

공시일	2024-05-16
기준일	2024-05-14

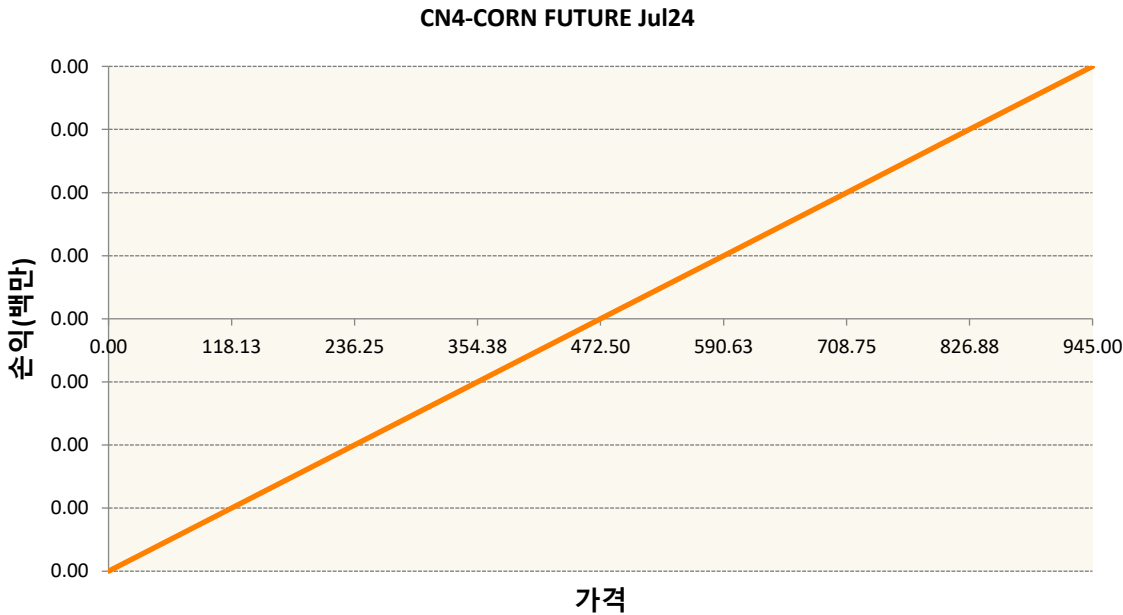
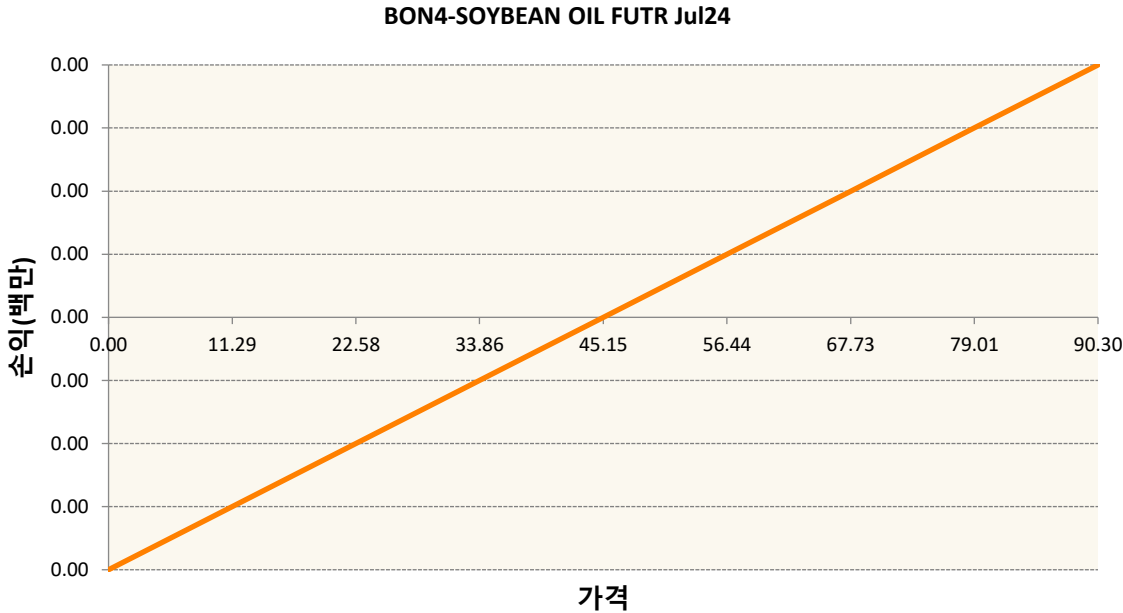
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

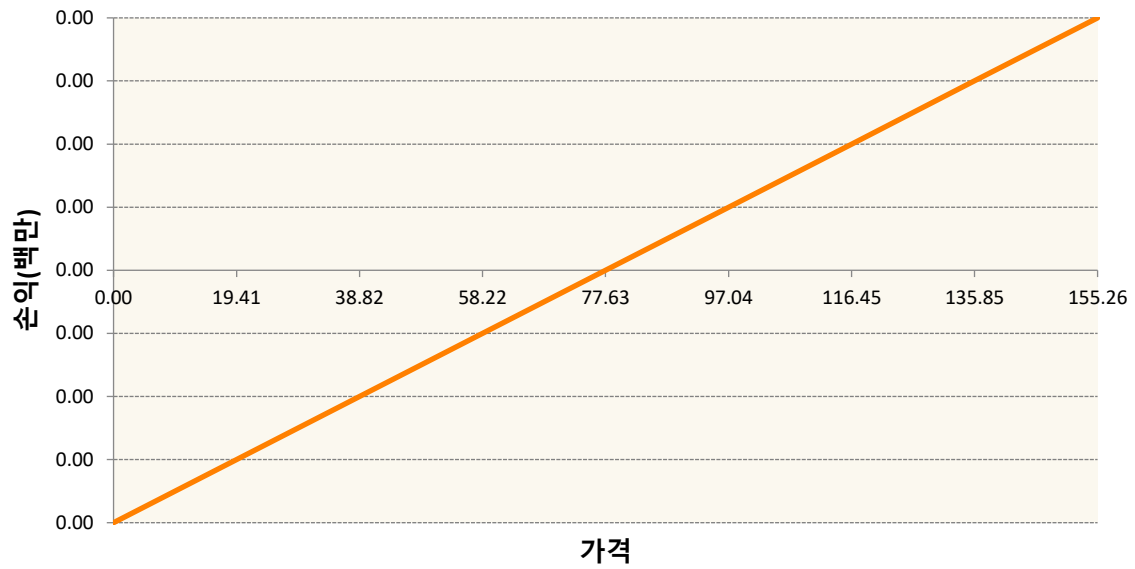
(단위:USD 백만)

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	4,334	0	4,334	
누계	통화	선물	0	548	-548	장내

