

공시일	2024-04-11
기준일	2024-04-09

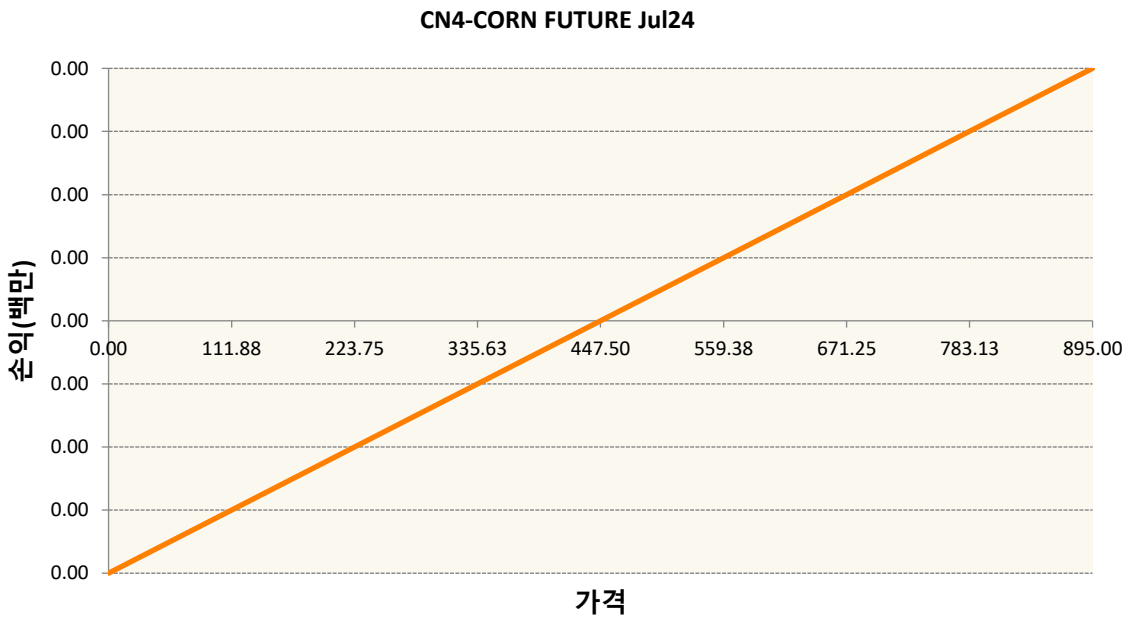
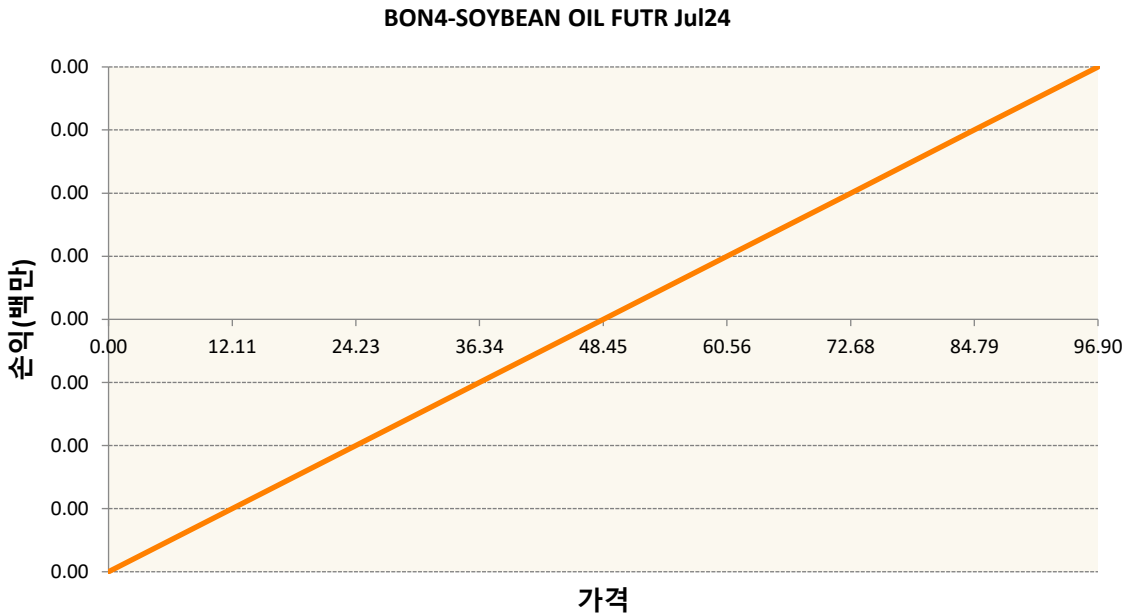
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

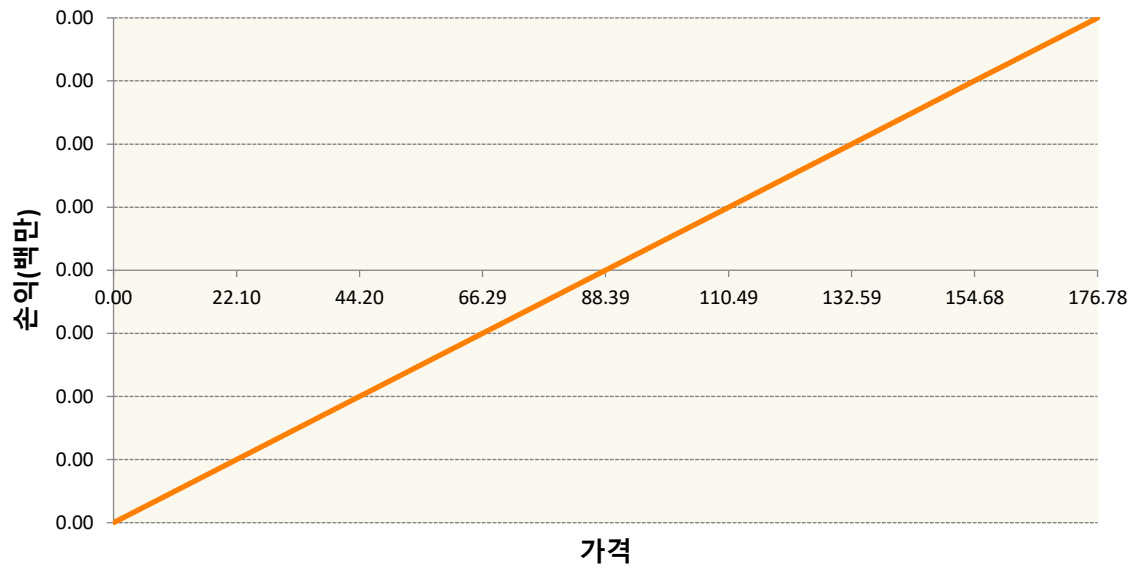
(단위:USD 백만)

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	4,010	0	4,010	
누계	통화	선물	0	528	-528	장내

