

공시일	2024-04-12
기준일	2024-04-11

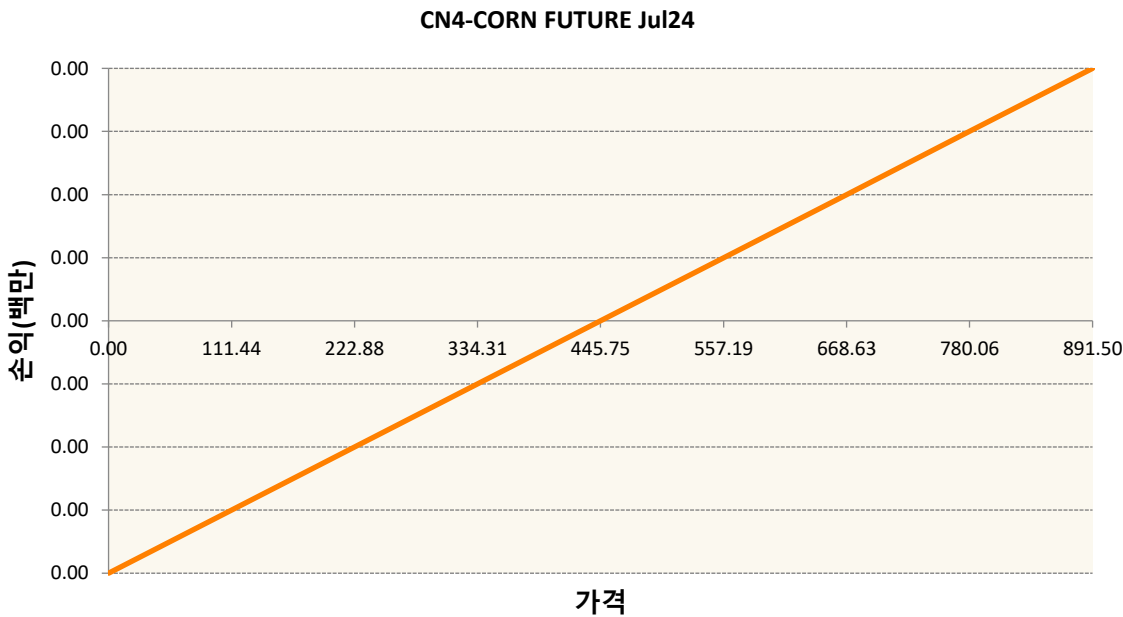
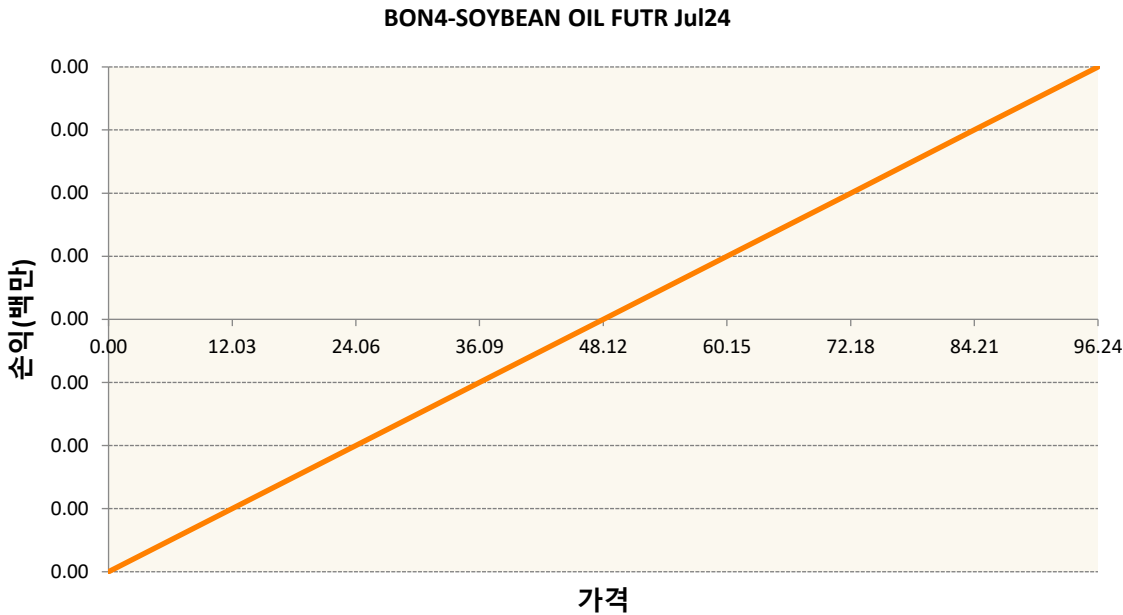
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

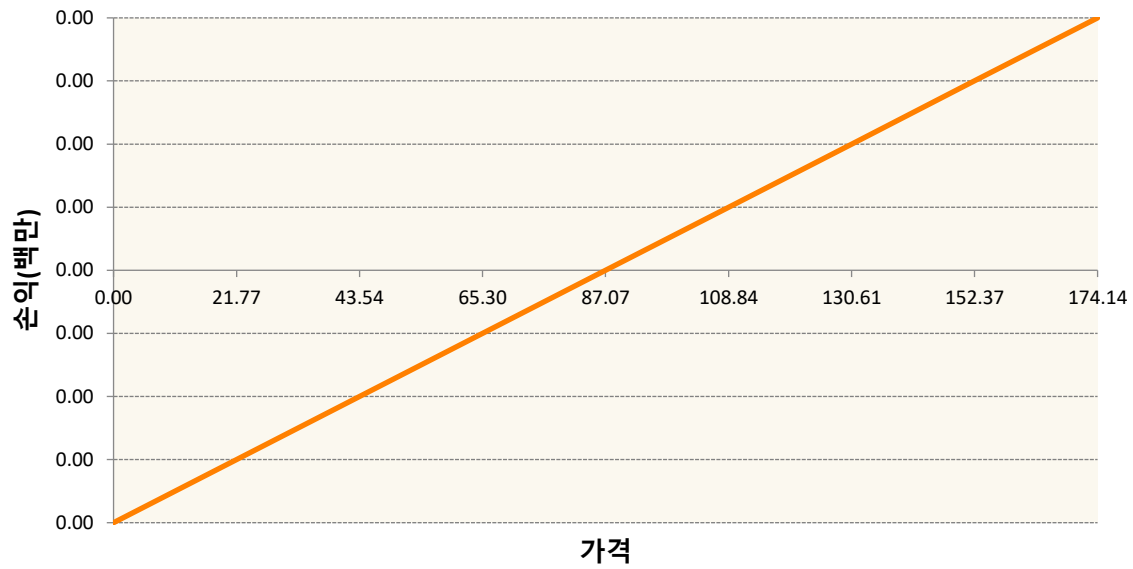
(단위:USD 백만)

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	4,335	0	4,335	
누계	통화	선물	0	532	-532	장내