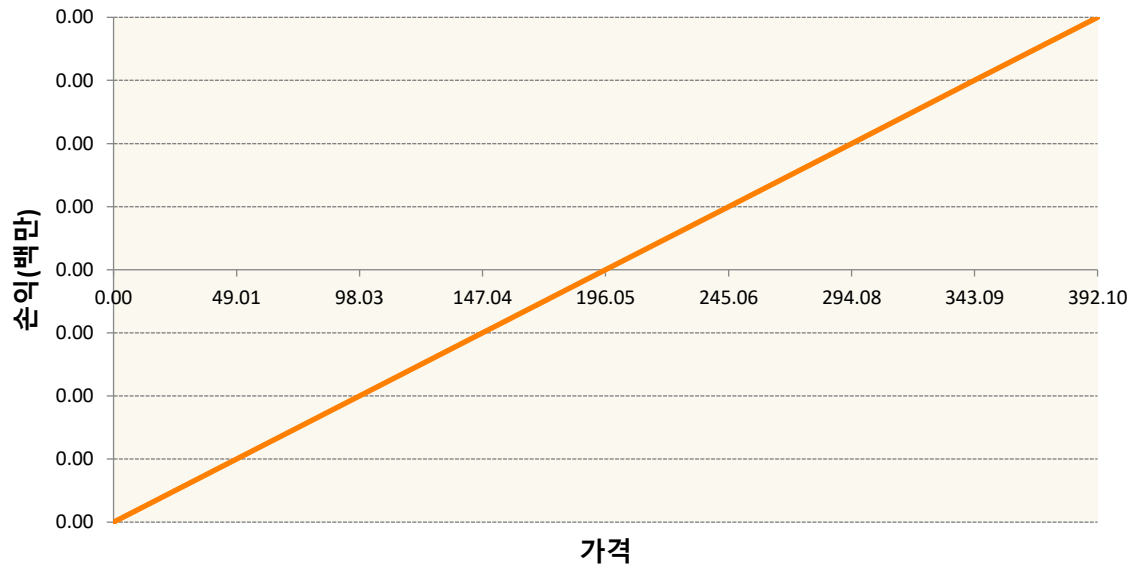
2. 만기시점의 손익구조



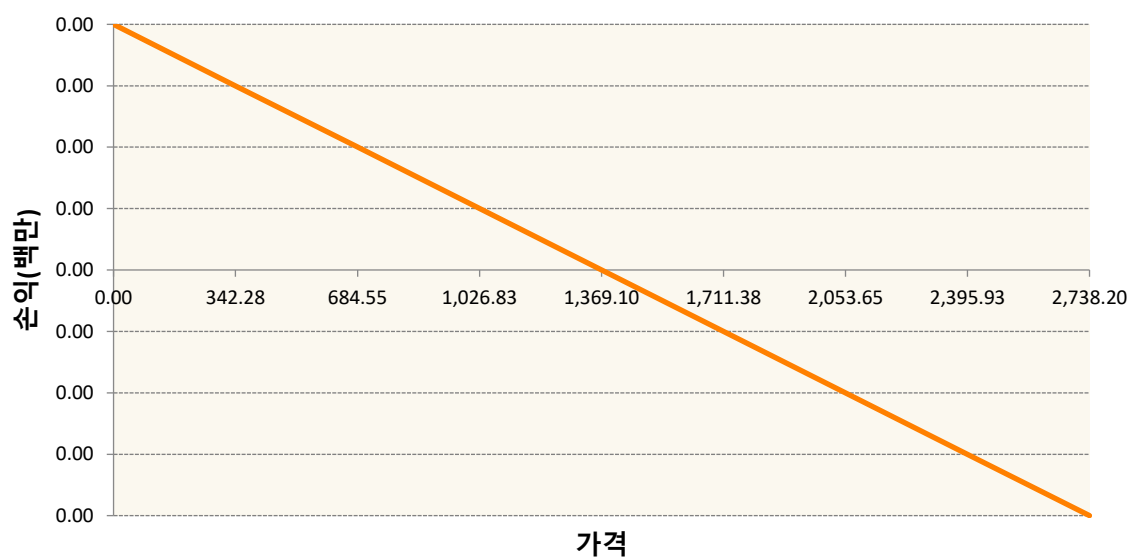
CTN4-COTTON NO.2 FUTR Jul24



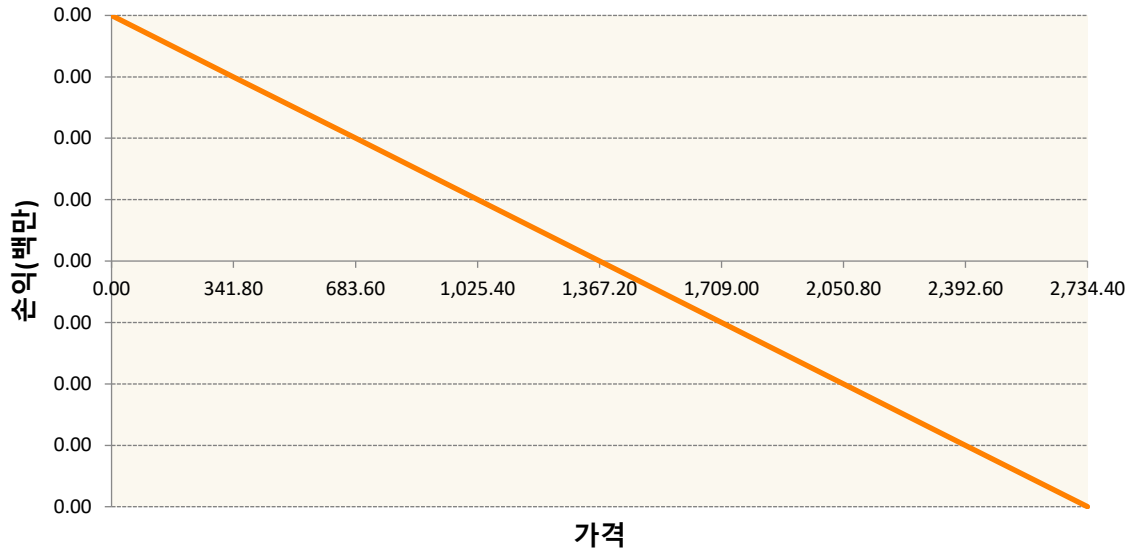
KCN4-COFFEE 'C' FUTURE Jul24



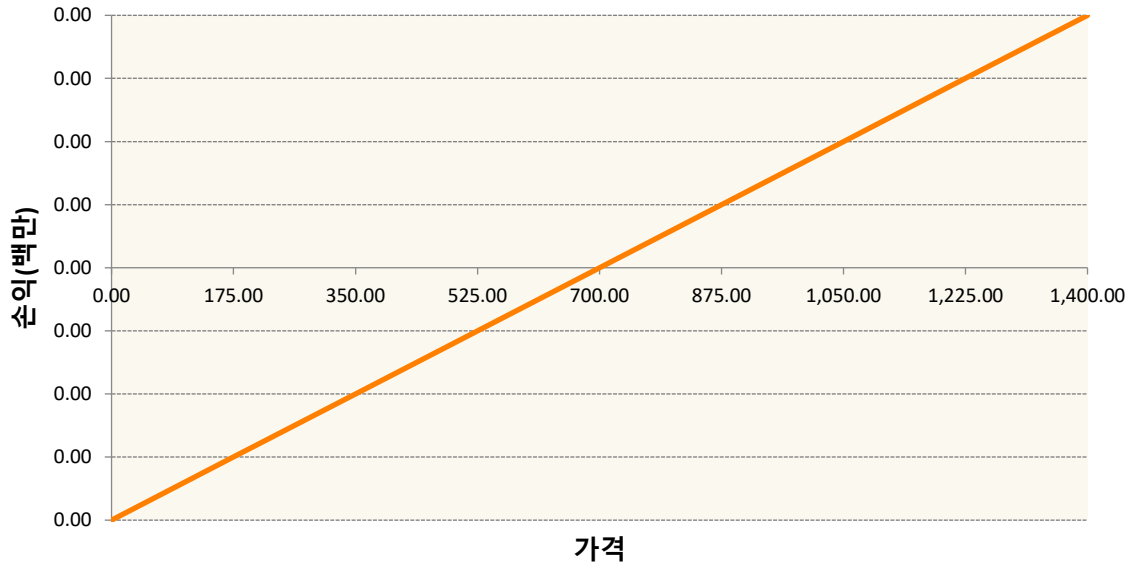
KR4175V50007-2024-05 달러선물



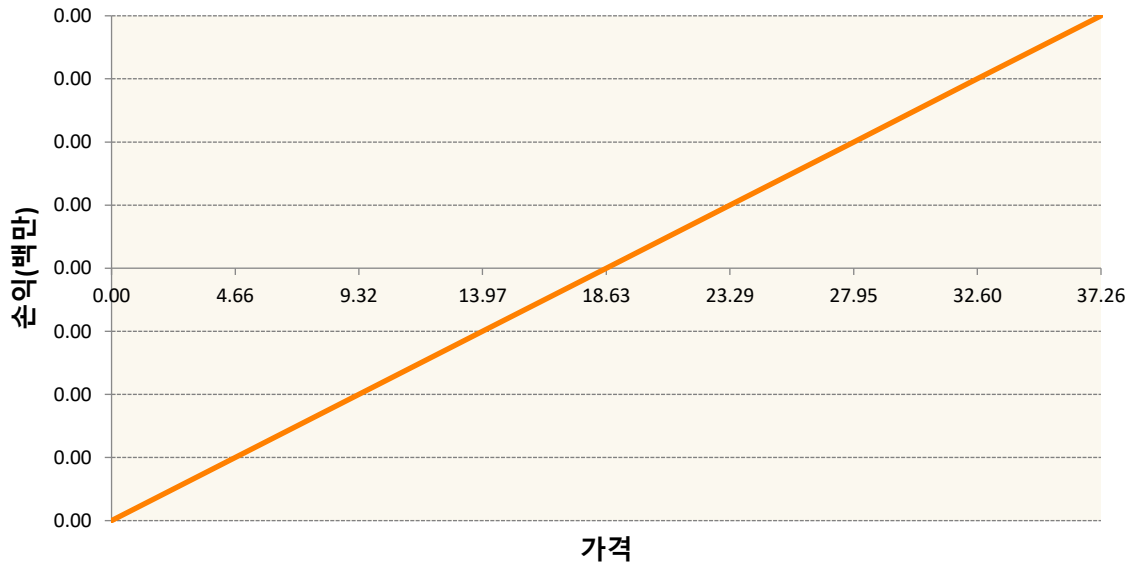
KR4175V60006-2024-06 달러선물



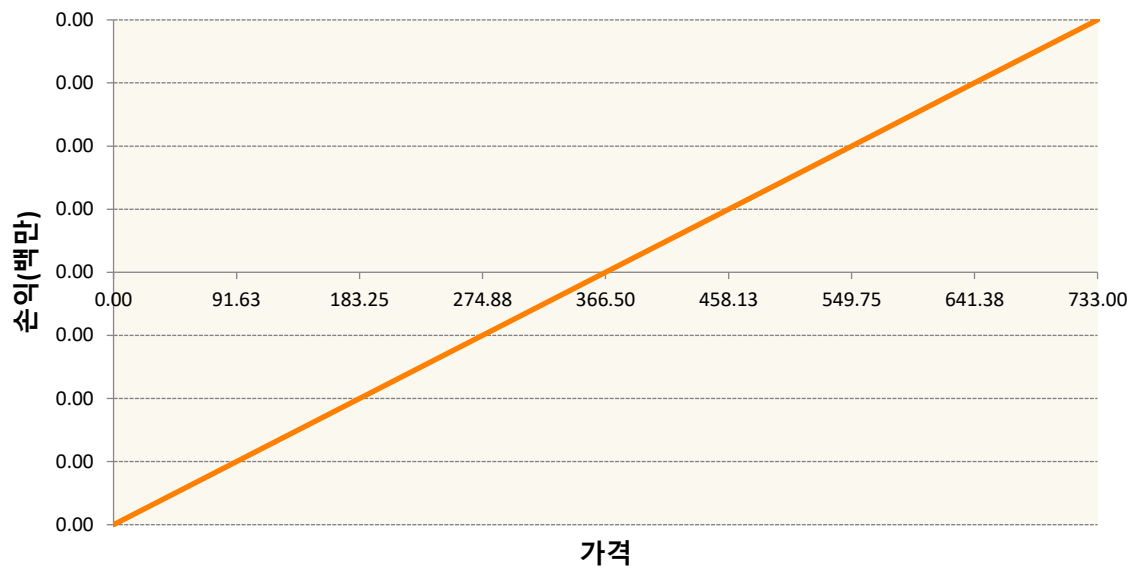
KWN4-KC HRW WHEAT FUT Jul24



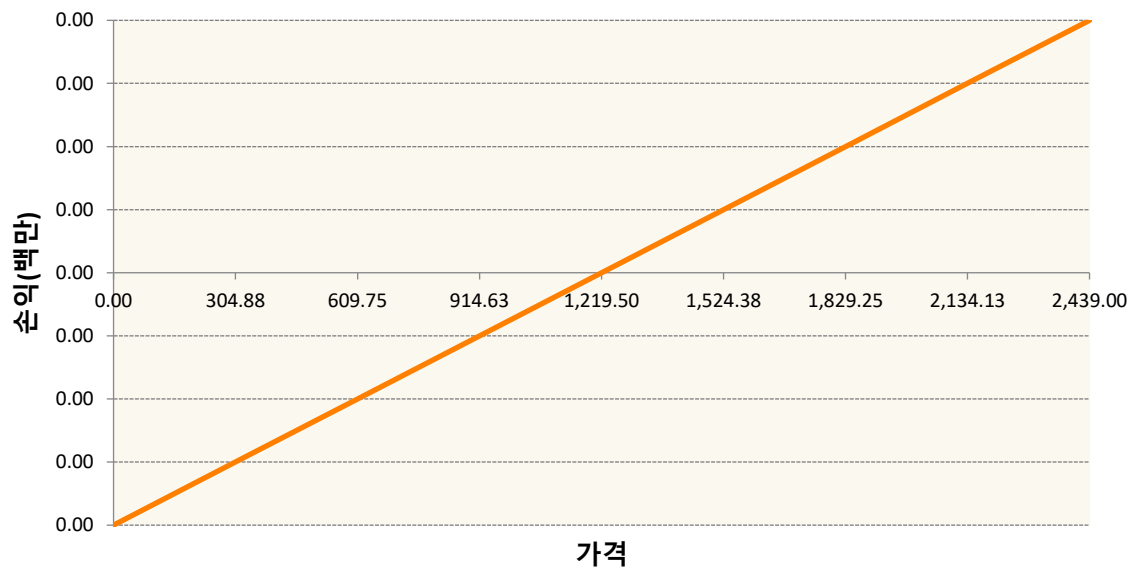
SBN4-Sugar #11 (WORLD) Jul24



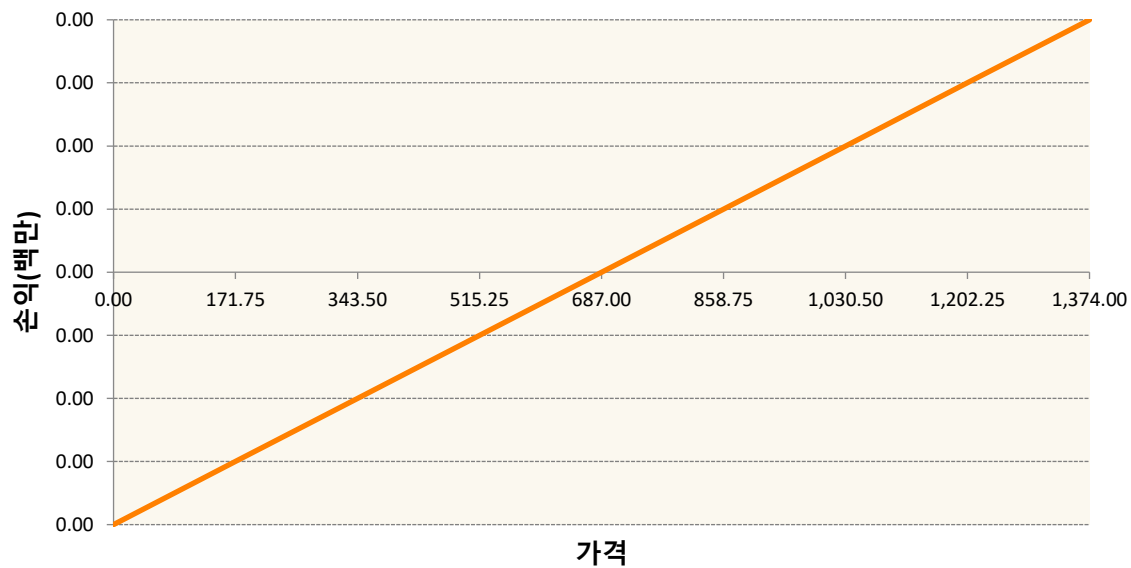
SMN4-SOYBEAN MEAL FUTR Jul24



SN4-SOYBEAN FUTURE Jul24



WN4-WHEAT FUTURE(CBT) 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	2024-05-16
기준일	2024-05-14

