

공시일	2024-04-17
기준일	2024-04-16

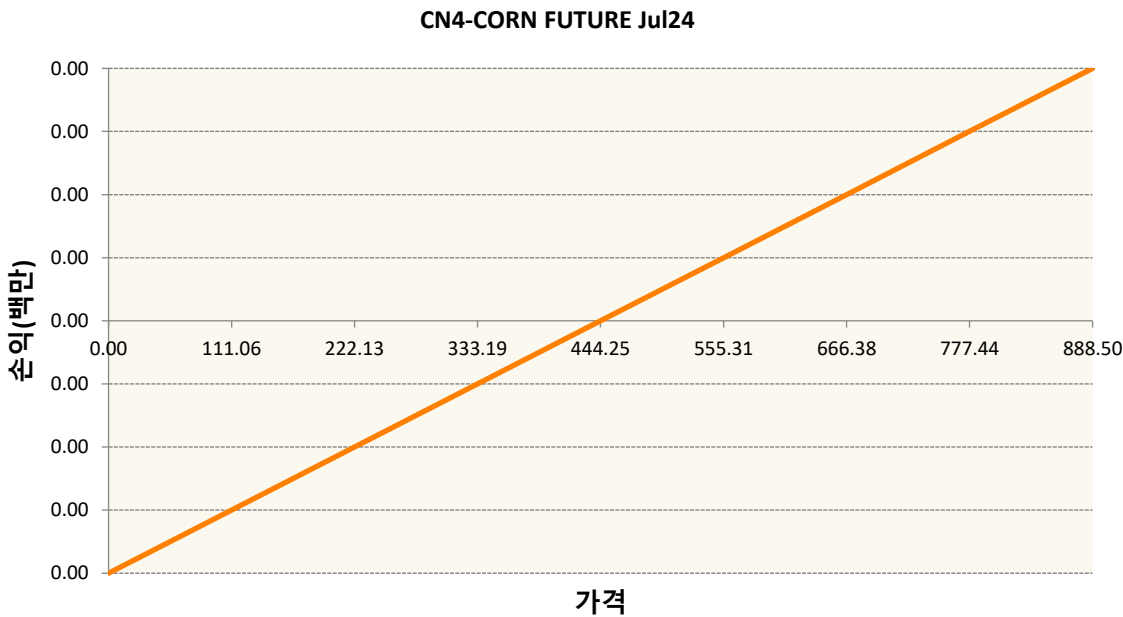
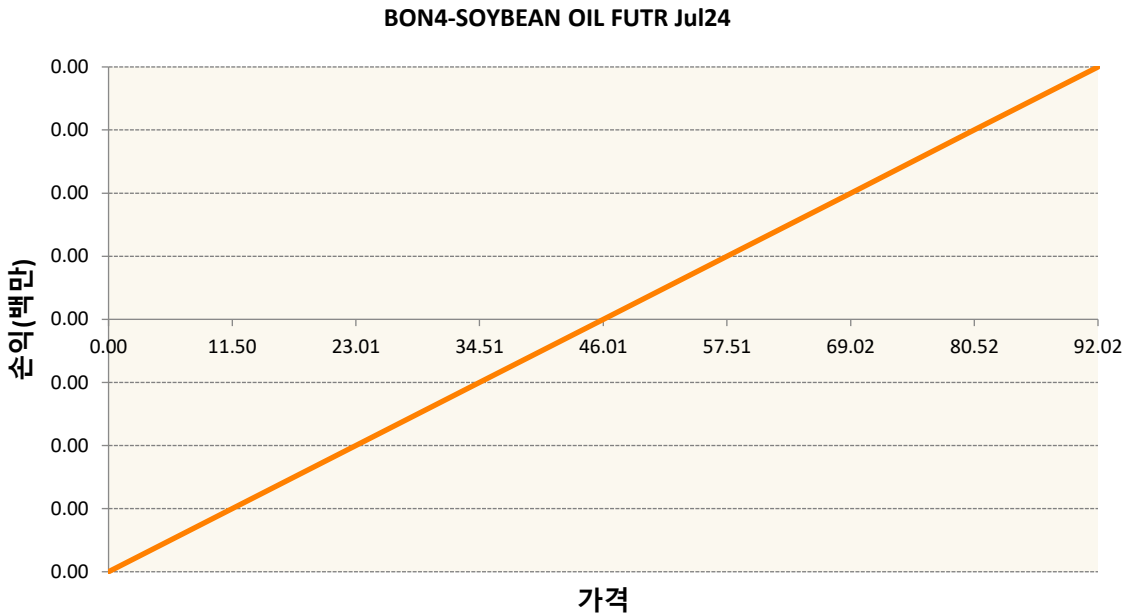
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

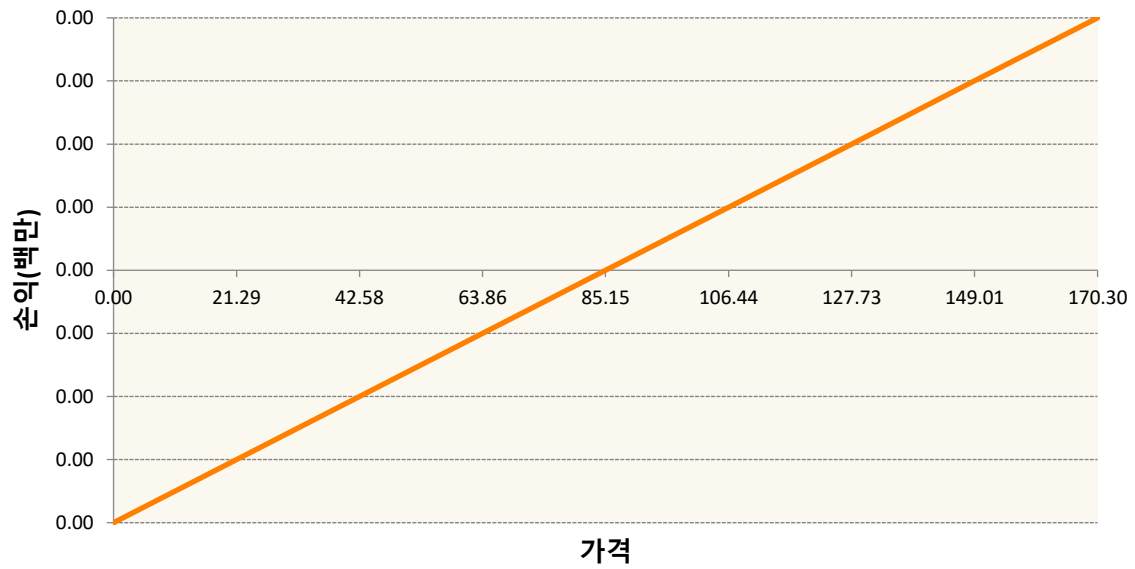
(단위:USD 백만)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	28	0	28	장내
누계	유가증권	선물	4,204	0	4,204	
누계	통화	선물	0	516	-516	장내

