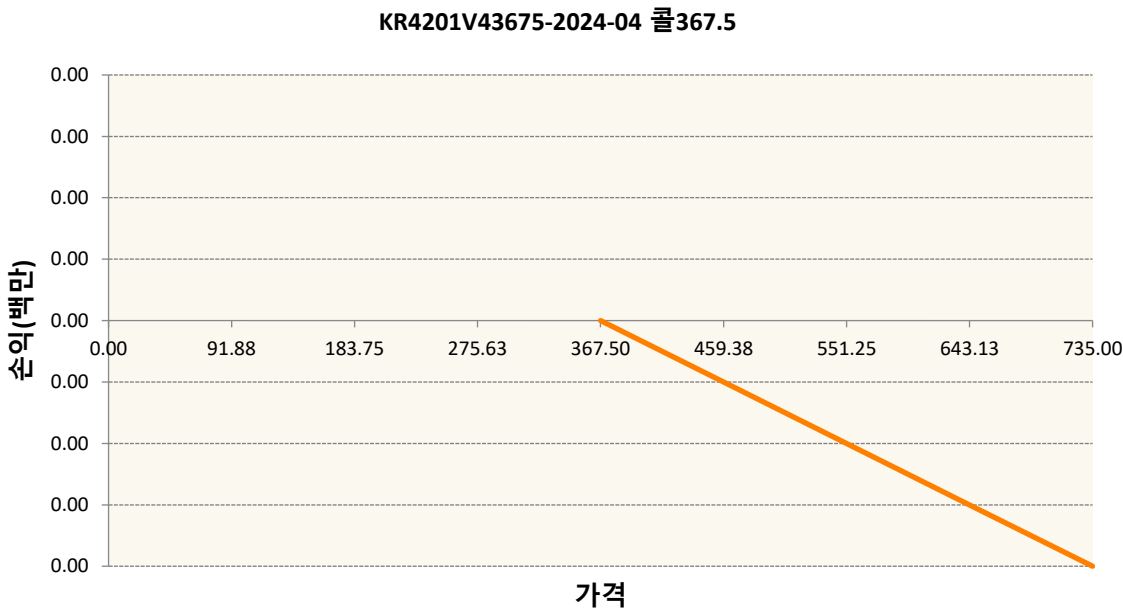
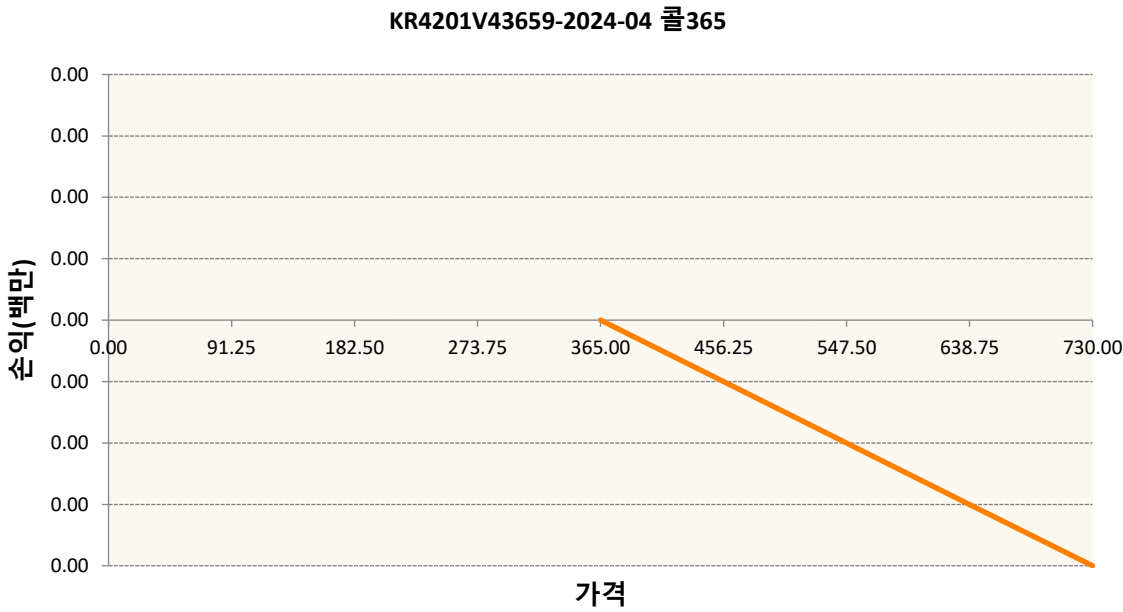
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

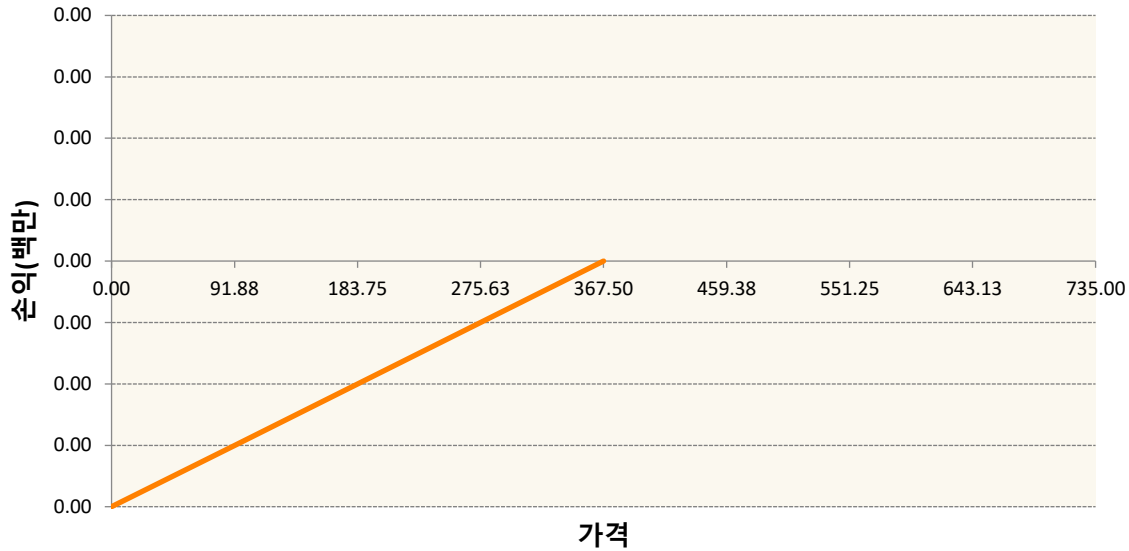
(단위:백만원)

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				1,203
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	319	319	319	319	319	319	319
-5.33%	319	319	319	318	317	316	314
-2.67%	286	279	272	265	258	250	243
0%	8	6	3	0	-4	-8	-13
2.67%	-393	-393	-393	-393	-394	-394	-394
5.33%	-798	-798	-798	-798	-798	-798	-798
8.00%	-1,203	-1,203	-1,203	-1,203	-1,203	-1,203	-1,203
KR4201V43675			2024-04 콜367.5				1,909
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	374	374	374	374	374	374	374
-5.33%	374	374	373	373	372	372	370
-2.67%	354	347	339	330	321	311	301
0%	24	17	9	0	-9	-19	-29
2.67%	-608	-608	-608	-609	-609	-611	-612
5.33%	-1,258	-1,258	-1,258	-1,258	-1,258	-1,259	-1,259
8.00%	-1,909	-1,909	-1,909	-1,909	-1,909	-1,909	-1,909
KR4301V43673			2024-04 풋367.5				542
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-542	-542	-542	-542	-542	-542	-542
-5.33%	-319	-319	-319	-319	-319	-319	-320
-2.67%	-102	-104	-107	-110	-113	-117	-120
0%	8	6	3	0	-3	-7	-10

2.67%	15	15	15	14	14	14	13
5.33%	15	15	15	15	15	15	15
8.00%	15	15	15	15	15	15	15

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

(단위:백만원)

4,771

공시일	2024-04-09
기준일	2024-04-08

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	1,752	0	1,752	

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	2024-04-09
기준일	2024-04-08

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	4,377	0	4,377	

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	2024-04-09
기준일	2024-04-08

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	15,943	0	15,943	
누계	통화	선도	0	15,677	-15,677	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213E1W KRW/USD 30-04-24E	253
FXW213E2TC KRW/USD 31-05-24E	585
FXW213E3TC KRW/USD 28-06-24E	417
IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