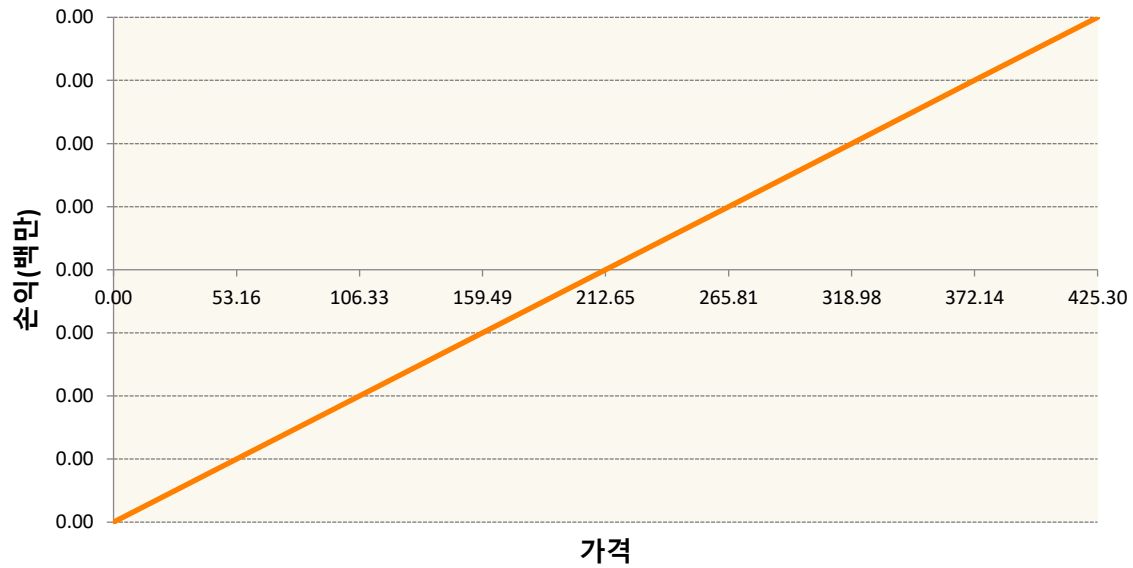
2. 만기시점의 손익구조



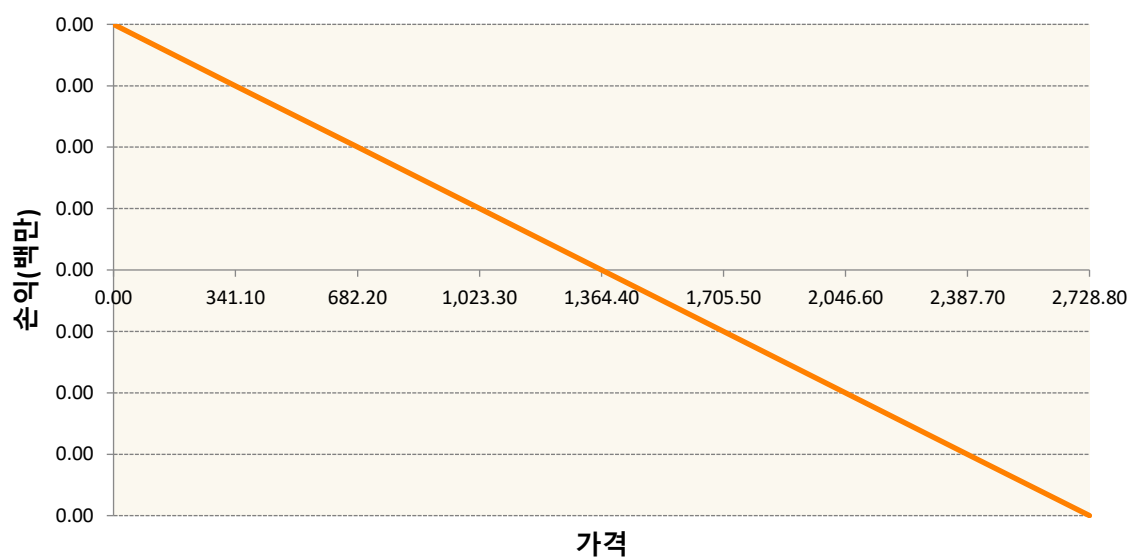
CTN4-COTTON NO.2 FUTR Jul24



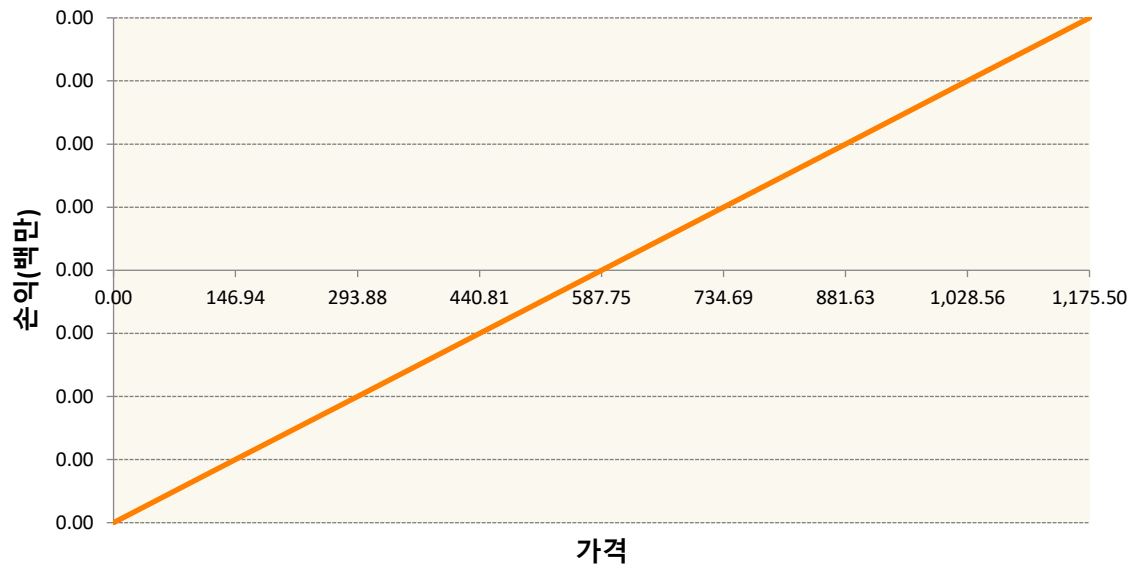
KCN4-COFFEE 'C' FUTURE Jul24



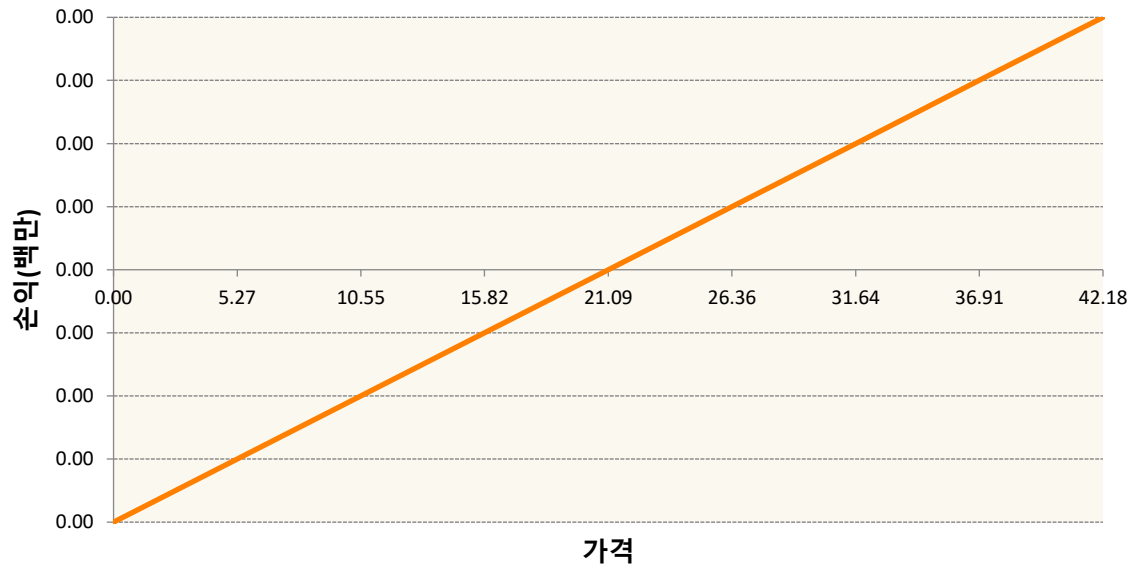
KR4175V40008-2024-04 달러선물



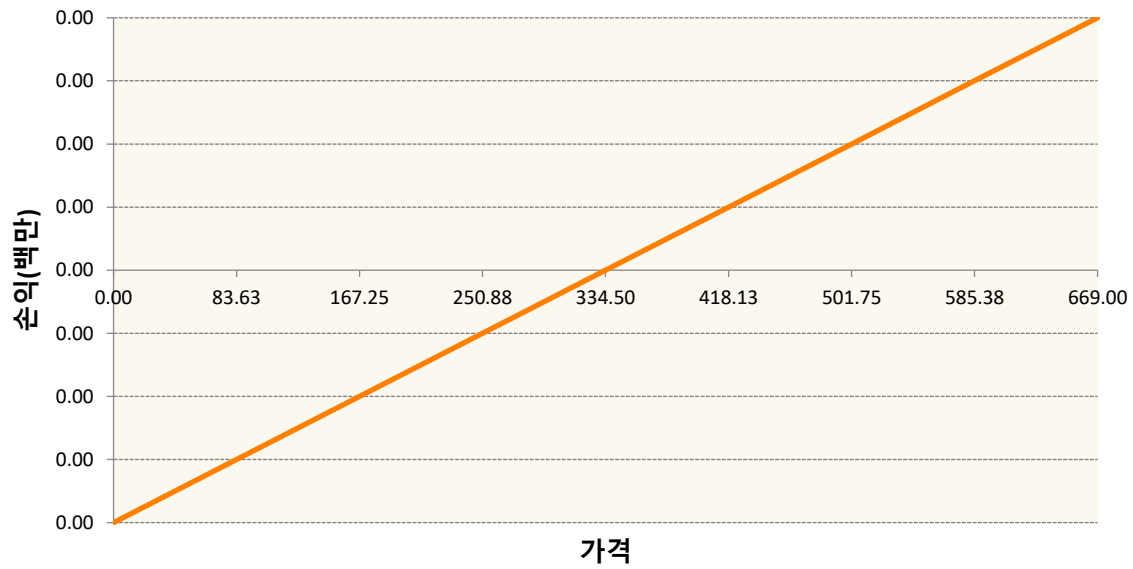
KWN4-KC HRW WHEAT FUT Jul24

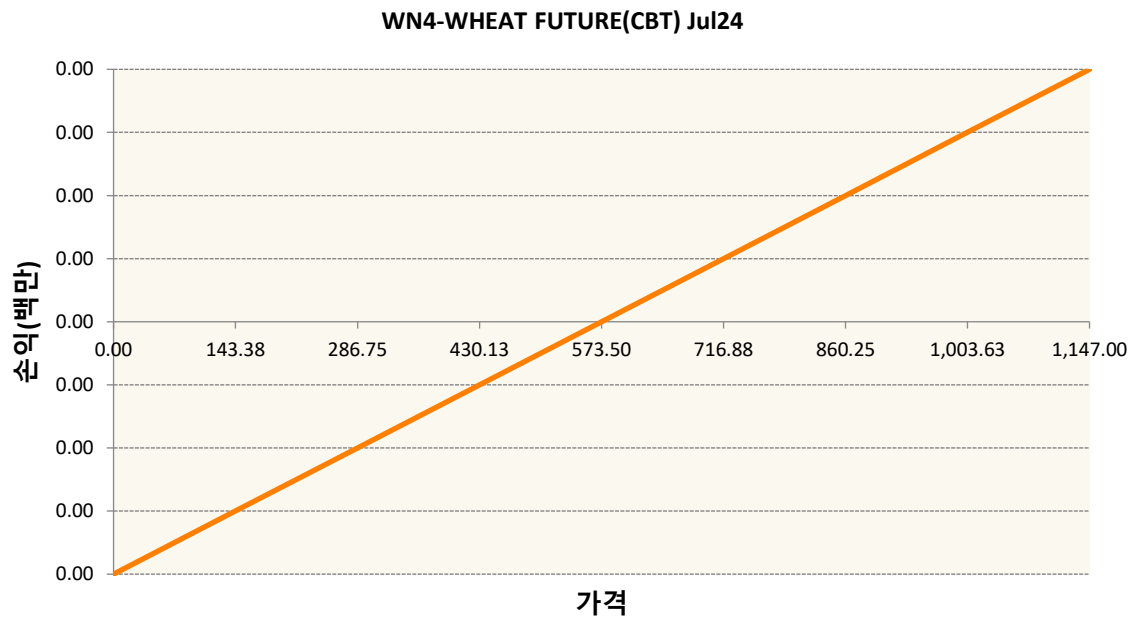
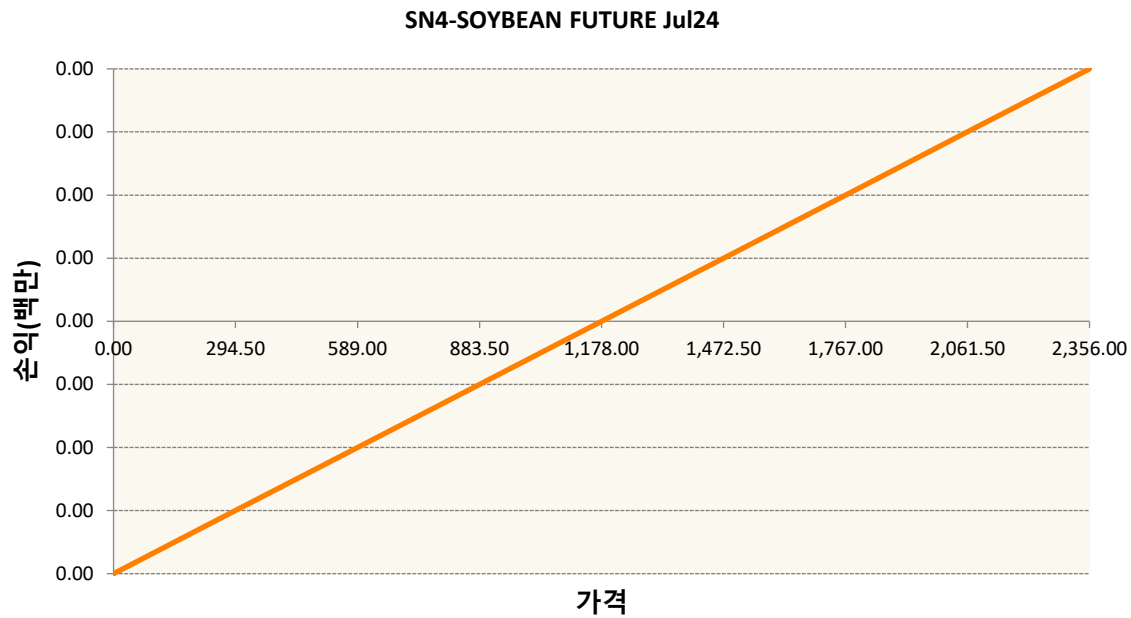


SBN4-Sugar #11 (WORLD) Jul24



SMN4-SOYBEAN MEAL FUTR Jul24





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

공시일	2024-04-12
기준일	2024-04-11

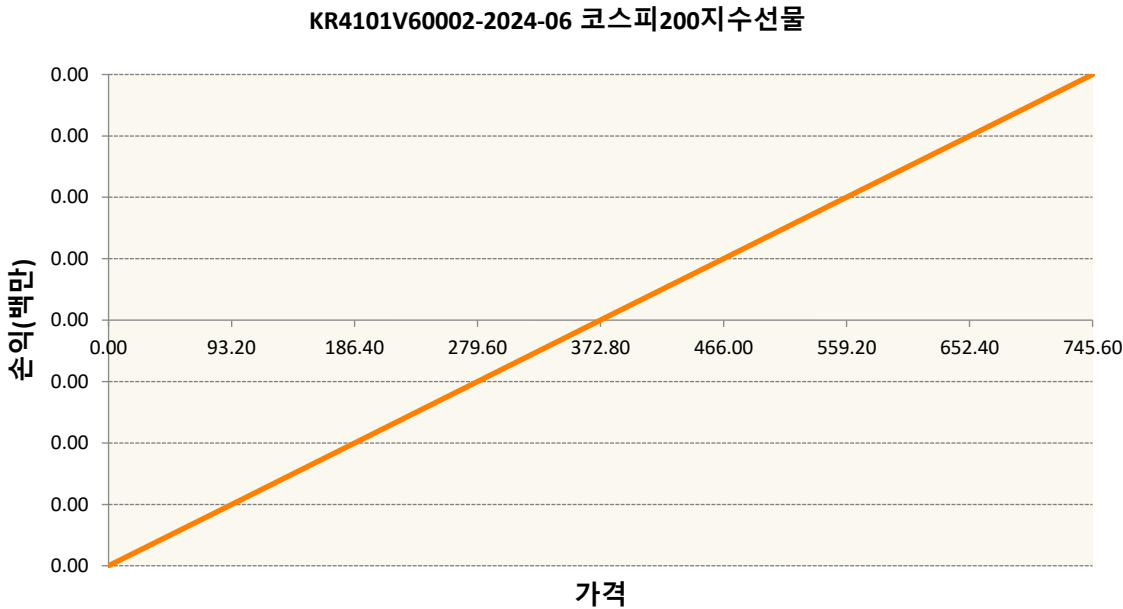
스마트인덱스모

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	1,025	-1,025	장내
누계	유가증권	선물	1,584	0	1,584	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101V60002		2024-06 코스피200지수선물					126
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-126	-126	-126	-126	-126	-126	-126
-5.33%	-84	-84	-84	-84	-84	-84	-84
-2.67%	-42	-42	-42	-42	-42	-42	-42
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	42	42	42	42	42	42	42
5.33%	84	84	84	84	84	84	84
8.00%	126	126	126	126	126	126	126

공시일	2024-04-12
기준일	2024-04-11

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	262
-----------------------------	-----

