

공시일	2024-05-07
기준일	2024-05-03

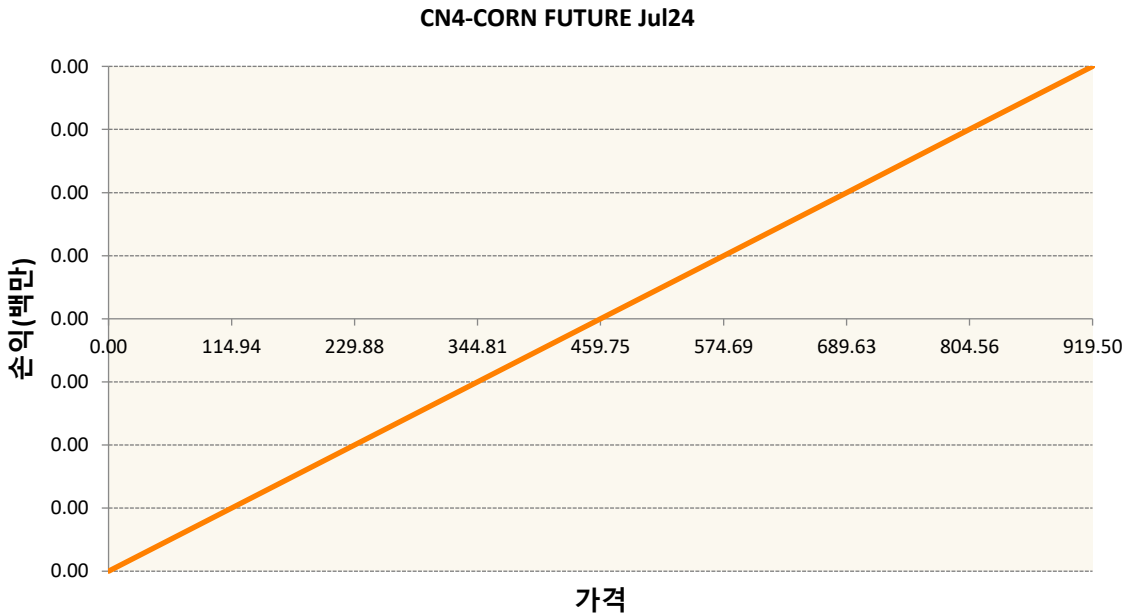
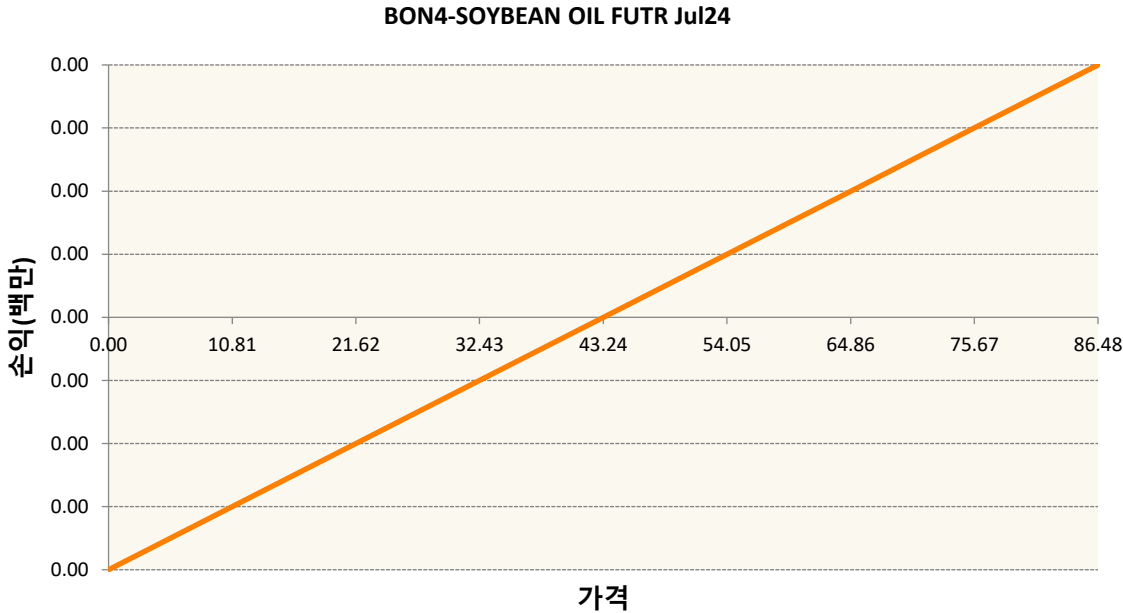
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

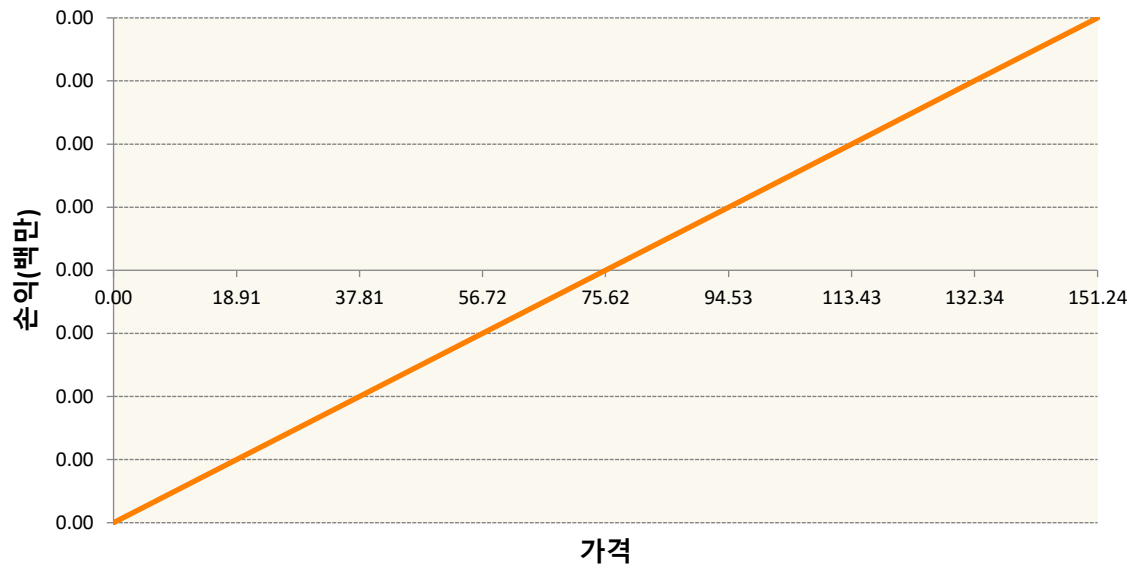
(단위:USD 백만)

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	4,225	0	4,225	
누계	통화	선물	0	504	-504	장내