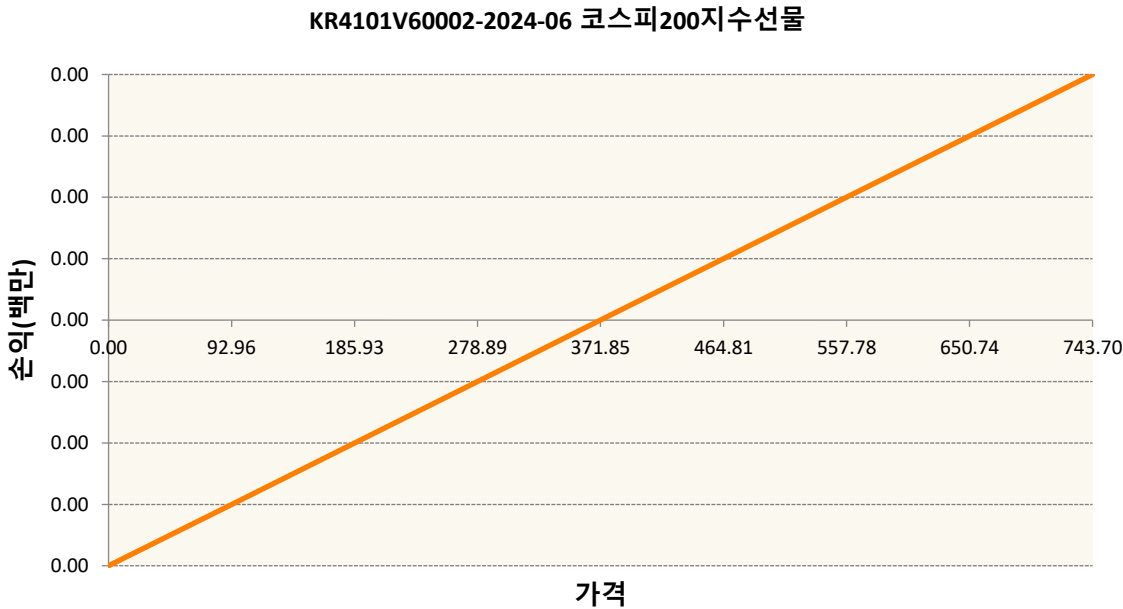
스마트인덱스모

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	93	-93	장내
누계	유가증권	선물	1,487	0	1,487	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101V60002			2024-06 코스피200지수선물				119
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-119	-119	-119	-119	-119	-119	-119
-5.33%	-79	-79	-79	-79	-79	-79	-79
-2.67%	-40	-40	-40	-40	-40	-40	-40
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	40	40	40	40	40	40	40
5.33%	79	79	79	79	79	79	79
8.00%	119	119	119	119	119	119	119

공시일	2024-05-16
기준일	2024-05-14

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	274
-----------------------------	-----

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

332

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2024-05-16
기준일	2024-05-14

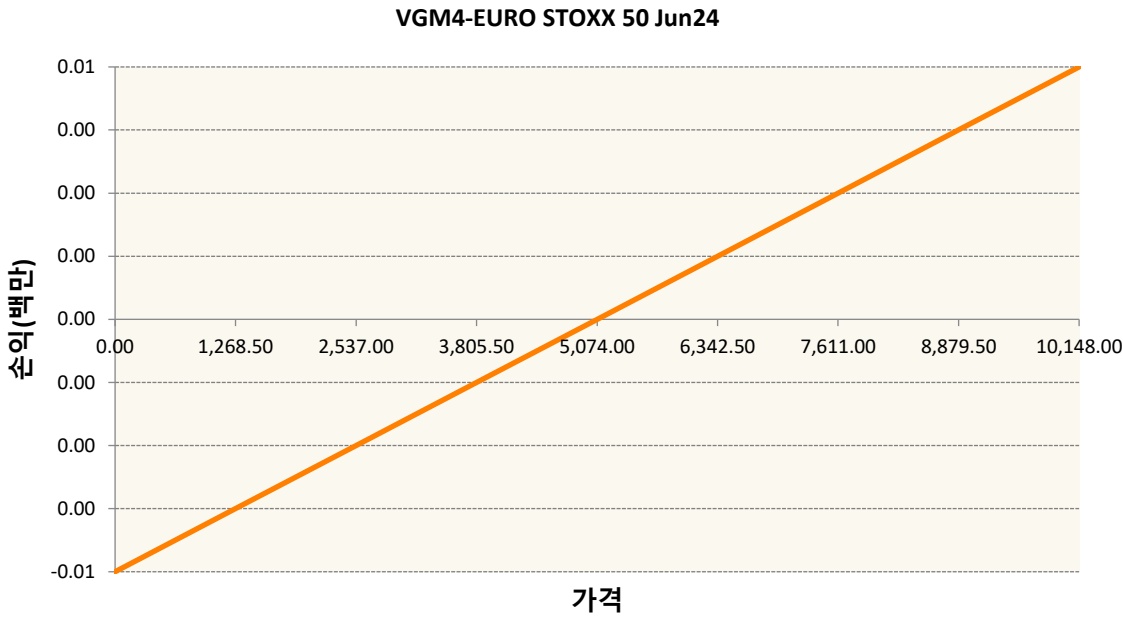
유로인덱스모(주식-파생형)

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	947	0	947	
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	76

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

(단위:백만원)

63

공시일	2024-05-16
기준일	2024-05-14

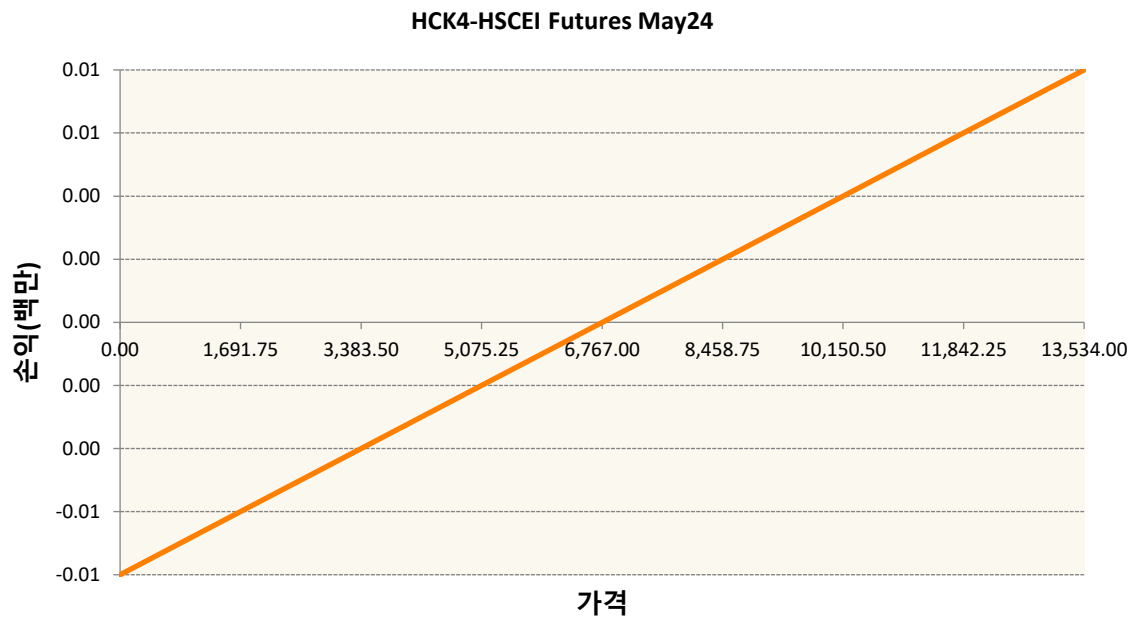
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,307	0	1,307	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCK4	HSCEI Futures May24	105
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

131

공시일	2024-05-16
기준일	2024-05-14

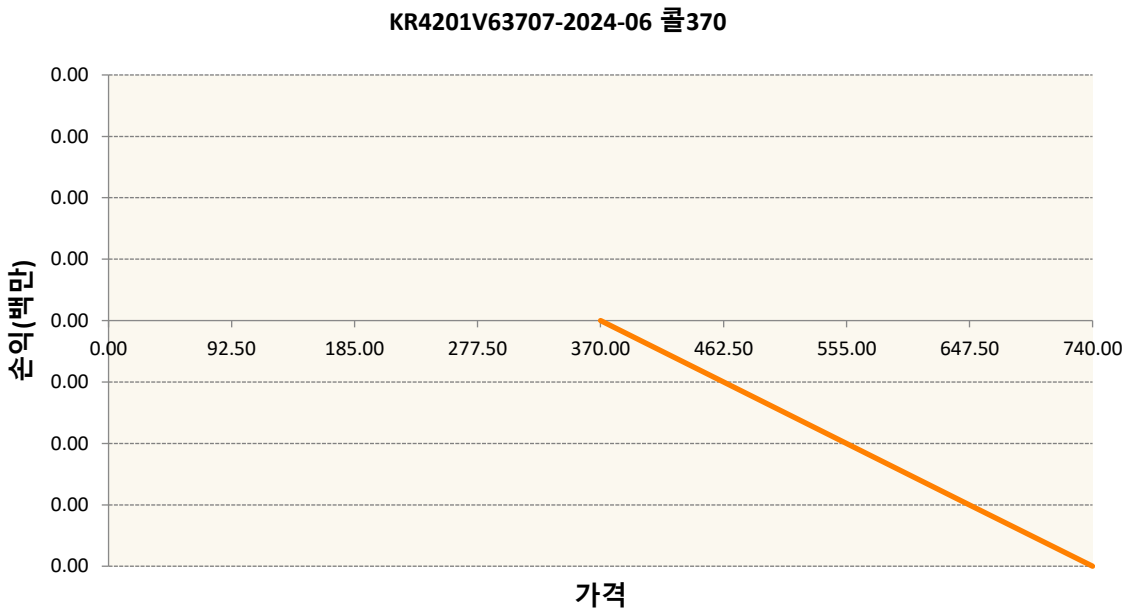
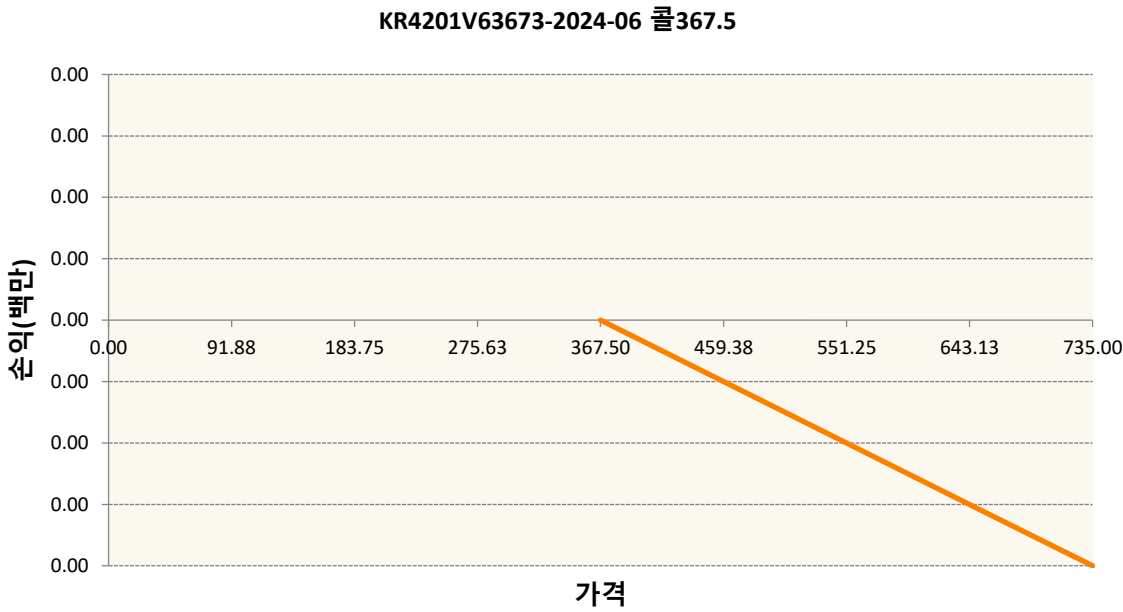
커버드콜모(주식혼합-파생형)

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	47,026	-47,026	장내

2. 만기시점의 손익구조



The graph illustrates a linear relationship between price and profit/loss. The x-axis, labeled '가격' (Price), ranges from 0.00 to 735.00. The y-axis, labeled '손익(백만)' (Profit/Loss in millions), ranges from 0.00 to 0.00. An orange line starts at the origin (0, 0) and extends to the point (367.50, 0.00).

가격	손익(백만)
0.00	0.00
91.88	0.00
183.75	0.00
275.63	0.00
367.50	0.00
459.38	0.00
551.25	0.00
643.13	0.00
735.00	0.00

The graph illustrates the relationship between price (가격) and profit (이익). The x-axis (가격) ranges from 0.00 to 740.00, and the y-axis (이익) ranges from 0.00 to 0.00. A single orange line starts at (0, 0) and ends at (370, 0), indicating that profit is zero for all prices in this range.