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

308

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2024-04-12
기준일	2024-04-11

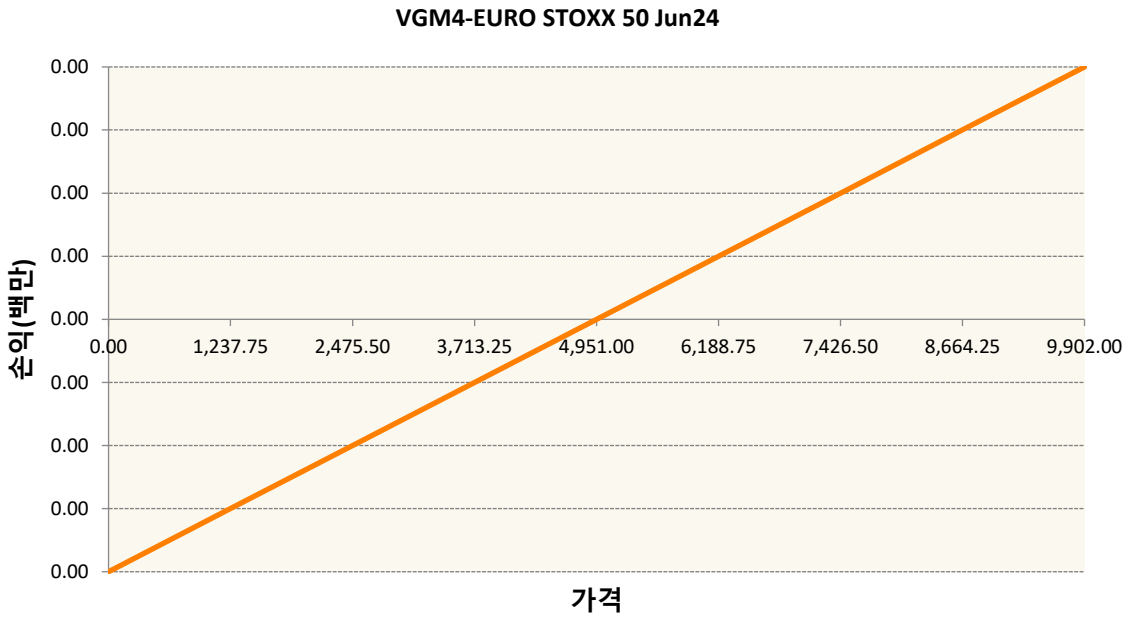
유로인덱스모(주식-파생형)

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	994	0	994	
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)

65

공시일	2024-04-12
기준일	2024-04-11

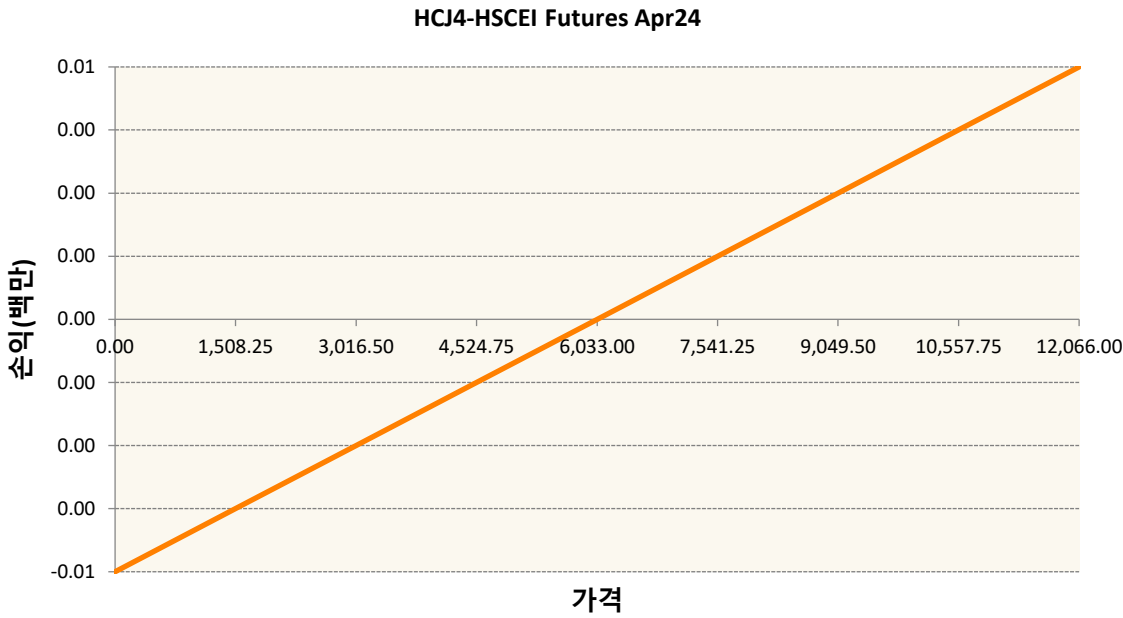
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,240	0	1,240	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCI4	HSCEI Futures Apr24	99
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

129

공시일	2024-04-12
기준일	2024-04-11

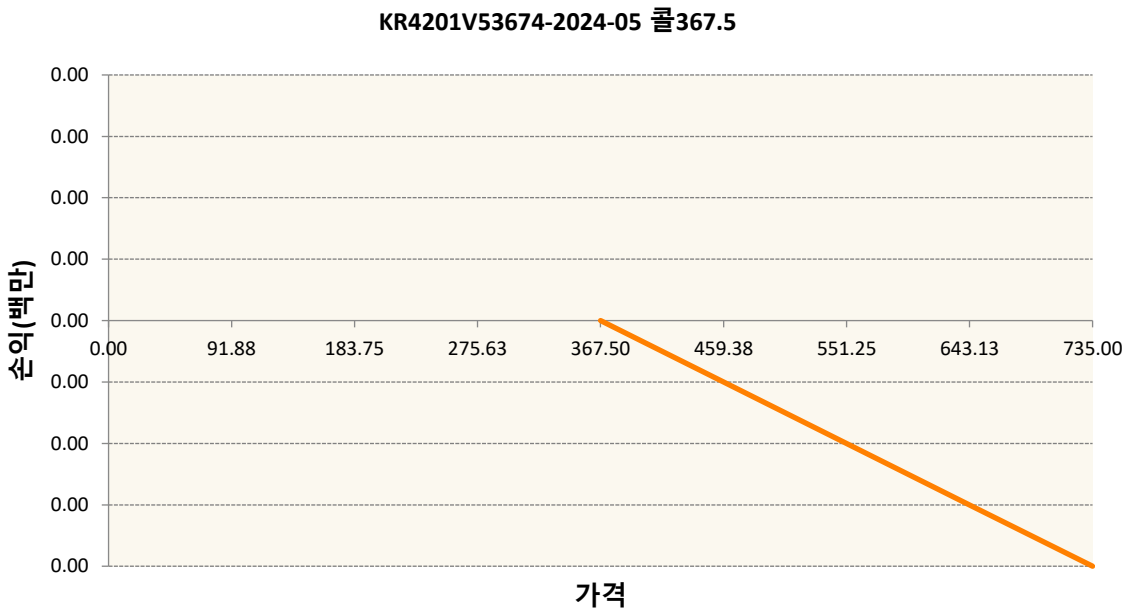
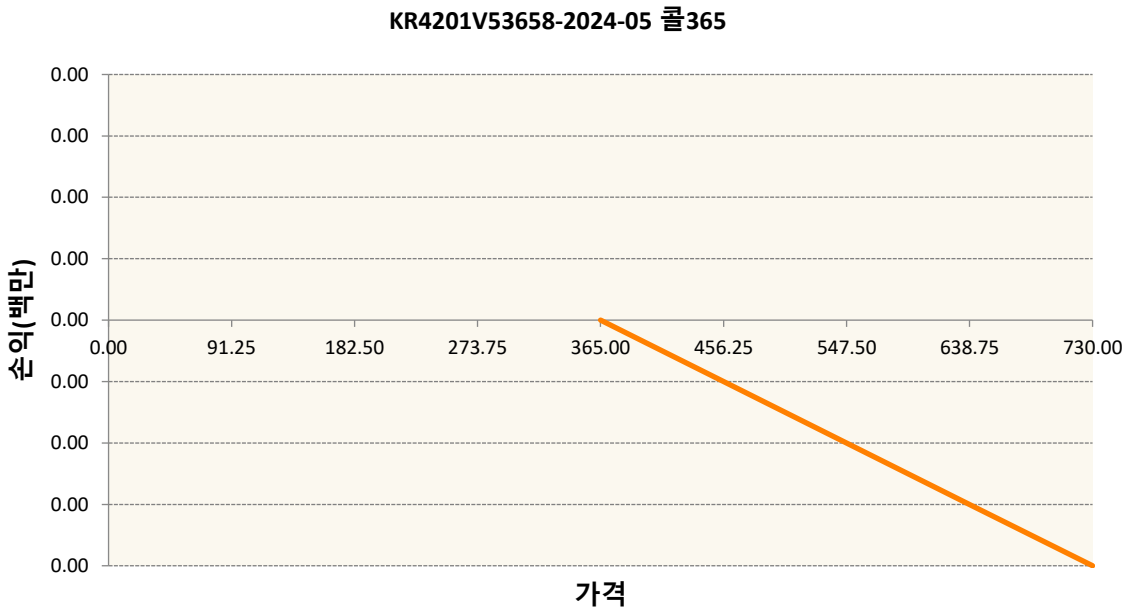
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

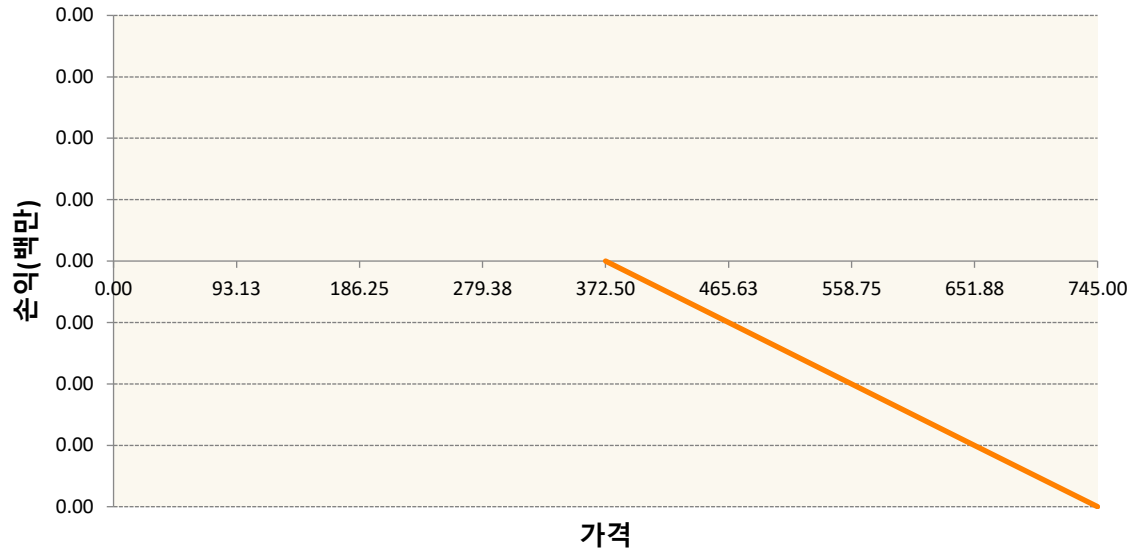
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	30,865	-30,865	장내
누계	유가증권	옵션	0	30,184	-30,184	장내

2. 만기시점의 손익구조



KR4201V53724-2024-05 콜372.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201V53658 2024-05 콜365 981							
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	406	401	393	385	375	364	352
-5.33%	372	358	342	325	308	290	271
-2.67%	270	247	225	202	180	157	134
0%	65	44	22	0	-22	-45	-67
2.67%	-232	-245	-260	-276	-293	-311	-329
5.33%	-584	-589	-596	-605	-615	-626	-639
8.00%	-955	-957	-959	-963	-968	-974	-981
KR4201V53674 2024-05 콜367.5 366							
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	136	134	132	129	126	122	118
-5.33%	126	122	117	111	105	98	92
-2.67%	95	87	79	70	62	53	45
0%	26	18	9	0	-9	-18	-27
2.67%	-80	-86	-93	-100	-107	-114	-122
5.33%	-212	-214	-218	-222	-227	-232	-237
8.00%	-354	-355	-356	-358	-360	-363	-366
KR4201V53724 2024-05 콜372.5 666							
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	195	193	191	188	183	178	172
-5.33%	186	180	173	165	155	145	134
-2.67%	150	136	123	108	93	78	62
0%	54	36	18	0	-18	-36	-54

2.67%	-120	-135	-151	-167	-184	-201	-218
5.33%	-357	-366	-376	-387	-399	-412	-425
8.00%	-628	-631	-636	-642	-649	-657	-666

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

(단위:백만원)

2,112

공시일	2024-04-12
기준일	2024-04-11

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	1,764	0	1,764	

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	2024-04-12
기준일	2024-04-11

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	4,407	0	4,407	

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	2024-04-12
기준일	2024-04-11

H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	205	-205	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	15,846	0	15,846	
누계	통화	선도	0	15,803	-15,803	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213E1W KRW/USD 30-04-24E	255
FXW213E2TC KRW/USD 31-05-24E	589
FXW213E3TC KRW/USD 28-06-24E	420
IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