589

공시일	2024-04-09
기준일	2024-04-08

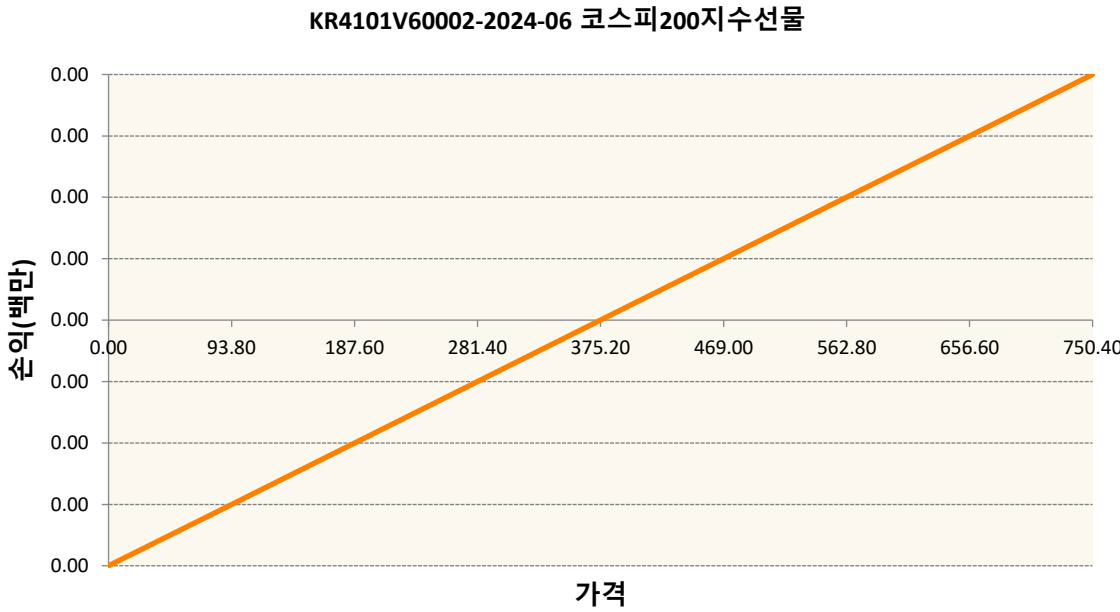
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

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	469	0	469	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	2024-04-09
기준일	2024-04-08

SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

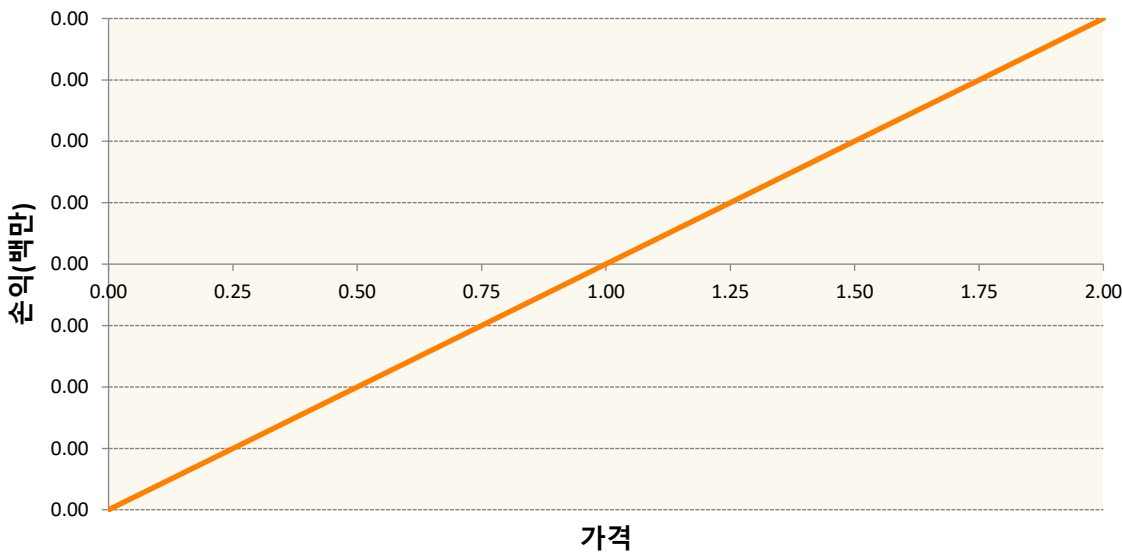
1. 계약금액

(단위:백만원)

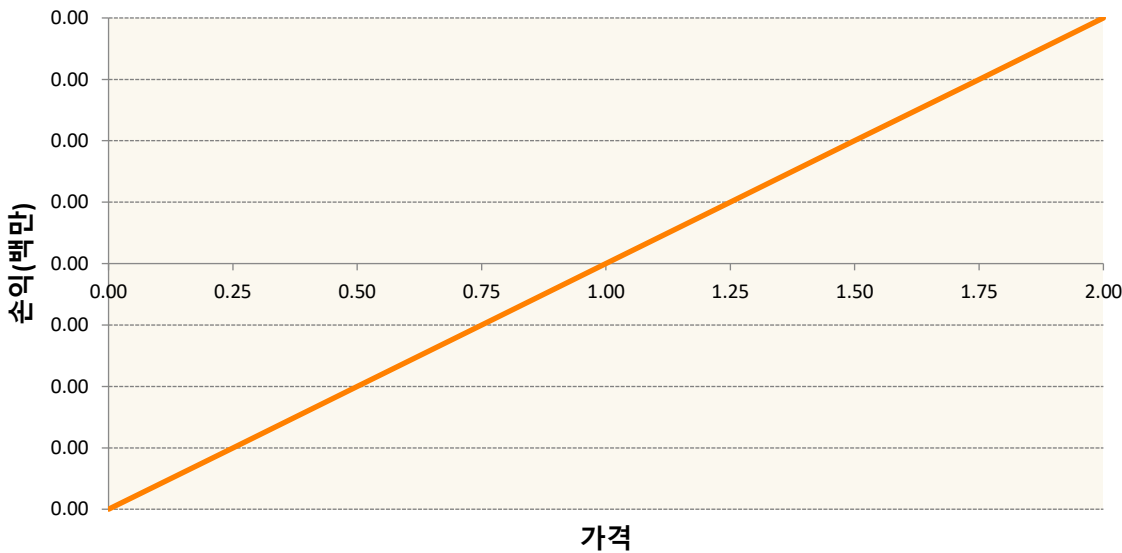
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	18,440	0	18,440	

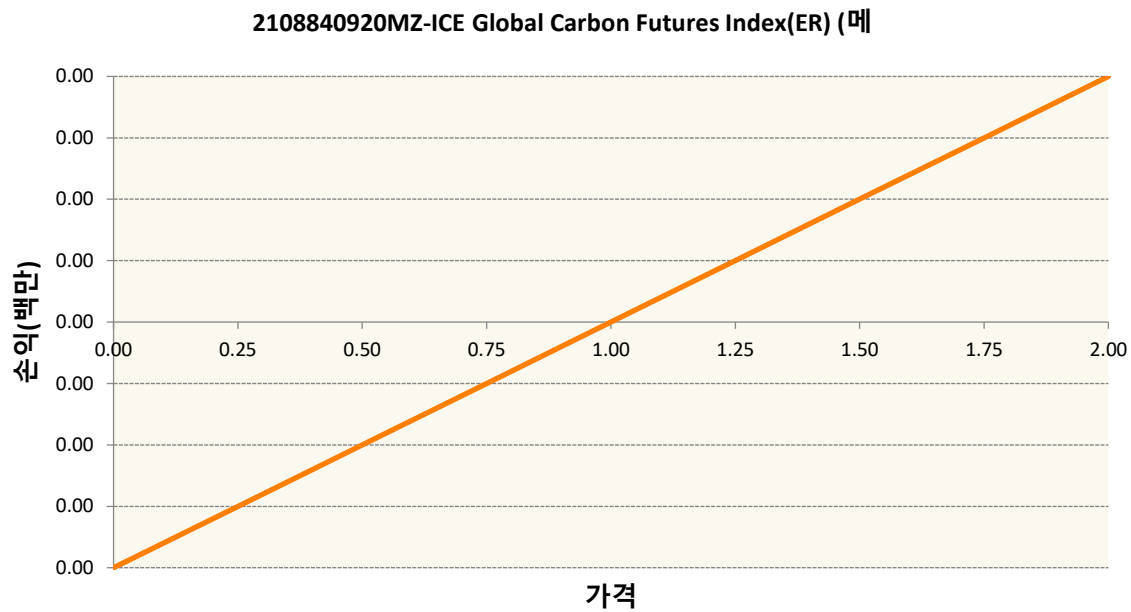
2. 만기시점의 손익구조

2108840321MR-ICE Global Carbon Futures Index(ER) (미



2108840920KM-ICE Global Carbon Futures Index(ER) (키





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108840321IICE Global Carbon Futures Index(ER) (미		434
2108840920IICE Global Carbon Futures Index(ER) (키		867
2108840920IICE Global Carbon Futures Index(ER) (메		173

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)		(단위:백만원)
		1,689

공시일	2024-04-09
기준일	2024-04-08

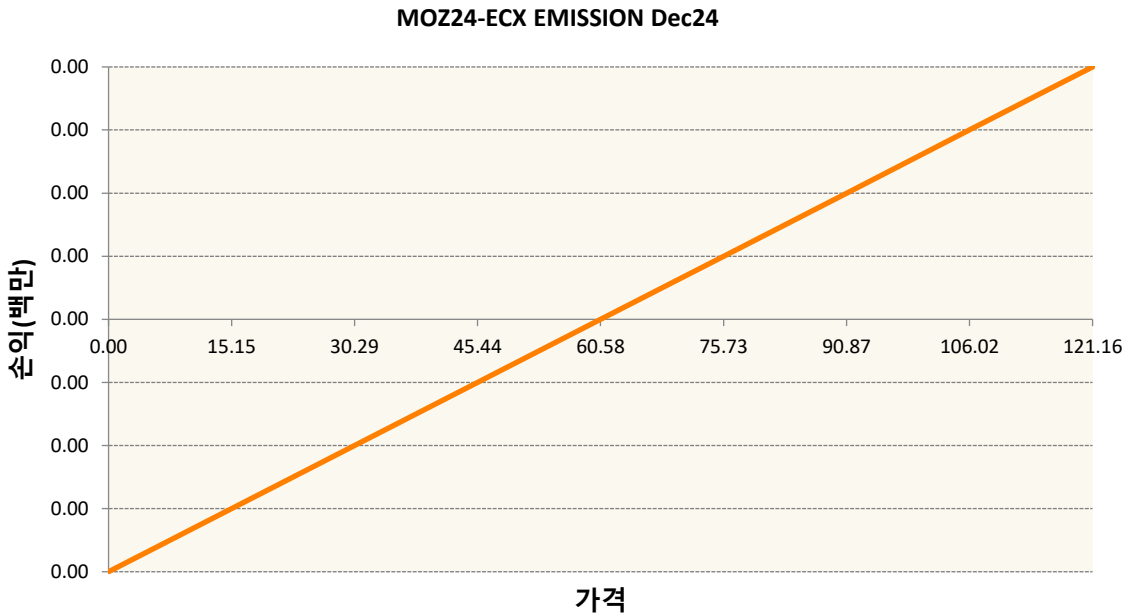
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	9,029	0	9,029	
누계	지수	스왑	331	0	331	장외
누계	통화	선도	0	2,601	-2,601	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213E3SC KRW/EUR 30-04-24E	62
FXW213E3SC KRW/EUR 30-04-24E	147
MOZ24 ECX EMISSION Dec24	722
SWICEUACN ICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX	0.12

