

공시일	2024-04-16
기준일	2024-04-15

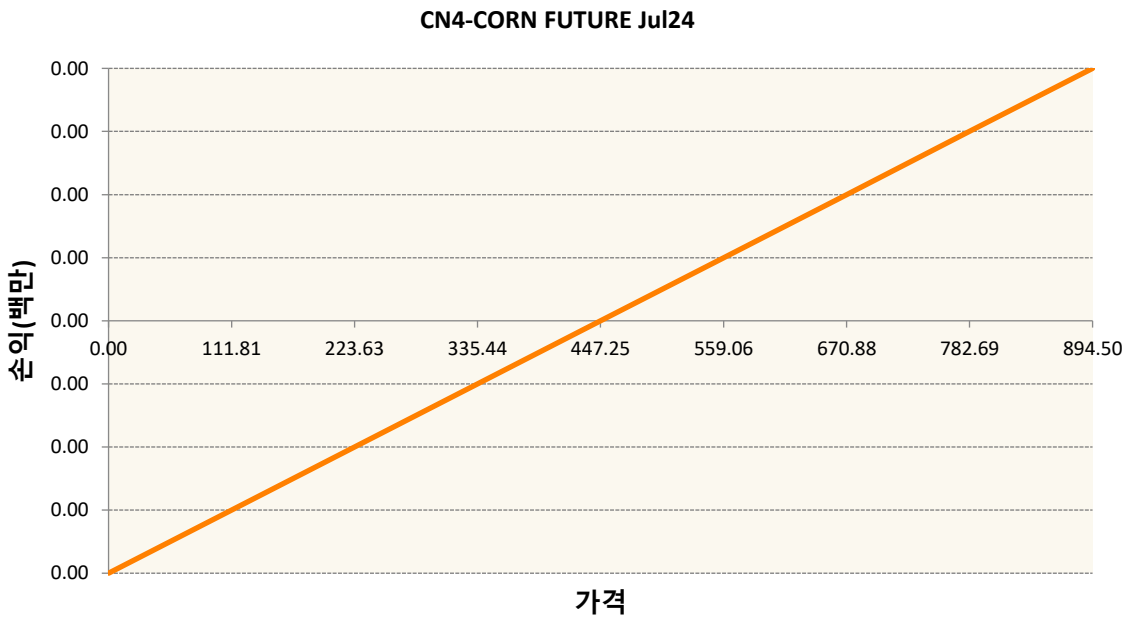
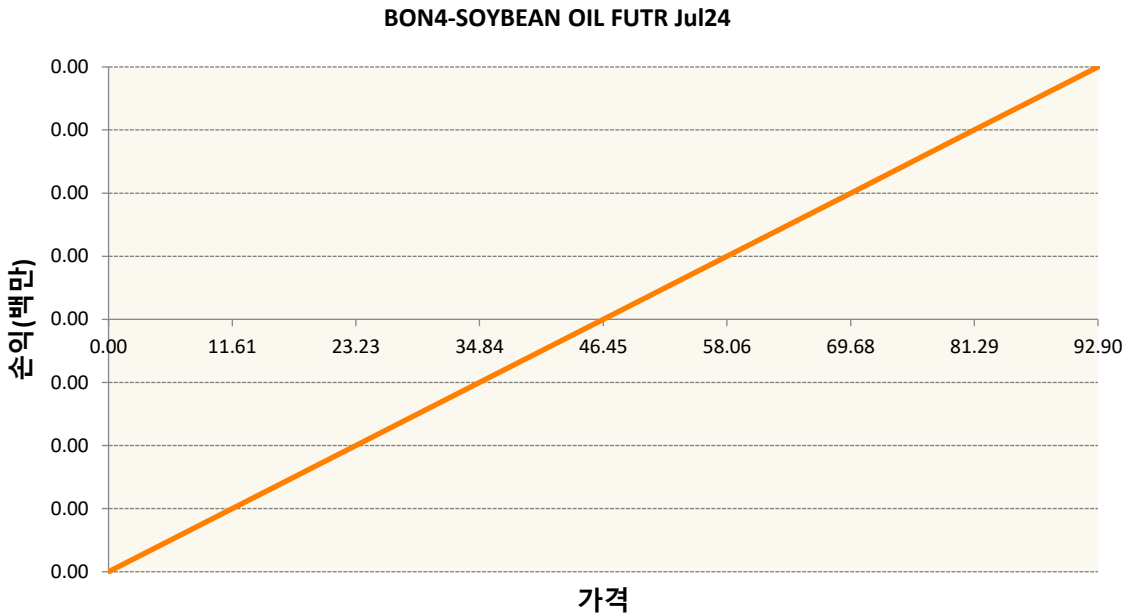
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

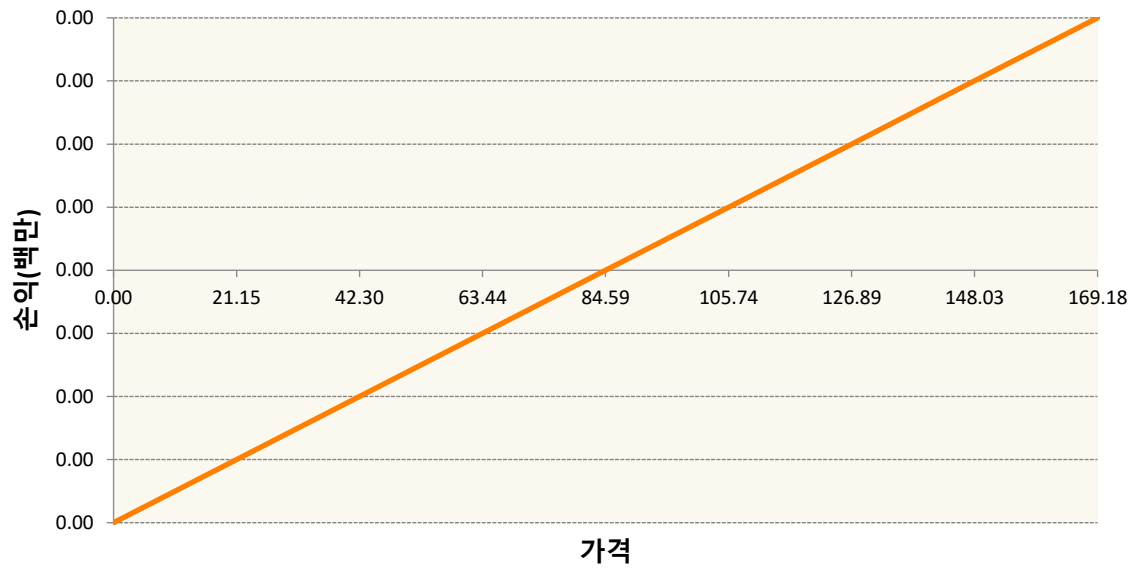
(단위:USD 백만)

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	4,262	0	4,262	
누계	통화	선물	0	538	-538	장내