581

공시일	2024-04-12
기준일	2024-04-11

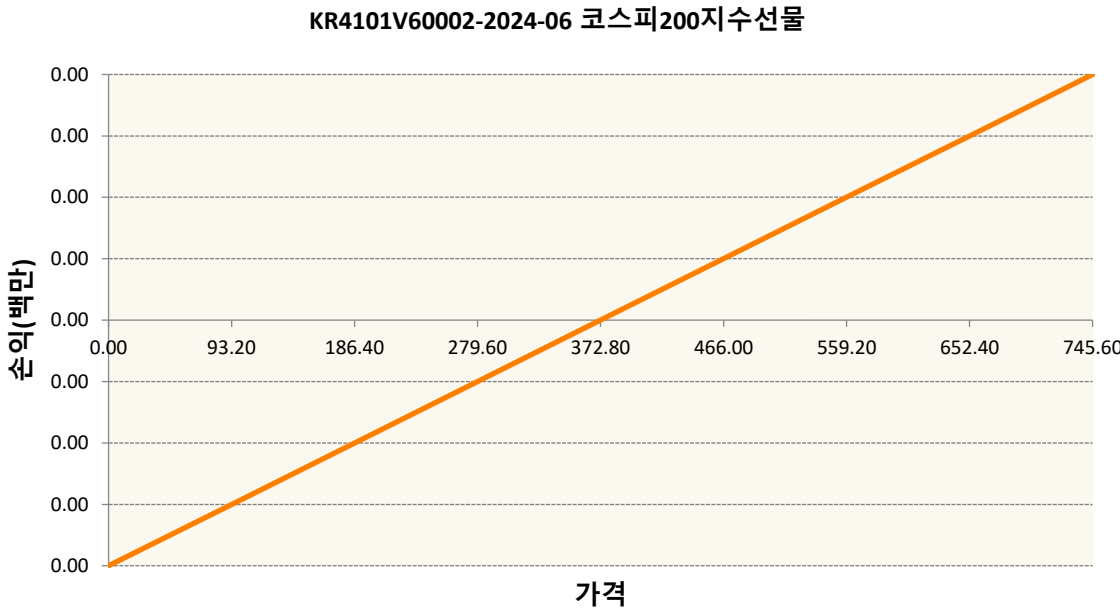
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

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	2024-04-12
기준일	2024-04-11

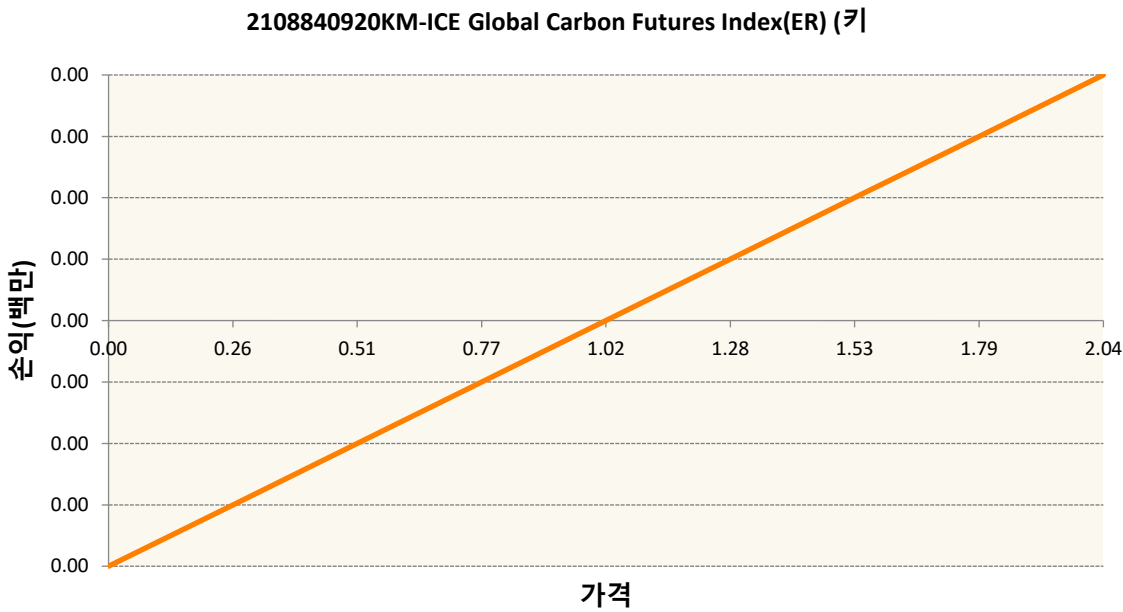
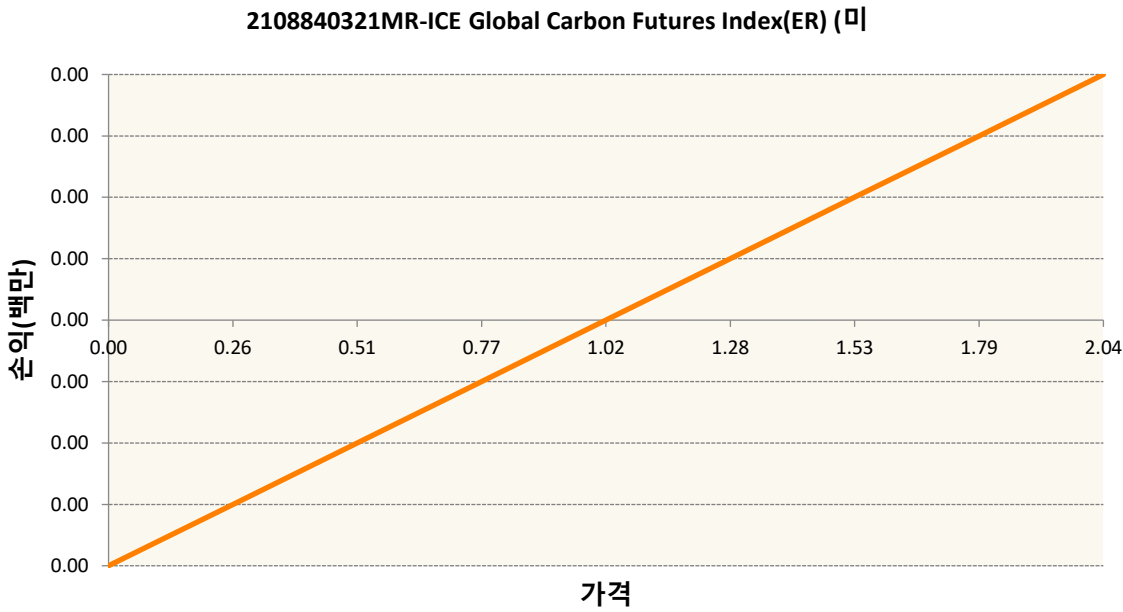
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

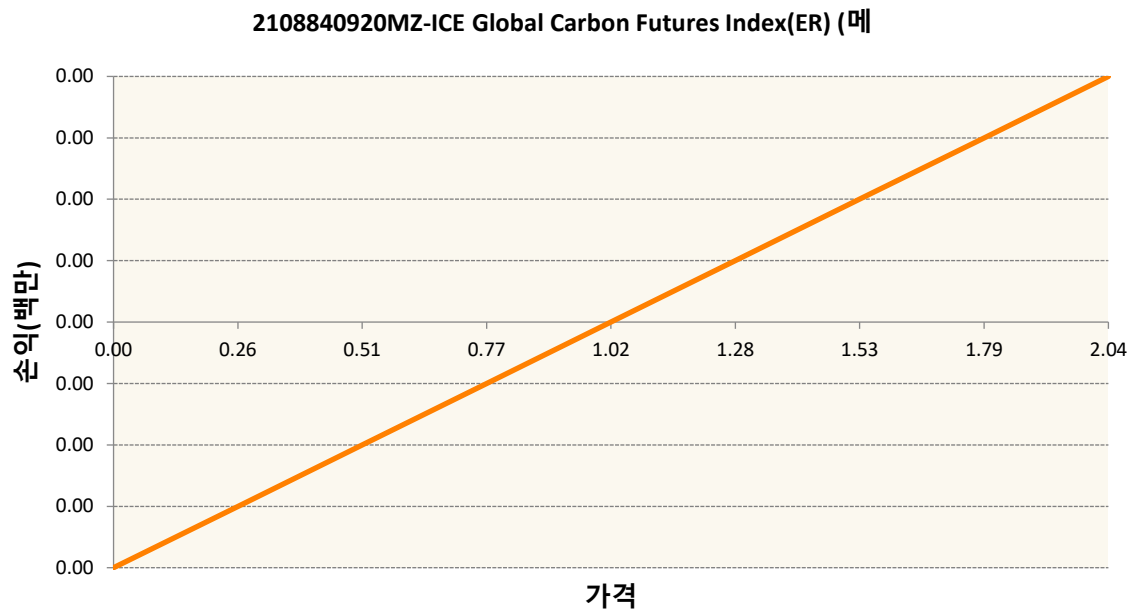
1. 계약금액

(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		887
2108840920IICE Global Carbon Futures Index(ER) (메		177

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)		(단위:백만원)
		1,730

공시일	2024-04-12
기준일	2024-04-11

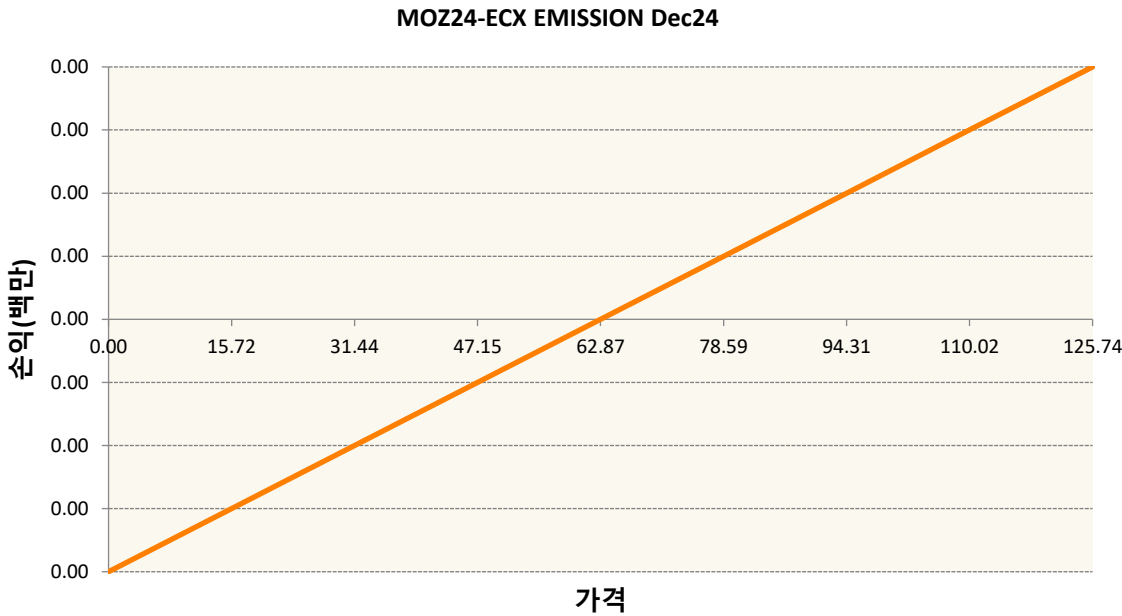
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	9,387	0	9,387	
누계	지수	스왑	331	0	331	장외
누계	통화	선도	0	2,599	-2,599	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	751
SWICEUACN ICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX	1

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

(단위:백만원)

1,424

공시일	2024-04-12
기준일	2024-04-11

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)	5
SWCSI00000 신한CSI Index 231013 (NH)	5

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

(단위:백만원)

35

공시일	2024-04-12
기준일	2024-04-11

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)	13
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	2024-04-12
기준일	2024-04-11