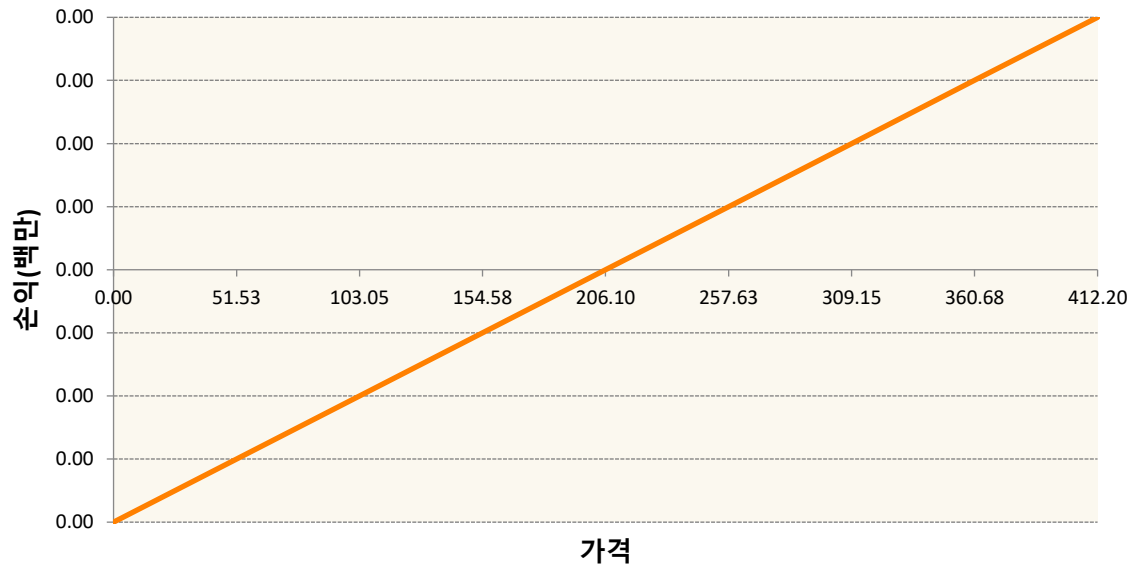
2. 만기시점의 손익구조



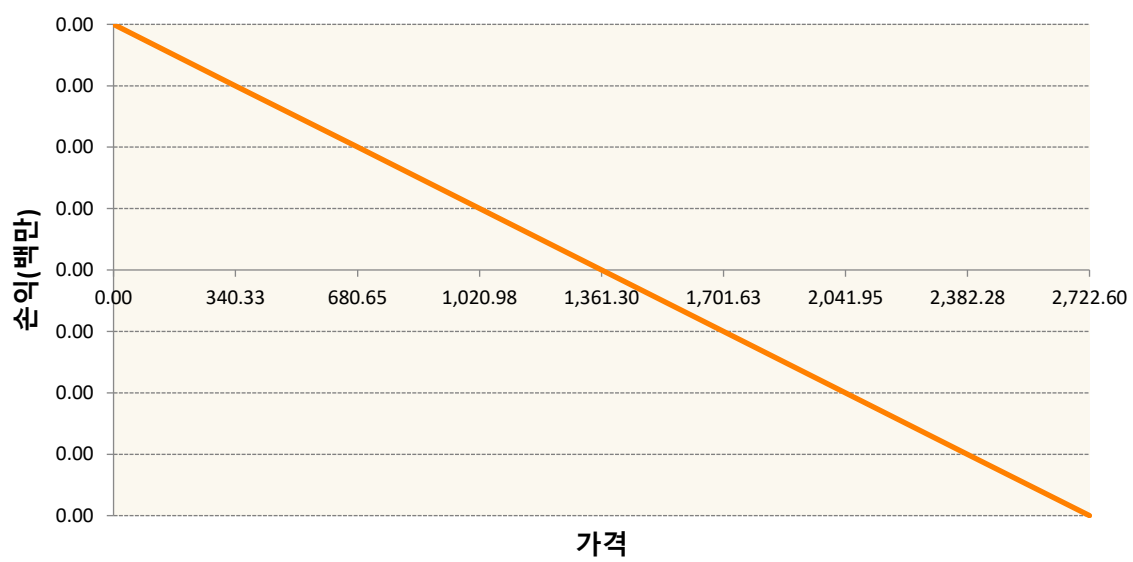
CTN4-COTTON NO.2 FUTR Jul24



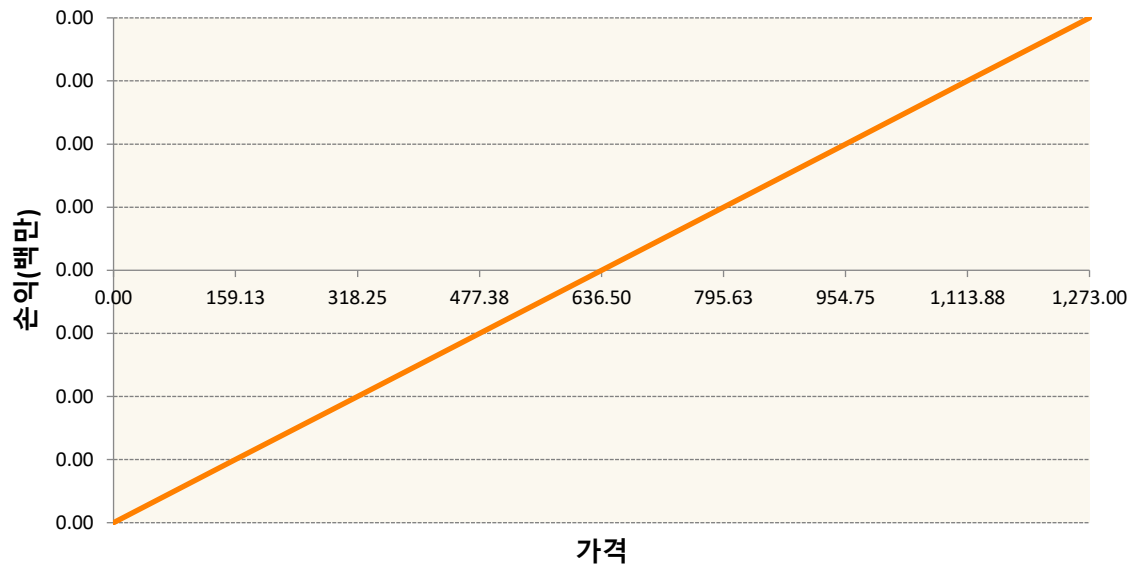
KCN4-COFFEE 'C' FUTURE Jul24



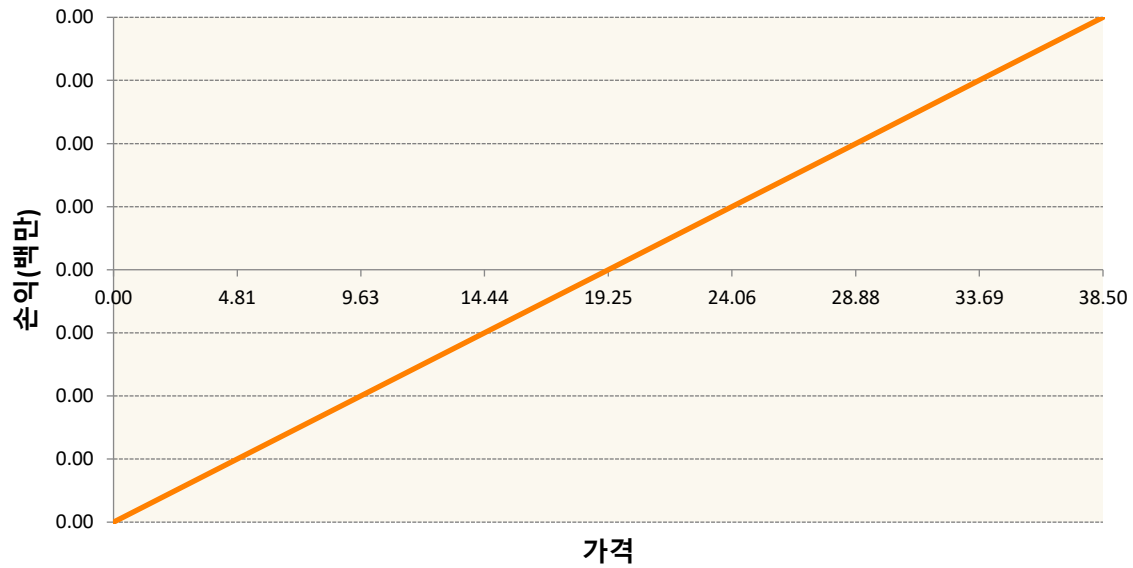
KR4175V50007-2024-05 달러선물



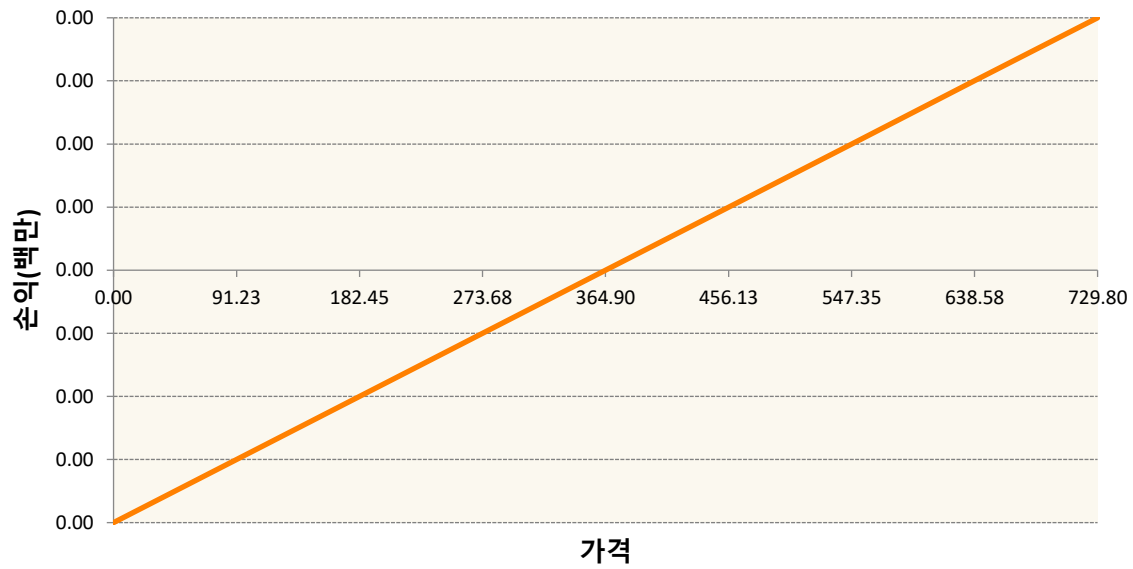
KWN4-KC HRW WHEAT FUT Jul24

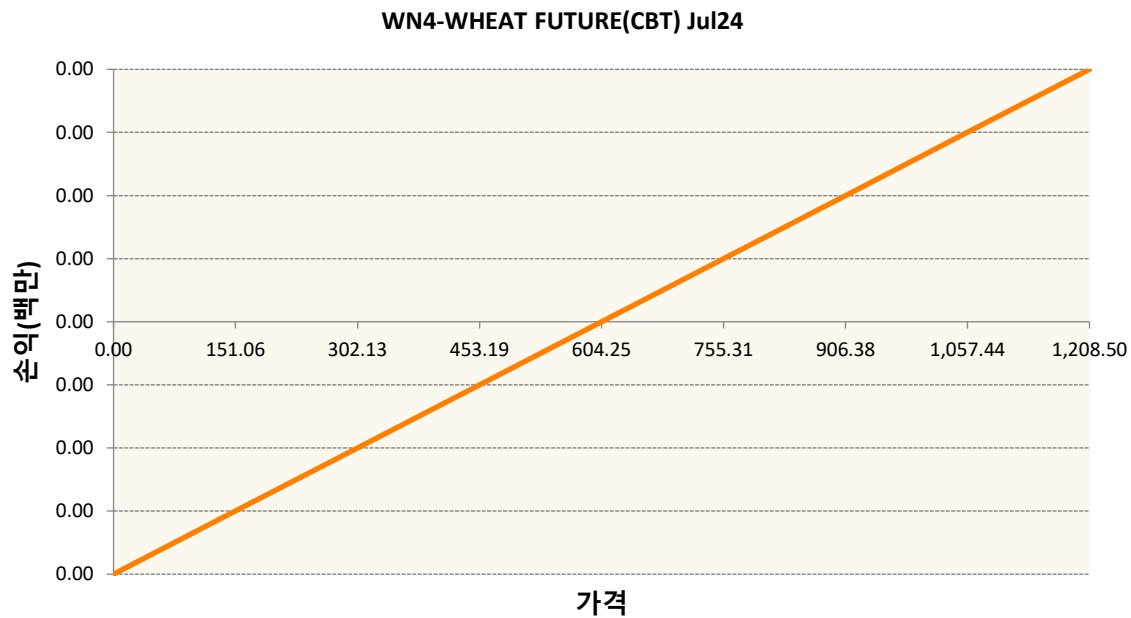
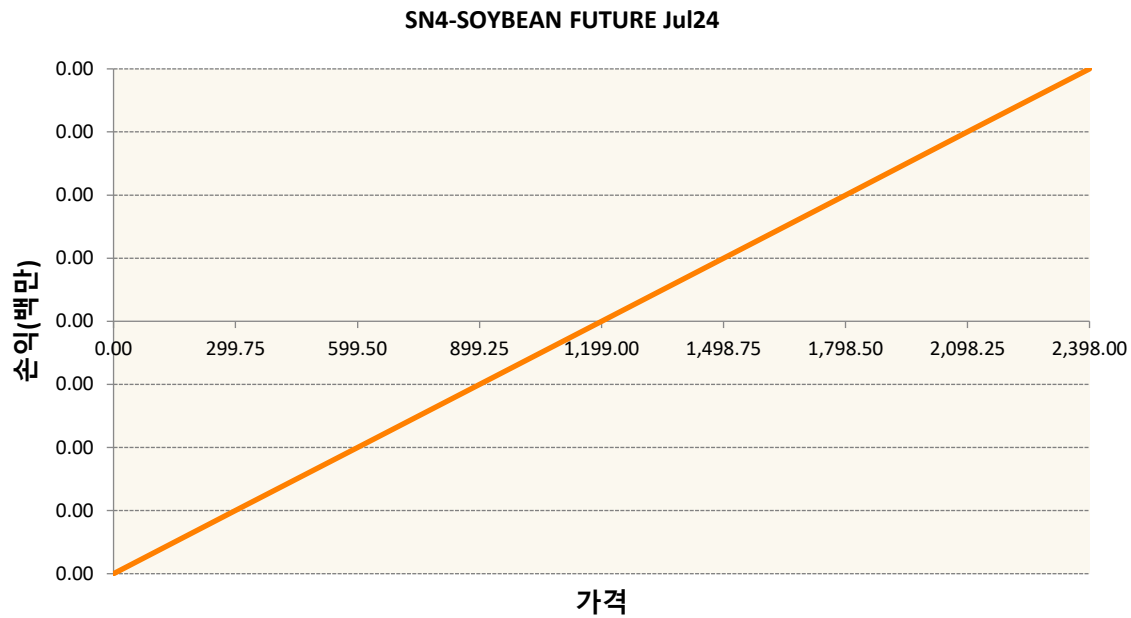


SBN4-Sugar #11 (WORLD) Jul24



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	2024-05-07
기준일	2024-05-03

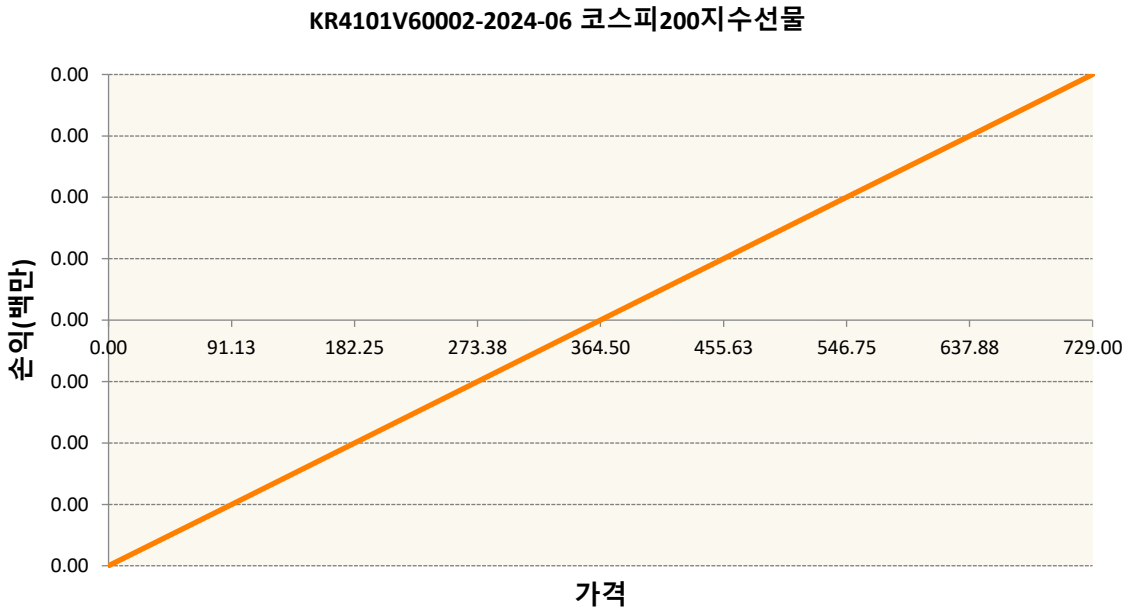
스마트인덱스모

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	2,369	0	2,369	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101V60002		2024-06 코스피200지수선물					189
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-189	-189	-189	-189	-189	-189	-189
-5.33%	-126	-126	-126	-126	-126	-126	-126
-2.67%	-63	-63	-63	-63	-63	-63	-63
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	63	63	63	63	63	63	63
5.33%	126	126	126	126	126	126	126
8.00%	189	189	189	189	189	189	189

공시일	2024-05-07
기준일	2024-05-03

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	270
-----------------------------	-----

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

325

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2024-05-07
기준일	2024-05-03

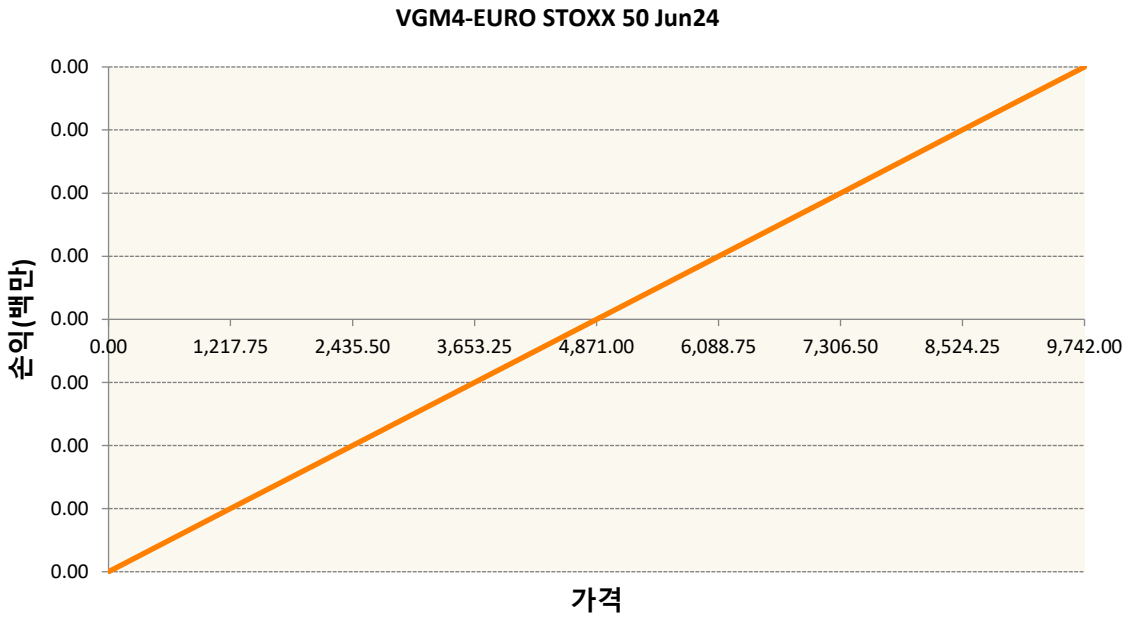
유로인덱스모(주식-파생형)