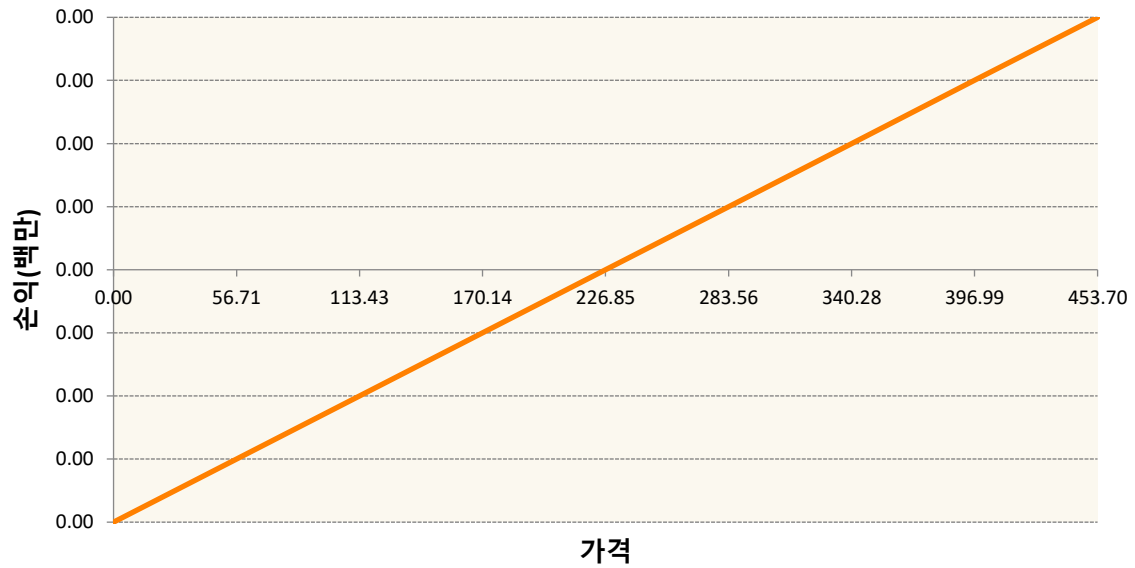
2. 만기시점의 손익구조



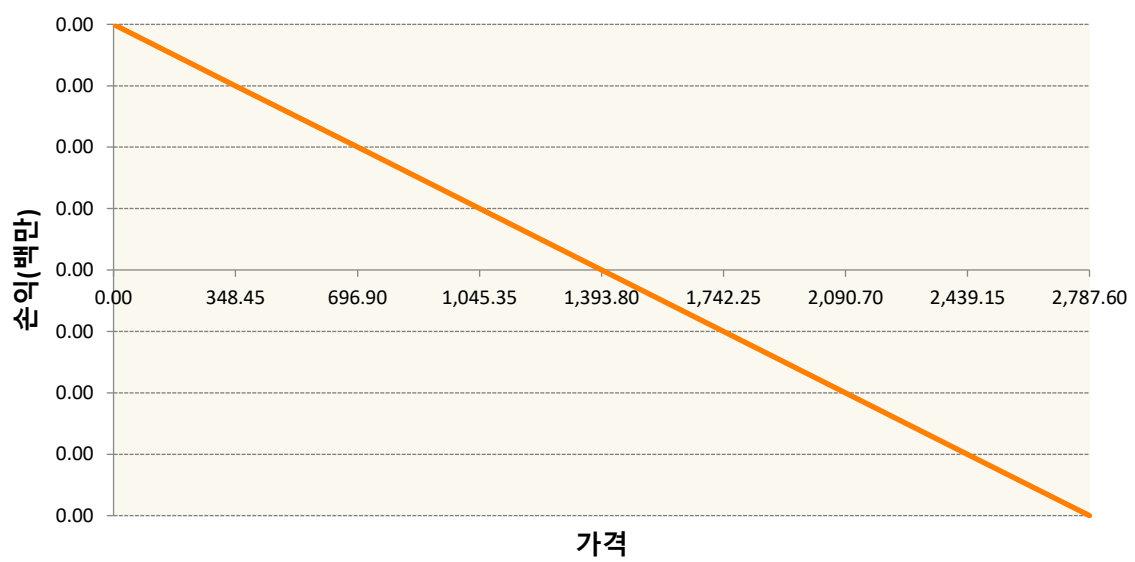
CTN4-COTTON NO.2 FUTR Jul24



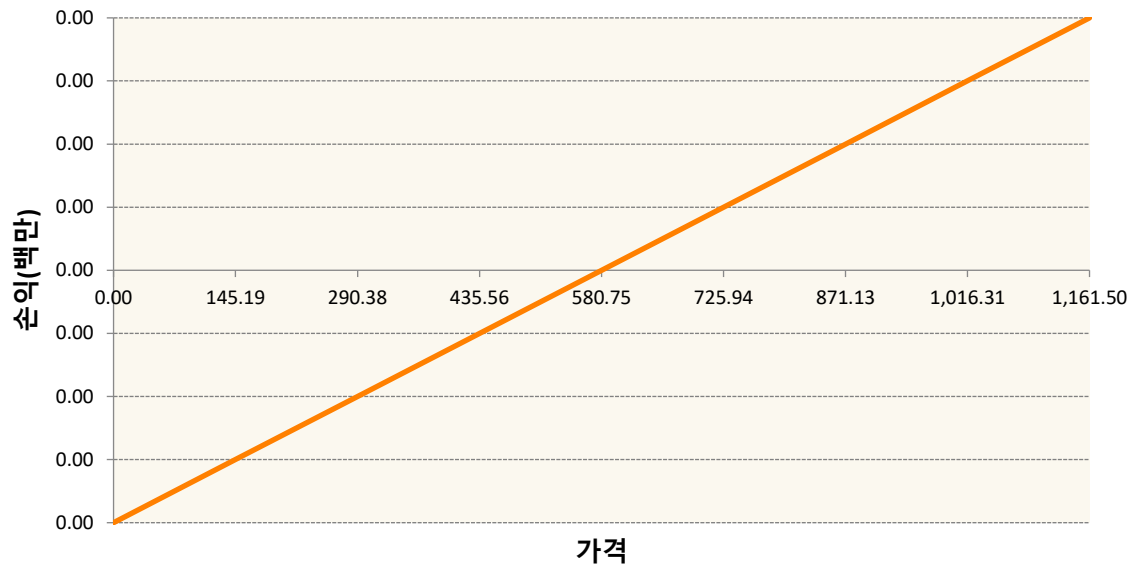
KCN4-COFFEE 'C' FUTURE Jul24



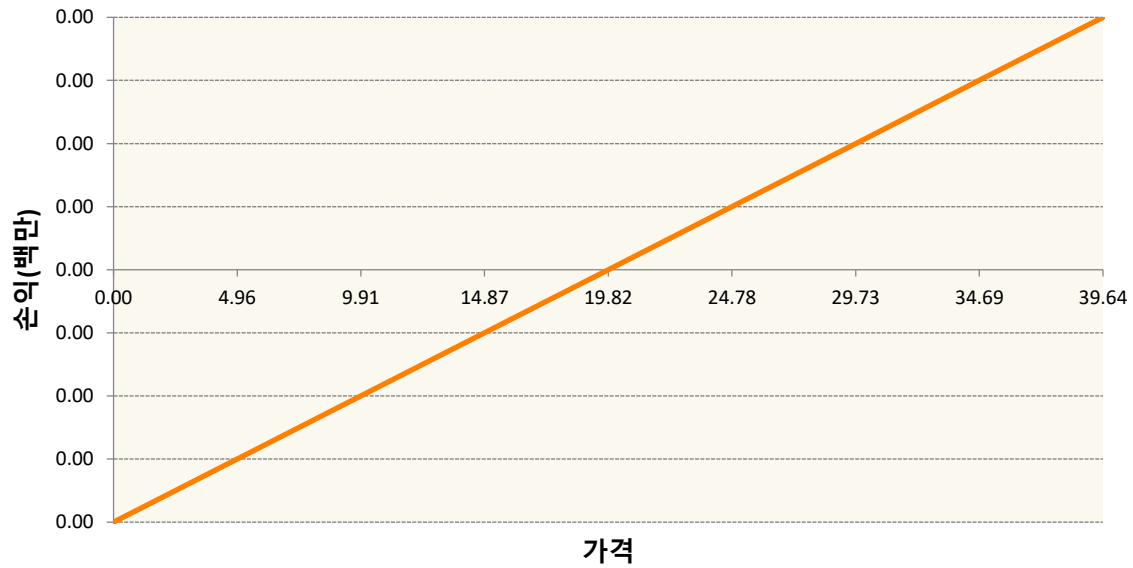
KR4175V50007-2024-05 달러선물



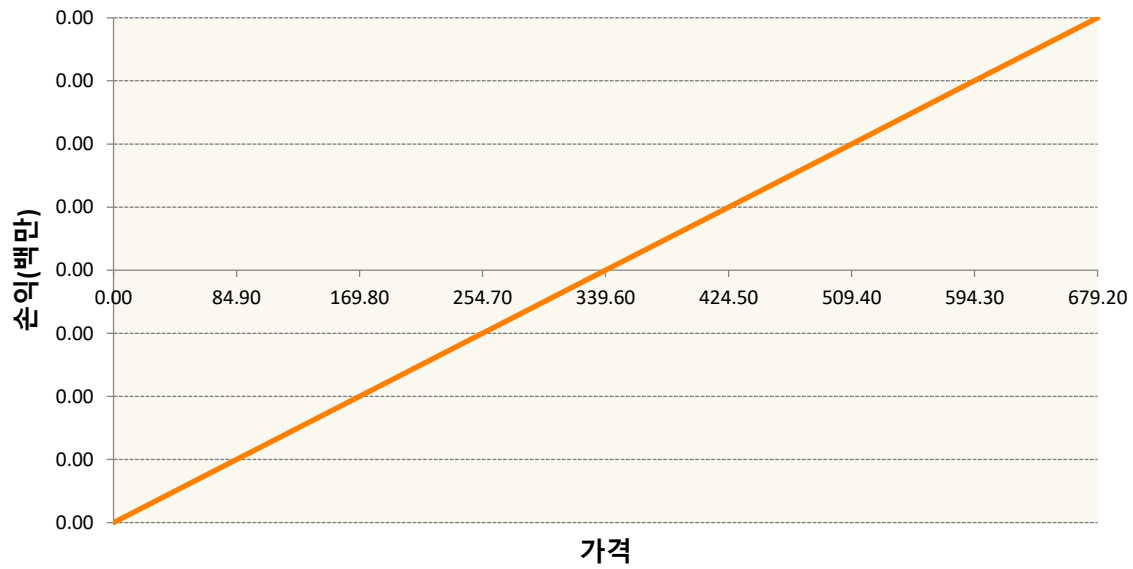
KWN4-KC HRW WHEAT FUT Jul24

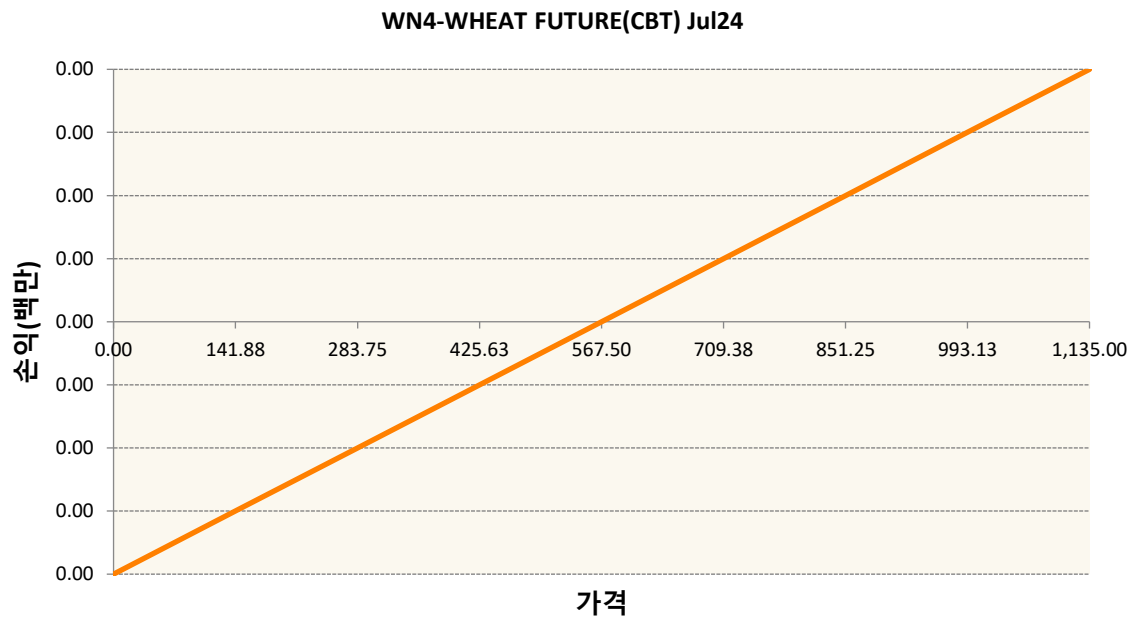
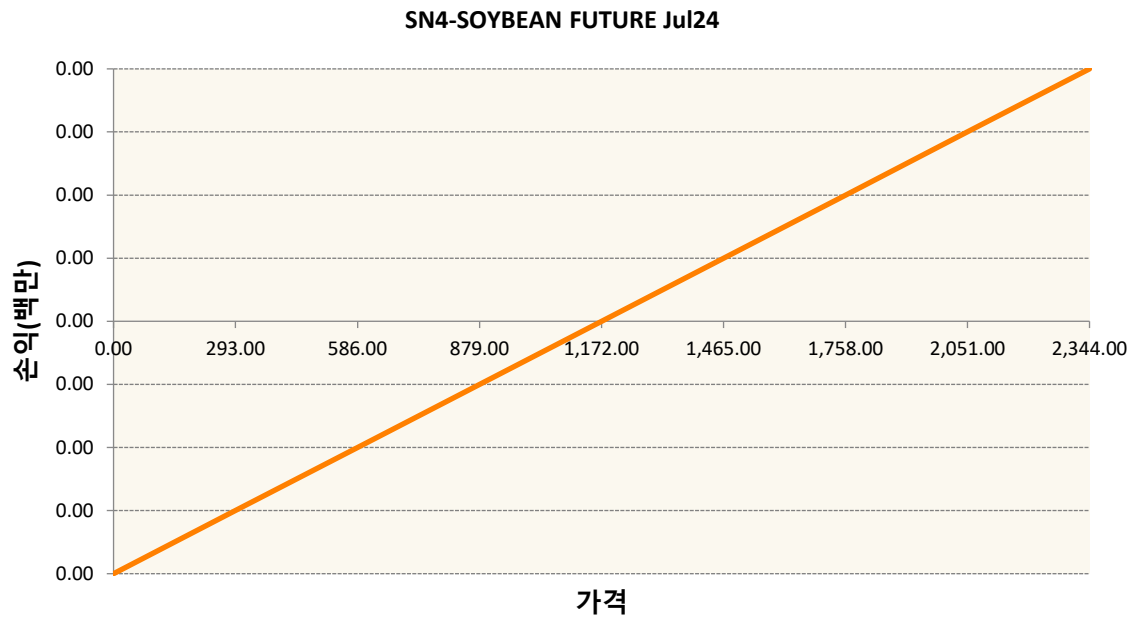


SBN4-Sugar #11 (WORLD) Jul24



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	2024-04-17
기준일	2024-04-16

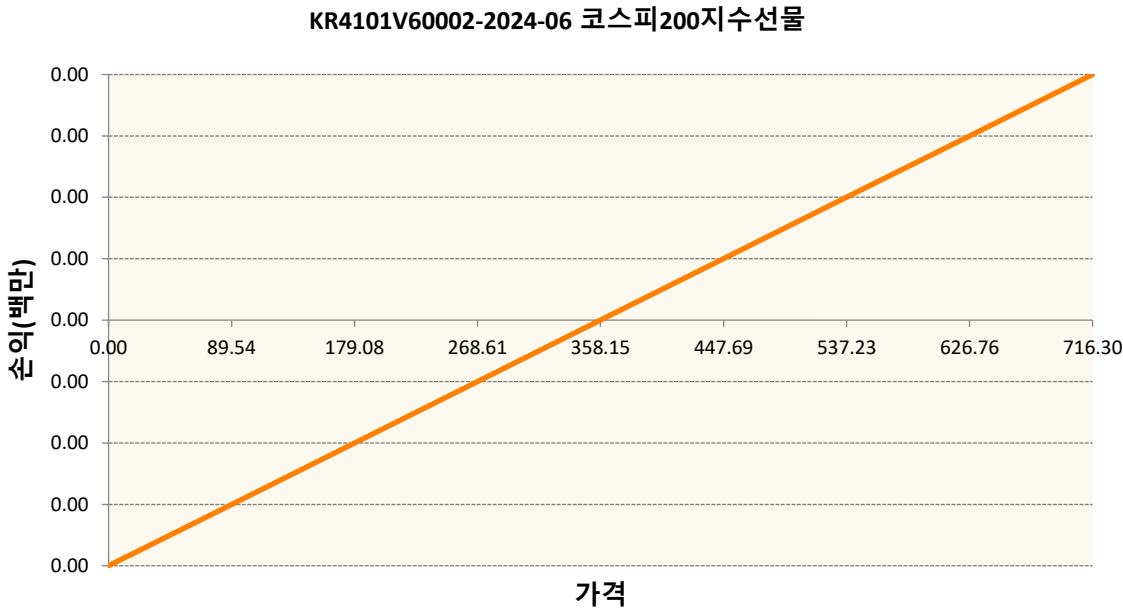
스마트인덱스모

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	179	-179	장내
누계	유가증권	선물	1,612	0	1,612	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101V60002		2024-06 코스피200지수선물					128
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-128	-128	-128	-128	-128	-128	-128
-5.33%	-86	-86	-86	-86	-86	-86	-86
-2.67%	-43	-43	-43	-43	-43	-43	-43
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	43	43	43	43	43	43	43
5.33%	86	86	86	86	86	86	86
8.00%	128	128	128	128	128	128	128

공시일	2024-04-17
기준일	2024-04-16

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	265
-----------------------------	-----

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

312

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2024-04-17
기준일	2024-04-16

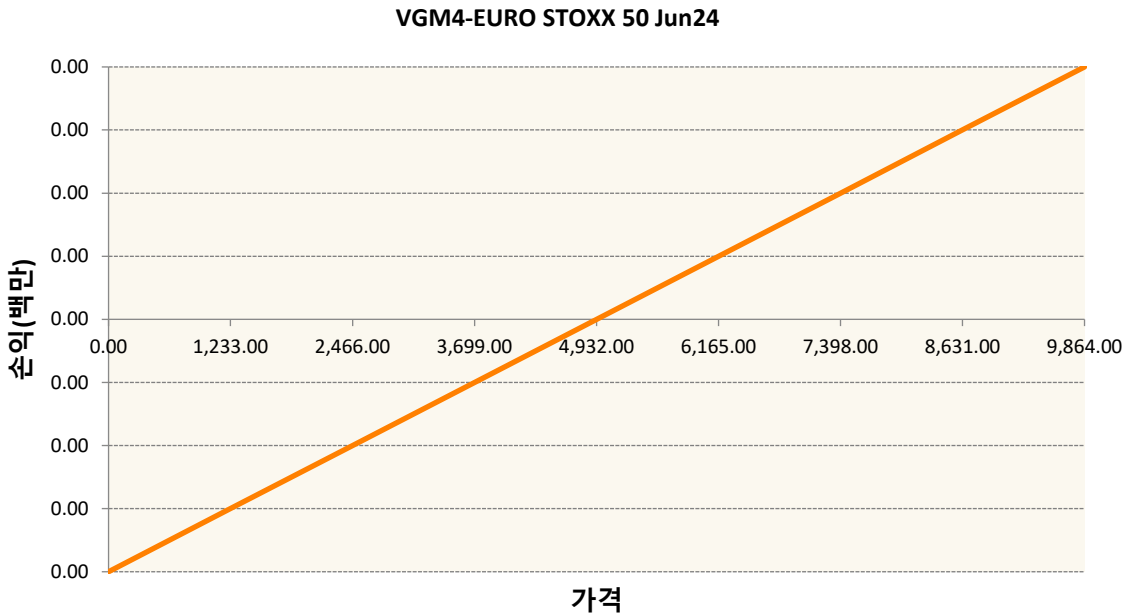
유로인덱스모(주식-파생형)

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	920	0	920	
누계	통화	선도	222	0	222	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213E3K(EUR/KRW 21-06-24E	18
VGM4 EURO STOXX 50 Jun24	74

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

(단위:백만원)

61

공시일	2024-04-17
기준일	2024-04-16

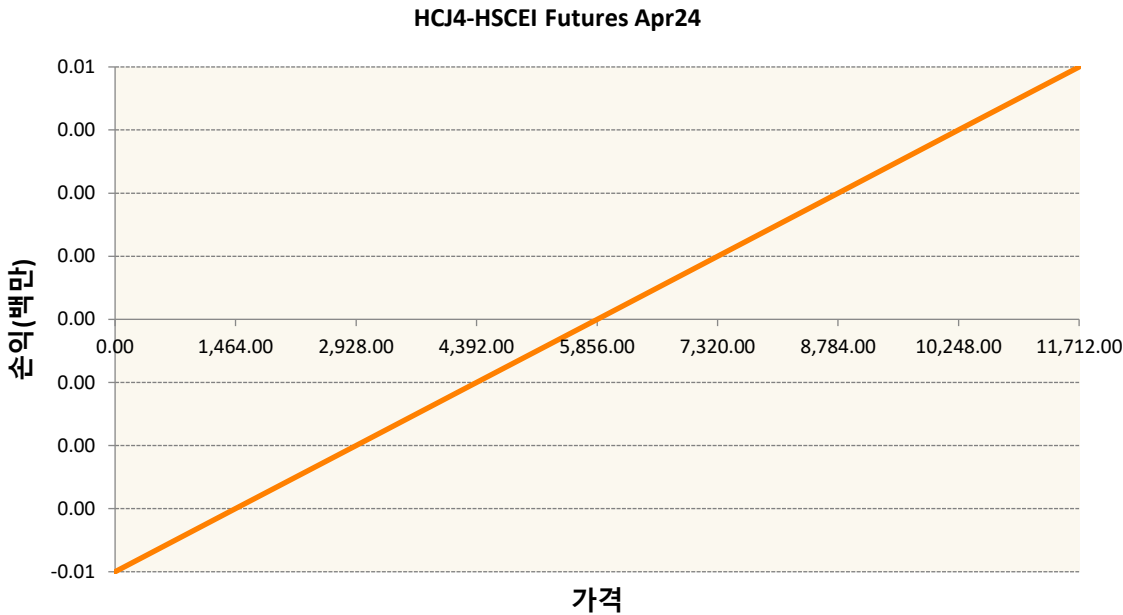
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,103	0	1,103	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCI4	HSCEI Futures Apr24	88
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