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

(단위:백만원)

1,375

공시일	2024-04-09
기준일	2024-04-08

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	2024-04-09
기준일	2024-04-08

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	2024-04-09
기준일	2024-04-08

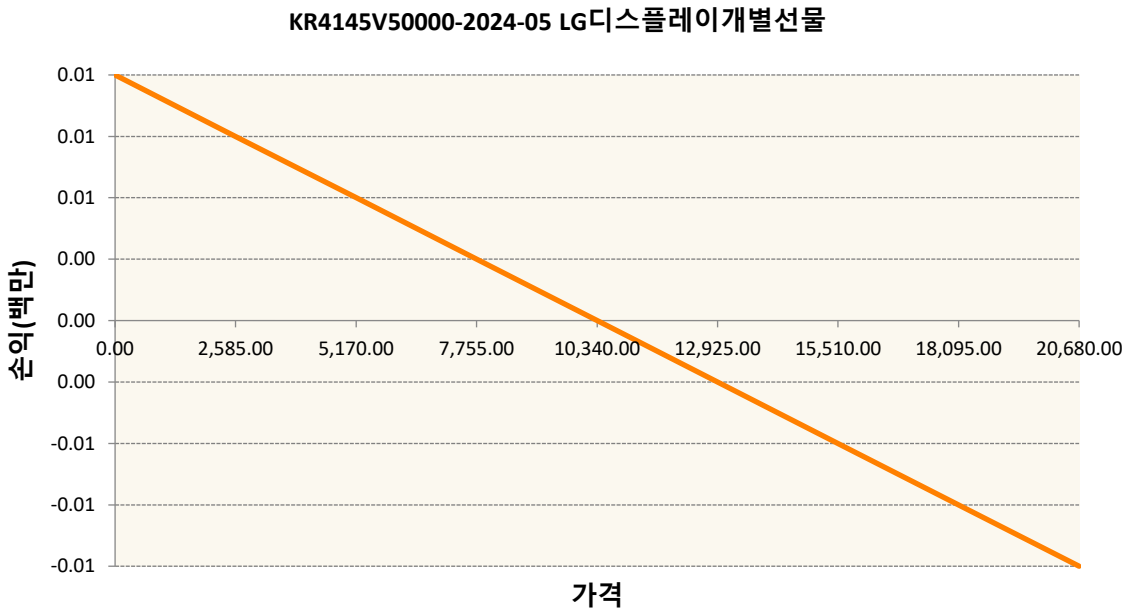
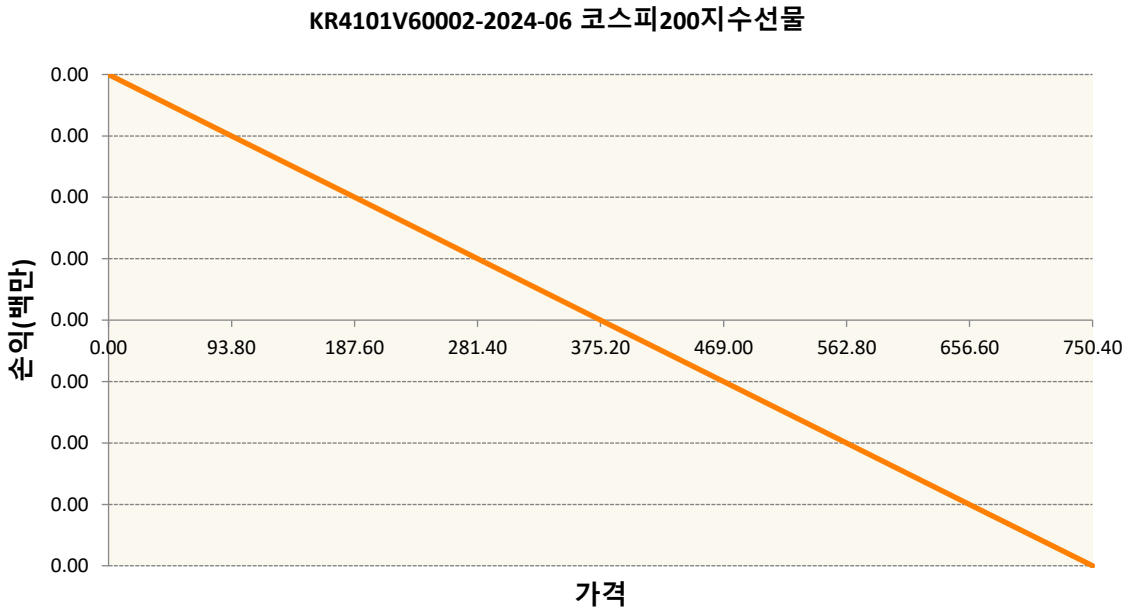
에퀴티알파일반사모혼합자산

1. 계약금액

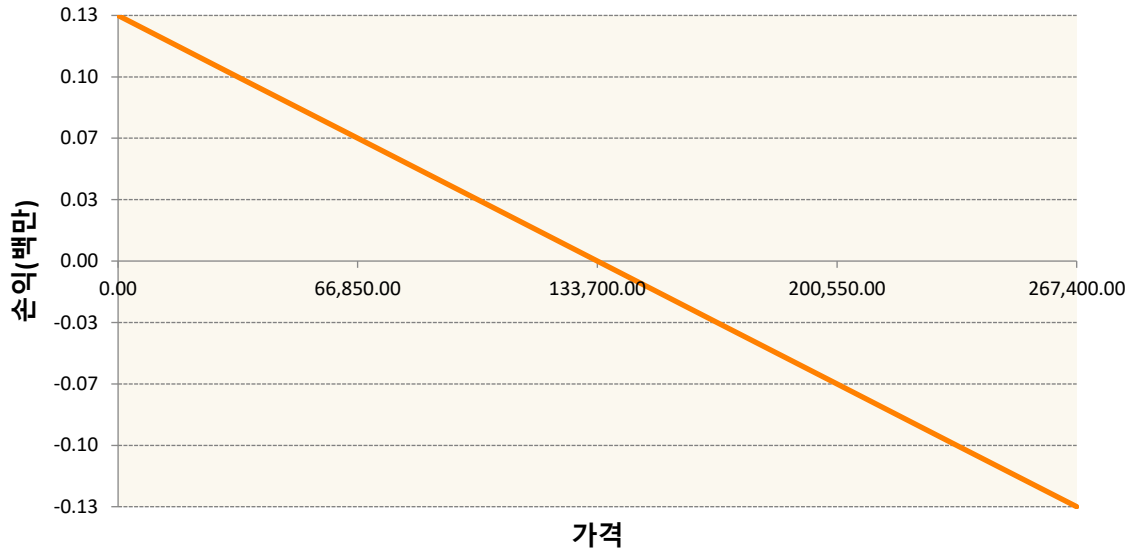
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	1	3	-3	장내
누계	유가증권	선물	21	751	-730	장내