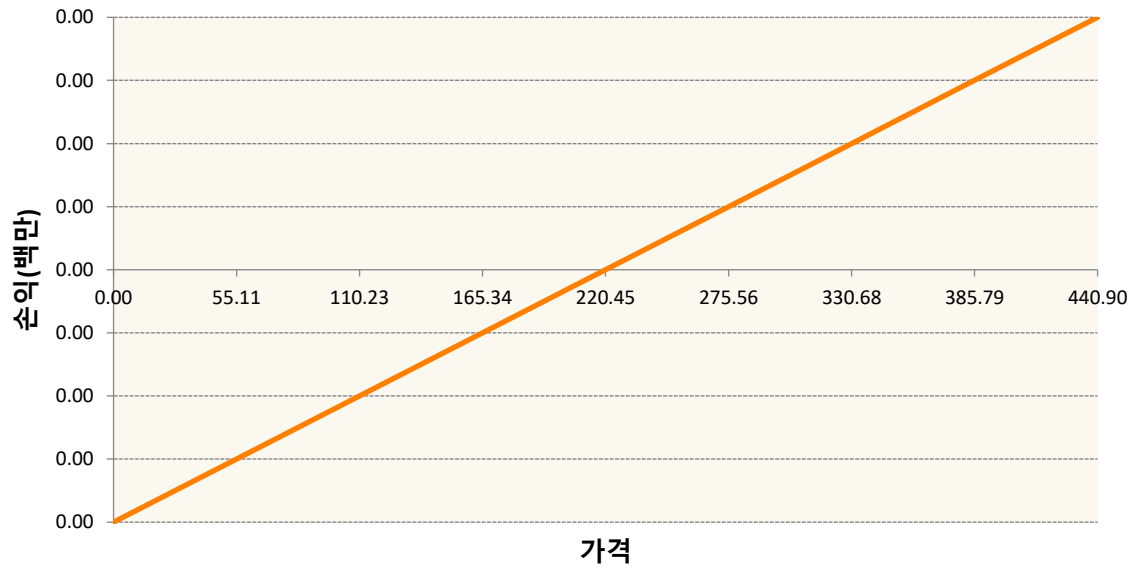
2. 만기시점의 손익구조



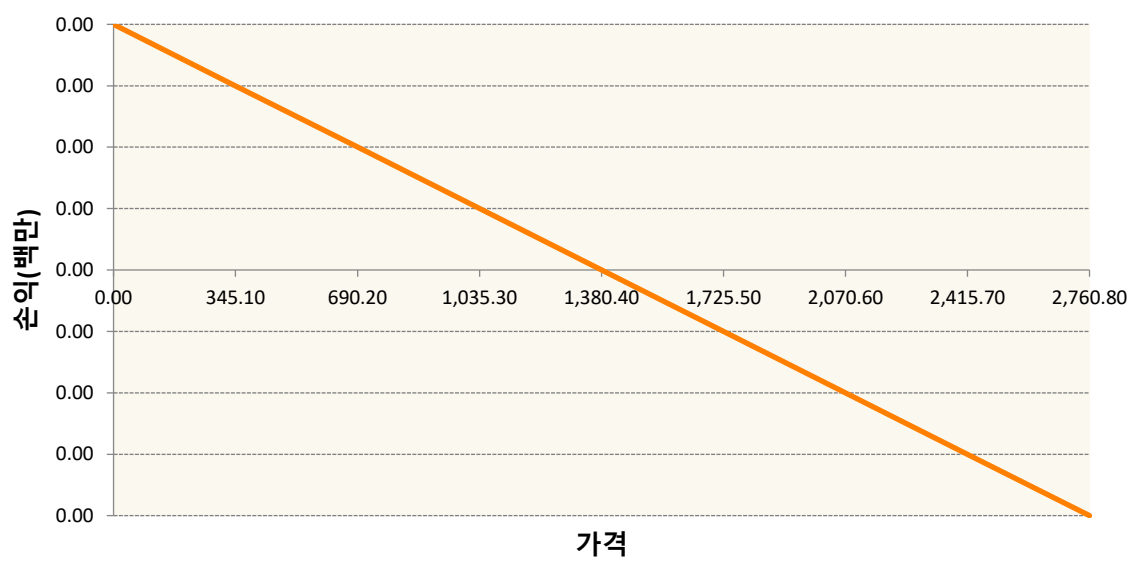
CTN4-COTTON NO.2 FUTR Jul24



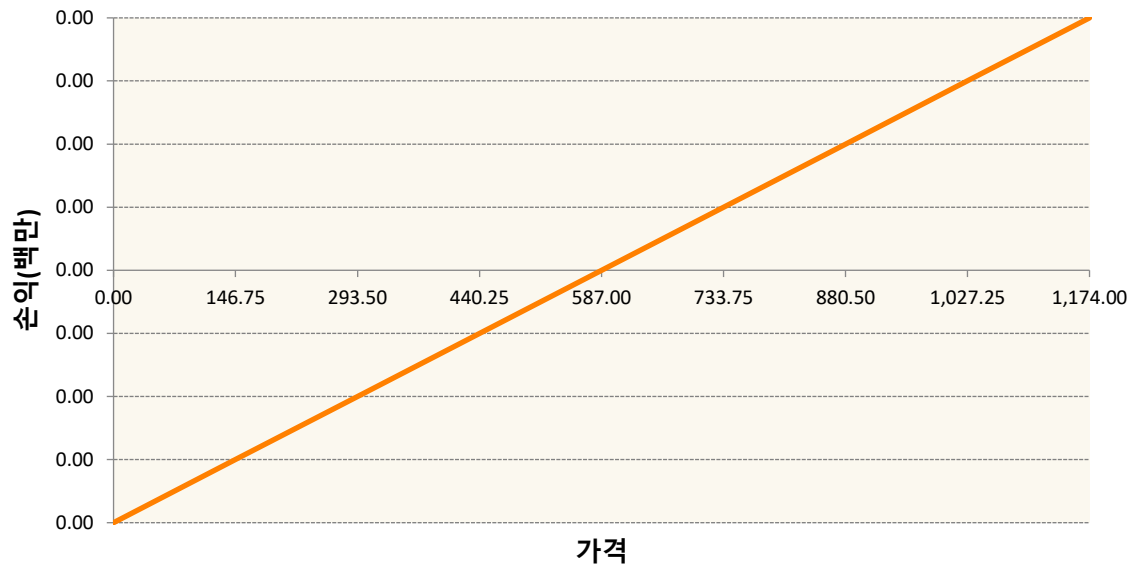
KCN4-COFFEE 'C' FUTURE Jul24



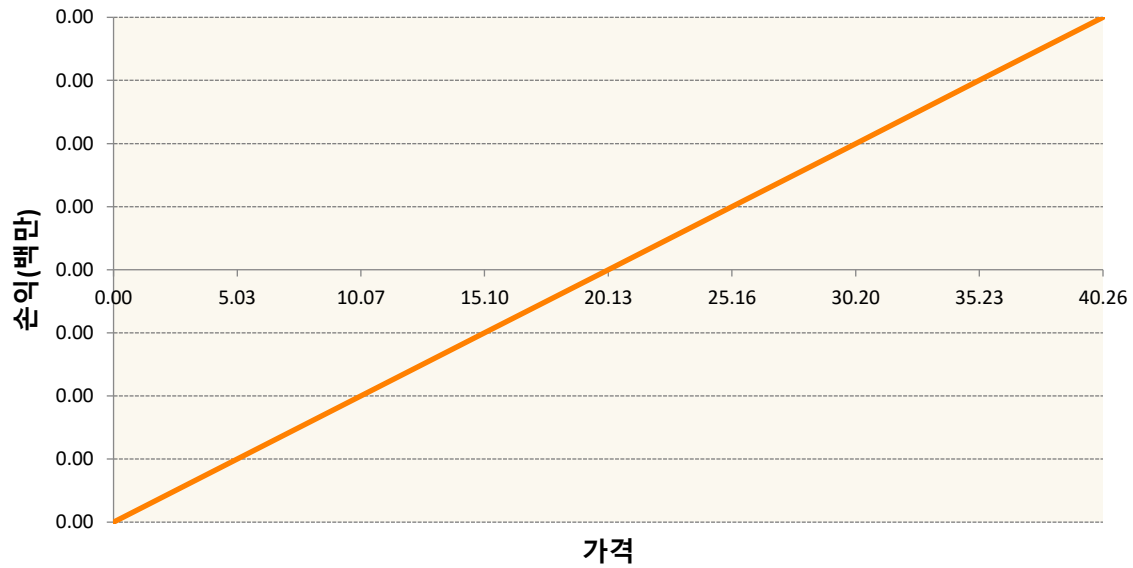
KR4175V50007-2024-05 달러선물



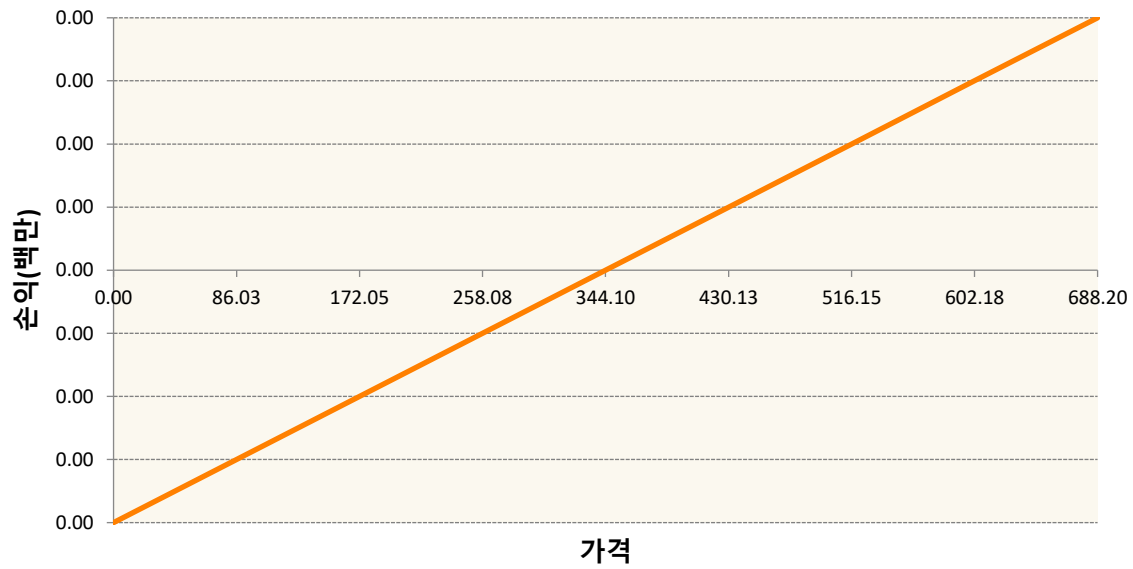
KWN4-KC HRW WHEAT FUT Jul24

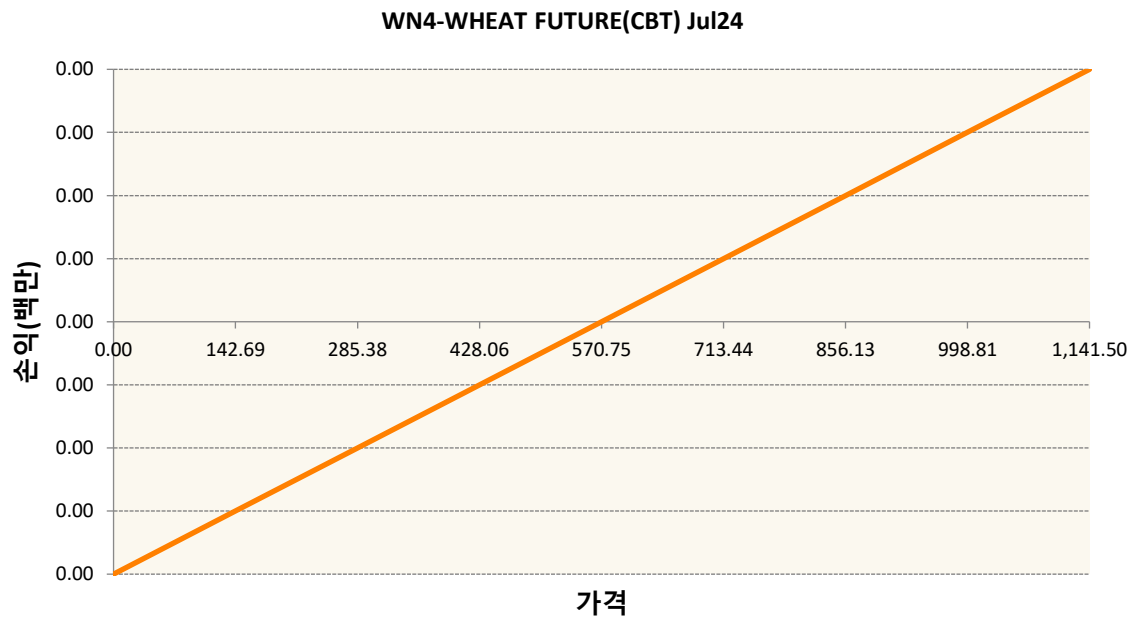
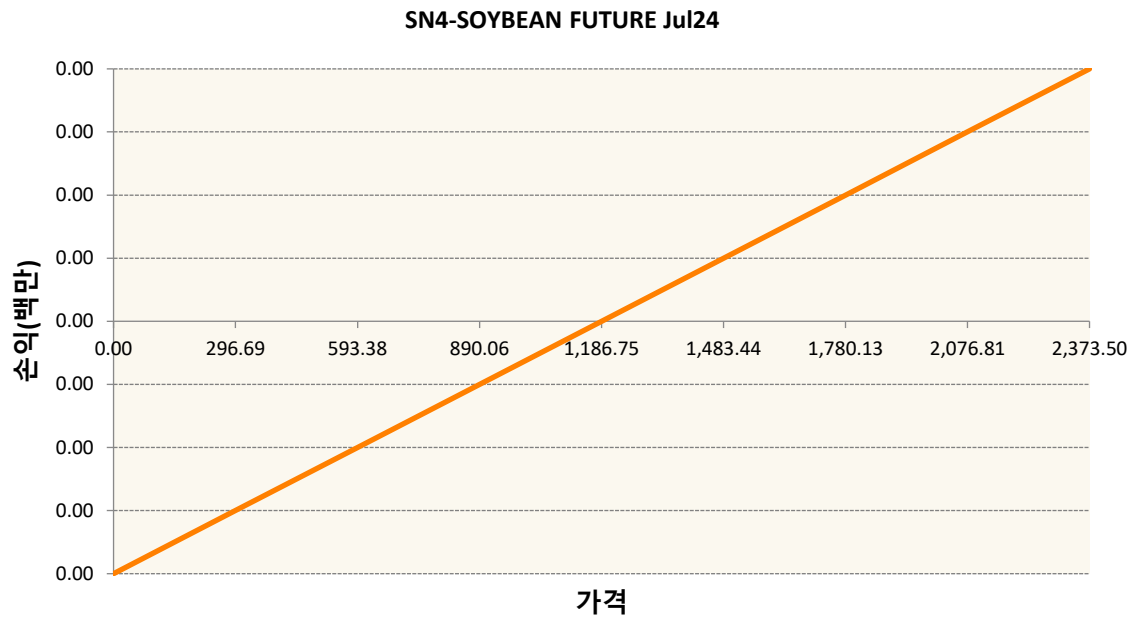


SBN4-Sugar #11 (WORLD) Jul24



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	2024-04-16
기준일	2024-04-15

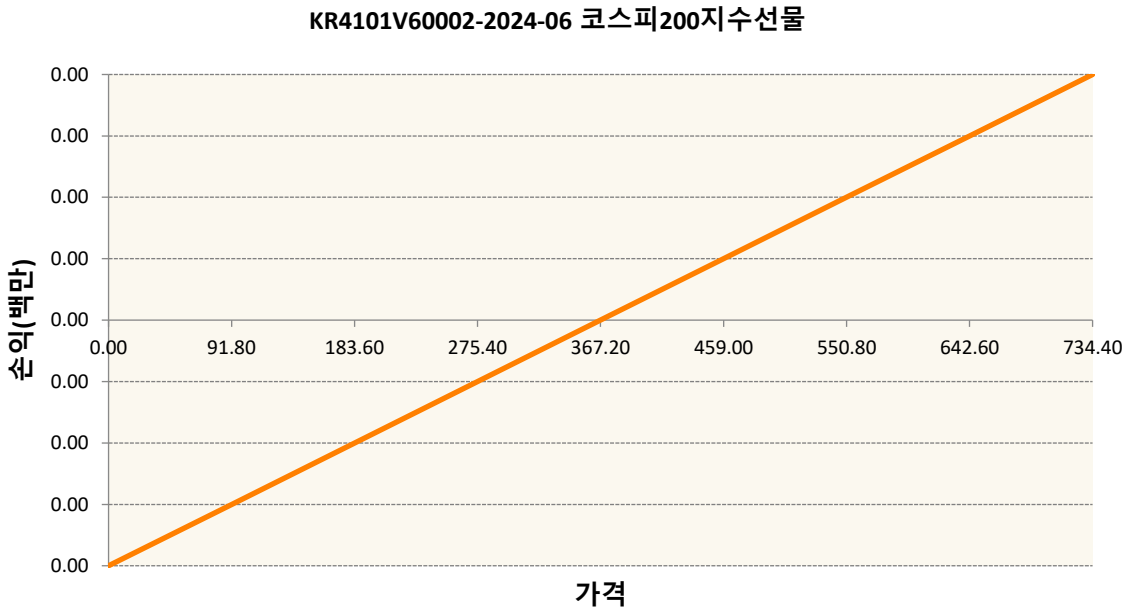
스마트인덱스모

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	92	-92	장내
누계	유가증권	선물	1,836	0	1,836	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101V60002		2024-06 코스피200지수선물					146
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-146	-146	-146	-146	-146	-146	-146
-5.33%	-97	-97	-97	-97	-97	-97	-97
-2.67%	-49	-49	-49	-49	-49	-49	-49
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	49	49	49	49	49	49	49
5.33%	97	97	97	97	97	97	97
8.00%	146	146	146	146	146	146	146

공시일	2024-04-16
기준일	2024-04-15

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	2024-04-16
기준일	2024-04-15

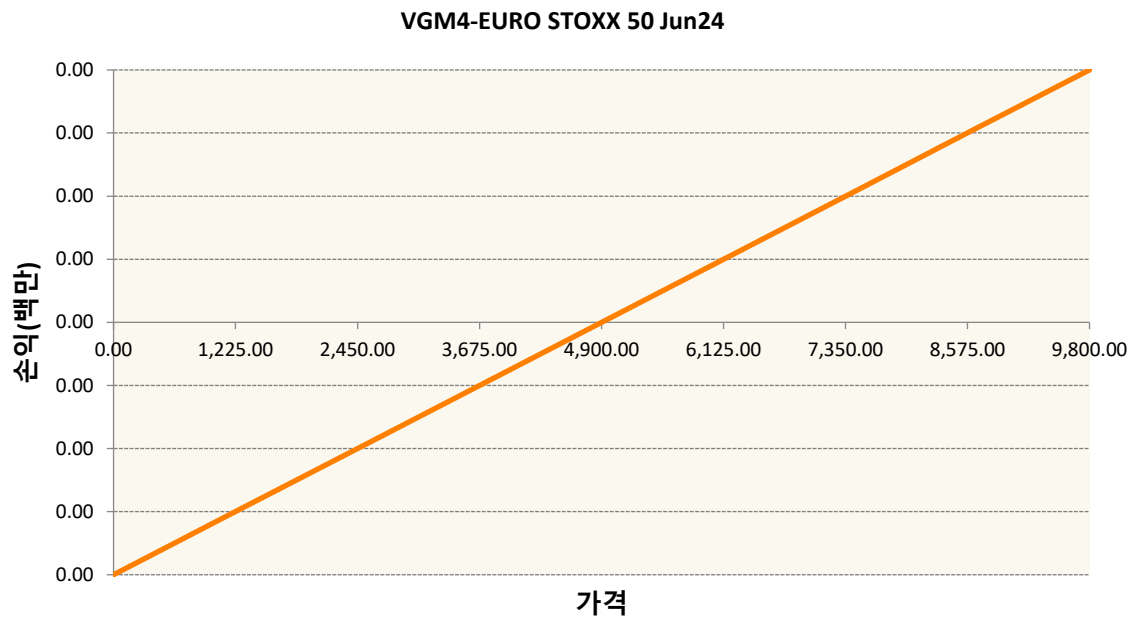
유로인덱스모(주식-파생형)

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	984	0	984	
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	79

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

(단위:백만원)