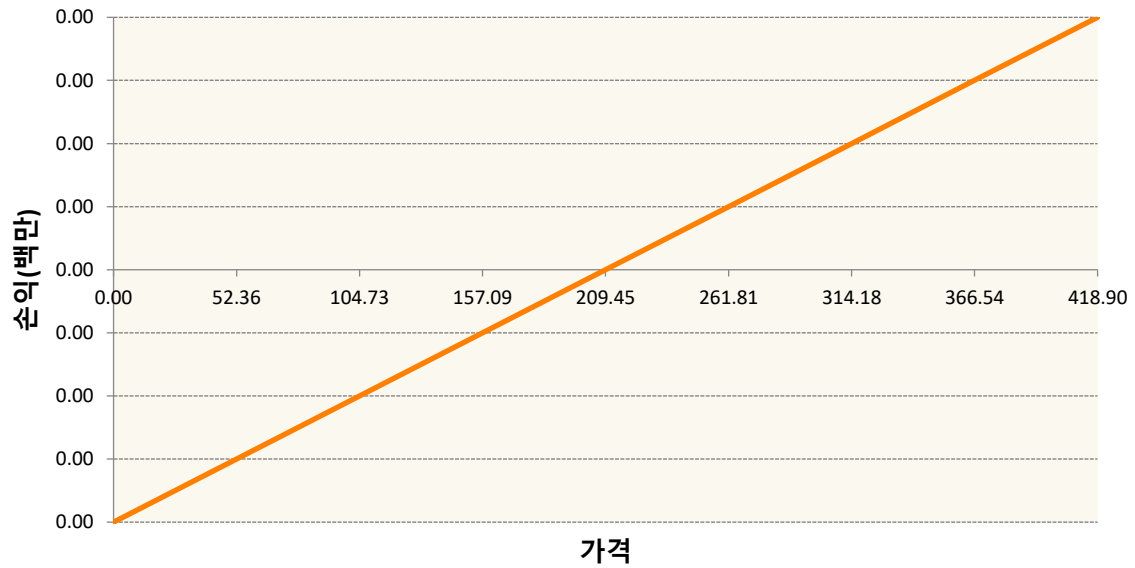
2. 만기시점의 손익구조



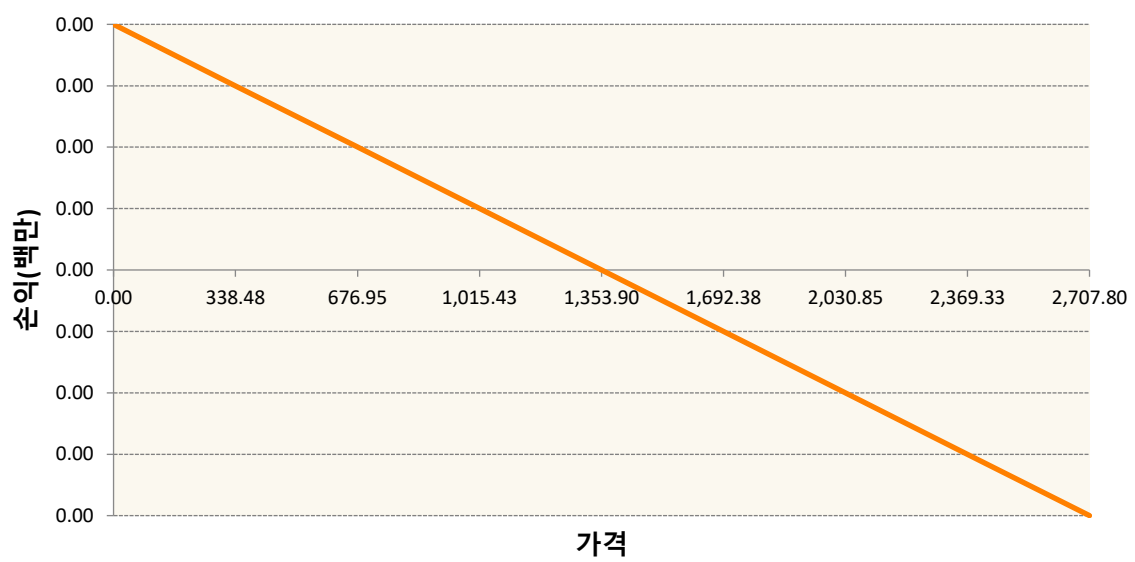
CTN4-COTTON NO.2 FUTR Jul24



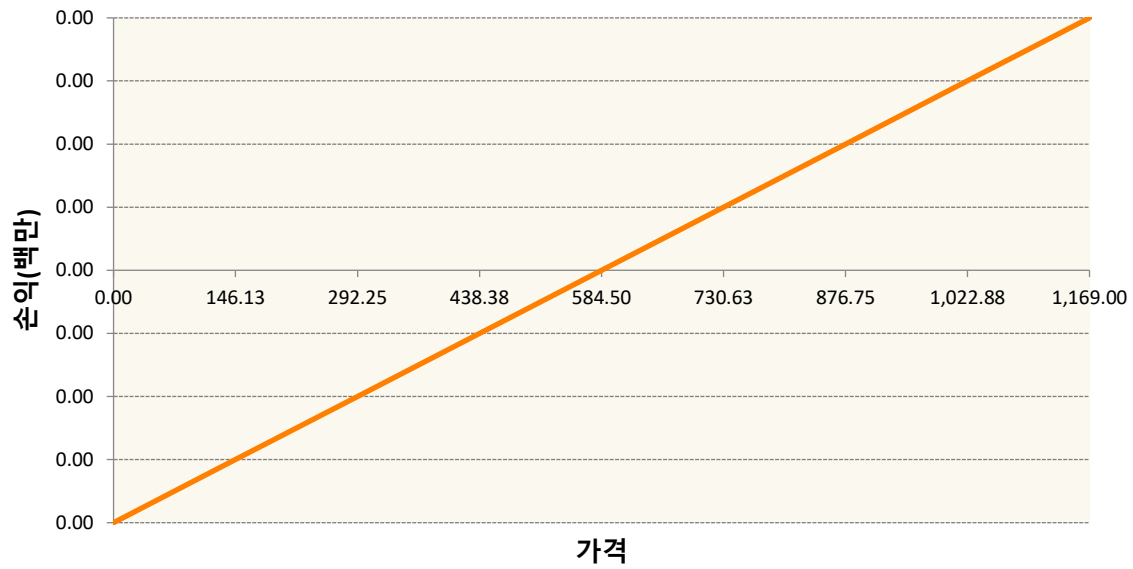
KCN4-COFFEE 'C' FUTURE Jul24



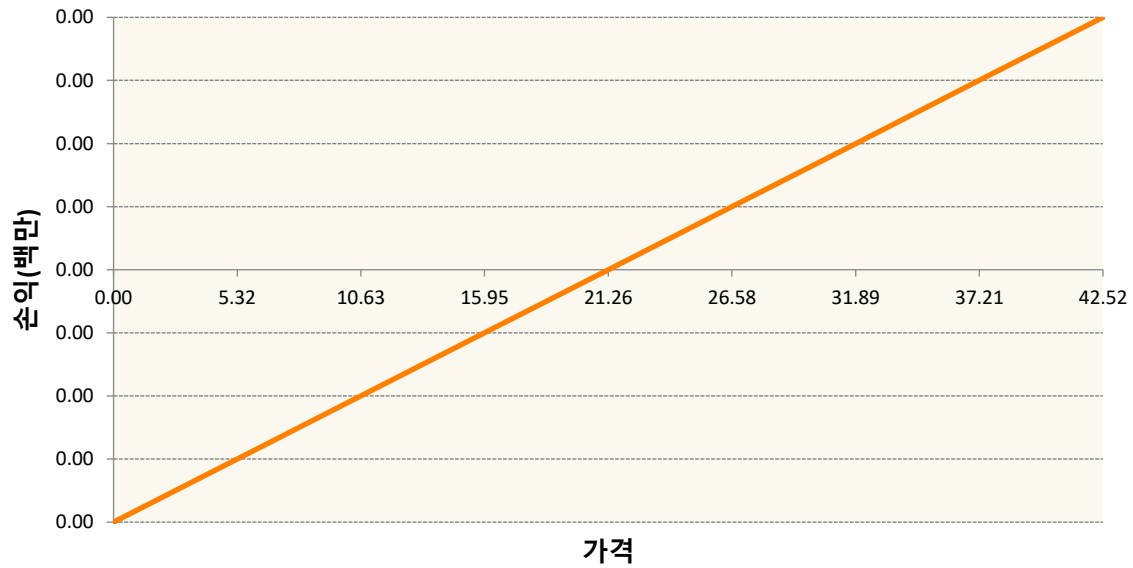
KR4175V40008-2024-04 달러선물



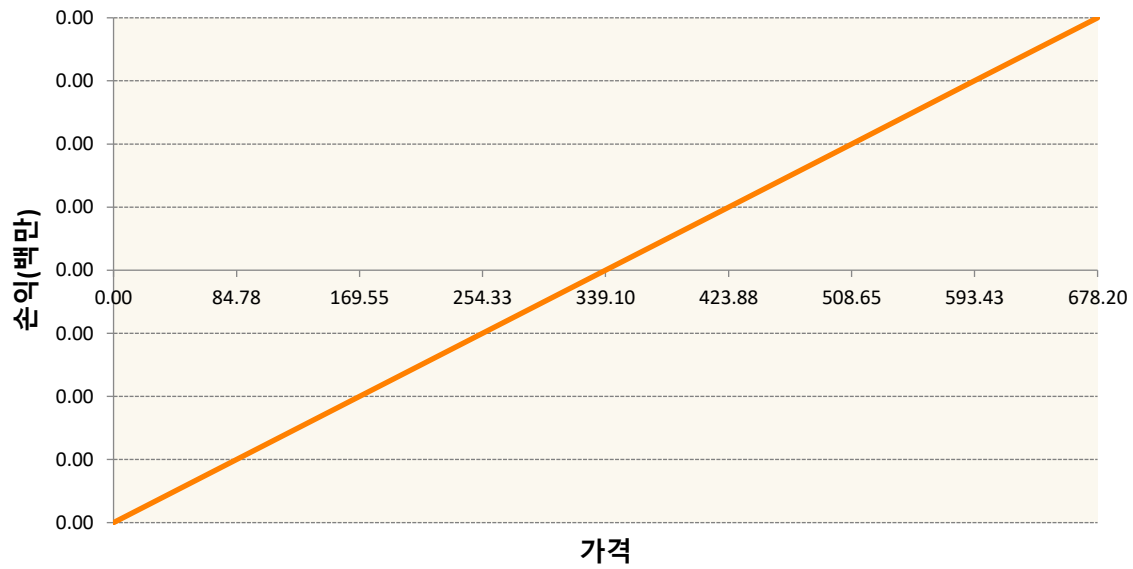
KWN4-KC HRW WHEAT FUT Jul24



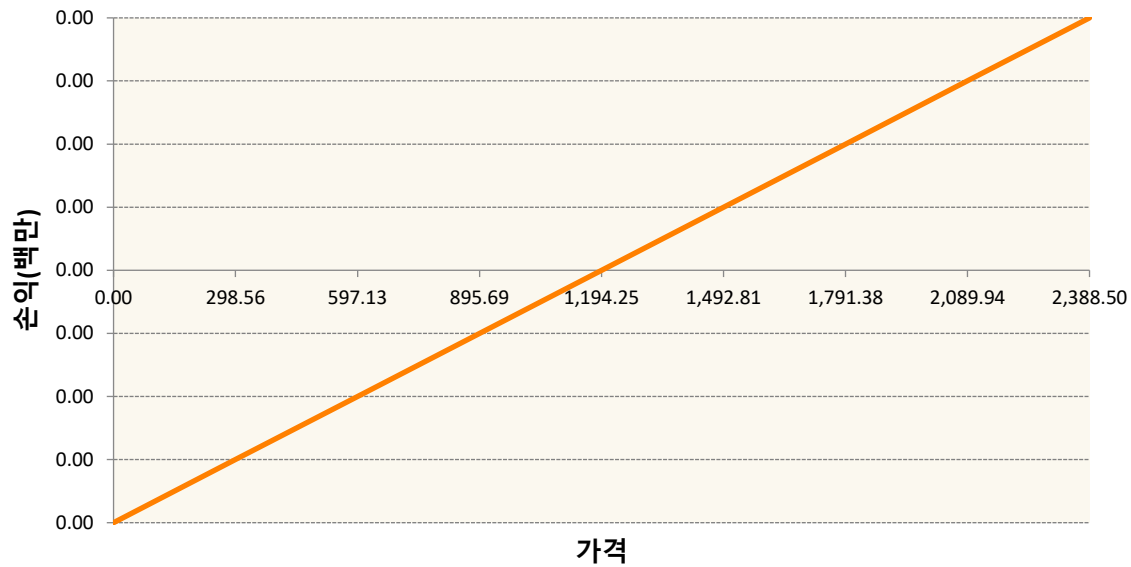
SBN4-Sugar #11 (WORLD) Jul24



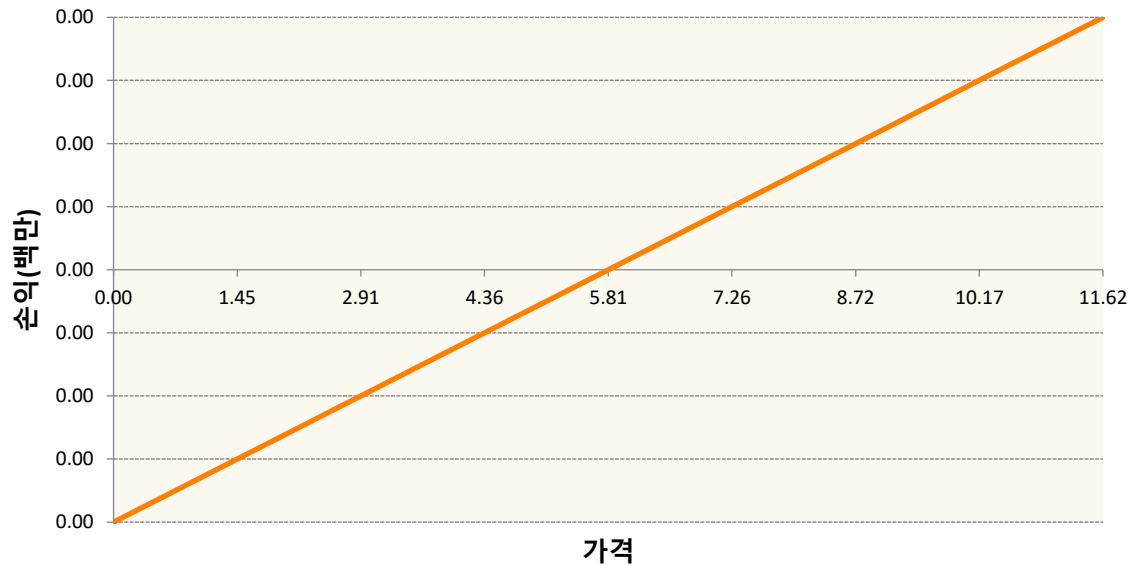
SMN4-SOYBEAN MEAL FUTR Jul24



SN4-SOYBEAN FUTURE Jul24



WN4-WHEAT FUTURE(CBT) Jul24



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

공시일	2024-04-11
기준일	2024-04-09

스마트인덱스모

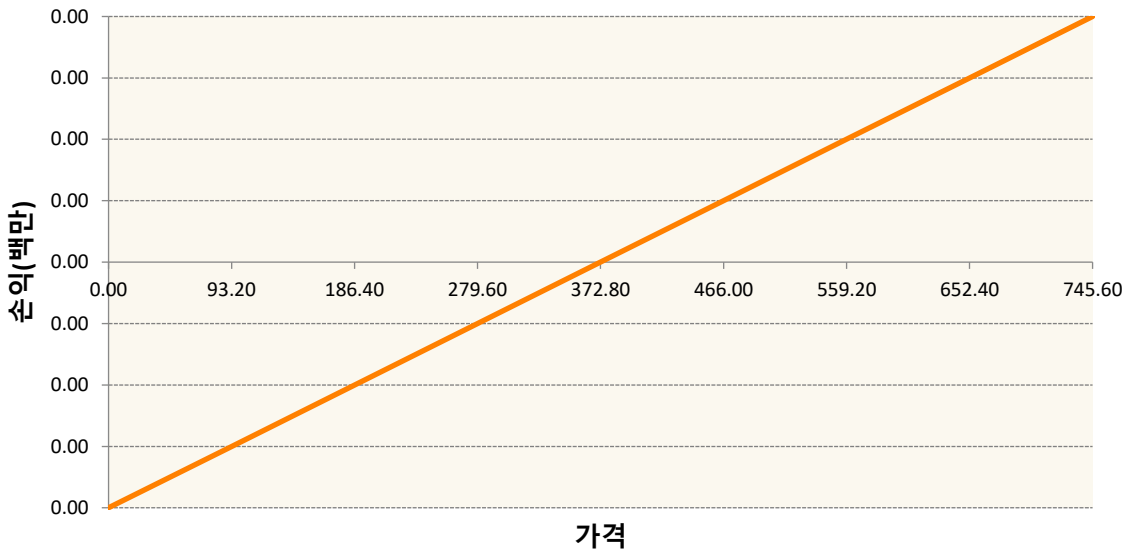
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,610	0	2,610	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101V60002-2024-06 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101V60002		2024-06 코스피200지수선물					207
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-207	-207	-207	-207	-207	-207	-207
-5.33%	-138	-138	-138	-138	-138	-138	-138
-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%	138	138	138	138	138	138	138
8.00%	207	207	207	207	207	207	207