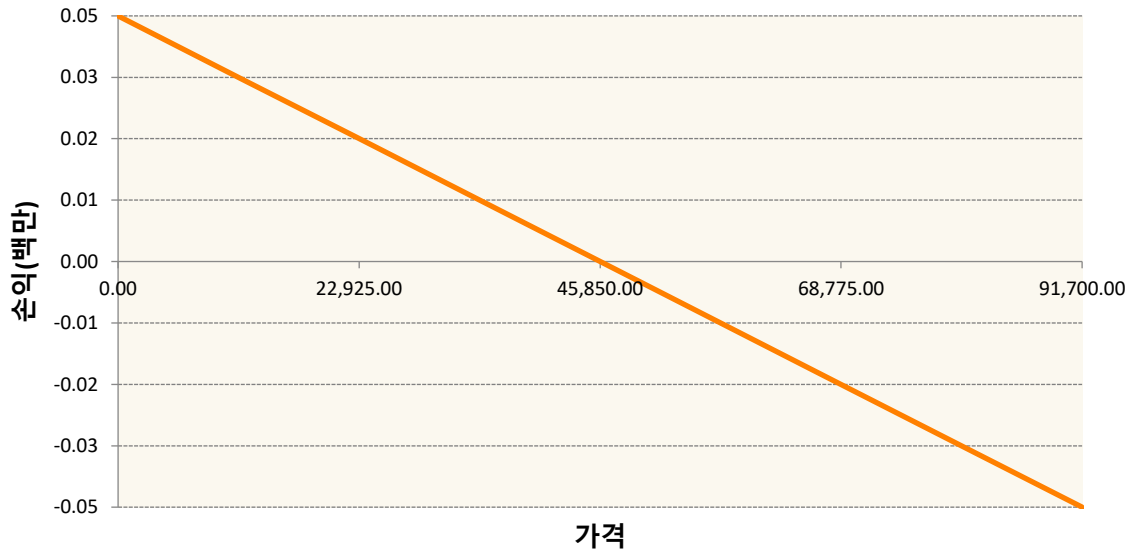
2. 만기시점의 손익구조



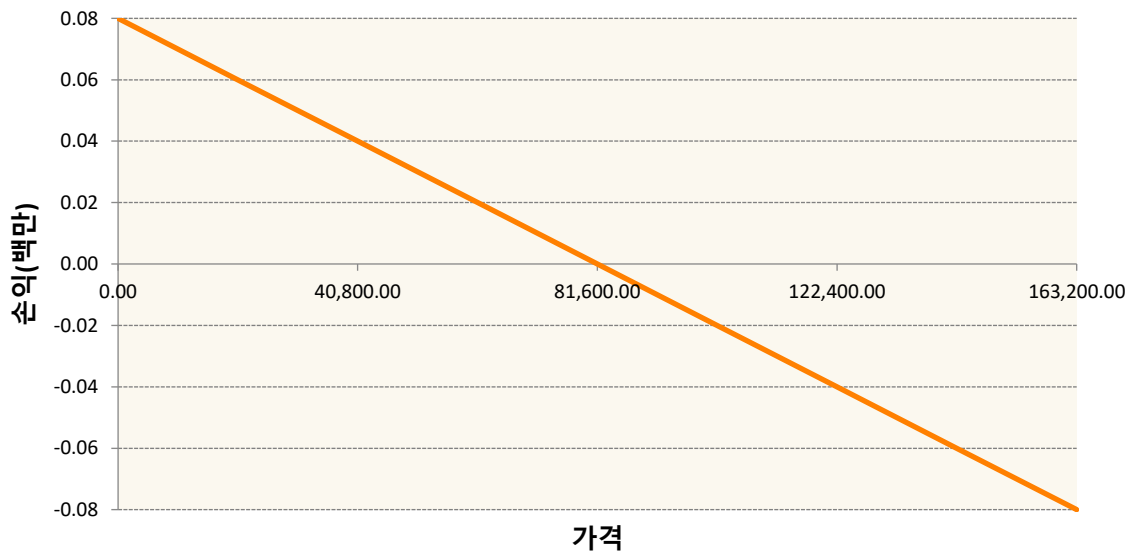
KR41C6V40000-2024-04 아모레퍼시픽개별선물



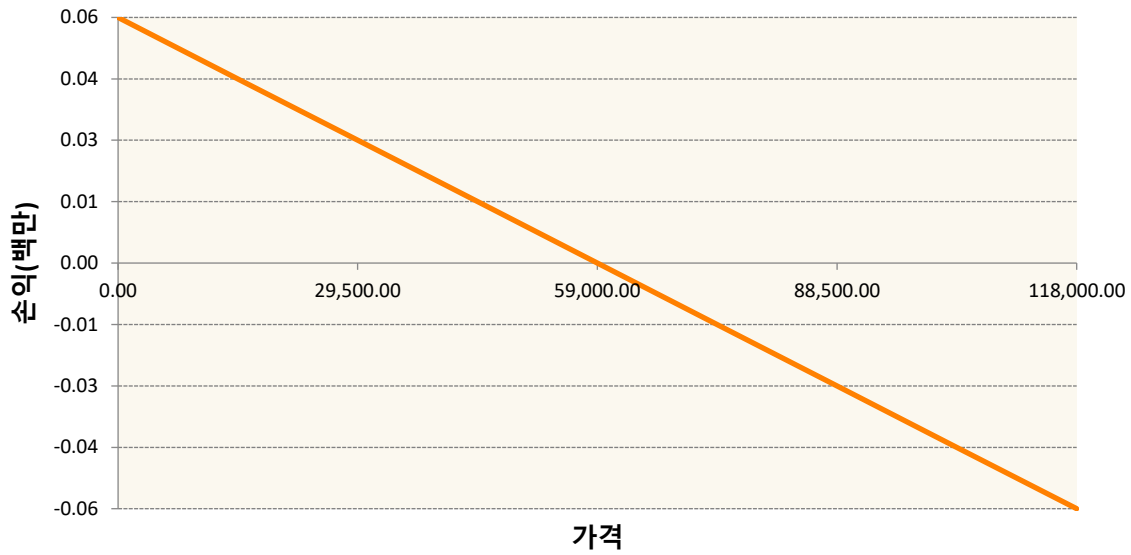
KR41CNV40003-2024-04 포스코DX개별선물



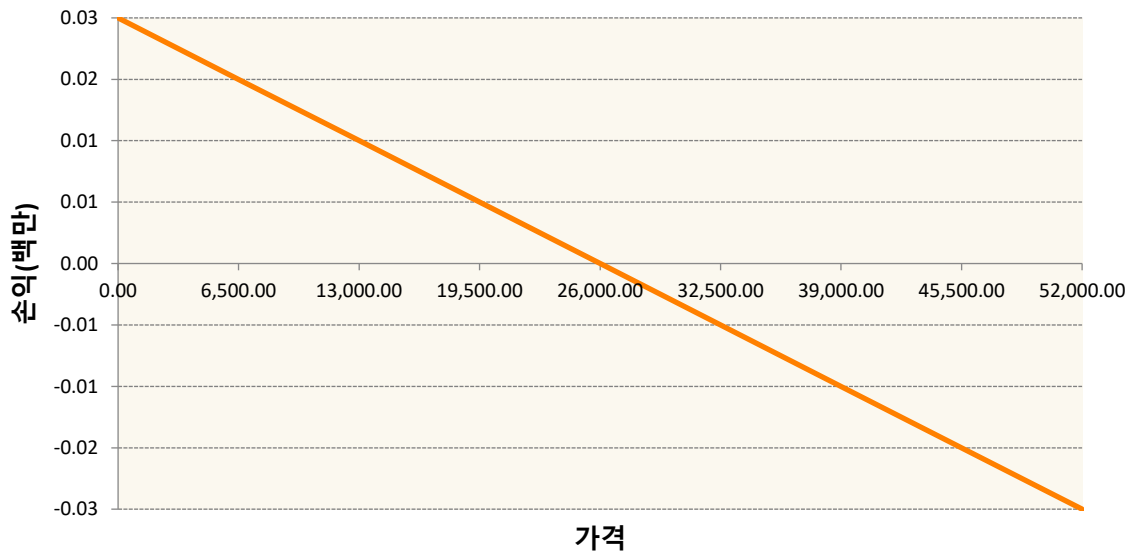
KR41E4V40003-2024-04 에스엠개별선물



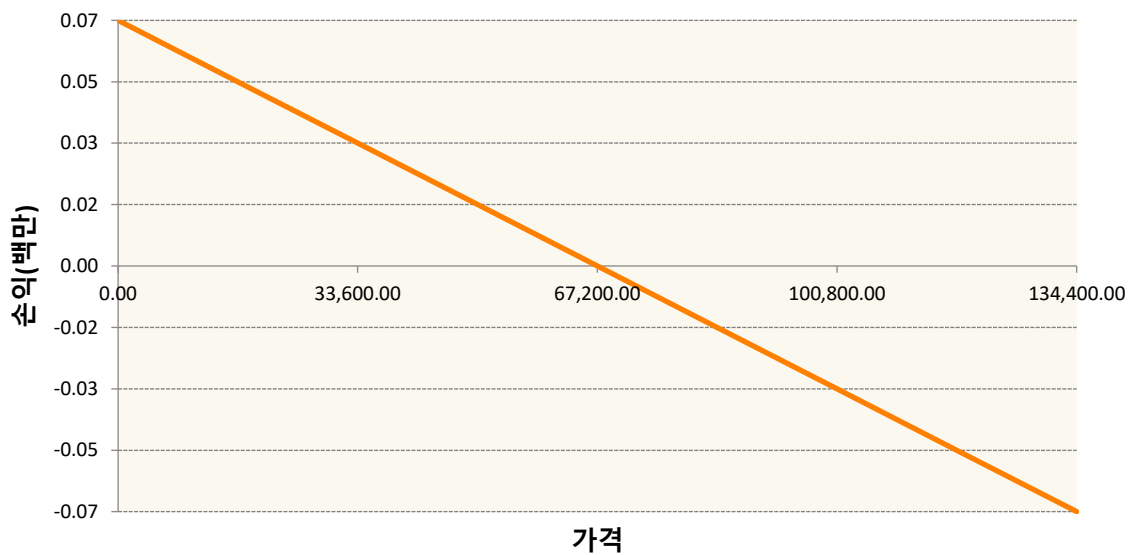
KR41E5V40000-2024-04 넷마블개별선물



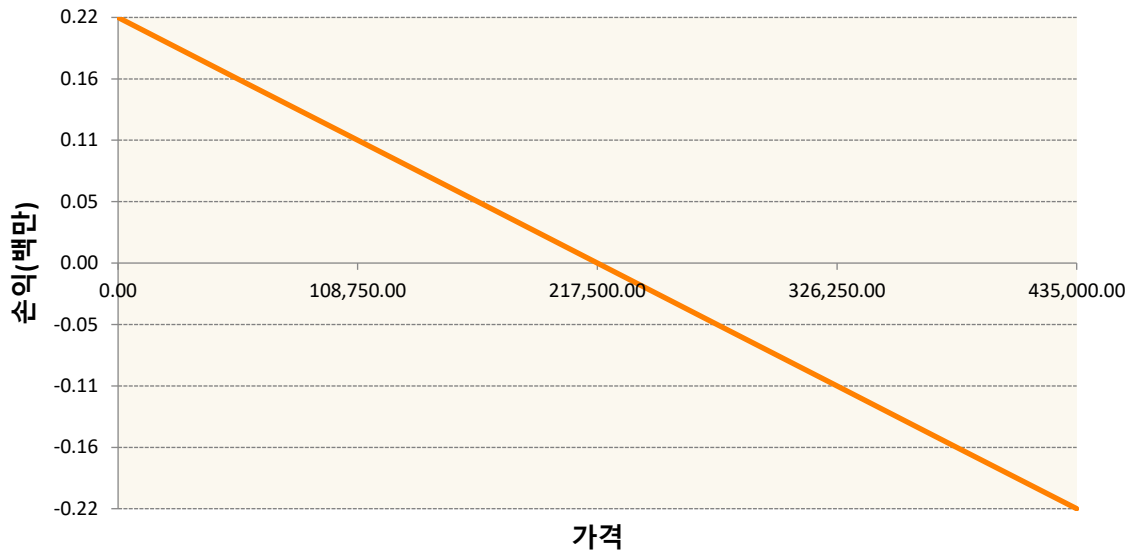
KR41F6V40007-2024-04 카카오뱅크개별선물



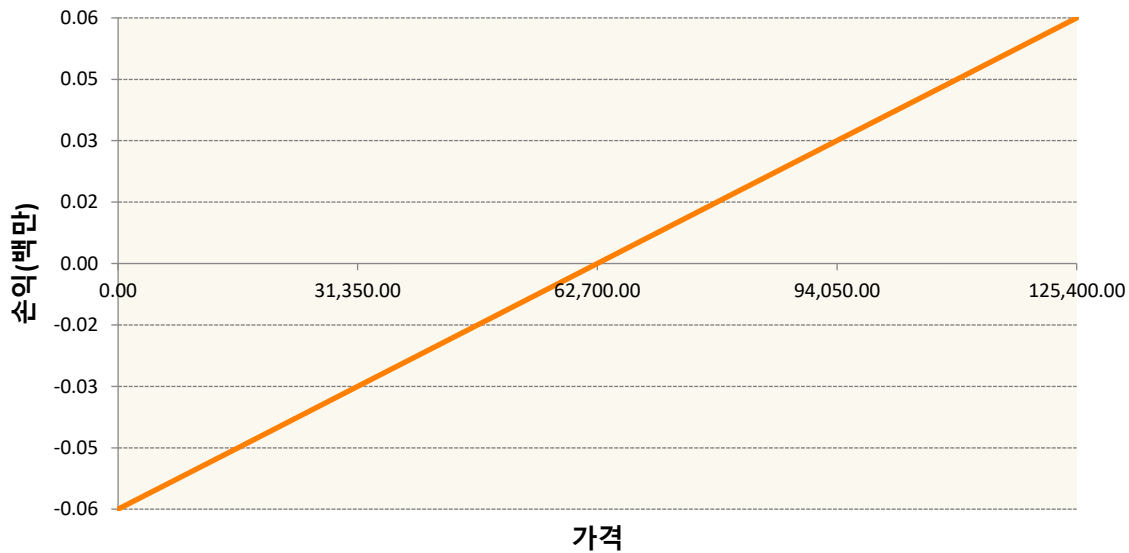
KR41FBV40001-2024-04 SK아이이테크놀로지개별선물



KR41FCV40009-2024-04 하이브개별선물



KR41G9V40000-2024-04 레고캠바이오개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101V600 2024-06 코스피200지수선물	45
KR4145V500 2024-05 LG디스플레이개별선물	0.27
