

공시일	2024-05-20
기준일	2024-05-17

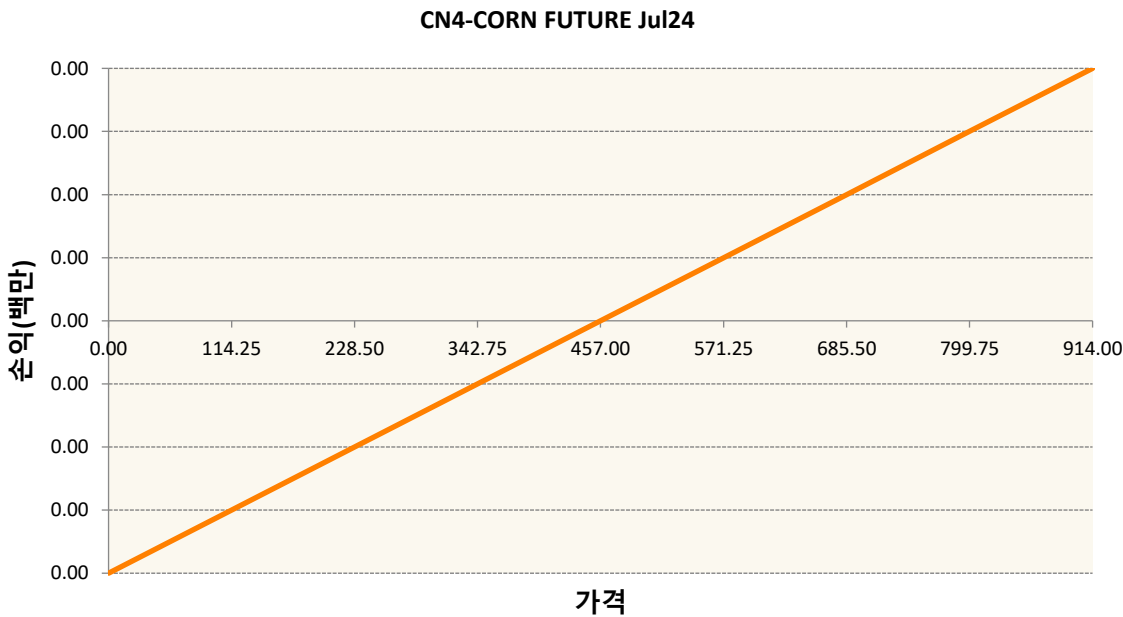
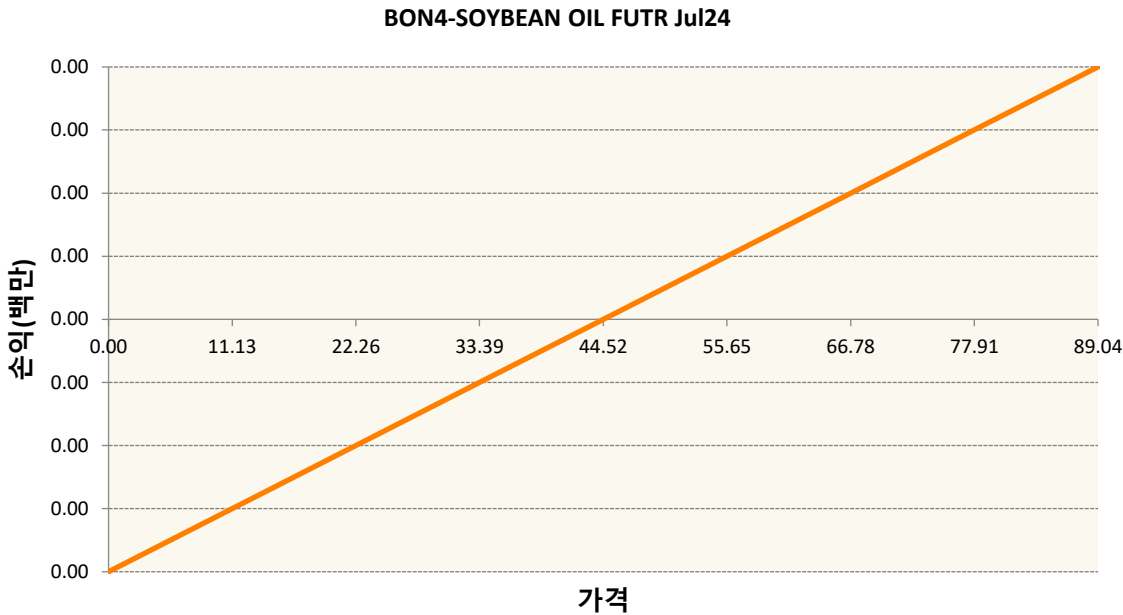
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