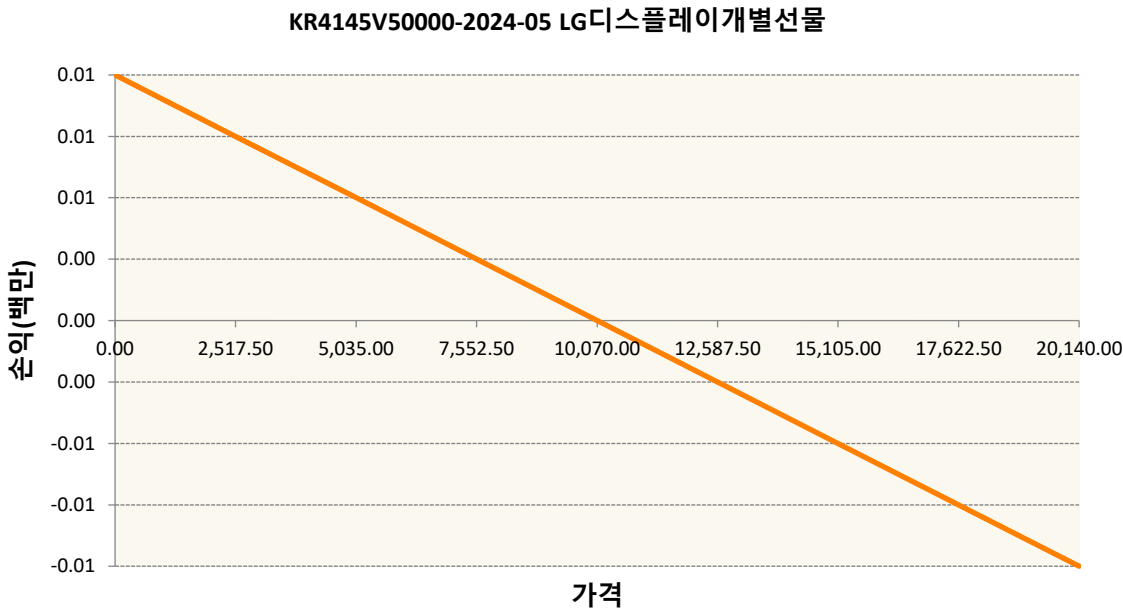
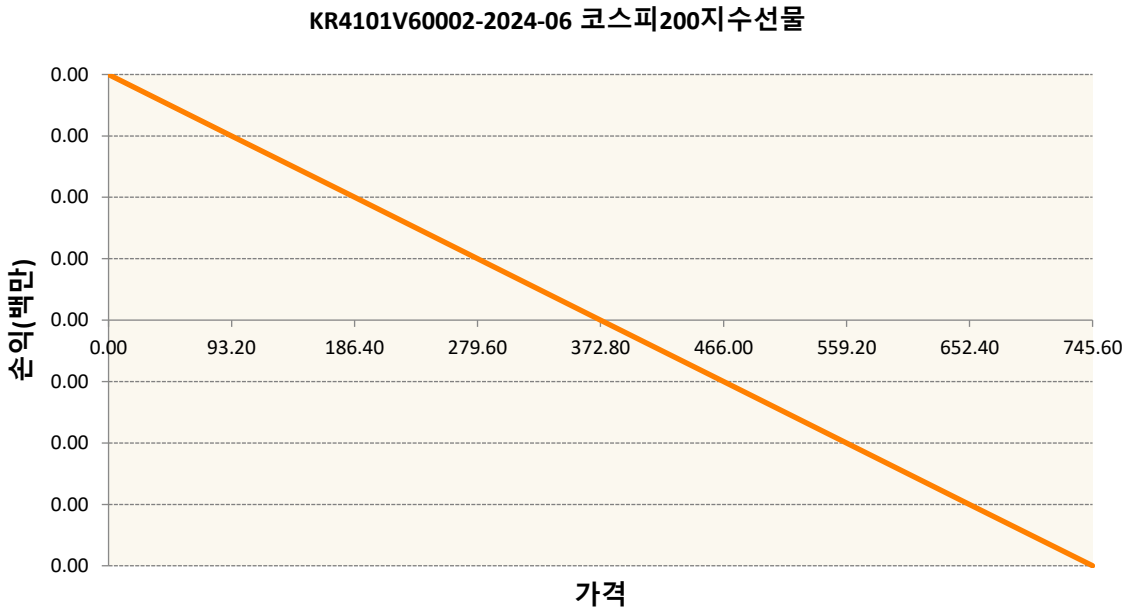
에퀴티알파일반사모혼합자산

1. 계약금액

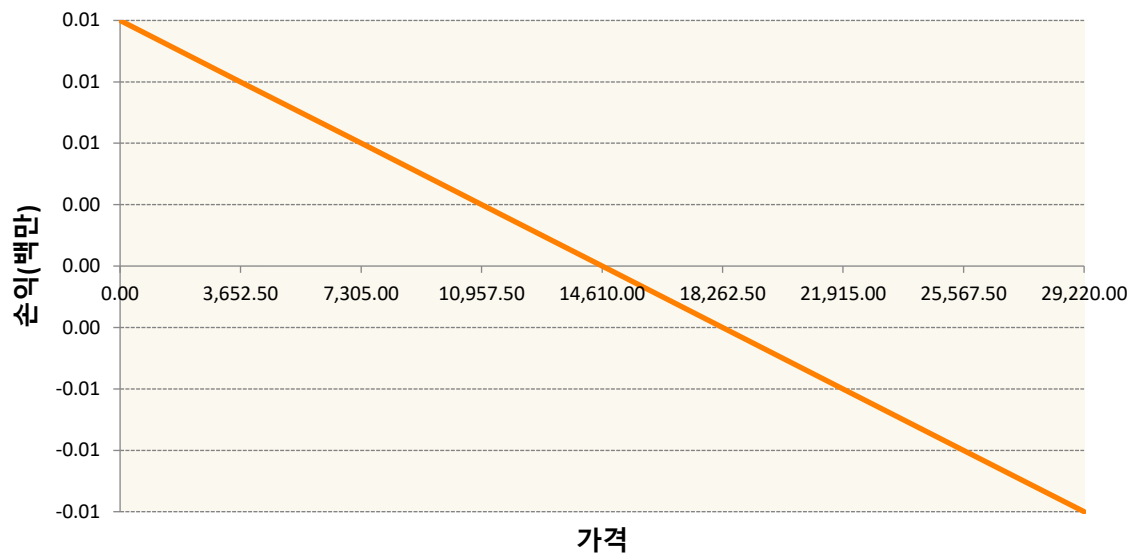
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	57	-57	장내
누계	유가증권	선물	0	620	-620	장내