64

공시일	2024-04-16
기준일	2024-04-15

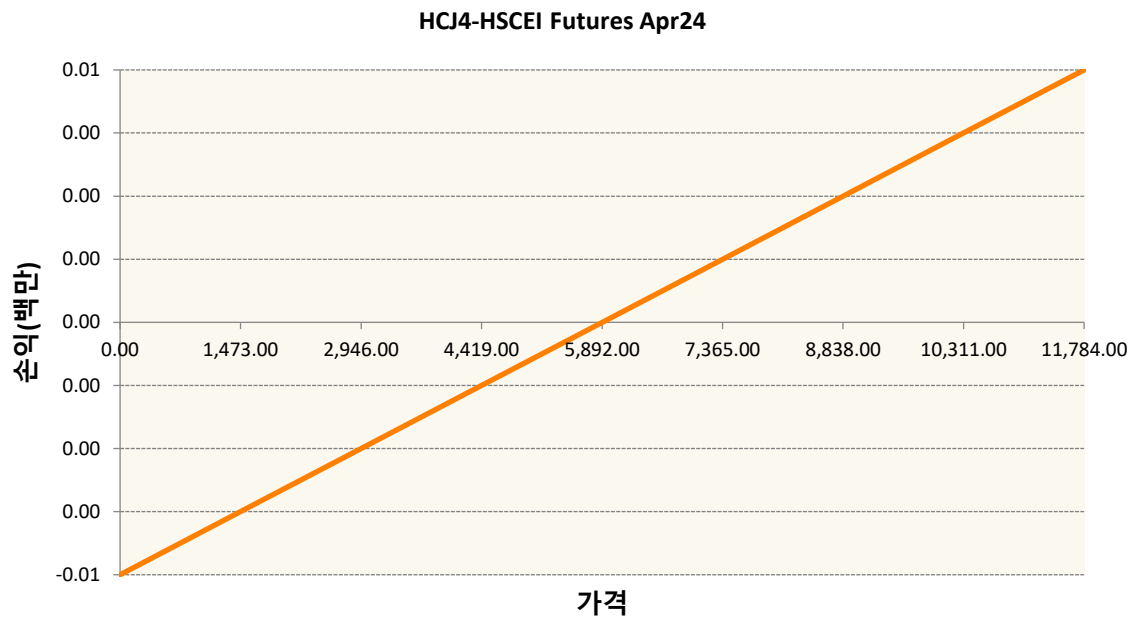
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,161	0	1,161	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCI4	HSCEI Futures Apr24	93
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

122

공시일	2024-04-16
기준일	2024-04-15

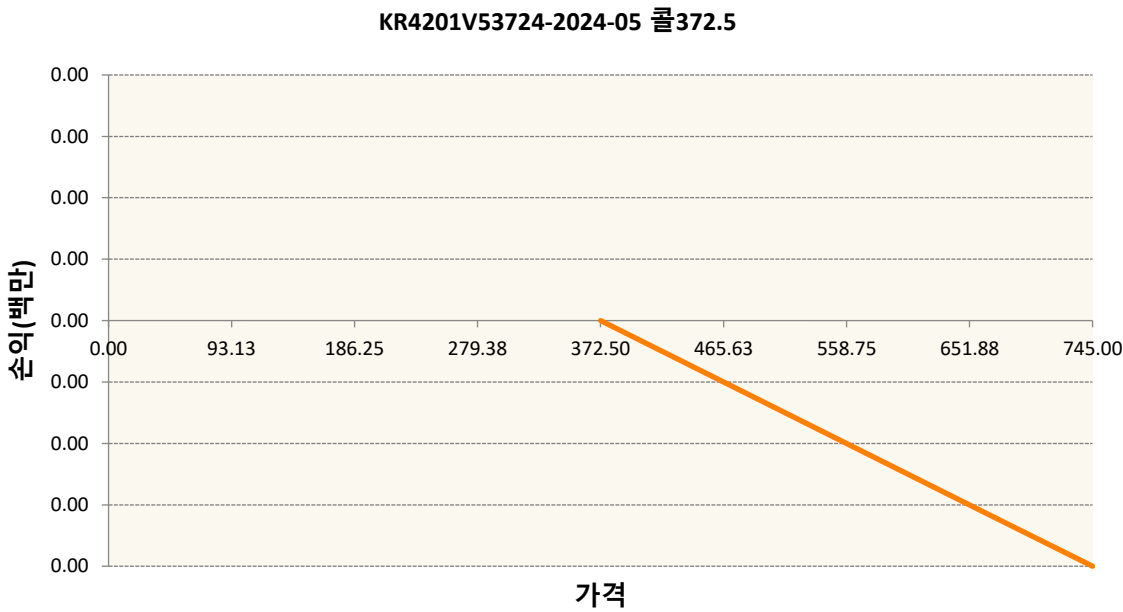
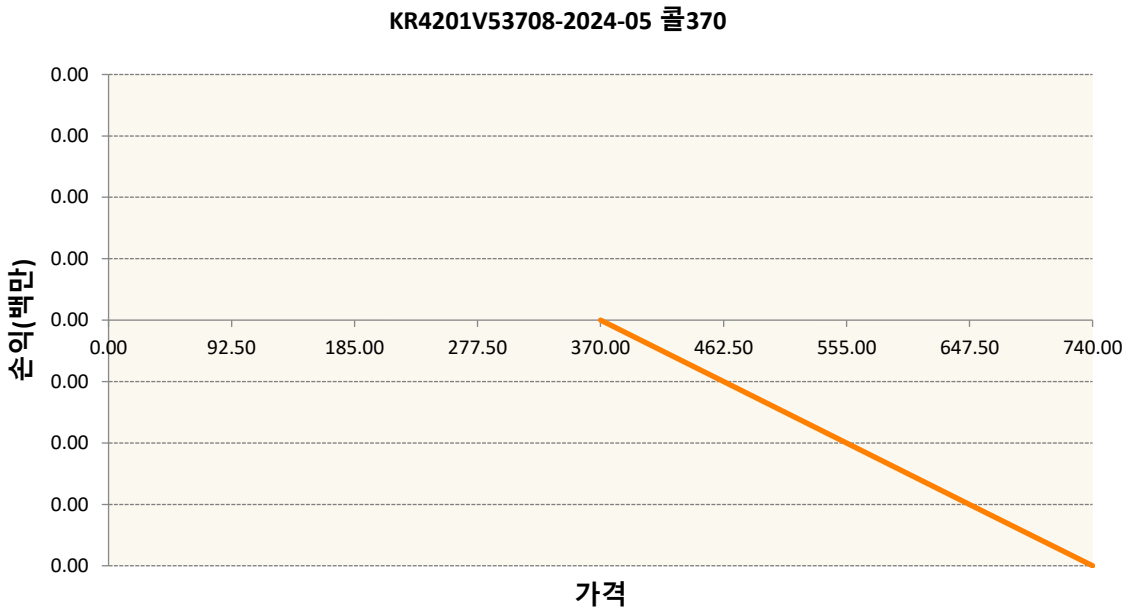
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

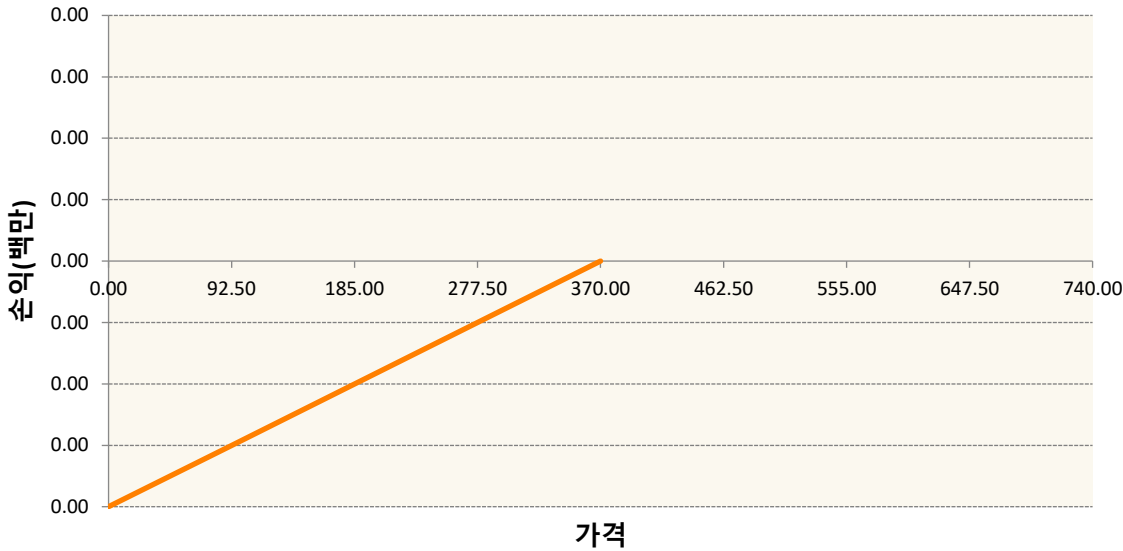
(단위:백만원)

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

2. 만기시점의 손익구조



KR4301V53706-2024-05 풋370



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201V53708			2024-05 콜370				1,453
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	566	551	533	511	485	456	424
-5.33%	517	487	454	417	378	336	292
-2.67%	400	353	304	253	201	148	94
0%	178	119	60	0	-60	-119	-179
2.67%	-172	-231	-291	-351	-411	-471	-531
5.33%	-644	-692	-742	-795	-848	-903	-959
8.00%	-1,208	-1,240	-1,277	-1,317	-1,360	-1,405	-1,453
KR4201V53724			2024-05 콜372.5				753
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	271	265	256	246	233	219	203
-5.33%	250	236	220	202	183	161	139
-2.67%	198	175	150	124	97	70	42
0%	94	63	32	0	-32	-64	-96
2.67%	-77	-110	-143	-176	-209	-242	-275
5.33%	-316	-344	-373	-403	-433	-464	-495
8.00%	-609	-629	-651	-675	-700	-726	-753
KR4301V53706			2024-05 풋370				555
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-545	-546	-547	-548	-550	-552	-555
-5.33%	-329	-332	-335	-340	-345	-350	-357
-2.67%	-127	-135	-143	-152	-161	-171	-181
0%	37	25	13	0	-13	-25	-38

2.67%	142	130	117	105	92	80	67
5.33%	190	182	174	165	155	146	135
8.00%	205	202	198	193	188	181	174

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

(단위:백만원)

2,623

공시일	2024-04-16
기준일	2024-04-15

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	1,760	0	1,760	

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	2024-04-16
기준일	2024-04-15

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	4,397	0	4,397	

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	2024-04-16
기준일	2024-04-15

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	15,809	0	15,809	
누계	통화	선도	0	16,034	-16,034	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213E1W KRW/USD 30-04-24E	259
FXW213E2TC KRW/USD 31-05-24E	598
FXW213E3TC KRW/USD 28-06-24E	426
IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

592

공시일	2024-04-16
기준일	2024-04-15

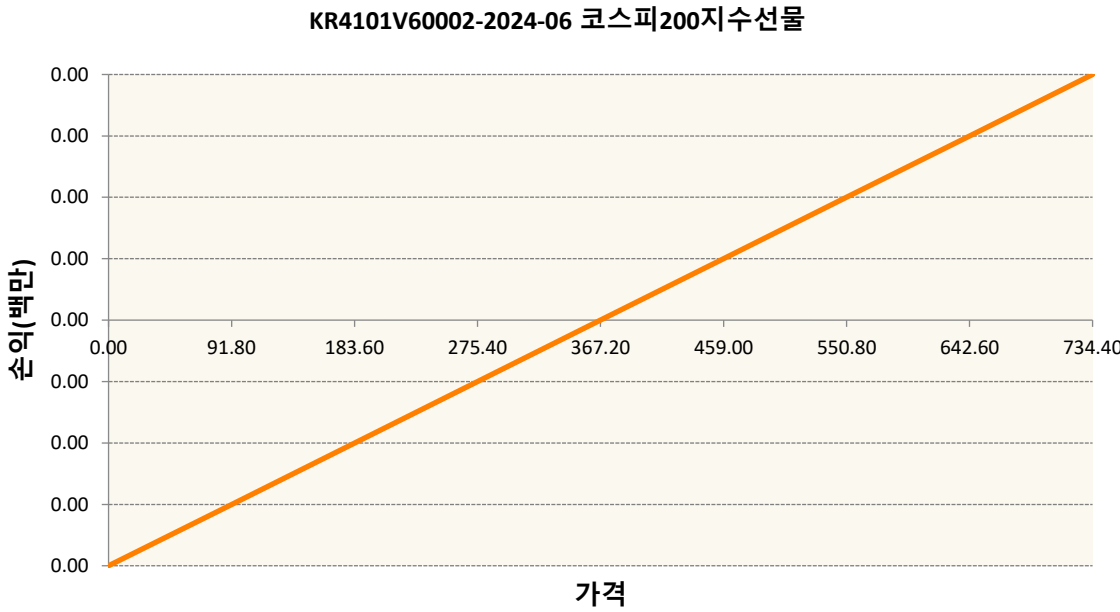
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

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	459	0	459	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	2024-04-16
기준일	2024-04-15

SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

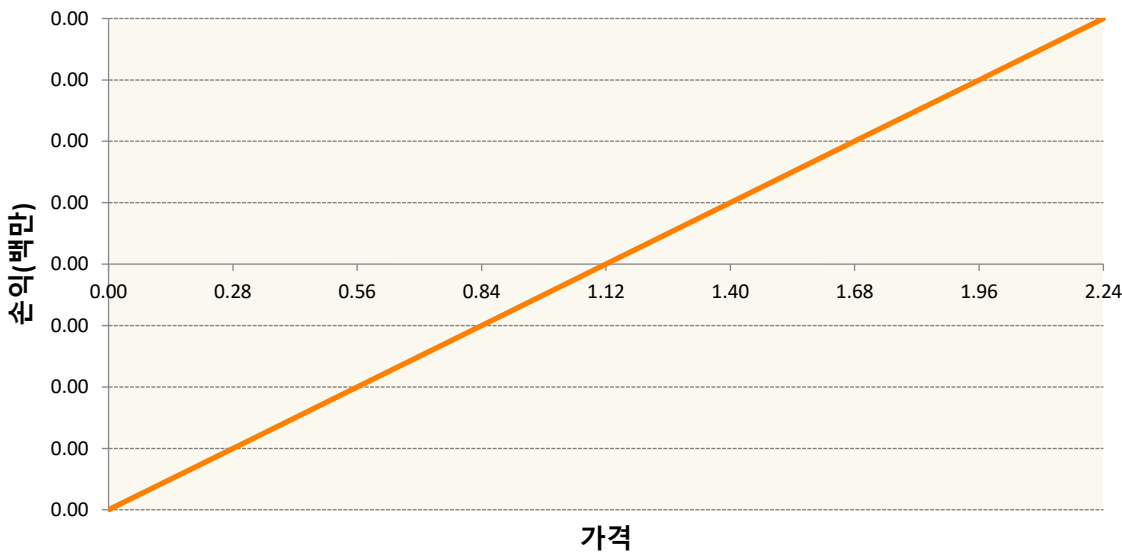
1. 계약금액

(단위:백만원)