KR41C6V400 2024-04 아모레퍼시픽개별선물	3
KR41CNV40(2024-04 포스코DX개별선물	3
KR41E4V400 2024-04 에스엠개별선물	0.07
KR41E5V400 2024-04 넷마블개별선물	1
KR41F6V400 2024-04 카카오뱅크개별선물	2
KR41FBV400 2024-04 SK아이이테크놀로지개별선물	2
KR41FCV400 2024-04 하이브개별선물	3
KR41G9V40C 2024-04 레고캠바이오개별선물	2

공시일	2024-04-09
기준일	2024-04-08

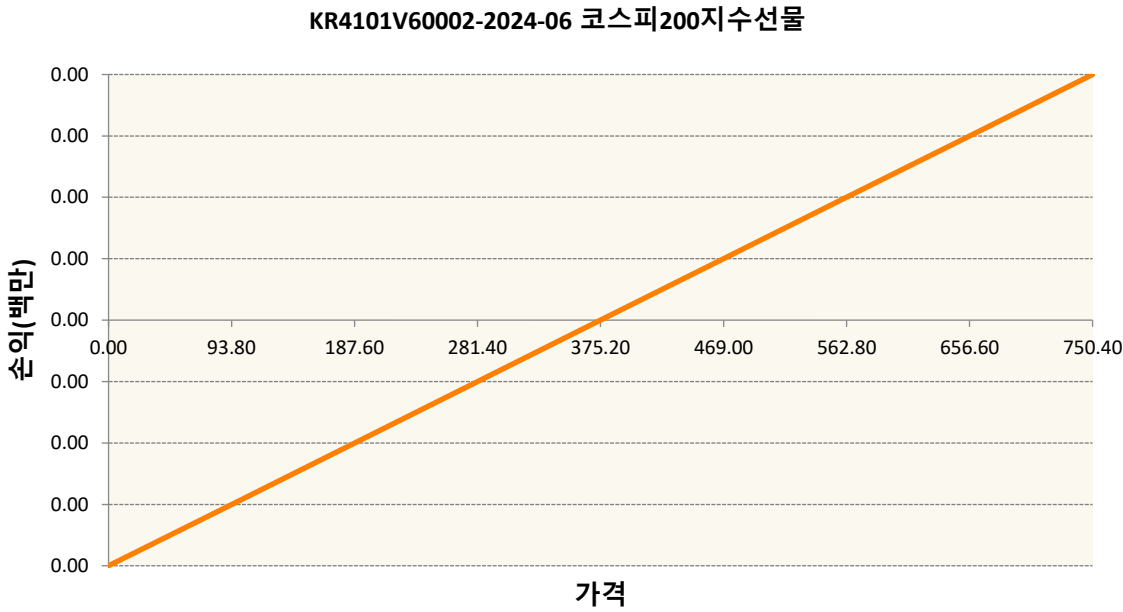
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

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	3,002	0	3,002	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	2024-04-09
기준일	2024-04-08

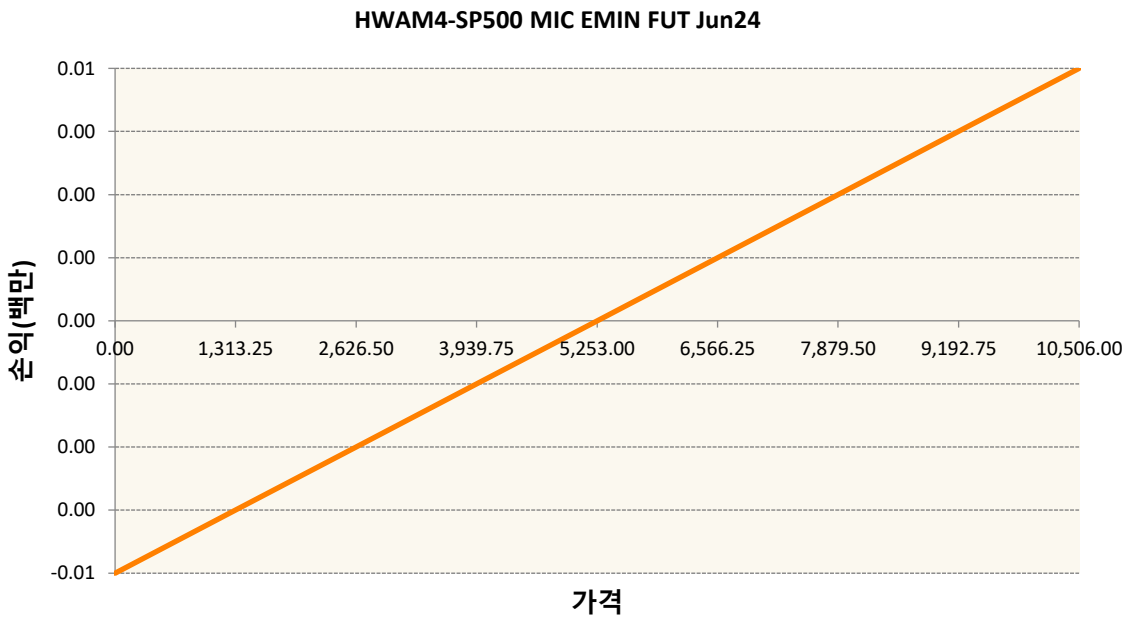
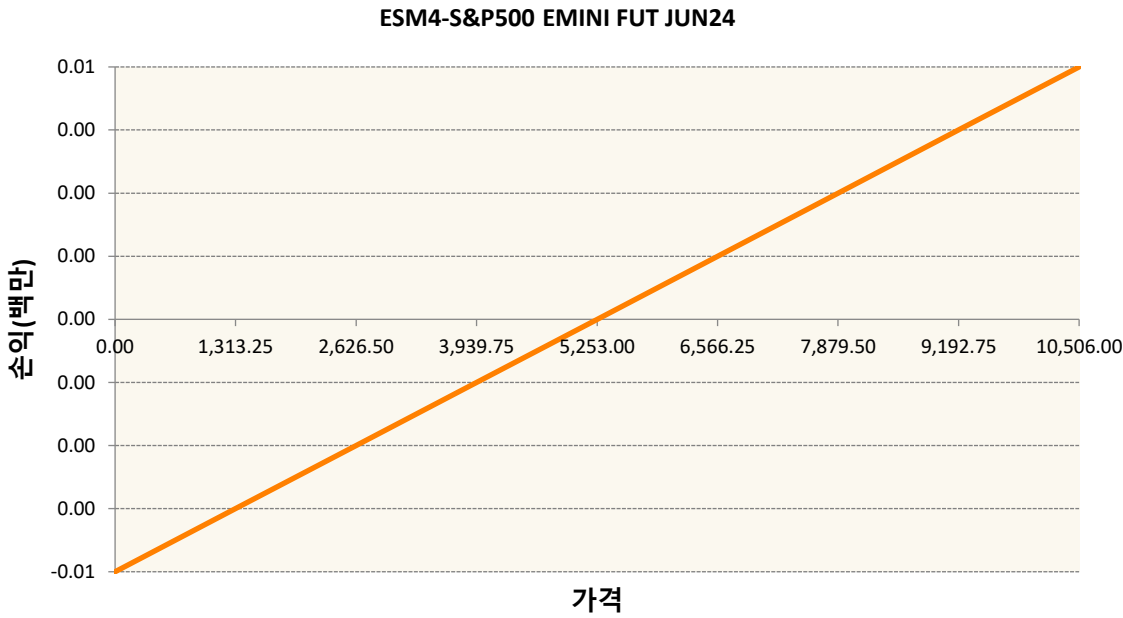
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

