

공시일	2024-04-15
기준일	2024-04-12

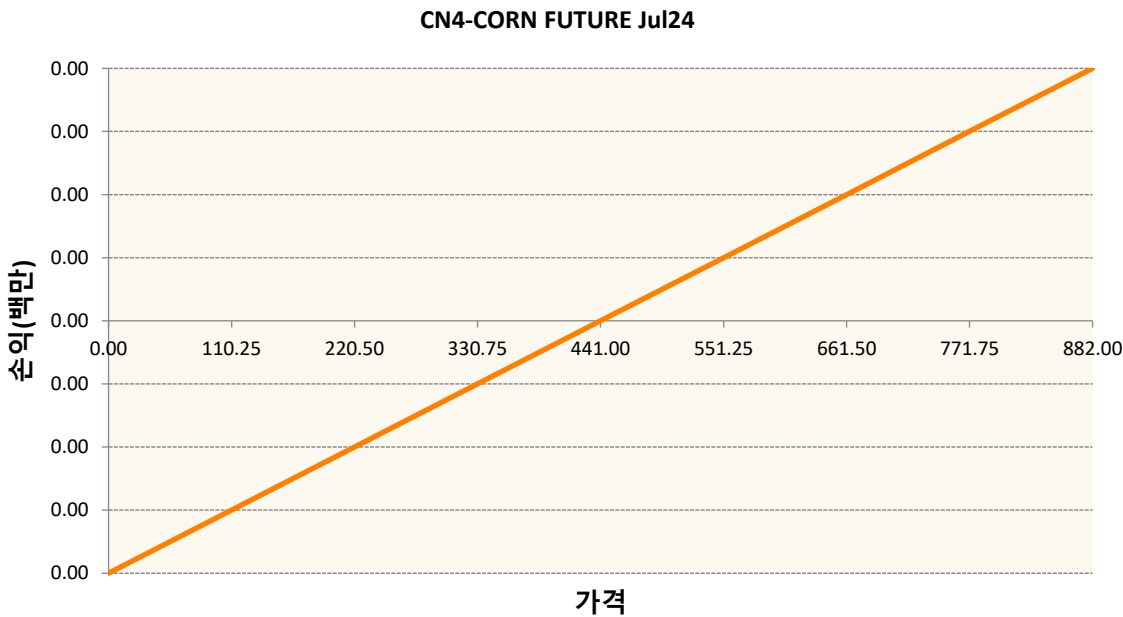
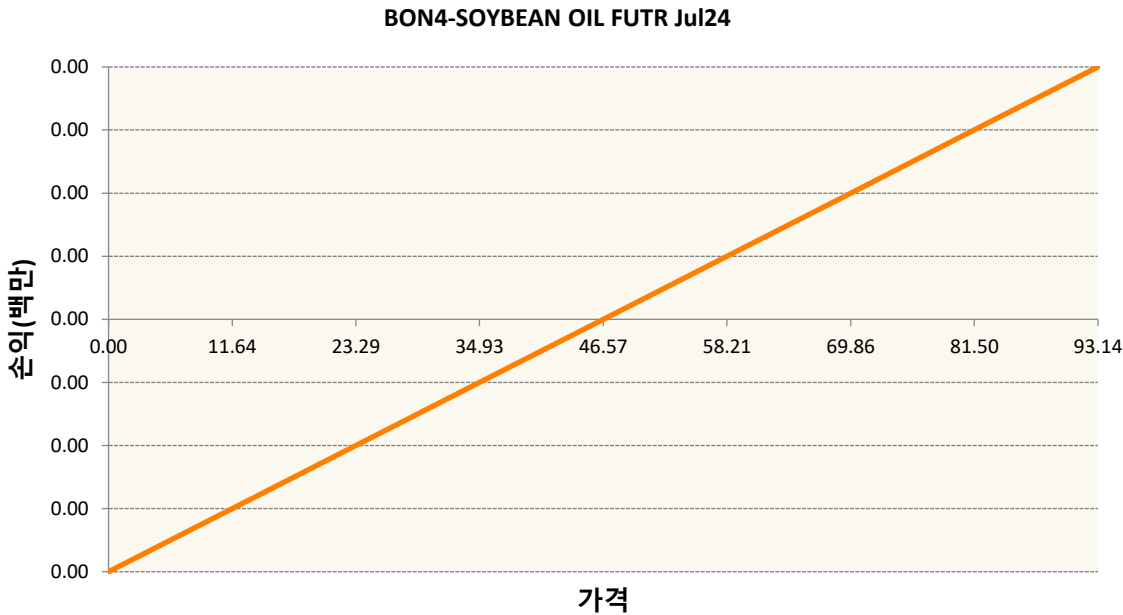
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

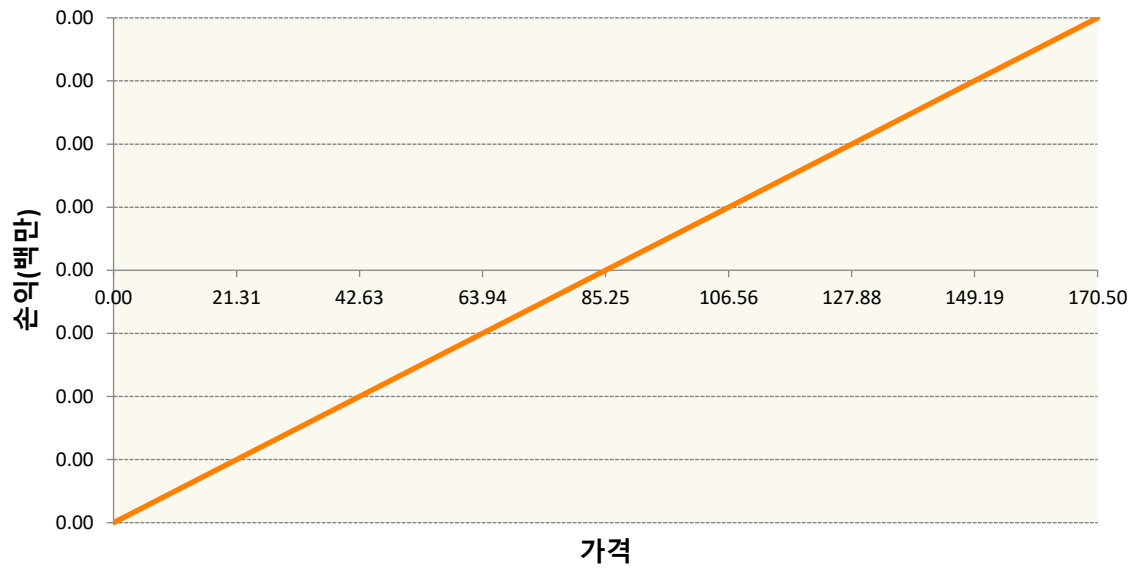
(단위:USD 백만)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	535	-535	장내
누계	유가증권	선물	4,267	0	4,267	
누계	통화	선물	0	536	-536	장내