공시일	2024-04-11
기준일	2024-04-09

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)

309

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2024-04-11
기준일	2024-04-09

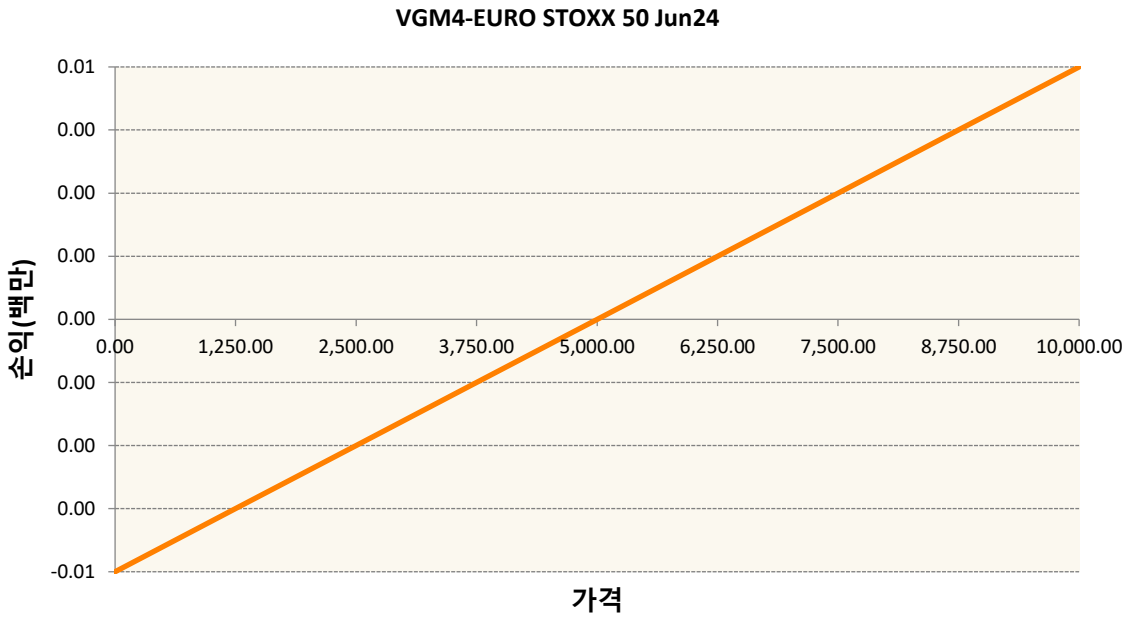
유로인덱스모(주식-파생형)

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	1,004	0	1,004	
누계	통화	선도	221	0	221	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	2024-04-11
기준일	2024-04-09

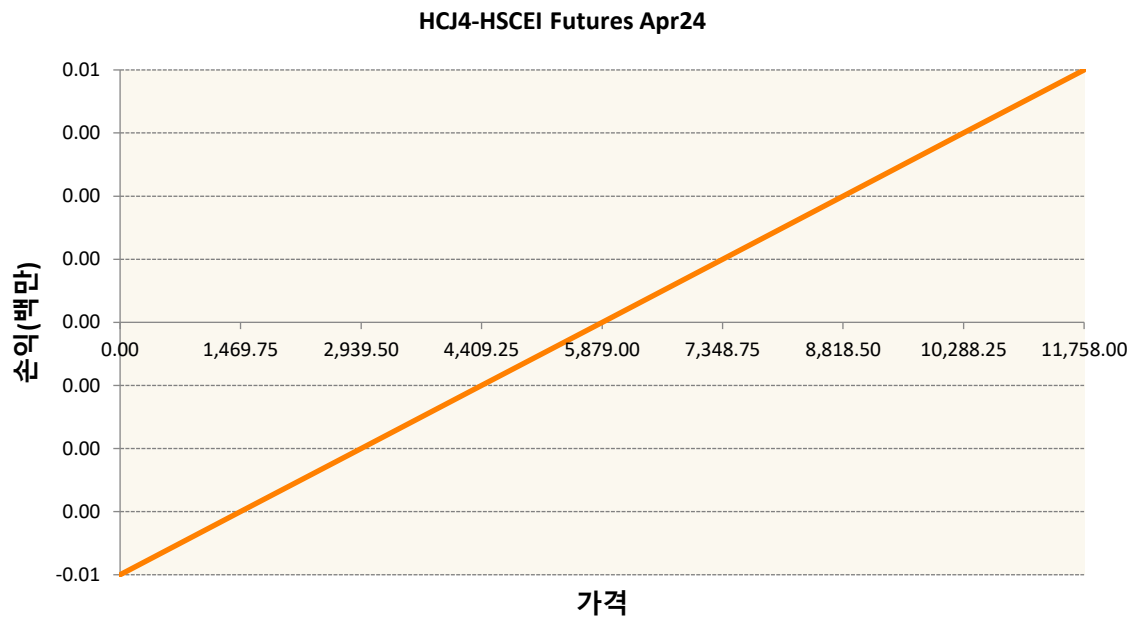
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,208	0	1,208	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

126

공시일	2024-04-11
기준일	2024-04-09

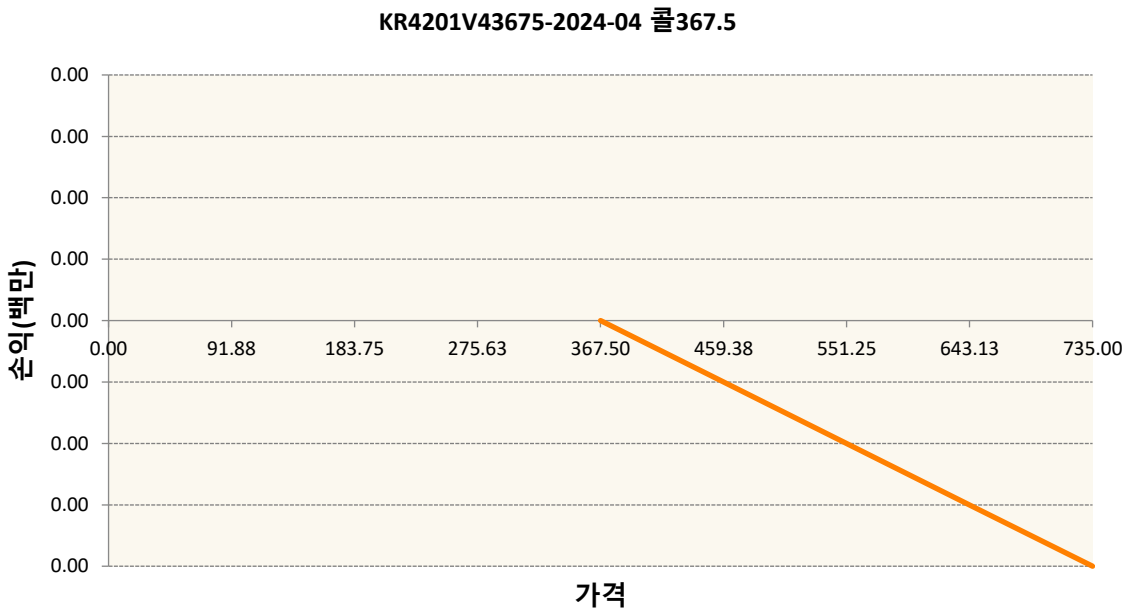
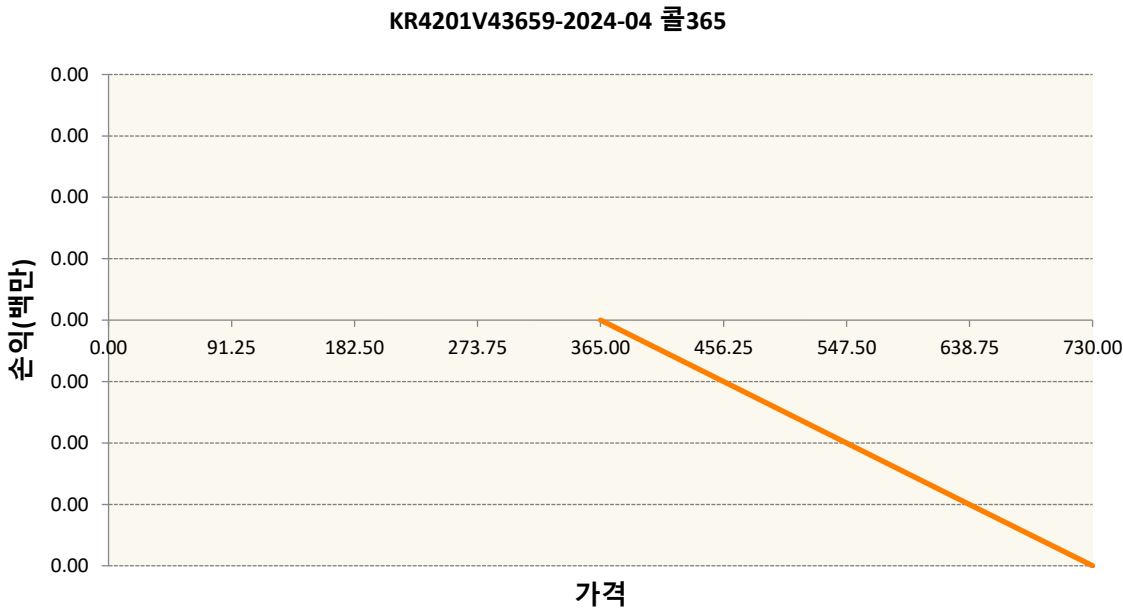
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

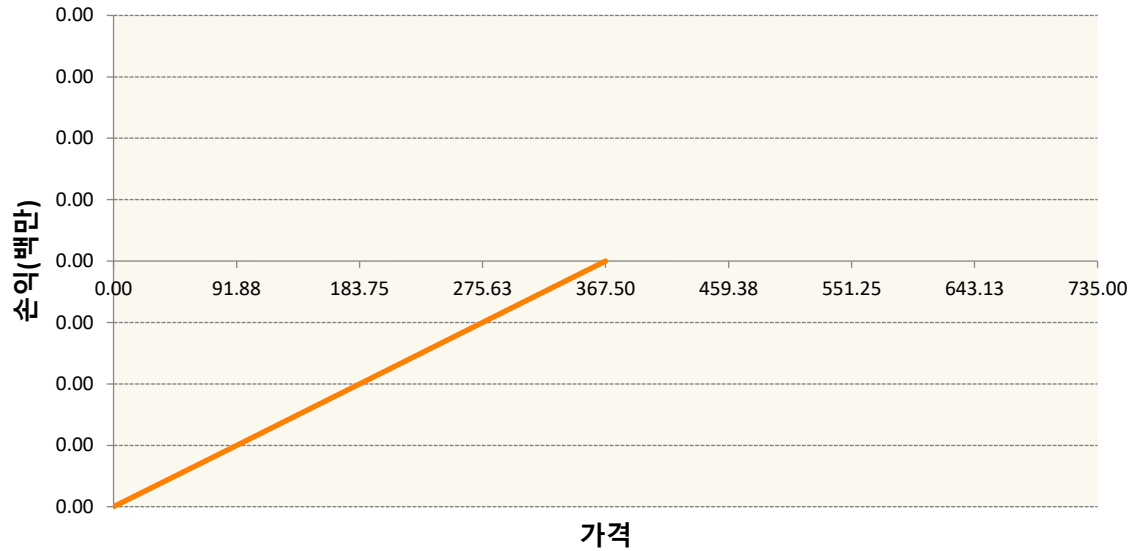
(단위:백만원)