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	4,159	0	4,159	
누계	유가증권	선물	1,909	0	1,909	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESM4	S&P500 EMINI FUT JUN24	333
HWAM4	SP500 MIC EMIN FUT Jun24	153

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	344

공시일	2024-04-09
기준일	2024-04-08

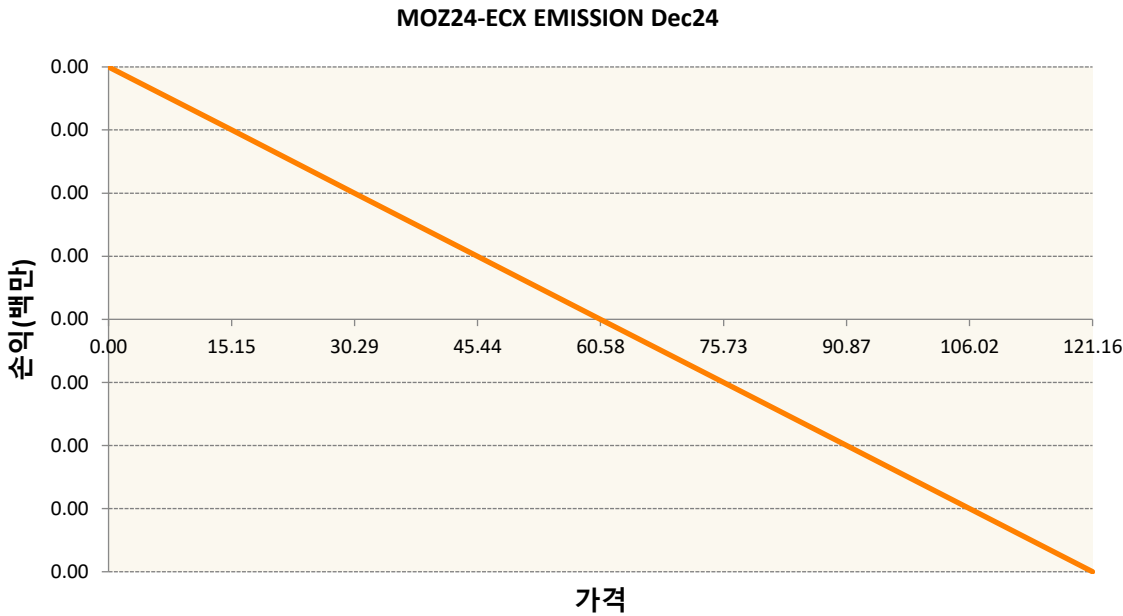
SOL유럽탄소배출권선물인버스ICE특별자산상

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	5,941	-5,941	
누계	지수	스왑	331	0	331	장외
누계	통화	선도	0	1,111	-1,111	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213E3SC KRW/EUR 30-04-24E	89
MOZ24 ECX EMISSION Dec24	475
SWICEUACN ICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX	0.1

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

(단위:백만원)

876

공시일	2024-04-09
기준일	2024-04-08

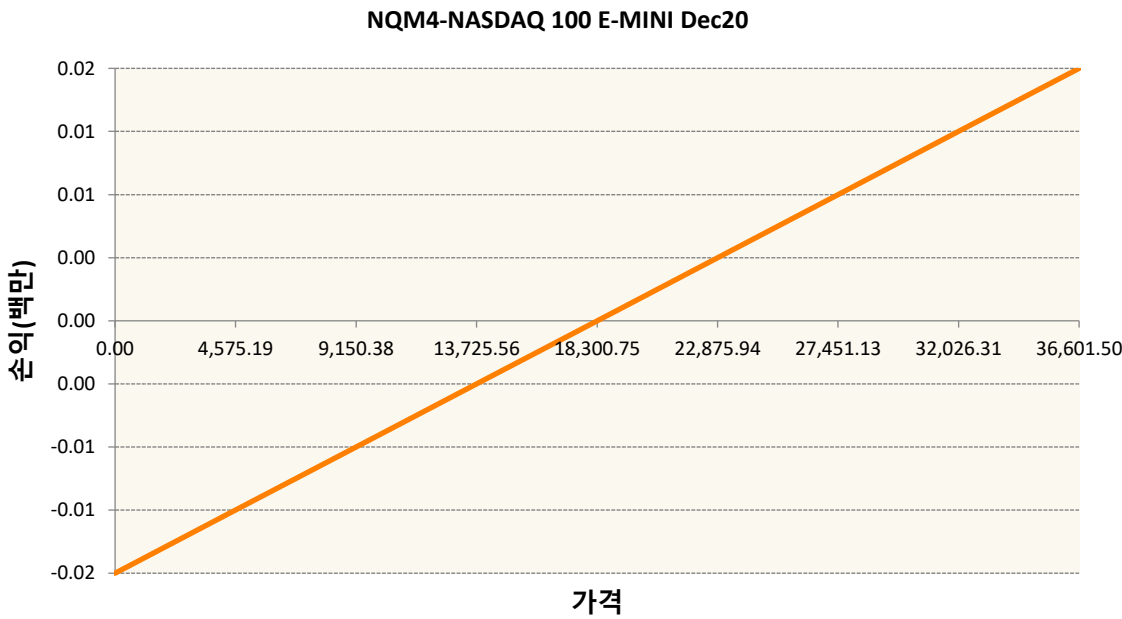
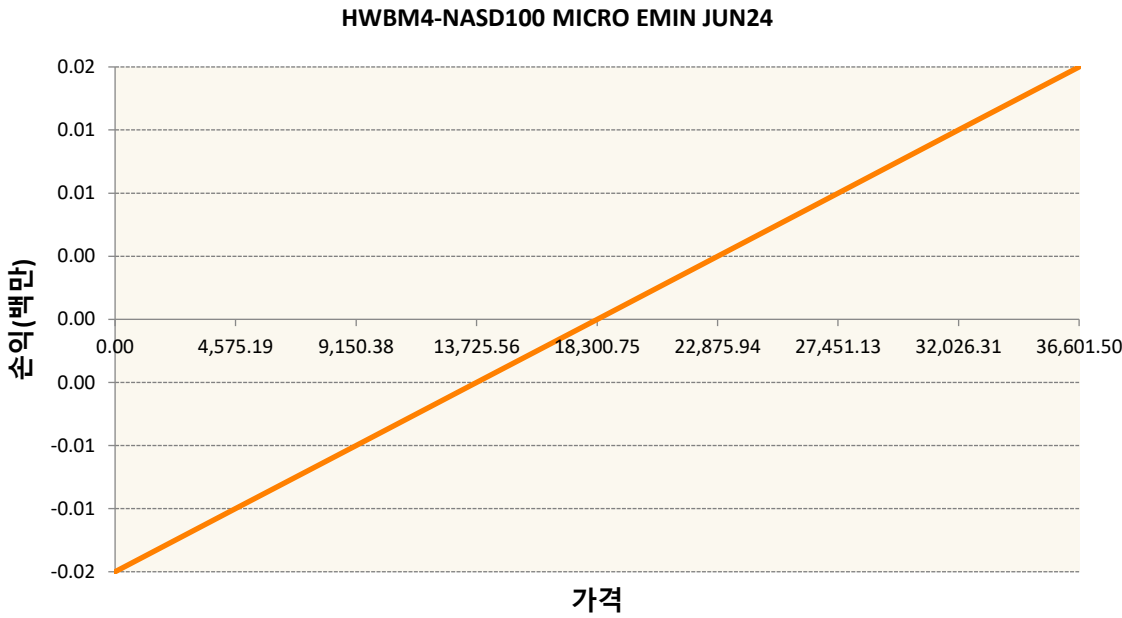
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