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	908	0	908	
누계	통화	선도	219	0	219	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213E3K(EUR/KRW 21-06-24E	18
VGM4 EURO STOXX 50 Jun24	73

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

(단위:백만원)

61

공시일	2024-05-07
기준일	2024-05-03

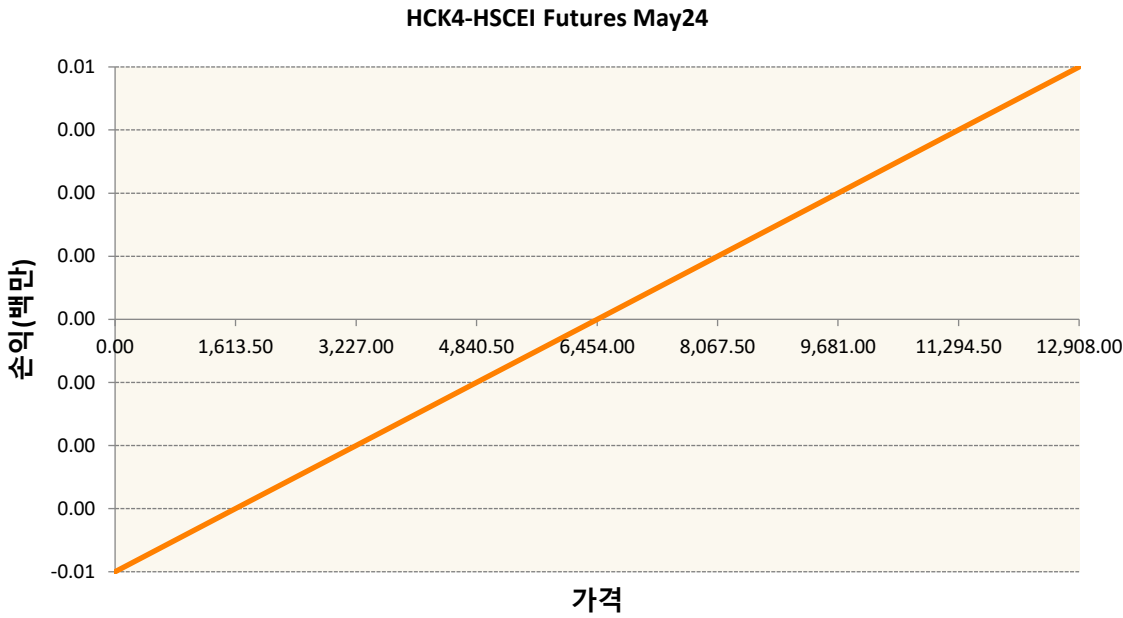
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,190	0	1,190	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCK4	HSCEI Futures May24	95
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

120

공시일	2024-05-07
기준일	2024-05-03

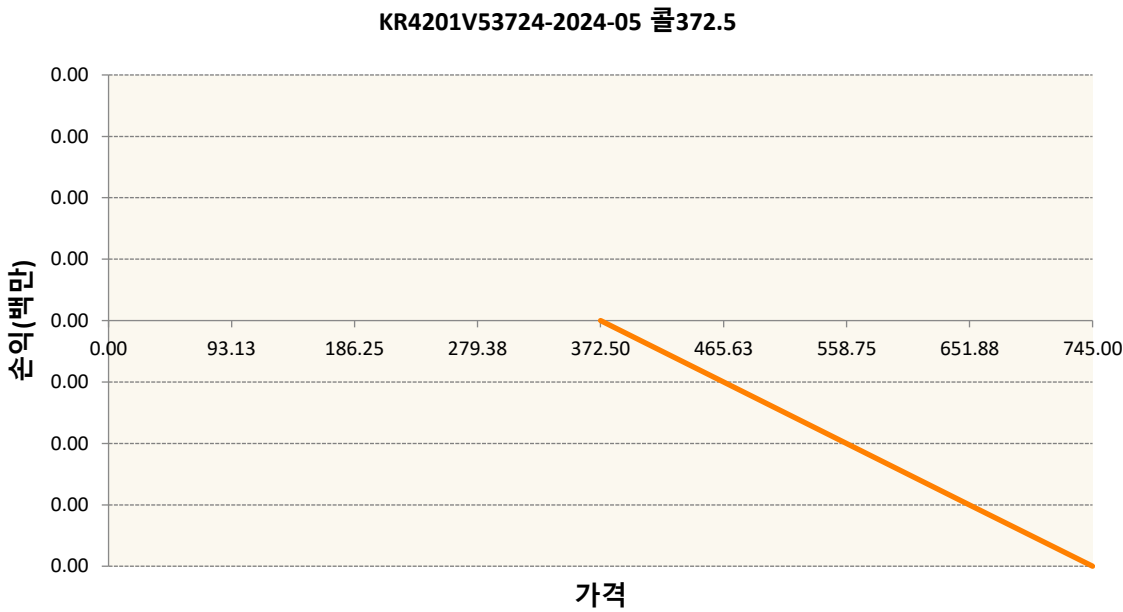
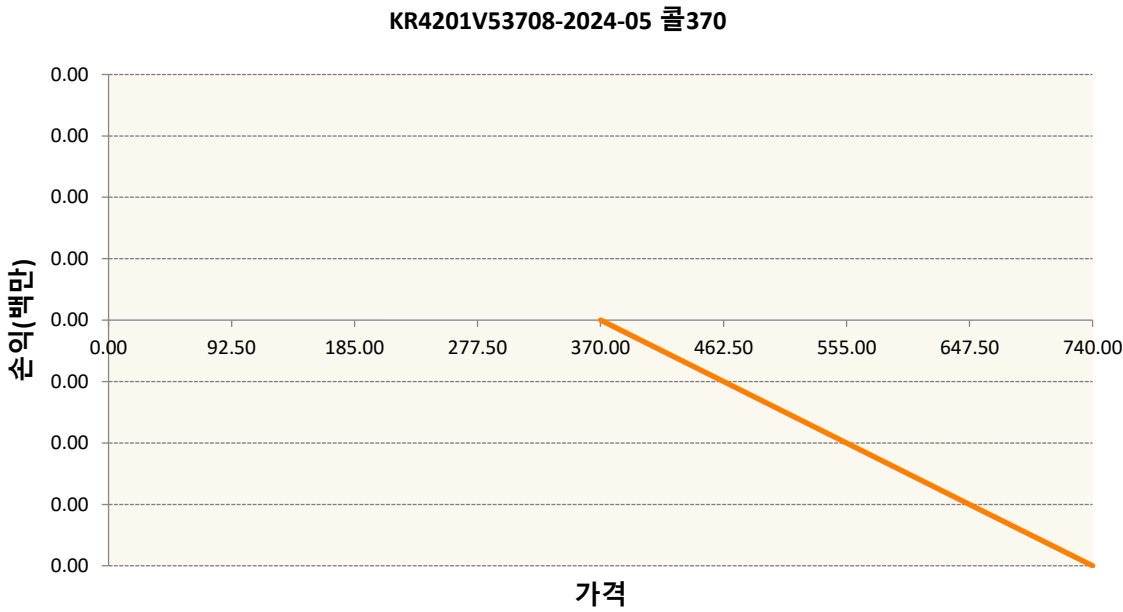
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

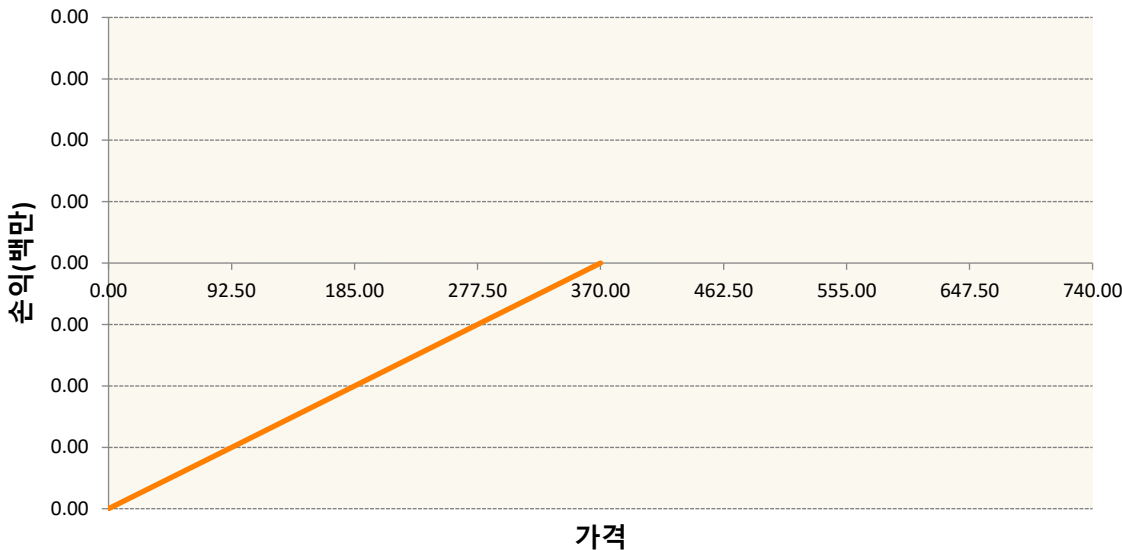
(단위:백만원)

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					1,438
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	175	175	175	174	174	173	171
-5.33%	174	173	172	169	165	160	153
-2.67%	163	155	145	133	119	104	88
0%	74	50	26	0	-26	-53	-80
2.67%	-223	-251	-280	-308	-337	-366	-395
5.33%	-754	-768	-783	-801	-820	-840	-862
8.00%	-1,396	-1,399	-1,404	-1,410	-1,418	-1,427	-1,438
KR4201V53724		2024-05 콜372.5					718
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	69	69	69	69	69	69	68
-5.33%	69	69	68	67	66	64	61
-2.67%	66	63	59	54	49	42	34
0%	35	24	12	0	-13	-26	-39
2.67%	-92	-108	-124	-140	-156	-172	-188
5.33%	-350	-360	-371	-382	-394	-407	-420
8.00%	-688	-690	-694	-698	-704	-711	-718
KR4301V53706		2024-05 풋370					598
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-597	-597	-597	-597	-598	-598	-598
-5.33%	-379	-380	-380	-381	-382	-384	-386
-2.67%	-165	-168	-171	-175	-179	-184	-189
0%	24	16	8	0	-9	-17	-26

2.67%	145	136	127	118	108	99	89
5.33%	190	186	181	175	169	162	155
8.00%	199	198	196	194	192	189	185

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

(단위:백만원)

2,820

공시일	2024-05-07
기준일	2024-05-03

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	1,549	0	1,549	

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	2024-05-07
기준일	2024-05-03

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	4,267	0	4,267	

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	2024-05-07
기준일	2024-05-03

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	14,765	0	14,765	
누계	통화	선도	0	15,038	-15,038	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213E2TC KRW/USD 31-05-24E	589
FXW213E3TC KRW/USD 28-06-24E	420
FXW213E4SC KRW/USD 31-07-24E	195
IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

553

공시일	2024-05-07
기준일	2024-05-03

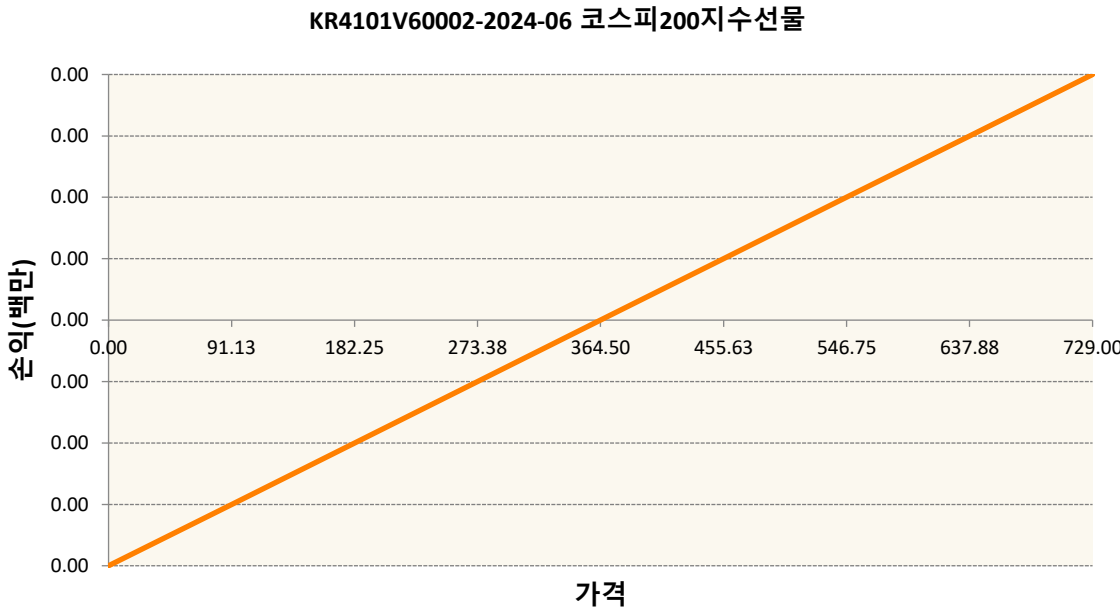
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