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				1,193
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	230	230	230	230	230	230	230
-5.33%	230	230	230	230	230	230	230
-2.67%	223	220	216	212	208	203	198
0%	9	7	4	0	-4	-8	-13
2.67%	-388	-388	-388	-388	-388	-388	-389
5.33%	-790	-790	-790	-790	-790	-790	-790
8.00%	-1,193	-1,193	-1,193	-1,193	-1,193	-1,193	-1,193
KR4201V43675			2024-04 콜367.5				1,883
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	240	240	240	240	240	240	240
-5.33%	240	240	240	240	240	240	240
-2.67%	238	236	234	230	226	222	217
0%	26	18	9	0	-9	-19	-28
2.67%	-590	-590	-590	-590	-591	-592	-593
5.33%	-1,236	-1,236	-1,236	-1,236	-1,236	-1,236	-1,236
8.00%	-1,883	-1,883	-1,883	-1,883	-1,883	-1,883	-1,883
KR4301V43673			2024-04 풋367.5				584
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-584	-584	-584	-584	-584	-584	-584
-5.33%	-362	-362	-362	-362	-362	-362	-362
-2.67%	-140	-141	-142	-143	-144	-146	-148
0%	9	6	3	0	-3	-6	-10

2.67%	20	20	20	19	19	19	19
5.33%	20	20	20	20	20	20	20
8.00%	20	20	20	20	20	20	20

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

(단위:백만원)

5,197

공시일	2024-04-11
기준일	2024-04-09

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	1,744	0	1,744	

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	2024-04-11
기준일	2024-04-09

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	4,358	0	4,358	

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	2024-04-11
기준일	2024-04-09

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	15,874	0	15,874	
누계	통화	선도	0	15,697	-15,697	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)

578

공시일	2024-04-11
기준일	2024-04-09

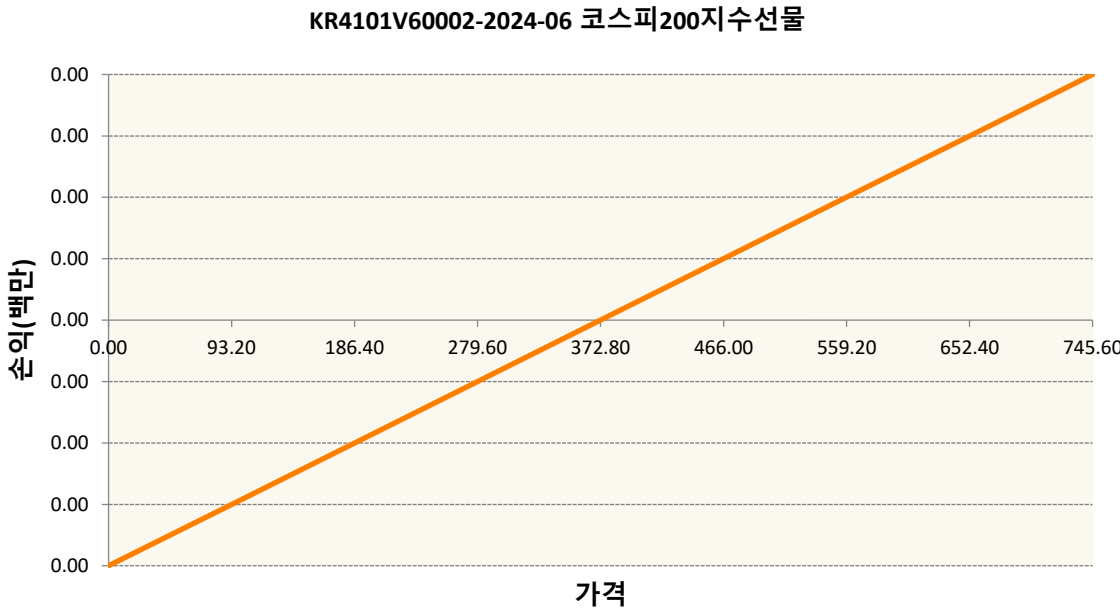
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

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	466	0	466	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	2024-04-11
기준일	2024-04-09

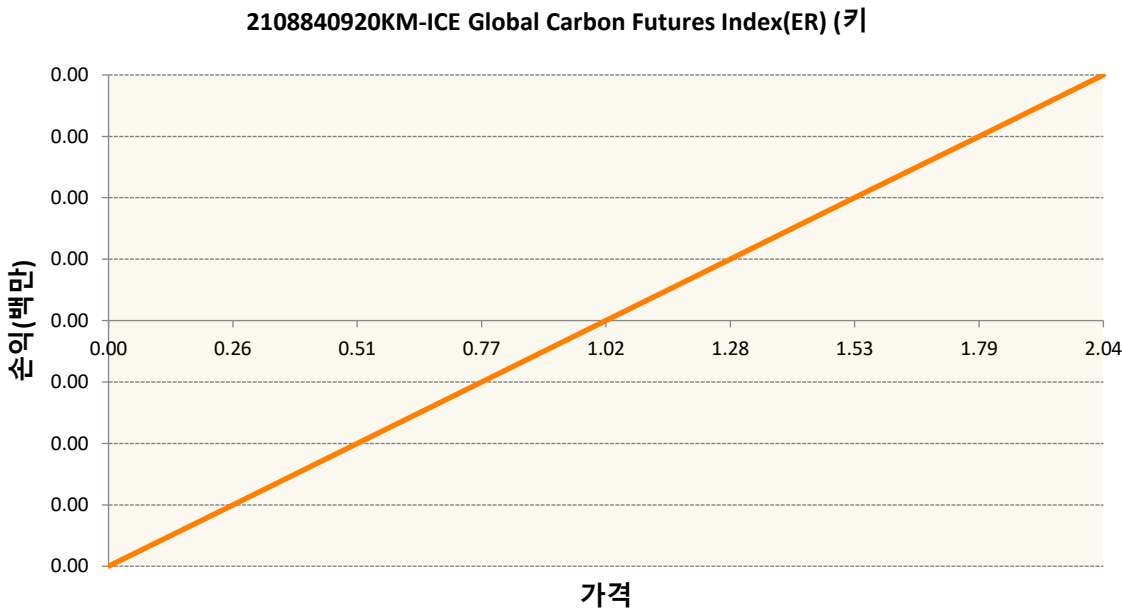
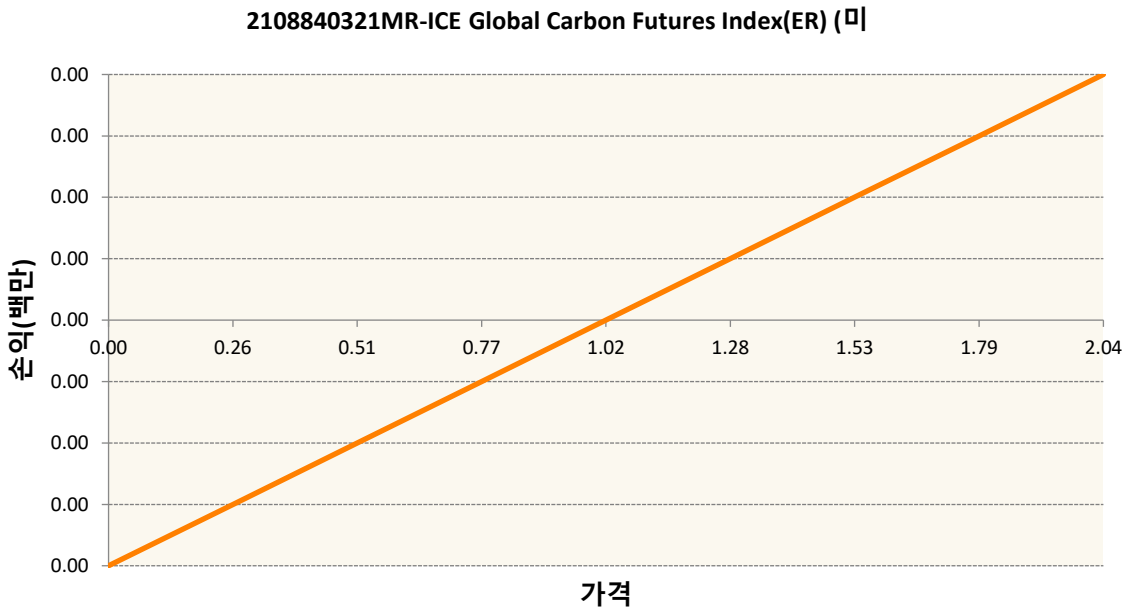
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

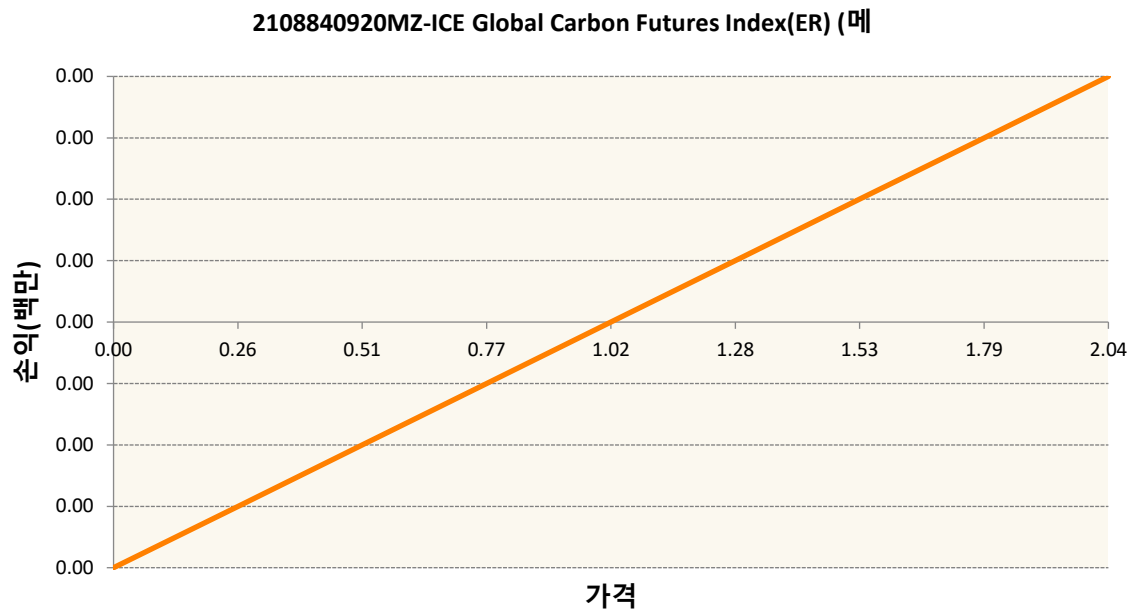
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	18,809	0	18,809	

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108840321IICE Global Carbon Futures Index(ER) (미		444
2108840920IICE Global Carbon Futures Index(ER) (키		889
2108840920IICE Global Carbon Futures Index(ER) (메		178