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	2,418	0	2,418	
누계	유가증권	선물	2,464	0	2,464	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
HWBM4	NASD100 MICRO EMIN JUN24		197
NQM4	NASDAQ 100 E-MINI Dec20		193

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)			(단위:백만원)
			327

공시일	2024-04-09
기준일	2024-04-08

SOL미국30년국채커버드콜(합성)

1. 계약금액 (단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	11,962	0	11,962	장외
누계	지수	스왑	121,752	0	121,752	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
SWKEDI0000 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	439
SWKEDI0000 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	1,606
SWKEDI0000 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	6,710
SWKEDI0000 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	945

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	6,043

공시일	2024-04-09
기준일	2024-04-08

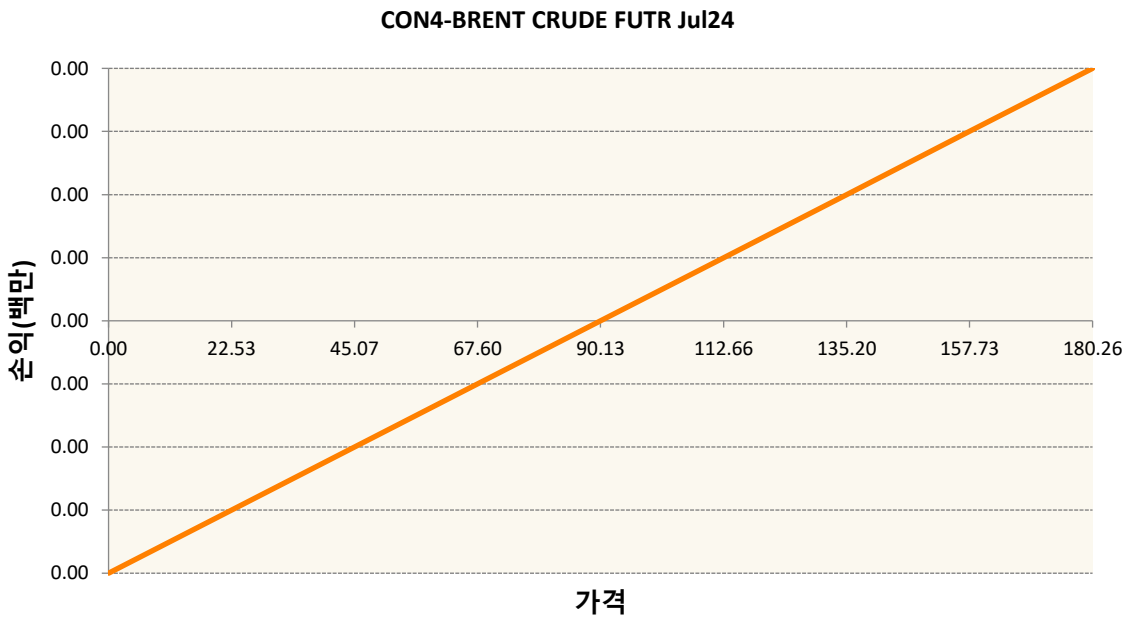
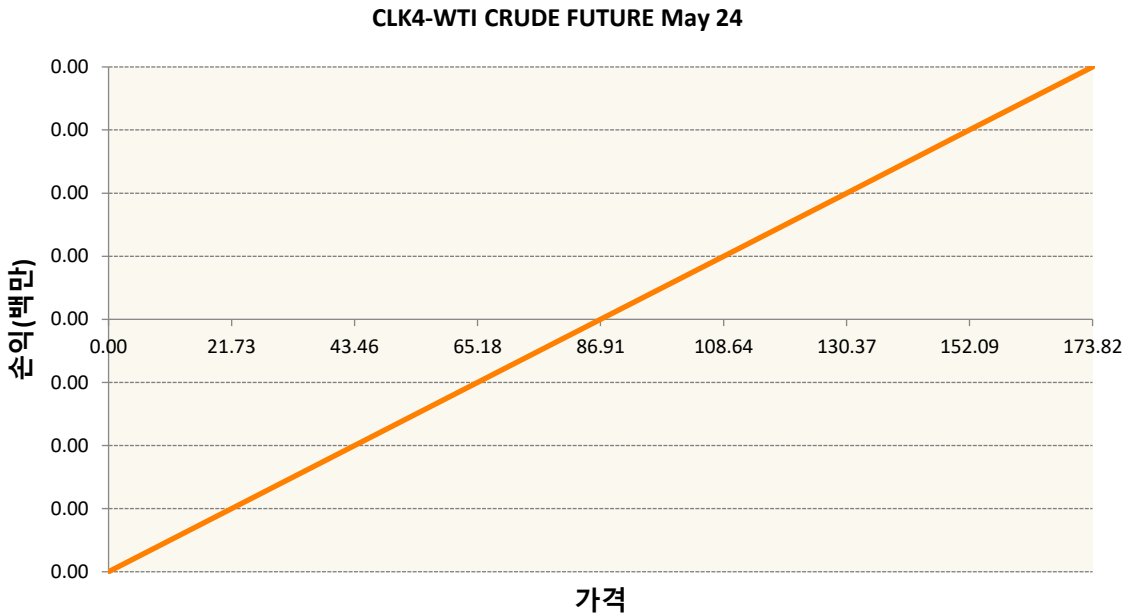
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

1. 계약금액

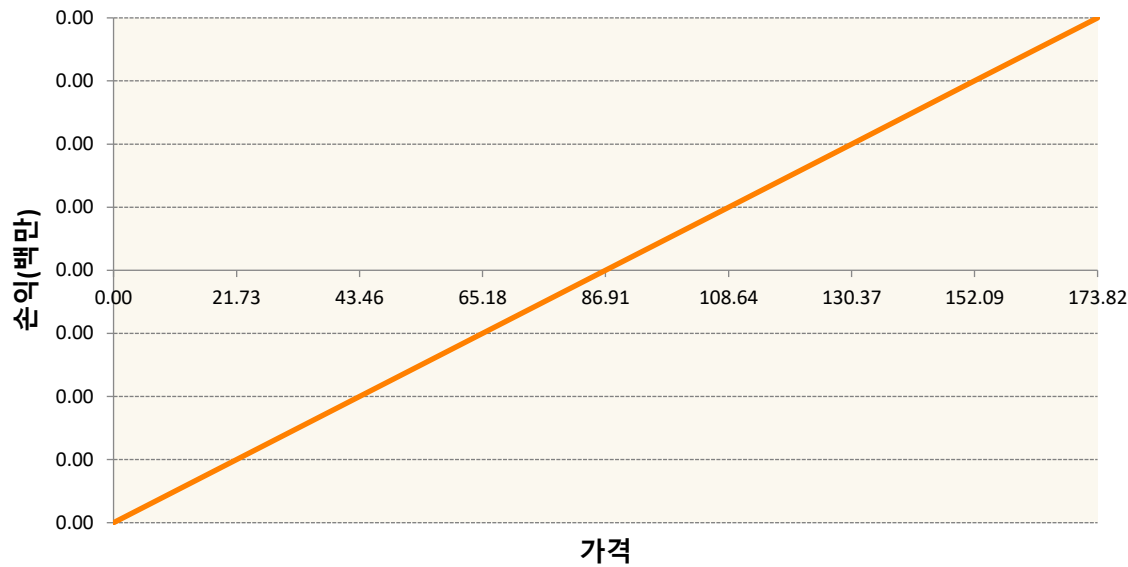
(단위:백만원)

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	1,216	0	1,216	
누계	통화	선물	0	244	-244	장내