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	1,094	0	1,094	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101V60002		2024-06 코스피200지수선물					87
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-87	-87	-87	-87	-87	-87	-87
-5.33%	-58	-58	-58	-58	-58	-58	-58
-2.67%	-29	-29	-29	-29	-29	-29	-29
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	29	29	29	29	29	29	29
5.33%	58	58	58	58	58	58	58
8.00%	87	87	87	87	87	87	87

공시일	2024-05-07
기준일	2024-05-03

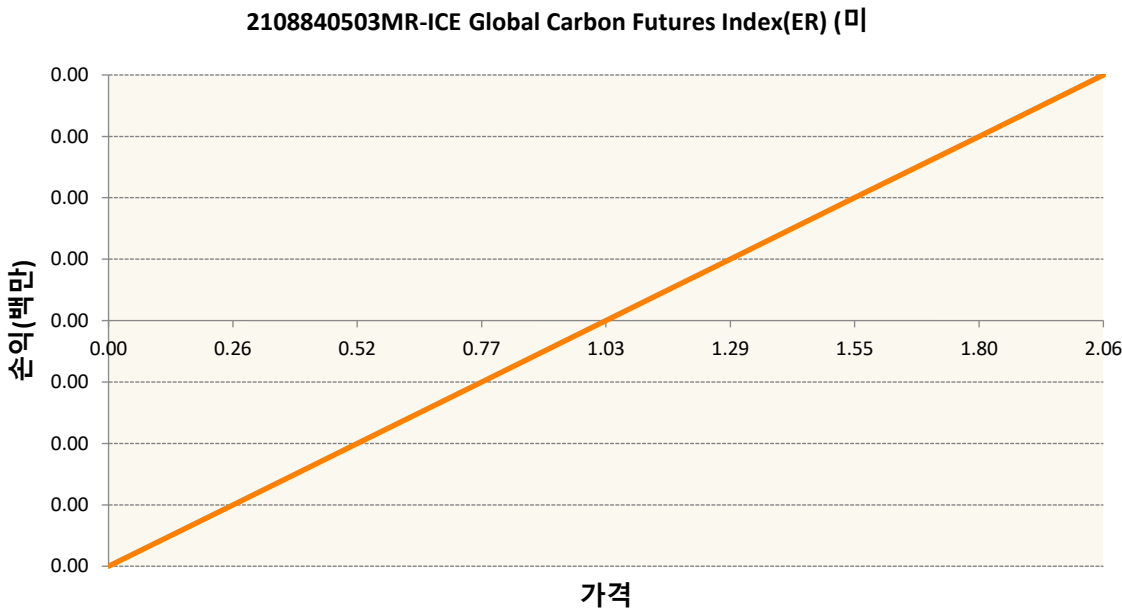
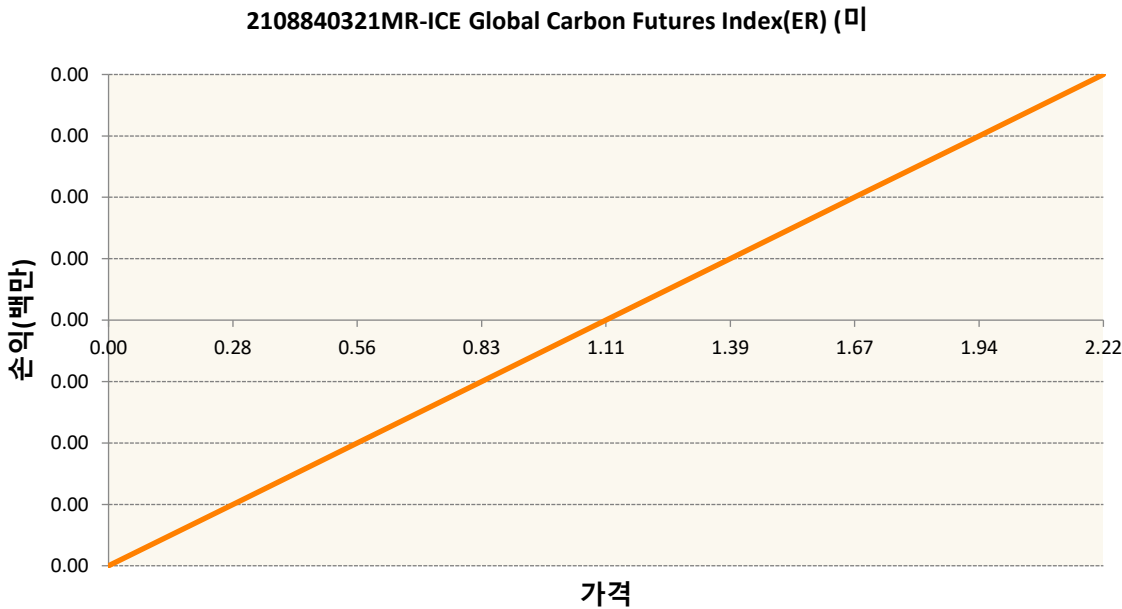
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

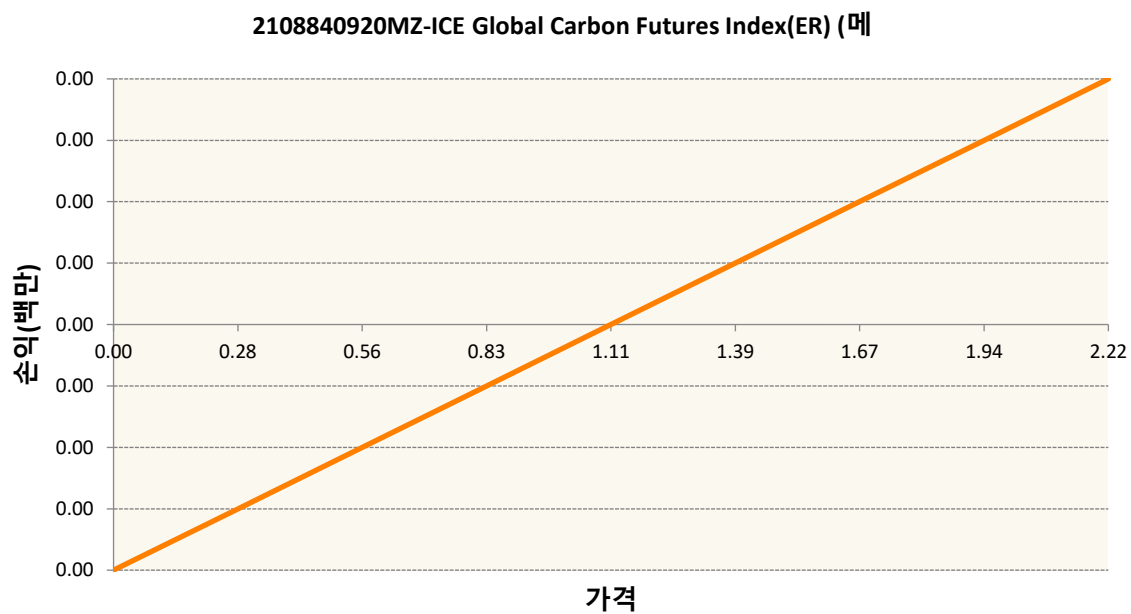
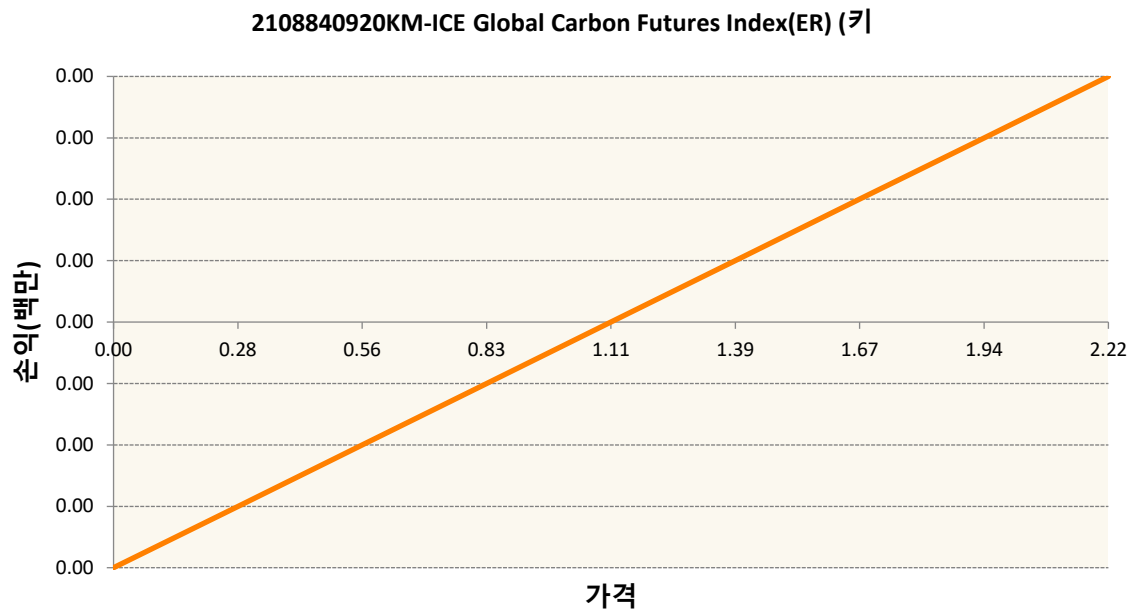
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	2,341	0	2,341	
누계	유가증권	선물	22,879	0	22,879	

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108840321IICE Global Carbon Futures Index(ER) (미)		482
2108840503IICE Global Carbon Futures Index(ER) (미)		193
2108840920IICE Global Carbon Futures Index(ER) (키)		964
2108840920IICE Global Carbon Futures Index(ER) (메)		193

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	2,161

공시일	2024-05-07
기준일	2024-05-03

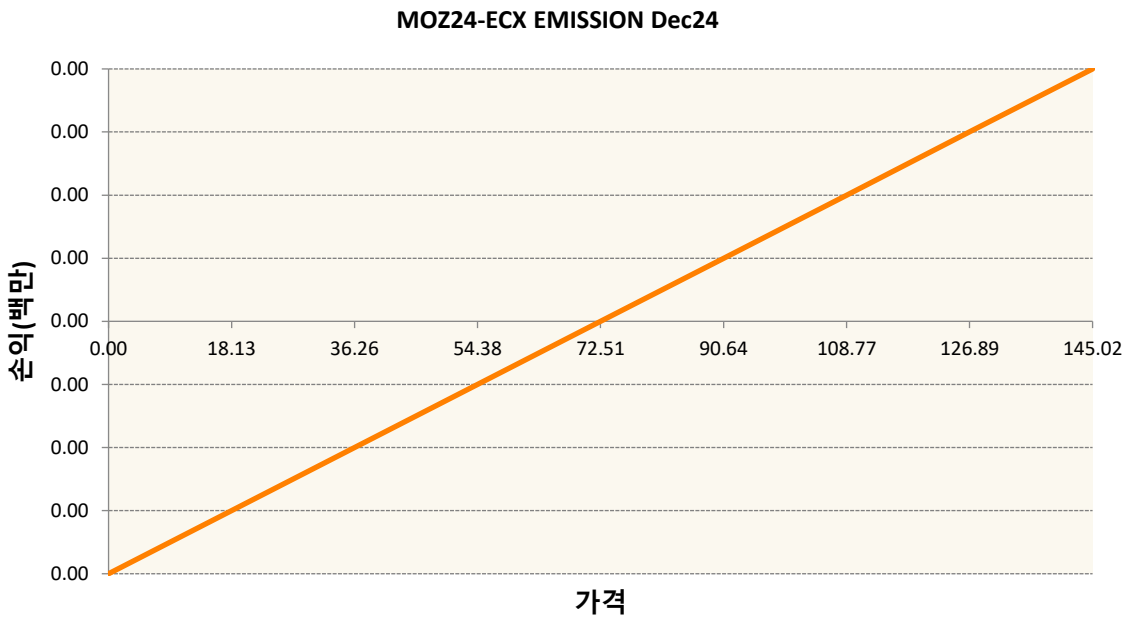
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	10,884	0	10,884	
누계	지수	스왑	331	0	331	장외
누계	통화	선도	0	2,659	-2,659	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213E4W KRW/EUR 31-05-24E	23
FXW213E4W KRW/EUR 31-05-24E	190
MOZ24 ECX EMISSION Dec24	871
SWICEUACN ICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX	5

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

(단위:백만원)

1,720

공시일	2024-05-07
기준일	2024-05-03

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)	12
SWCSI00000 신한CSI Index 230622 (메리츠)	12
SWCSI00000 신한CSI Index 230922 (키움)	8
SWCSI00000 신한CSI Index 231013 (NH)	8

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

(단위:백만원)