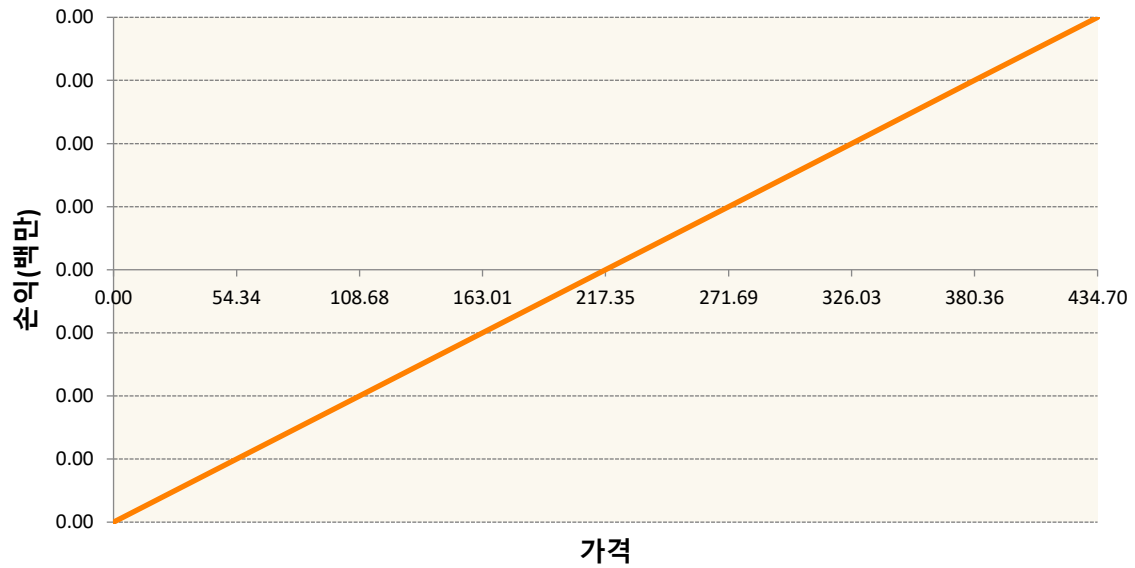
2. 만기시점의 손익구조



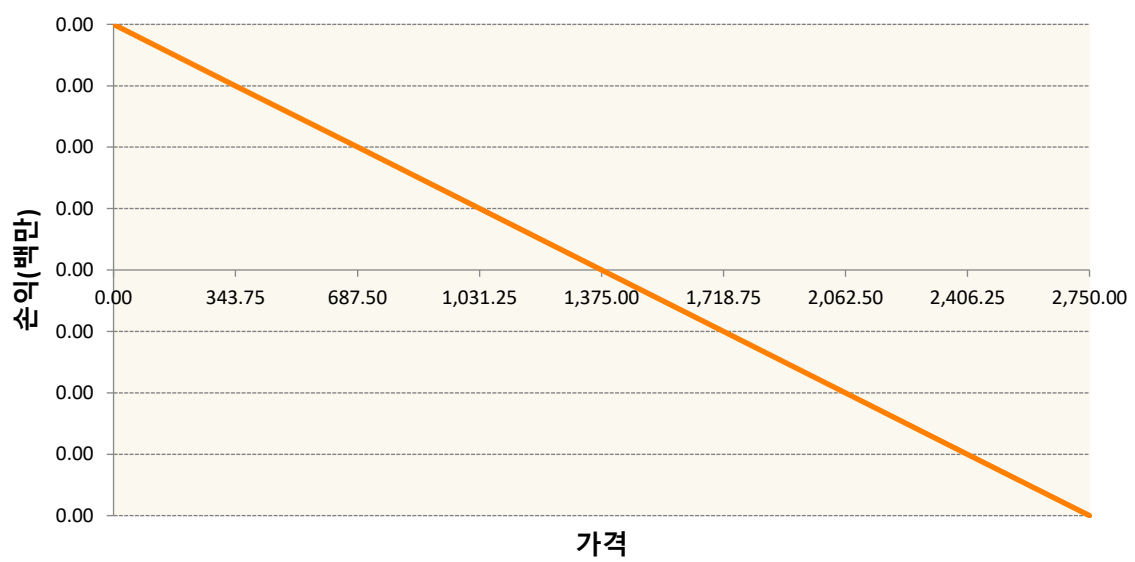
CTN4-COTTON NO.2 FUTR Jul24



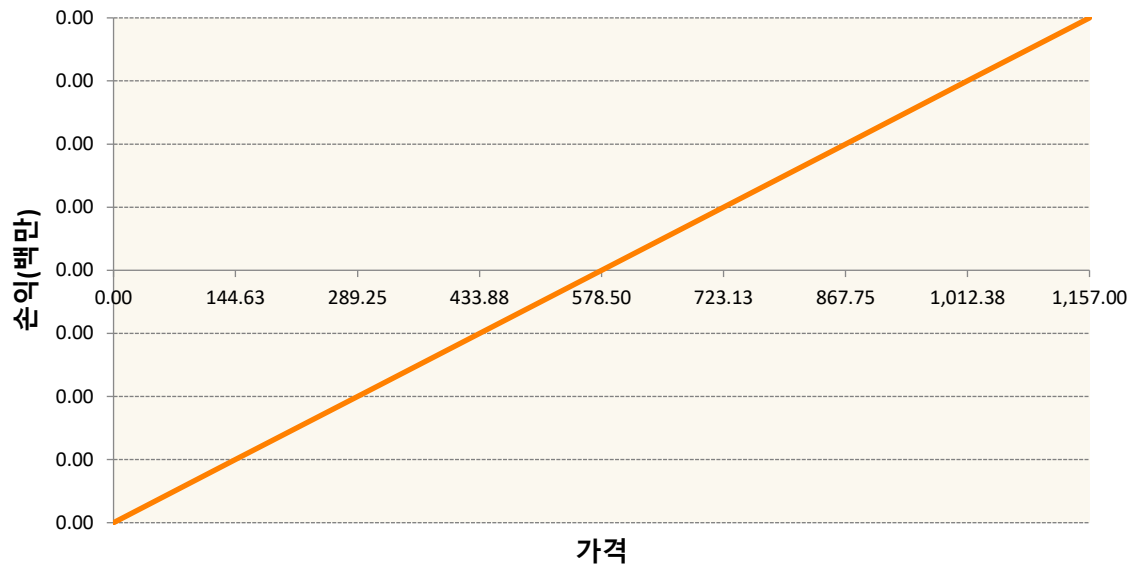
KCN4-COFFEE 'C' FUTURE Jul24



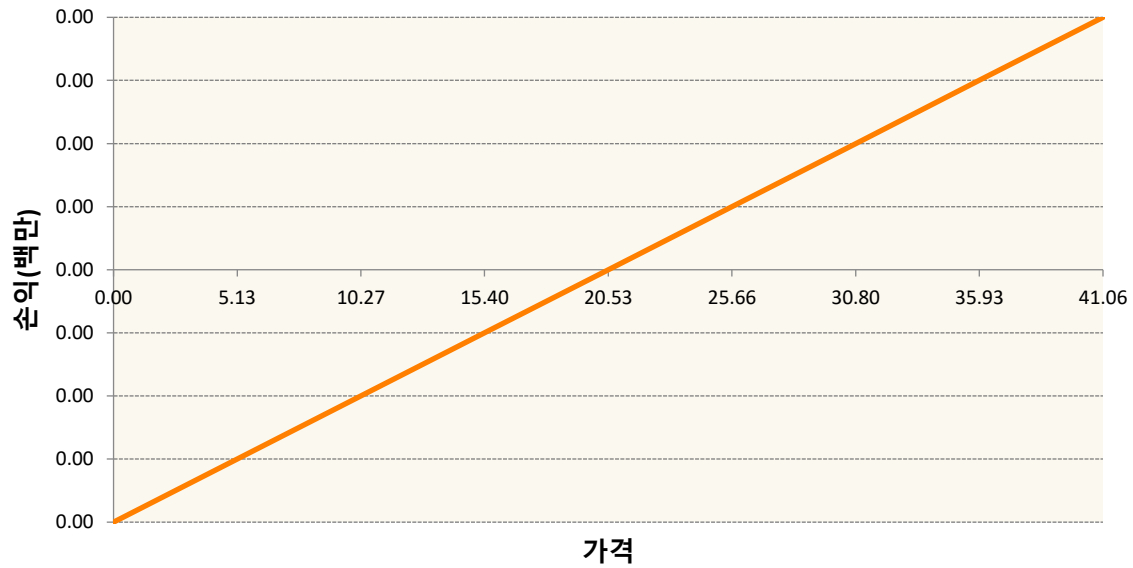
KR4175V50007-2024-05 달러선물



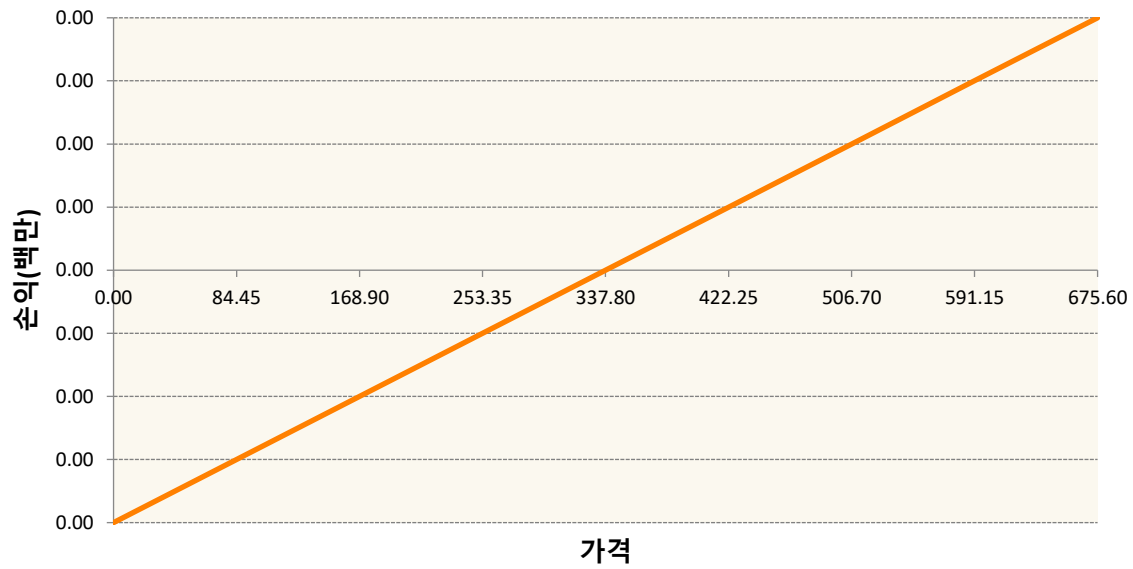
KWN4-KC HRW WHEAT FUT Jul24

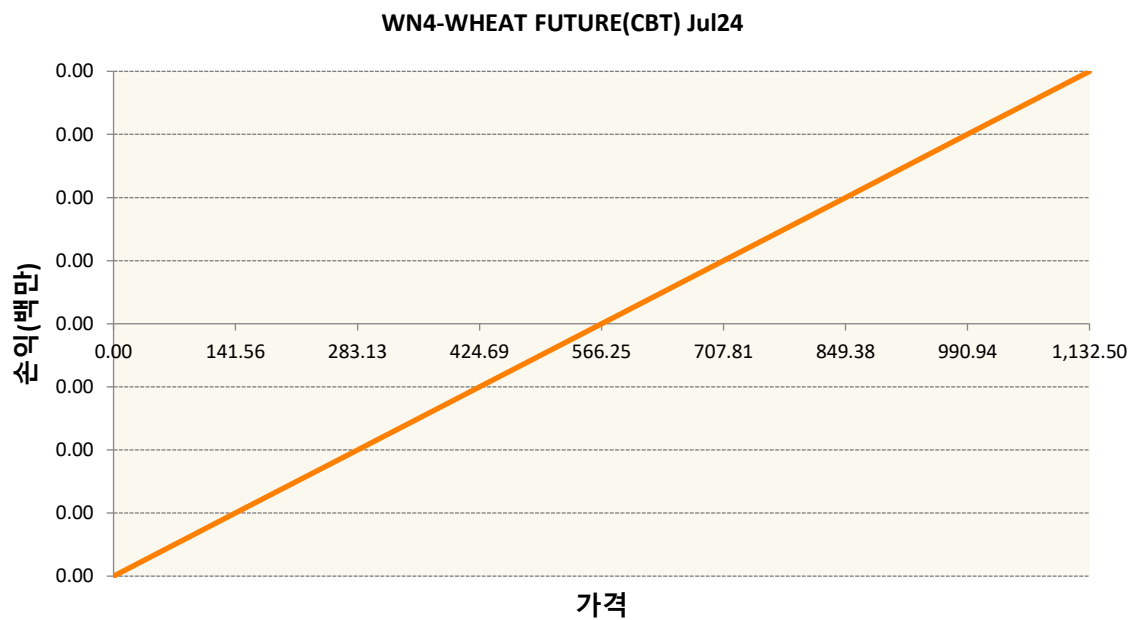
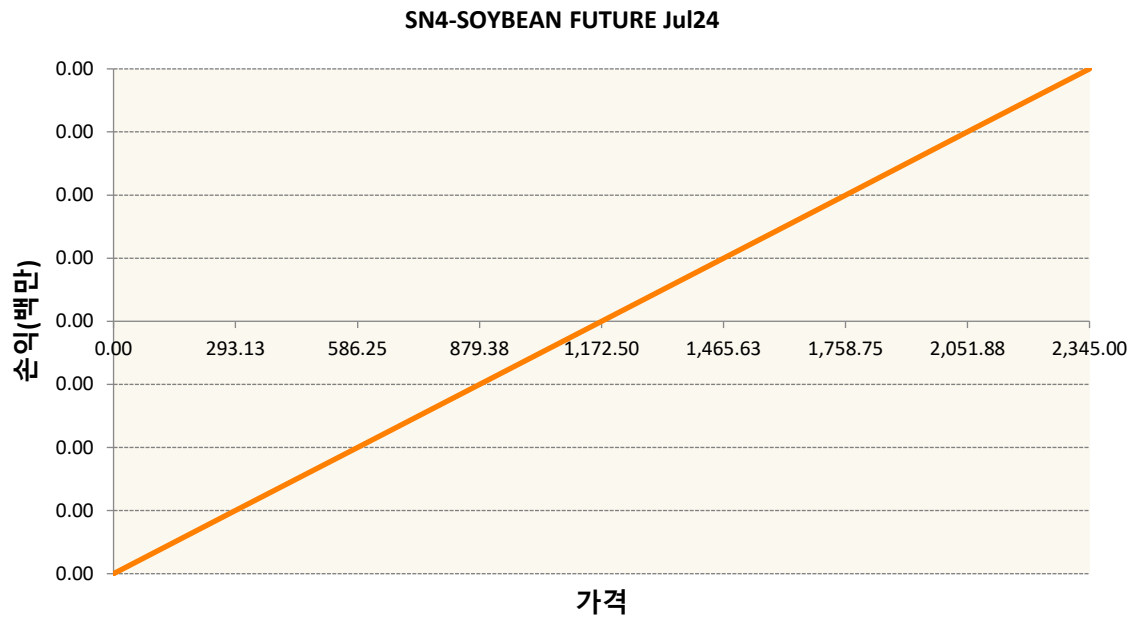


SBN4-Sugar #11 (WORLD) Jul24



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	2024-04-15
기준일	2024-04-12

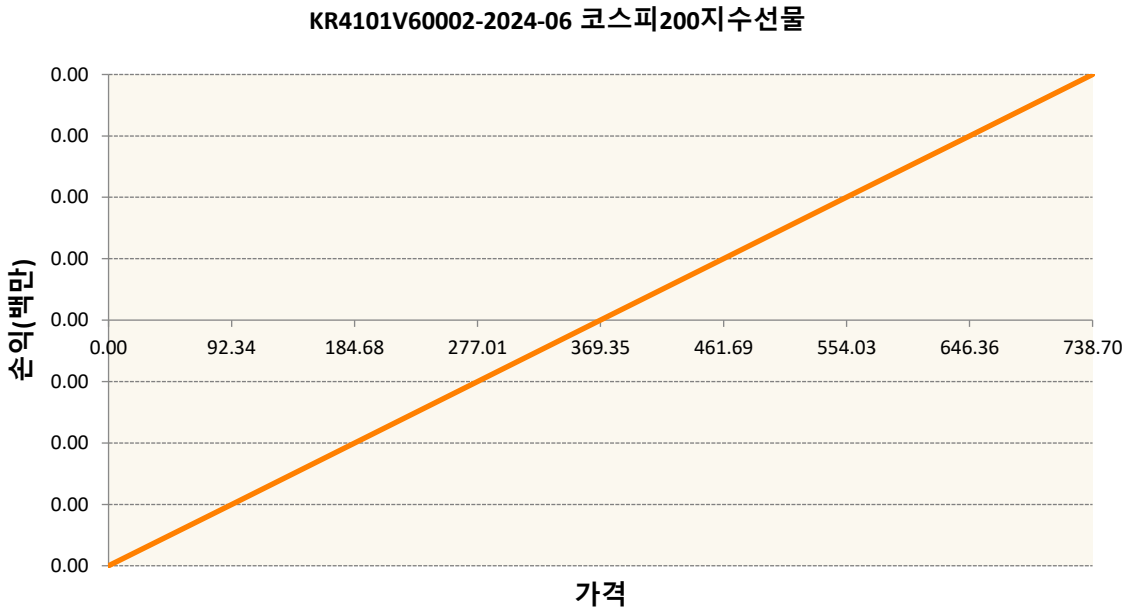
스마트인덱스모

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	462	93	369	장내
누계	유가증권	선물	1,939	0	1,939	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101V60002		2024-06 코스피200지수선물					154
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-154	-154	-154	-154	-154	-154	-154
-5.33%	-103	-103	-103	-103	-103	-103	-103
-2.67%	-51	-51	-51	-51	-51	-51	-51
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	51	51	51	51	51	51	51
5.33%	103	103	103	103	103	103	103
8.00%	154	154	154	154	154	154	154

공시일	2024-04-15
기준일	2024-04-12

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)

310

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2024-04-15
기준일	2024-04-12

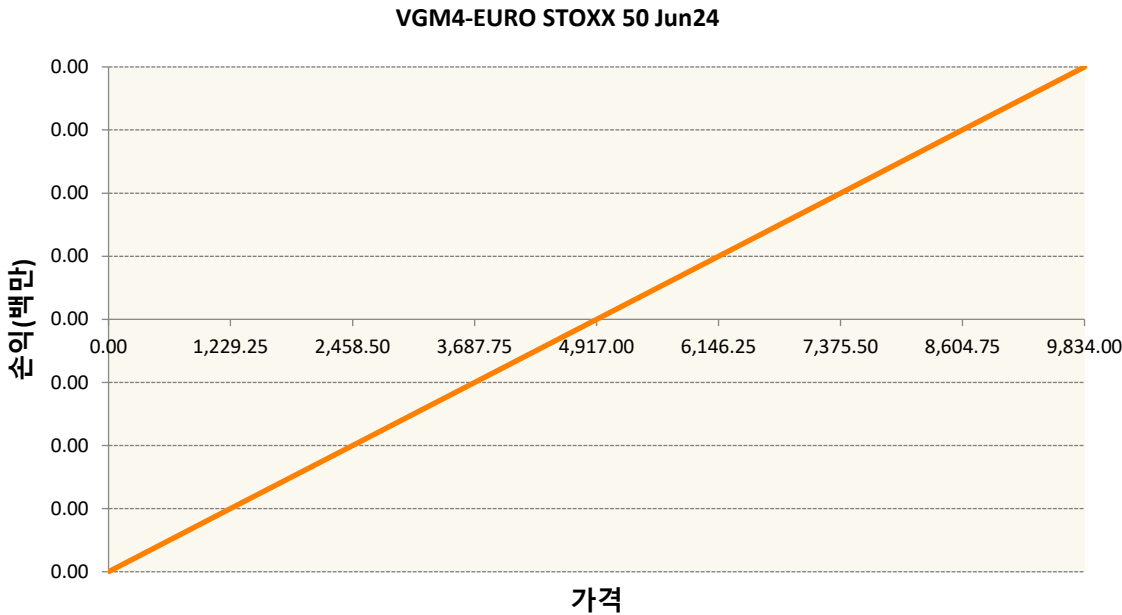
유로인덱스모(주식-파생형)

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	987	0	987	
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	79

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

(단위:백만원)

64

공시일	2024-04-15
기준일	2024-04-12

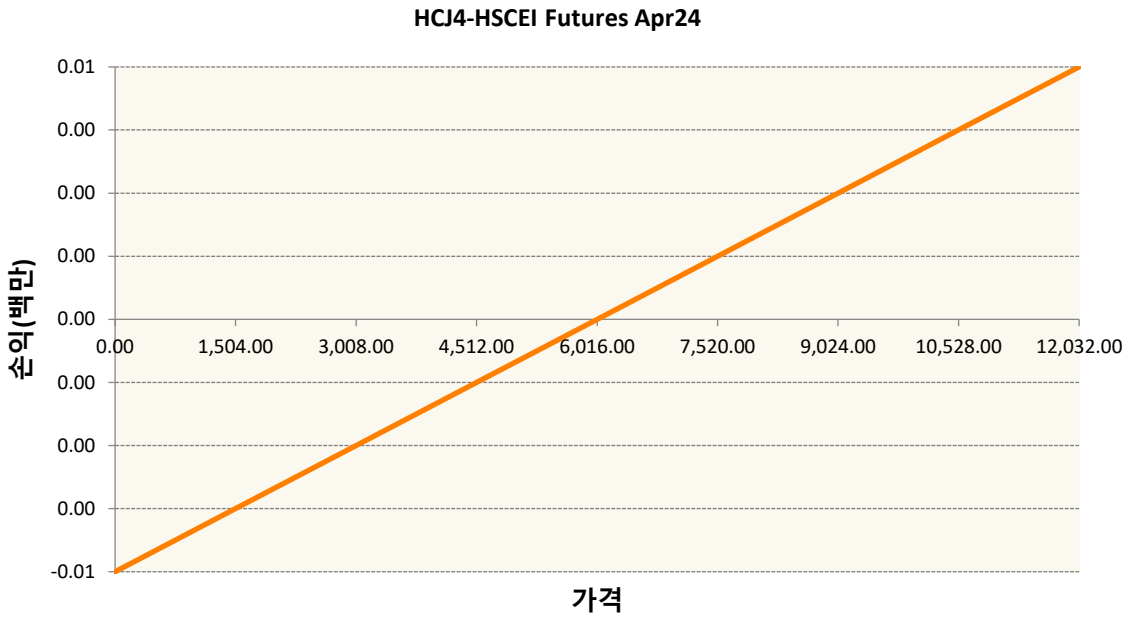
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,186	0	1,186	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCI4	HSCEI Futures Apr24	95
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