(단위:백만원)

KR4201V63673		2024-06 콜367.5					941
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	486	469	449	428	405	380	354
-5.33%	422	395	366	336	305	274	242
-2.67%	301	266	231	195	160	124	88
0%	109	73	37	0	-37	-73	-110
2.67%	-152	-183	-215	-248	-282	-316	-350
5.33%	-470	-492	-516	-543	-570	-599	-629
8.00%	-824	-838	-854	-872	-893	-916	-941
KR4201V63707		2024-06 콜370					1,515
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	735	710	681	649	613	575	534
-5.33%	647	605	560	514	465	415	364
-2.67%	472	416	359	301	243	185	126
0%	184	123	61	0	-61	-123	-184
2.67%	-222	-277	-333	-390	-448	-506	-565
5.33%	-727	-768	-812	-859	-909	-960	-1,012
8.00%	-1,301	-1,327	-1,358	-1,392	-1,430	-1,471	-1,515

KR4301V63671

2024-06 풋367.5

432

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-410	-412	-415	-418	-422	-427	-432
-5.33%	-225	-231	-237	-244	-252	-260	-269
-2.67%	-69	-80	-91	-101	-112	-124	-135
0%	34	23	11	0	-12	-23	-35
2.67%	84	77	69	60	51	41	32
5.33%	101	98	94	89	84	77	71
8.00%	105	104	103	101	98	95	91

KR4301V63705

2024-06 풋370

57

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-55	-55	-55	-55	-56	-56	-57
-5.33%	-31	-32	-32	-33	-34	-35	-36
-2.67%	-10	-11	-13	-14	-15	-17	-18
0%	4	3	1	0	-1	-3	-4
2.67%	12	11	10	9	7	6	5
5.33%	15	15	14	13	12	12	11
8.00%	16	16	15	15	15	14	14

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

(단위:백만원)

2,827

공시일	2024-05-16
기준일	2024-05-14

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	1,590	0	1,590	

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	2024-05-16
기준일	2024-05-14

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	4,333	0	4,333	

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	2024-05-16
기준일	2024-05-14

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	15,150	0	15,150	
누계	통화	선도	0	15,108	-15,108	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213E2TC KRW/USD 31-05-24E	591
FXW213E3TC KRW/USD 28-06-24E	422
FXW213E4SC KRW/USD 31-07-24E	196
IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

558

공시일	2024-05-16
기준일	2024-05-14

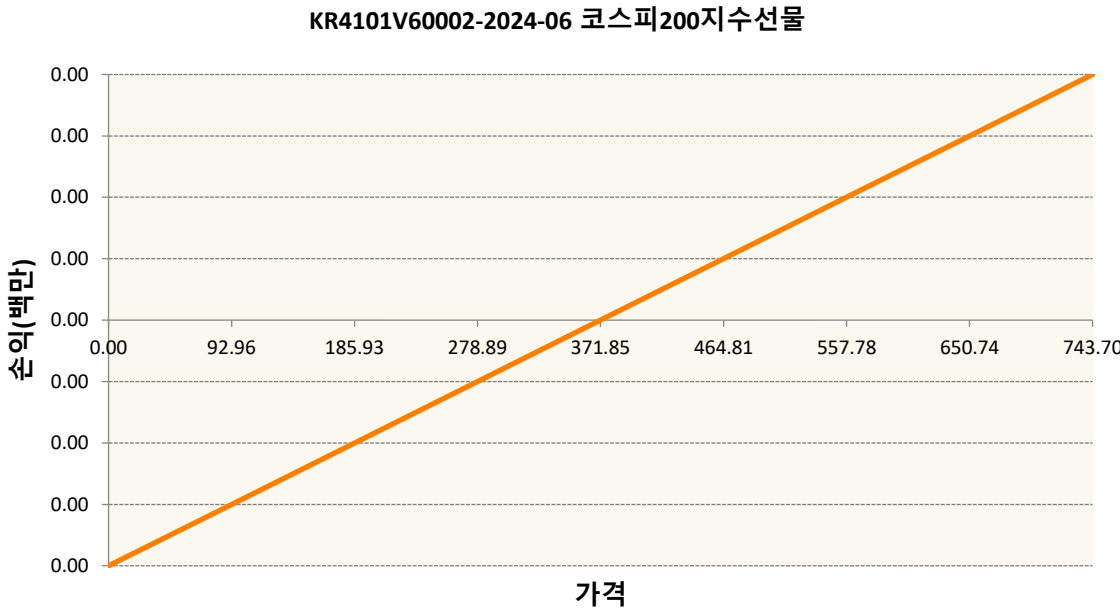
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

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	1,116	0	1,116	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101V60002		2024-06 코스피200지수선물					89
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-89	-89	-89	-89	-89	-89	-89
-5.33%	-59	-59	-59	-59	-59	-59	-59
-2.67%	-30	-30	-30	-30	-30	-30	-30
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	30	30	30	30	30	30	30
5.33%	59	59	59	59	59	59	59
8.00%	89	89	89	89	89	89	89

공시일	2024-05-16
기준일	2024-05-14

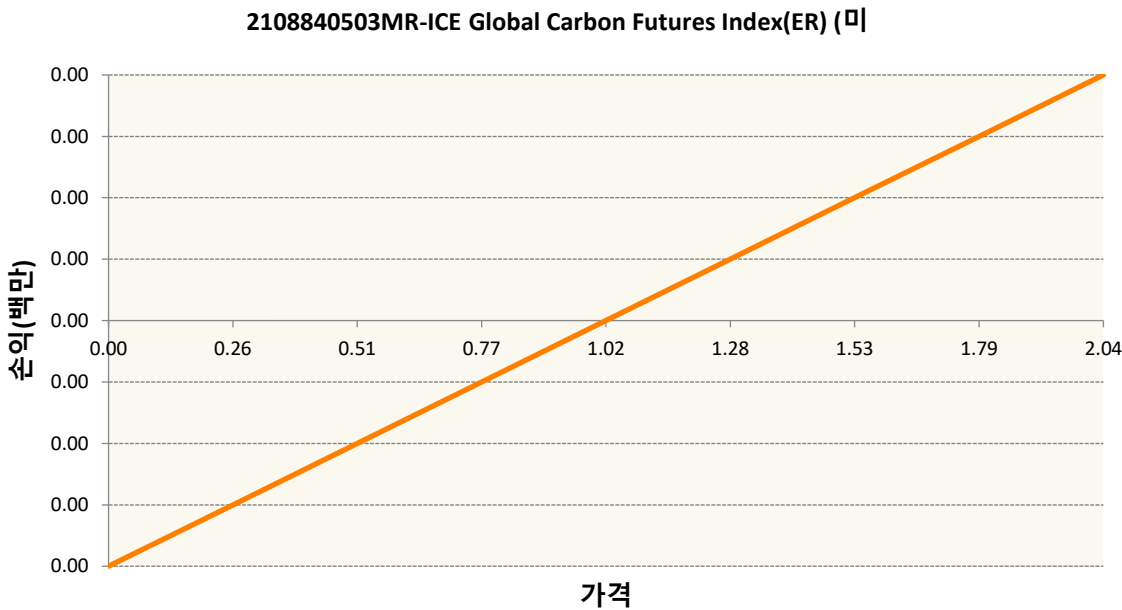
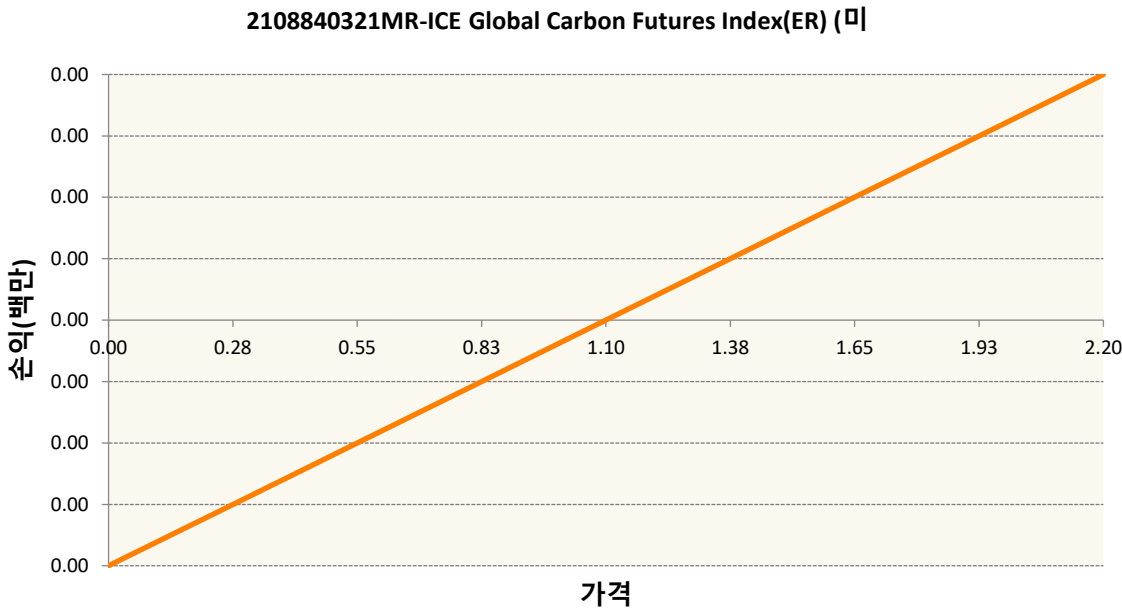
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

1. 계약금액

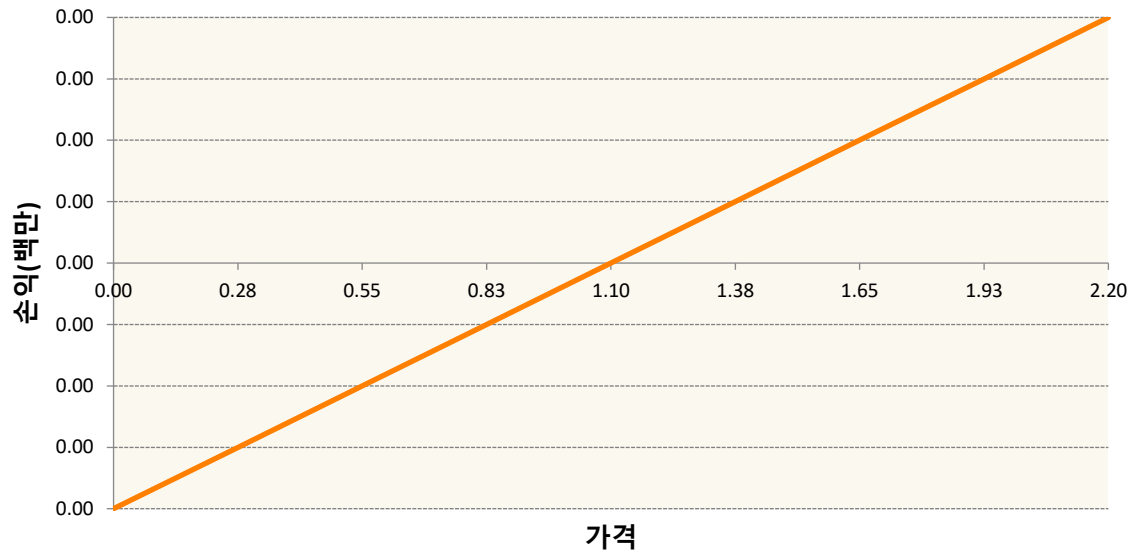
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	22,671	0	22,671	