57

공시일	2024-05-07
기준일	2024-05-03

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)	9
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(키움)	2

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

(단위:백만원)

26

공시일	2024-05-07
기준일	2024-05-03

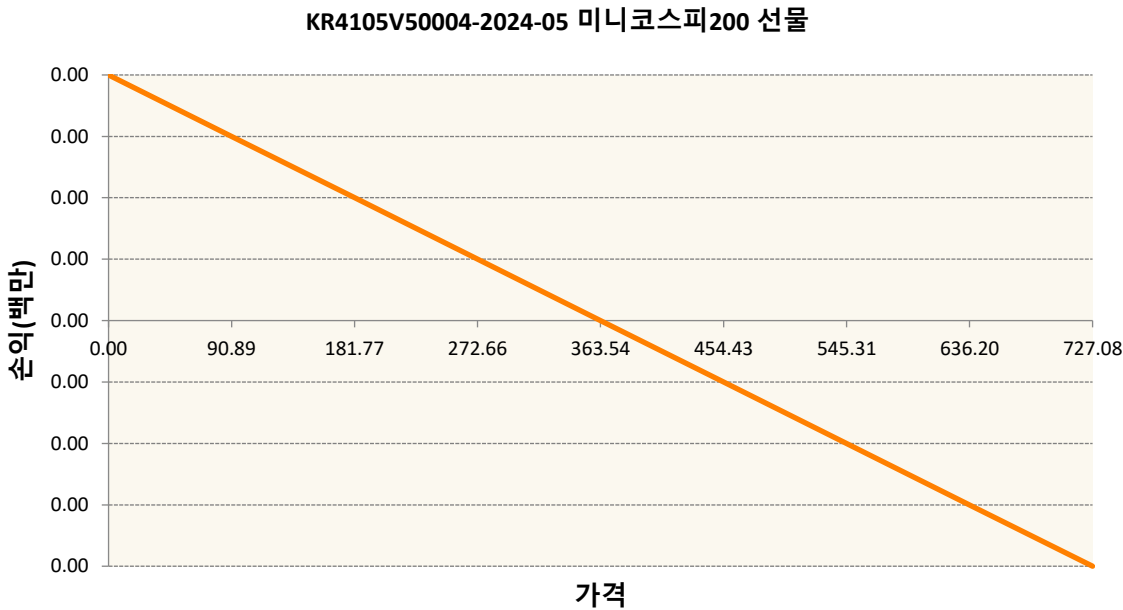
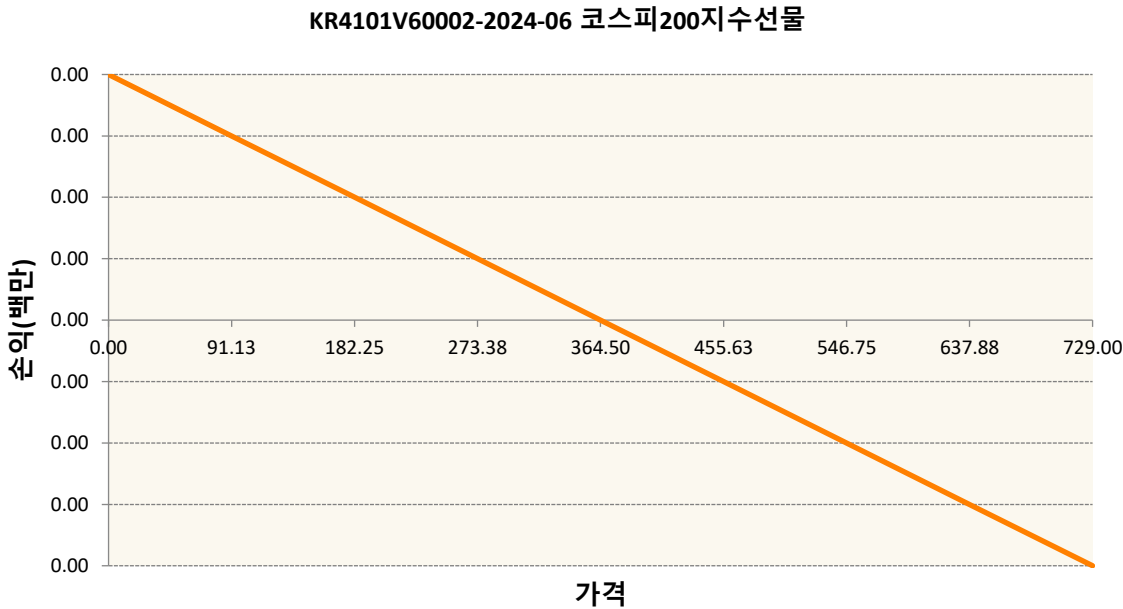
에퀴티알파일반사모혼합자산

1. 계약금액

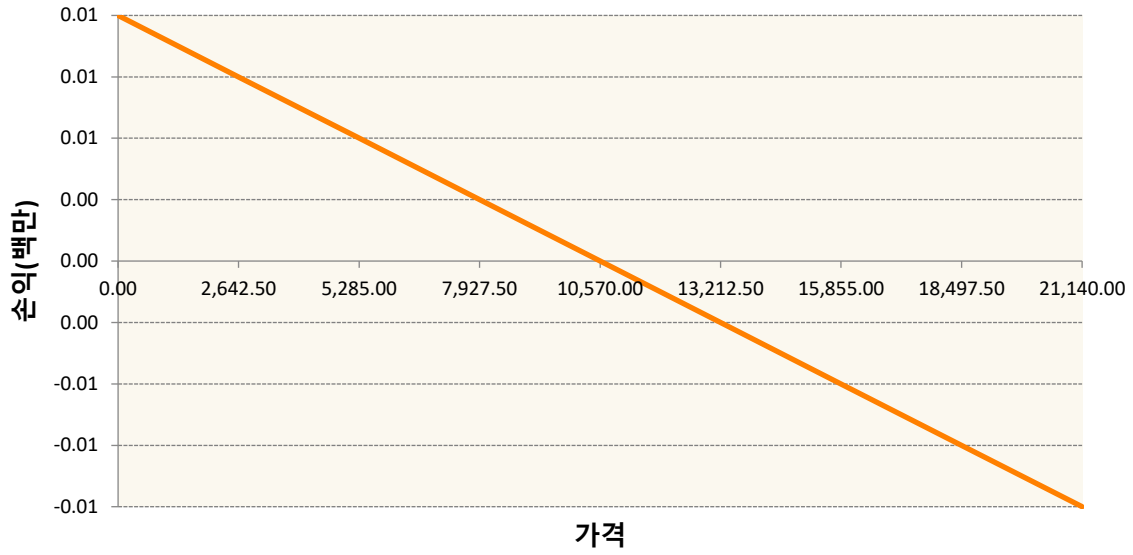
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	22	184	-163	장내
누계	유가증권	선물	21	768	-747	장내