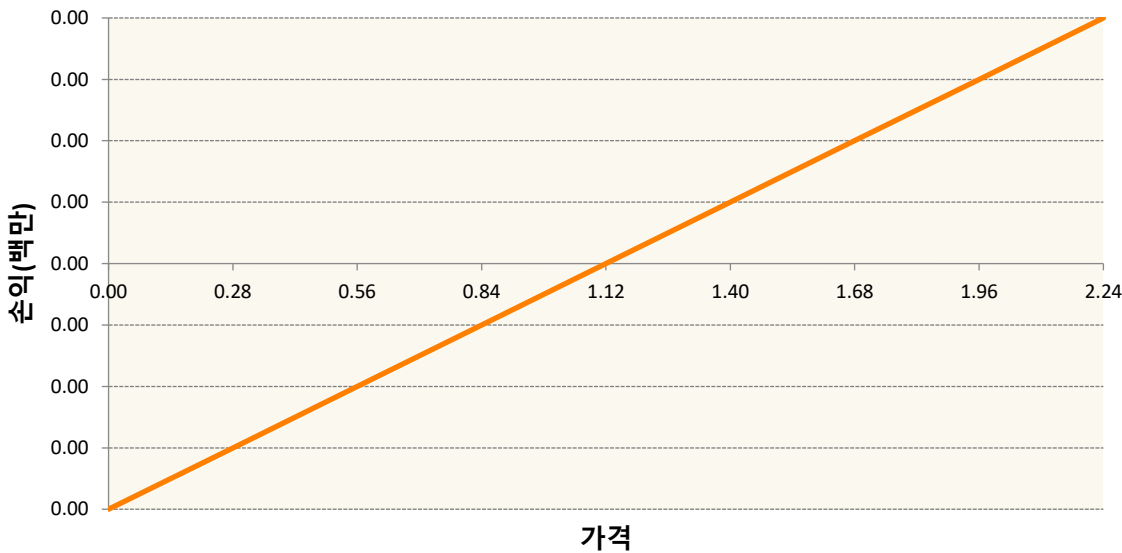
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	20,653	0	20,653	

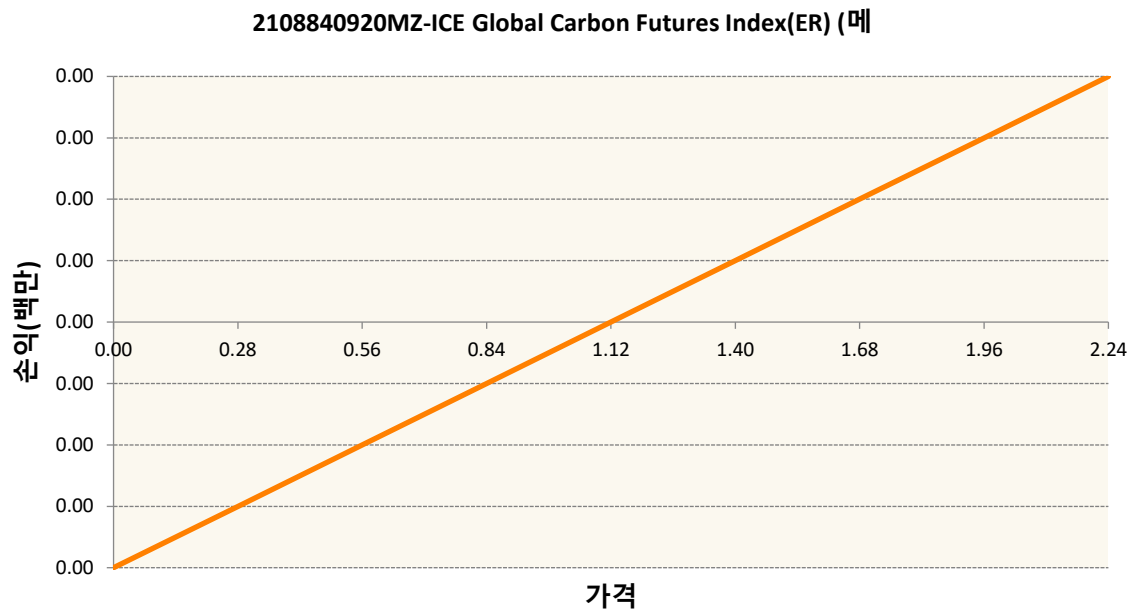
2. 만기시점의 손익구조

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		485
2108840920IICE Global Carbon Futures Index(ER) (키		970
2108840920IICE Global Carbon Futures Index(ER) (메		194

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,924

공시일	2024-04-16
기준일	2024-04-15

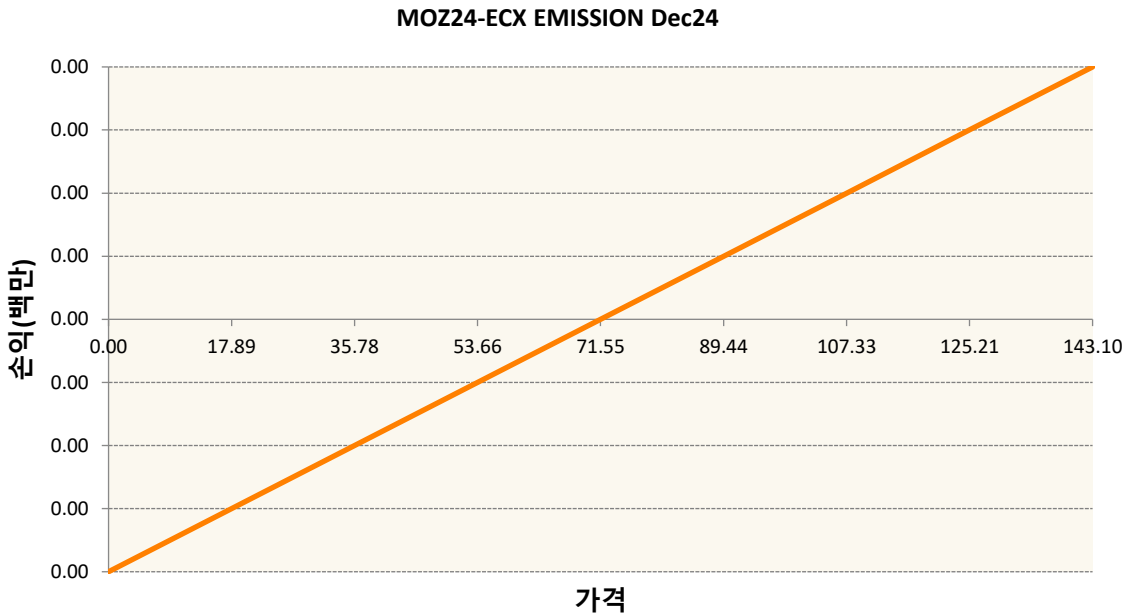
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	10,729	0	10,729	
누계	지수	스왑	331	0	331	장외
누계	통화	선도	0	2,616	-2,616	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	858
SWICEUACN ICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX	5

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

(단위:백만원)

1,652

공시일	2024-04-16
기준일	2024-04-15

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)	9
SWCSI00000 신한CSI Index 230622 (메리츠)	9
SWCSI00000 신한CSI Index 230922 (키움)	6
SWCSI00000 신한CSI Index 231013 (NH)	6

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

(단위:백만원)

42

공시일	2024-04-16
기준일	2024-04-15

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)	9
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(메리츠)	12
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(키움)	3

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

(단위:백만원)

37

공시일	2024-04-16
기준일	2024-04-15

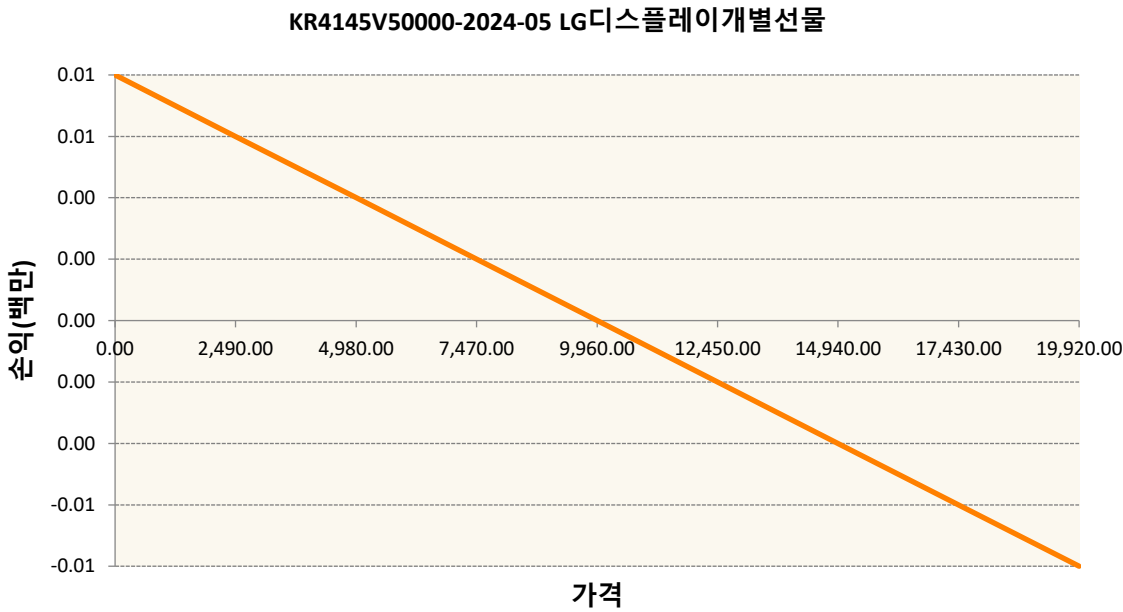
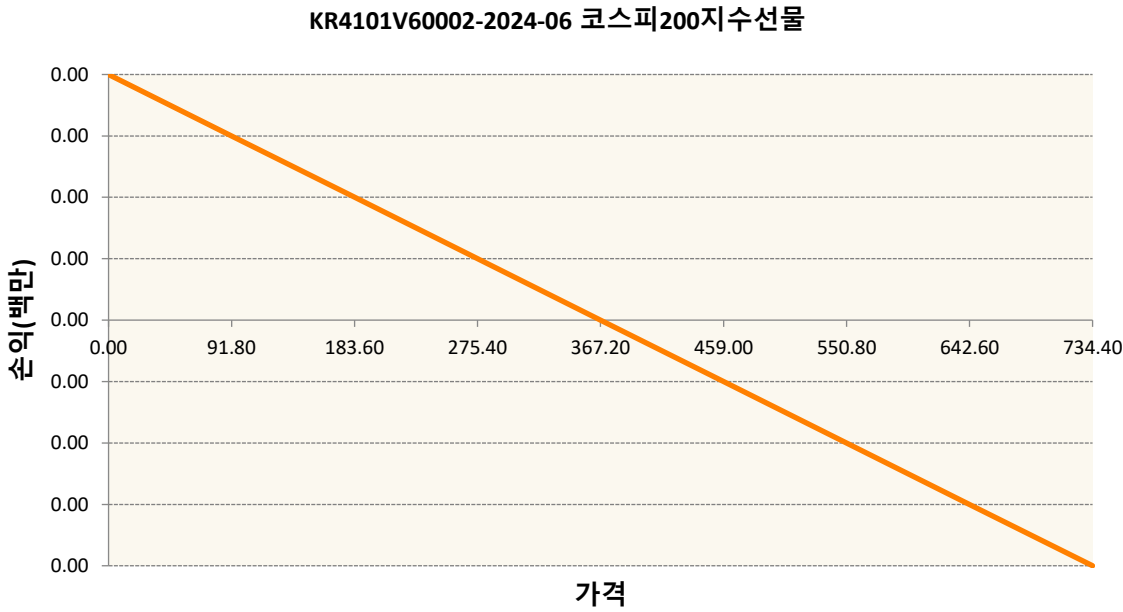
에퀴티알파일반사모혼합자산

1. 계약금액

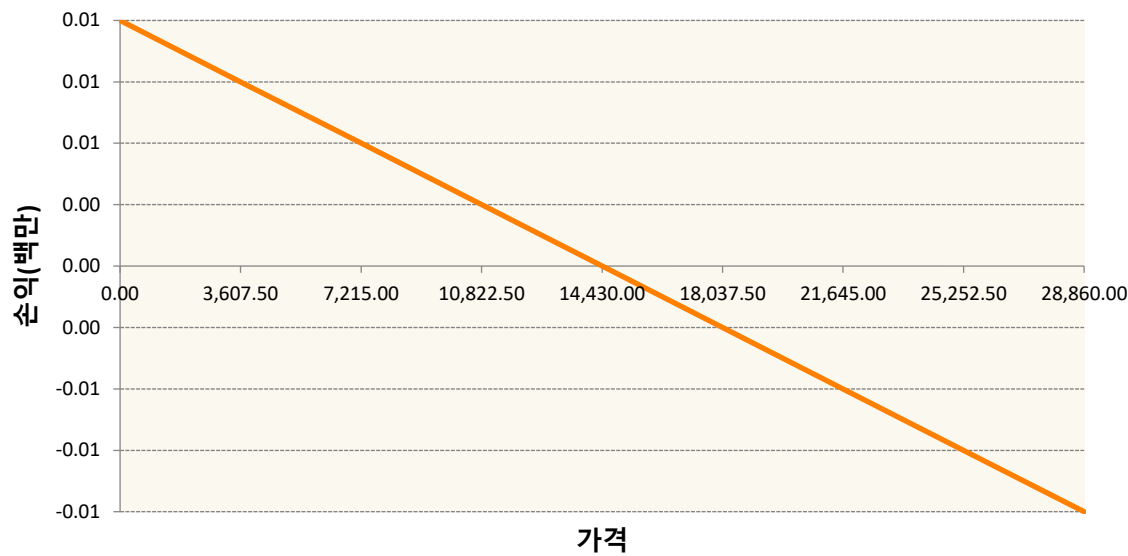
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	195	0	195	장내
누계	유가증권	선물	0	453	-453	장내