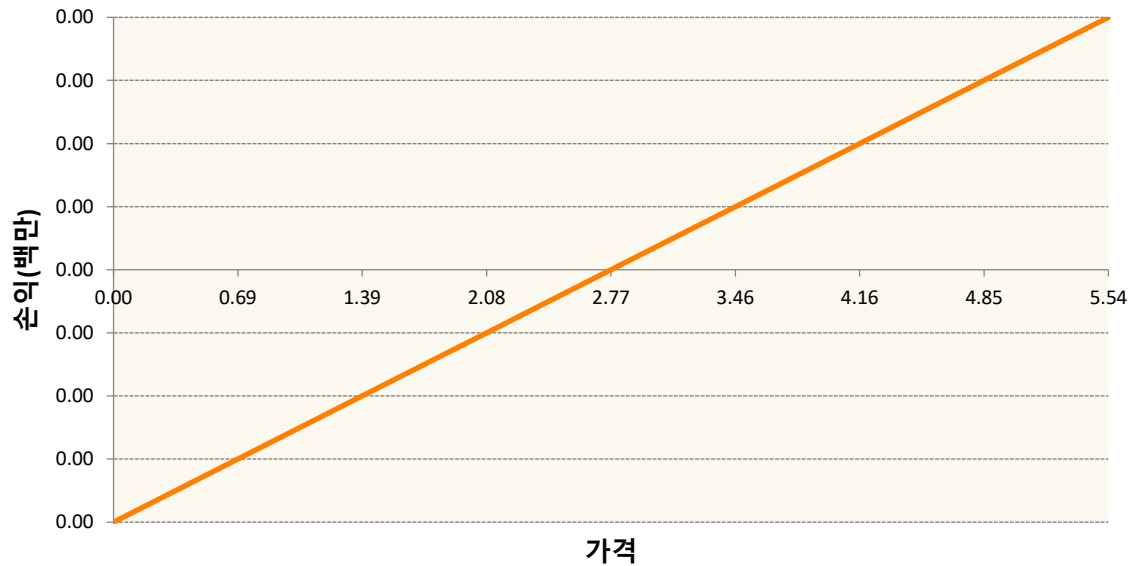
2. 만기시점의 손익구조



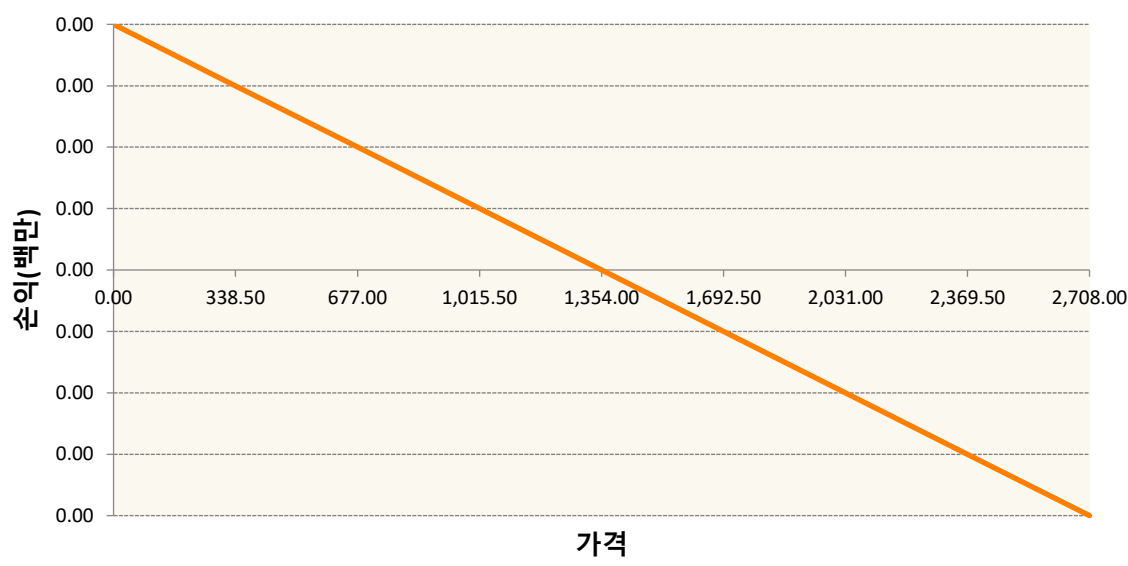
ECK4-E-mini Crude Oil May 24



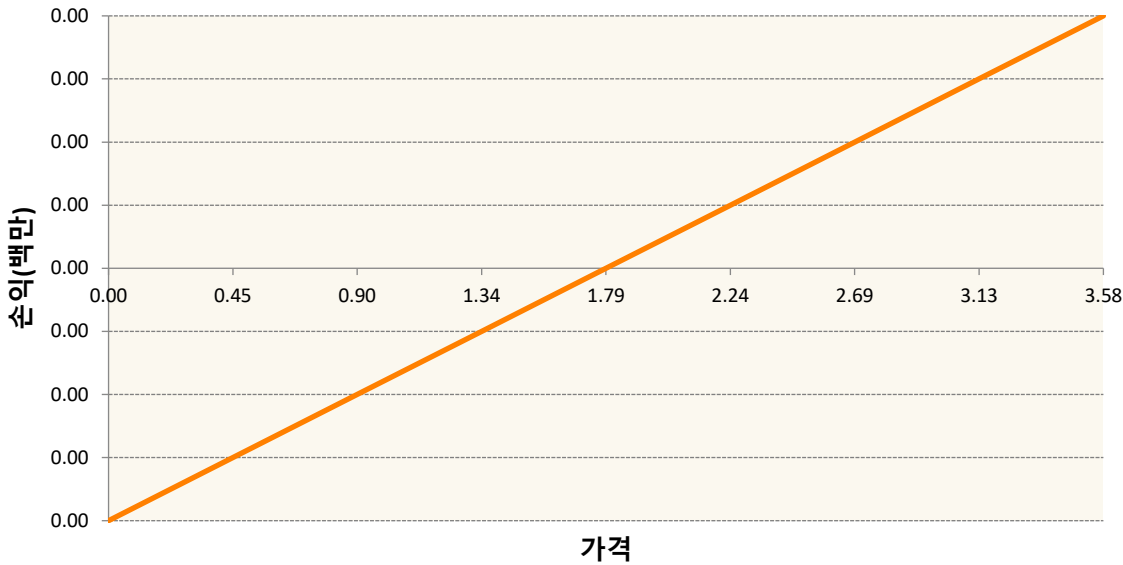
HOK4-NY Harb ULSD Fut May 24



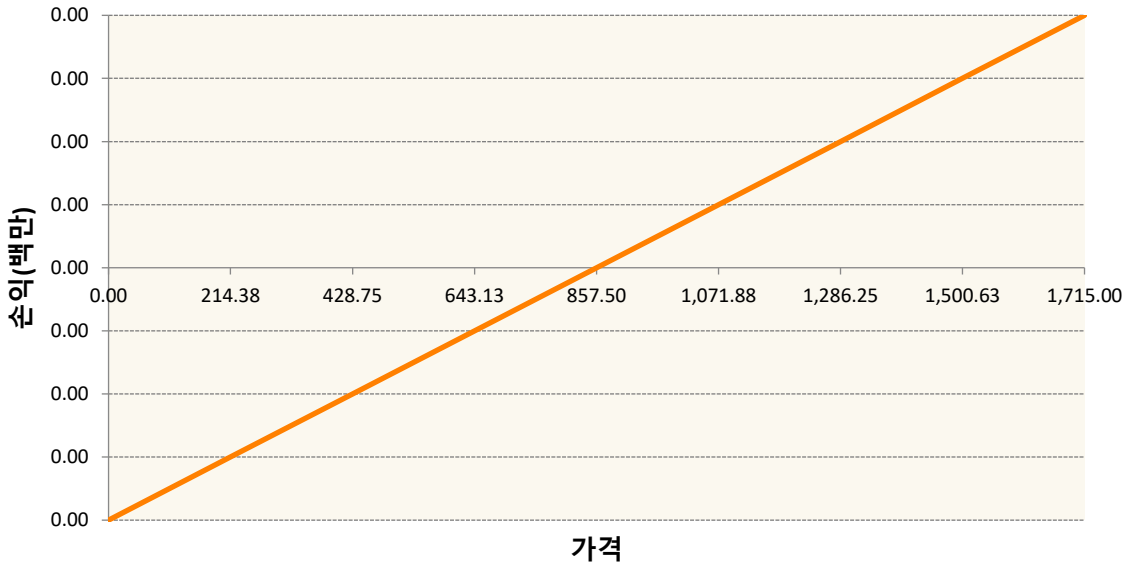
KR4175V40008-2024-04 달러선물



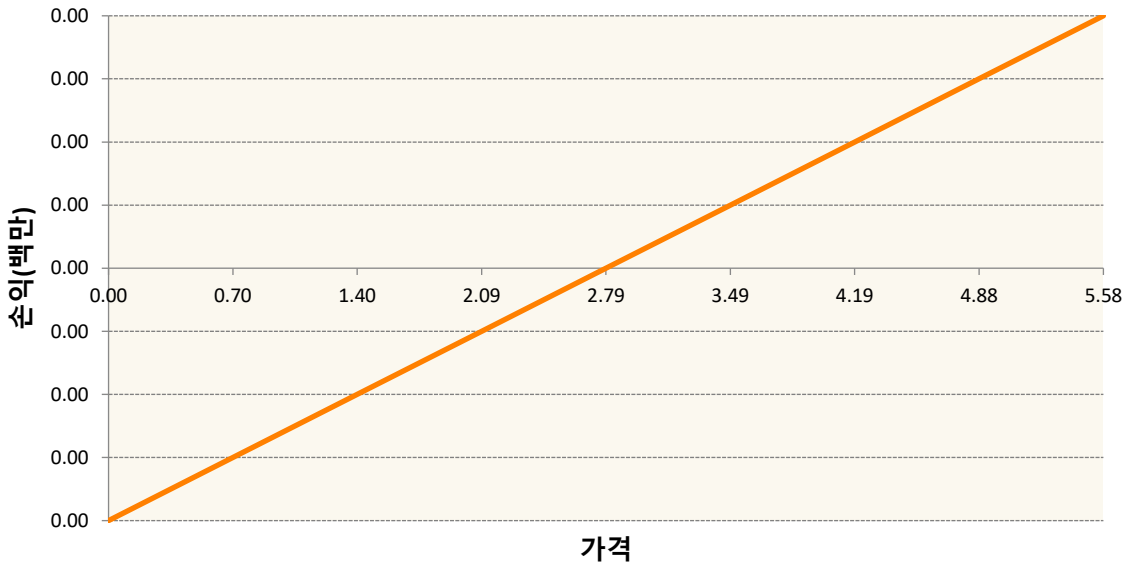
NGK24-NATURAL GAS FUTR May 24



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)

209