124

공시일	2024-04-15
기준일	2024-04-12

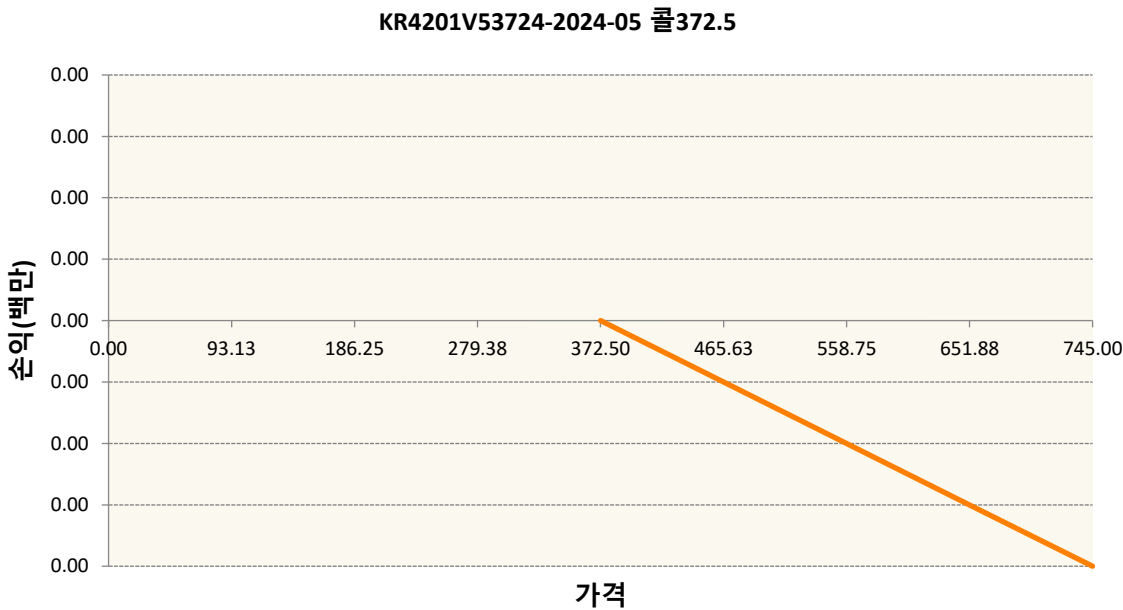
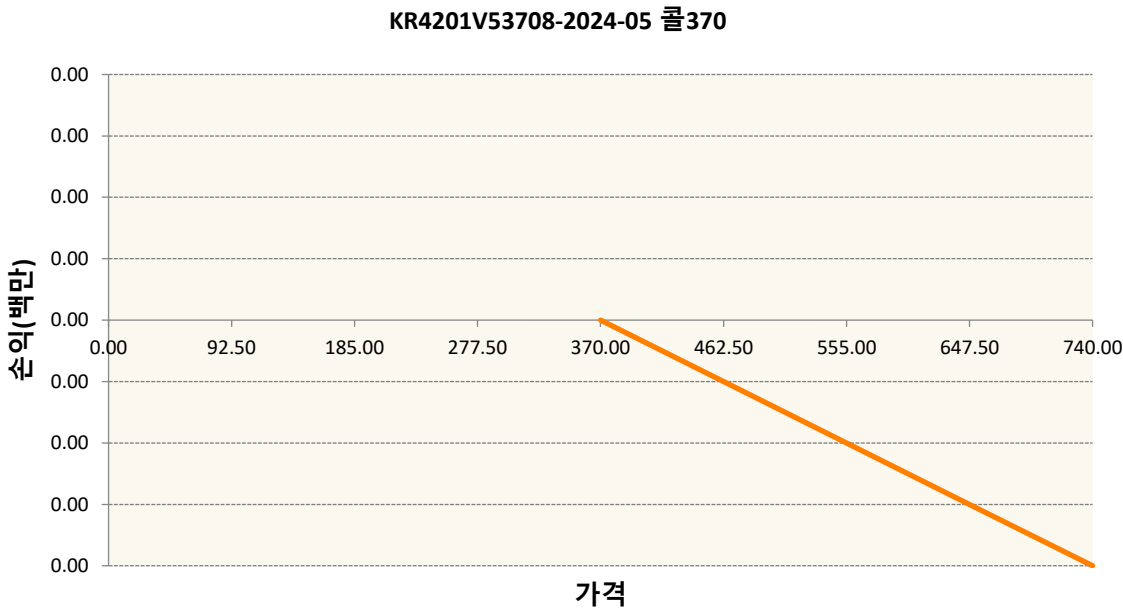
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

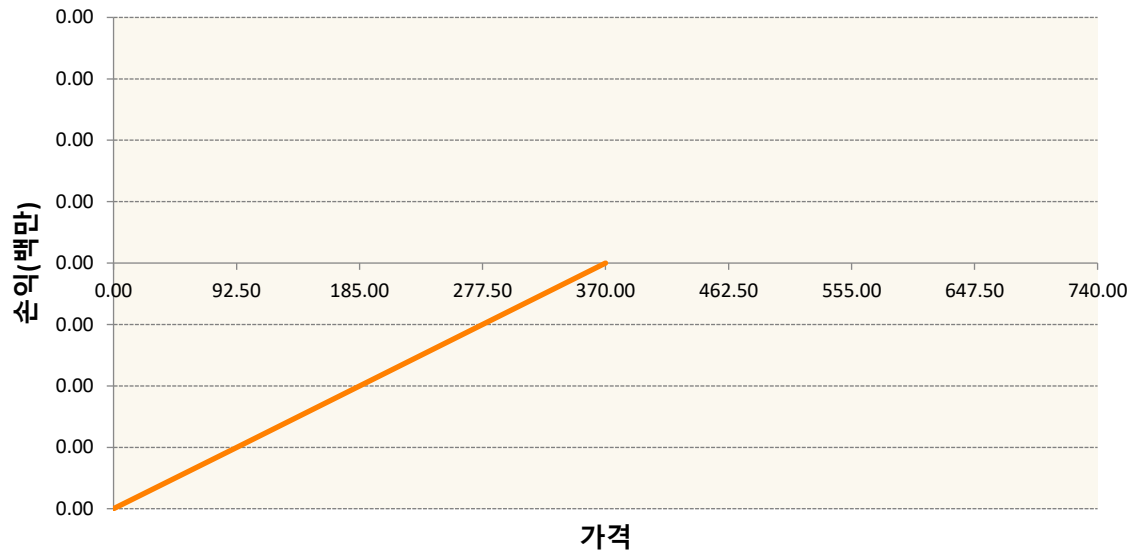
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	37,571	-37,571	장내
누계	유가증권	옵션	0	47,731	-47,731	장내

2. 만기시점의 손익구조



KR4301V53706-2024-05 풋370



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201V53708		2024-05 콜370					1,504
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	651	631	607	579	548	513	476
-5.33%	585	549	509	466	420	373	323
-2.67%	442	389	334	277	220	162	104
0%	189	126	63	0	-63	-126	-190
2.67%	-188	-249	-310	-372	-434	-497	-559
5.33%	-679	-727	-778	-832	-887	-943	-1,000
8.00%	-1,255	-1,287	-1,324	-1,365	-1,409	-1,455	-1,504
KR4201V53724		2024-05 콜372.5					783
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	315	307	295	282	266	249	231
-5.33%	287	269	250	228	205	181	156
-2.67%	221	194	166	137	108	77	47
0%	101	67	34	0	-34	-68	-102
2.67%	-86	-119	-154	-188	-222	-257	-291
5.33%	-336	-364	-394	-424	-455	-487	-519
8.00%	-636	-656	-678	-702	-728	-755	-783
KR4301V53706		2024-05 풋370					542
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-529	-529	-531	-532	-535	-538	-542
-5.33%	-313	-317	-321	-326	-332	-339	-346
-2.67%	-115	-124	-133	-143	-154	-164	-175
0%	39	26	13	0	-13	-26	-39

2.67%	131	119	108	95	83	71	58
5.33%	170	164	156	148	140	130	120
8.00%	182	179	176	172	167	162	155

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

(단위:백만원)

2,687

공시일	2024-04-15
기준일	2024-04-12

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	1,759	0	1,759	

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	2024-04-15
기준일	2024-04-12

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	4,394	0	4,394	

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	2024-04-15
기준일	2024-04-12

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	15,798	0	15,798	
누계	통화	선도	0	15,934	-15,934	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213E1W KRW/USD 30-04-24E	257
FXW213E2TC KRW/USD 31-05-24E	594
FXW213E3TC KRW/USD 28-06-24E	424
IE00BD8RGM75	

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

588

공시일	2024-04-15
기준일	2024-04-12

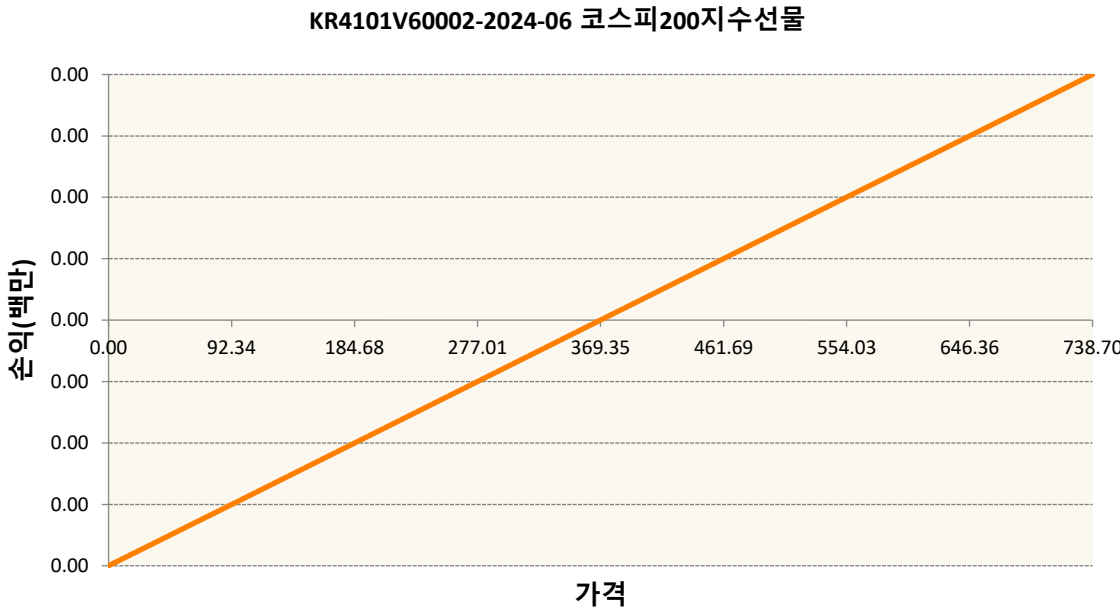
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

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	462	0	462	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%	-24	-24	-24	-24	-24	-24	-24
-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%	24	24	24	24	24	24	24
8.00%	37	37	37	37	37	37	37

공시일	2024-04-15
기준일	2024-04-12

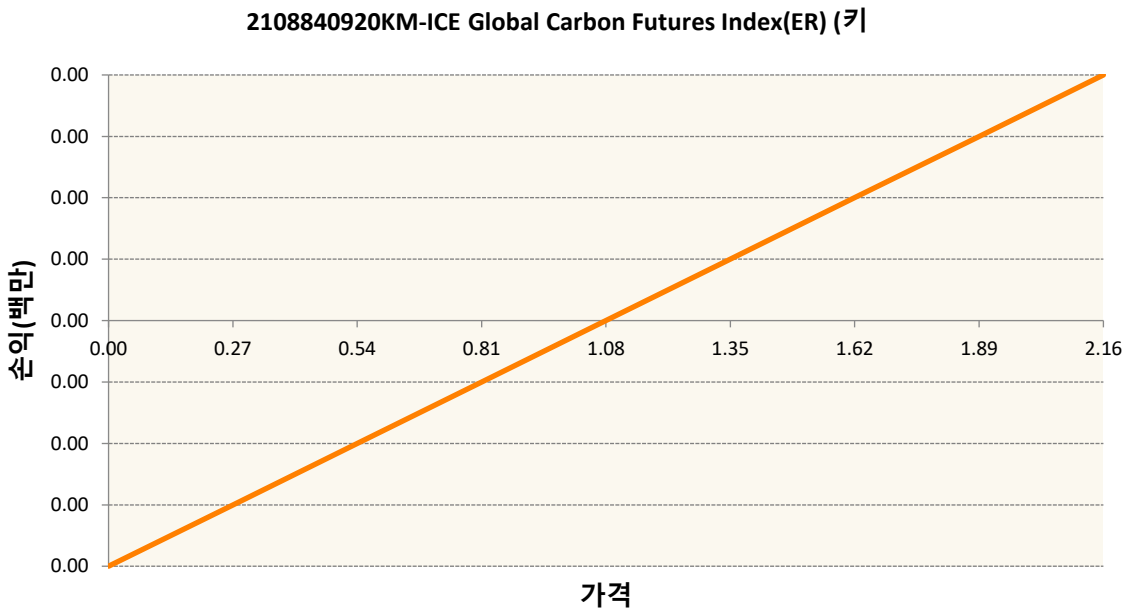
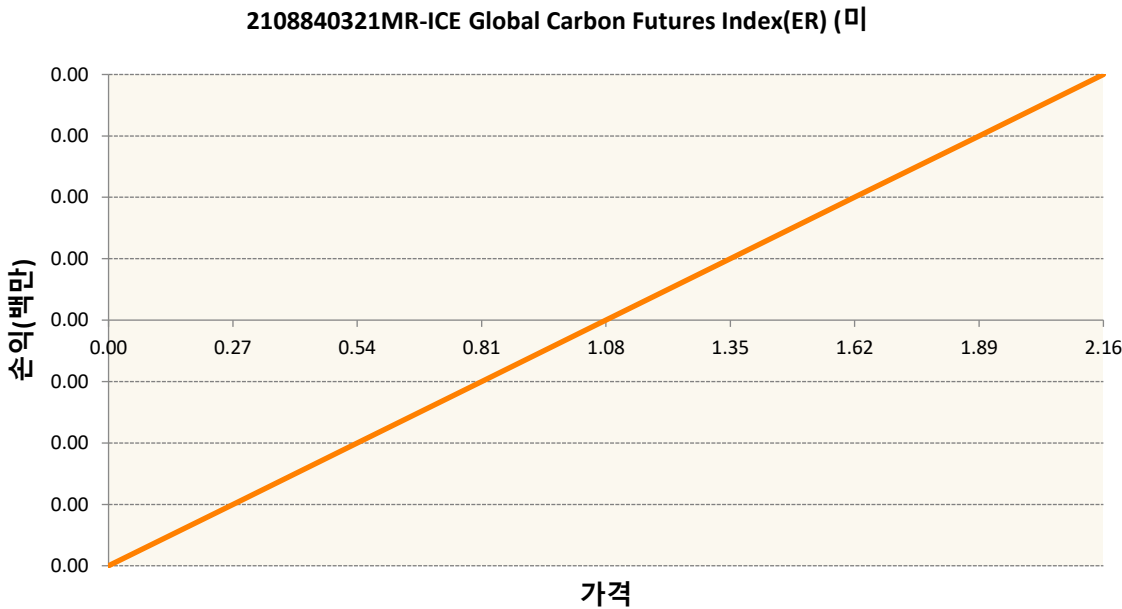
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