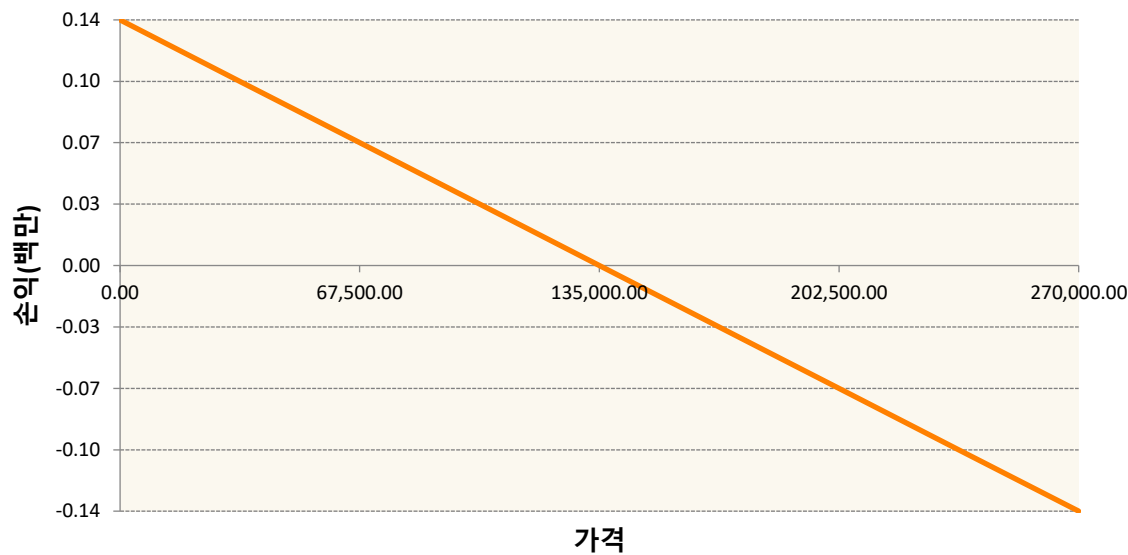
2. 만기시점의 손익구조



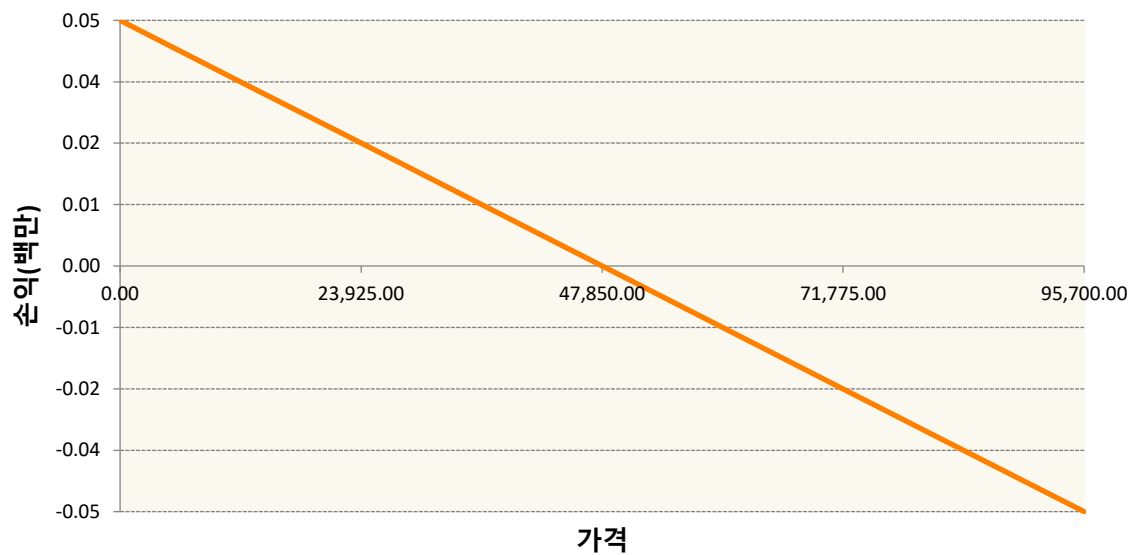
KR4151V50008-2024-05 GS건설개별선물



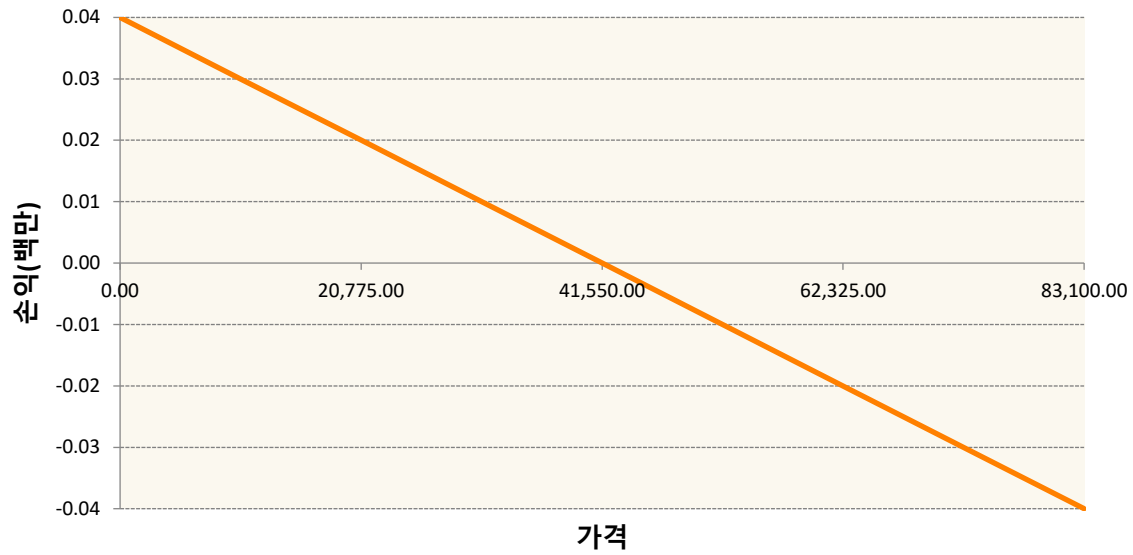
KR41C6V50009-2024-05 아모레퍼시픽개별선물



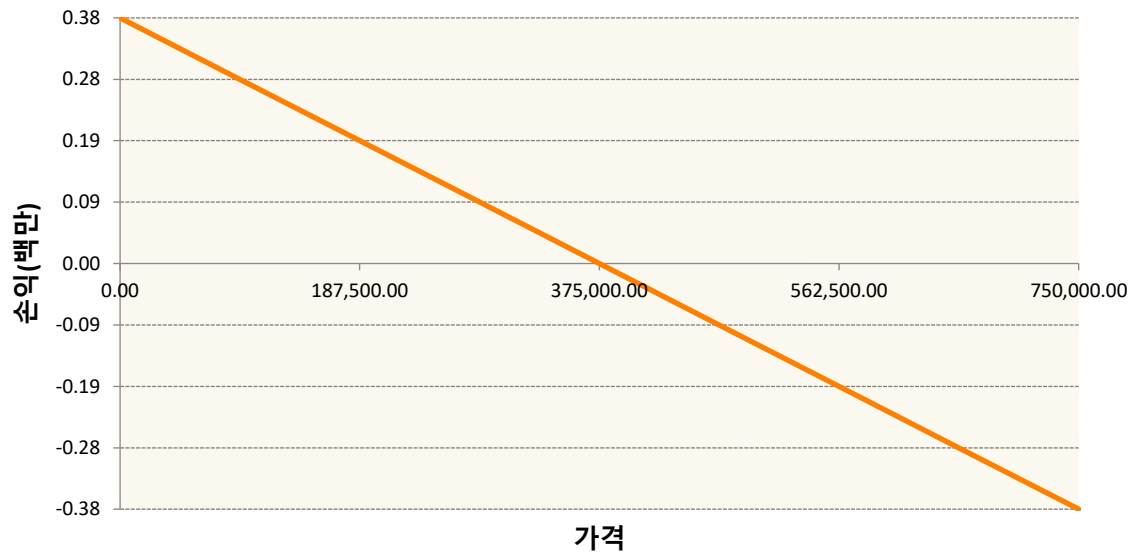
KR41CFV50008-2024-05 카카오개별선물



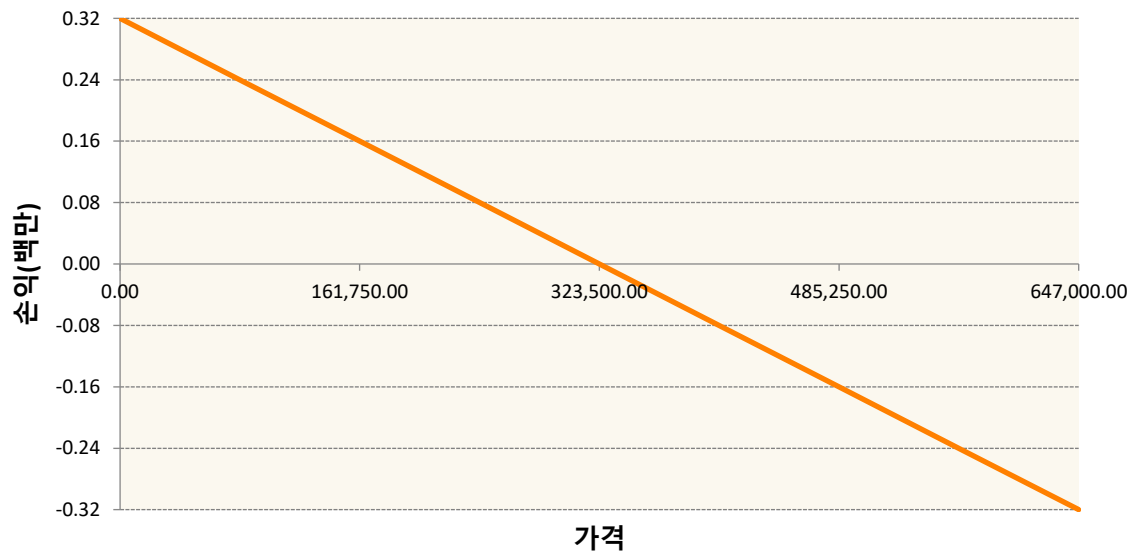
KR41CNV50002-2024-05 포스코DX개별선물



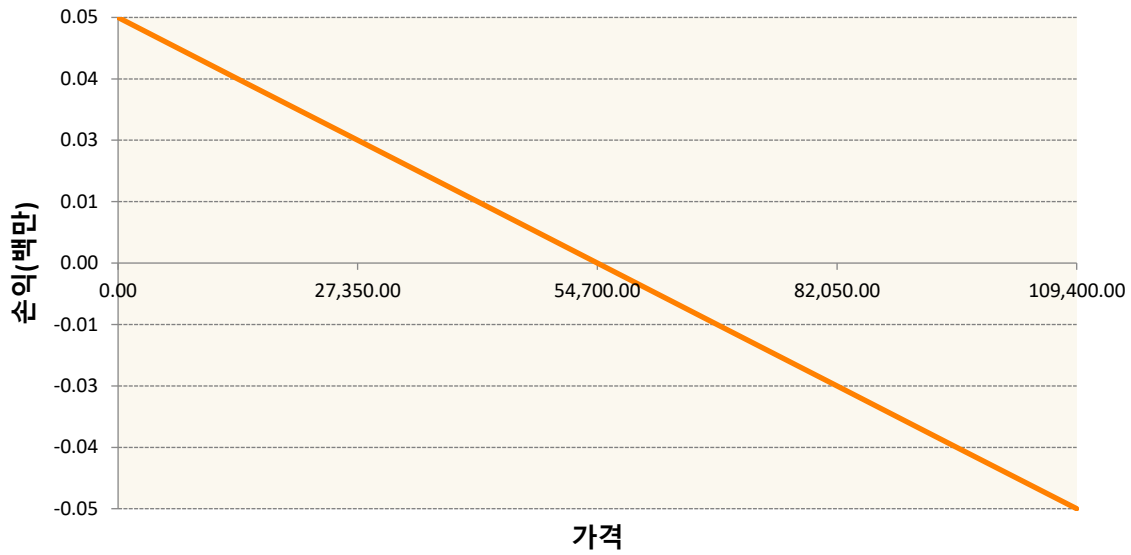
KR41CRV50003-2024-05 LG생활건강개별선물



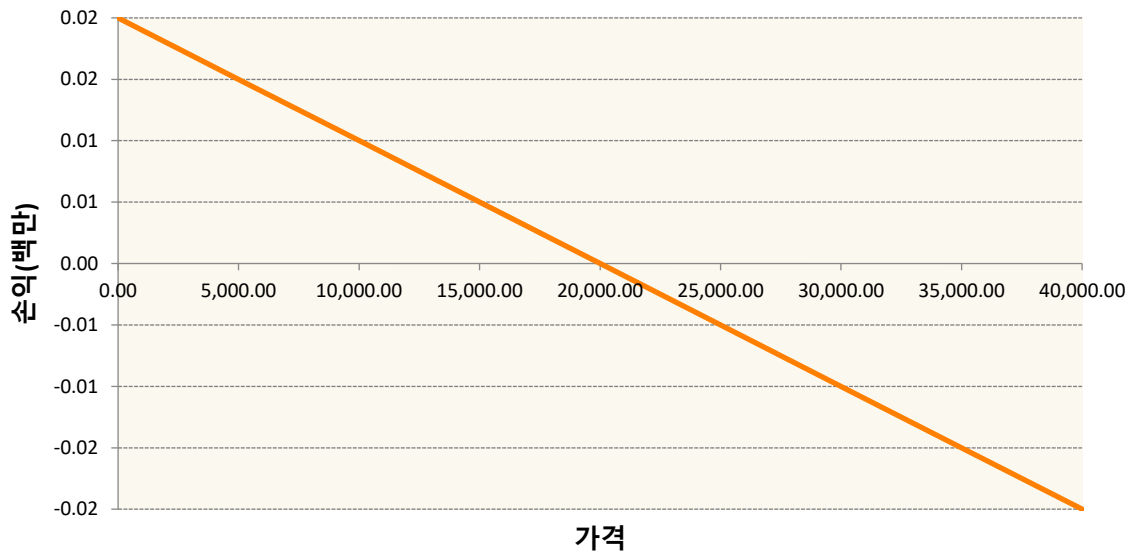
KR41D1V50009-2024-05 CJ제일제당개별선물



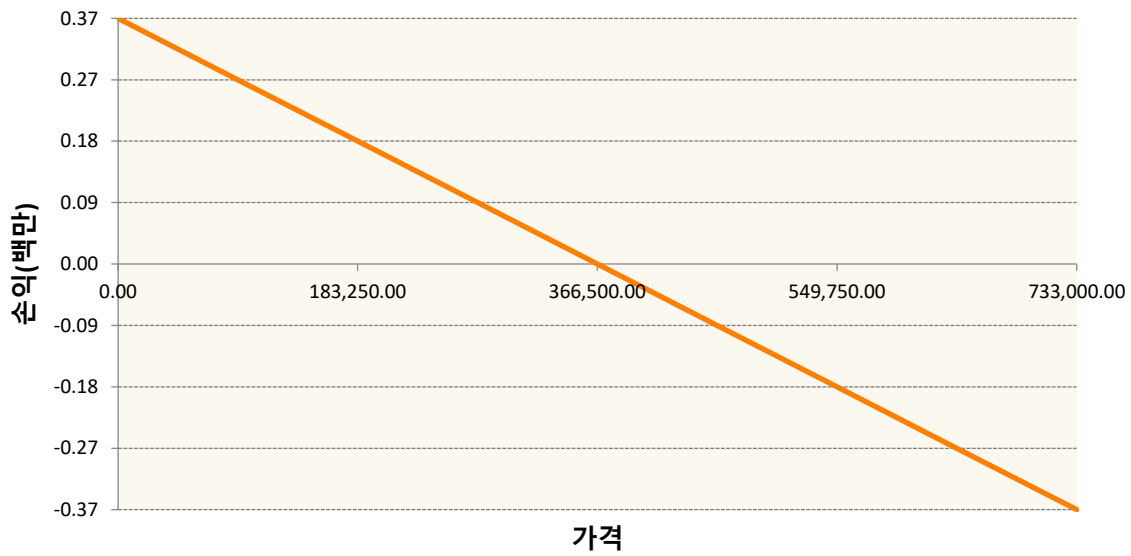
KR41E5V50009-2024-05 넷마블개별선물



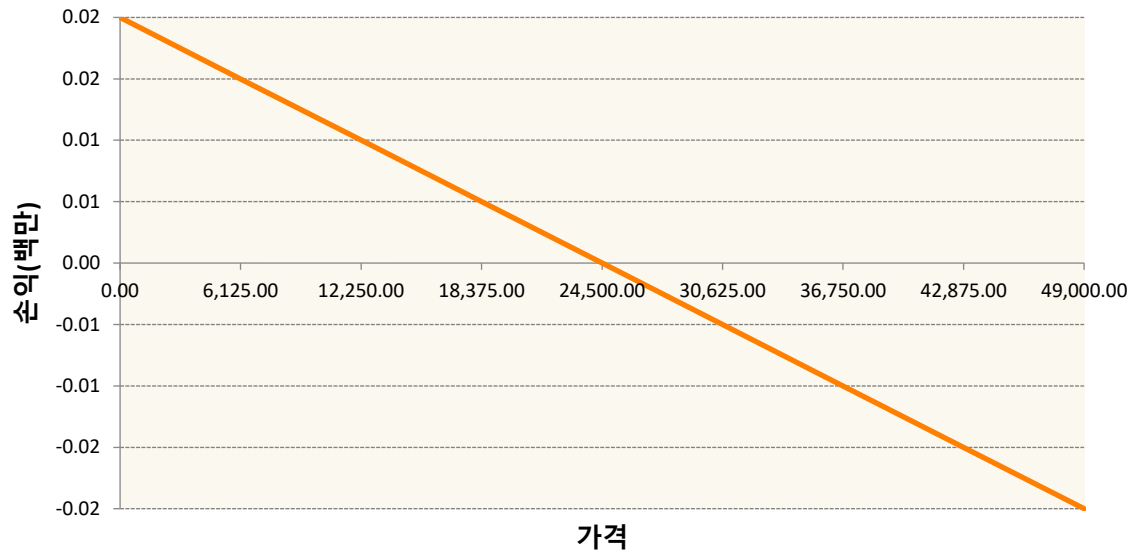
KR41EXV50007-2024-05 카카오게임즈개별선물



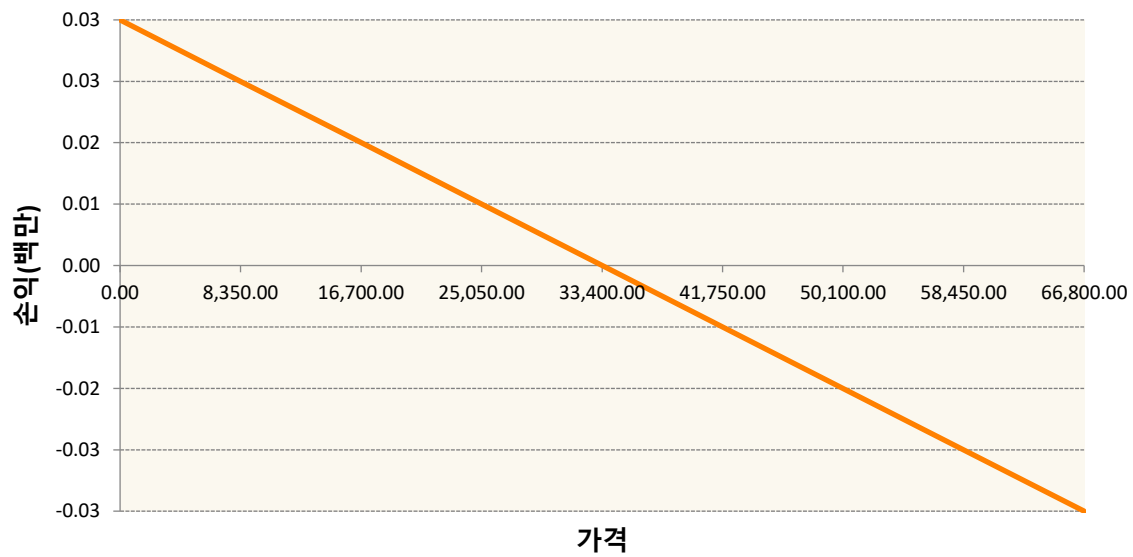
KR41F5V50008-2024-05 LG에너지솔루션개별선물



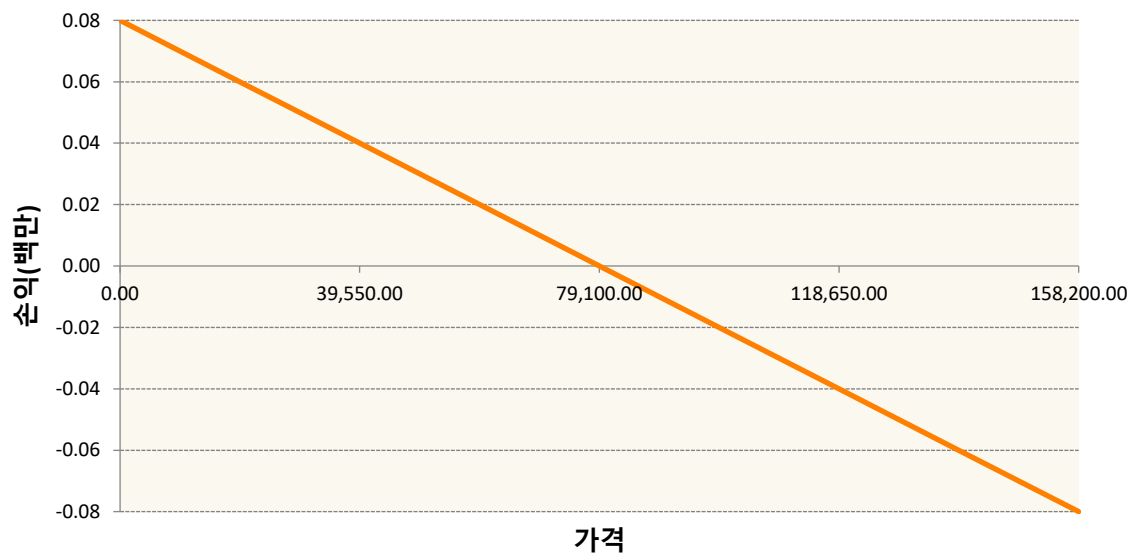
KR41F6V50006-2024-05 카카오뱅크개별선물



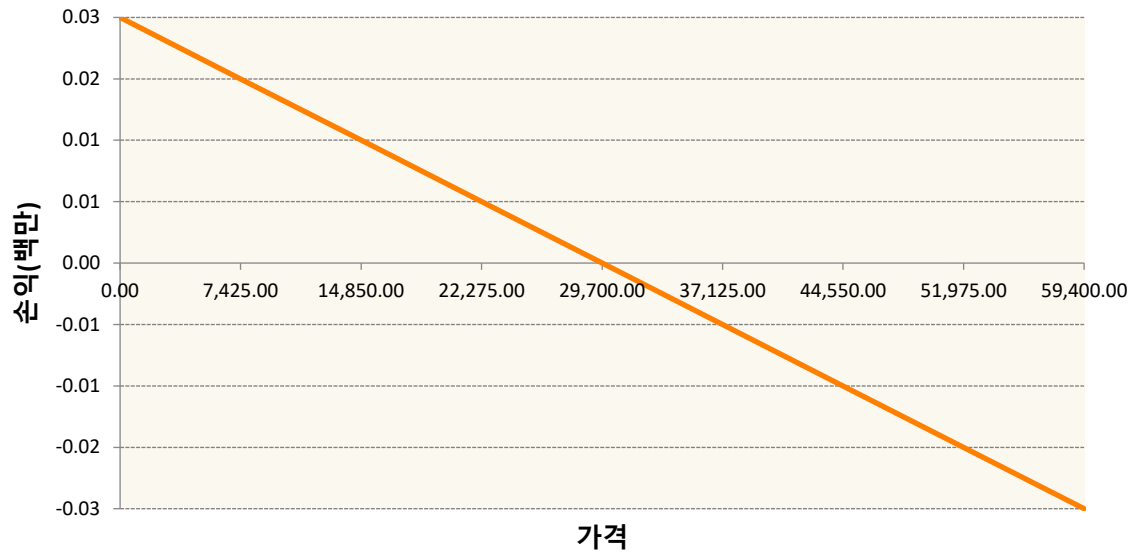
KR41F7V50004-2024-05 카카오페이개별선물



KR41FEV50004-2024-05 SK스퀘어개별선물



KR41FVV50008-2024-05 한화오션개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101V600 2024-06 코스피200지수선물	29