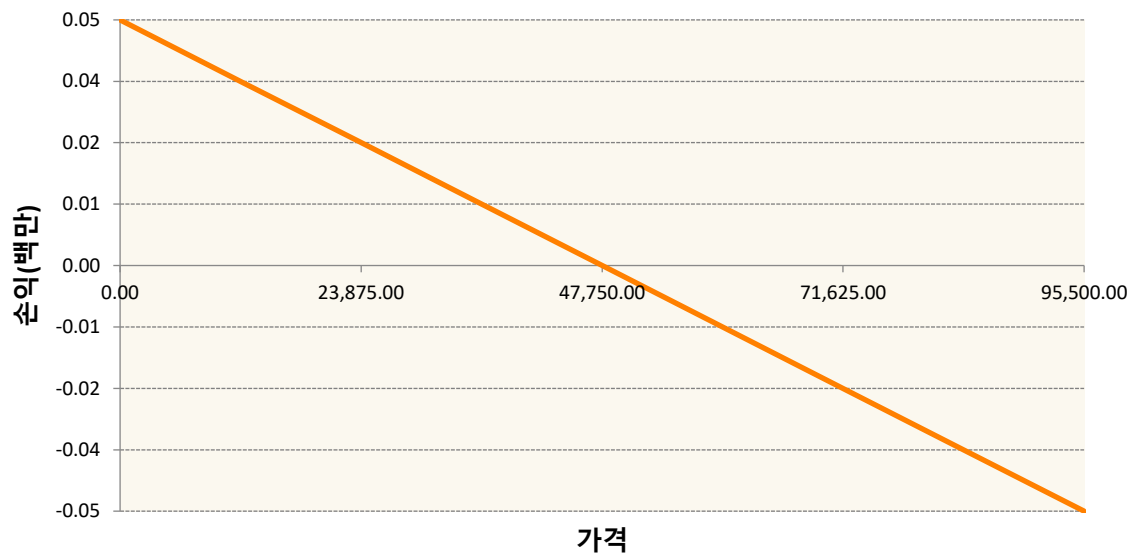
2. 만기시점의 손익구조



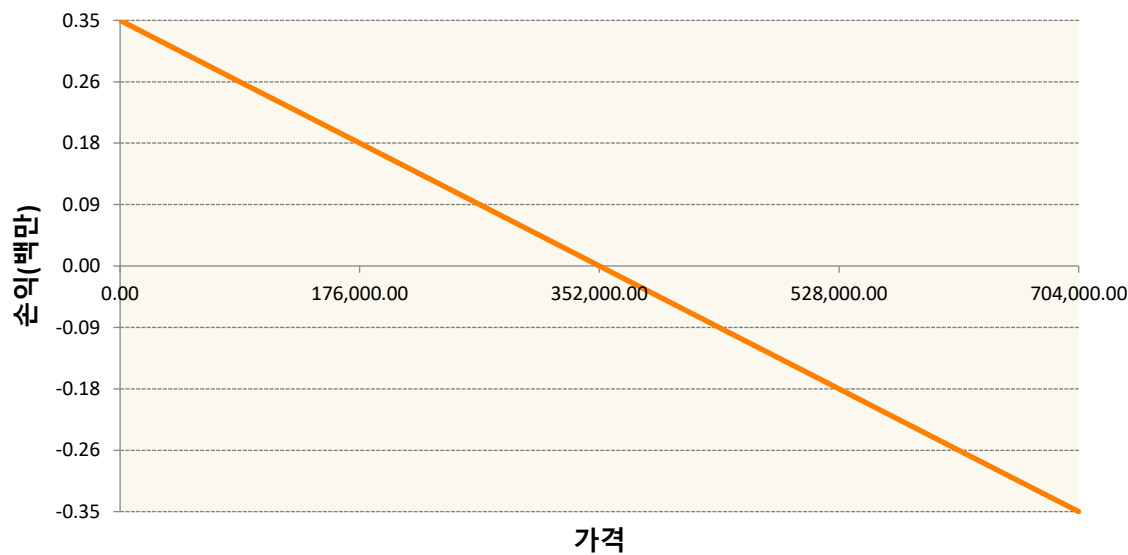
KR4151V50008-2024-05 GS건설개별선물



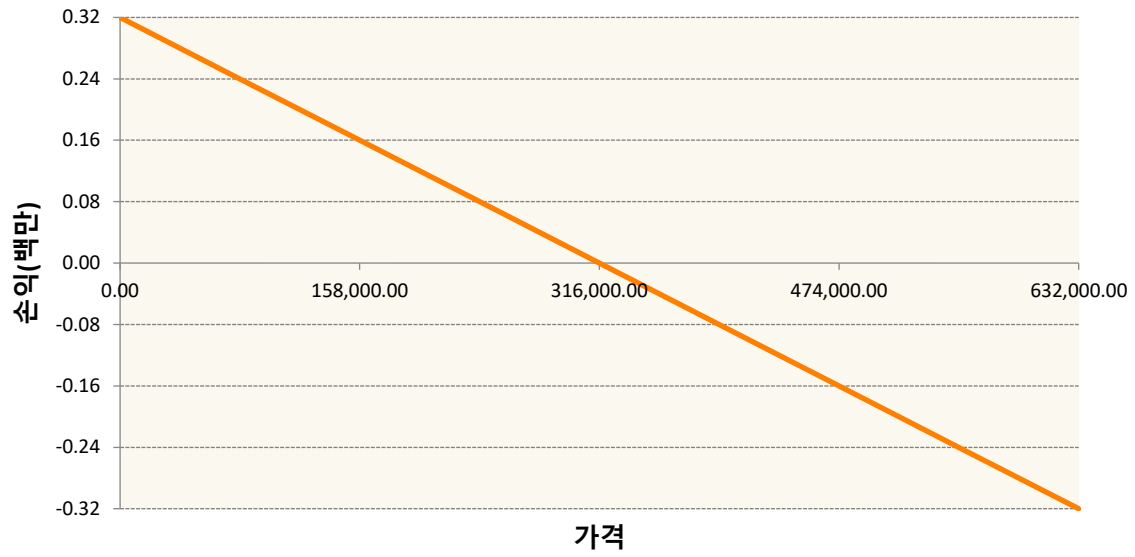
KR41CFV50008-2024-05 카카오개별선물



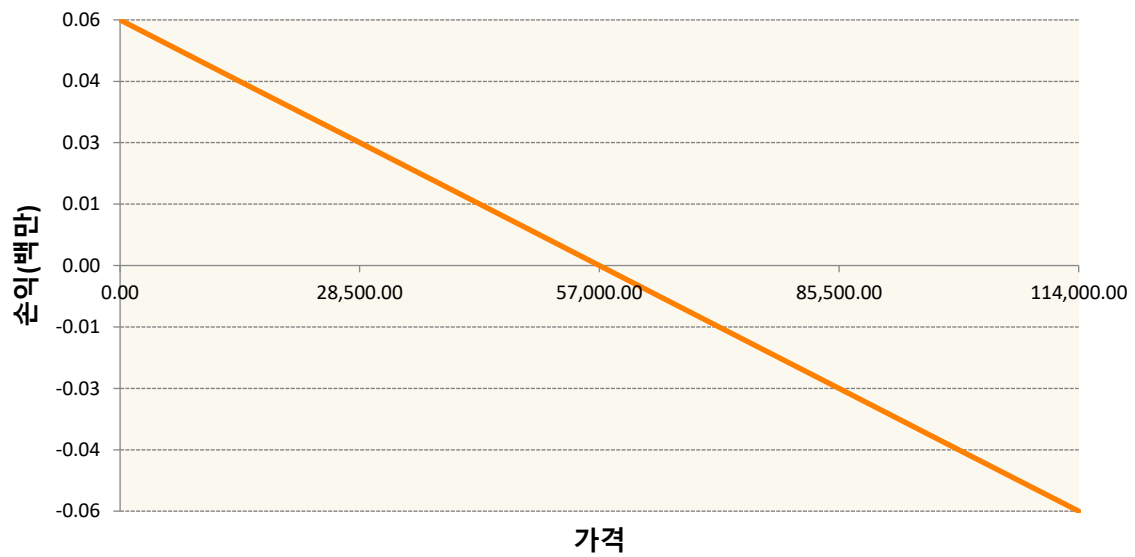
KR41CRV50003-2024-05 LG생활건강개별선물



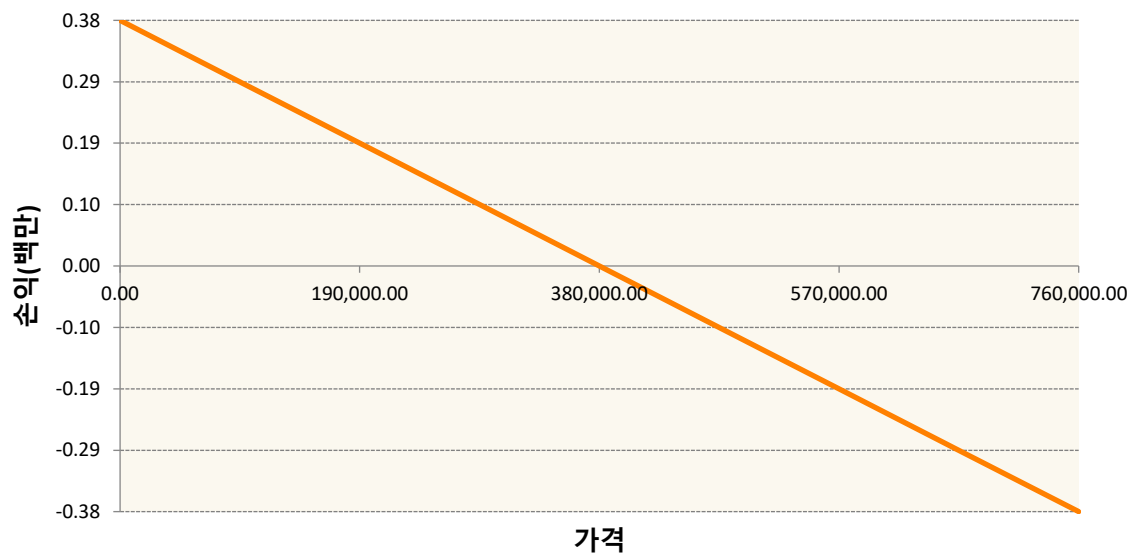
KR41D1V50009-2024-05 CJ제일제당개별선물



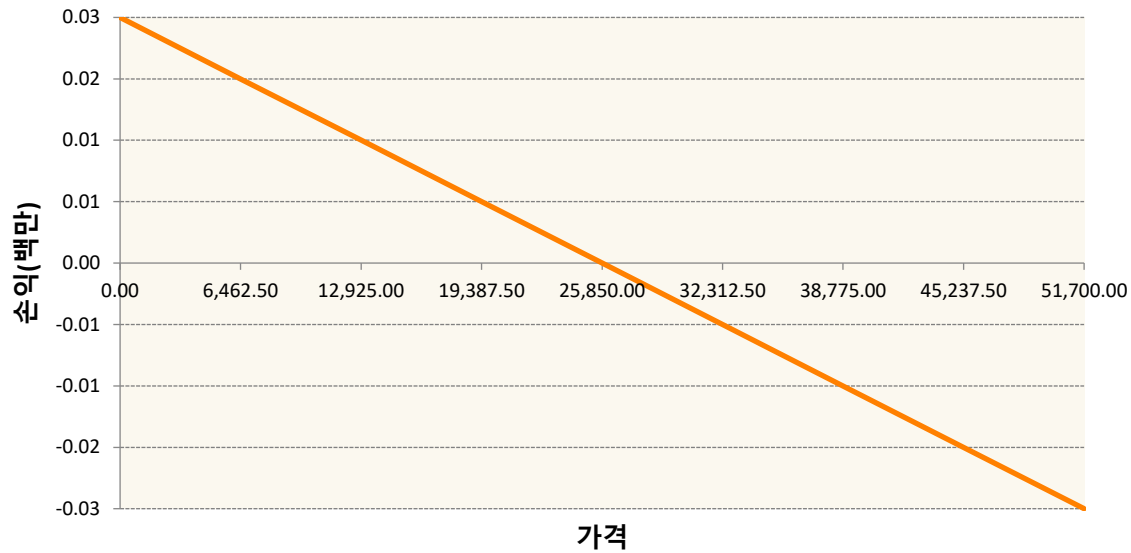
KR41E5V50009-2024-05 넷마블개별선물



KR41F5V50008-2024-05 LG에너지솔루션개별선물



KR41F6V50006-2024-05 카카오뱅크개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101V600 2024-06 코스피200지수선물	45
KR4145V500 2024-05 LG디스플레이개별선물	1
KR4151V500 2024-05 GS건설개별선물	0.22
KR41CFV500 2024-05 카카오개별선물	0.42
KR41CRV500 2024-05 LG생활건강개별선물	1
KR41D1V500 2024-05 CJ제일제당개별선물	1
KR41E5V500 2024-05 넷마블개별선물	0.27
KR41F5V500 2024-05 LG에너지솔루션개별선물	1
KR41F6V500 2024-05 카카오뱅크개별선물	1

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

(단위:백만원)

51

공시일	2024-04-12
기준일	2024-04-11

코리아인덱스(주식-파생형)(종)

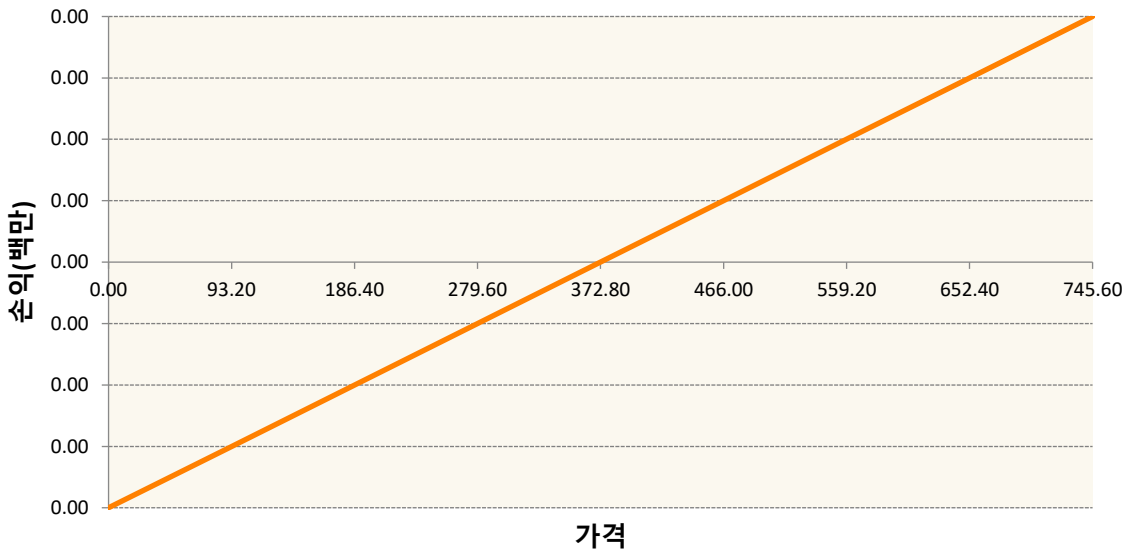
1. 계약금액

(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	2024-04-12
기준일	2024-04-11

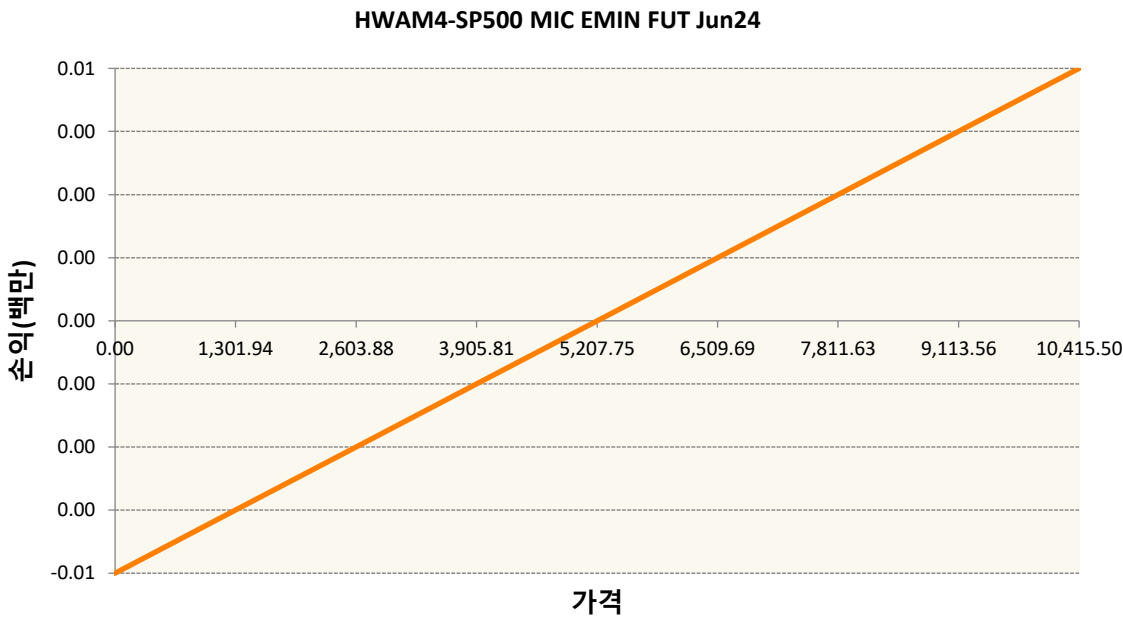
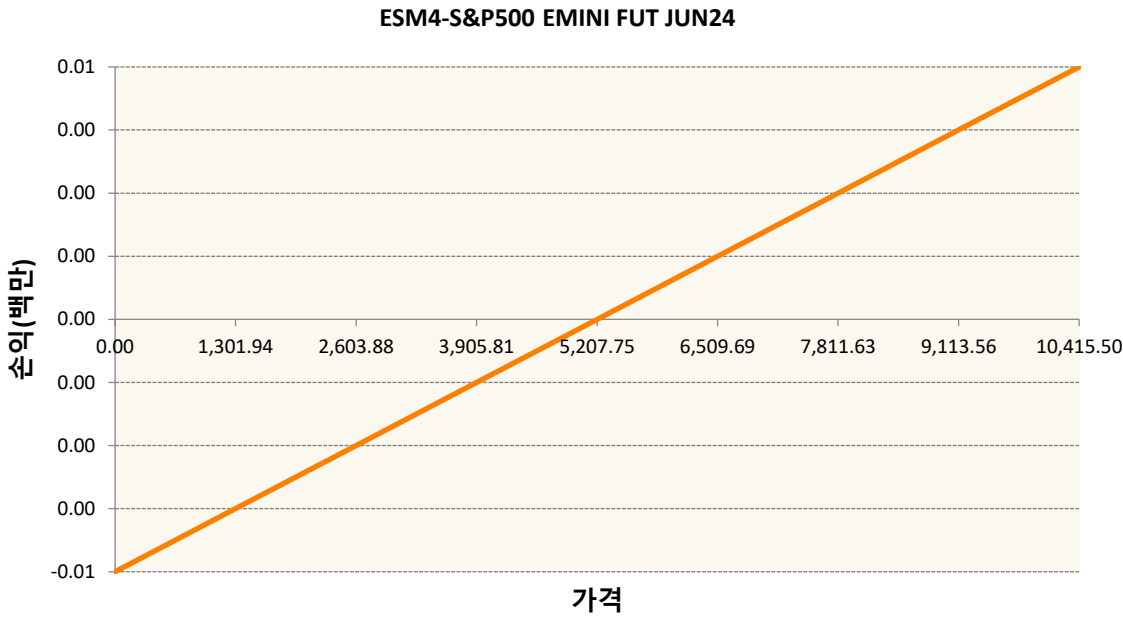
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