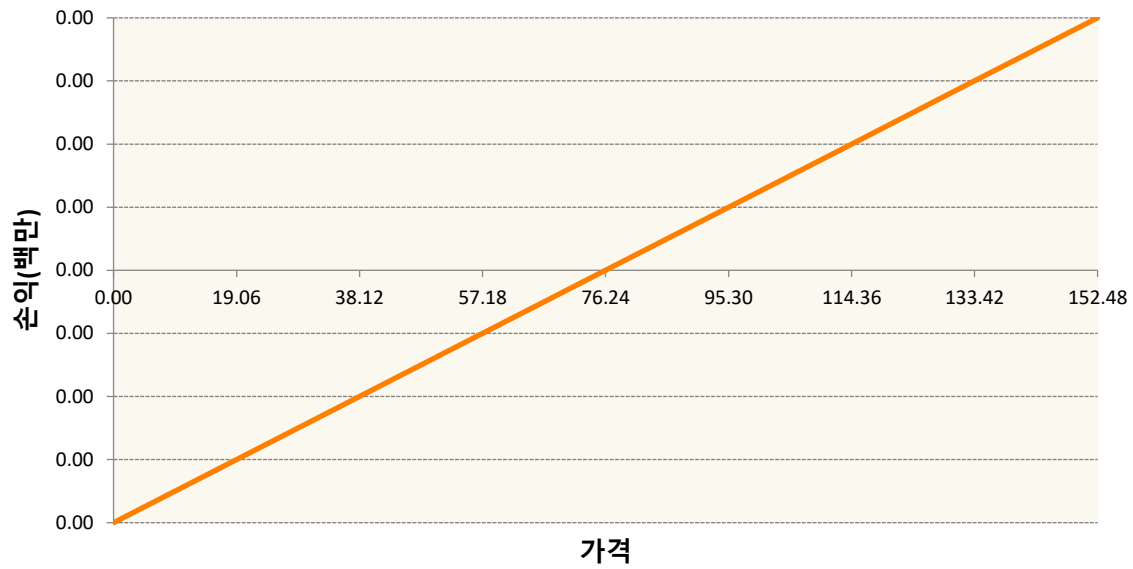
(단위:USD 백만)

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	4,346	0	4,346	
누계	통화	선물	0	541	-541	장내