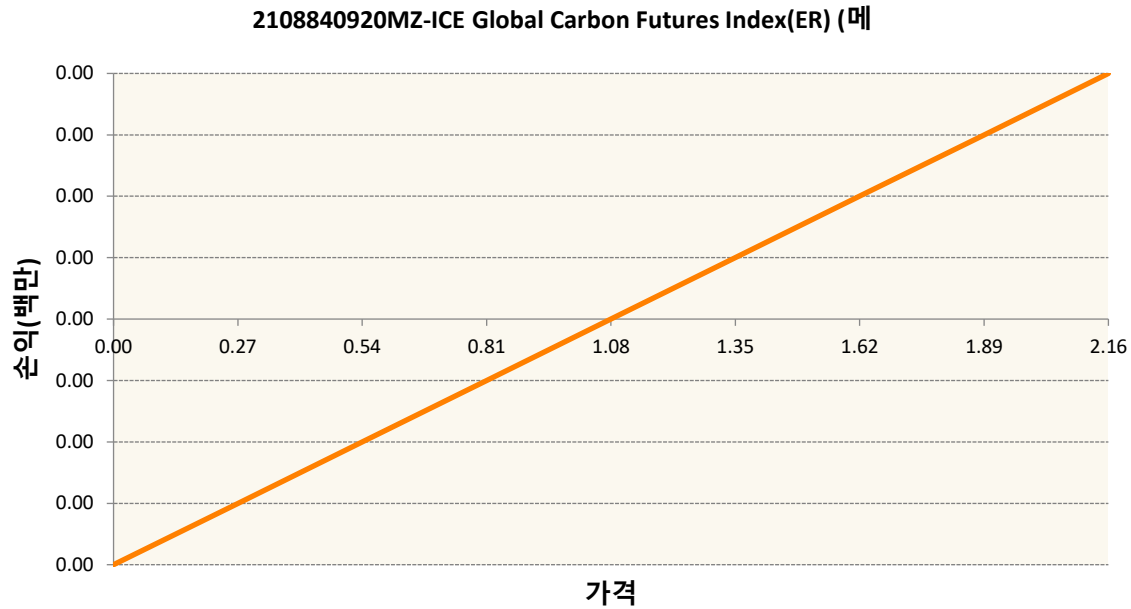
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	19,915	0	19,915	

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108840321IICE Global Carbon Futures Index(ER) (미		469
2108840920IICE Global Carbon Futures Index(ER) (키		939
2108840920IICE Global Carbon Futures Index(ER) (메		188

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)		(단위:백만원)
		1,854

공시일	2024-04-15
기준일	2024-04-12

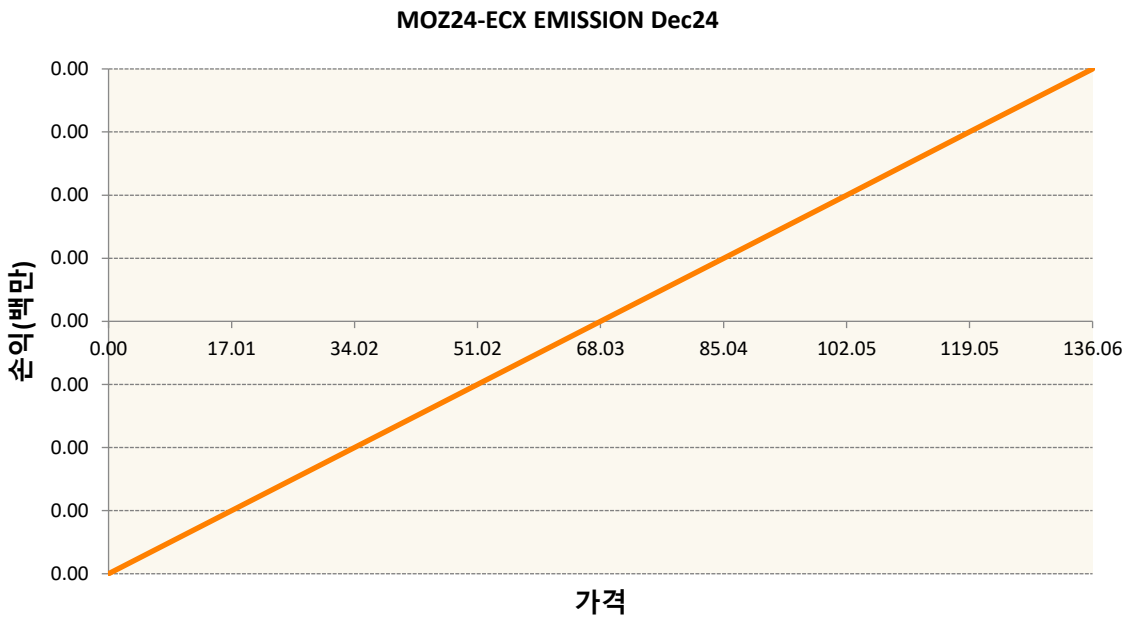
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	10,183	0	10,183	
누계	지수	스왑	331	0	331	장외
누계	통화	선도	0	2,608	-2,608	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	815
SWICEUACN ICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX	3

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

(단위:백만원)

1,565

공시일	2024-04-15
기준일	2024-04-12

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	2024-04-15
기준일	2024-04-12

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)	11
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(NH)	9
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(메리츠)	13
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(키움)	3

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

(단위:백만원)

39

공시일	2024-04-15
기준일	2024-04-12

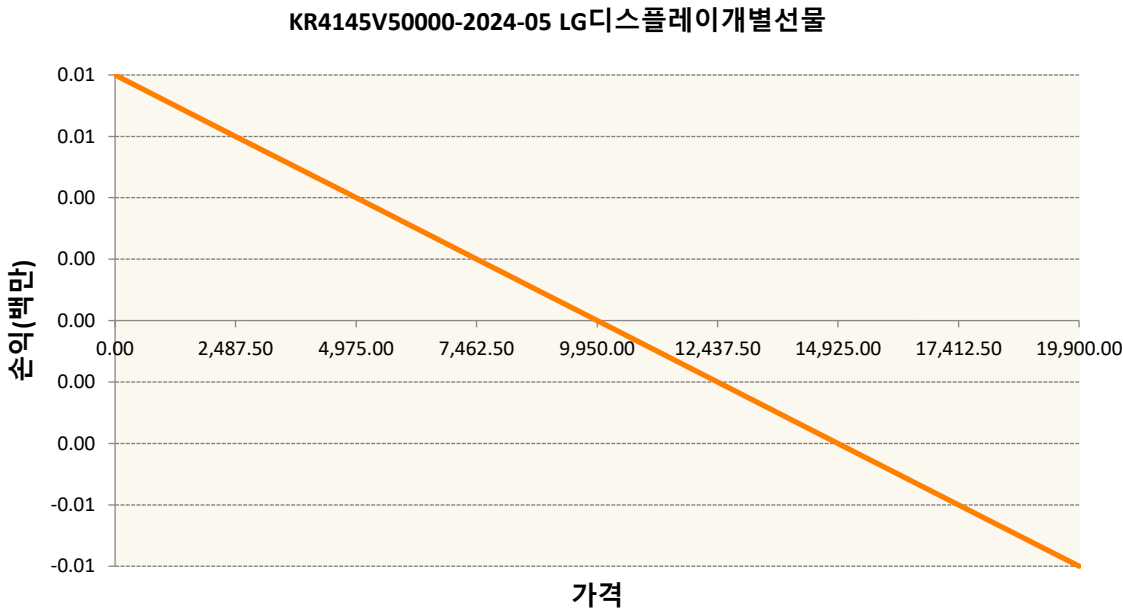
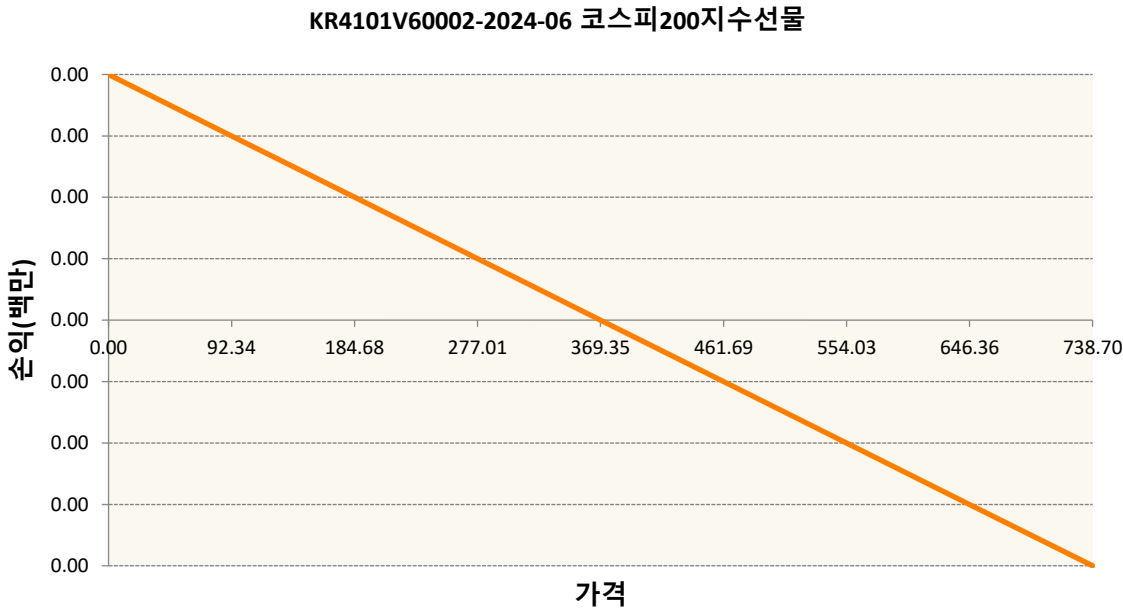
에퀴티알파일반사모혼합자산

1. 계약금액

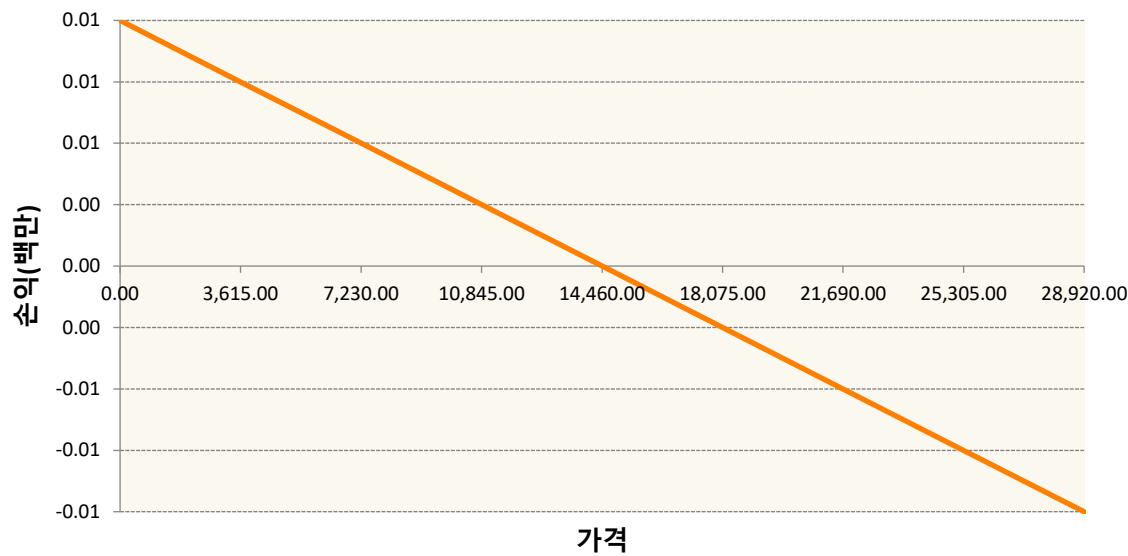
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	42	-42	장내
누계	유가증권	선물	0	656	-656	장내