116

공시일	2024-04-17
기준일	2024-04-16

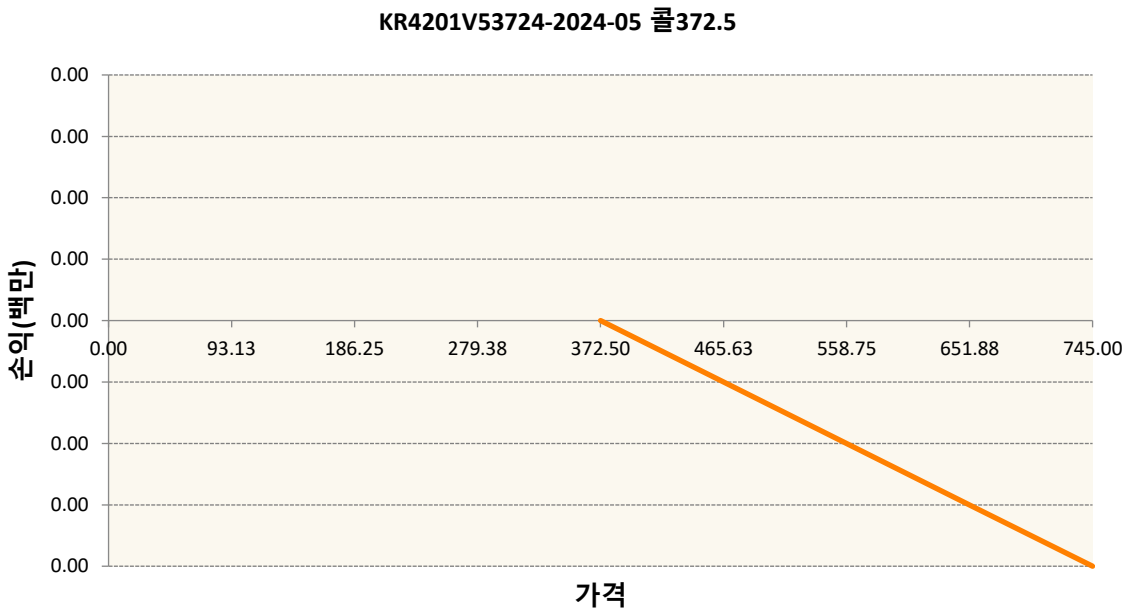
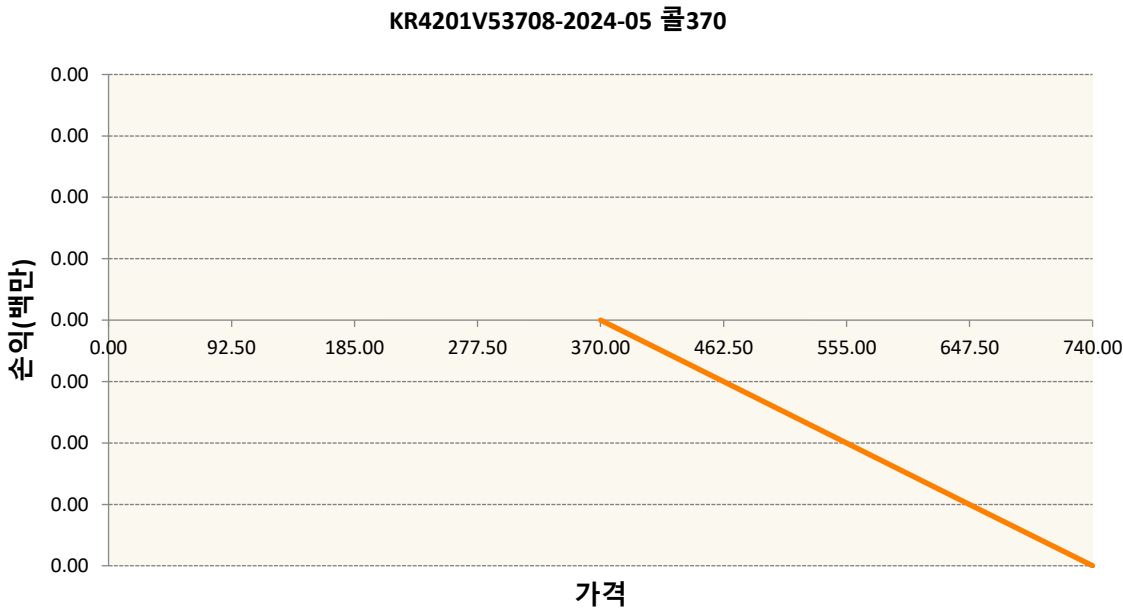
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

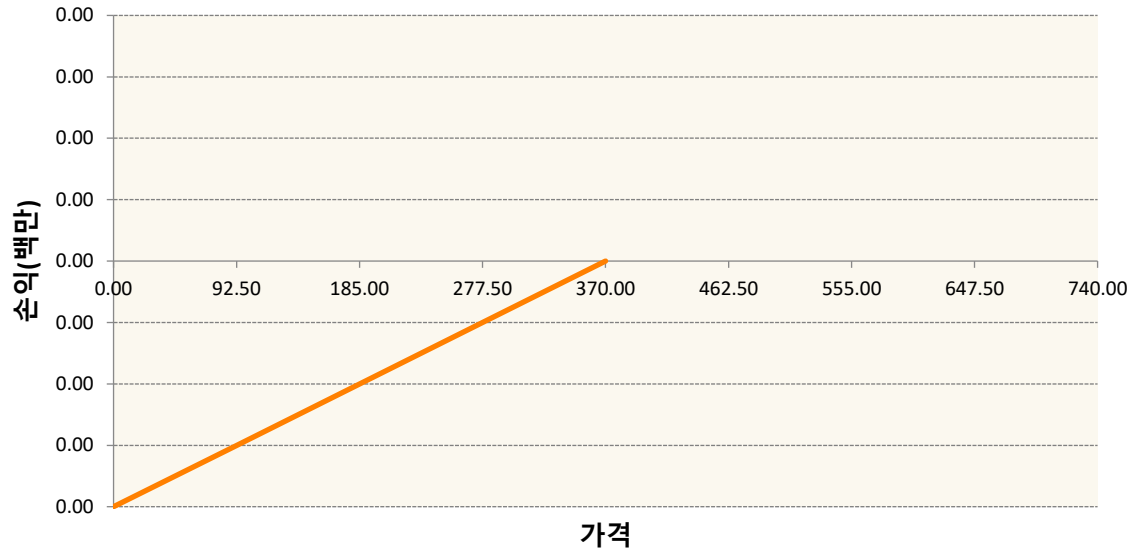
(단위:백만원)

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						1,205
		기초자산의 변동성						
가격		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	344	338	329	317	302	283	261	
-5.33%	326	311	291	267	240	209	176	
-2.67%	273	242	207	168	128	85	40	
0%	150	102	51	0	-53	-106	-160	
2.67%	-78	-137	-196	-255	-315	-374	-434	
5.33%	-429	-487	-546	-605	-664	-724	-783	
8.00%	-896	-943	-992	-1,043	-1,096	-1,150	-1,205	
KR4201V53724		2024-05 콜372.5						616
		기초자산의 변동성						
가격		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	161	158	154	149	142	133	122	
-5.33%	154	147	138	126	113	98	82	
-2.67%	131	116	99	81	60	39	16	
0%	76	52	26	0	-27	-55	-83	
2.67%	-31	-62	-94	-125	-157	-189	-221	
5.33%	-203	-236	-268	-301	-333	-366	-399	
8.00%	-440	-467	-496	-525	-555	-585	-616	
KR4301V53706		2024-05 풋370						590
		기초자산의 변동성						
가격		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-585	-585	-585	-586	-587	-588	-590	
-5.33%	-372	-373	-374	-376	-379	-383	-387	
-2.67%	-163	-167	-172	-177	-184	-191	-198	
0%	29	20	10	0	-11	-22	-33	

2.67%	182	169	155	142	128	115	101
5.33%	280	267	254	241	228	214	201
8.00%	327	319	310	300	290	279	268

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

(단위:백만원)

2,177

공시일	2024-04-17
기준일	2024-04-16

H2O글로벌본드(USD)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	165	-165	
누계	유가증권	수익증권	1,611	0	1,611	

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	2024-04-17
기준일	2024-04-16

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	4,435	0	4,435	

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	2024-04-17
기준일	2024-04-16

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	15,945	0	15,945	
누계	통화	선도	0	16,155	-16,155	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213E1W KRW/USD 30-04-24E	260
FXW213E2TC KRW/USD 31-05-24E	602
FXW213E3TC KRW/USD 28-06-24E	430
IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

600

공시일	2024-04-17
기준일	2024-04-16

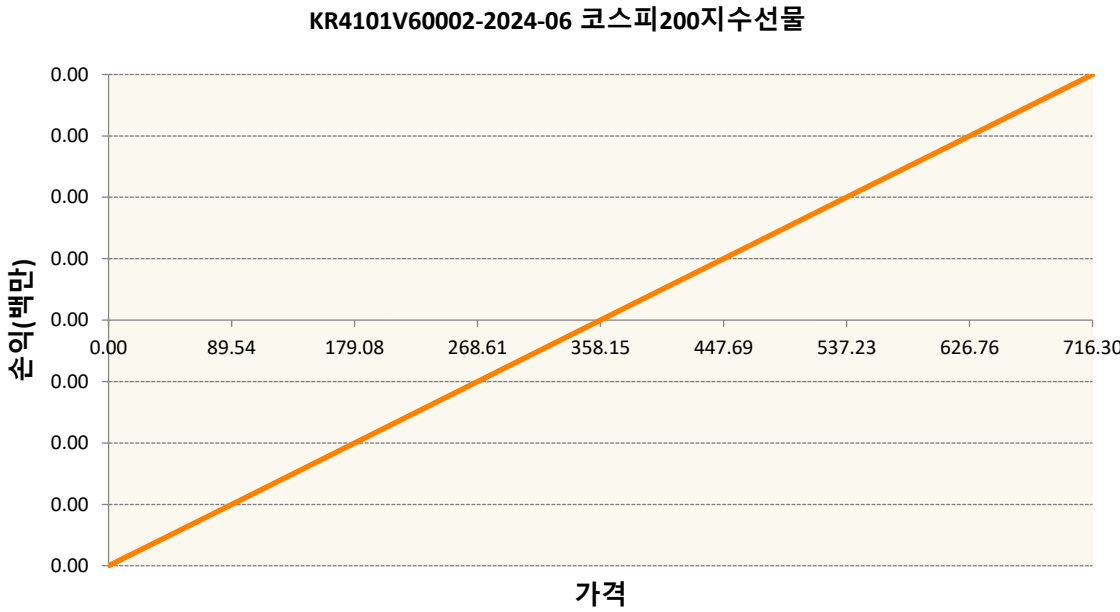
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

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	448	0	448	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101V60002			2024-06 코스피200지수선물				36
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-36	-36	-36	-36	-36	-36	-36
-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%	36	36	36	36	36	36	36

공시일	2024-04-17
기준일	2024-04-16

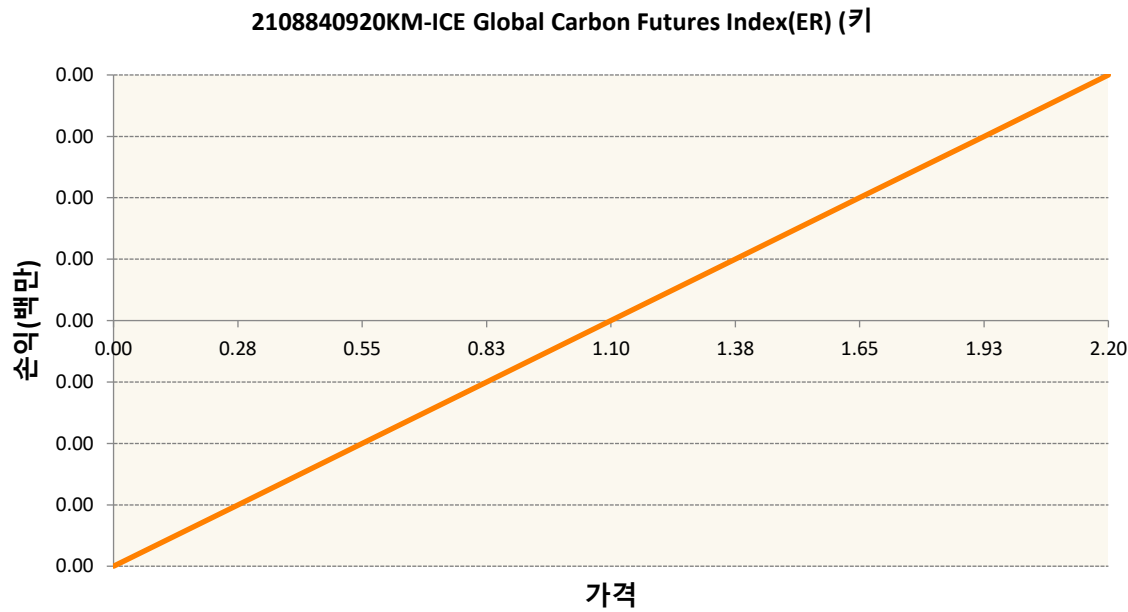
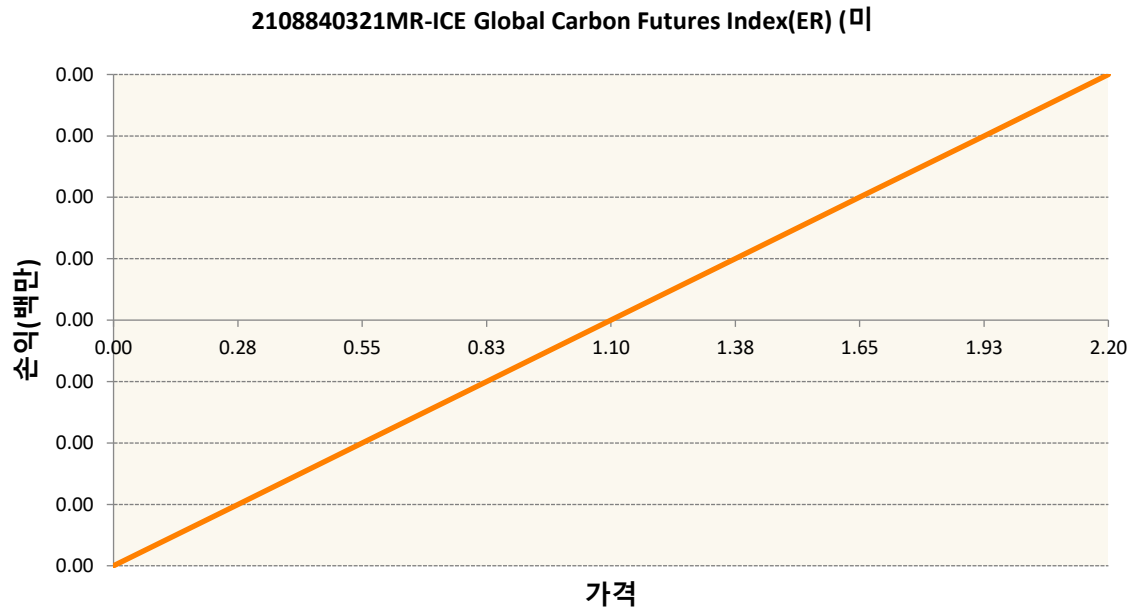
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