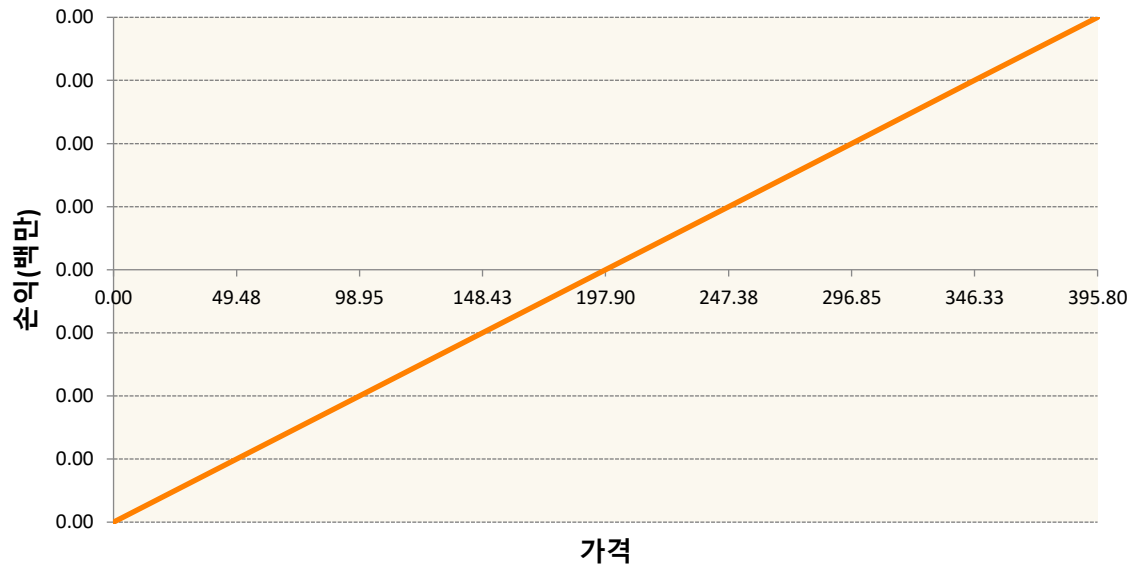
2. 만기시점의 손익구조



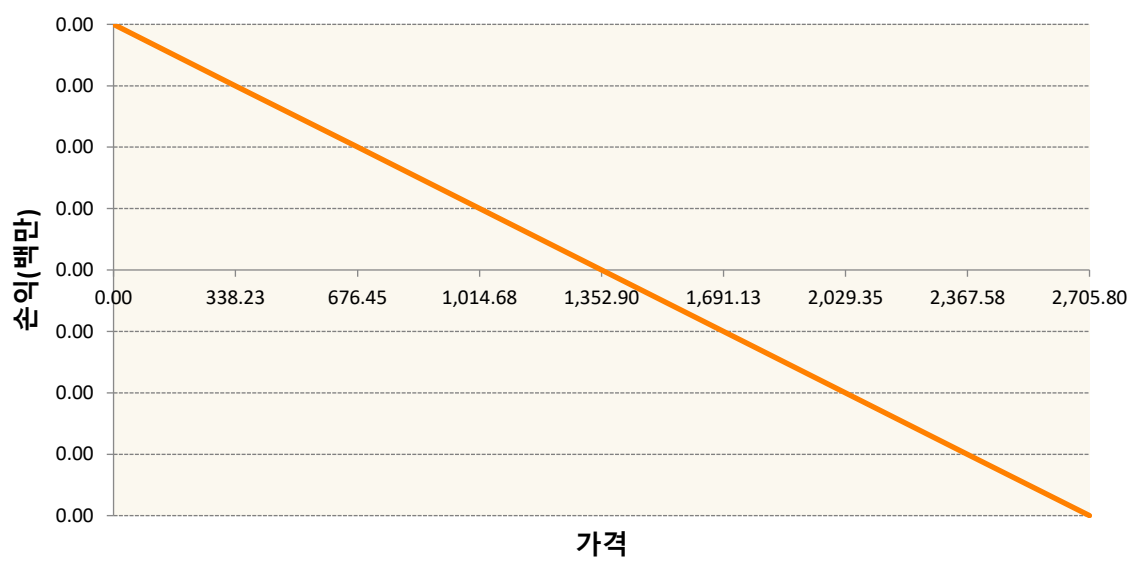
CTN4-COTTON NO.2 FUTR Jul24