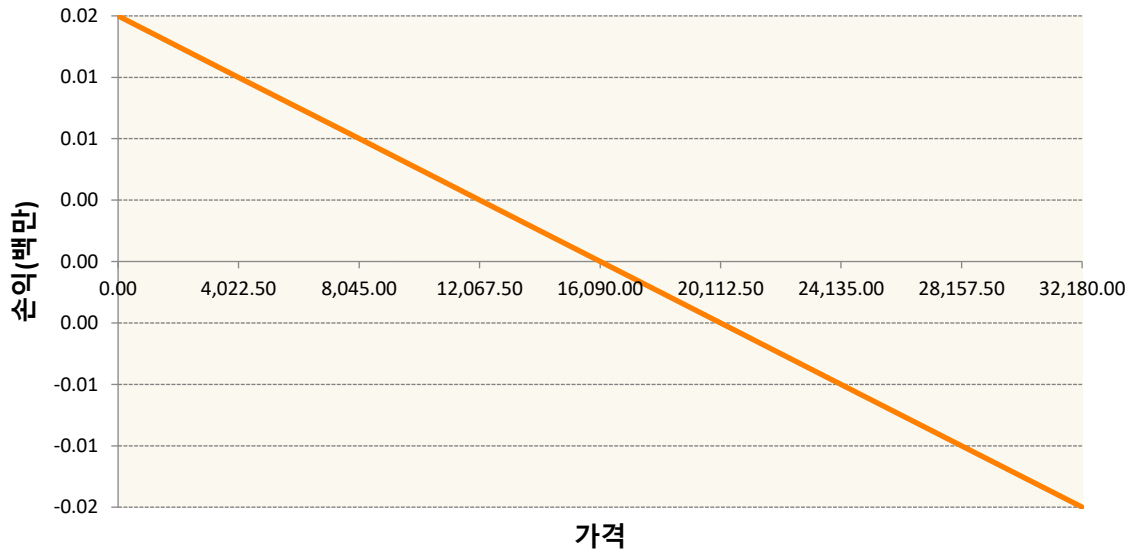
2. 만기시점의 손익구조



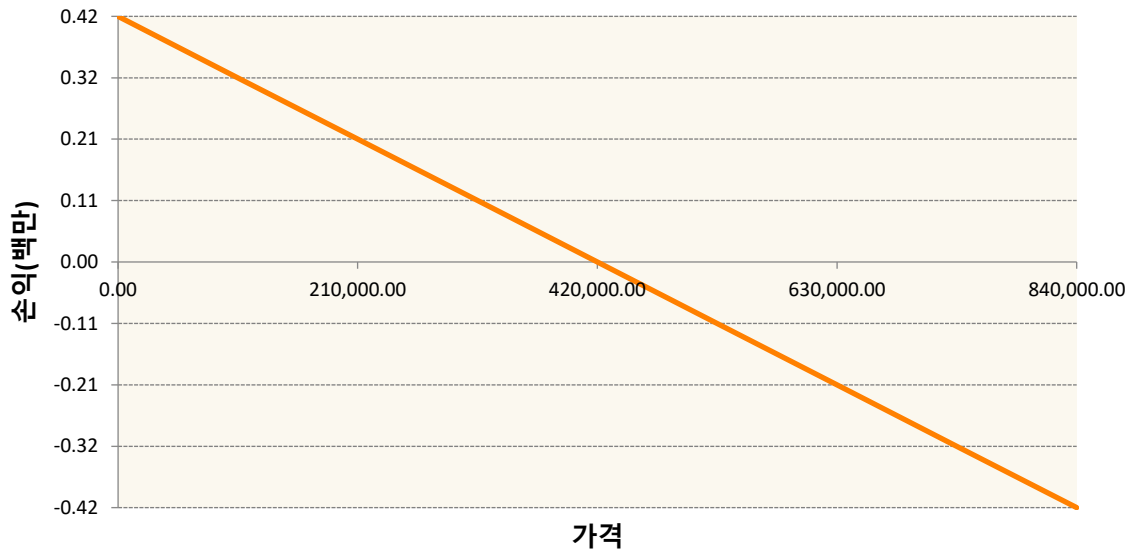
KR4145V50000-2024-05 LG디스플레이개별선물



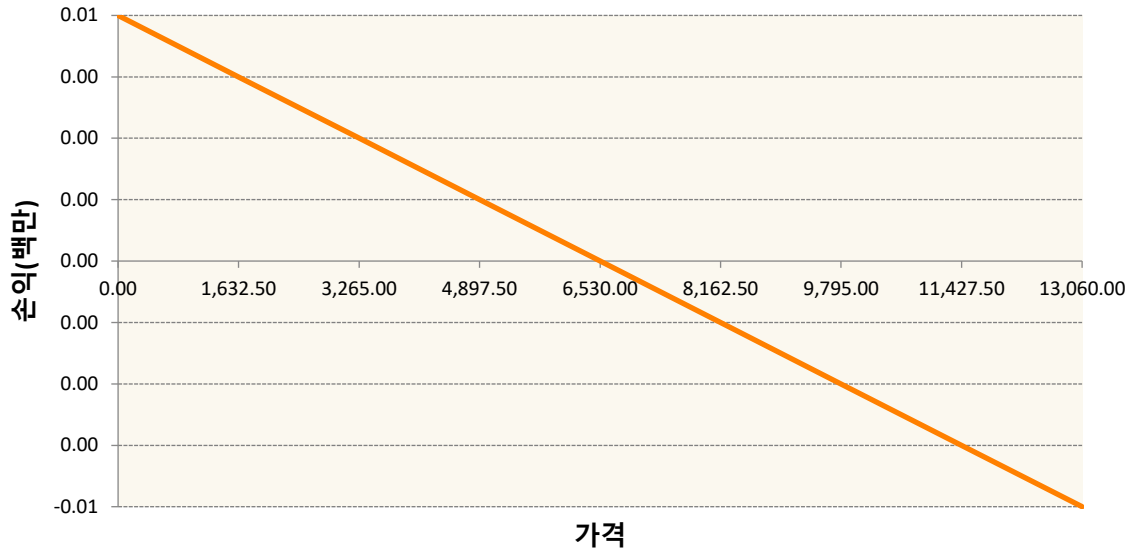
KR4151V50008-2024-05 GS건설개별선물



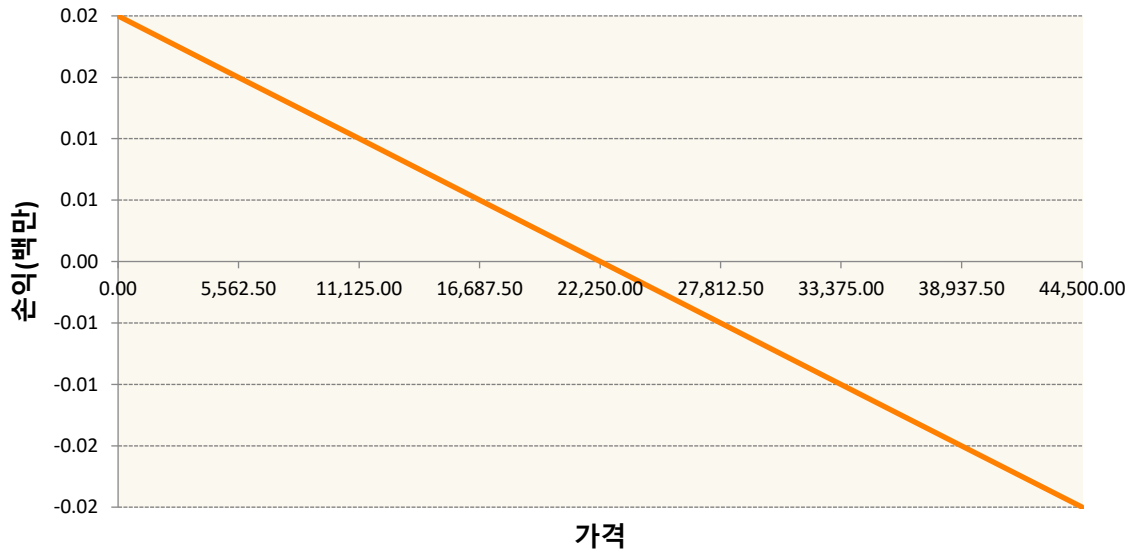
KR41CRV50003-2024-05 LG생활건강개별선물



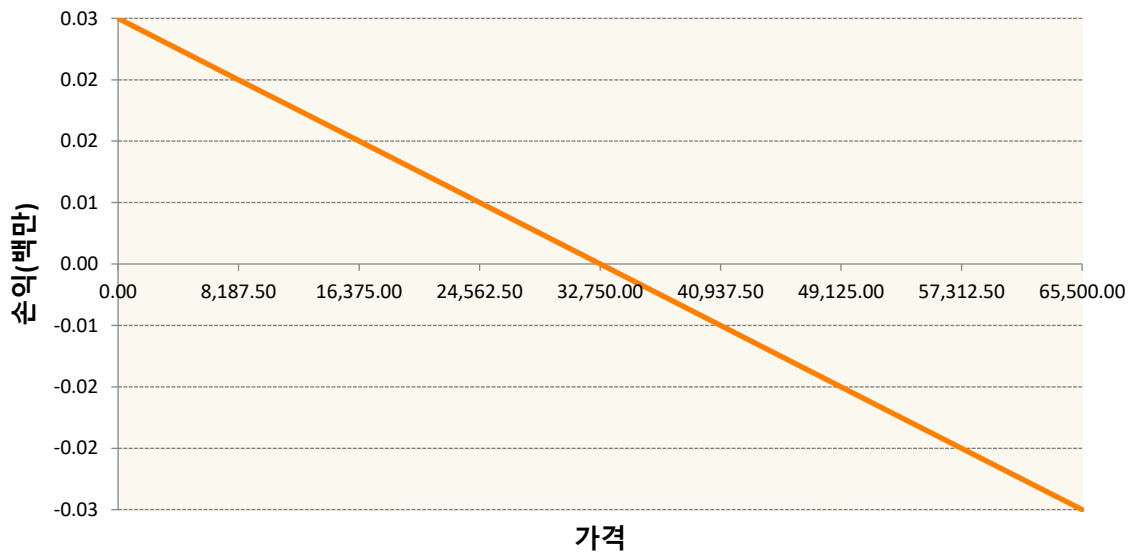
KR41CYV50009-2024-05 한온시스템개별선물



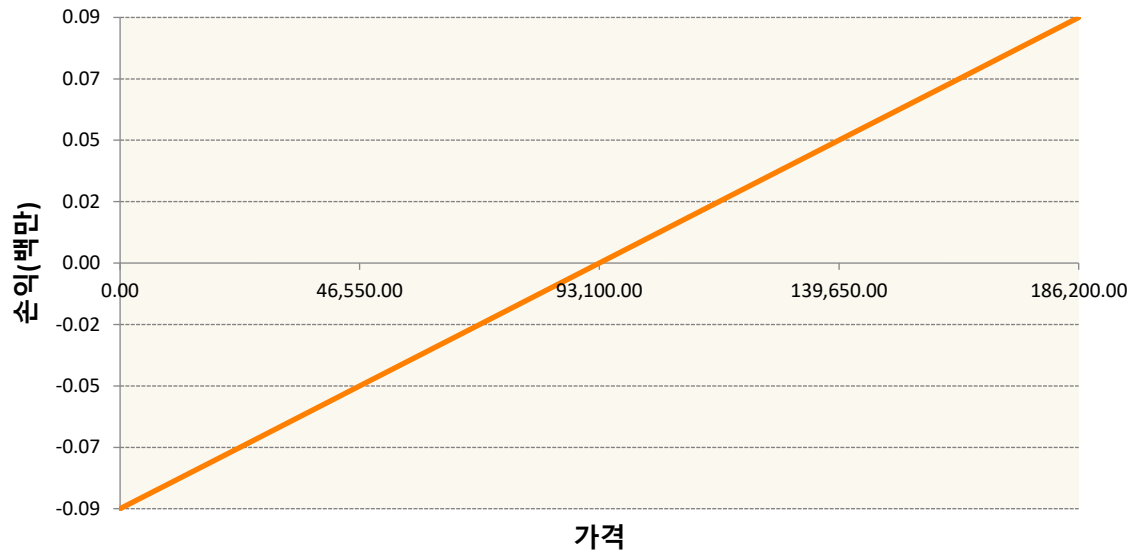
KR41EXV50007-2024-05 카카오게임즈개별선물



KR41FLV50009-2024-05 펄어비스개별선물



KR41GNV50003-금양 F 202405 (10)



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101V600 2024-06 코스피200지수선물	29
KR4105V500 2024-05 미니코스피200 선물	6
KR4145V500 2024-05 LG디스플레이개별선물	1
KR4151V500 2024-05 GS건설개별선물	0.35
KR41CRV500 2024-05 LG생활건강개별선물	1
KR41CYV500 2024-05 한온시스템개별선물	1
KR41EXV500 2024-05 카카오게임즈개별선물	0.05
KR41FLV500 2024-05 펄어비스개별선물	1
KR41GNV500(금양 F 202405 (10))	2

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

(단위:백만원)

47

공시일	2024-05-07
기준일	2024-05-03

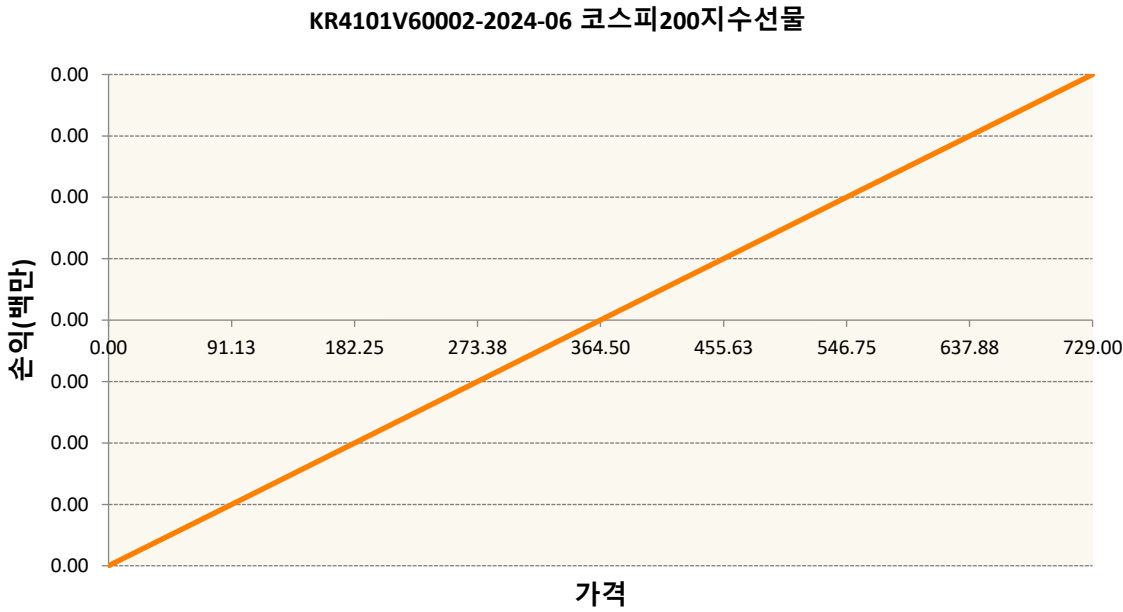
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	182	0	182	장내
누계	유가증권	선물	8,748	0	8,748	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101V60002		2024-06 코스피200지수선물					698
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-698	-698	-698	-698	-698	-698	-698
-5.33%	-465	-465	-465	-465	-465	-465	-465
-2.67%	-233	-233	-233	-233	-233	-233	-233
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	233	233	233	233	233	233	233
5.33%	465	465	465	465	465	465	465
8.00%	698	698	698	698	698	698	698

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

(단위:백만원)

662

공시일	2024-05-07
기준일	2024-05-03

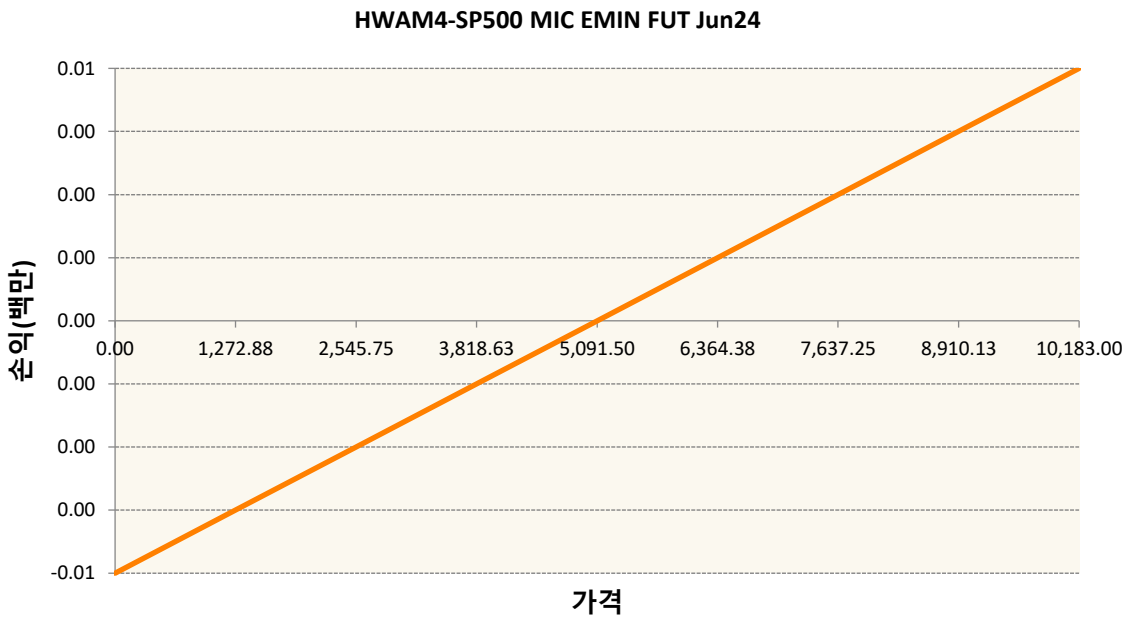
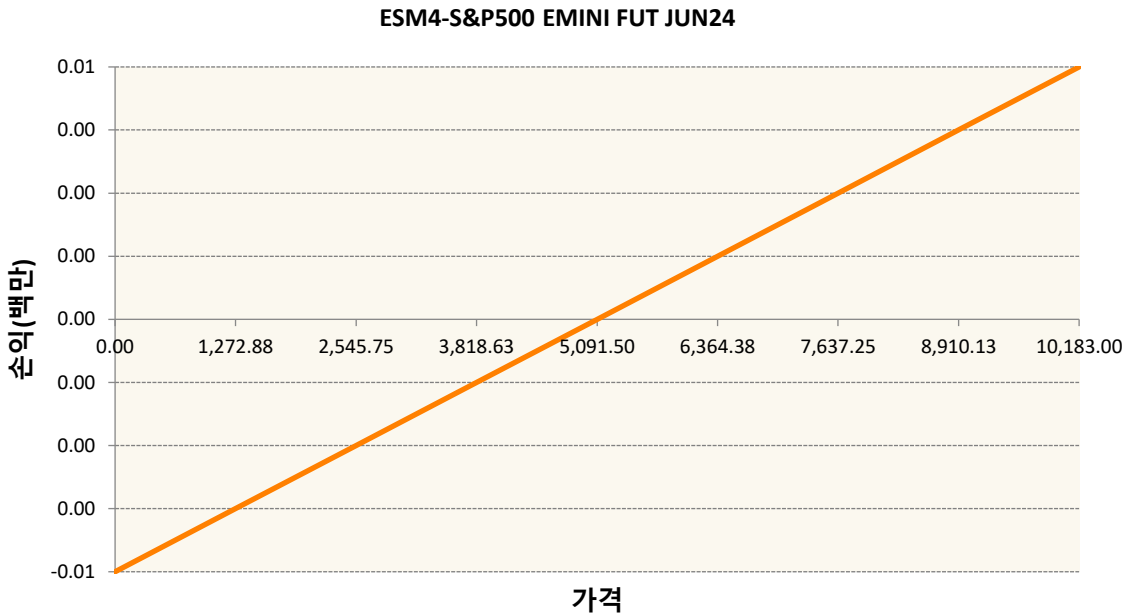
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