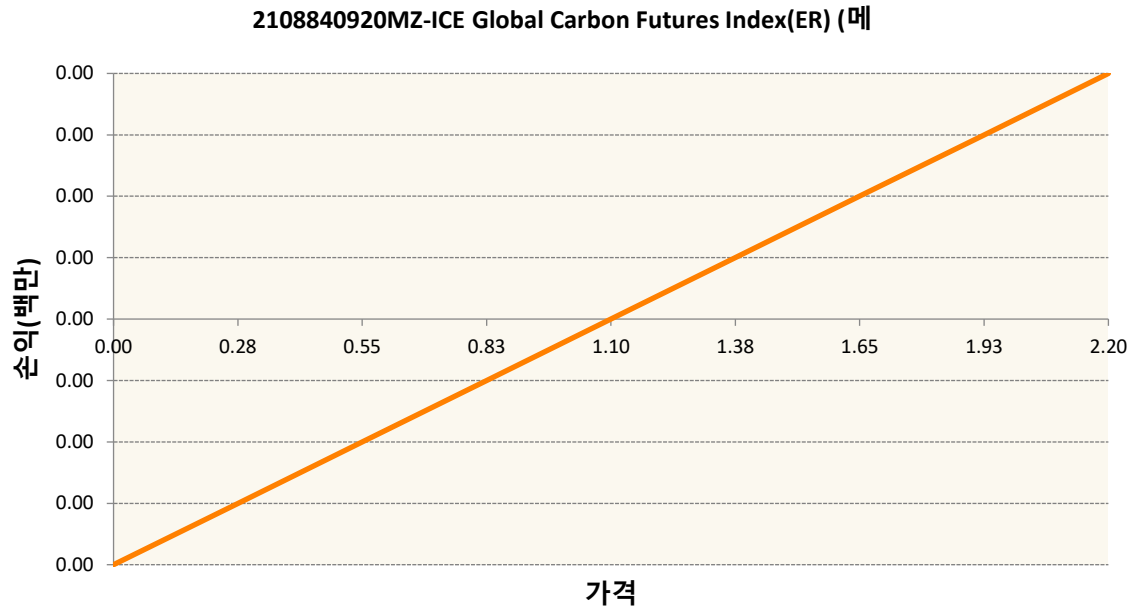
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	20,284	0	20,284	

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108840321IICE Global Carbon Futures Index(ER) (미		479
2108840920IICE Global Carbon Futures Index(ER) (키		957
2108840920IICE Global Carbon Futures Index(ER) (메		191

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)		(단위:백만원)
		1,899

공시일	2024-04-17
기준일	2024-04-16

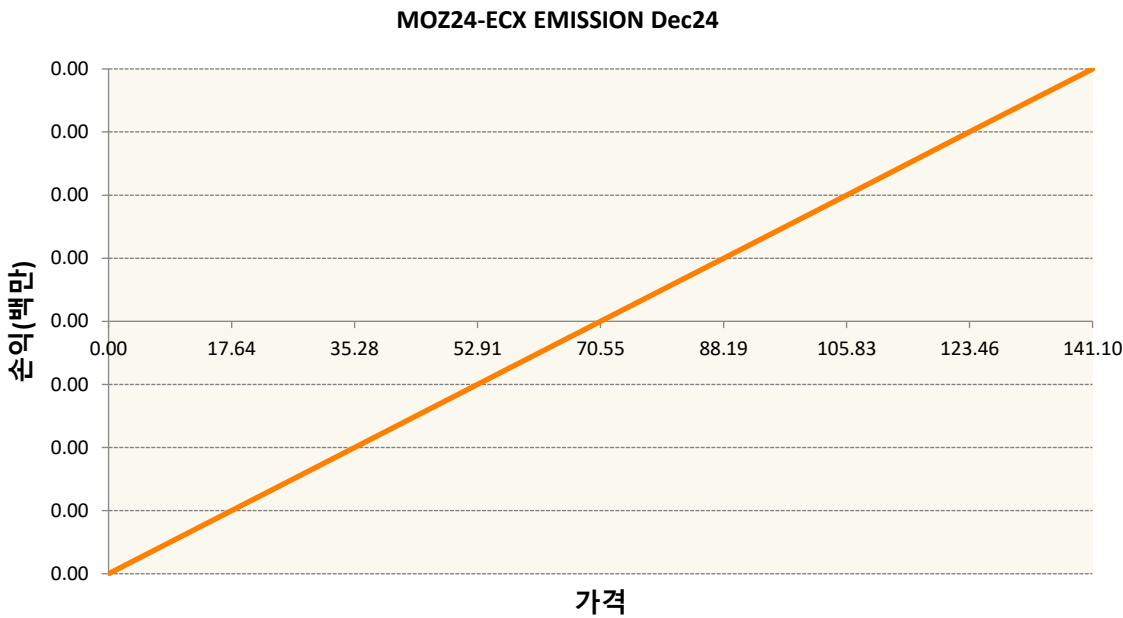
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	10,570	0	10,570	
누계	지수	스왑	331	0	331	장외
누계	통화	선도	0	2,626	-2,626	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213E3SC KRW/EUR 30-04-24E	62
FXW213E3SC KRW/EUR 30-04-24E	148
MOZ24 ECX EMISSION Dec24	846
SWICEUACN ICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX	4

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

(단위:백만원)

1,630

공시일	2024-04-17
기준일	2024-04-16

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	2024-04-17
기준일	2024-04-16

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)	7
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(NH)	6
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(메리츠)	8
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(키움)	2

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

(단위:백만원)

24

공시일	2024-04-17
기준일	2024-04-16

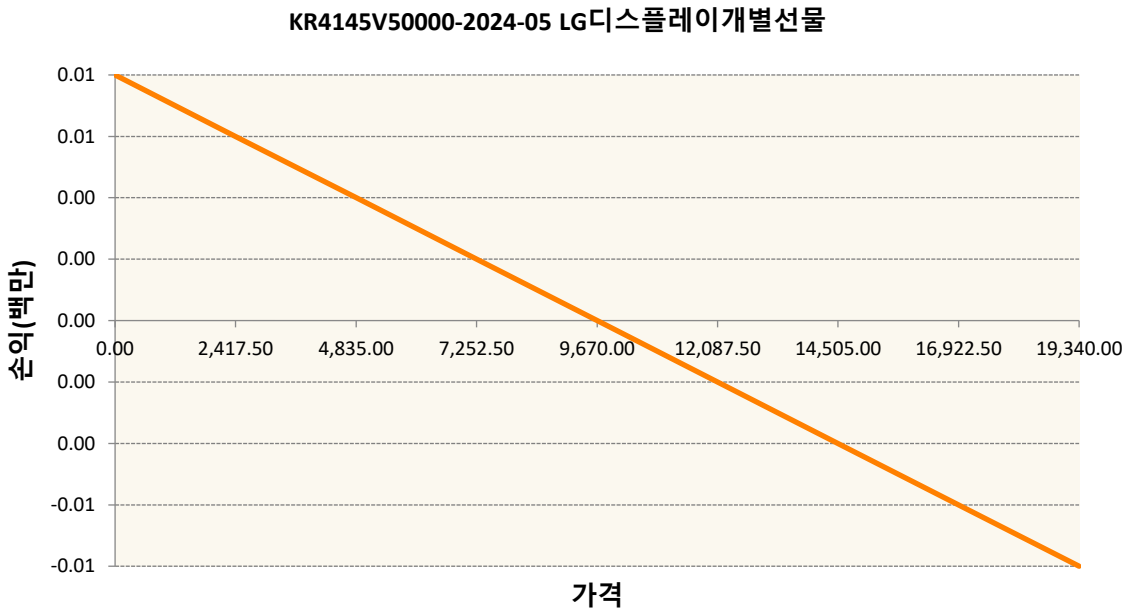
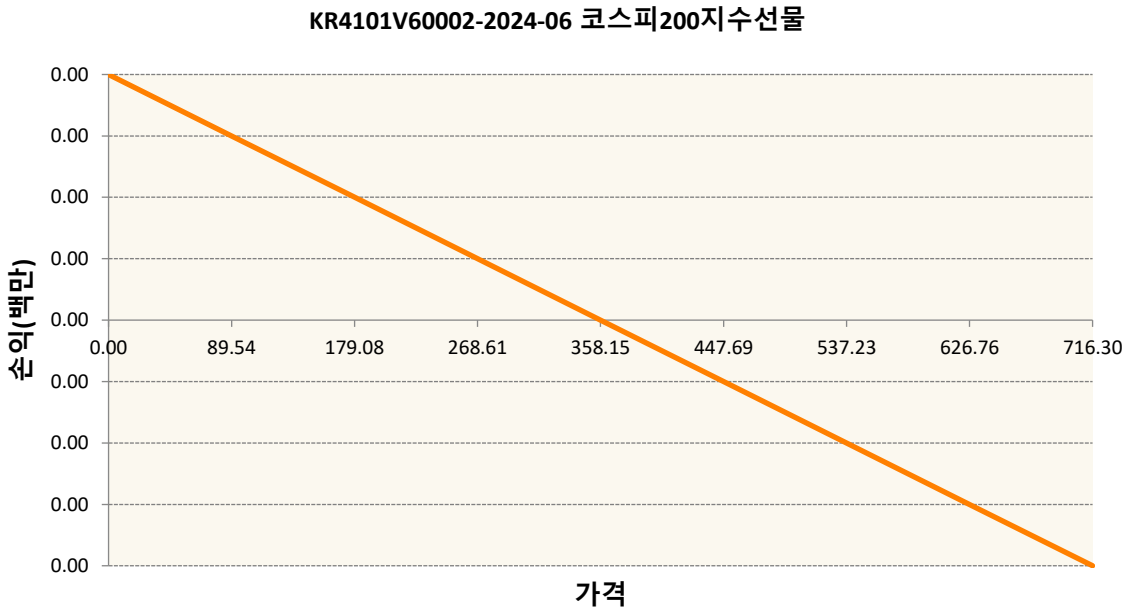
에퀴티알파일반사모혼합자산

1. 계약금액

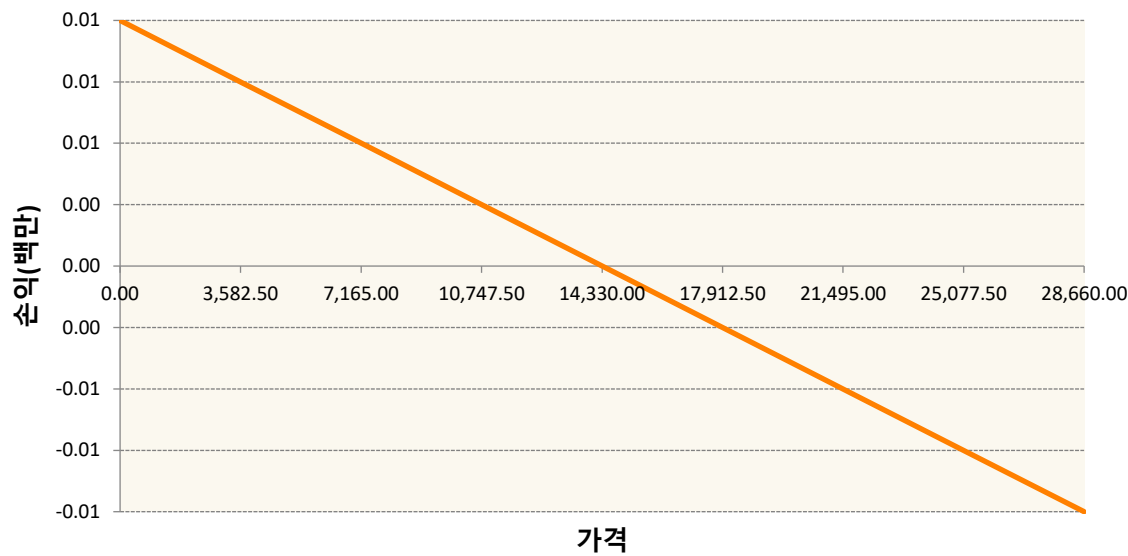
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	2	10	-8	장내
누계	유가증권	선물	0	451	-451	장내