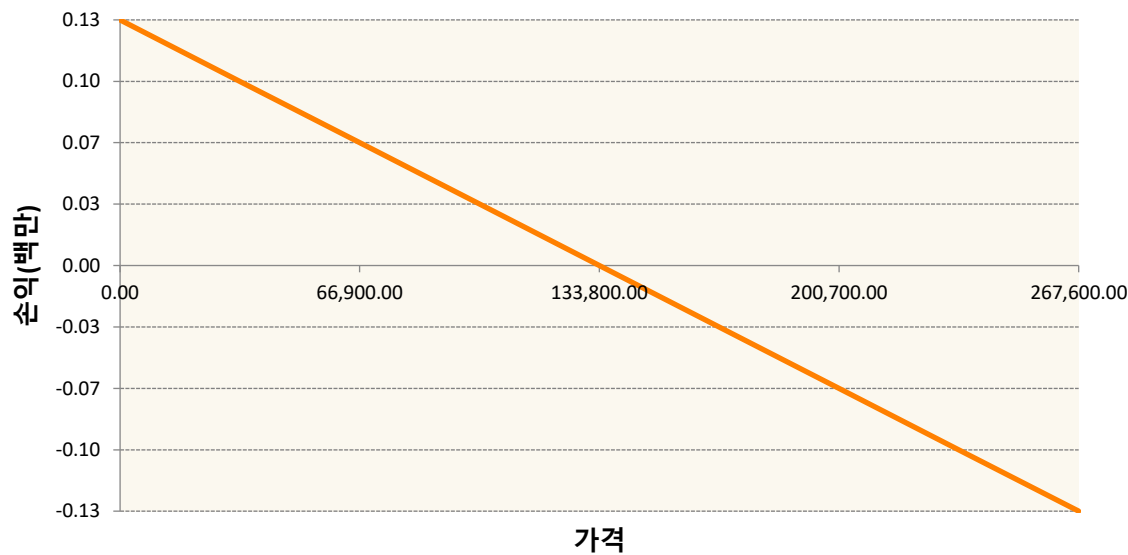
2. 만기시점의 손익구조



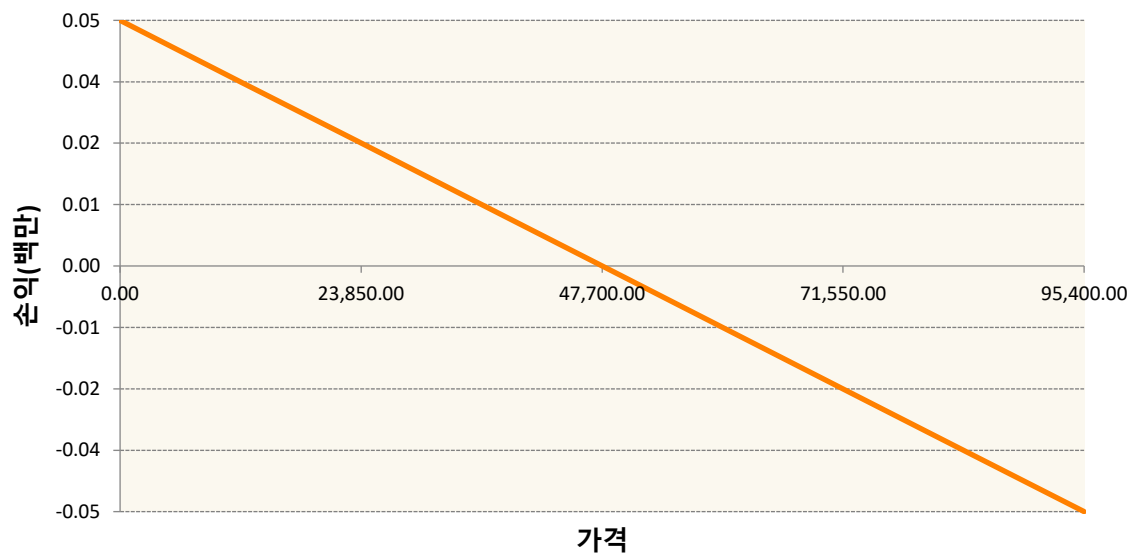
KR4151V50008-2024-05 GS건설개별선물



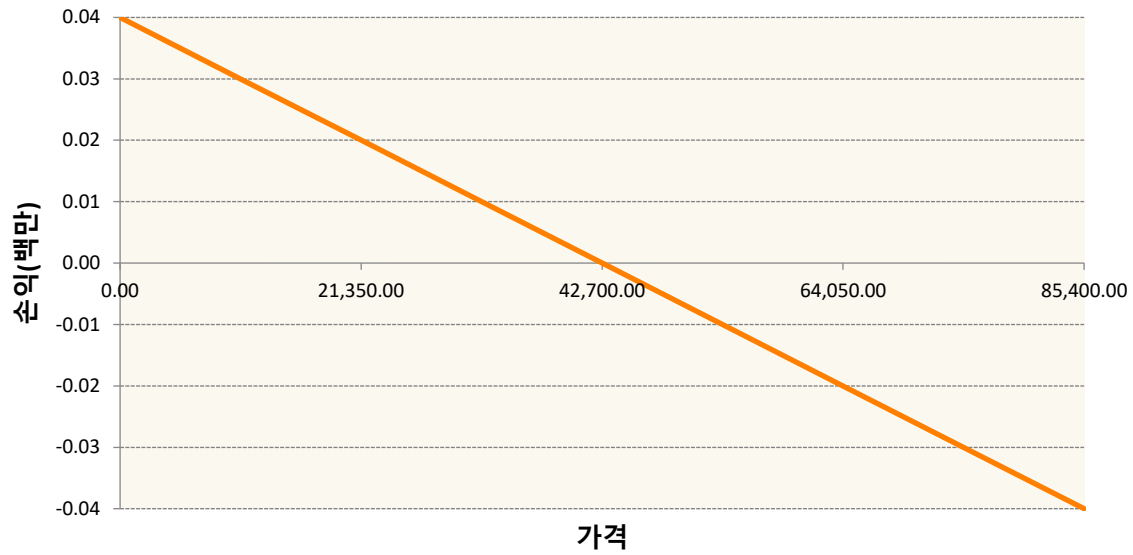
KR41C6V50009-2024-05 아모레퍼시픽개별선물



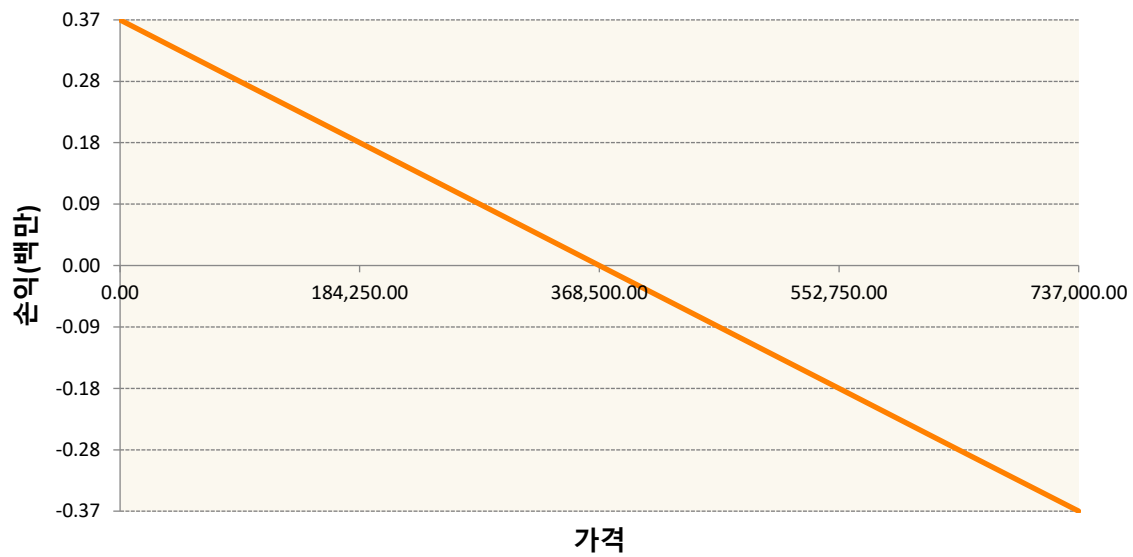
KR41CFV50008-2024-05 카카오개별선물



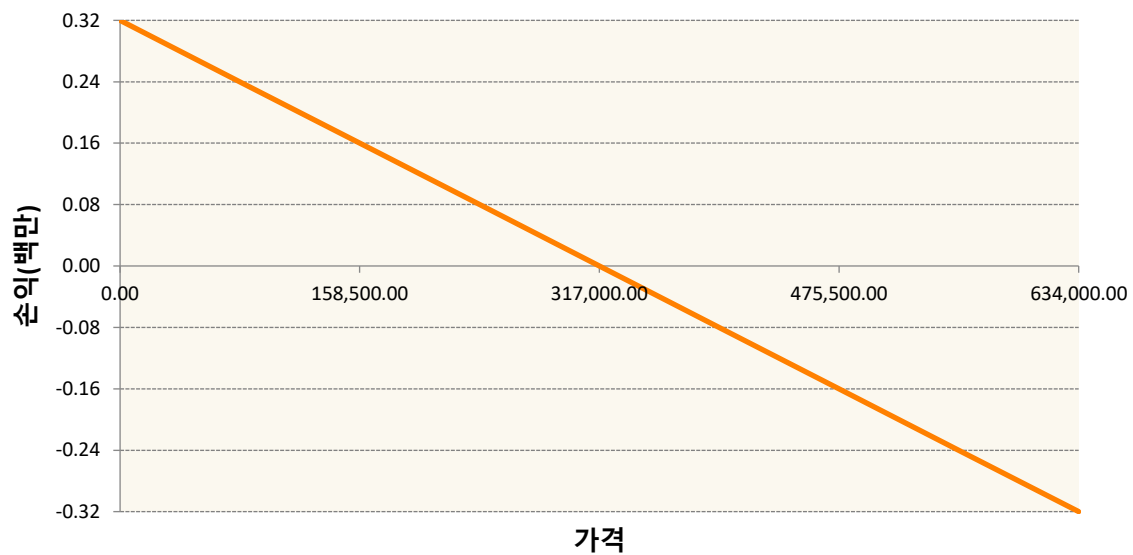
KR41CNV50002-2024-05 포스코DX개별선물



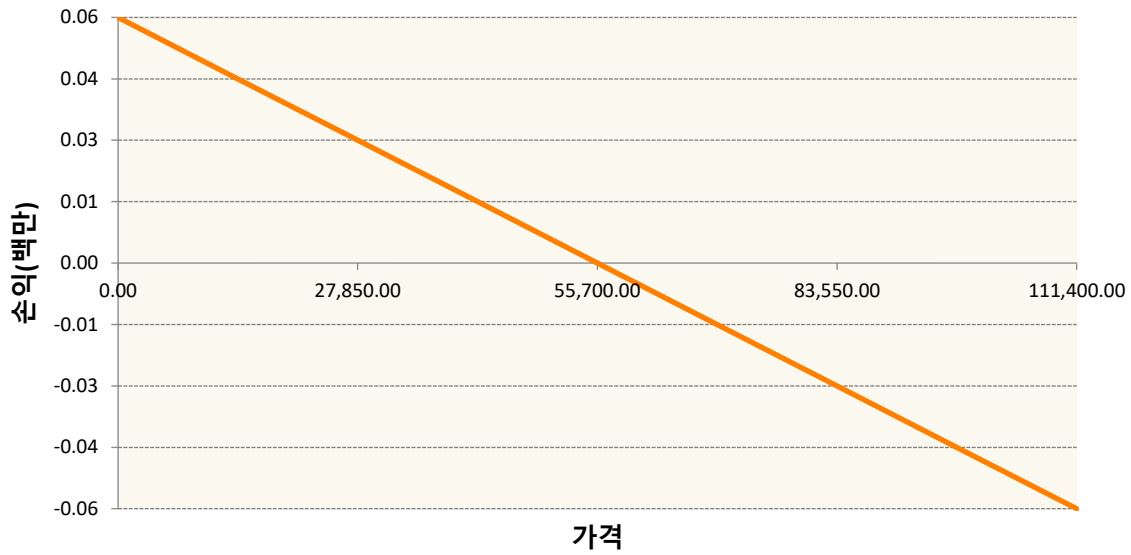
KR41CRV50003-2024-05 LG생활건강개별선물



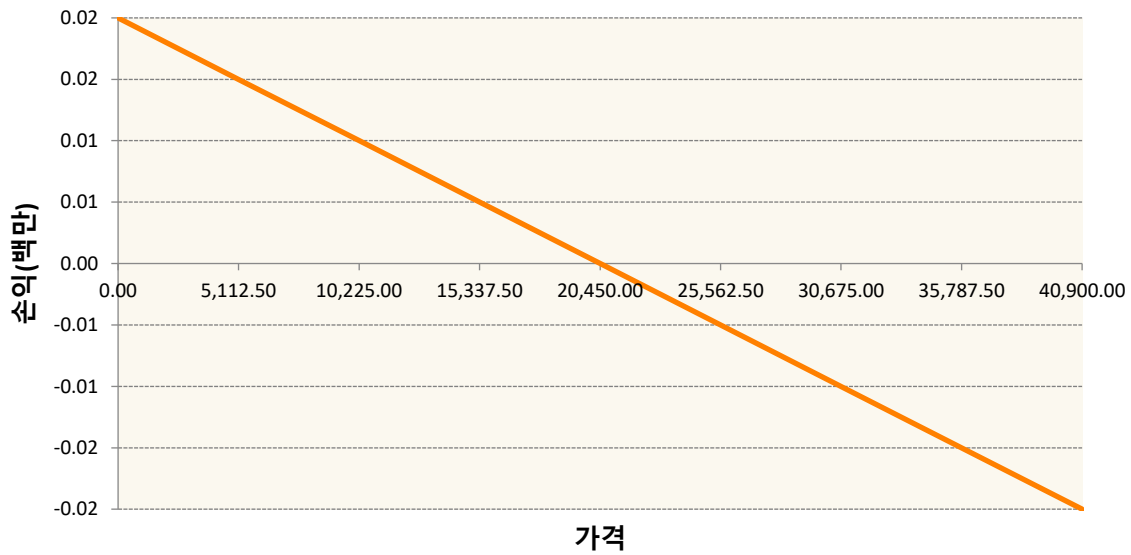
KR41D1V50009-2024-05 CJ제일제당개별선물



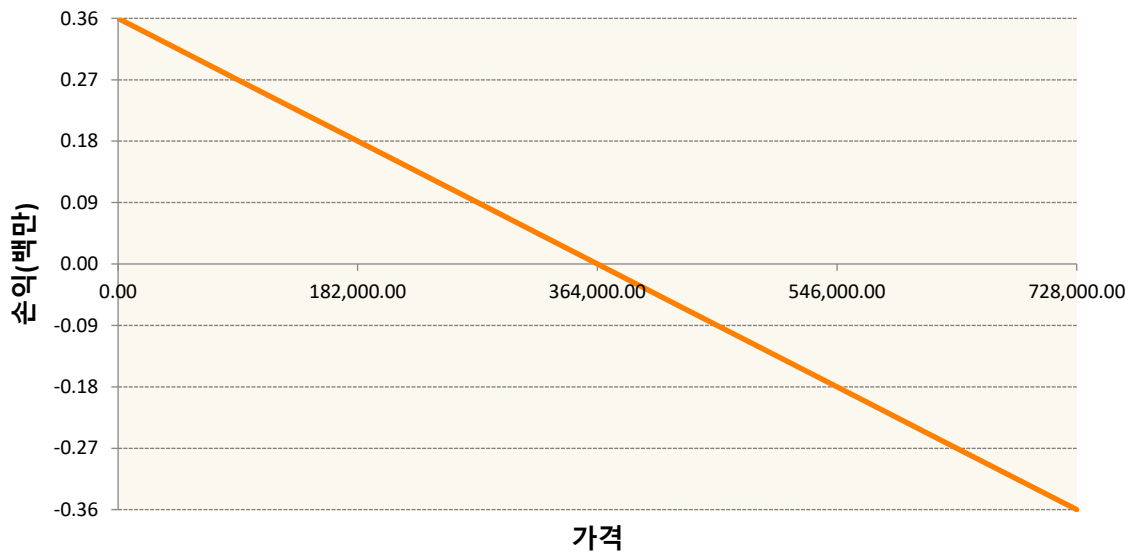
KR41E5V50009-2024-05 넷마블개별선물



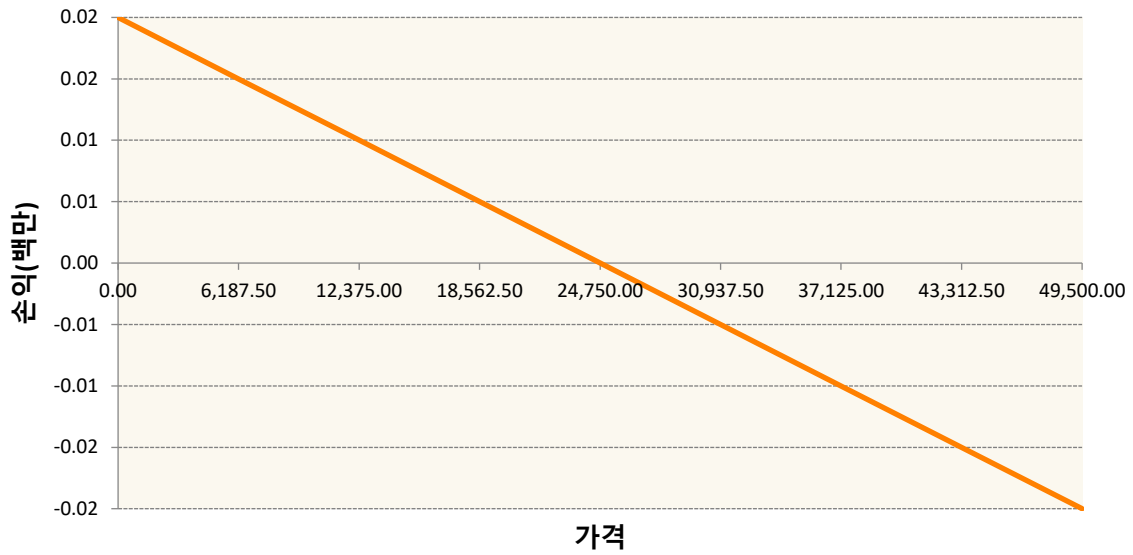
KR41EXV50007-2024-05 카카오게임즈개별선물



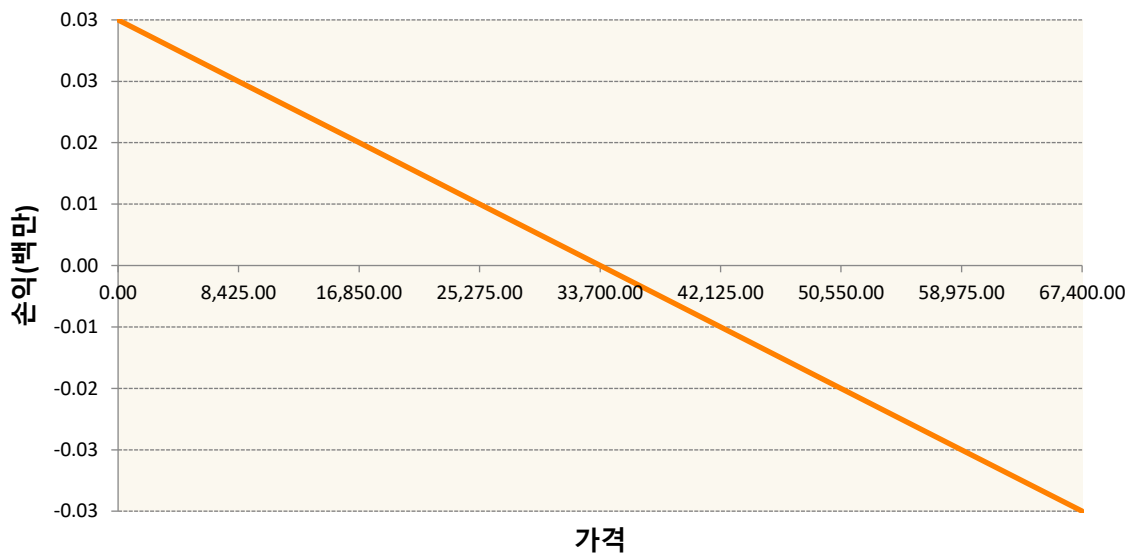
KR41F5V50008-2024-05 LG에너지솔루션개별선물



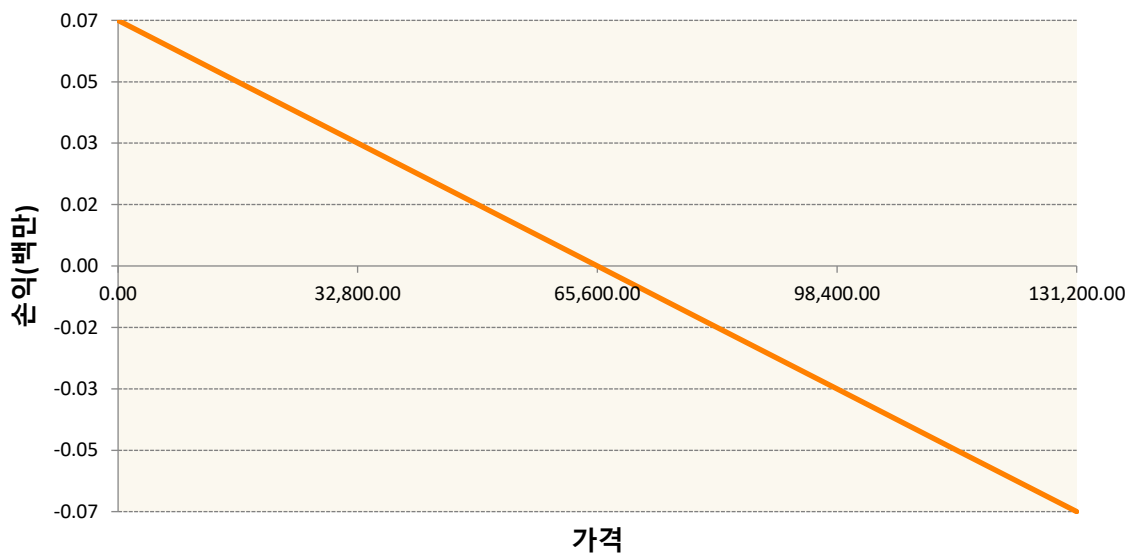
KR41F6V50006-2024-05 카카오뱅크개별선물



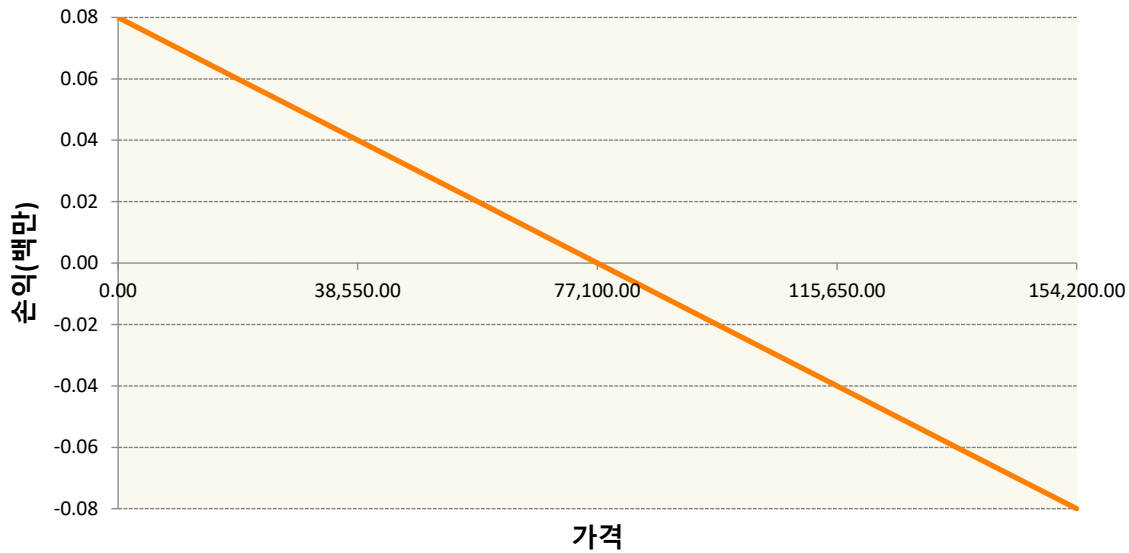
KR41F7V50004-2024-05 카카오페이개별선물



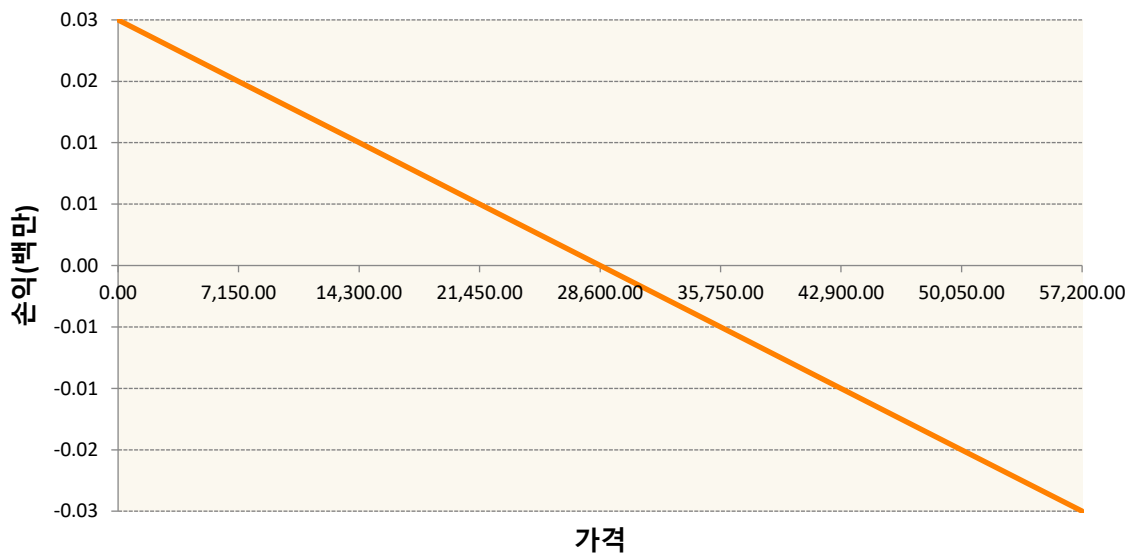
KR41FBV50000-2024-05 SK아이이테크놀로지개별선물



KR41FEV50004-2024-05 SK스퀘어개별선물



KR41FVV50008-2024-05 한화오션개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101V600 2024-06 코스피200지수선물	44
KR4145V500 2024-05 LG디스플레이개별선물	1