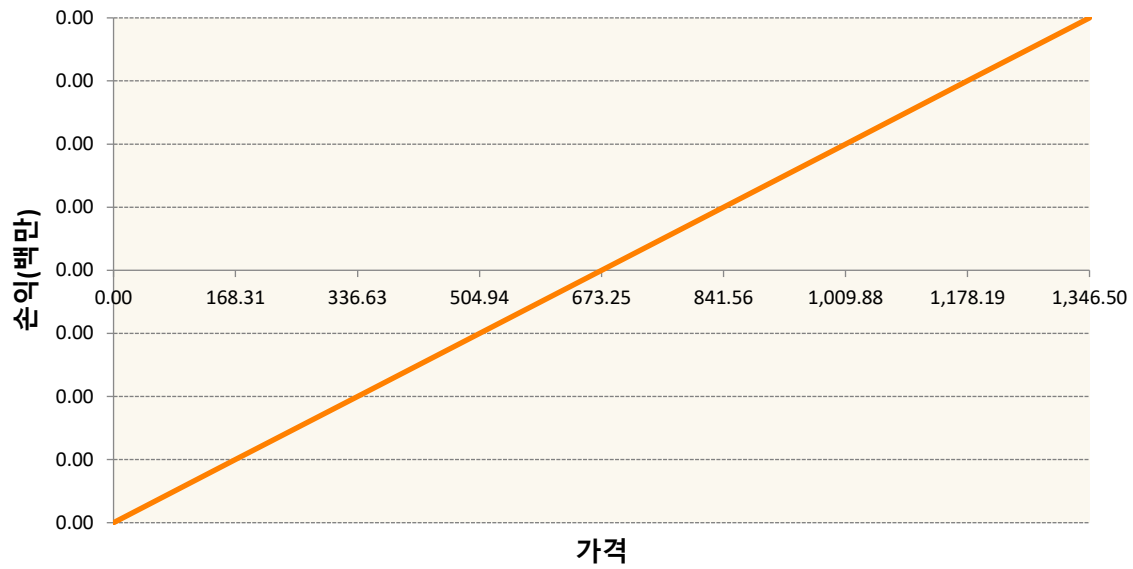
KCN4-COFFEE 'C' FUTURE Jul24



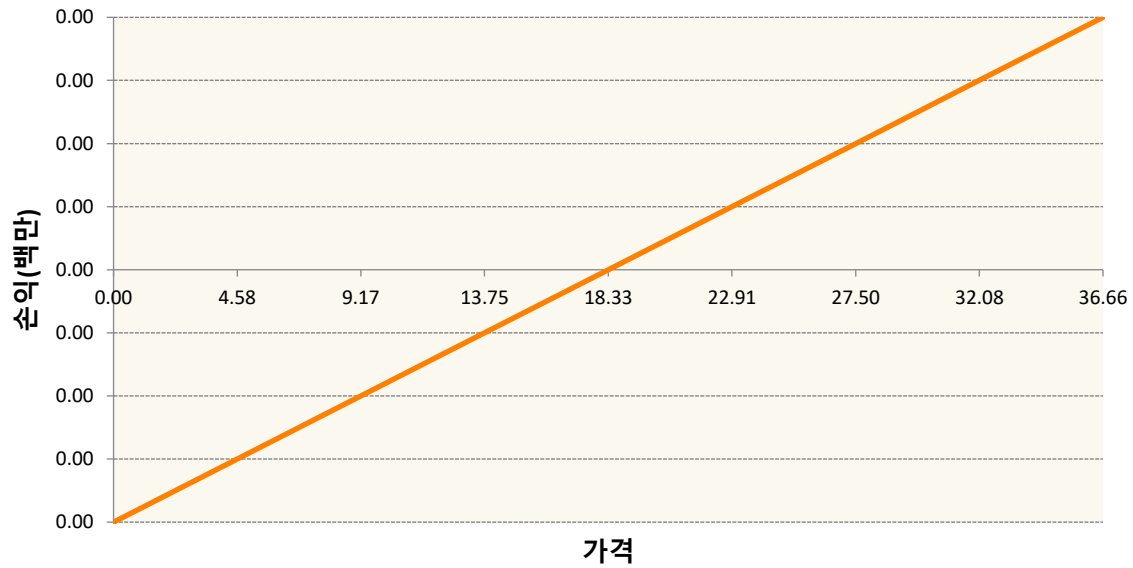
KR4175V60006-2024-06 달러선물