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)		(단위:백만원)
		1,738

공시일	2024-04-11
기준일	2024-04-09

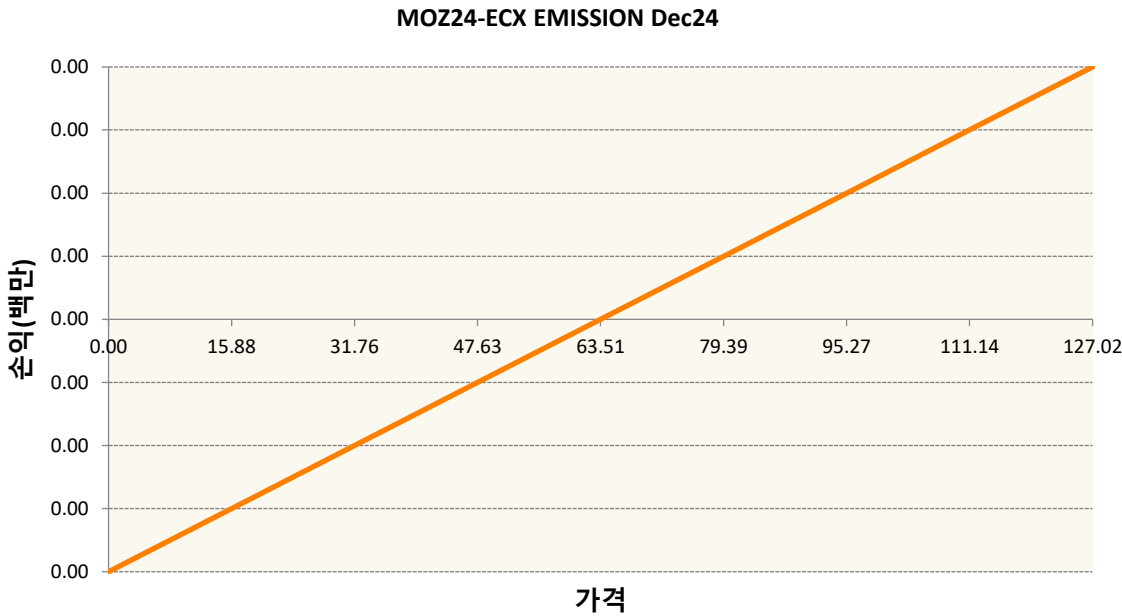
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	9,477	0	9,477	
누계	지수	스왑	331	0	331	장외
누계	통화	선도	0	2,610	-2,610	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	758
SWICEUACN ICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX	1

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

(단위:백만원)

1,444

공시일	2024-04-11
기준일	2024-04-09

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)	7
SWCSI00000 신한CSI Index 230622 (메리츠)	7
SWCSI00000 신한CSI Index 230922 (키움)	4
SWCSI00000 신한CSI Index 231013 (NH)	4

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

(단위:백만원)

31

공시일	2024-04-11
기준일	2024-04-09

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)	12
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(NH)	11
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(메리츠)	15
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(키움)	3

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

(단위:백만원)

45

공시일	2024-04-11
기준일	2024-04-09

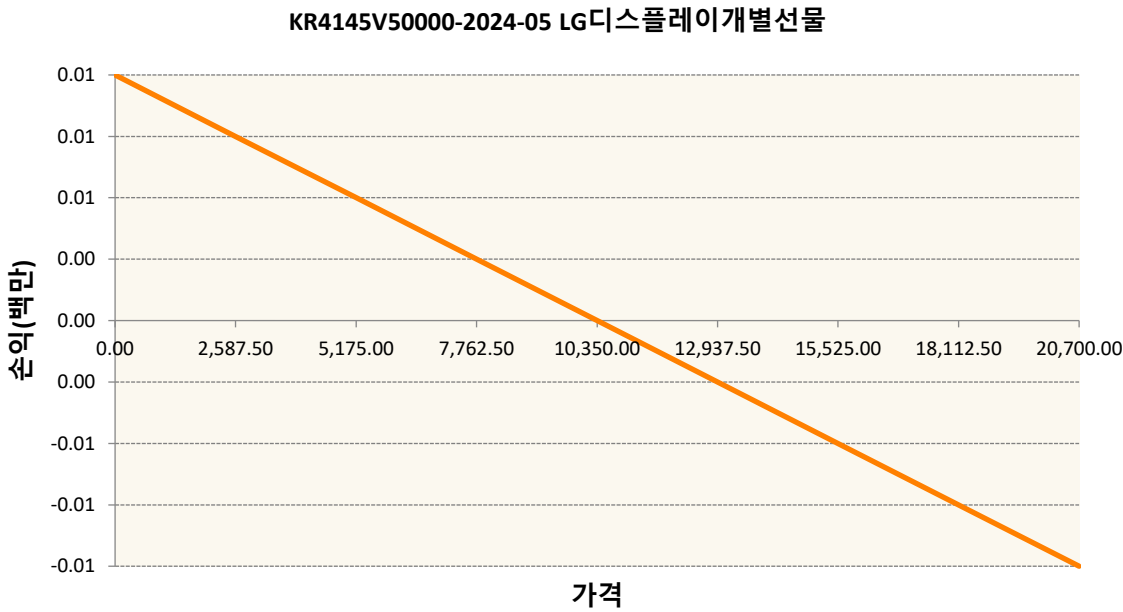
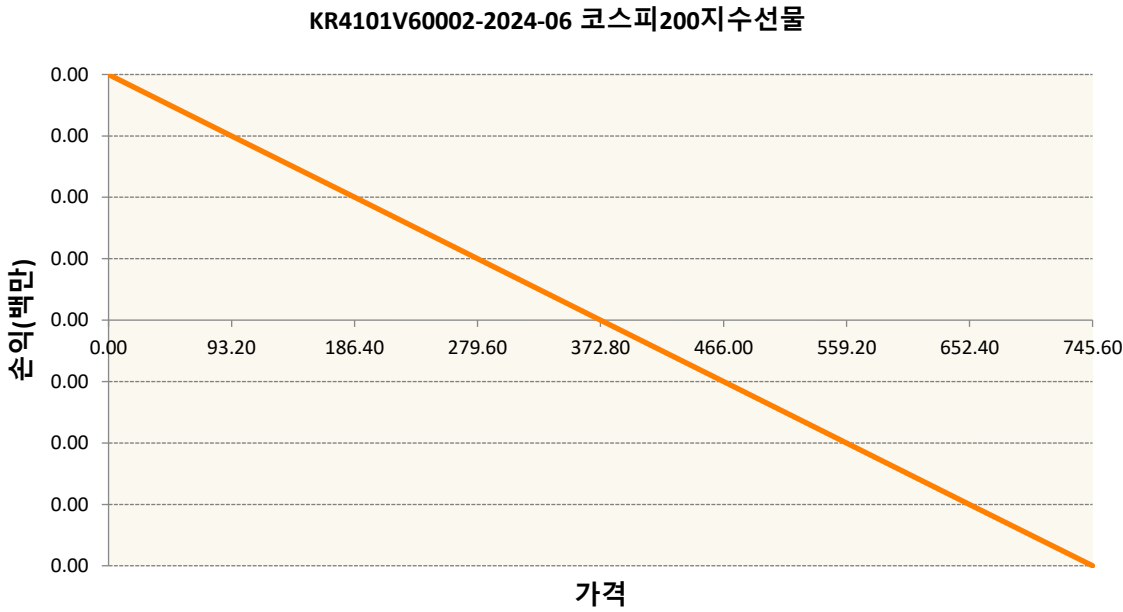
에퀴티알파일반사모혼합자산

1. 계약금액

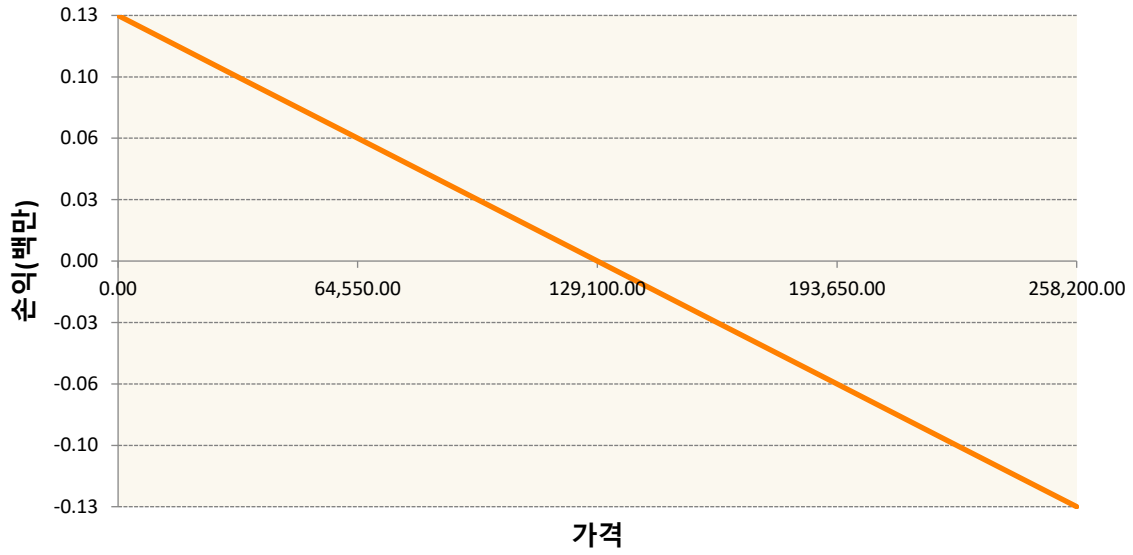
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	21	698	-677	장내