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	0.26
KR41E5V500 2024-05 넷마블개별선물	0.22
KR41EXV500 2024-05 카카오게임즈개별선물	1
KR41F5V500 2024-05 LG에너지솔루션개별선물	1
KR41F6V500 2024-05 카카오뱅크개별선물	1
KR41F7V500 2024-05 카카오페이개별선물	0.27
KR41FEV500 2024-05 SK스퀘어개별선물	0.13
KR41FVV500 2024-05 한화오션개별선물	0.17

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

(단위:백만원)

43

공시일	2024-04-16
기준일	2024-04-15

코리아인덱스(주식-파생형)(종)

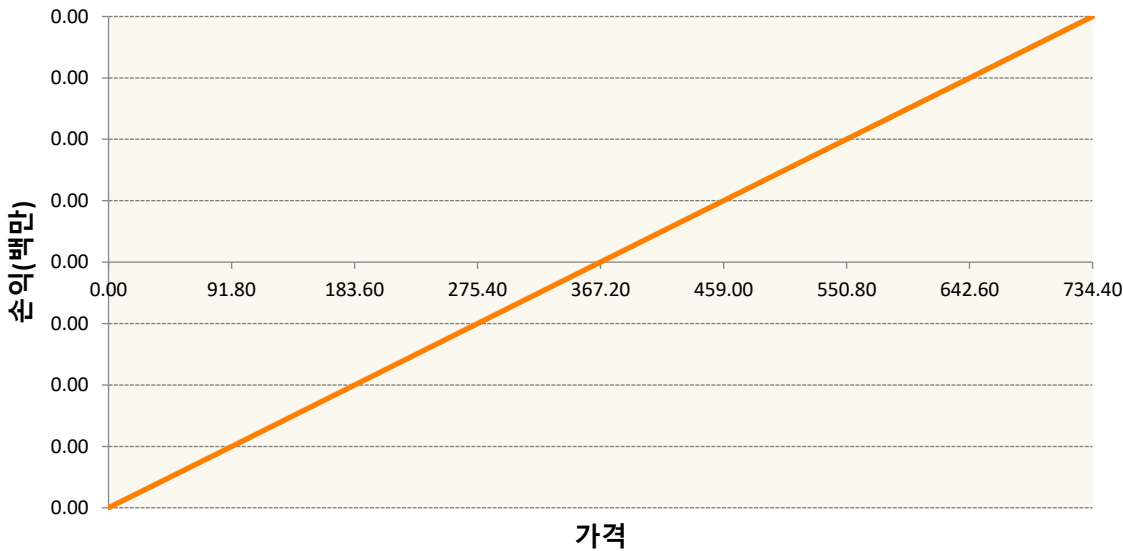
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,029	0	3,029	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101V60002-2024-06 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101V60002		2024-06 코스피200지수선물					241
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-241	-241	-241	-241	-241	-241	-241
-5.33%	-161	-161	-161	-161	-161	-161	-161
-2.67%	-80	-80	-80	-80	-80	-80	-80
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	80	80	80	80	80	80	80
5.33%	161	161	161	161	161	161	161
8.00%	241	241	241	241	241	241	241

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

(단위:백만원)