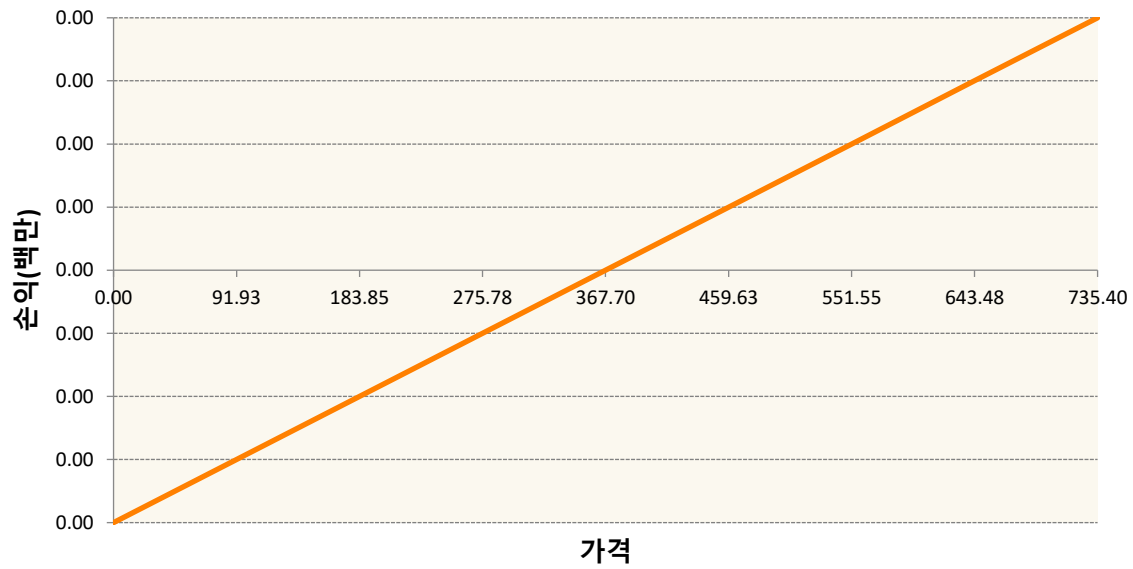
KWN4-KC HRW WHEAT FUT Jul24

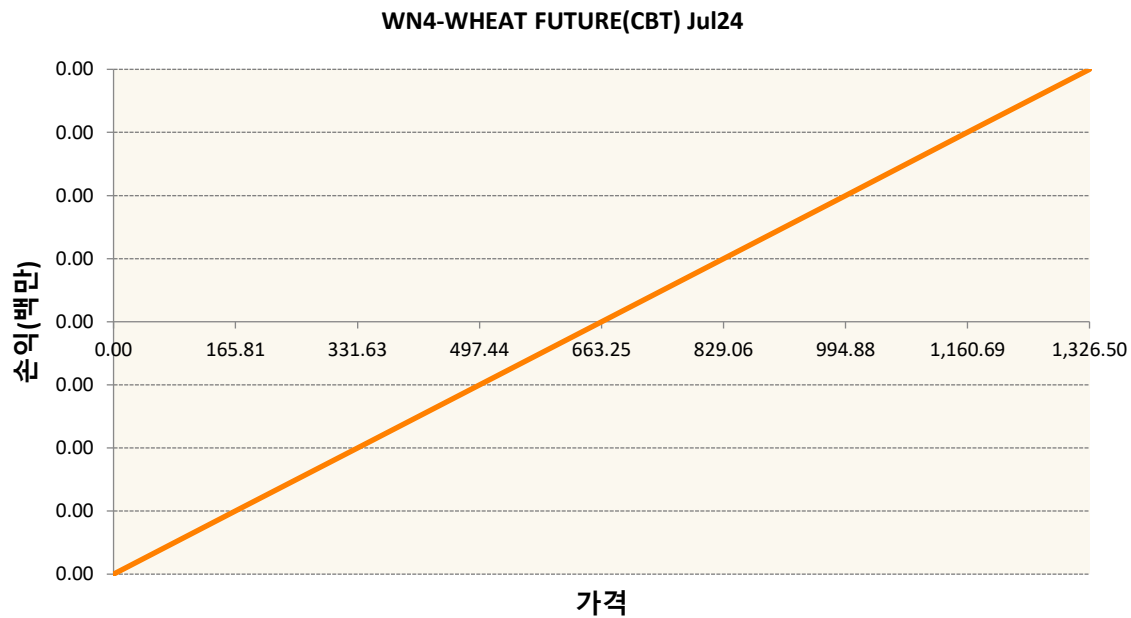
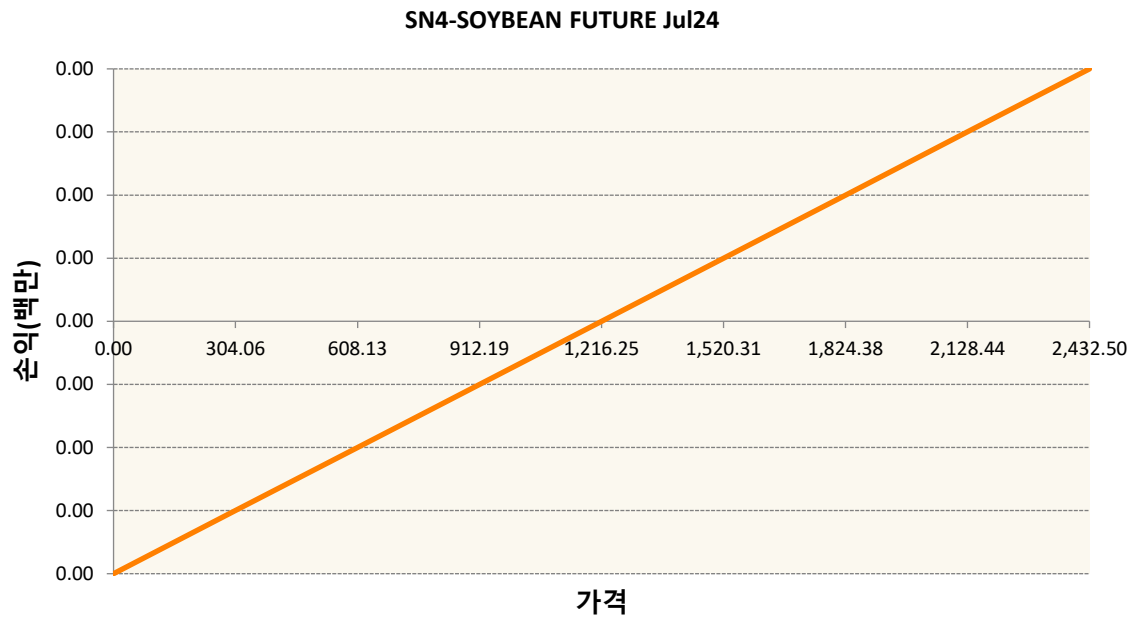