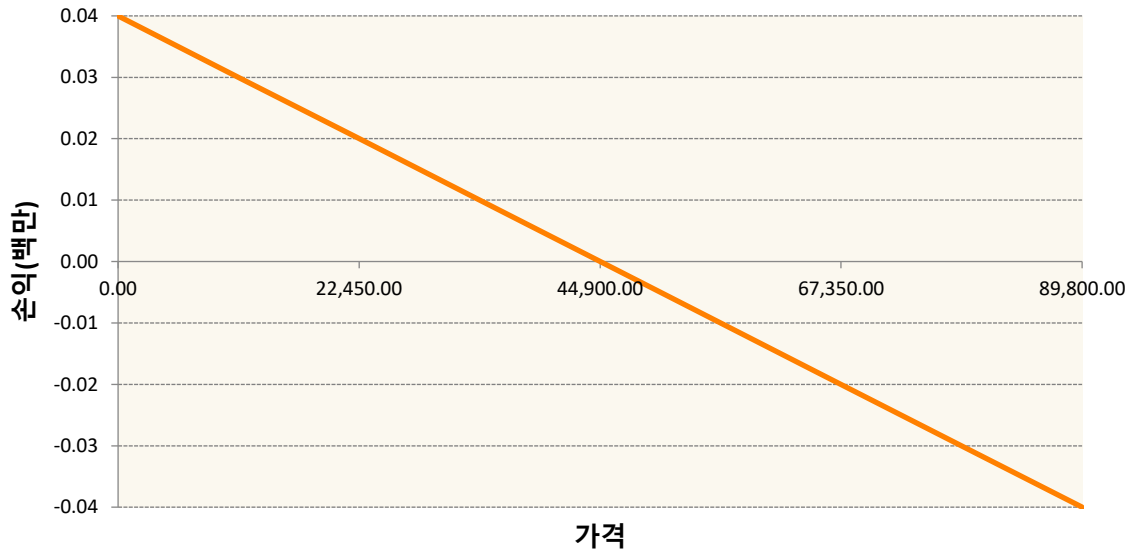
2. 만기시점의 손익구조



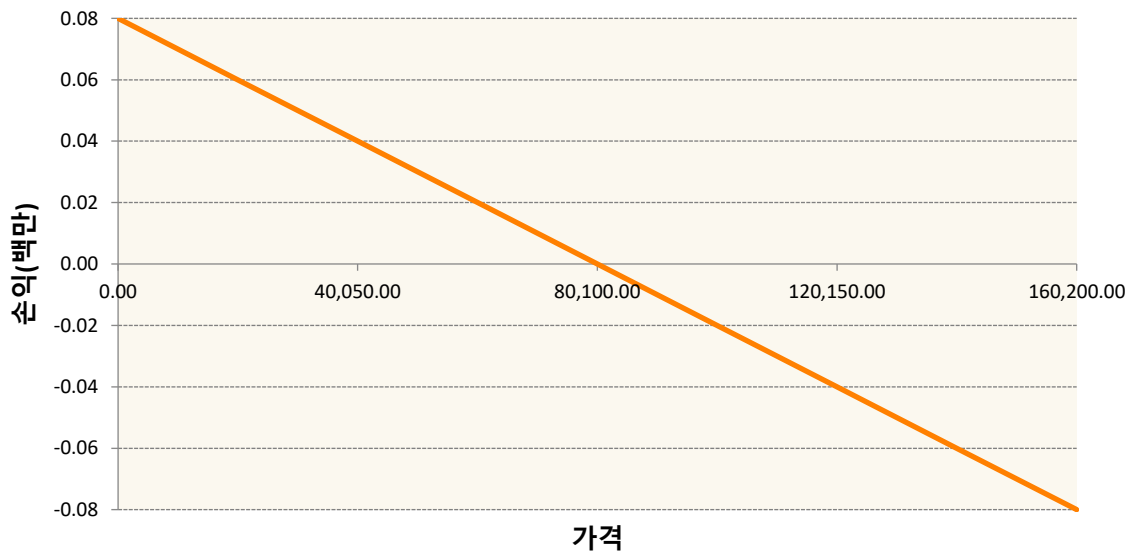
KR41C6V40000-2024-04 아모레퍼시픽개별선물



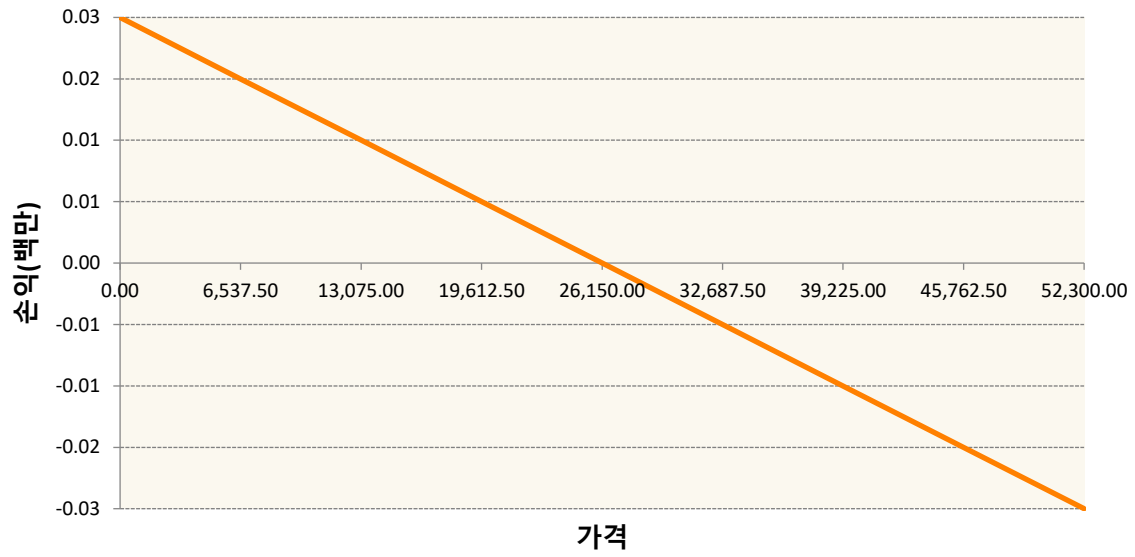
KR41CNV40003-2024-04 포스코DX개별선물



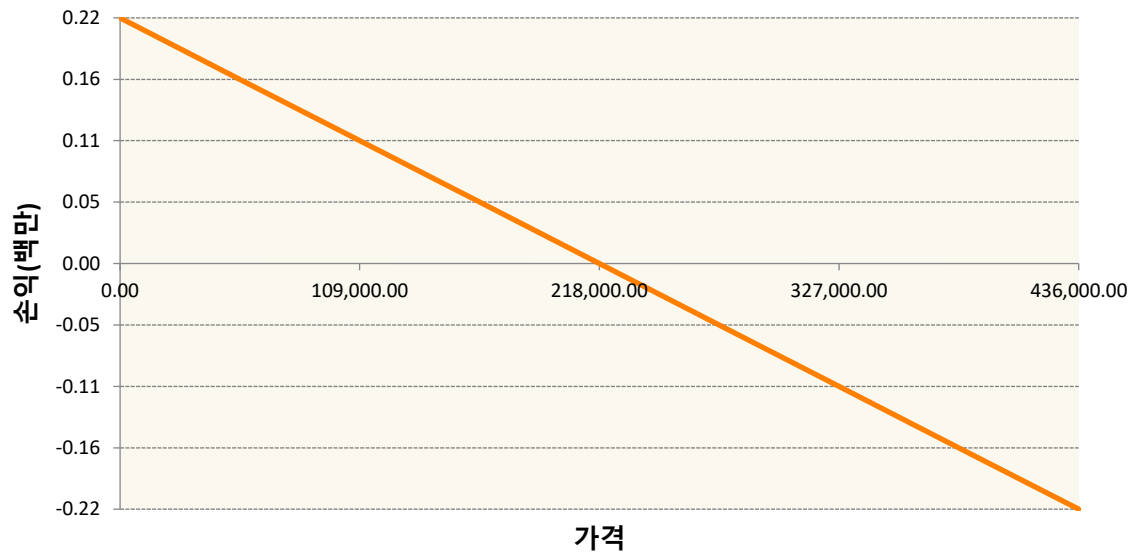
KR41E4V40003-2024-04 에스엠개별선물



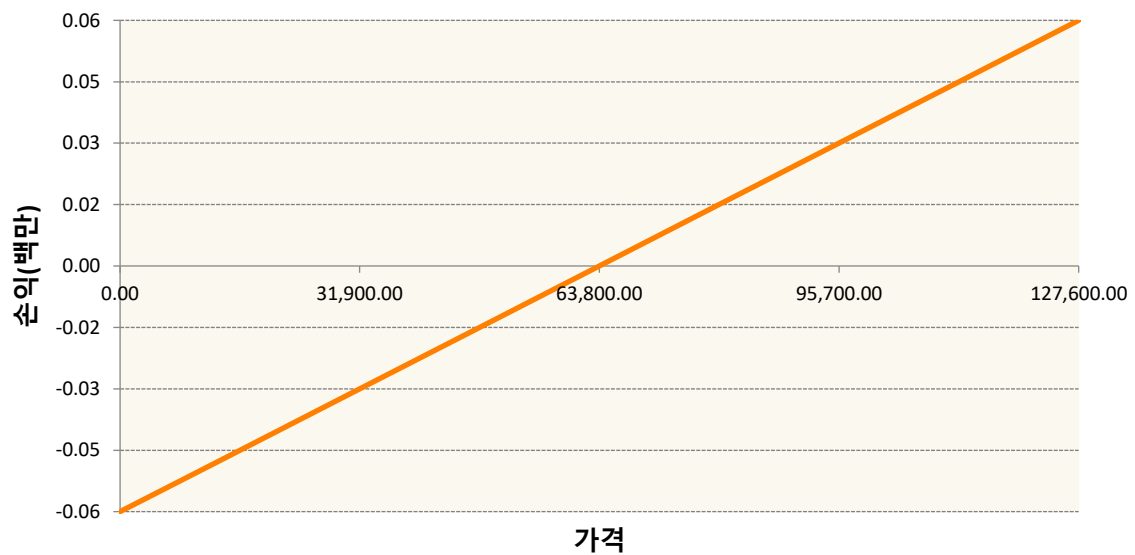
KR41F6V40007-2024-04 카카오뱅크개별선물



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		0.06
KR41F6V400 2024-04 카카오뱅크개별선물		2
KR41FCV400 2024-04 하이브개별선물		3
KR41G9V40C 2024-04 레고캠바이오개별선물		2

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	78

공시일	2024-04-11
기준일	2024-04-09

코리아인덱스(주식-파생형)(종)

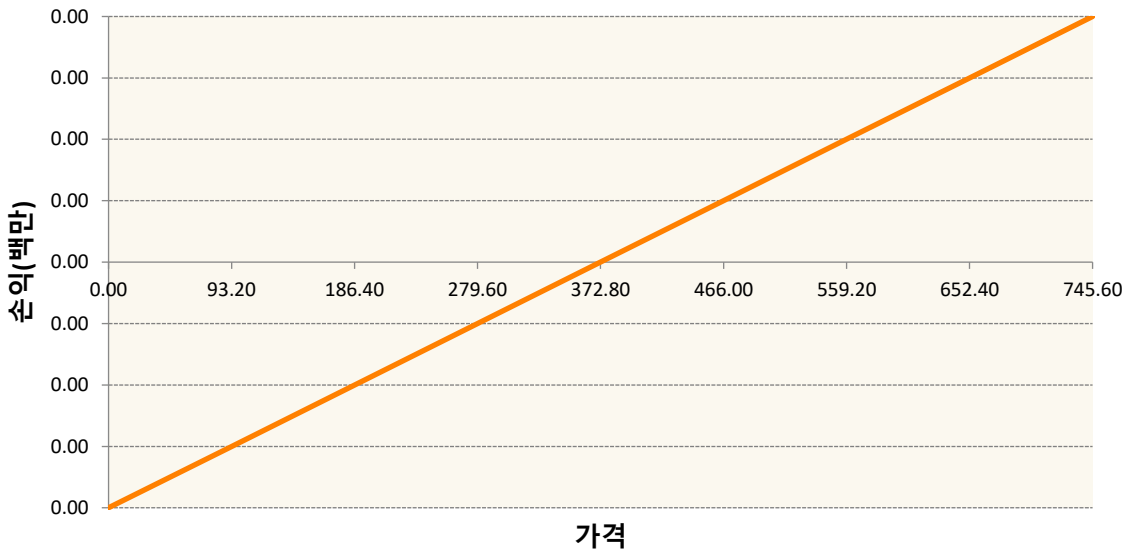
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,982	0	2,982	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101V60002-2024-06 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101V60002		2024-06 코스피200지수선물					237
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-237	-237	-237	-237	-237	-237	-237
-5.33%	-158	-158	-158	-158	-158	-158	-158
-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%	158	158	158	158	158	158	158
8.00%	237	237	237	237	237	237	237