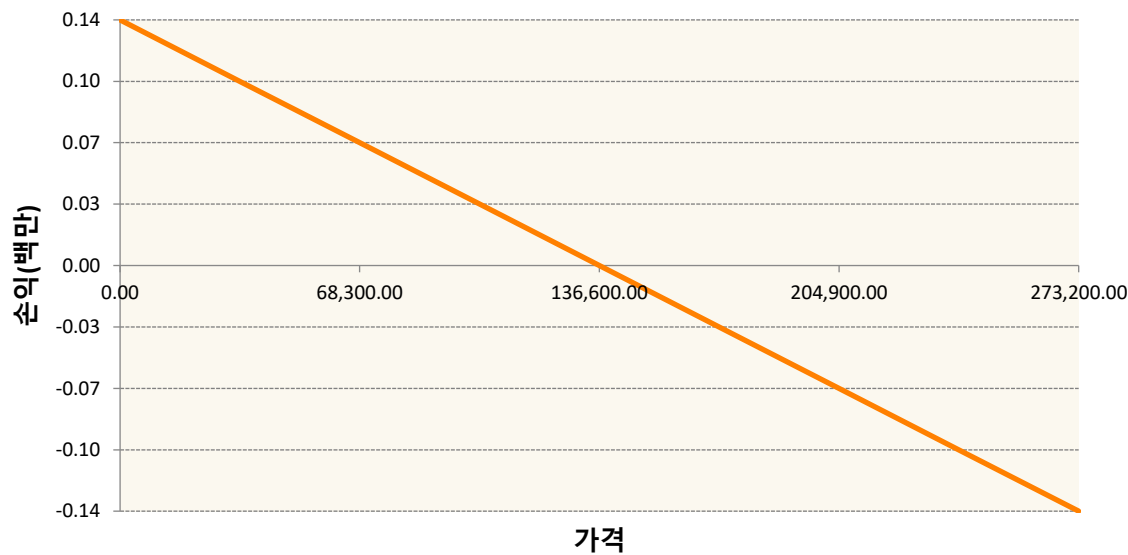
2. 만기시점의 손익구조



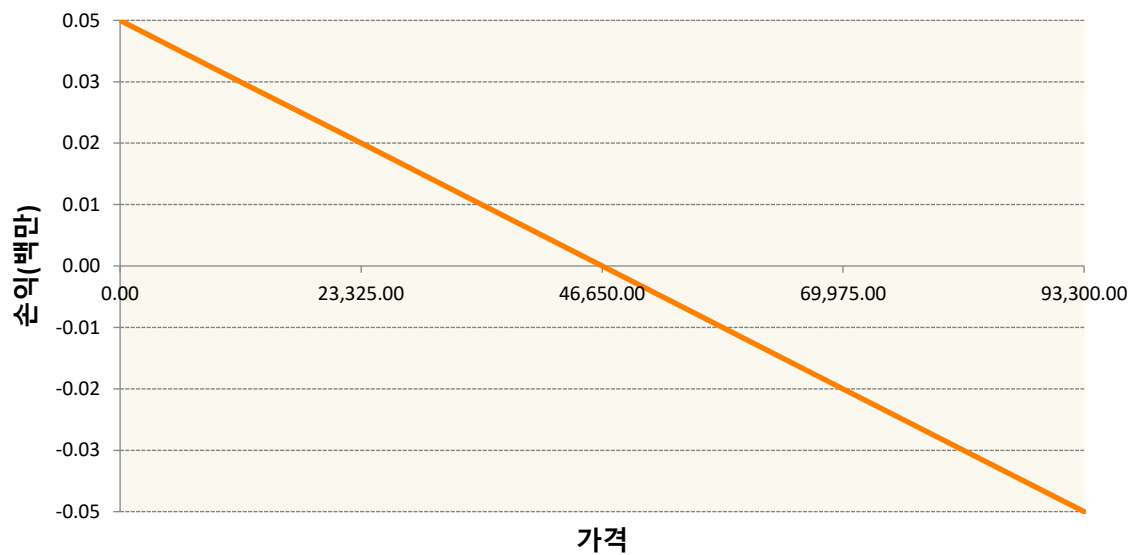
KR4151V50008-2024-05 GS건설개별선물



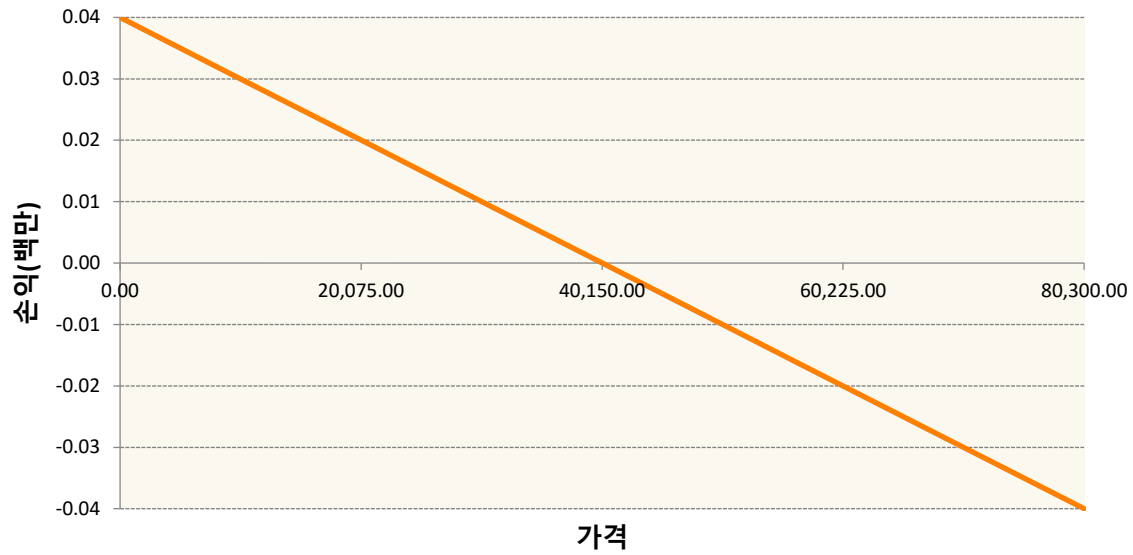
KR41C6V50009-2024-05 아모레퍼시픽개별선물



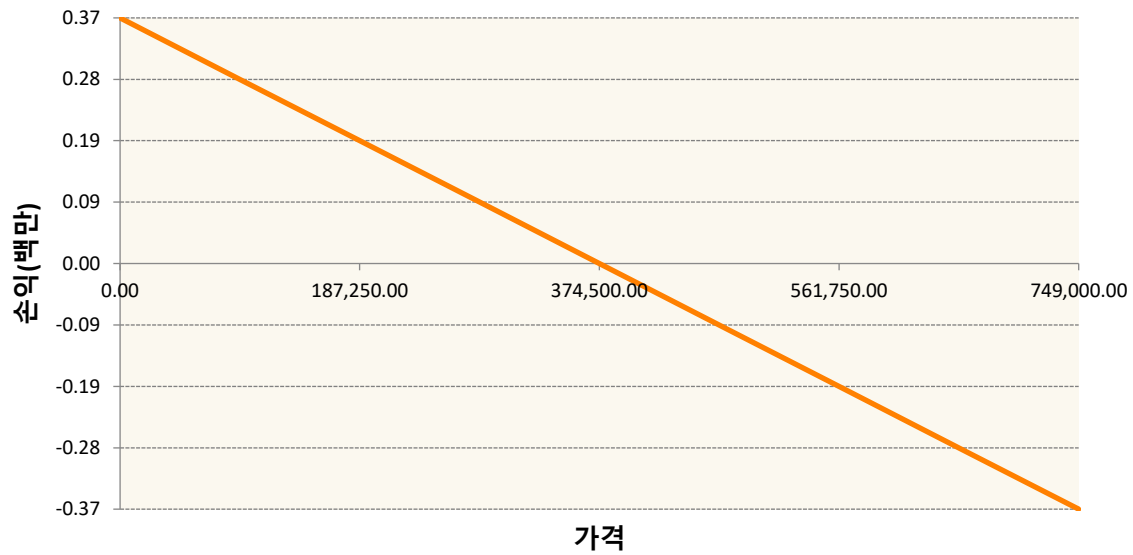
KR41CFV50008-2024-05 카카오개별선물



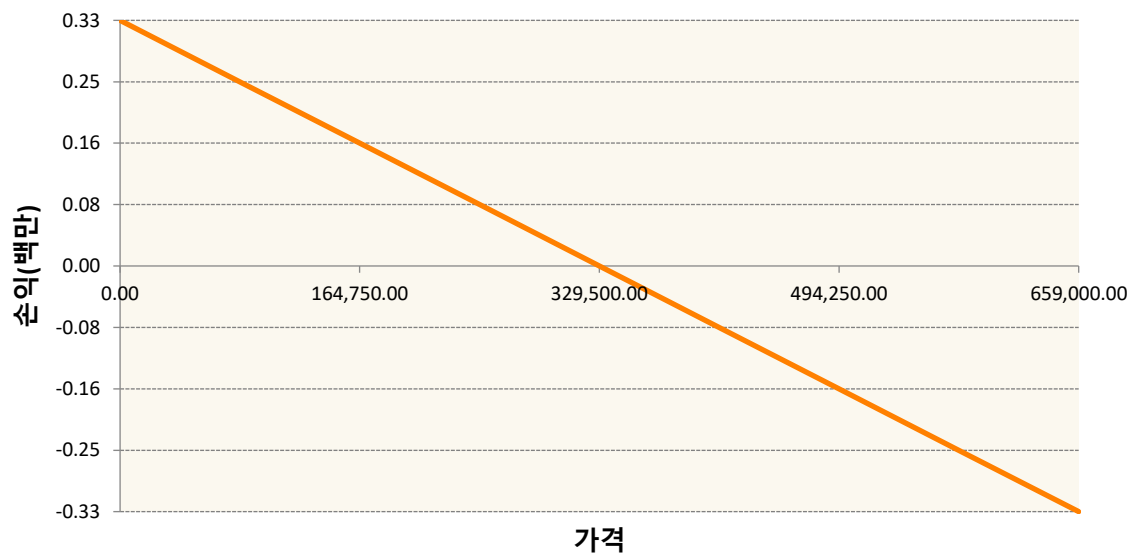
KR41CNV50002-2024-05 포스코DX개별선물



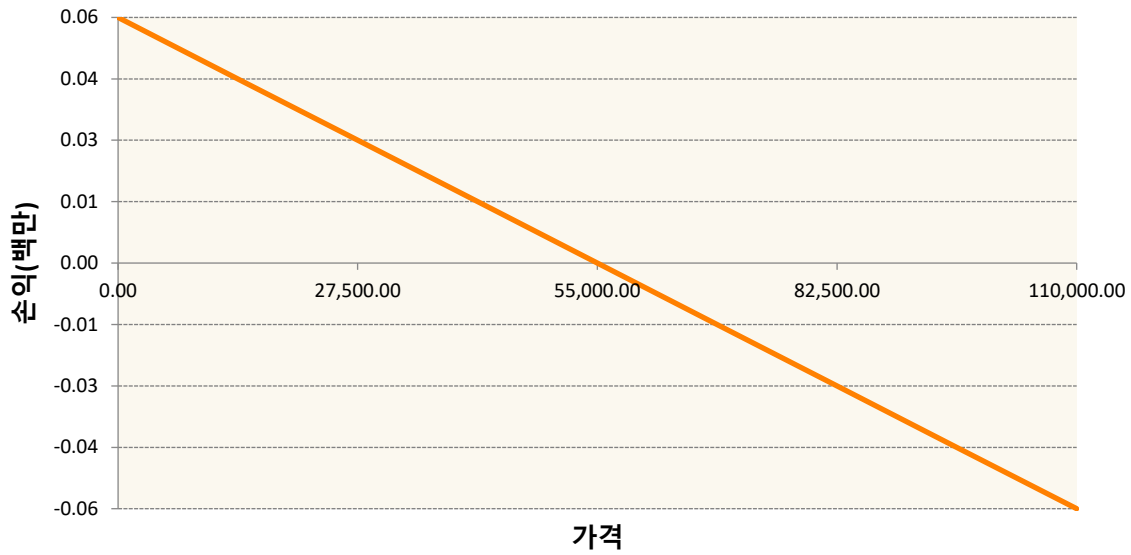
KR41CRV50003-2024-05 LG생활건강개별선물



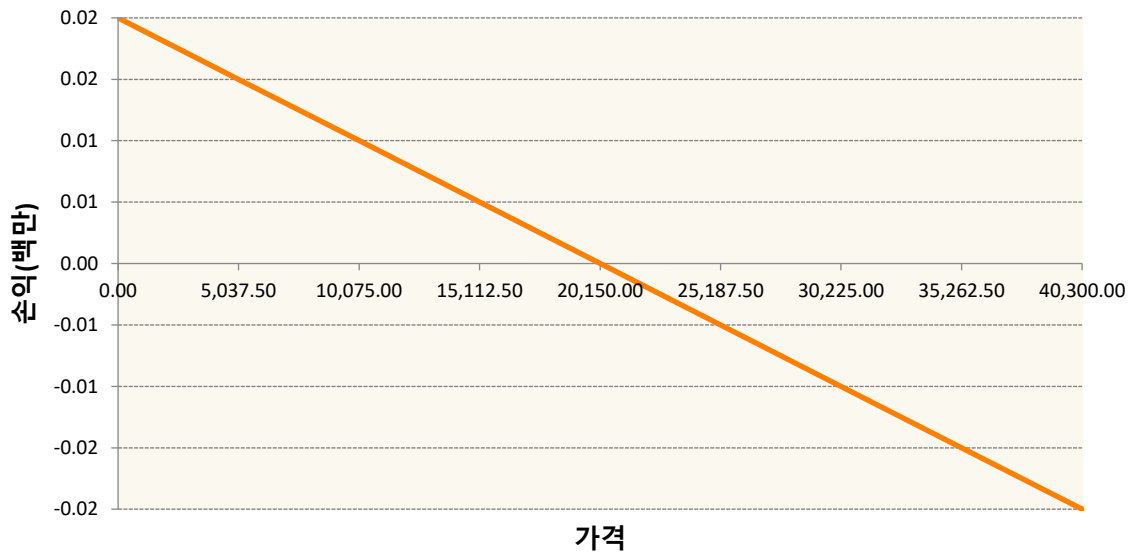
KR41D1V50009-2024-05 CJ제일제당개별선물



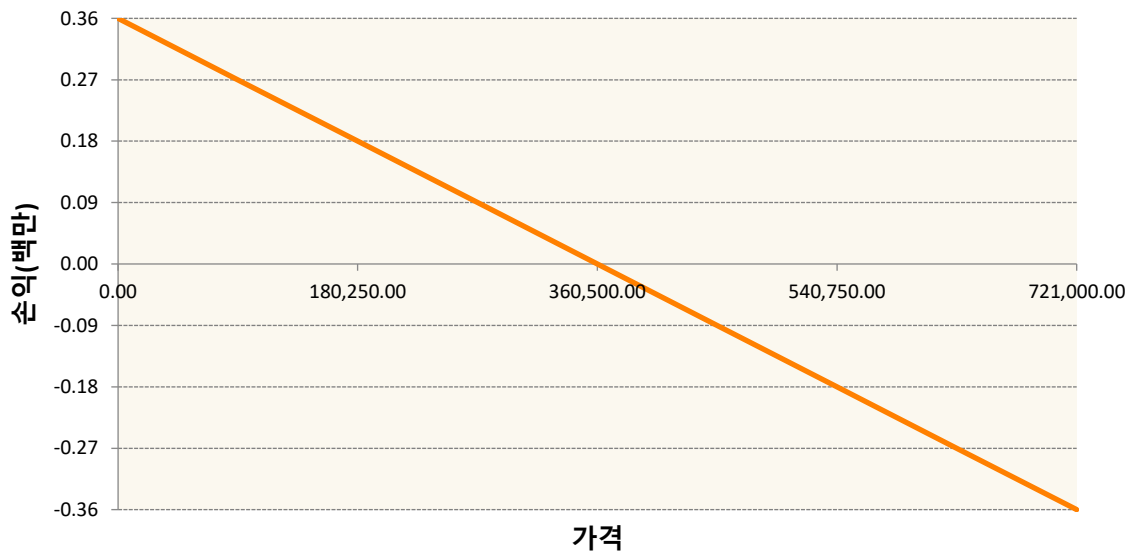
KR41E5V50009-2024-05 넷마블개별선물



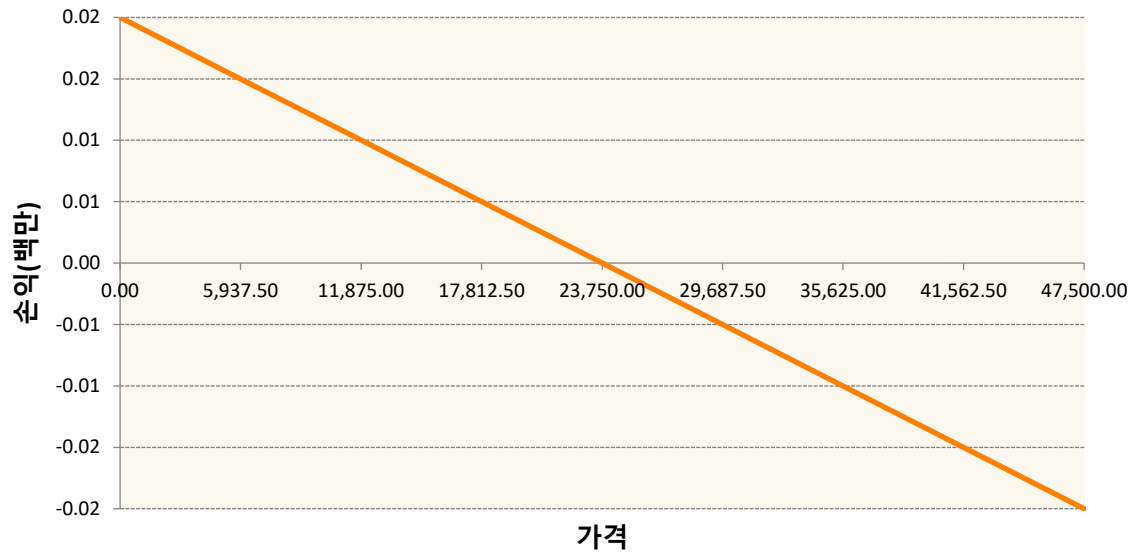
KR41EXV50007-2024-05 카카오게임즈개별선물



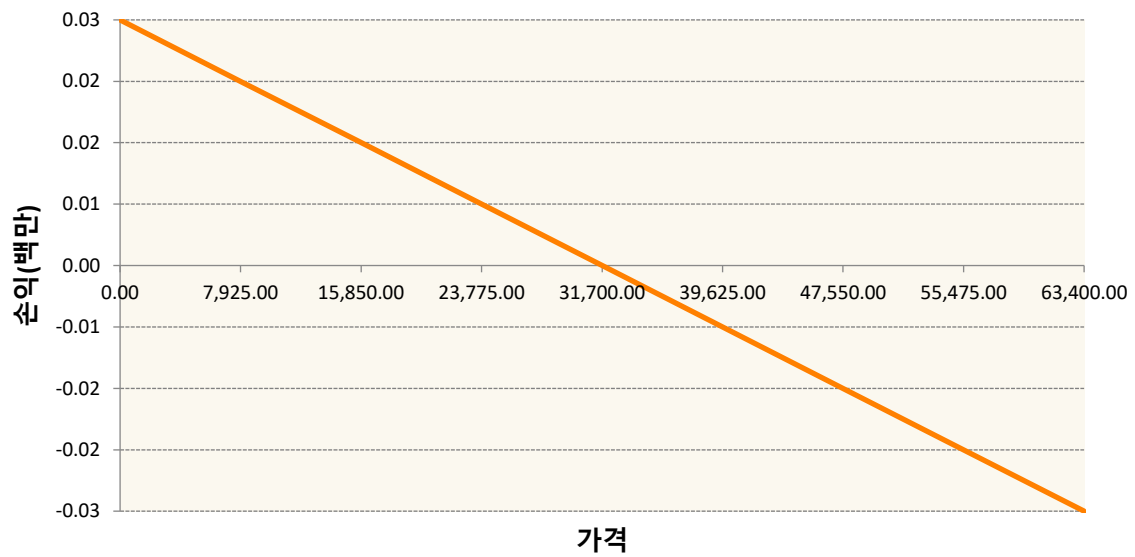
KR41F5V50008-2024-05 LG에너지솔루션개별선물



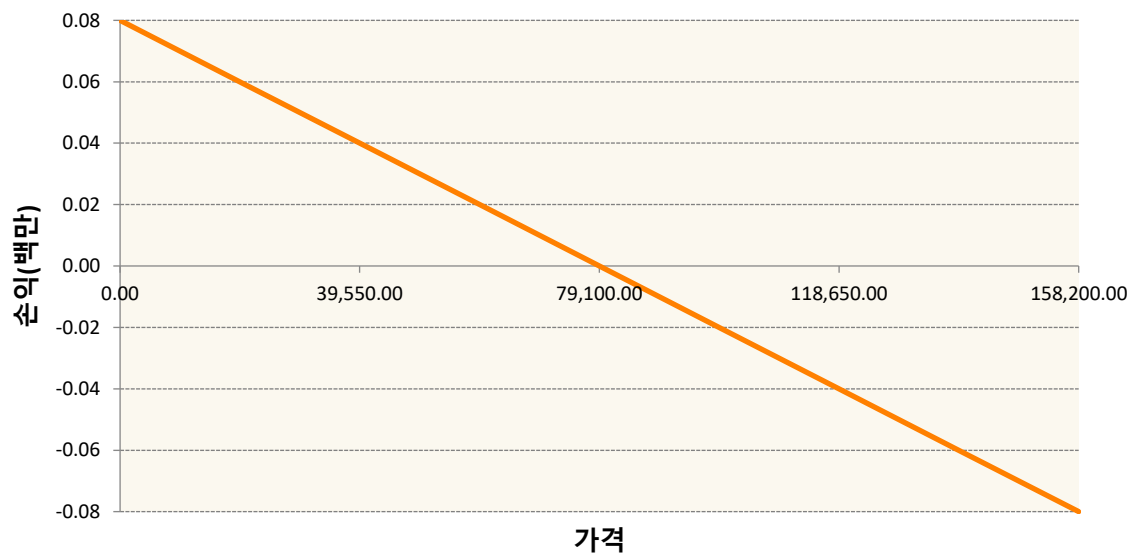
KR41F6V50006-2024-05 카카오뱅크개별선물



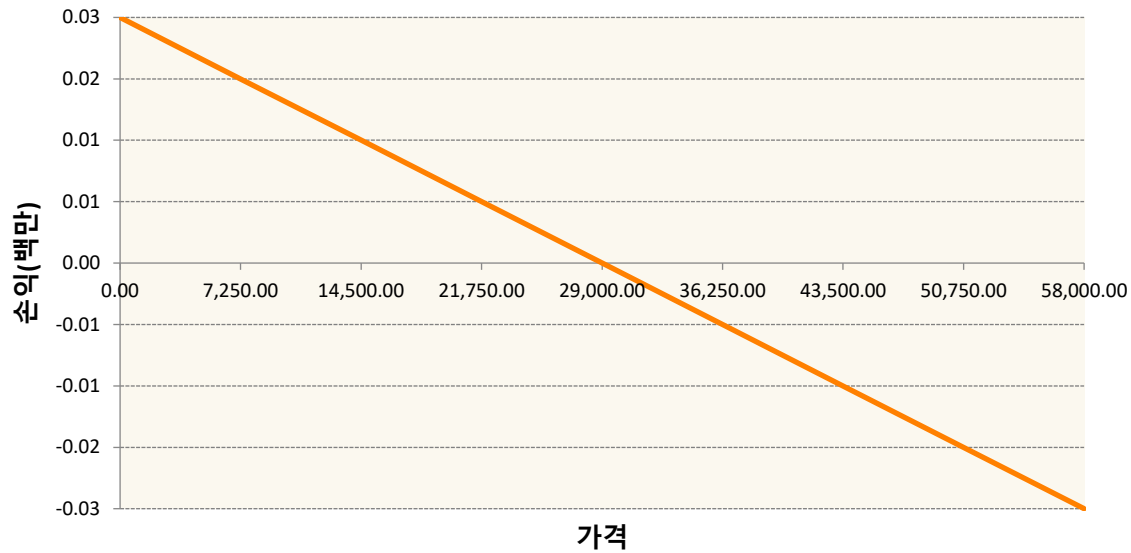
KR41F7V50004-2024-05 카카오페이개별선물



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	0.41