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	4,477	0	4,477	
누계	유가증권	선물	1,892	0	1,892	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESM4	S&P500 EMINI FUT JUN24	358
HWAM4	SP500 MIC EMIN FUT Jun24	151

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	356

공시일	2024-04-12
기준일	2024-04-11

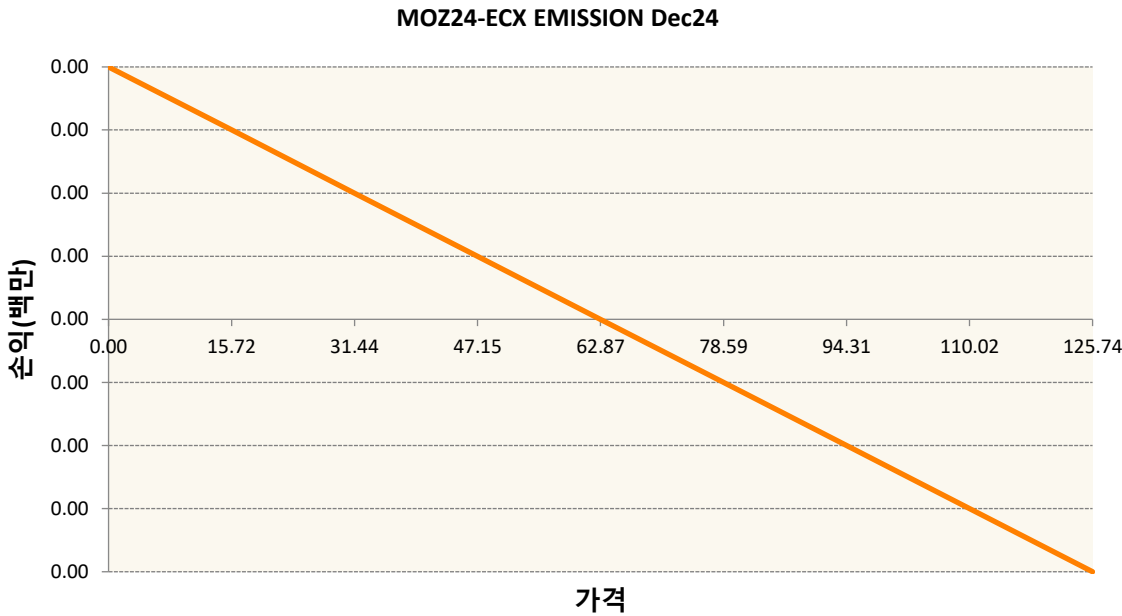
SOL유럽탄소배출권선물인버스ICE특별자산상

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	5,358	-5,358	
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	429
SWICEUACN ICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX	1

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

(단위:백만원)

796

공시일	2024-04-12
기준일	2024-04-11

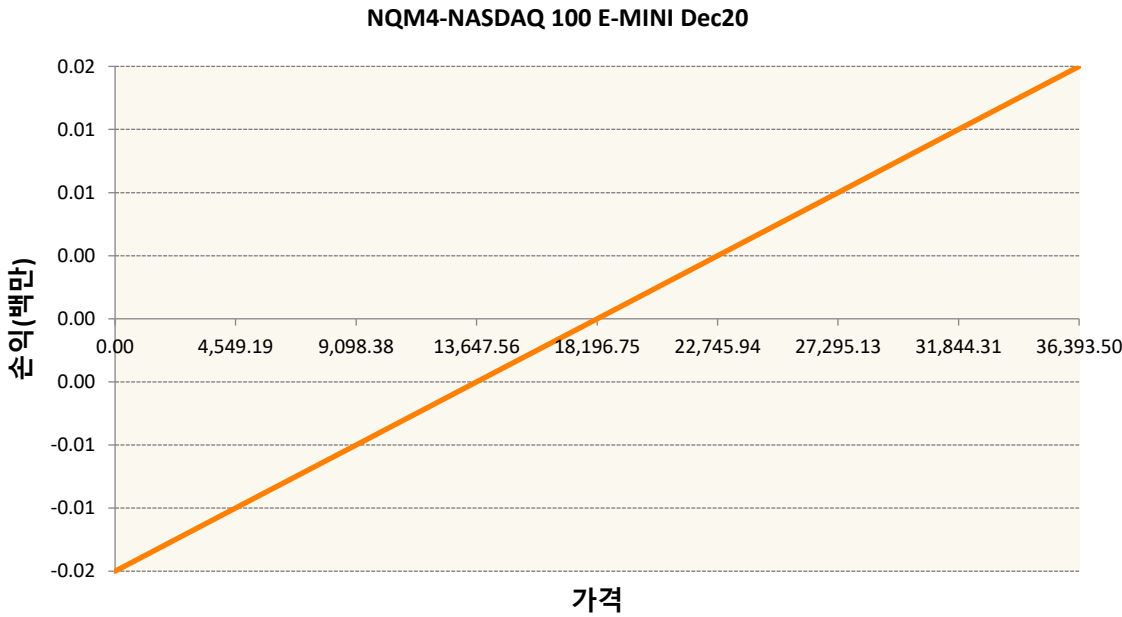
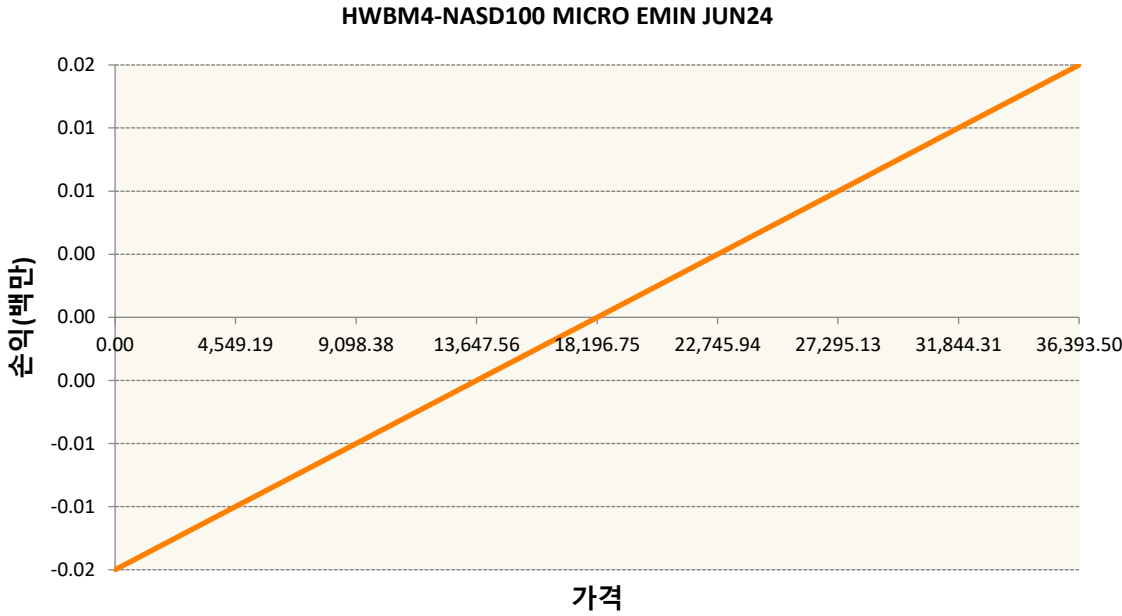
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

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	2,404	0	2,404	
누계	유가증권	선물	2,449	0	2,449	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
HWBM4	NASD100 MICRO EMIN JUN24		196
NQM4	NASDAQ 100 E-MINI Dec20		192

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)			(단위:백만원)
			321

공시일	2024-04-12
기준일	2024-04-11

SOL미국30년국채커버드콜(합성)

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	125,052	0	125,052	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWKEDI0000 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	437
SWKEDI0000 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	1,599
SWKEDI0000 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	941
SWKEDI0000 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	6,955

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

(단위:백만원)

6,184

공시일	2024-04-12
기준일	2024-04-11

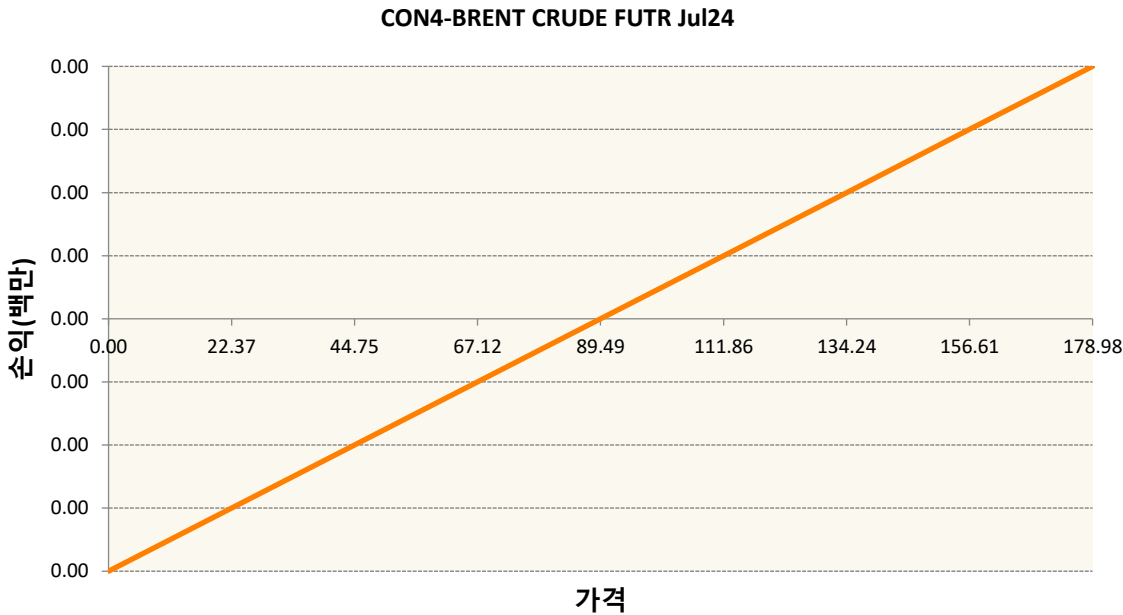
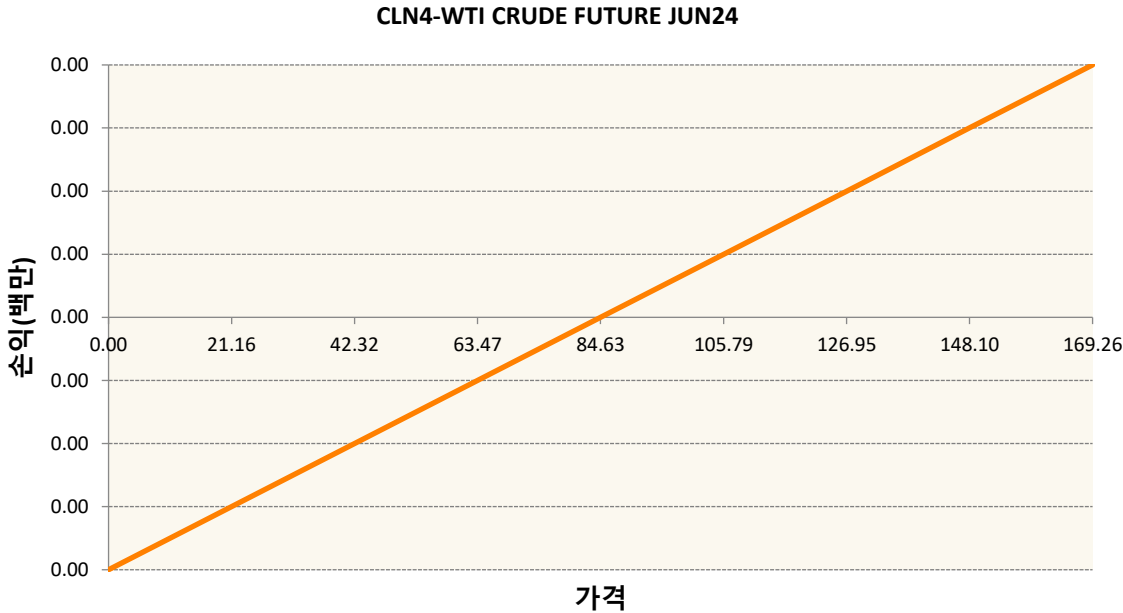
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