공시일	2024-04-11
기준일	2024-04-09

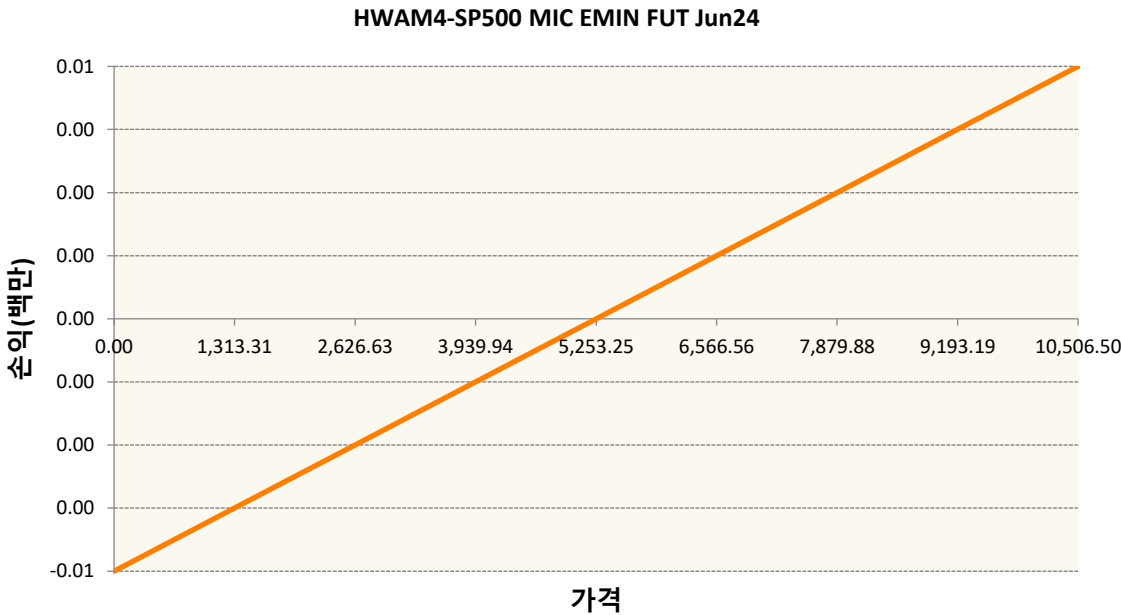
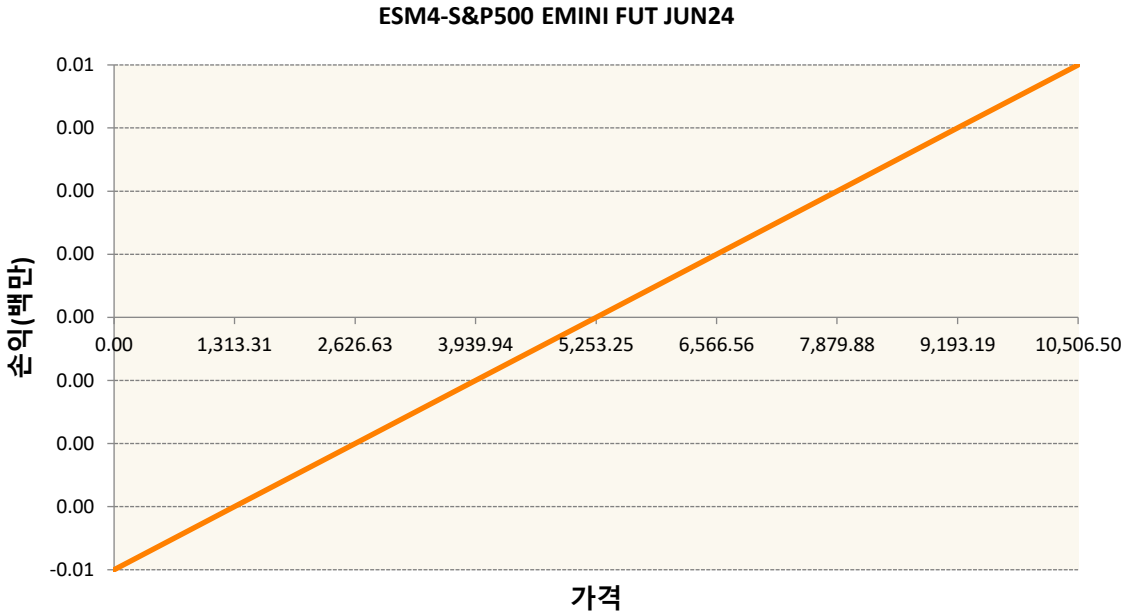
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

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	2024-04-11
기준일	2024-04-09

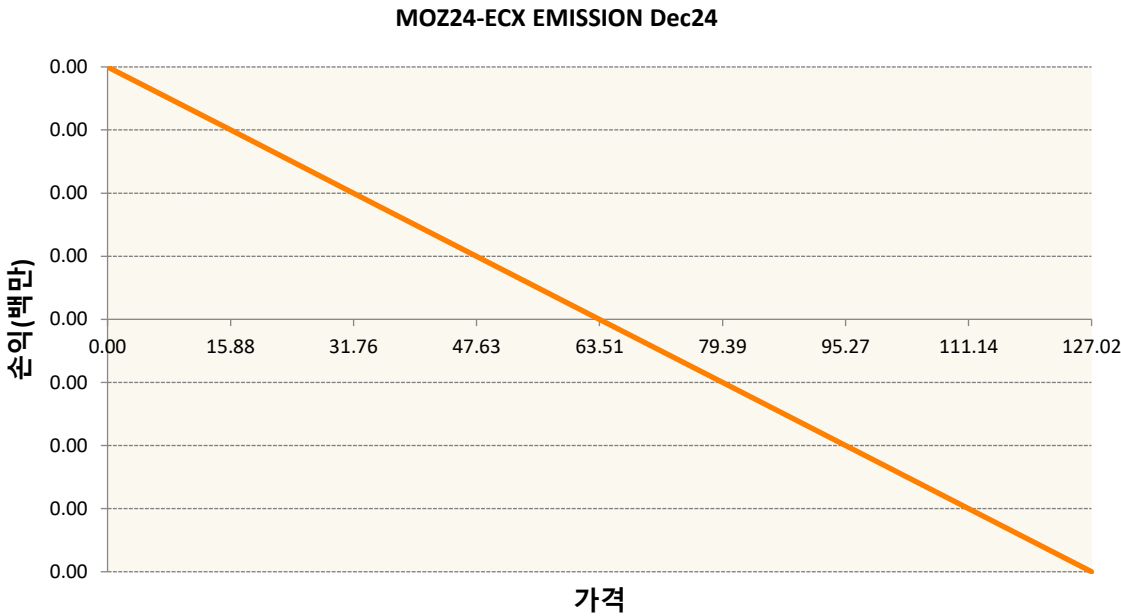
SOL유럽탄소배출권선물인버스ICE특별자산상

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	5,105	-5,105	
누계	지수	스왑	331	0	331	장외
누계	통화	선도	0	1,115	-1,115	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213E3SC KRW/EUR 30-04-24E	89
MOZ24 ECX EMISSION Dec24	408
SWICEUACN ICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX	1

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

(단위:백만원)

765

공시일	2024-04-11
기준일	2024-04-09

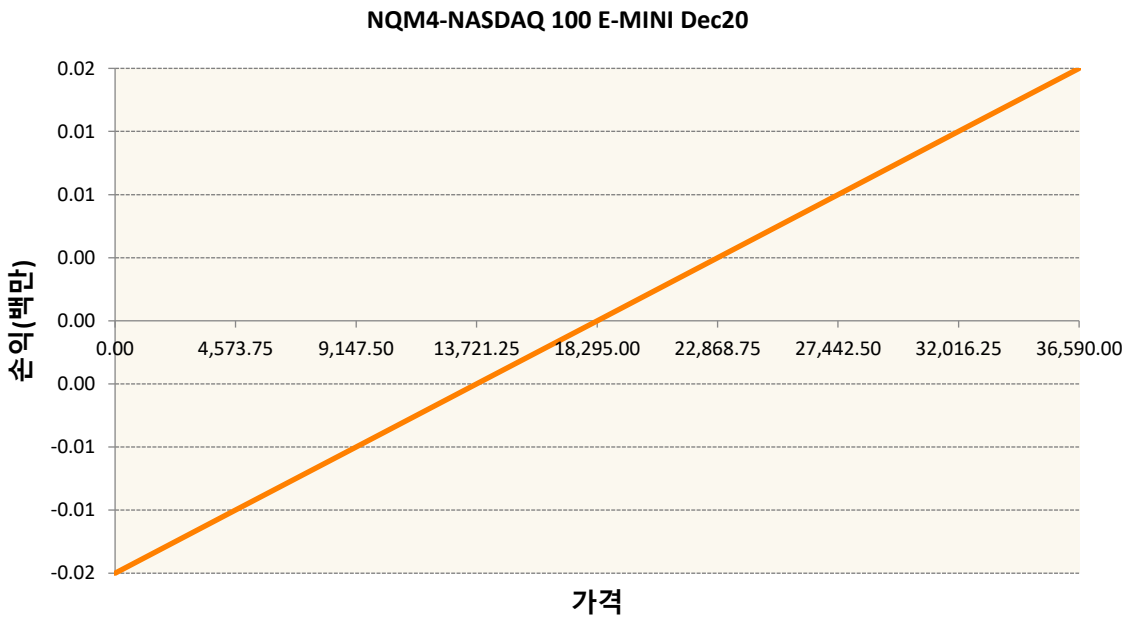
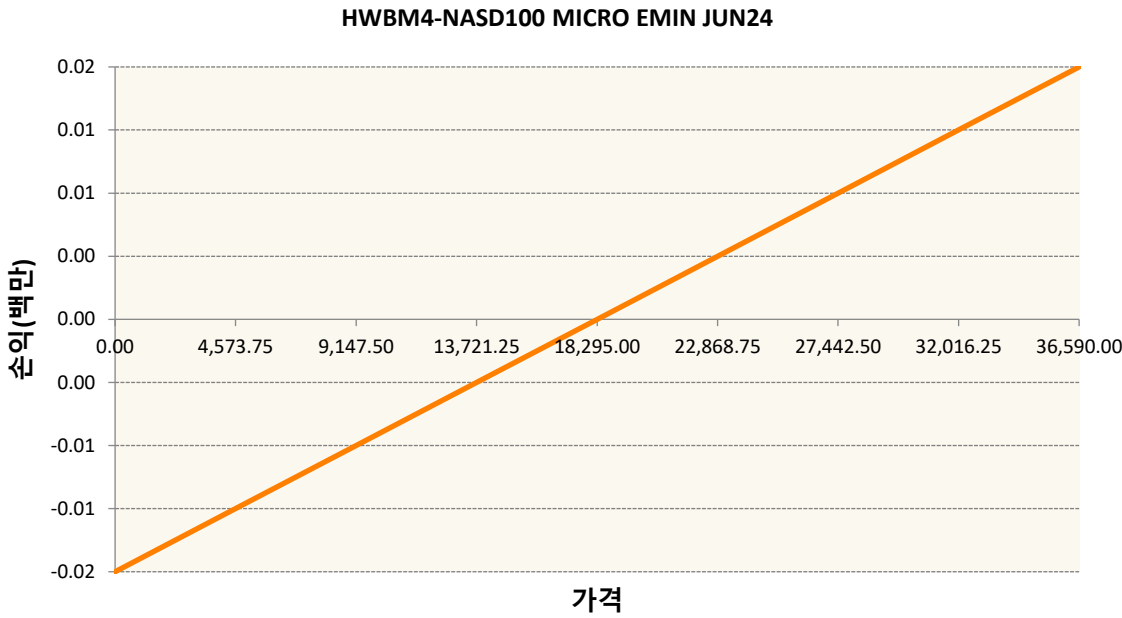
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

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	2,463	0	2,463	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)
			326

공시일	2024-04-11
기준일	2024-04-09

SOL미국30년국채커버드콜(합성)

1. 계약금액 (단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	87,318	0	87,318	장외
누계	지수	스왑	125,052	0	125,052	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	1,608
SWKEDI0000 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	947
SWKEDI0000 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	6,994