KR41CNV500 2024-05 포스코DX개별선물	2
KR41CRV500 2024-05 LG생활건강개별선물	1
KR41D1V500 2024-05 CJ제일제당개별선물	0.26
KR41E5V500 2024-05 넷마블개별선물	0.09
KR41EXV500 2024-05 카카오게임즈개별선물	1
KR41F5V500 2024-05 LG에너지솔루션개별선물	1
KR41F6V500 2024-05 카카오뱅크개별선물	1
KR41F7V500 2024-05 카카오페이개별선물	0.25
KR41FEV500 2024-05 SK스퀘어개별선물	0.13
KR41FVV500 2024-05 한화오션개별선물	0.16

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

(단위:백만원)

45

공시일	2024-04-17
기준일	2024-04-16

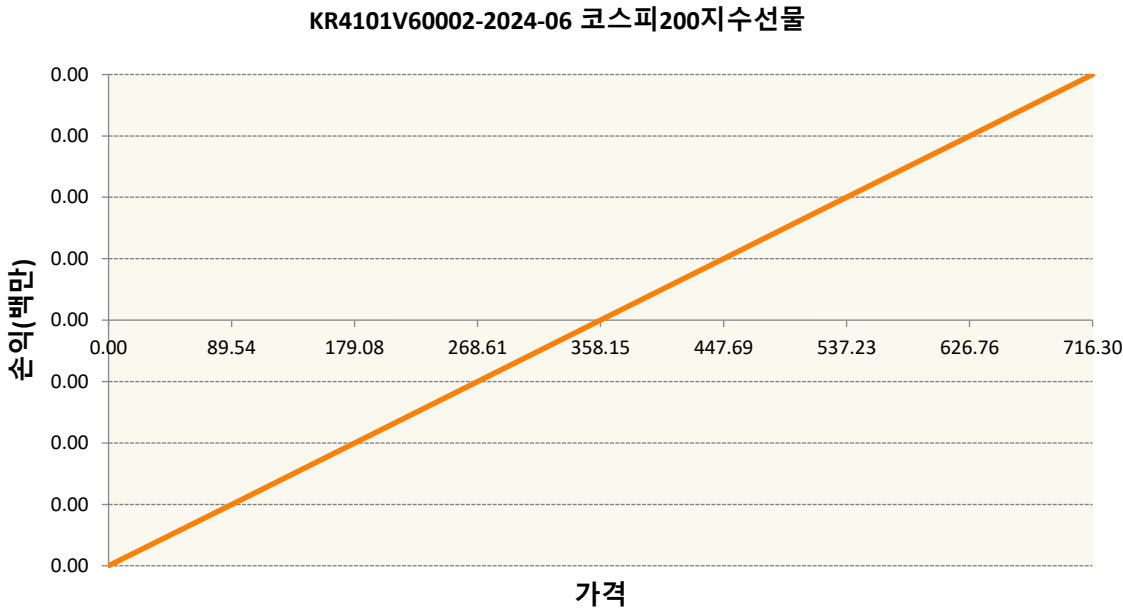
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	90	-90	장내
누계	유가증권	선물	2,865	0	2,865	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101V60002		2024-06 코스피200지수선물					228
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-228	-228	-228	-228	-228	-228	-228
-5.33%	-152	-152	-152	-152	-152	-152	-152
-2.67%	-76	-76	-76	-76	-76	-76	-76
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	76	76	76	76	76	76	76
5.33%	152	152	152	152	152	152	152
8.00%	228	228	228	228	228	228	228