KR4151V500 2024-05 GS건설개별선물	0.22
KR41C6V500 2024-05 아모레퍼시픽개별선물	0.11
KR41CFV500 2024-05 카카오개별선물	0.42
KR41CNV500 2024-05 포스코DX개별선물	1
KR41CRV500 2024-05 LG생활건강개별선물	1
KR41D1V500 2024-05 CJ제일제당개별선물	1
KR41E5V500 2024-05 넷마블개별선물	0.27
KR41EXV500 2024-05 카카오게임즈개별선물	1
KR41F5V500 2024-05 LG에너지솔루션개별선물	1
KR41F6V500 2024-05 카카오뱅크개별선물	1

KR41F7V500 2024-05 카카오페이개별선물	0.27
KR41FBV500 2024-05 SK아이이테크놀로지개별선물	0.26
KR41FEV500 2024-05 SK스퀘어개별선물	0.19
KR41FVV500 2024-05 한화오션개별선물	0.21

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	60

공시일	2024-04-15
기준일	2024-04-12

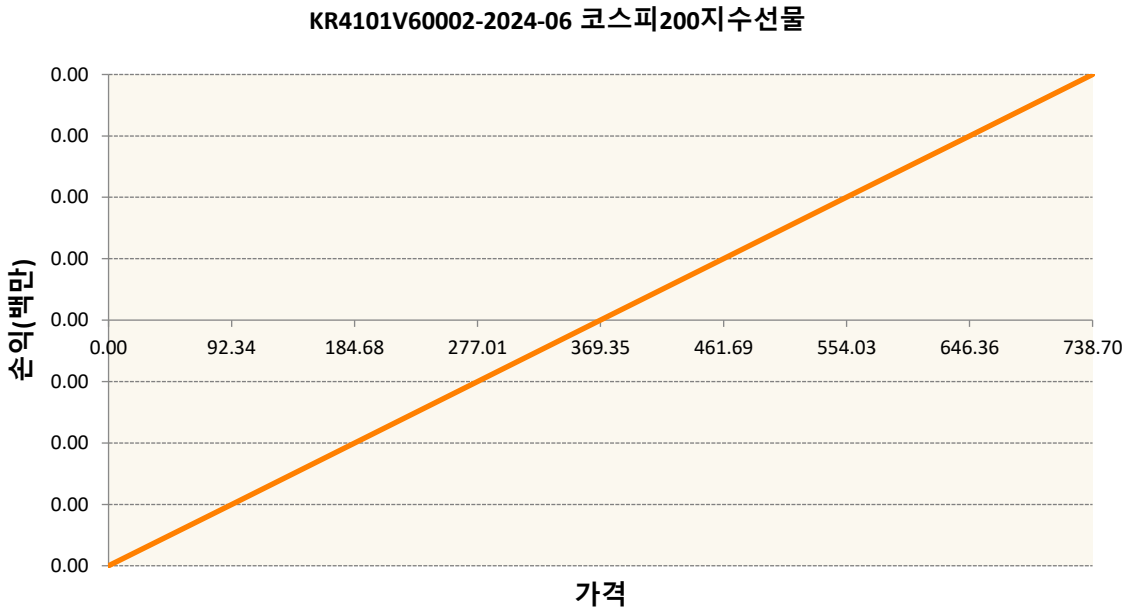
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	92	0	92	장내
누계	유가증권	선물	3,047	0	3,047	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101V60002		2024-06 코스피200지수선물					242
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-242	-242	-242	-242	-242	-242	-242
-5.33%	-162	-162	-162	-162	-162	-162	-162
-2.67%	-81	-81	-81	-81	-81	-81	-81
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	81	81	81	81	81	81	81
5.33%	162	162	162	162	162	162	162
8.00%	242	242	242	242	242	242	242

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

(단위:백만원)