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	4,725	0	4,725	
누계	유가증권	선물	1,955	0	1,955	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESM4	S&P500 EMINI FUT JUN24	378
HWAM4	SP500 MIC EMIN FUT Jun24	156

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	353

공시일	2024-05-07
기준일	2024-05-03

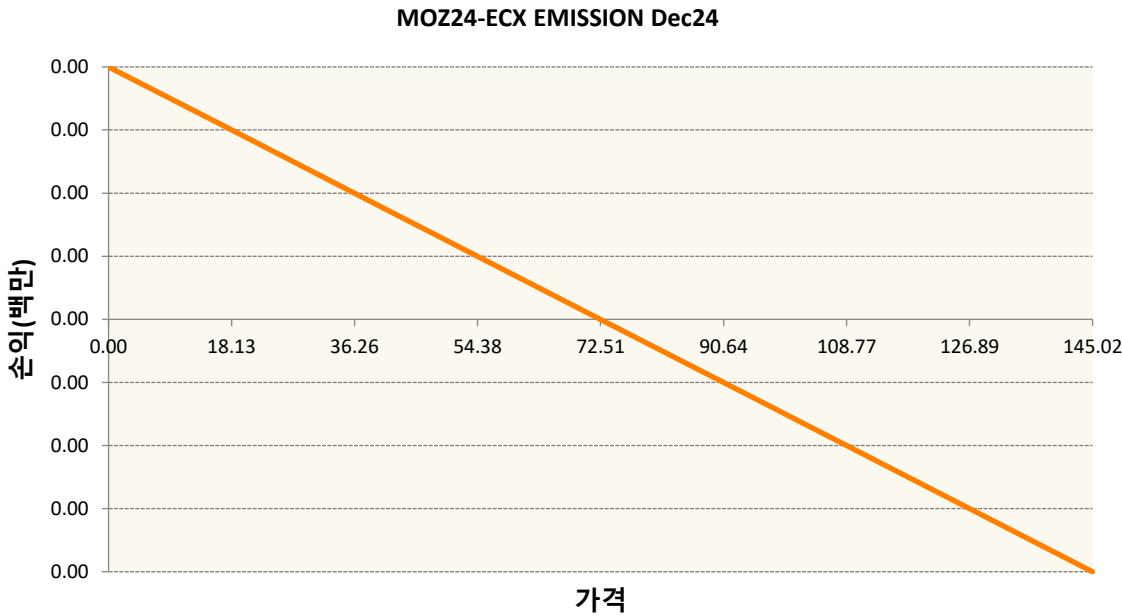
SOL유럽탄소배출권선물인버스ICE특별자산상

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	4,128	-4,128	
누계	지수	스왑	331	0	331	장외
누계	통화	선도	0	1,439	-1,439	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213E4W KRW/EUR 31-05-24E	9
FXW213E4W KRW/EUR 31-05-24E	106
MOZ24 ECX EMISSION Dec24	330
SWICEUACN ICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX	5

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

(단위:백만원)

678

공시일	2024-05-07
기준일	2024-05-03

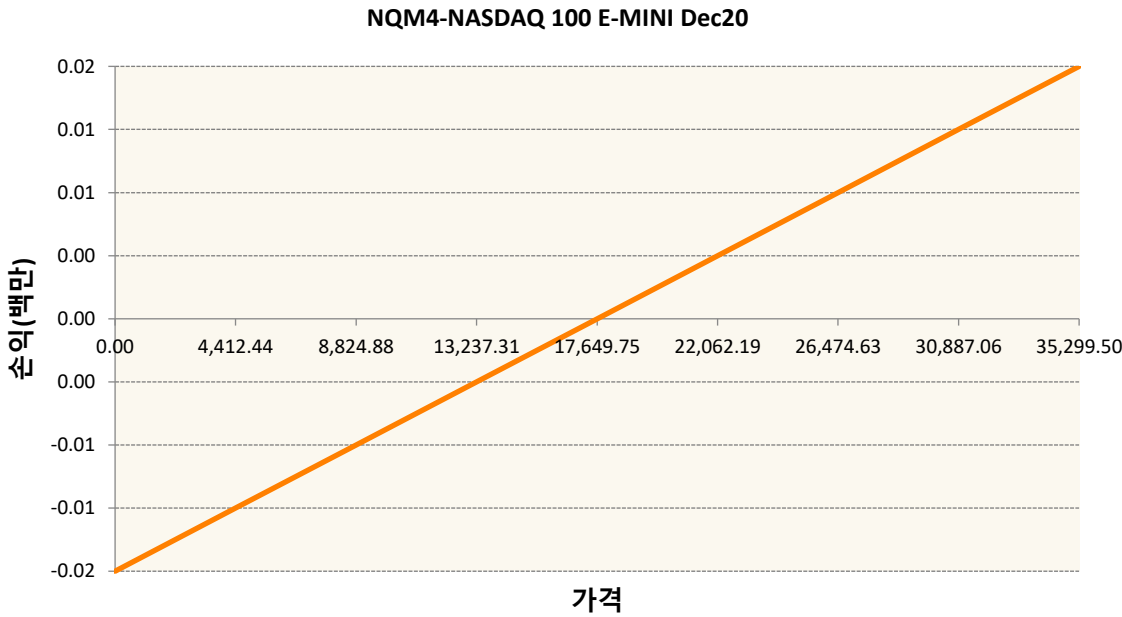
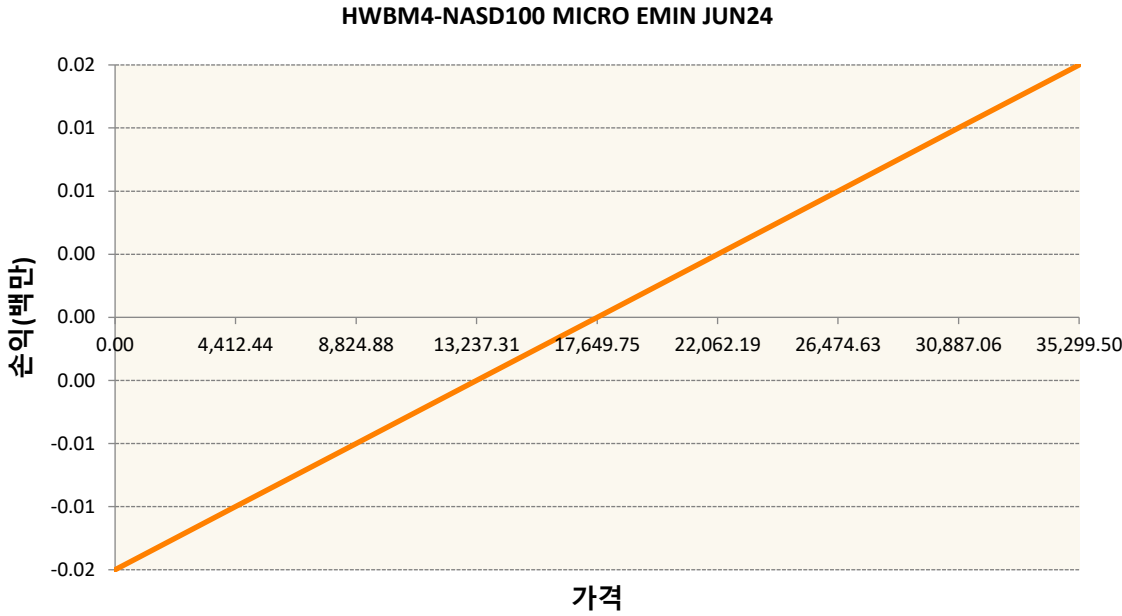
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

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	2,329	0	2,329	
누계	유가증권	선물	2,243	0	2,243	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
HWBM4	NASD100 MICRO EMIN JUN24		179
NQM4	NASDAQ 100 E-MINI Dec20		186

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)			(단위:백만원)
			288

공시일	2024-05-07
기준일	2024-05-03

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	150,060	0	150,060	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWKEDI0000 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	432
SWKEDI0000 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	931
SWKEDI0000 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	8,658
SWKEDI0000 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	1,951

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

(단위:백만원)

7,577

공시일	2024-05-07
기준일	2024-05-03

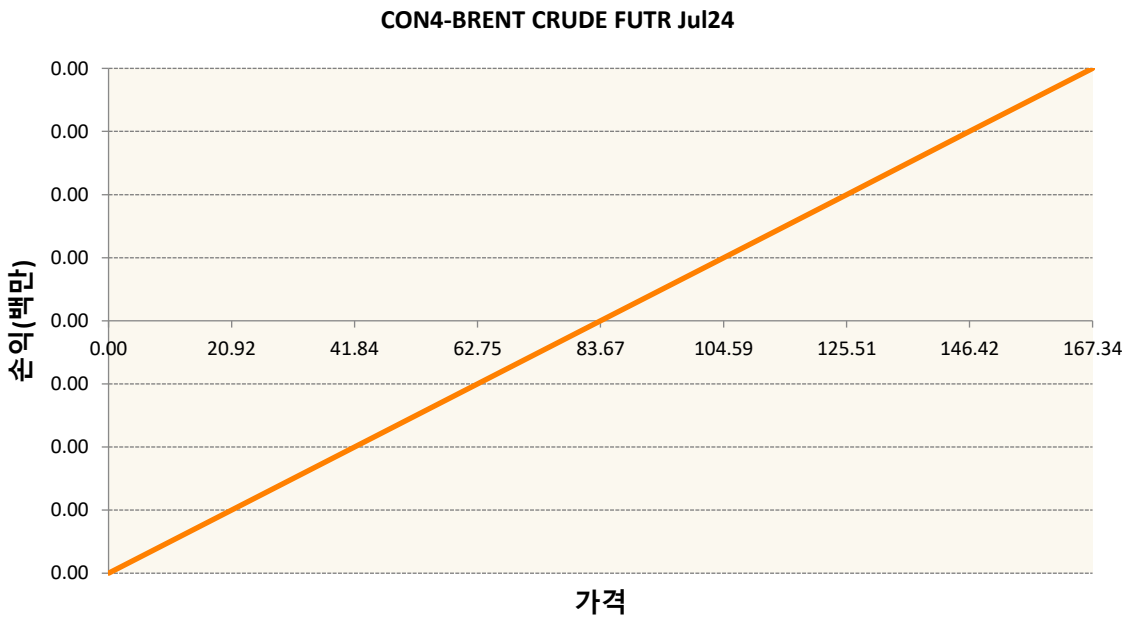
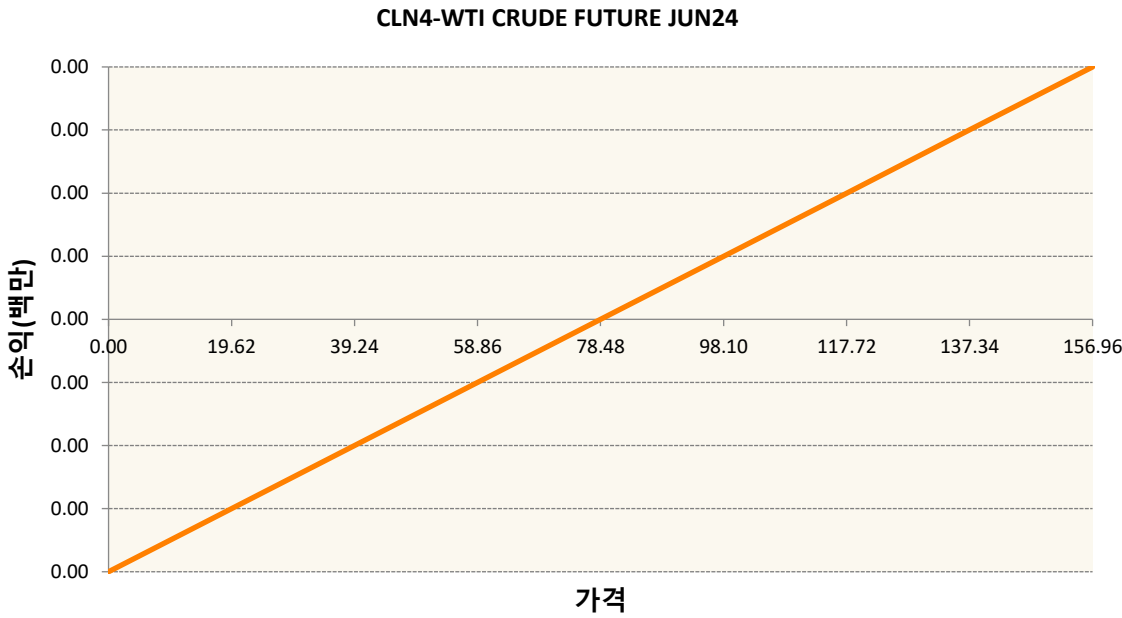
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