220

공시일	2024-04-16
기준일	2024-04-15

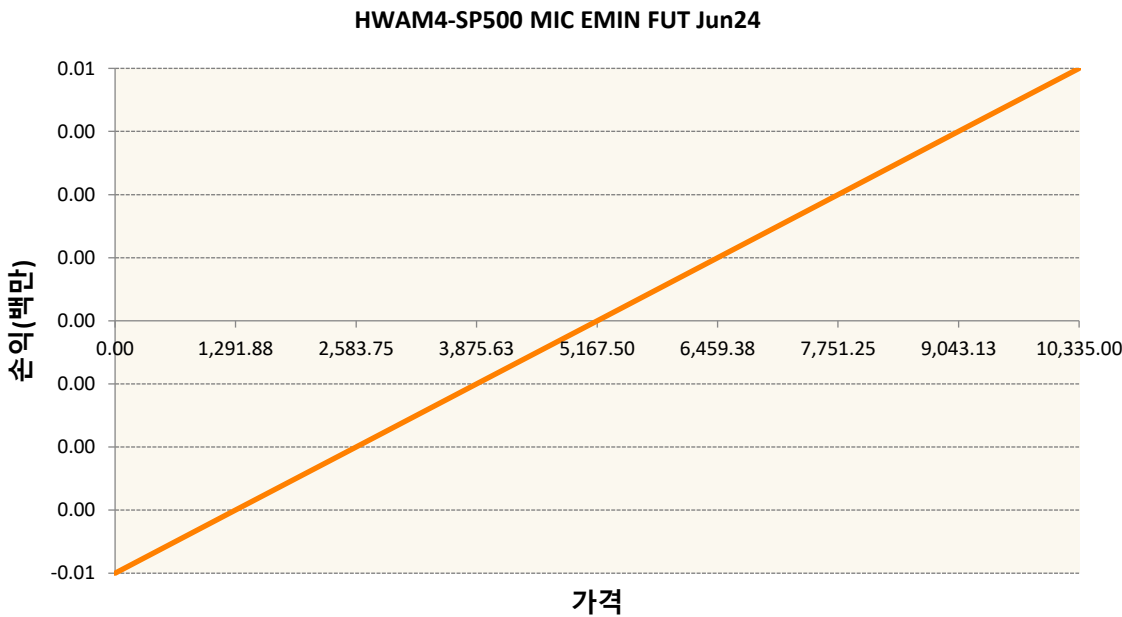
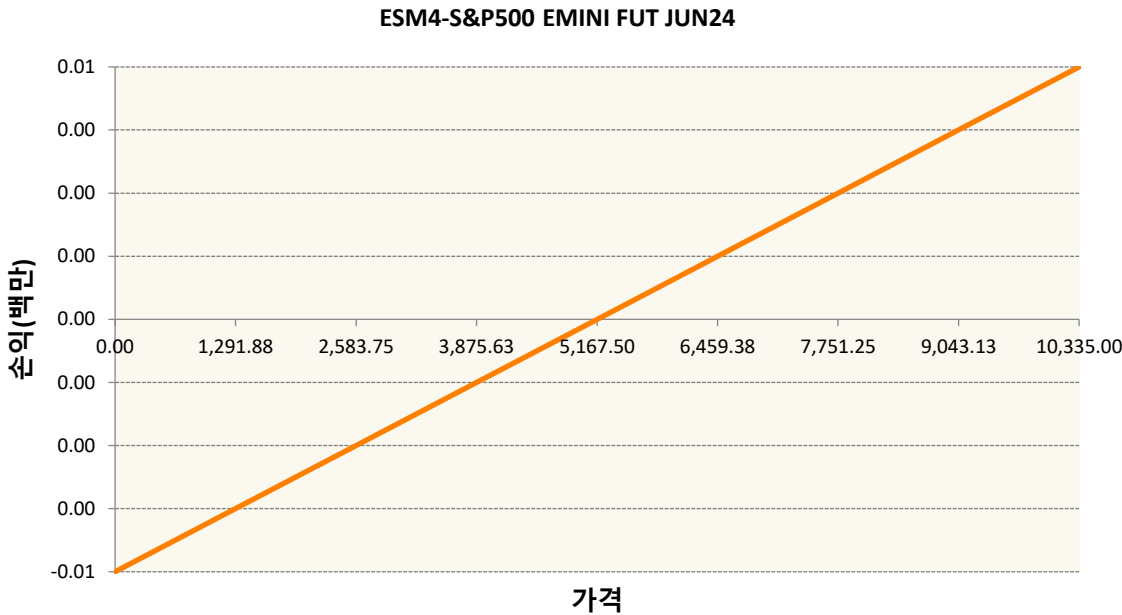
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

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	4,440	0	4,440	
누계	유가증권	선물	1,843	0	1,843	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESM4	S&P500 EMINI FUT JUN24	355
HWAM4	SP500 MIC EMIN FUT Jun24	147

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	352

공시일	2024-04-16
기준일	2024-04-15

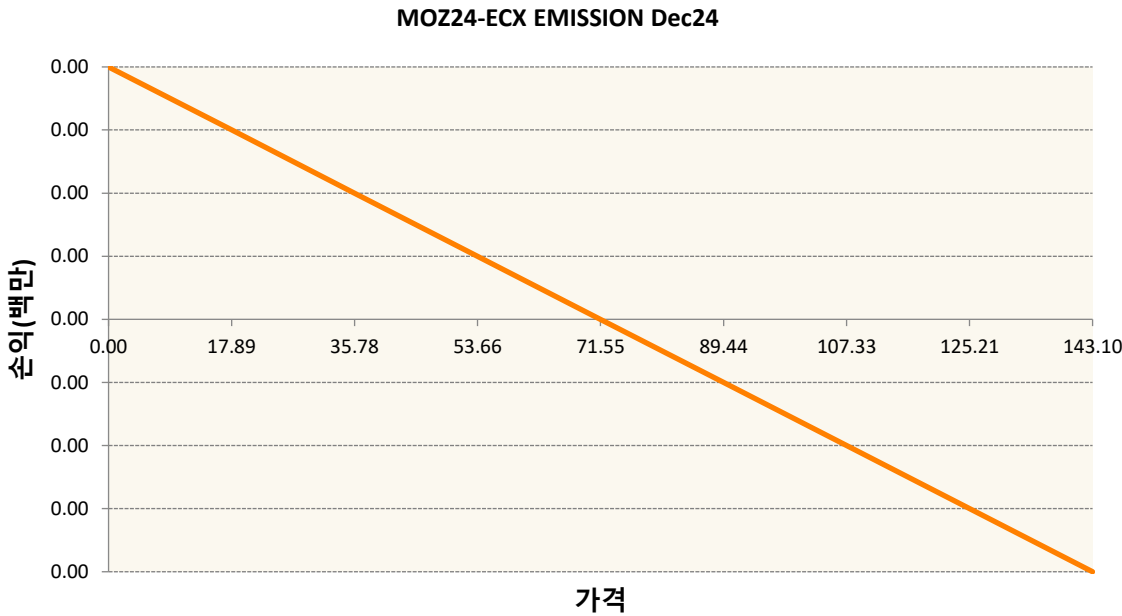
SOL유럽탄소배출권선물인버스ICE특별자산상

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	3,531	-3,531	
누계	지수	스왑	331	0	331	장외
누계	통화	선도	0	1,117	-1,117	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213E3SC KRW/EUR 30-04-24E	89
MOZ24 ECX EMISSION Dec24	282
SWICEUACN ICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX	5

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

(단위:백만원)

561

공시일	2024-04-16
기준일	2024-04-15

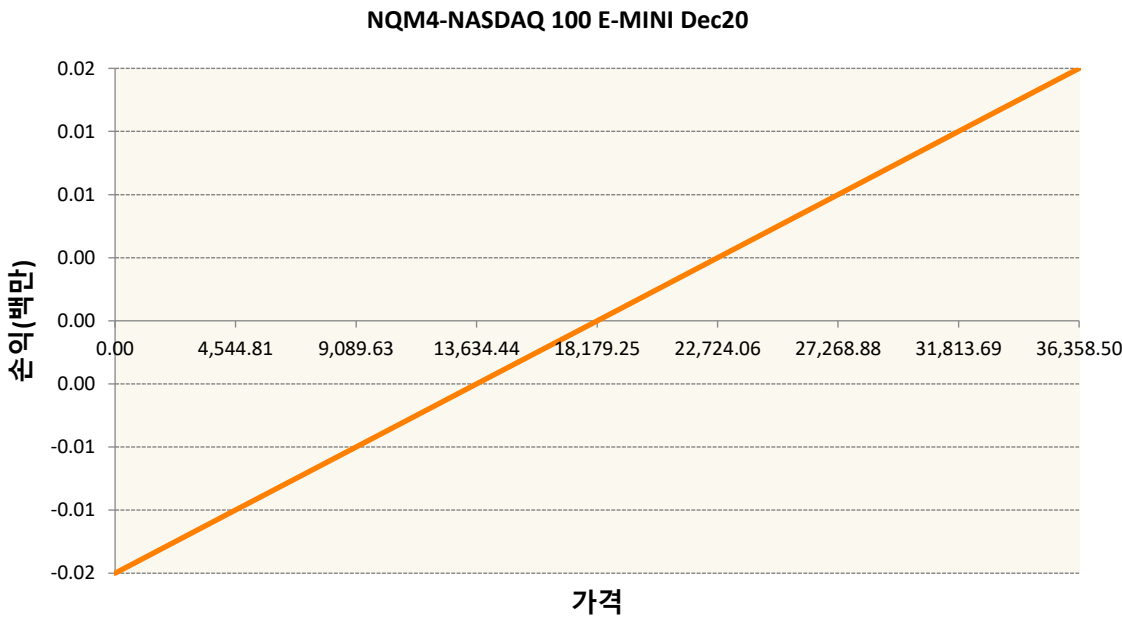
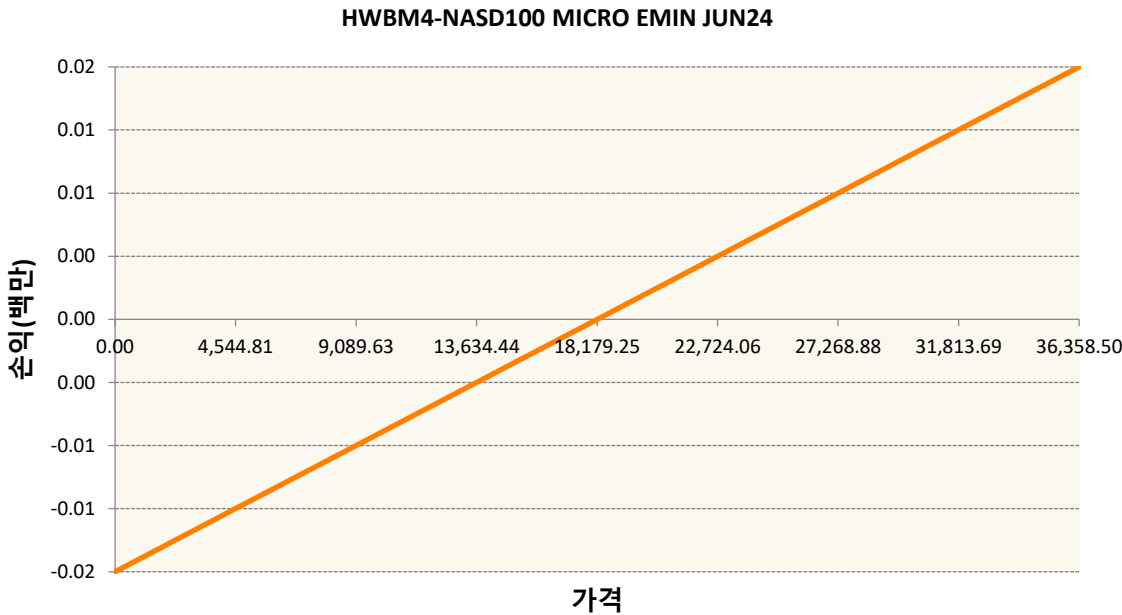
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

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	2,401	0	2,401	
누계	유가증권	선물	2,111	0	2,111	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
HWBM4	NASD100 MICRO EMIN JUN24		169
NQM4	NASDAQ 100 E-MINI Dec20		192

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)			(단위:백만원)
			301

공시일	2024-04-16
기준일	2024-04-15

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	131,531	0	131,531	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	1,623
SWKEDI0000 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	955
SWKEDI0000 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	7,615

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

(단위:백만원)

6,682

공시일	2024-04-16
기준일	2024-04-15

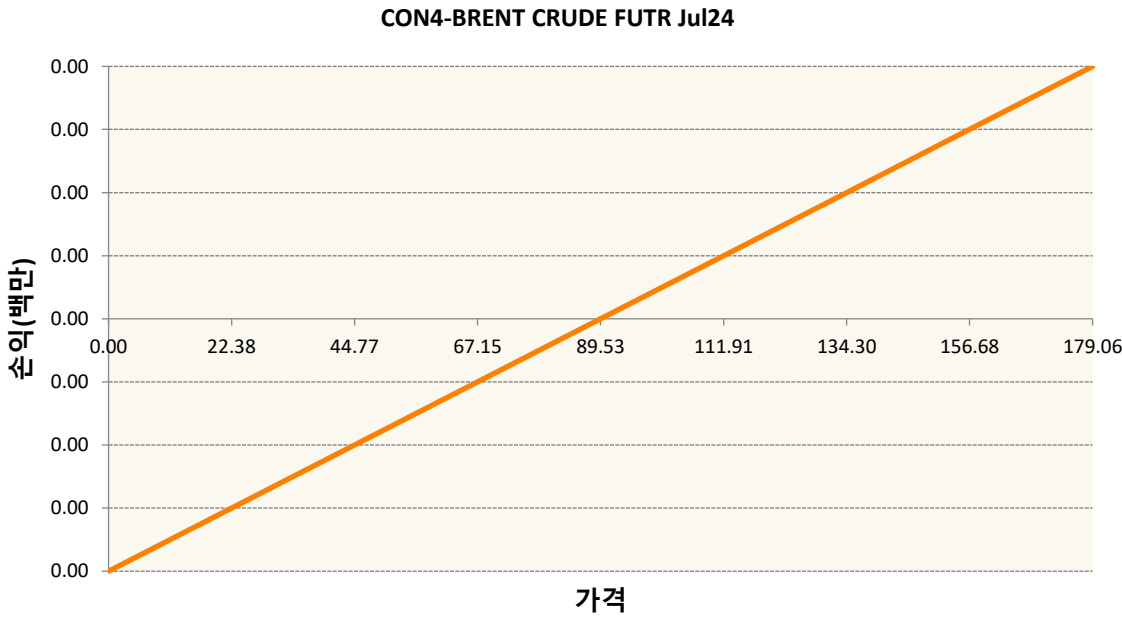
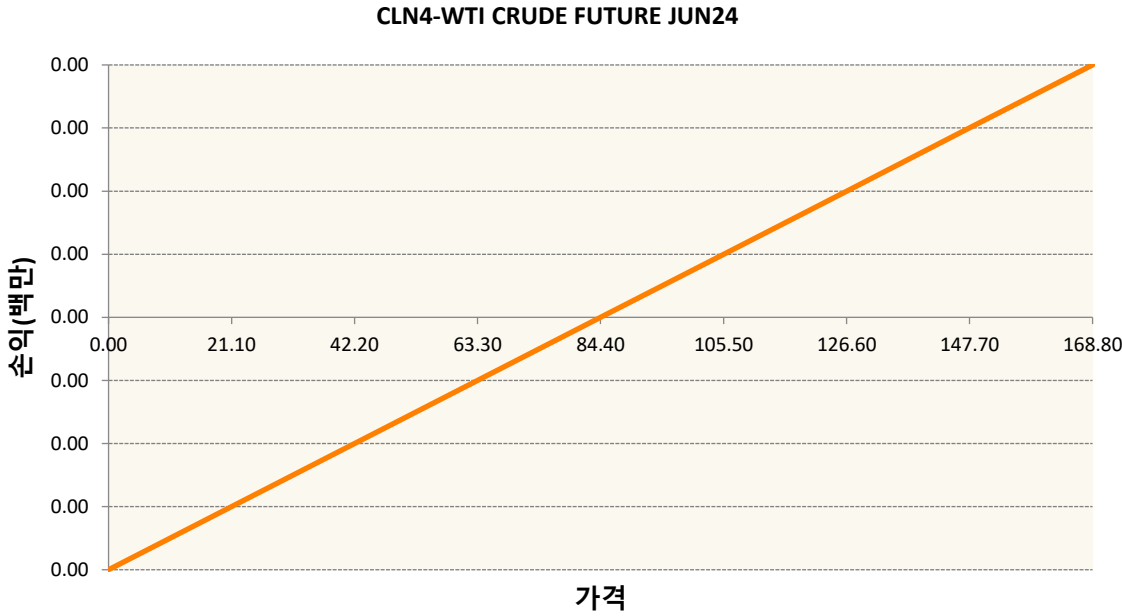
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