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	6,220

공시일	2024-04-11
기준일	2024-04-09

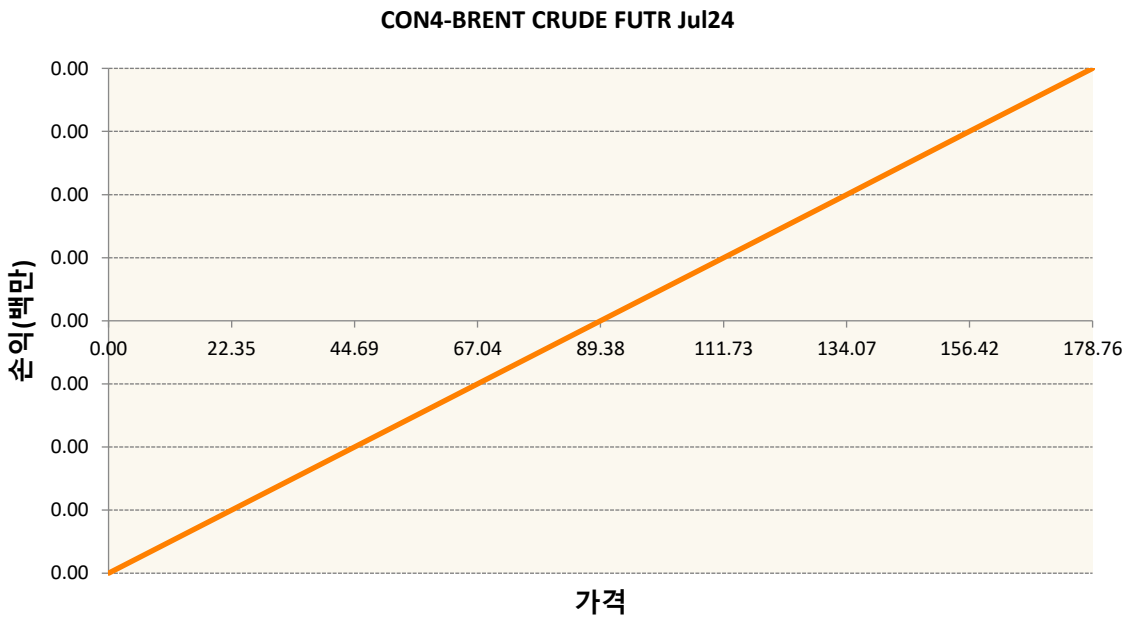
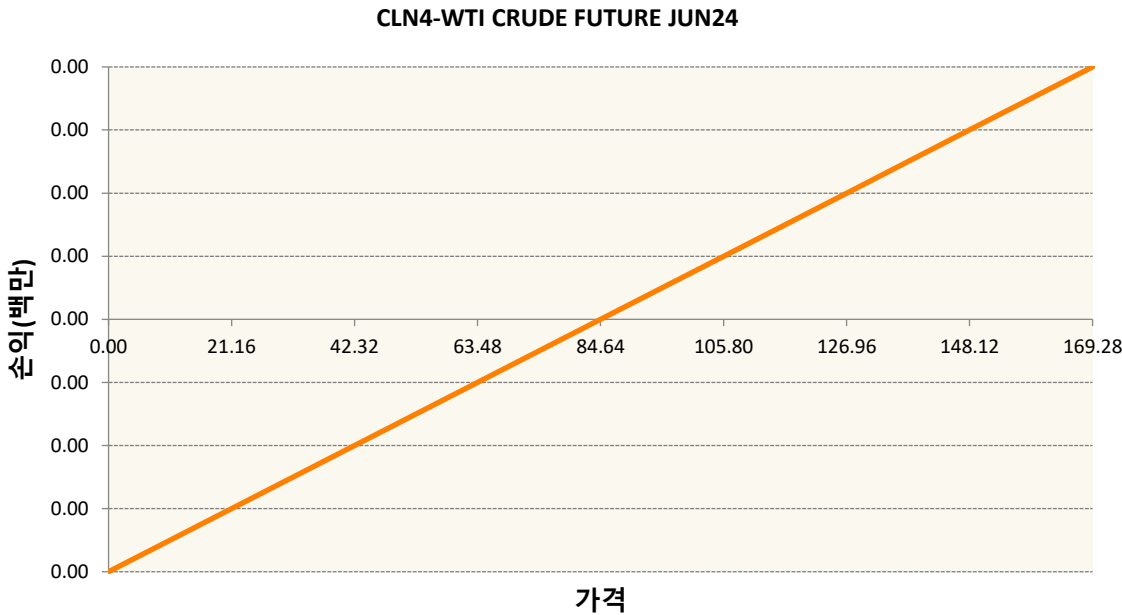
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

1. 계약금액

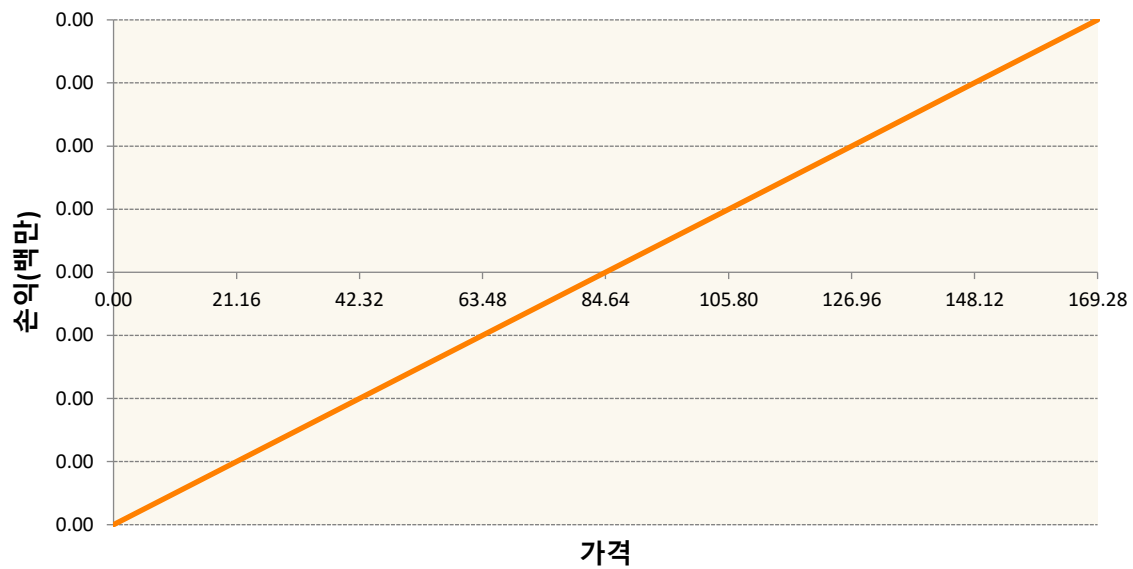
(단위:백만원)

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	1,221	0	1,221	
누계	통화	선물	0	244	-244	장내

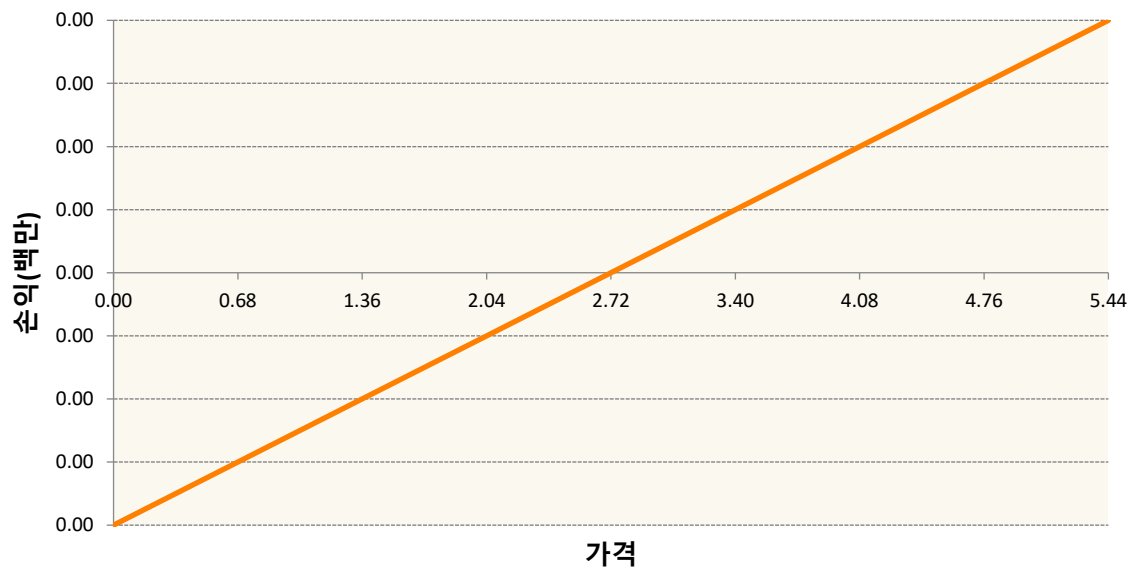
2. 만기시점의 손익구조



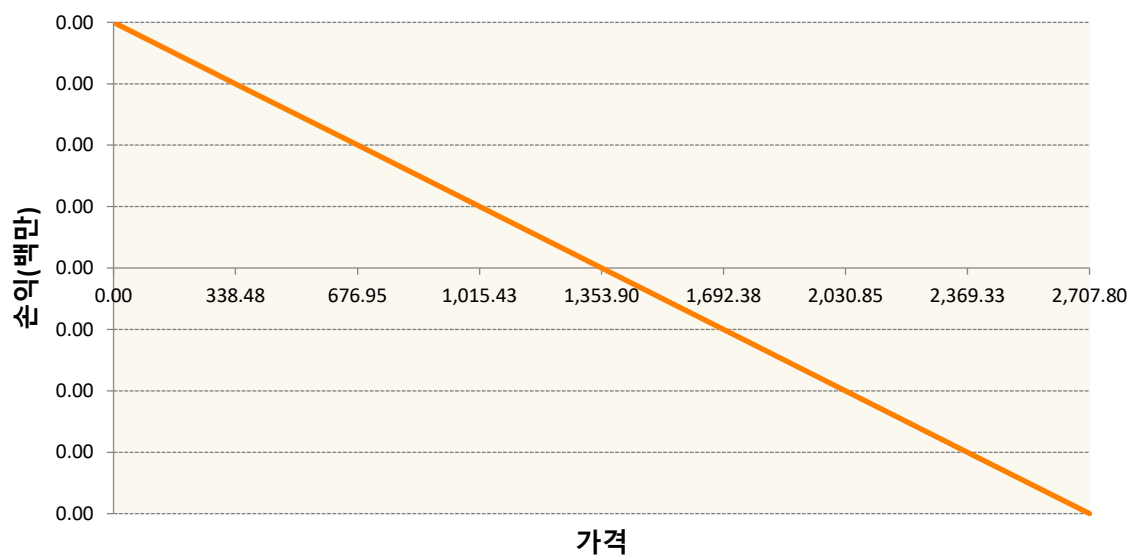
ECN4-E-mini Crude Oil Jul24



HON4-NY Harb ULSD Fut Jul24



KR4175V40008-2024-04 달러선물



The graph illustrates the relationship between price and profit. The x-axis is labeled '가격' (Price) and ranges from 0.00 to 4.78. The y-axis is labeled '이익(백만)' (Profit in millions) and ranges from 0.00 to 0.00. A blue line starts at (0.00, 0.00) and increases linearly to (4.78, 0.00).

가격 (Price)	이익 (Profit in millions)
0.00	0.00
0.60	0.00
1.20	0.00
1.79	0.00
2.39	0.00
2.99	0.00
3.59	0.00
4.18	0.00
4.78	0.00

The graph illustrates a linear relationship between Price (가격) and Net Income (순이익 (백만)). The x-axis represents Price, ranging from 0.00 to 1,653.50. The y-axis represents Net Income in millions, ranging from 0.00 to 0.00. A solid blue line shows the relationship, starting at the origin (0, 0) and ending at (1,653.50, 0.00).

가격	순이익 (백만)
0.00	0.00
206.69	0.00
413.38	0.00
620.06	0.00
826.75	0.00
1,033.44	0.00
1,240.13	0.00
1,446.81	0.00
1,653.50	0.00

The graph illustrates a linear relationship between price and net income. The x-axis, labeled '가격' (Price), ranges from 0.00 to 5.40. The y-axis, labeled '순이익(백만)' (Net Income in millions), ranges from 0.00 to 0.00. A solid orange line represents the relationship, starting at (0.00, 0.00) and ending at (5.40, 0.00).

가격	순이익(백만)
0.00	0.00
0.68	0.00
1.35	0.00
2.03	0.00
2.70	0.00
3.38	0.00
4.05	0.00
4.73	0.00
5.40	0.00

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLN4	WTI CRUDE FUTURE JUN24	18
CON4	BRENT CRUDE FUTR Jul24	28
ECN4	E-mini Crude Oil JUL24	5
HON4	NY Harb ULSD Fut Jul24	12
KR4175V400 2024-04 달러선물		19
NGN24	NATURAL GAS FUTR JUL24	13
QSN4	Low Su Gasoil G JUL24	9
XBN4	GASOLINE RBOB FUT JUL24	12

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

212