1. 계약금액

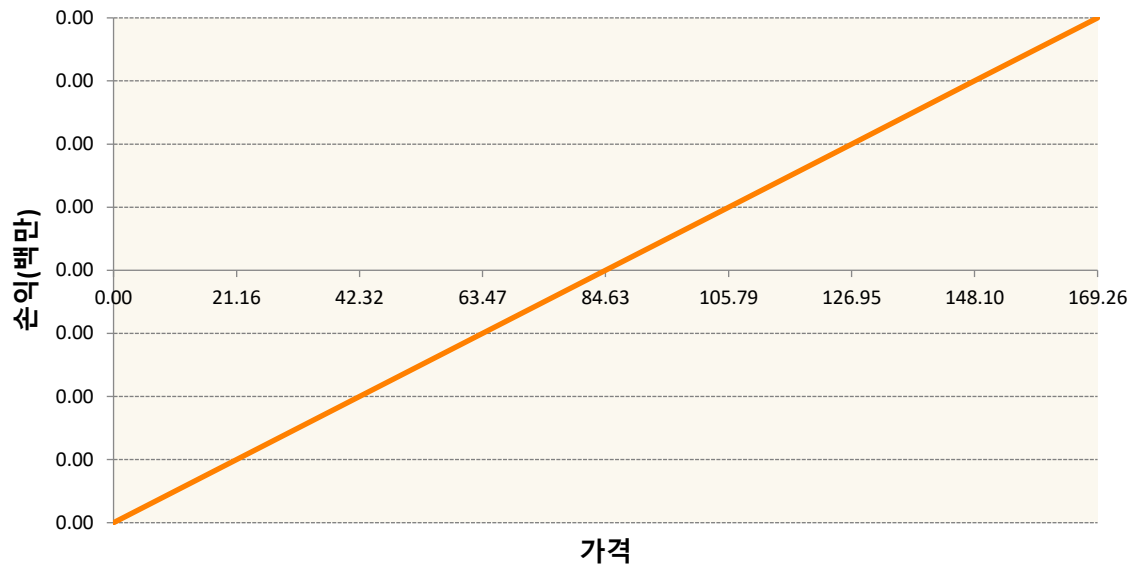
(단위:백만원)

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	1,220	0	1,220	
누계	통화	선물	0	246	-246	장내

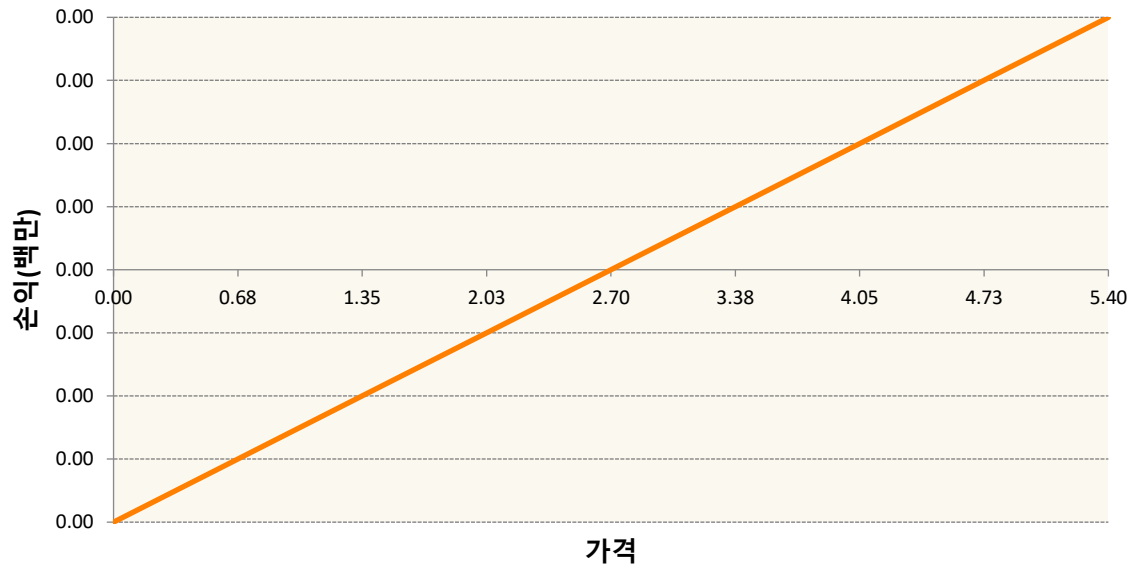
2. 만기시점의 손익구조



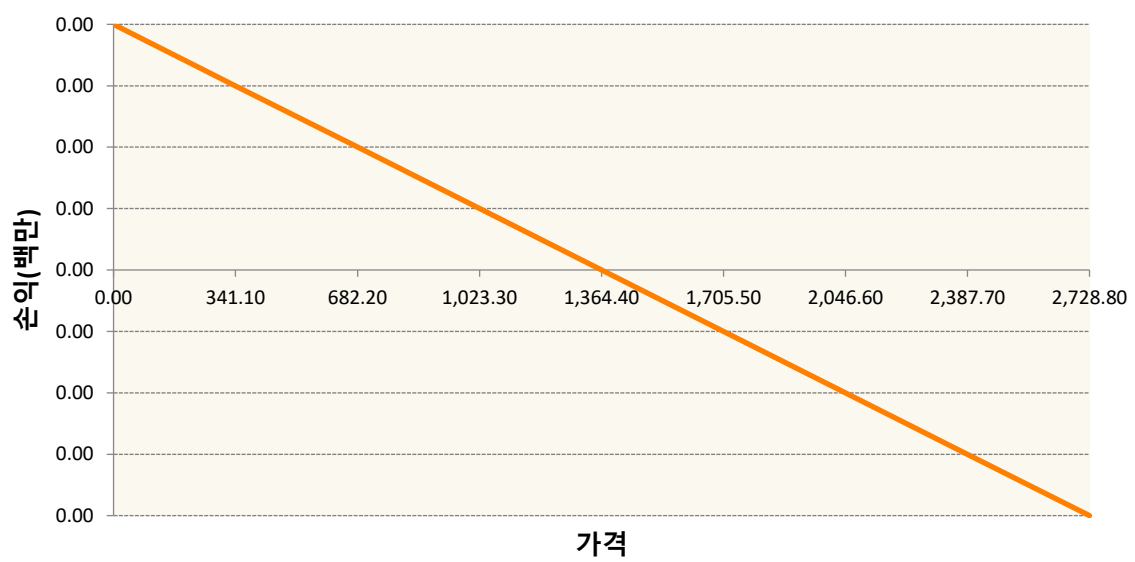
ECN4-E-mini Crude Oil JUL24



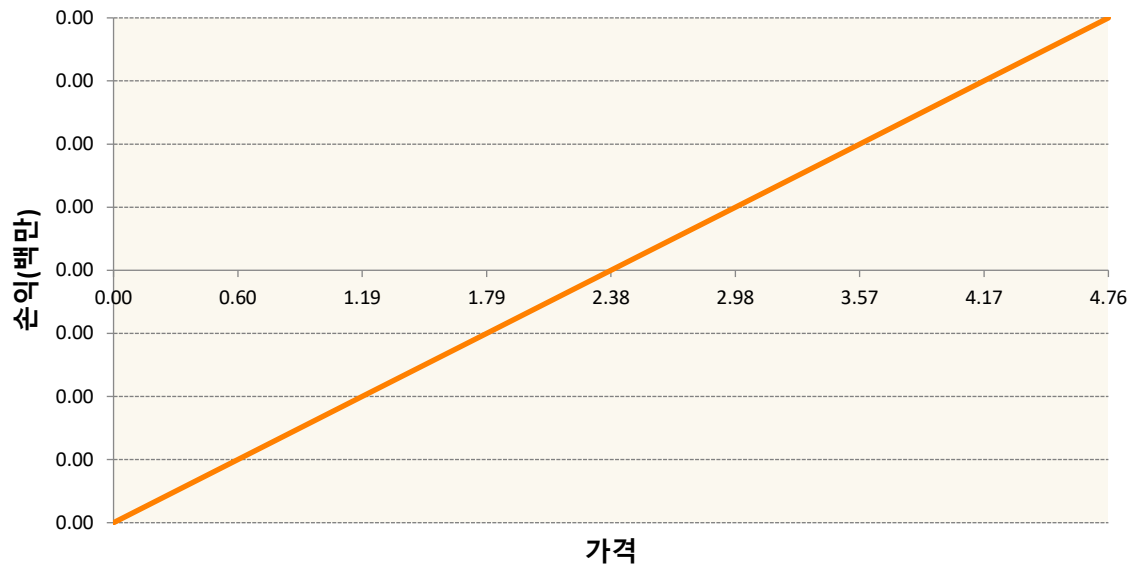
HON4-NY Harb ULSD Fut Jul24



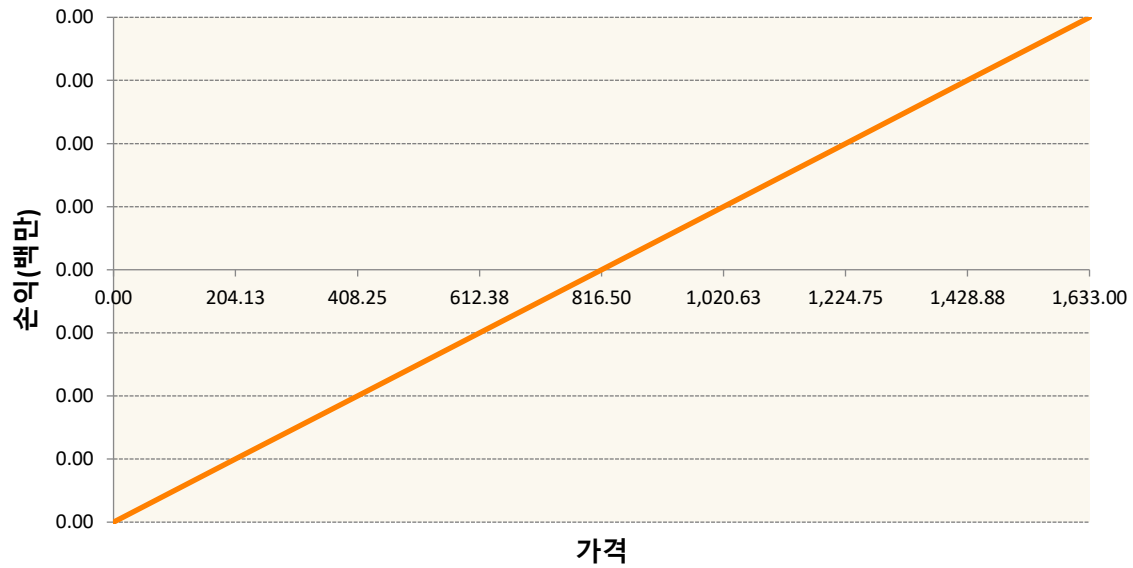
KR4175V40008-2024-04 달러선물



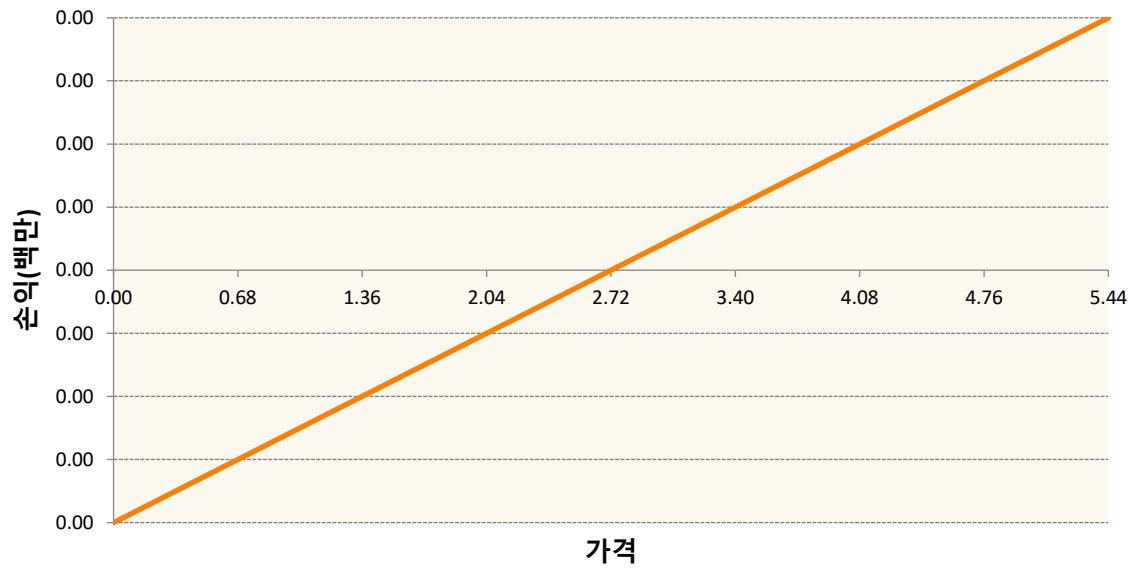
NGN24-NATURAL GAS FUTR JUL24



QSN4-Low Su Gasoil G JUL24



XBN4-GASOLINE RBOB FUT JUL24



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		20
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)

211