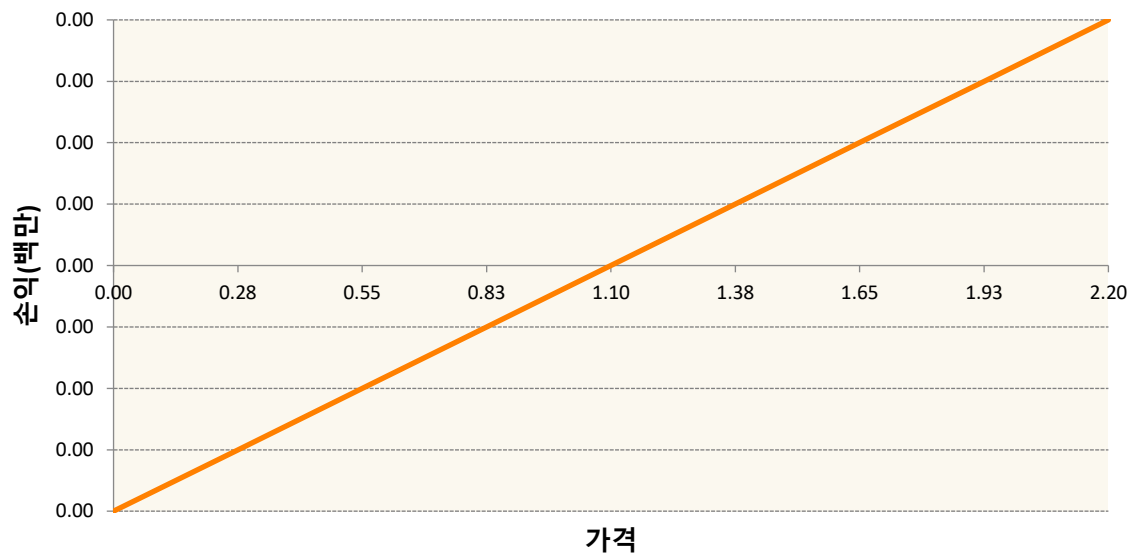
2. 만기시점의 손익구조



2108840920KM-ICE Global Carbon Futures Index(ER) (키



2108840920MZ-ICE Global Carbon Futures Index(ER) (메



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2108840321ICE Global Carbon Futures Index(ER) (미	478
2108840503ICE Global Carbon Futures Index(ER) (미	191
2108840920ICE Global Carbon Futures Index(ER) (키	956
2108840920ICE Global Carbon Futures Index(ER) (메	191

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

(단위:백만원)

2,135

공시일	2024-05-16
기준일	2024-05-14

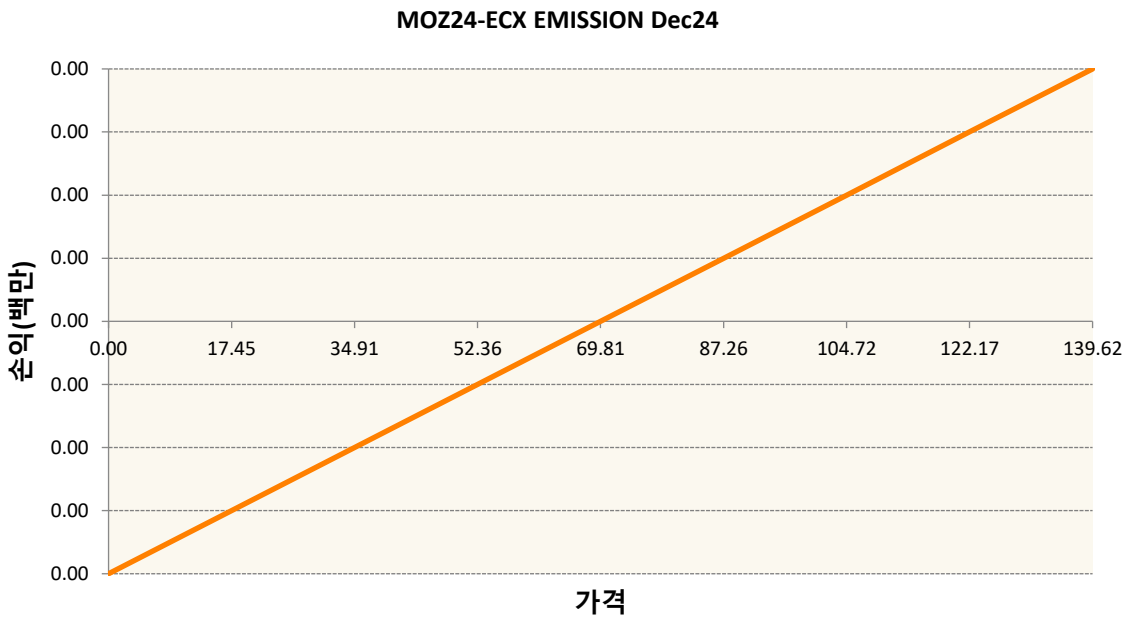
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	10,456	0	10,456	
누계	지수	스왑	331	0	331	장외
누계	통화	선도	0	2,685	-2,685	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213E4W KRW/EUR 31-05-24E	23
FXW213E4W KRW/EUR 31-05-24E	192
MOZ24 ECX EMISSION Dec24	836
SWICEUACN ICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX	4

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

(단위:백만원)

1,652

공시일	2024-05-16
기준일	2024-05-14

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)

44

공시일	2024-05-16
기준일	2024-05-14

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)

27

공시일	2024-05-16
기준일	2024-05-14

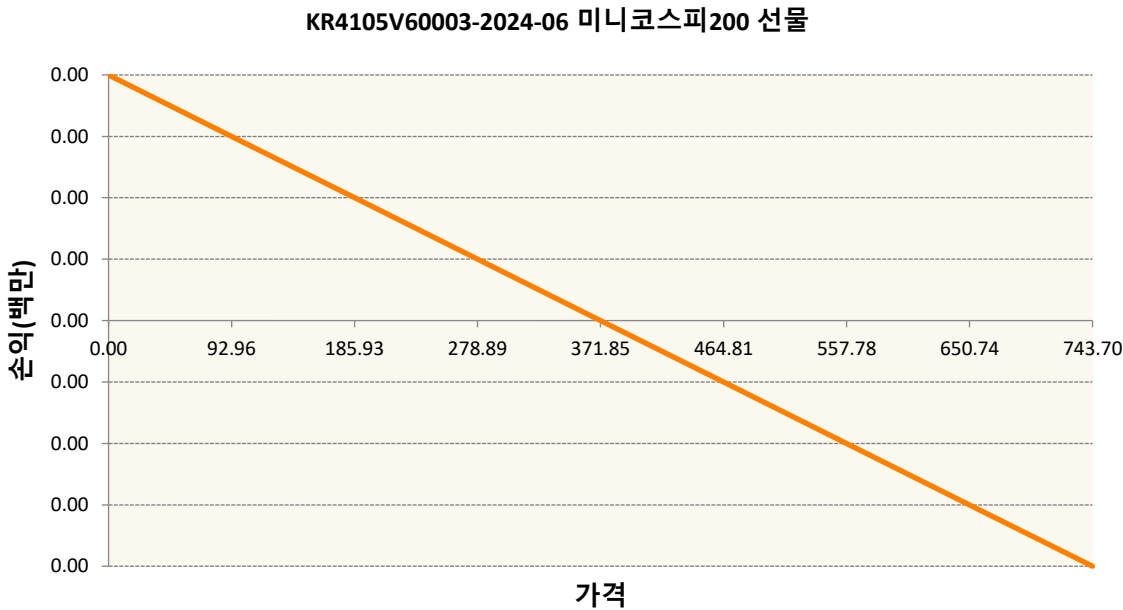
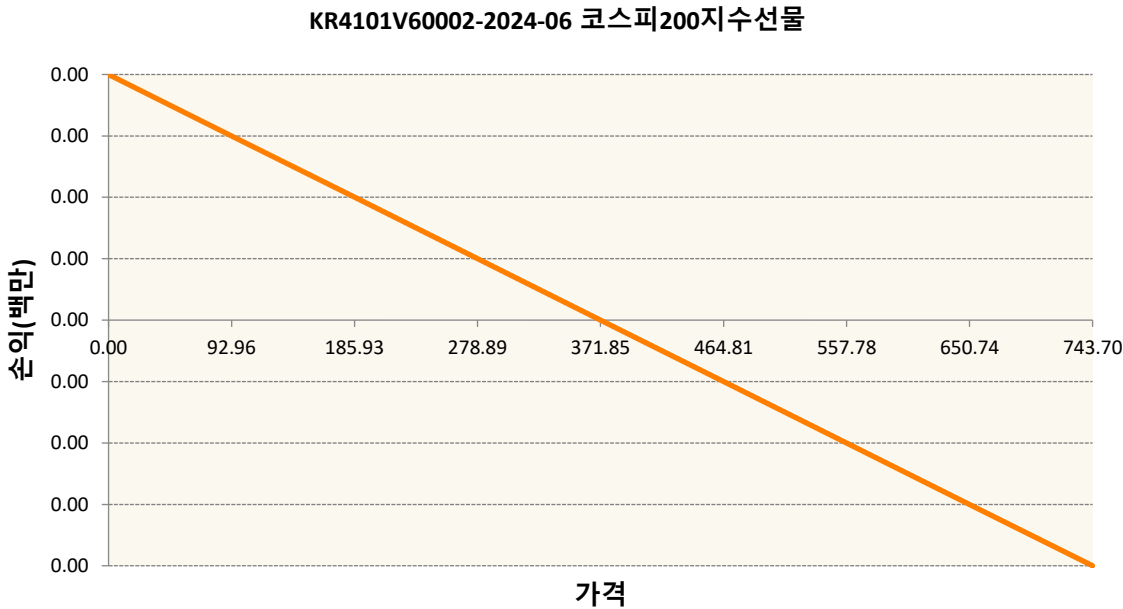
에퀴티알파일반사모혼합자산

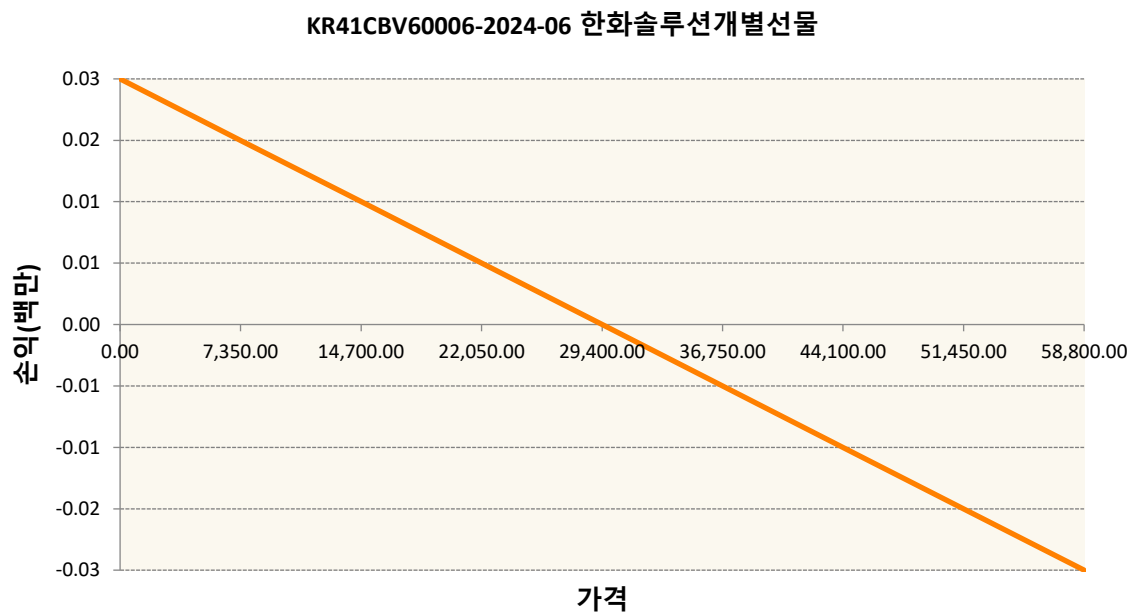
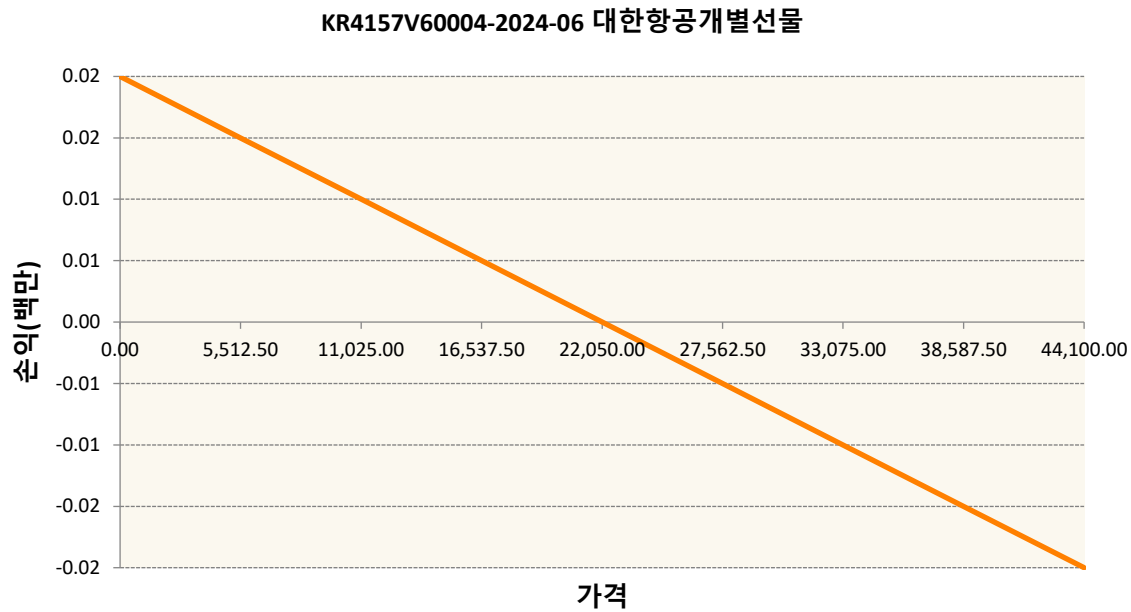
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	846	-846	장내