222

공시일	2024-04-15
기준일	2024-04-12

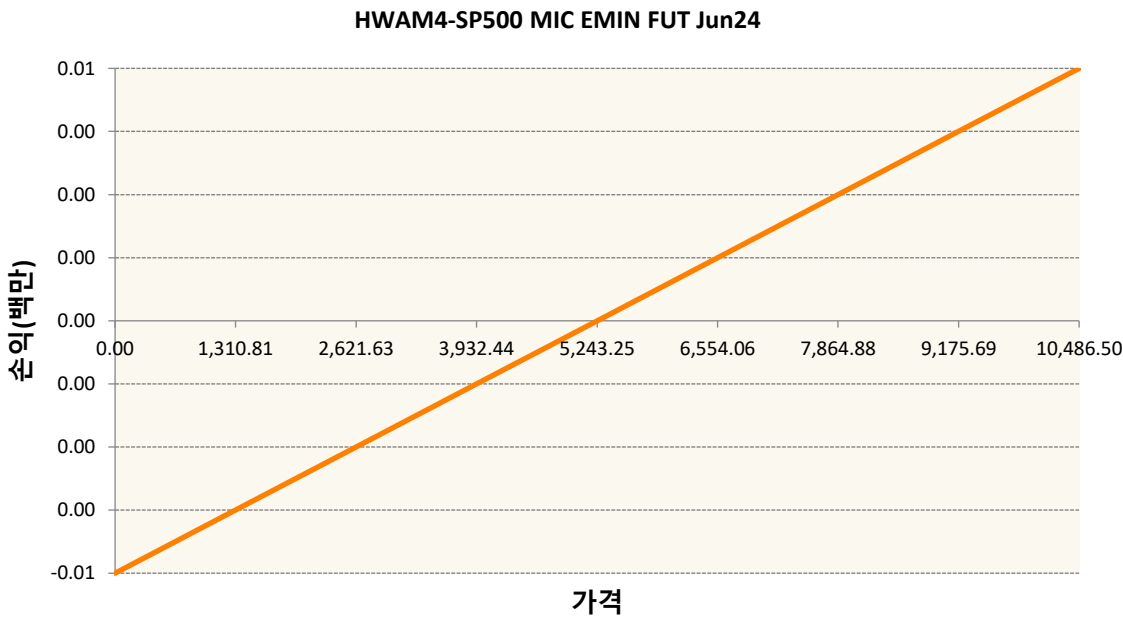
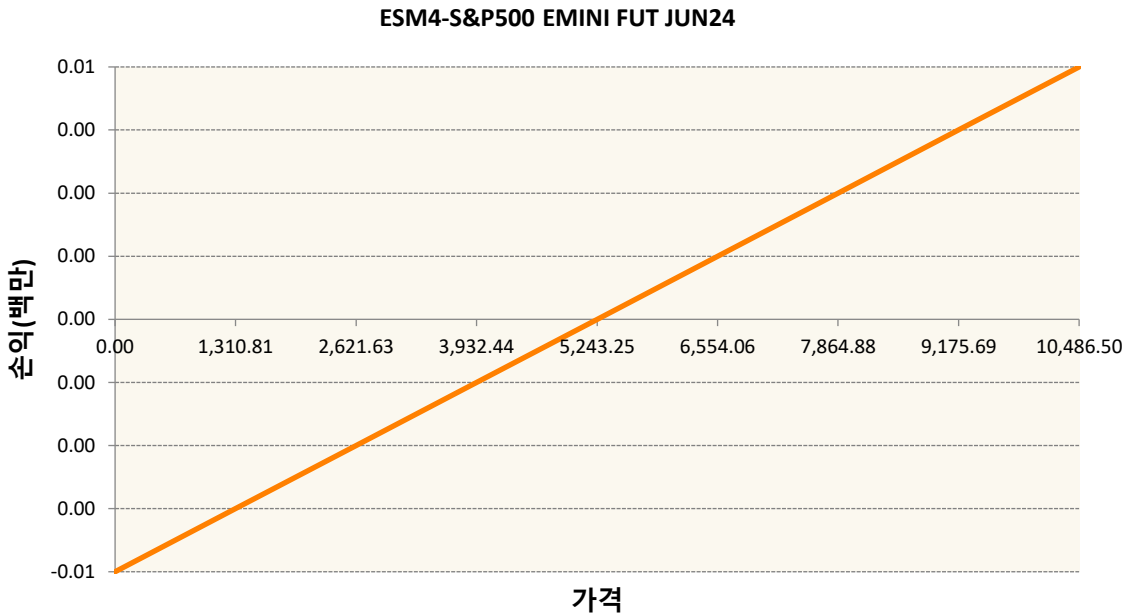
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

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	4,509	0	4,509	
누계	유가증권	선물	1,906	0	1,906	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESM4	S&P500 EMINI FUT JUN24	361
HWAM4	SP500 MIC EMIN FUT Jun24	152

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	358

공시일	2024-04-15
기준일	2024-04-12

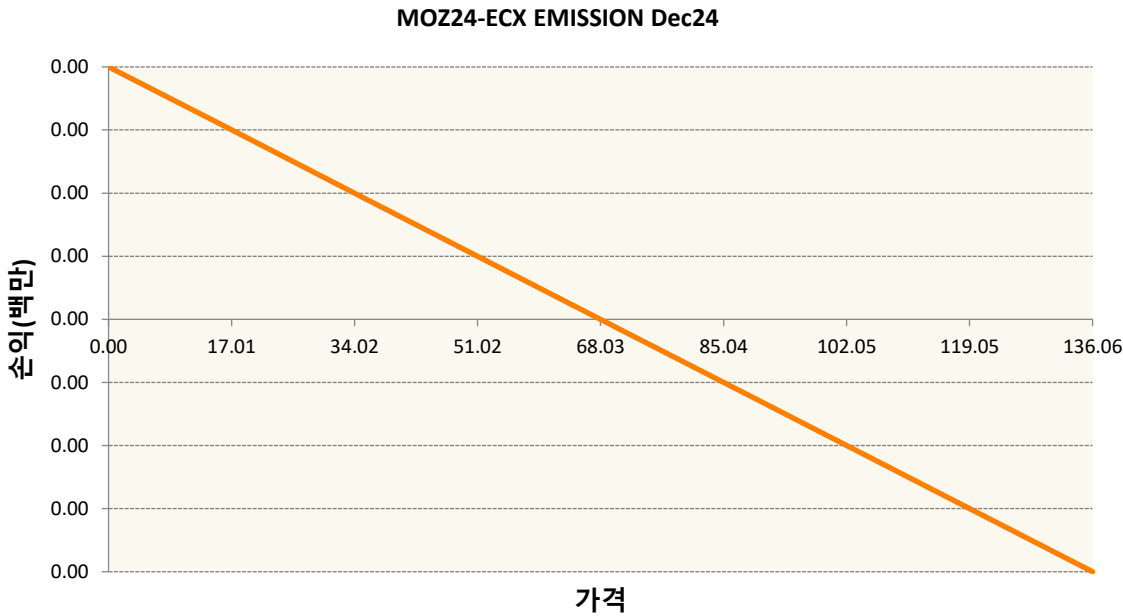
SOL유럽탄소배출권선물인버스ICE특별자산상

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	4,136	-4,136	
누계	지수	스왑	331	0	331	장외
누계	통화	선도	0	1,113	-1,113	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213E3SC KRW/EUR 30-04-24E	89
MOZ24 ECX EMISSION Dec24	331
SWICEUACN ICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX	3

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

(단위:백만원)

642

공시일	2024-04-15
기준일	2024-04-12

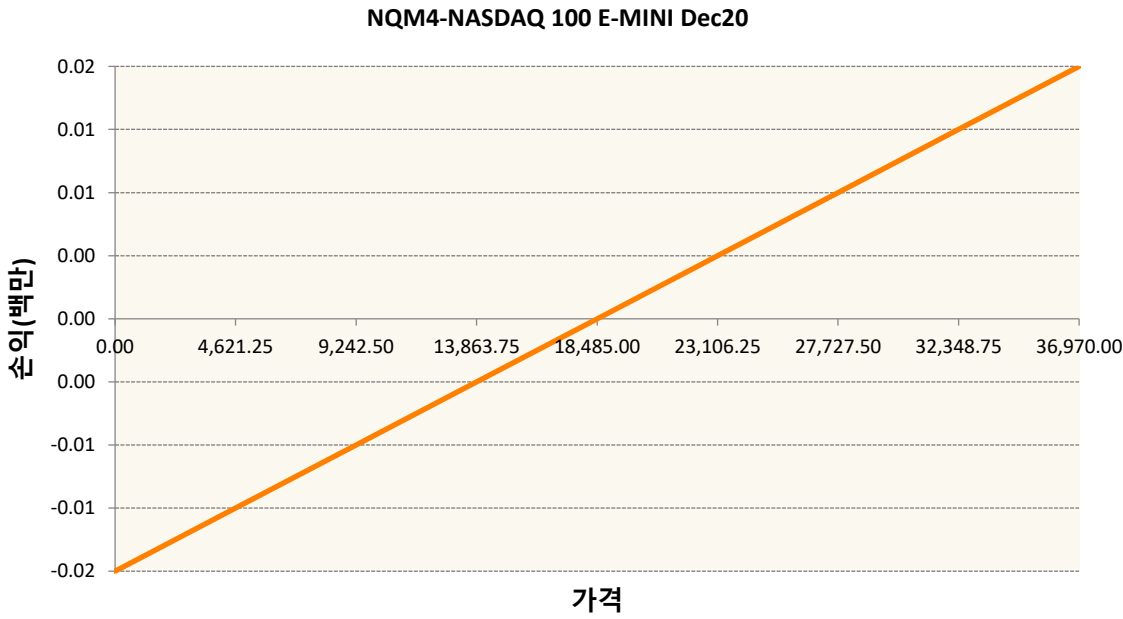
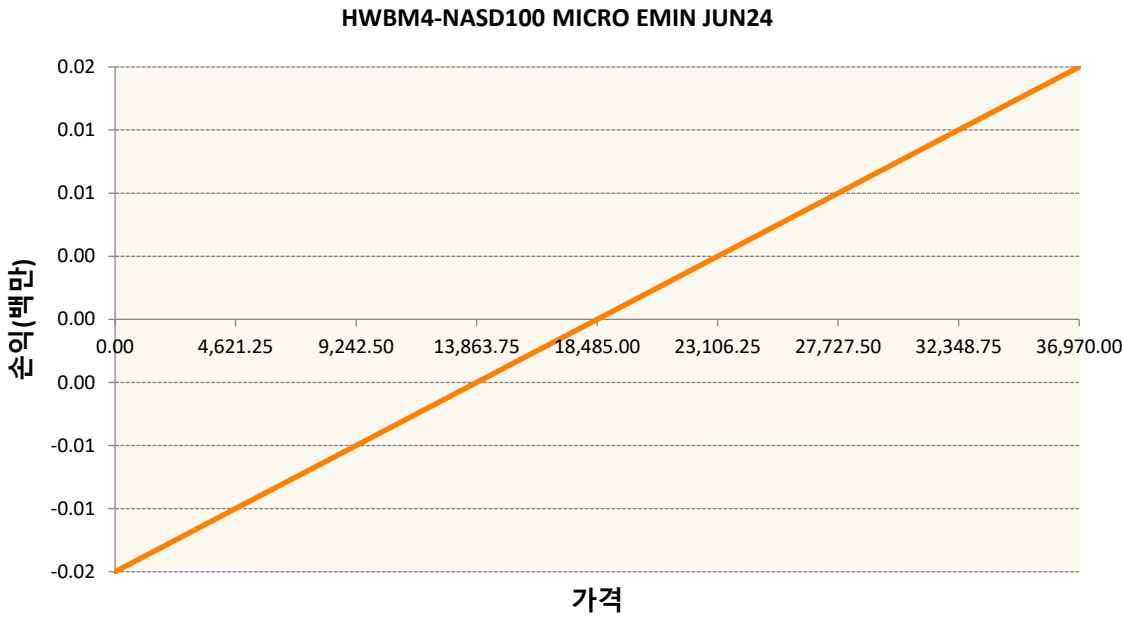
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

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	2,443	0	2,443	
누계	유가증권	선물	2,392	0	2,392	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)
			319

공시일	2024-04-15
기준일	2024-04-12

SOL미국30년국채커버드콜(합성)

1. 계약금액 (단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	93,797	0	93,797	장외
누계	지수	스왑	131,531	0	131,531	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
SWKEDI0000 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	438
SWKEDI0000 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	1,604
SWKEDI0000 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	944
SWKEDI0000 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	7,528

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	6,601

공시일	2024-04-15
기준일	2024-04-12

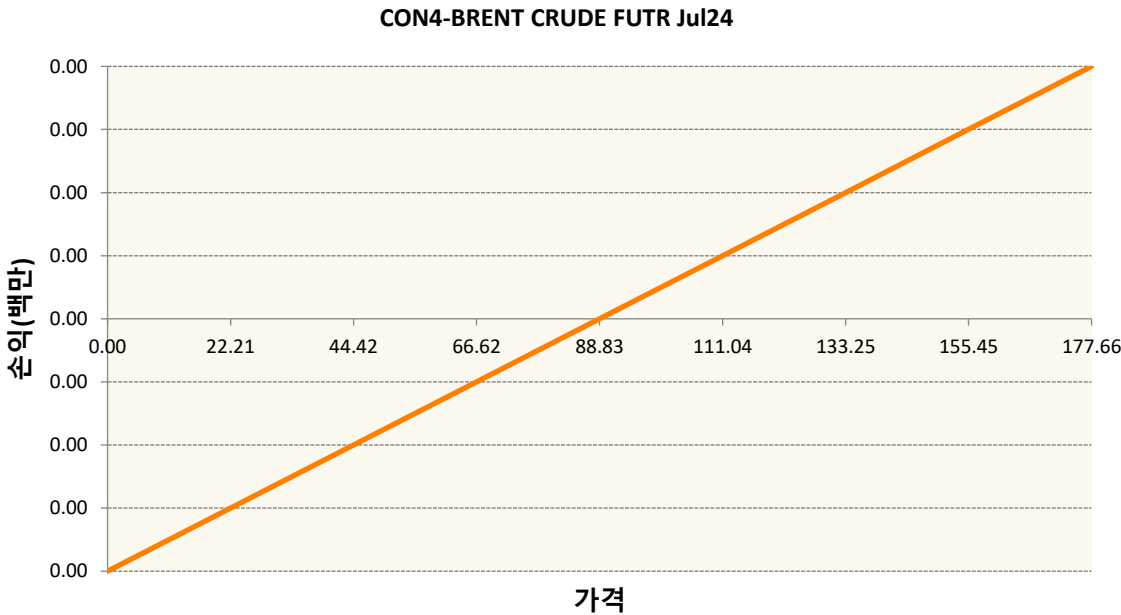
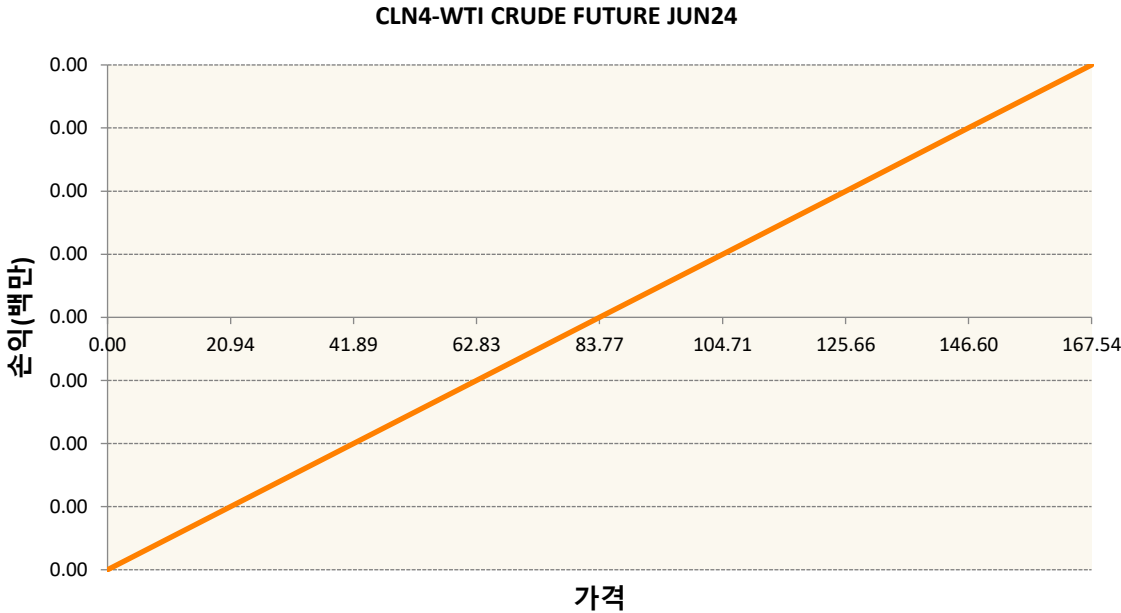
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