SBN4-Sugar #11 (WORLD) Jul24



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	2024-05-20
기준일	2024-05-17

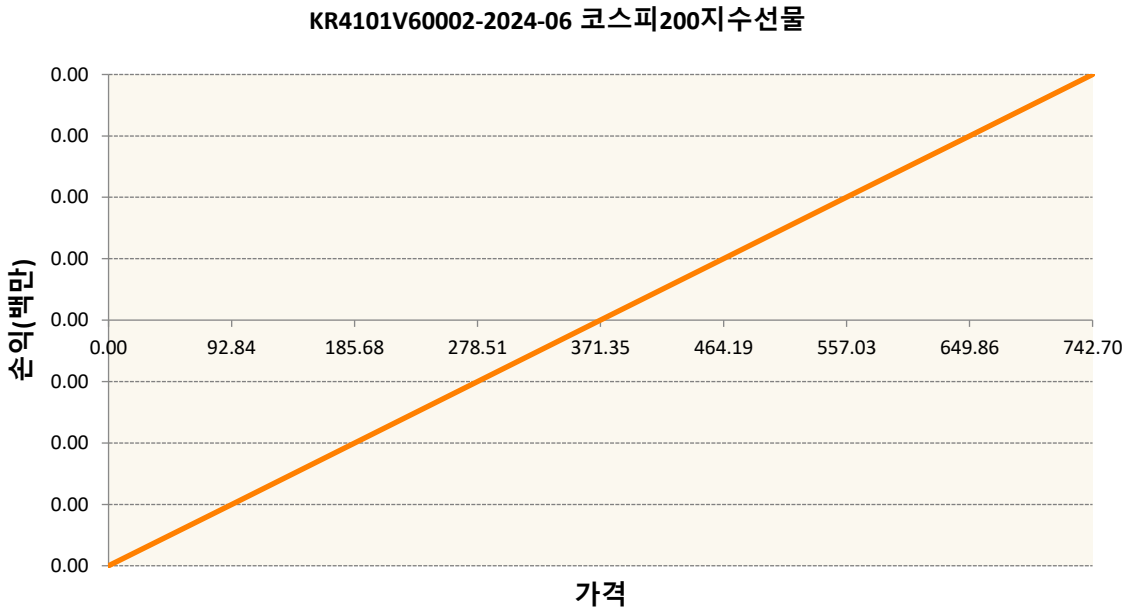
스마트인덱스모

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	1,485	0	1,485	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	2024-05-20
기준일	2024-05-17

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	271
-----------------------------	-----