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
KR4101V600 2024-06 코스피200지수선물		30
KR4105V600 2024-06 미니코스피200 선물		7
KR4157V600 2024-06 대한항공개별선물		0.3
KR41CBV600 2024-06 한화솔루션개별선물		0.47

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	37

공시일	2024-05-16
기준일	2024-05-14

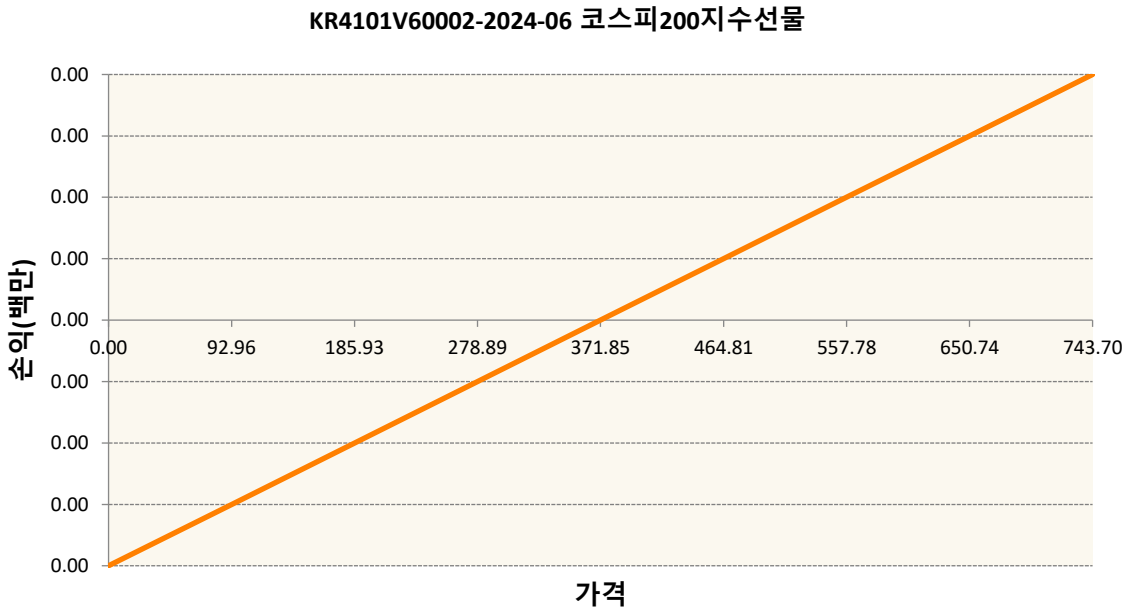
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	6,972	0	6,972	장내
누계	유가증권	선물	9,761	0	9,761	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101V60002		2024-06 코스피200지수선물					779
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-779	-779	-779	-779	-779	-779	-779
-5.33%	-519	-519	-519	-519	-519	-519	-519
-2.67%	-260	-260	-260	-260	-260	-260	-260
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	260	260	260	260	260	260	260
5.33%	519	519	519	519	519	519	519
8.00%	779	779	779	779	779	779	779

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

(단위:백만원)

748

공시일	2024-05-16
기준일	2024-05-14

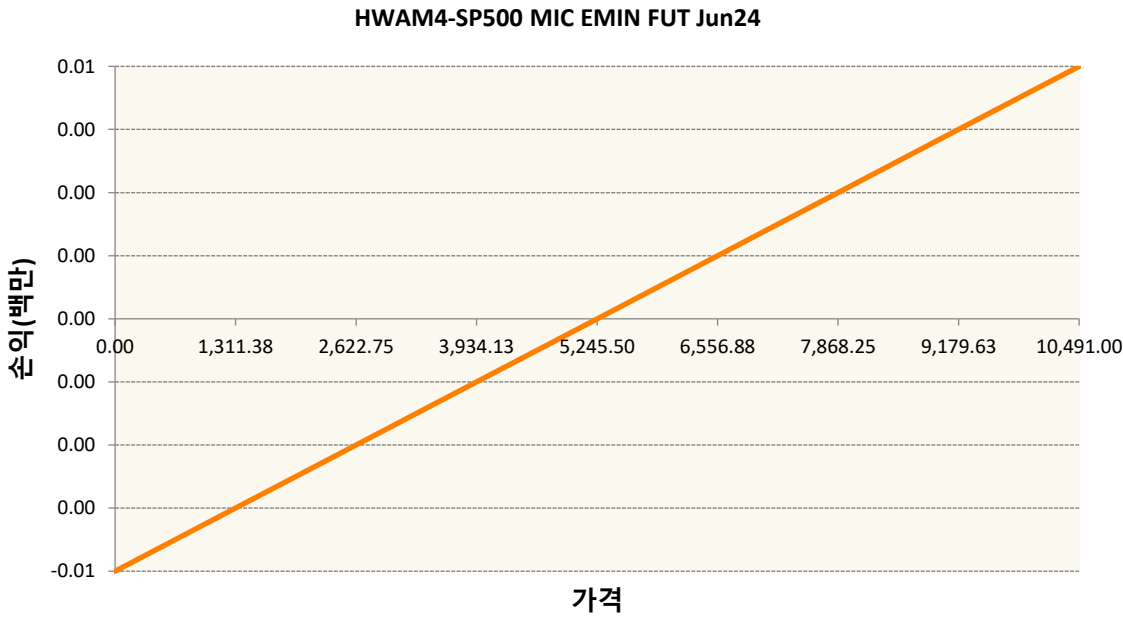
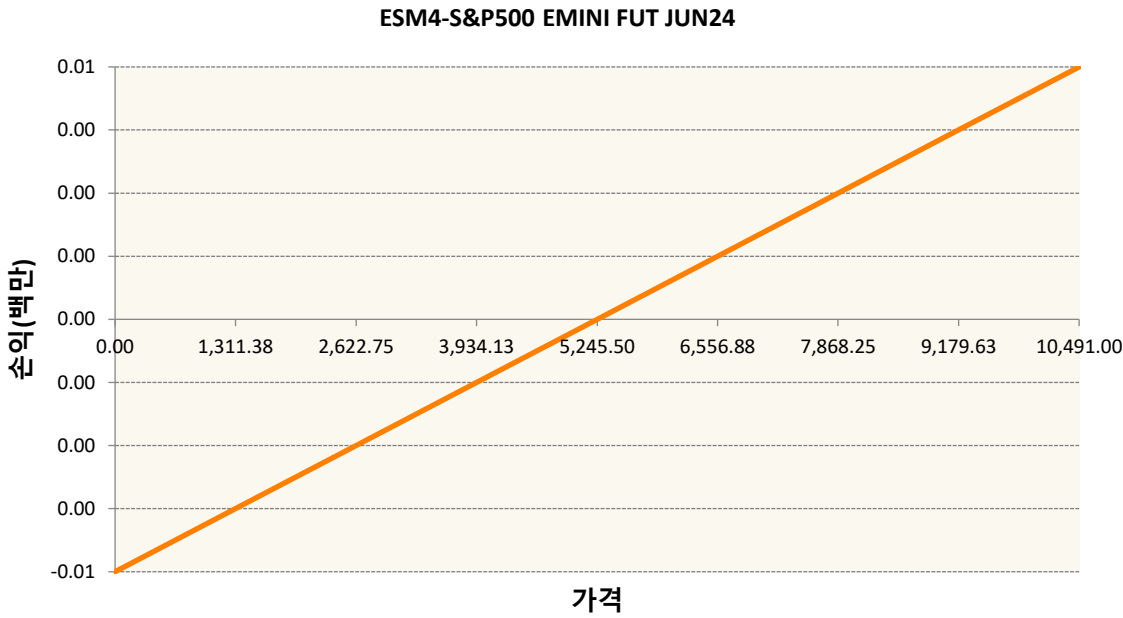
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

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	5,231	0	5,231	
누계	유가증권	선물	2,161	0	2,161	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESM4	S&P500 EMINI FUT JUN24	418
HWAM4	SP500 MIC EMIN FUT Jun24	173

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	381

공시일	2024-05-16
기준일	2024-05-14

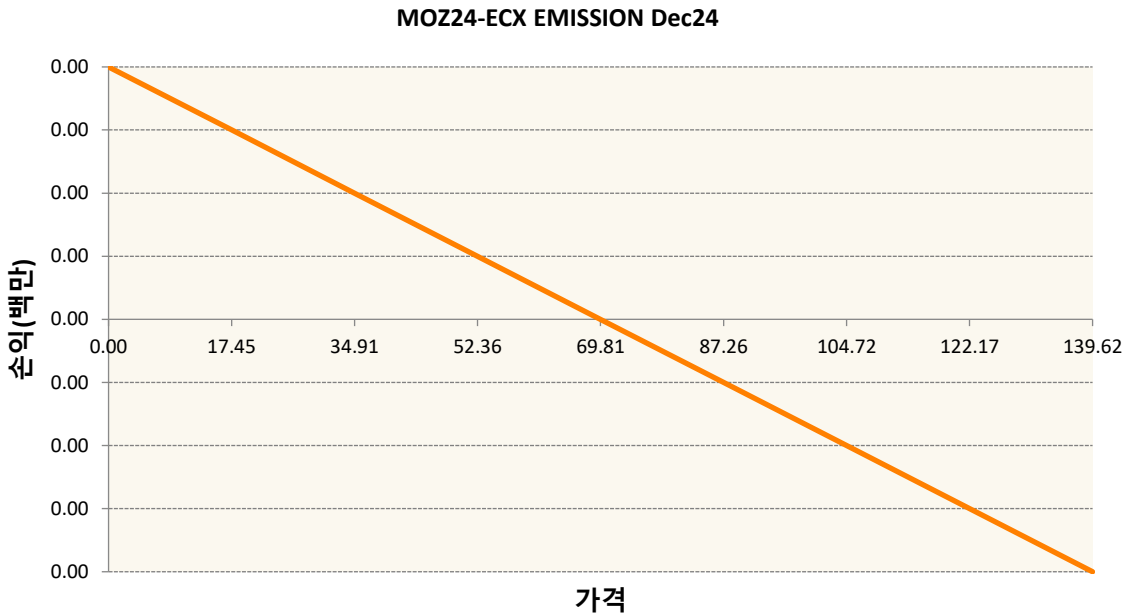
SOL유럽탄소배출권선물인버스ICE특별자산상

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	4,821	-4,821	
누계	지수	스왑	331	0	331	장외
누계	통화	선도	0	1,452	-1,452	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213E4W KRW/EUR 31-05-24E	9
FXW213E4W KRW/EUR 31-05-24E	107
MOZ24 ECX EMISSION Dec24	386
SWICEUACN ICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX	4

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

(단위:백만원)