공시일	2024-04-17
기준일	2024-04-16

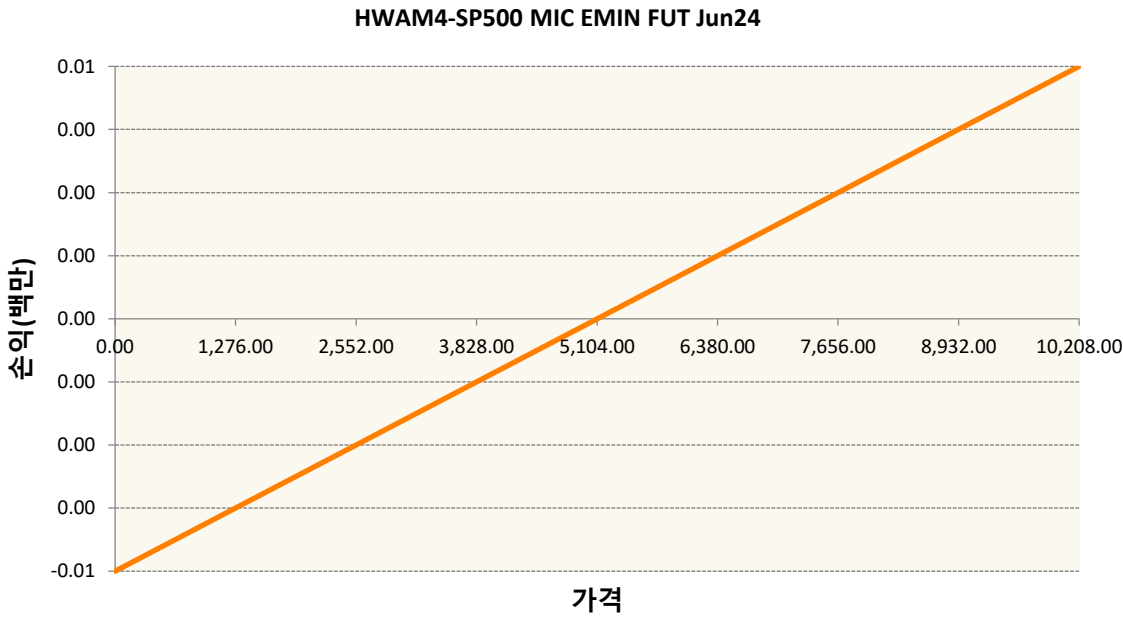
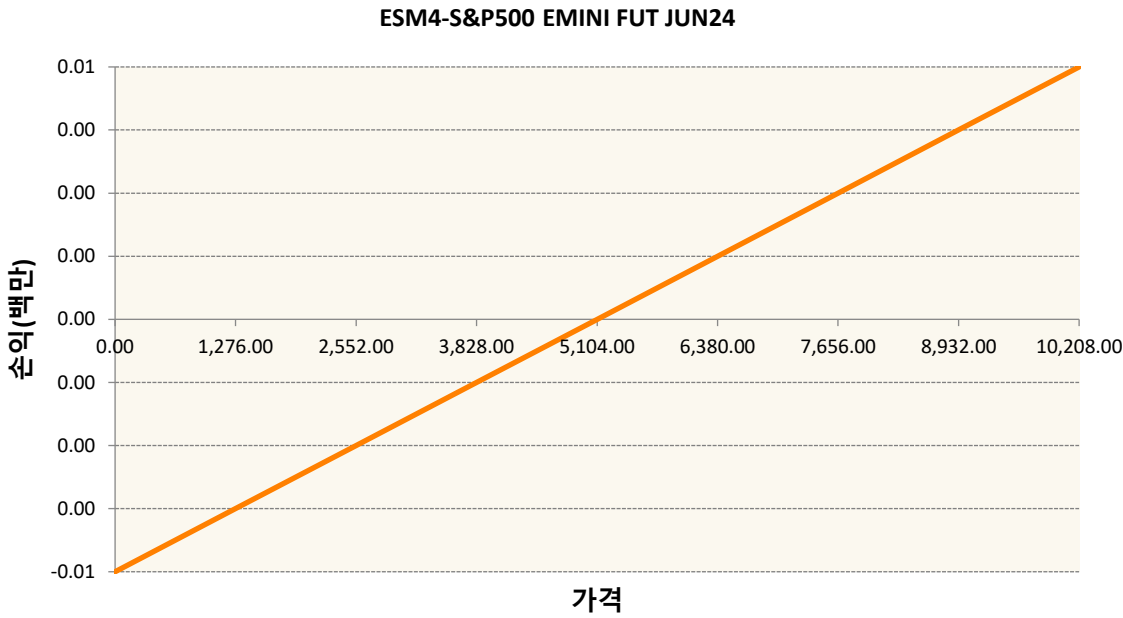
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

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	4,382	0	4,382	
누계	유가증권	선물	1,819	0	1,819	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESM4	S&P500 EMINI FUT JUN24	351
HWAM4	SP500 MIC EMIN FUT Jun24	145

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	348

공시일	2024-04-17
기준일	2024-04-16

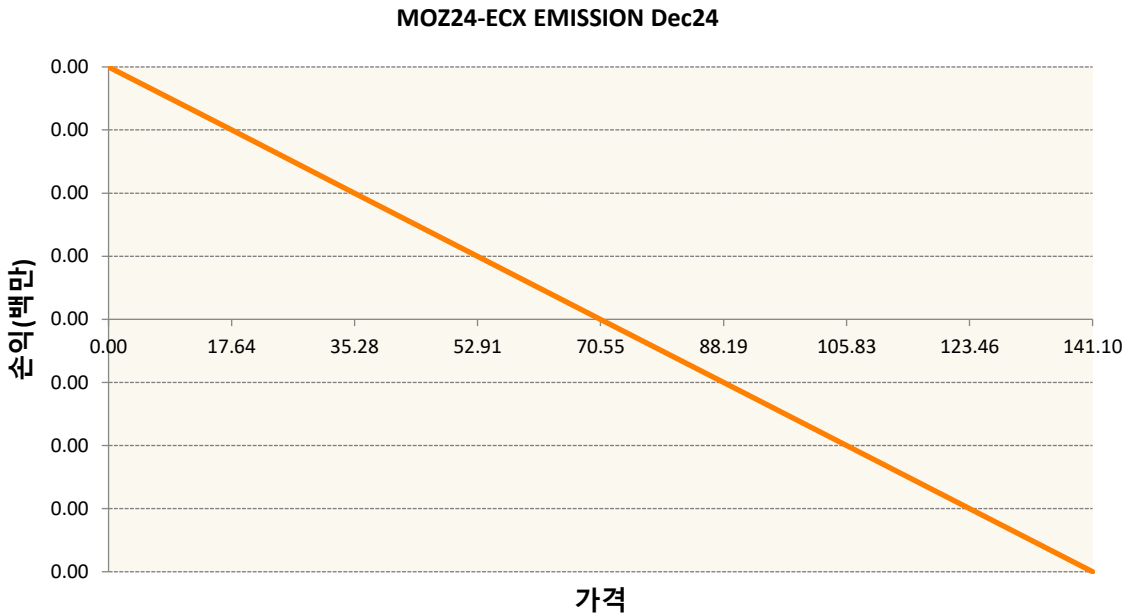
SOL유럽탄소배출권선물인버스ICE특별자산상

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	3,607	-3,607	
누계	지수	스왑	331	0	331	장외
누계	통화	선도	0	1,121	-1,121	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213E3SC KRW/EUR 30-04-24E	90
MOZ24 ECX EMISSION Dec24	289
SWICEUACN ICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX	4

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

(단위:백만원)

572

공시일	2024-04-17
기준일	2024-04-16

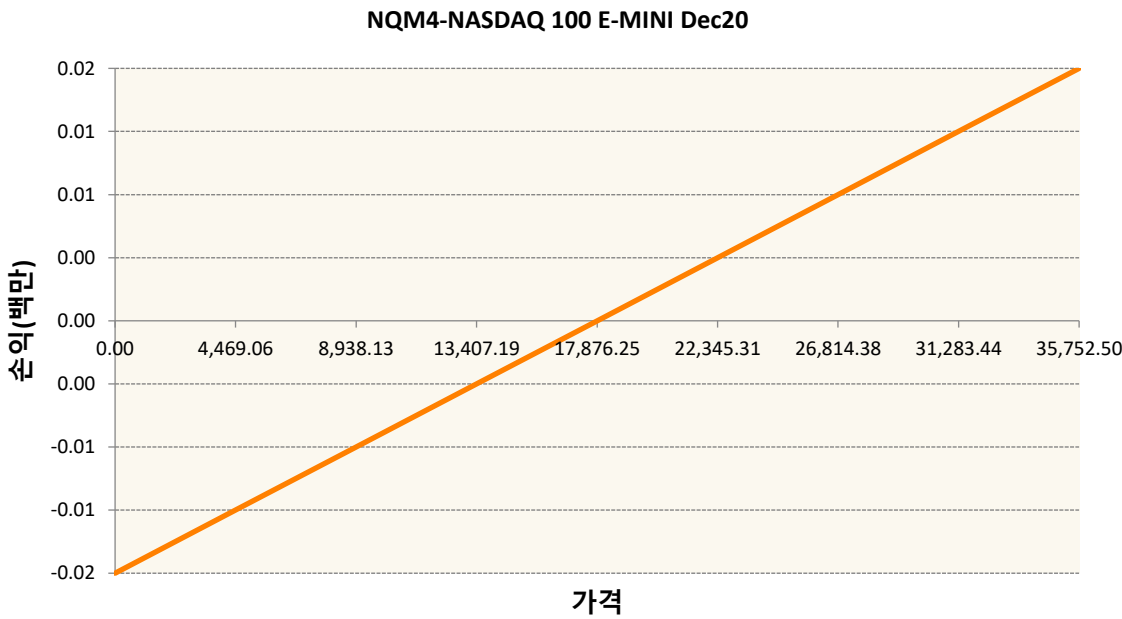
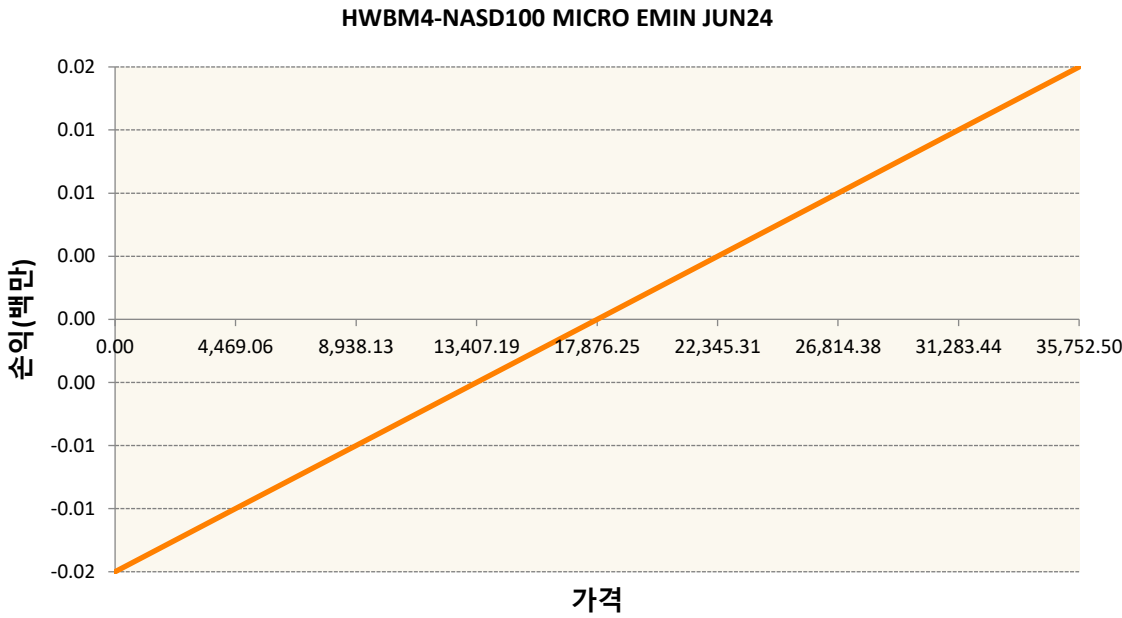
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

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	2,358	0	2,358	
누계	유가증권	선물	2,073	0	2,073	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
HWBM4	NASD100 MICRO EMIN JUN24		166
NQM4	NASDAQ 100 E-MINI Dec20		189

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)			(단위:백만원)
			297

공시일	2024-04-17
기준일	2024-04-16

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	440
SWKEDI0000 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	1,610
SWKEDI0000 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	948
SWKEDI0000 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	7,555

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

(단위:백만원)

6,660

공시일	2024-04-17
기준일	2024-04-16

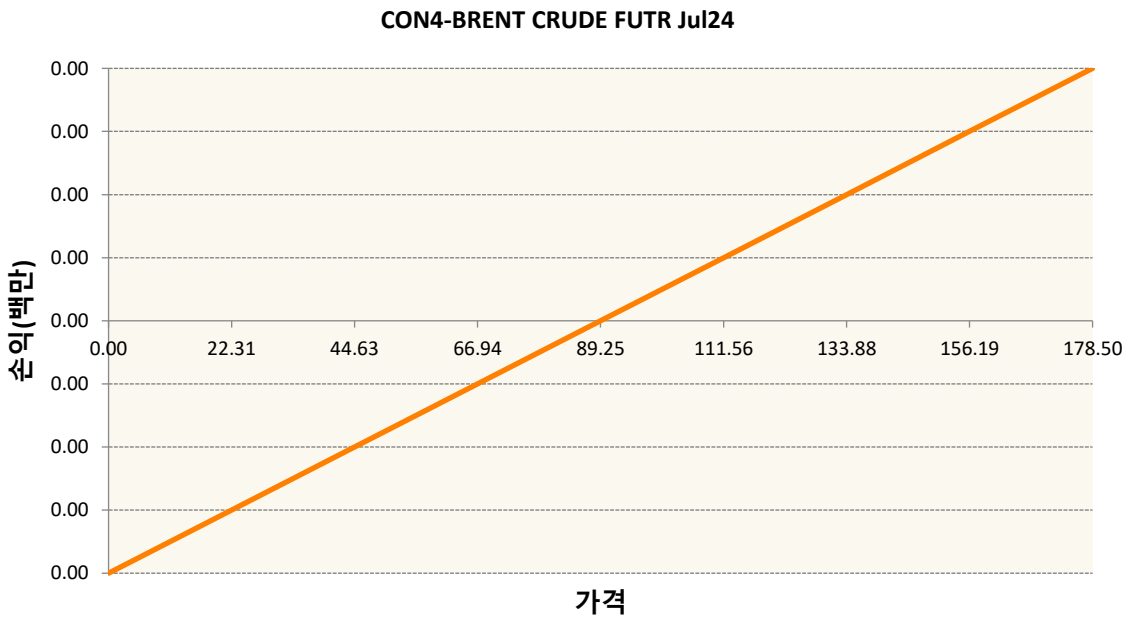
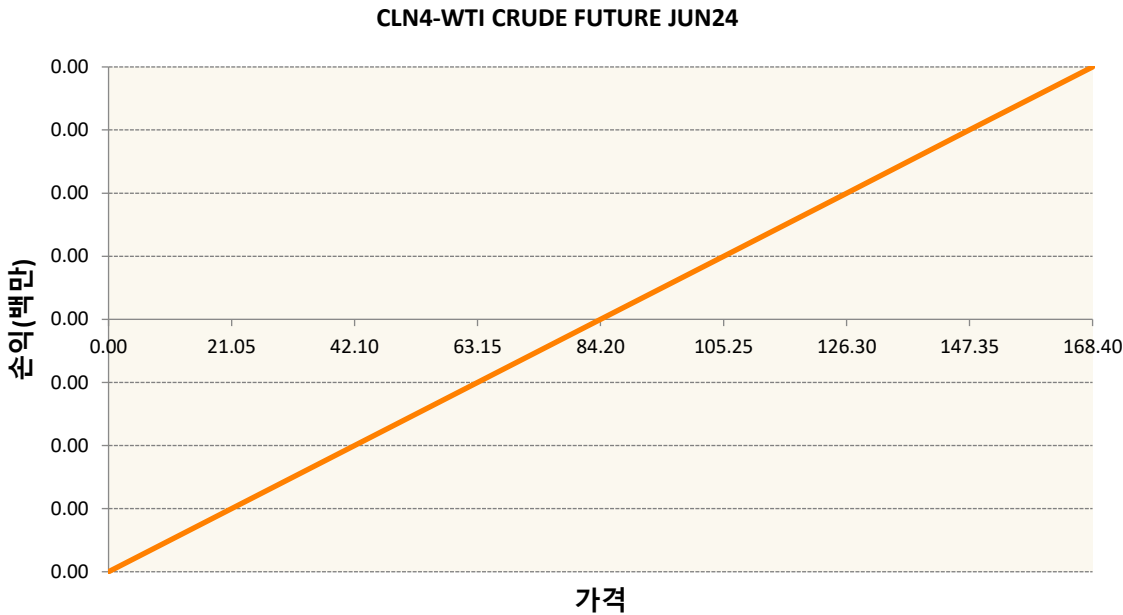
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