1. 계약금액

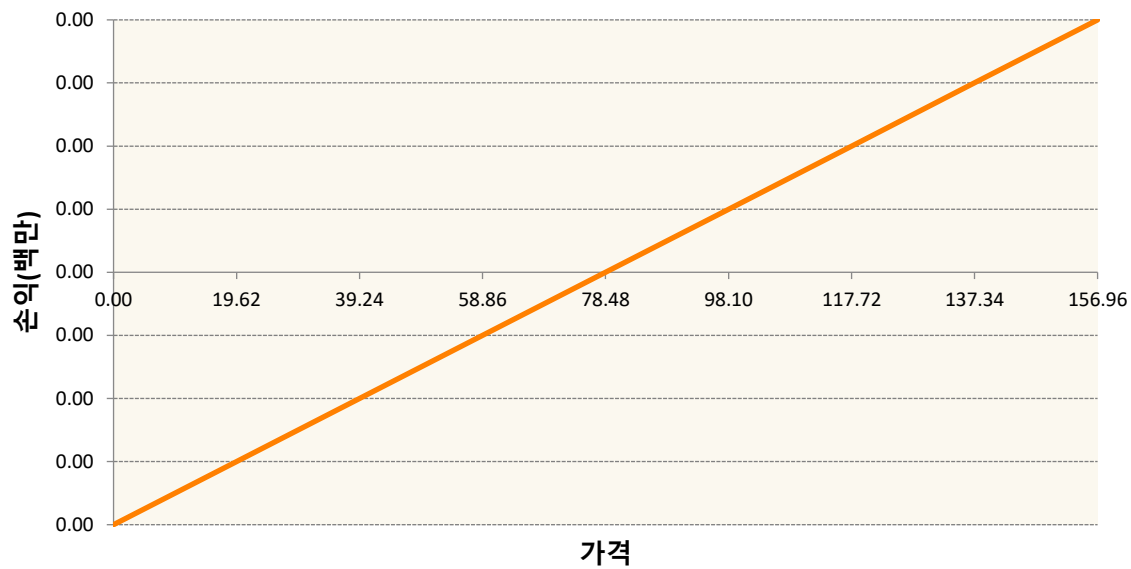
(단위:백만원)

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	1,088	0	1,088	
누계	통화	선물	0	177	-177	장내

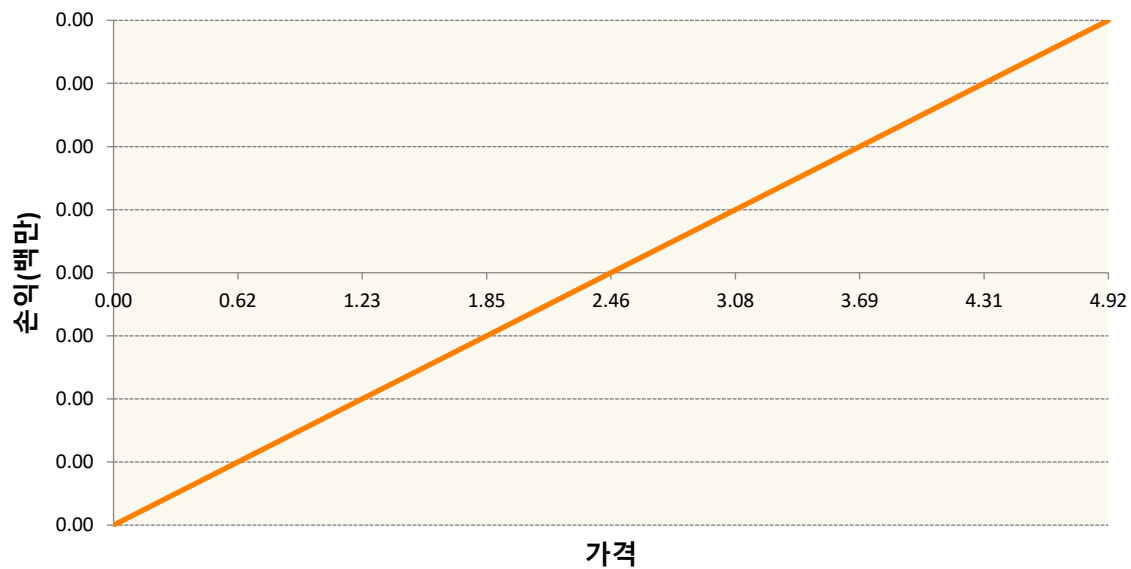
2. 만기시점의 손익구조



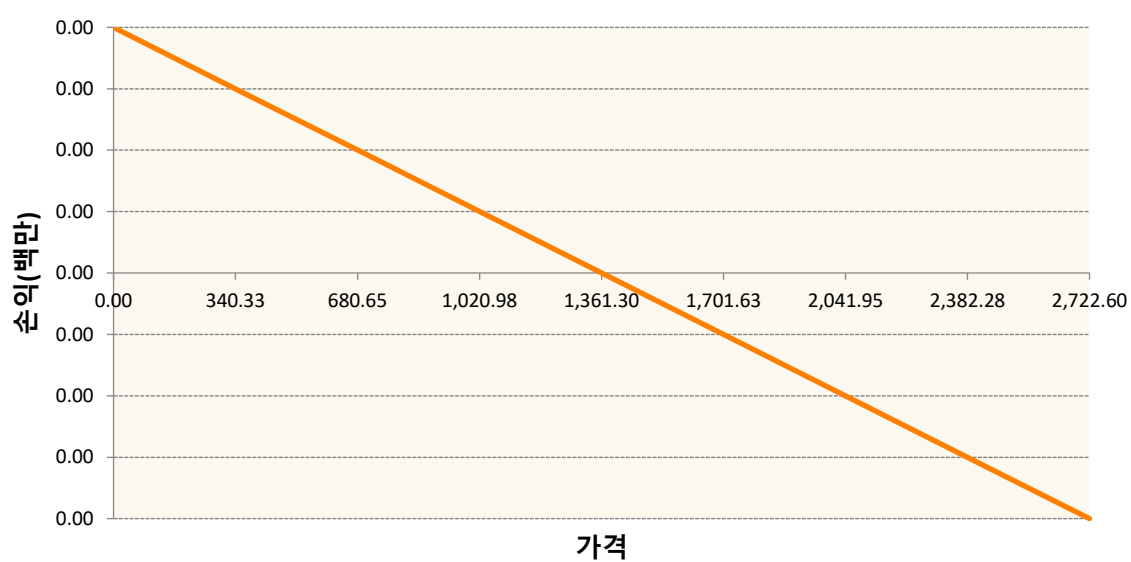
ECN4-E-mini Crude Oil JUL24



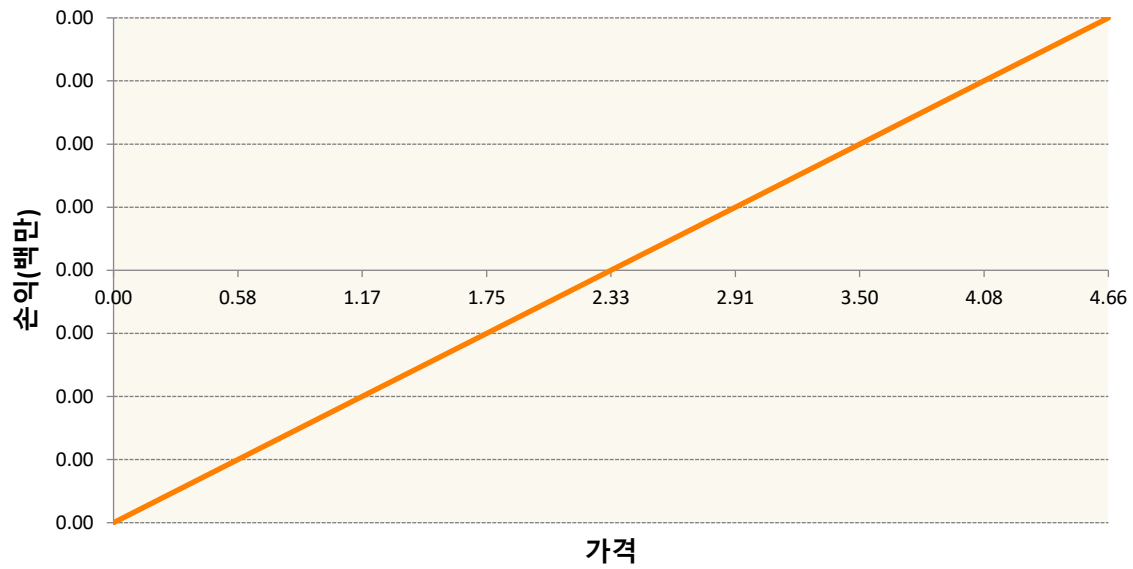
HON4-NY Harb ULSD Fut Jul24



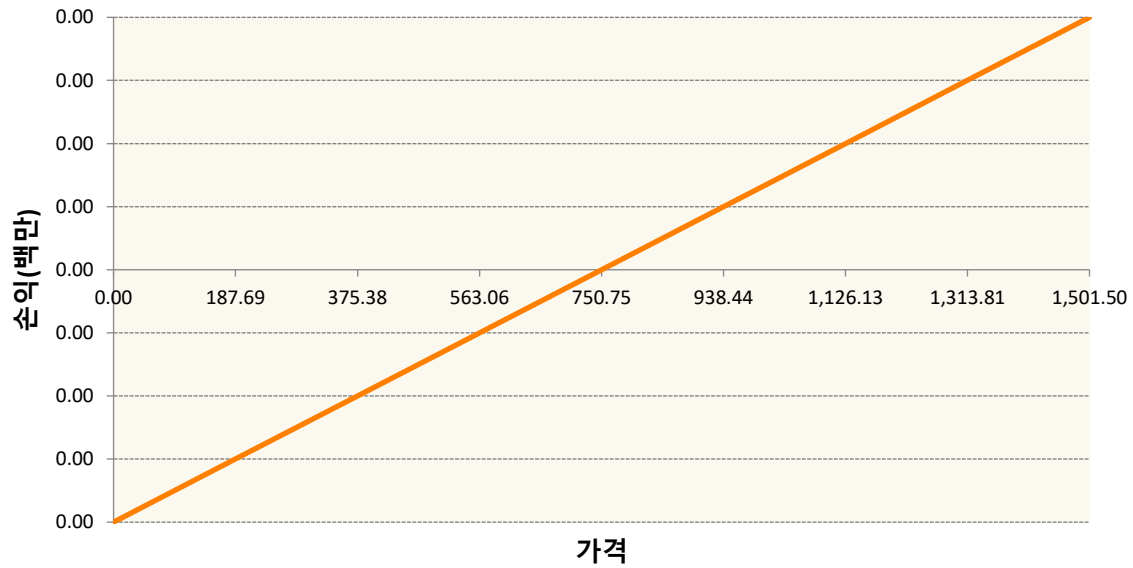
KR4175V50007-2024-05 달러선물



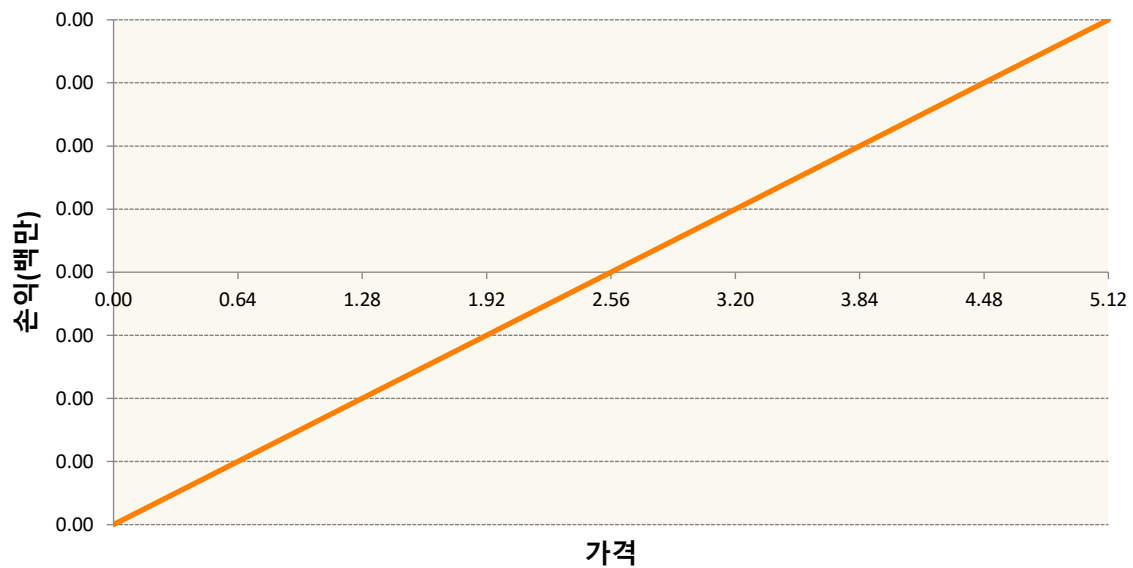
NGN24-NATURAL GAS FUTR JUL24



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	26
ECN4	E-mini Crude Oil JUL24	9
HON4	NY Harb ULSD Fut Jul24	11
KR4175V500 2024-05 달러선물		14
NGN24	NATURAL GAS FUTR JUL24	13
QSN4	Low Su Gasoil G JUL24	8
XBN4	GASOLINE RBOB FUT JUL24	12

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

185