776

공시일	2024-05-16
기준일	2024-05-14

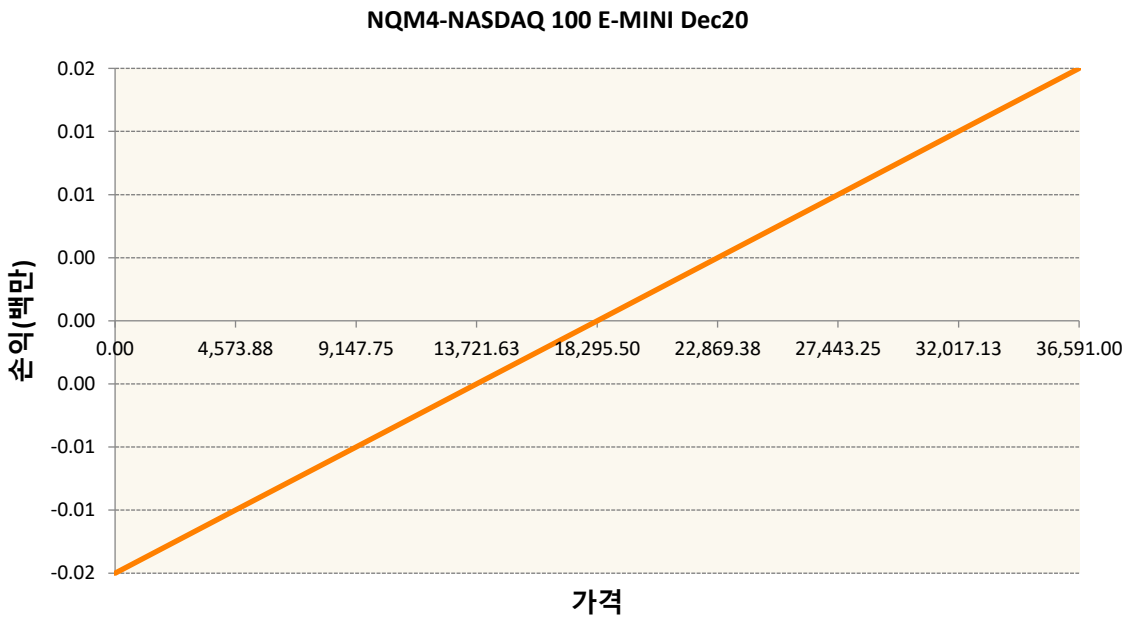
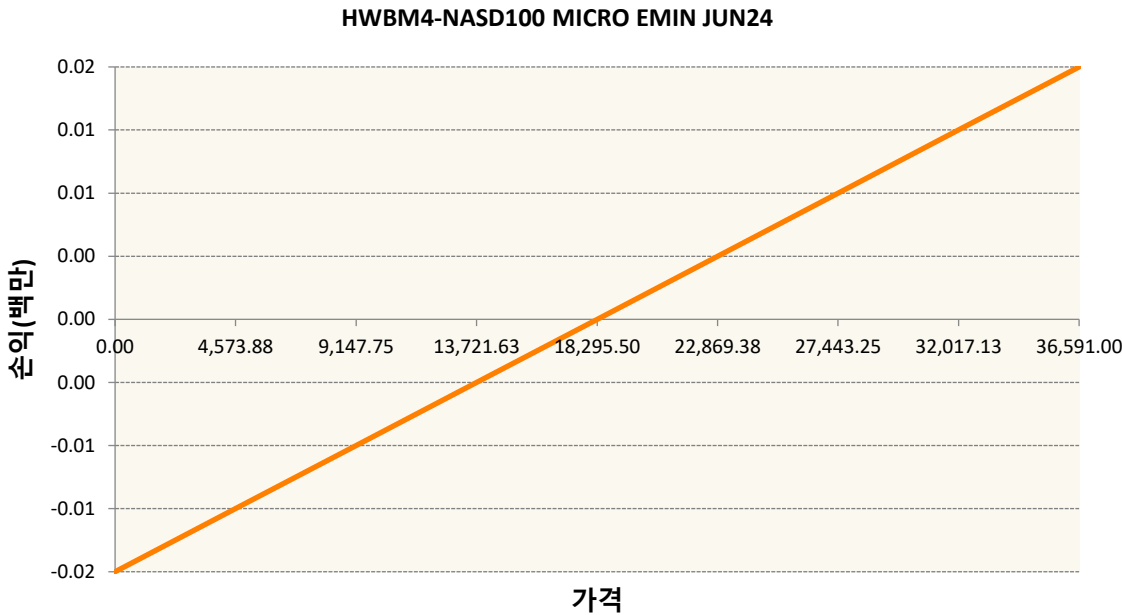
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

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	2,417	0	2,417	
누계	유가증권	선물	2,283	0	2,283	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
HWBM4	NASD100 MICRO EMIN JUN24		183
NQM4	NASDAQ 100 E-MINI Dec20		193

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)			(단위:백만원)
			289

공시일	2024-05-16
기준일	2024-05-14

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	441
SWKEDI0000 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	950
SWKEDI0000 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	8,838
SWKEDI0000 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	1,992

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

(단위:백만원)

7,673

공시일	2024-05-16
기준일	2024-05-14

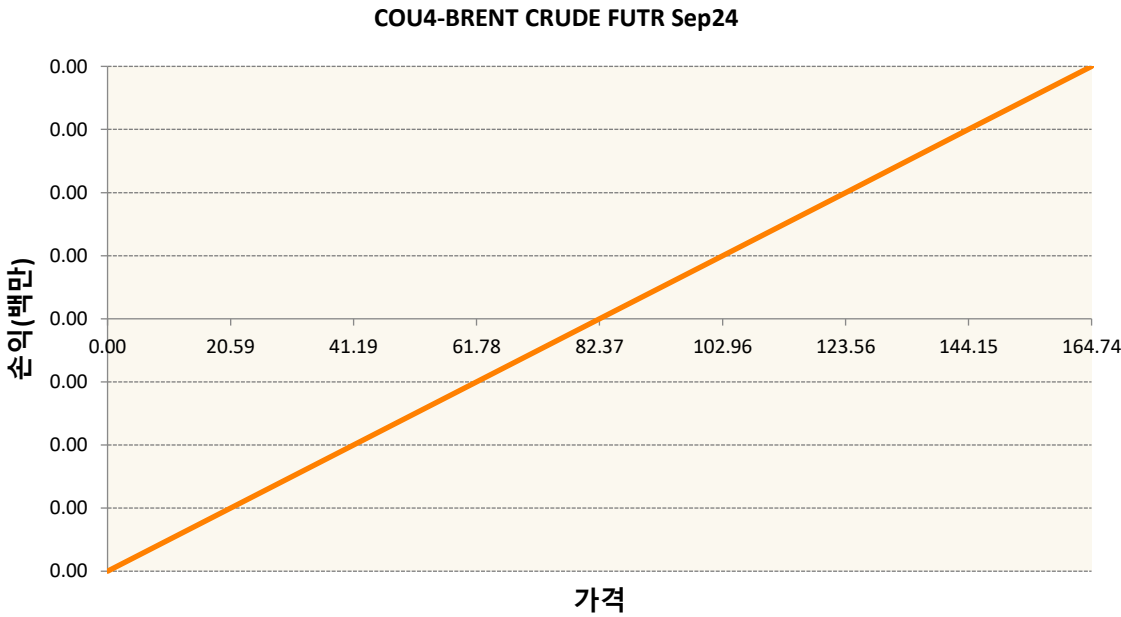
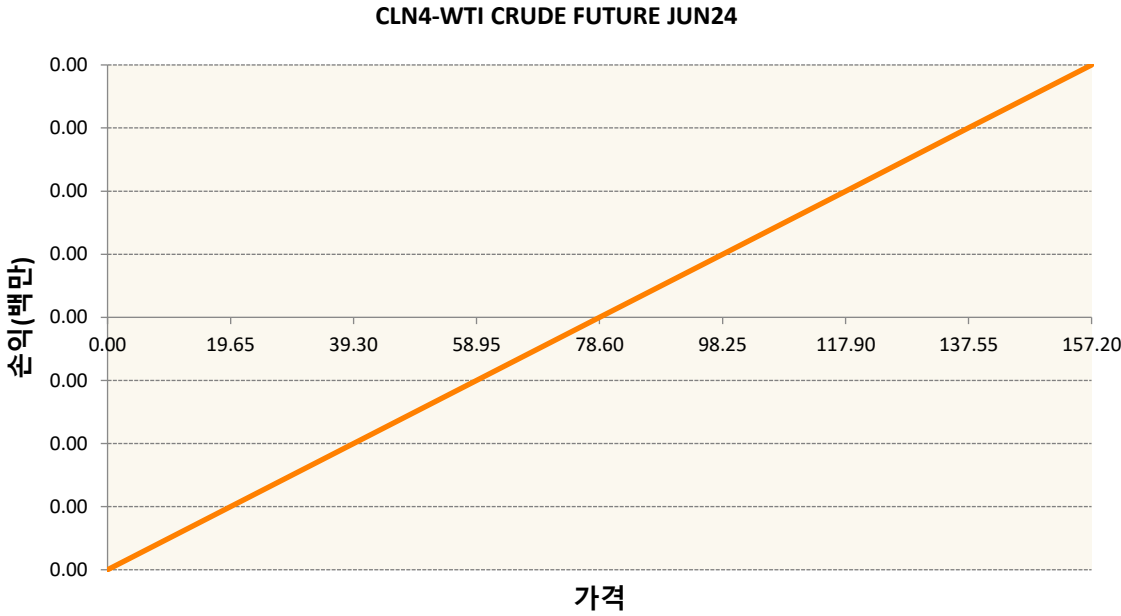
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

1. 계약금액

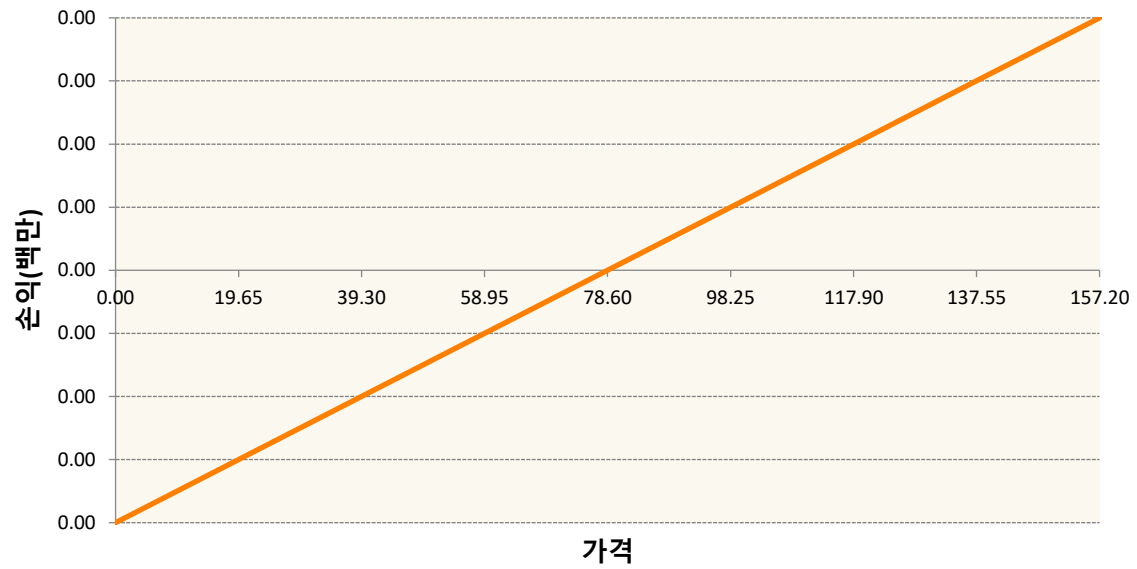
(단위:백만원)

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	1,128	0	1,128	
누계	통화	선물	0	192	-192	장내