1. 계약금액

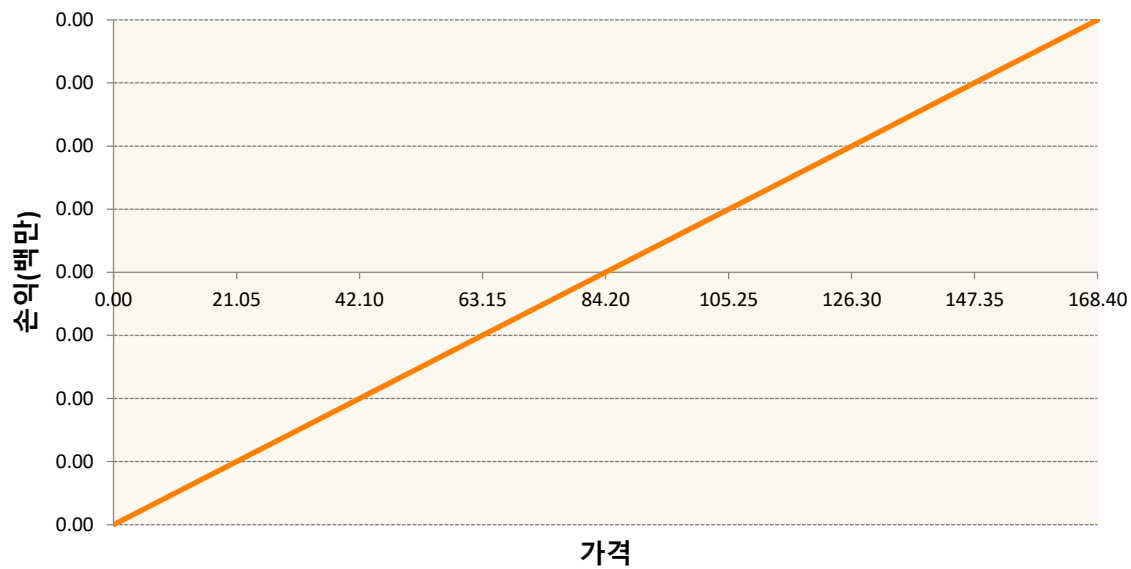
(단위:백만원)

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	1,152	0	1,152	
누계	통화	선물	0	251	-251	장내

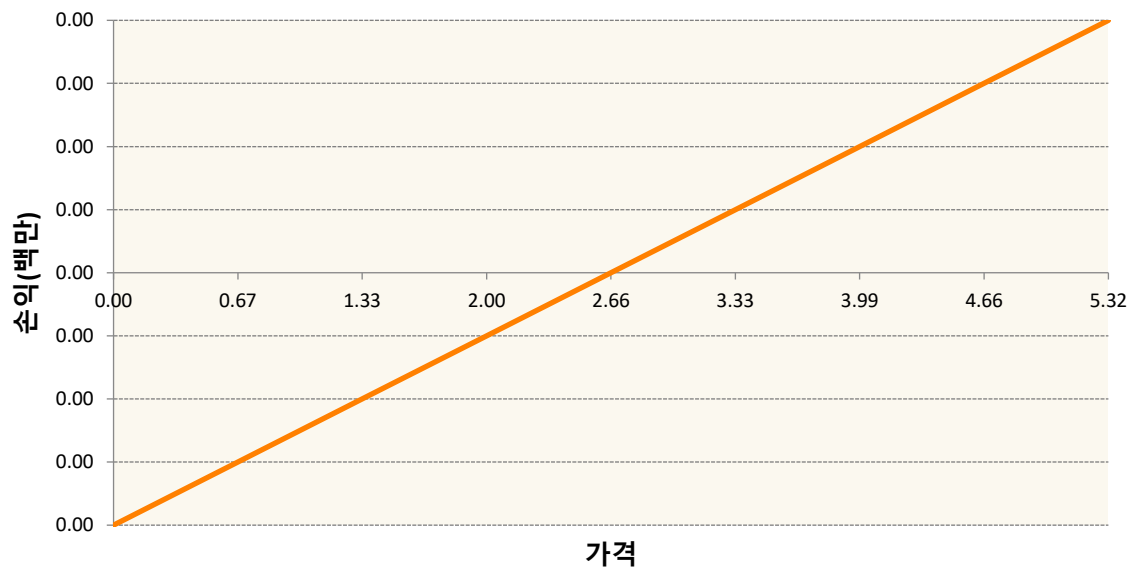
2. 만기시점의 손익구조



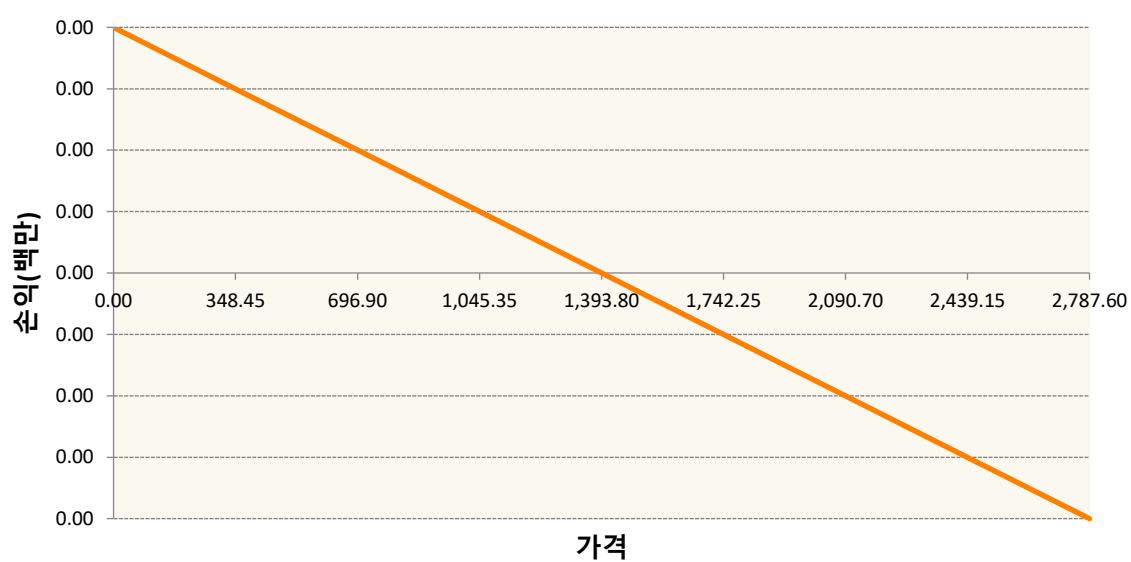
ECN4-E-mini Crude Oil JUL24



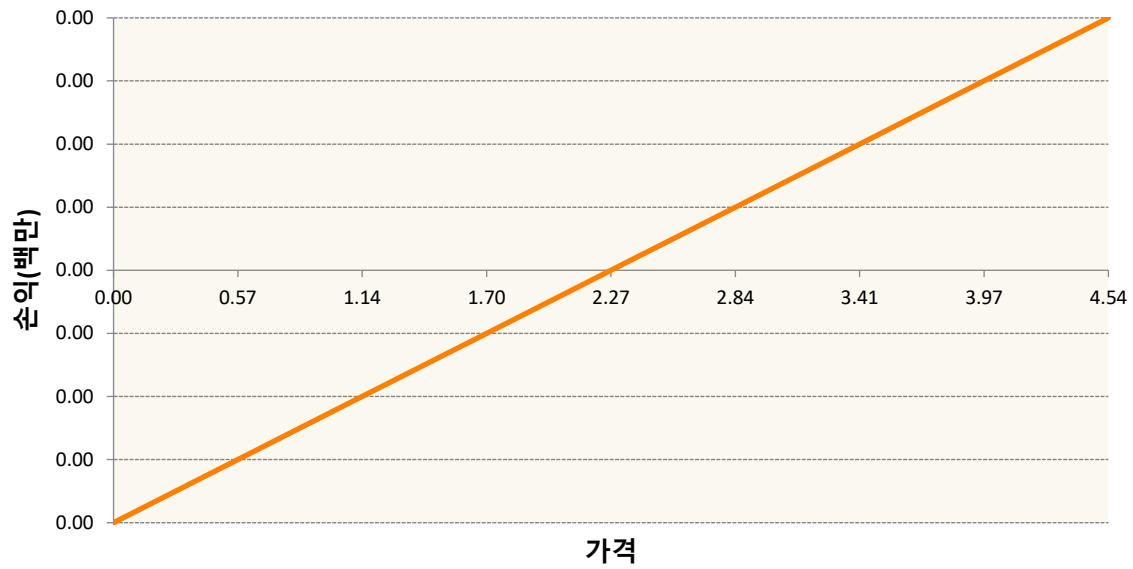
HON4-NY Harb ULSD Fut Jul24



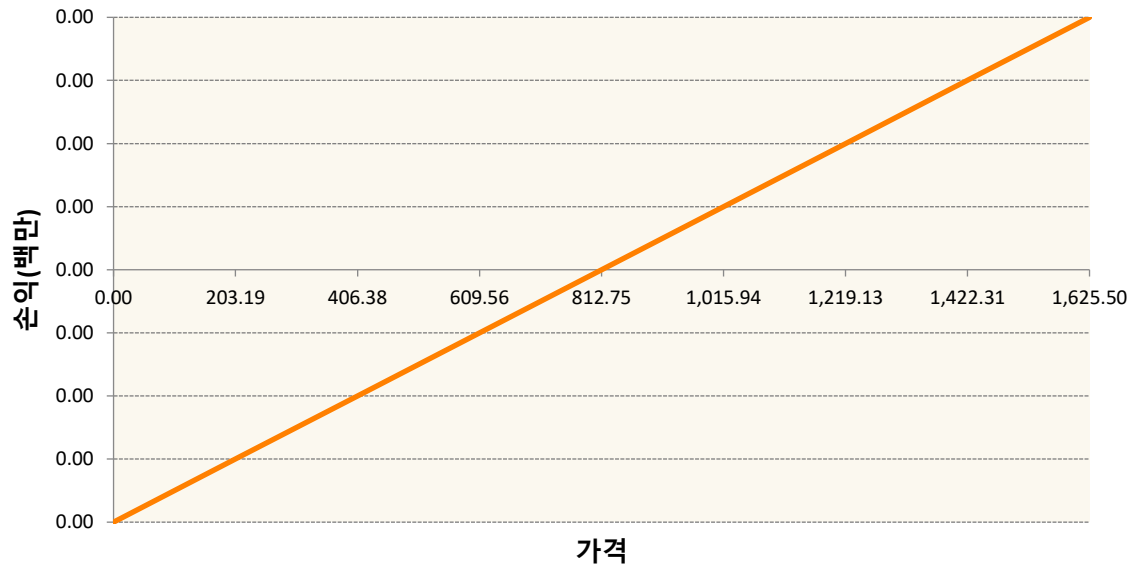
KR4175V50007-2024-05 달러선물



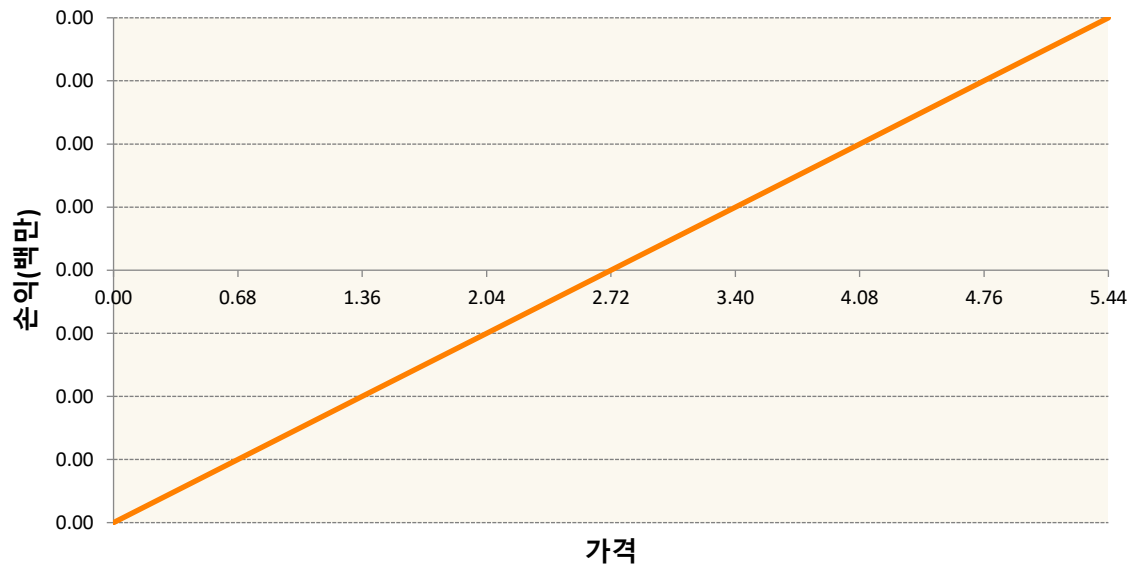
NGN24-NATURAL GAS FUTR JUL24



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	12
QSN4	Low Su Gasoil G JUL24	9
XBN4	GASOLINE RBOB FUT JUL24	12

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

197