1. 계약금액

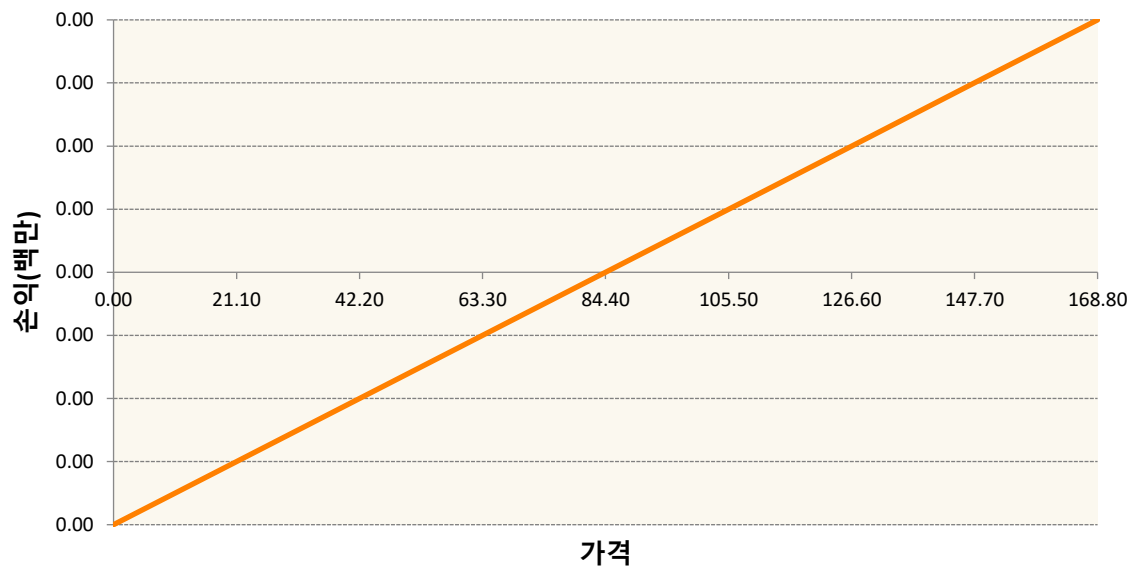
(단위:백만원)

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	1,164	0	1,164	
누계	통화	선물	0	248	-248	장내

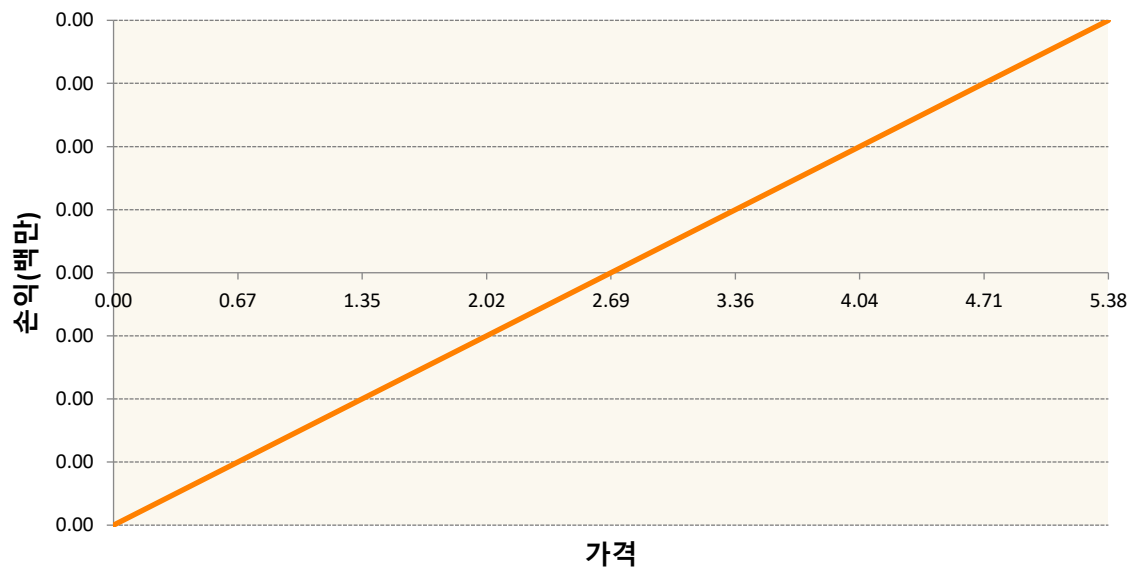
2. 만기시점의 손익구조



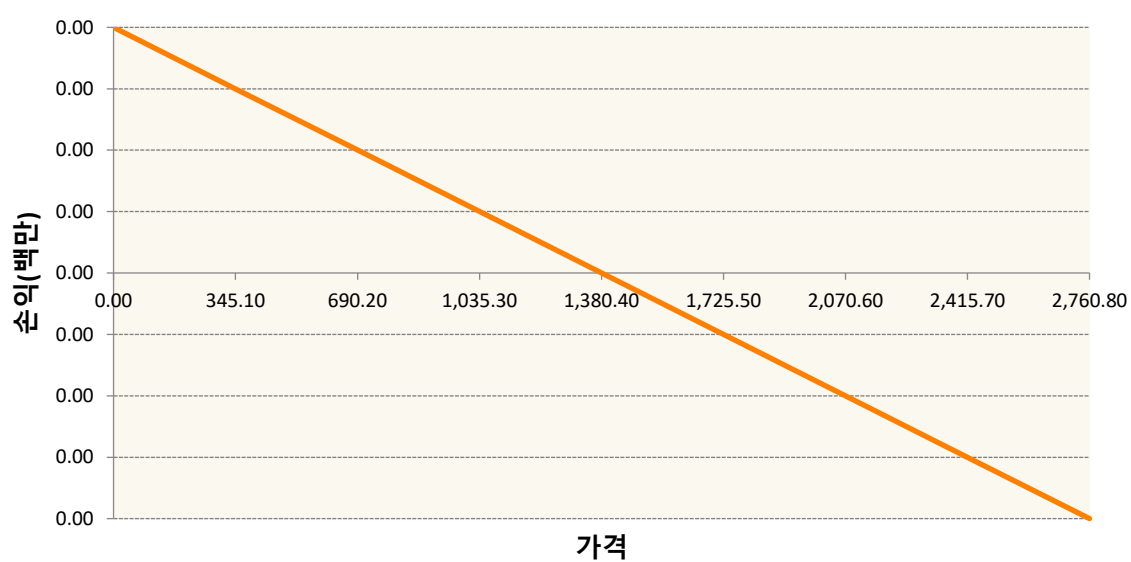
ECN4-E-mini Crude Oil JUL24



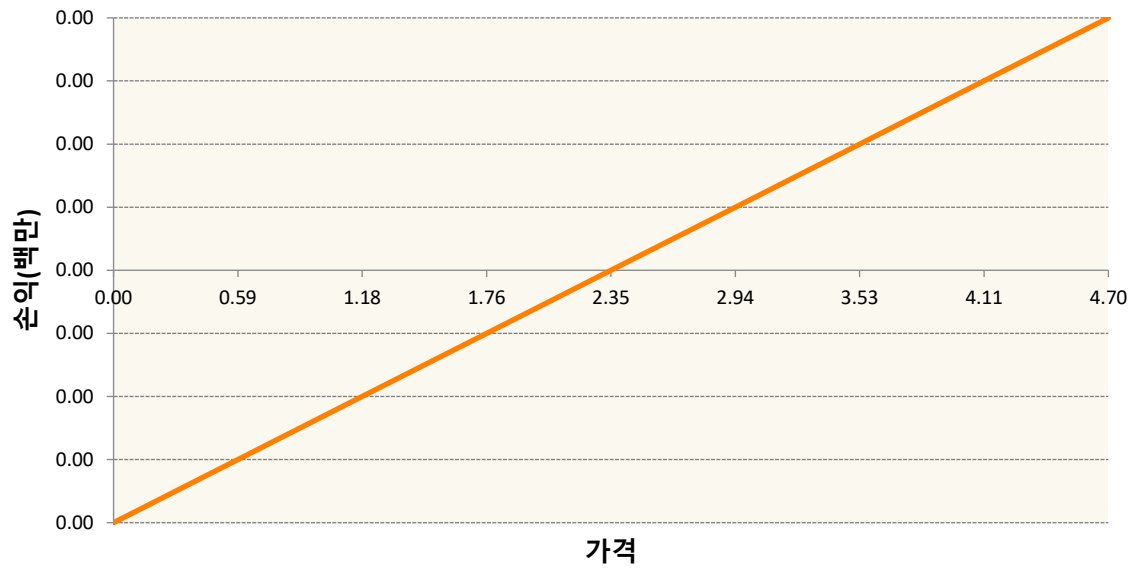
HON4-NY Harb ULSD Fut Jul24



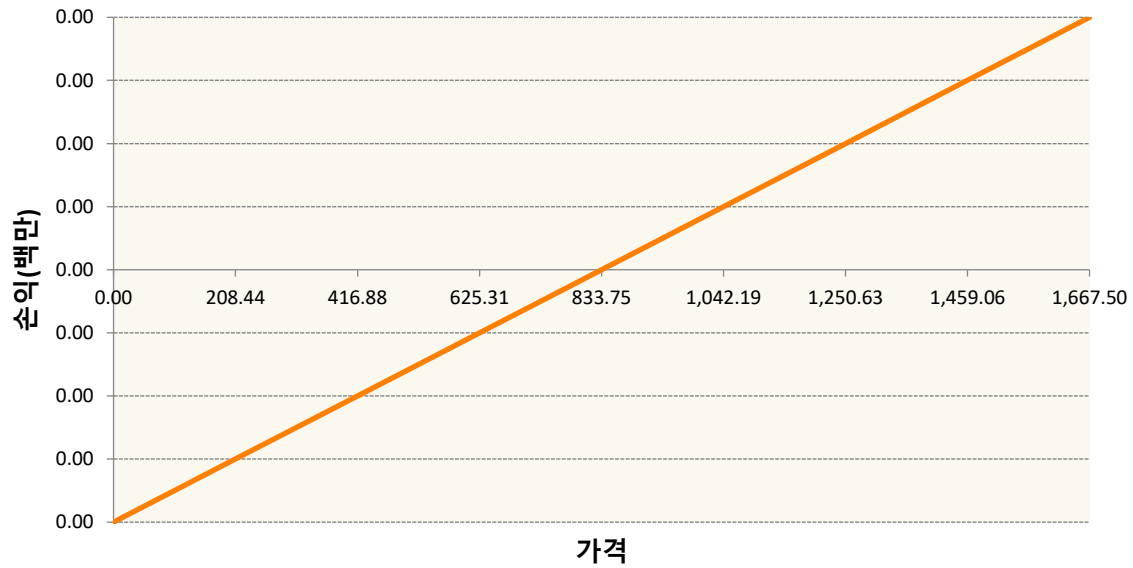
KR4175V50007-2024-05 달러선물



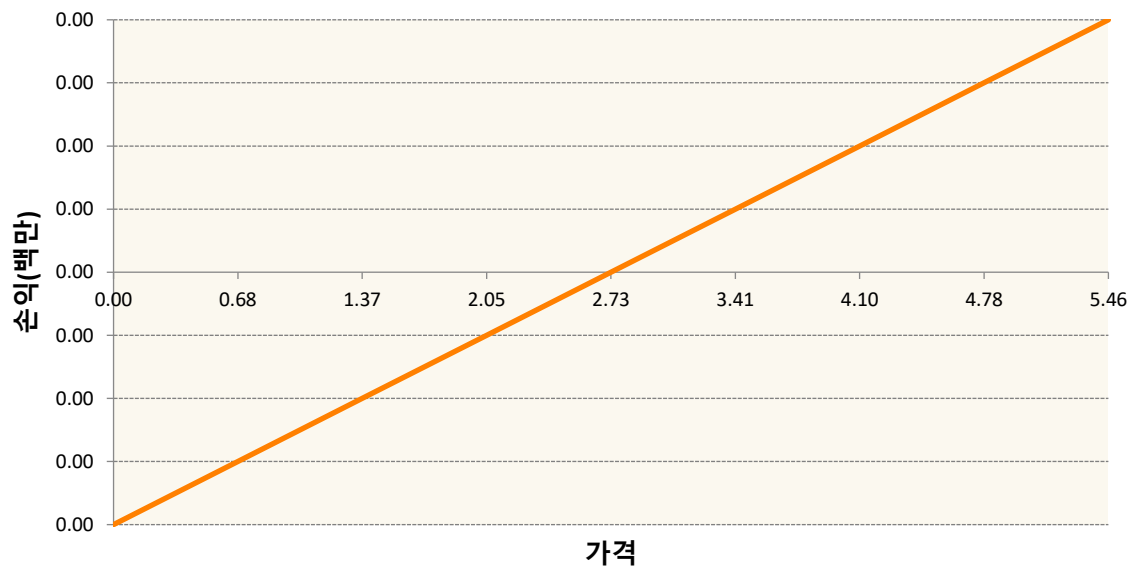
NGN24-NATURAL GAS FUTR JUL24



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)

200