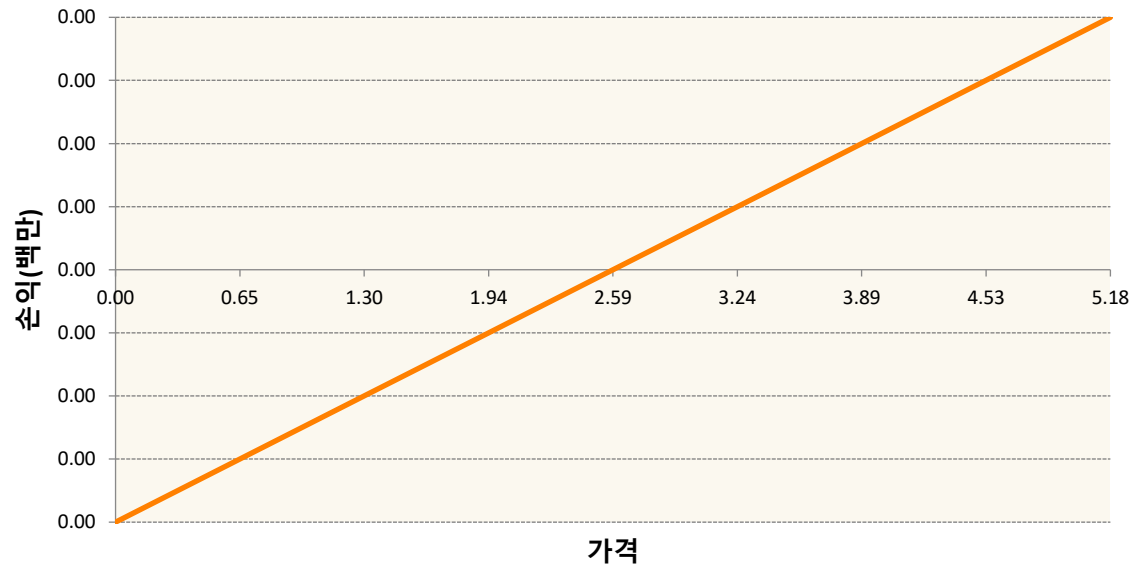
2. 만기시점의 손익구조



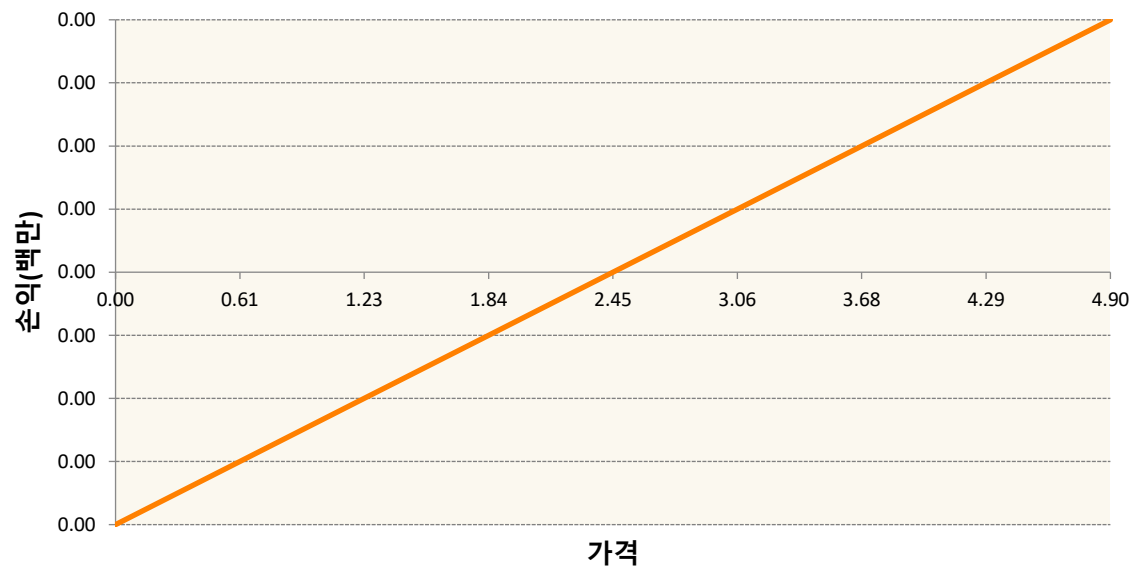
ECN4-E-mini Crude Oil Jul24



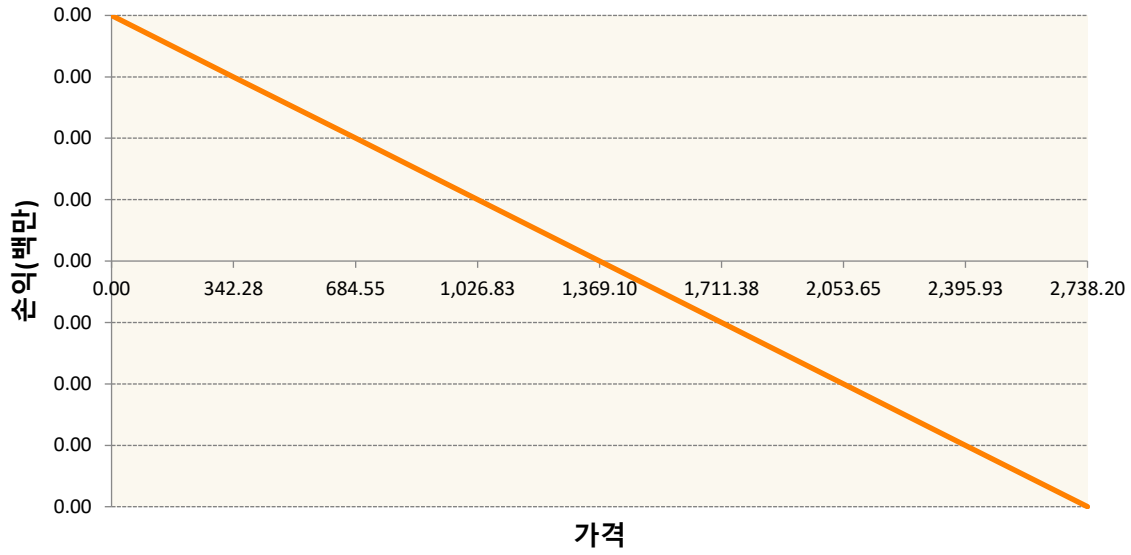
EON4-E-MINI NATURAL GAS Jul24



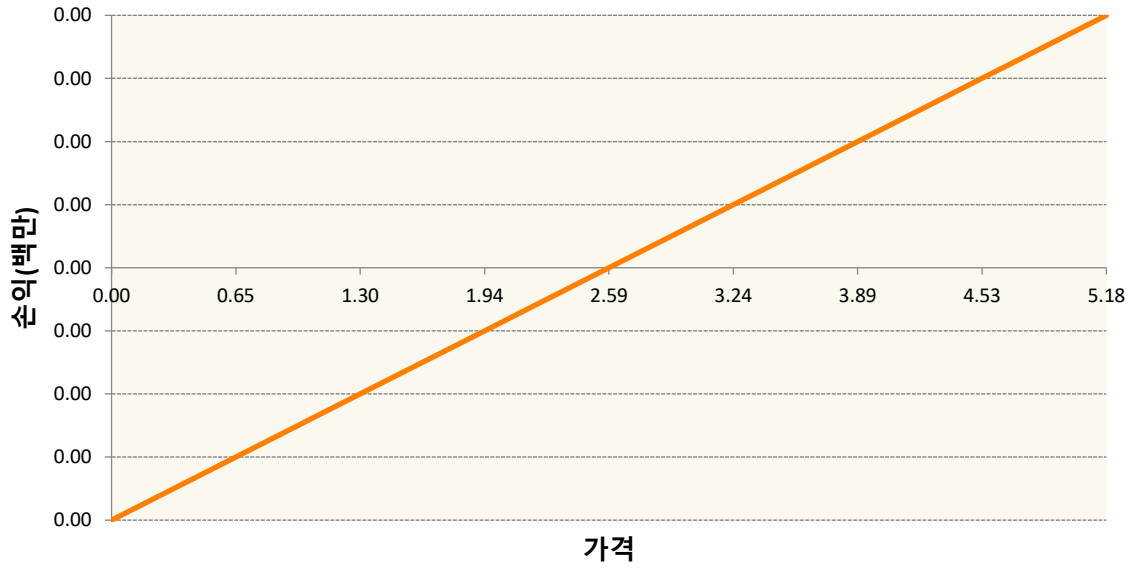
HON4-NY Harb ULSD Fut Jul24



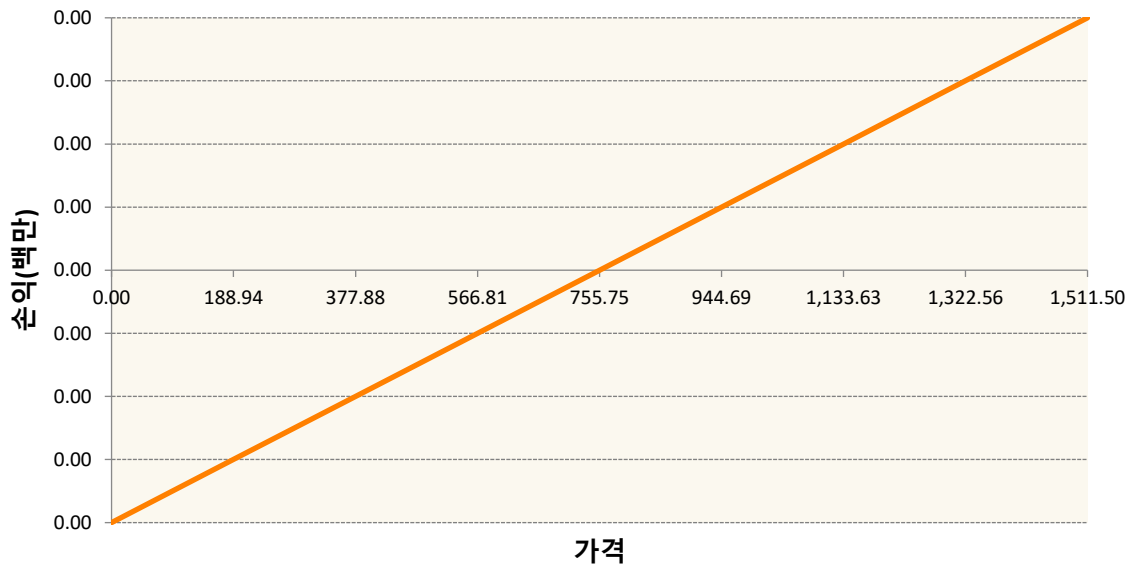
KR4175V50007-2024-05 달러선물

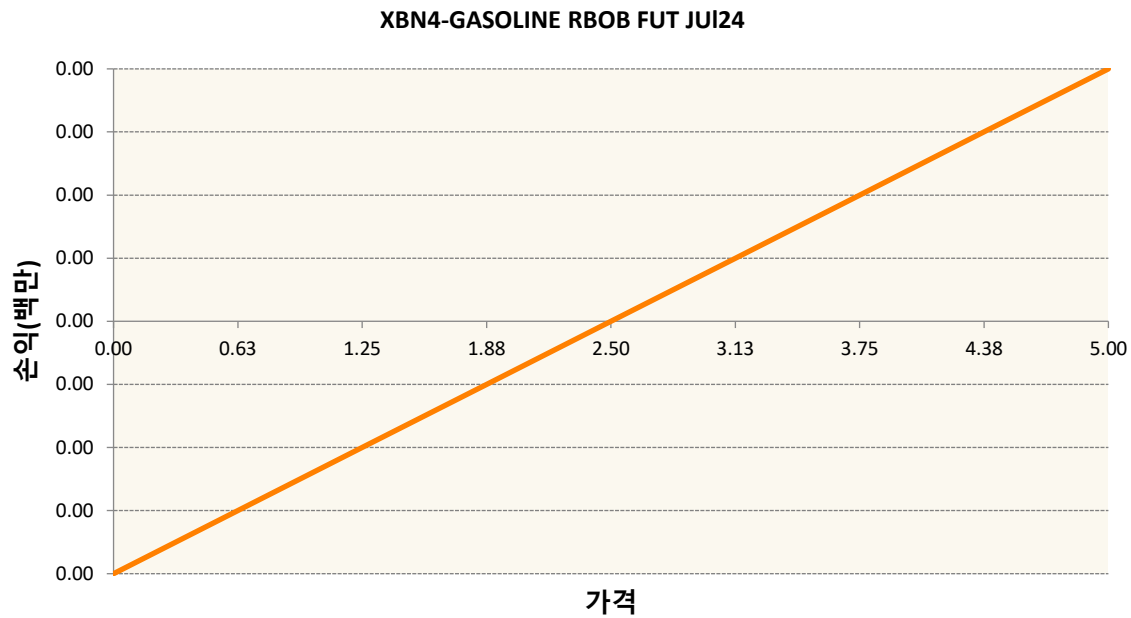


NGN24-NATURAL GAS FUTR JUL24



QSN4-Low Su Gasoil G JUL24





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
CLN4	WTI CRUDE FUTURE JUN24	9
COU4	BRENT CRUDE FUTR Sep24	27
ECN4	E-mini Crude Oil JUL24	9
EON4	E-MINI NATURAL GAS JUL24	1
HON4	NY Harb ULSD Fut Jul24	11
KR4175V500 2024-05 달러선물		15
NGN24	NATURAL GAS FUTR JUL24	14
QSN4	Low Su Gasoil G JUL24	8
XBN4	GASOLINE RBOB FUT JUL24	11

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	191