1. 계약금액

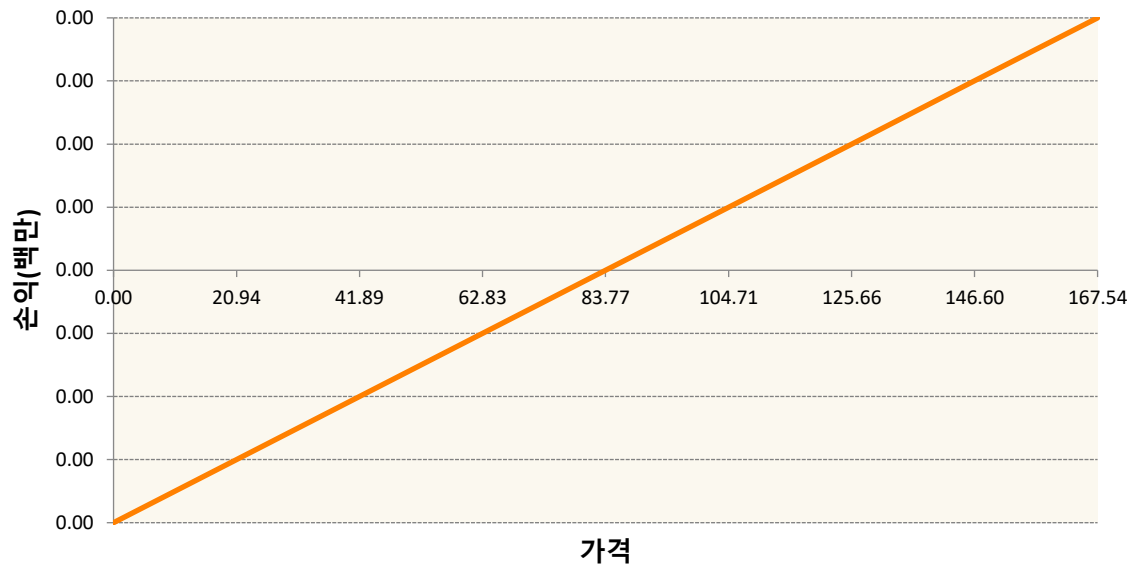
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	247	-247	장내
누계	유가증권	선물	1,152	0	1,152	
누계	통화	선물	0	248	-248	장내

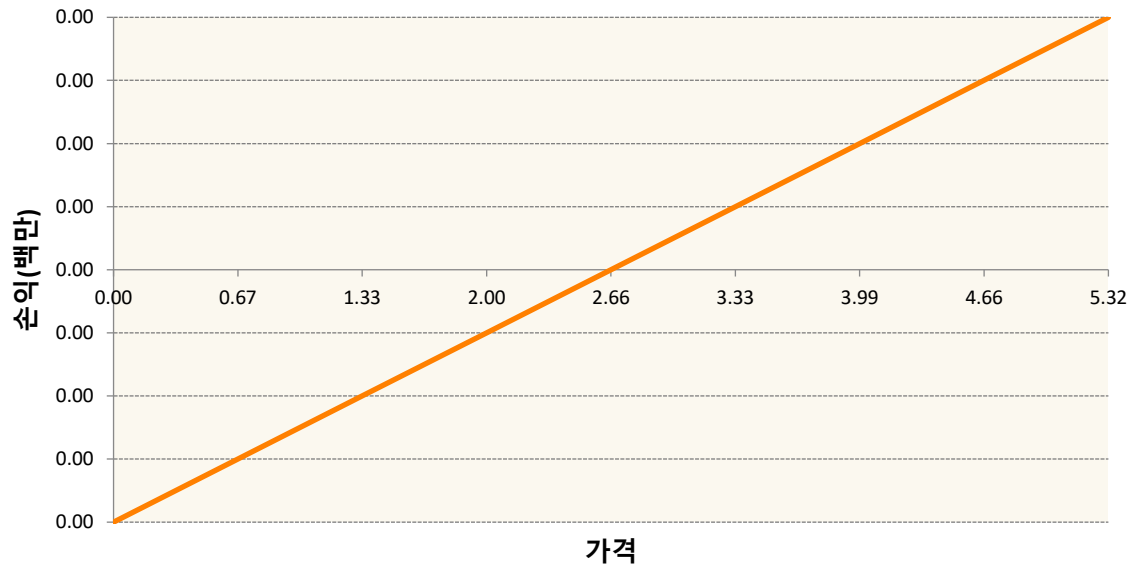
2. 만기시점의 손익구조



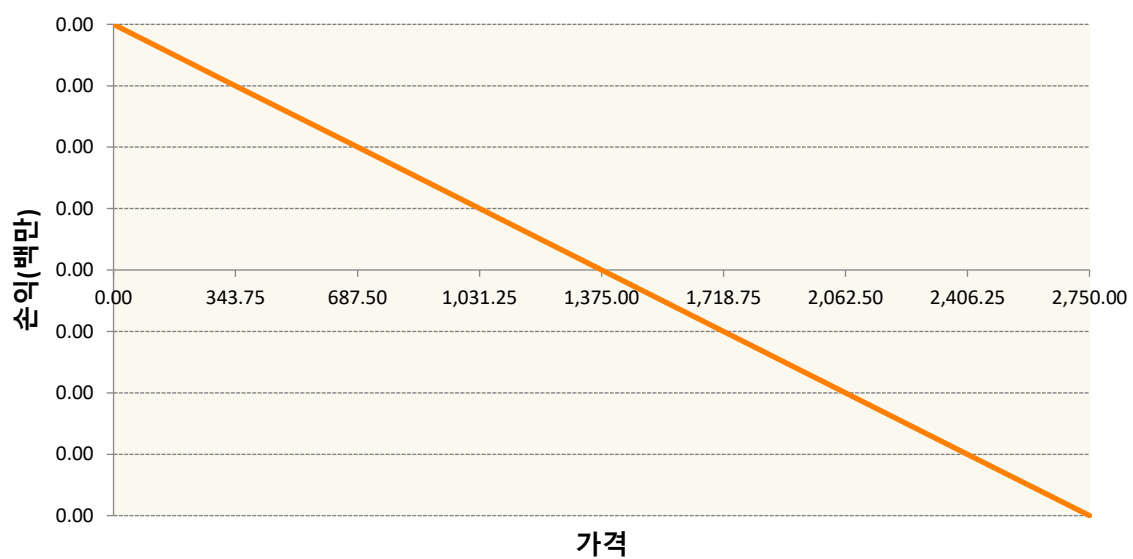
ECN4-E-mini Crude Oil JUL24



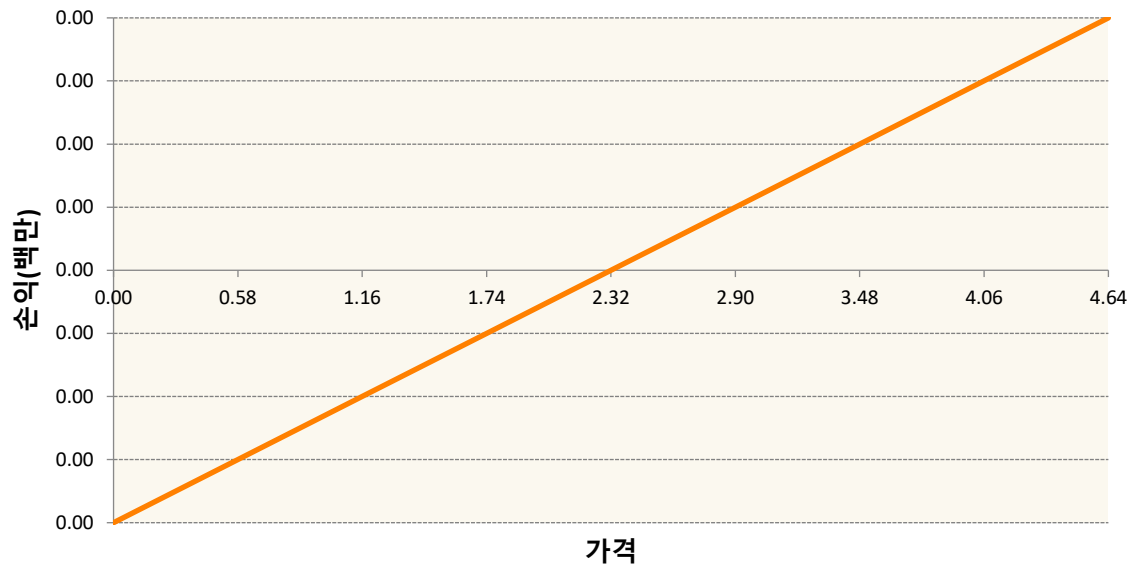
HON4-NY Harb ULSD Fut Jul24



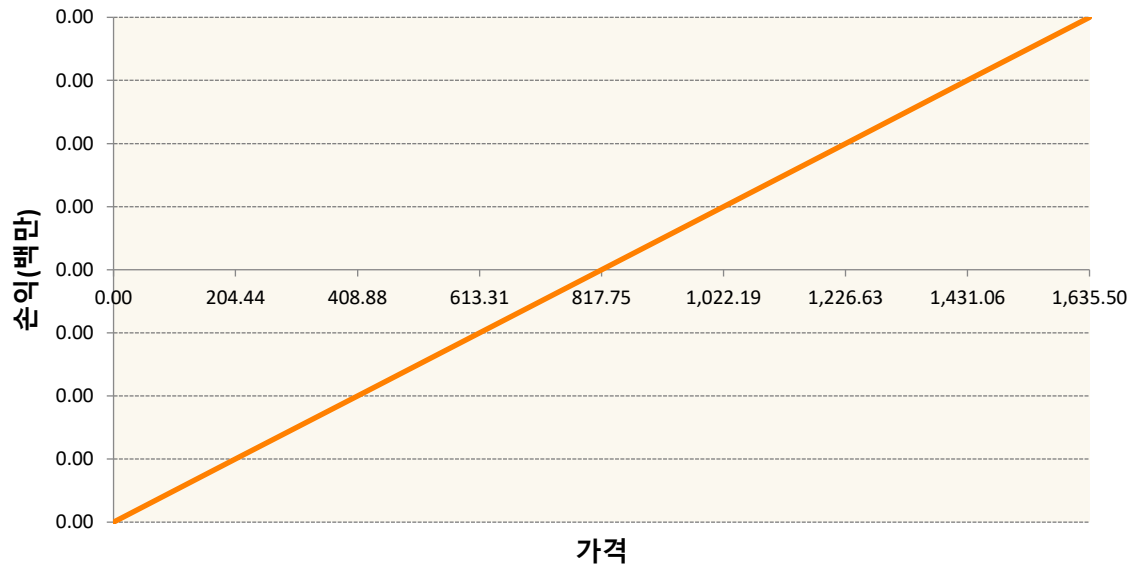
KR4175V50007-2024-05 달러선물



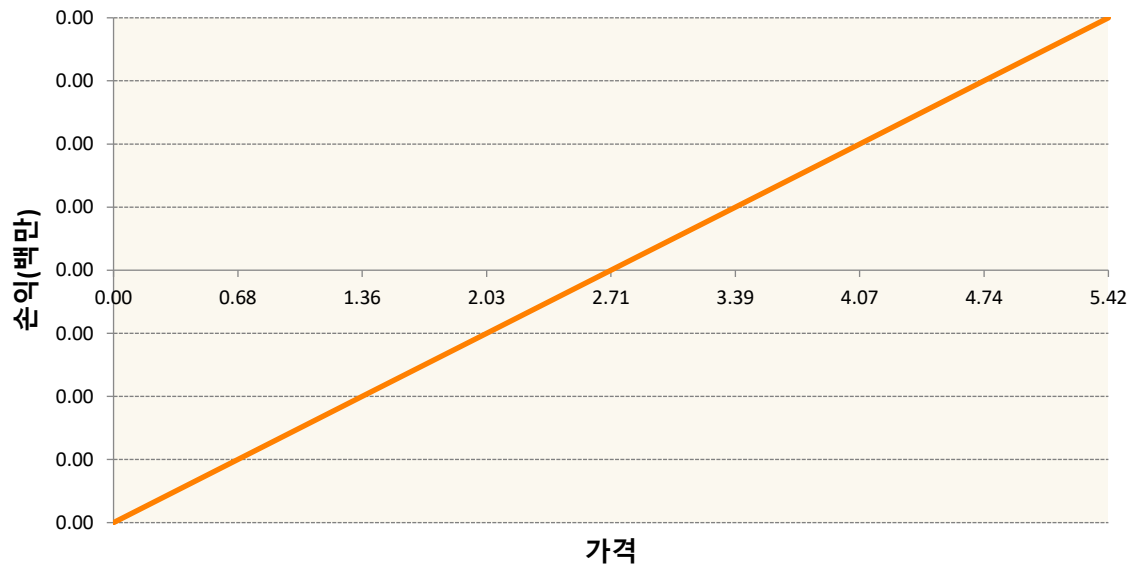
NGN24-NATURAL GAS FUTR JUL24



QSN4-Low Su Gasoil G JUL24



XBN4-GASOLINE RBOB FUT JUL24



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLN4	WTI CRUDE FUTURE JUN24	9
CON4	BRENT CRUDE FUTR Jul24	28
ECN4	E-mini Crude Oil JUL24	9
HON4	NY Harb ULSD Fut Jul24	12
KR4175V500 2024-05 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)

198