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

328

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2024-05-20
기준일	2024-05-17

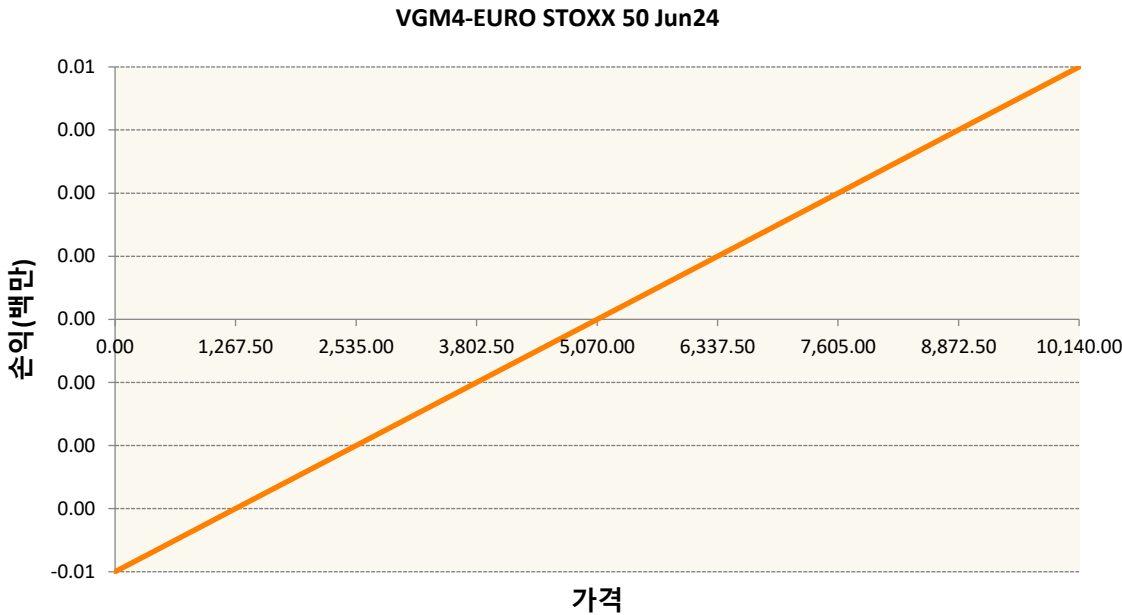
유로인덱스모(주식-파생형)

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	946	0	946	
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	76

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

(단위:백만원)

61

공시일	2024-05-20
기준일	2024-05-17

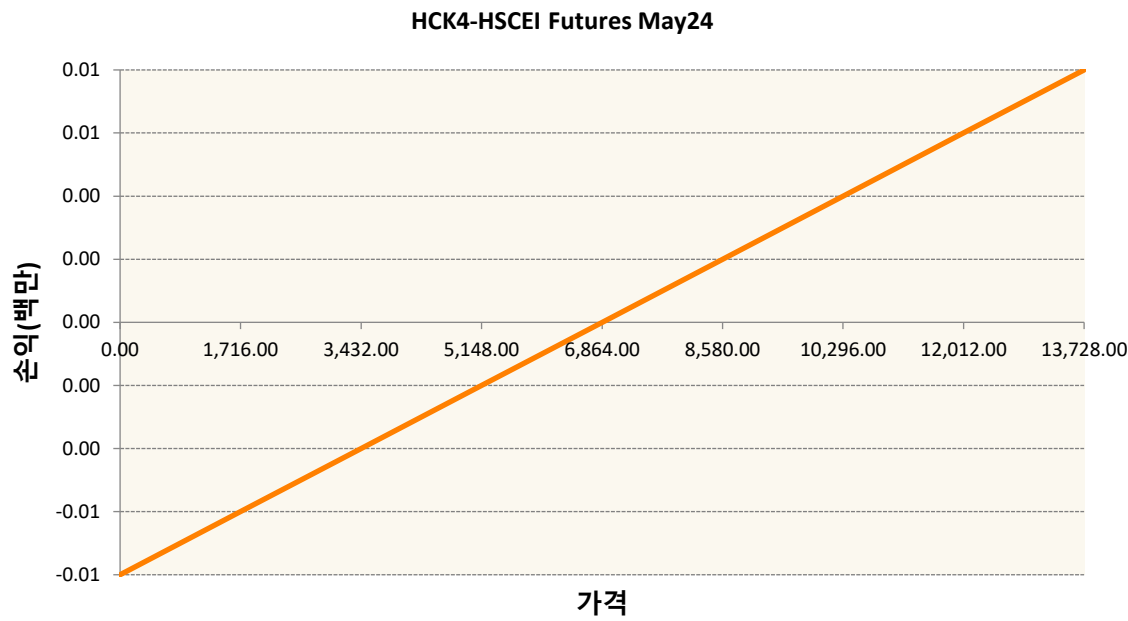
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,324	0	1,324	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCK4	HSCEI Futures May24	106
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

133

공시일	2024-05-20
기준일	2024-05-17

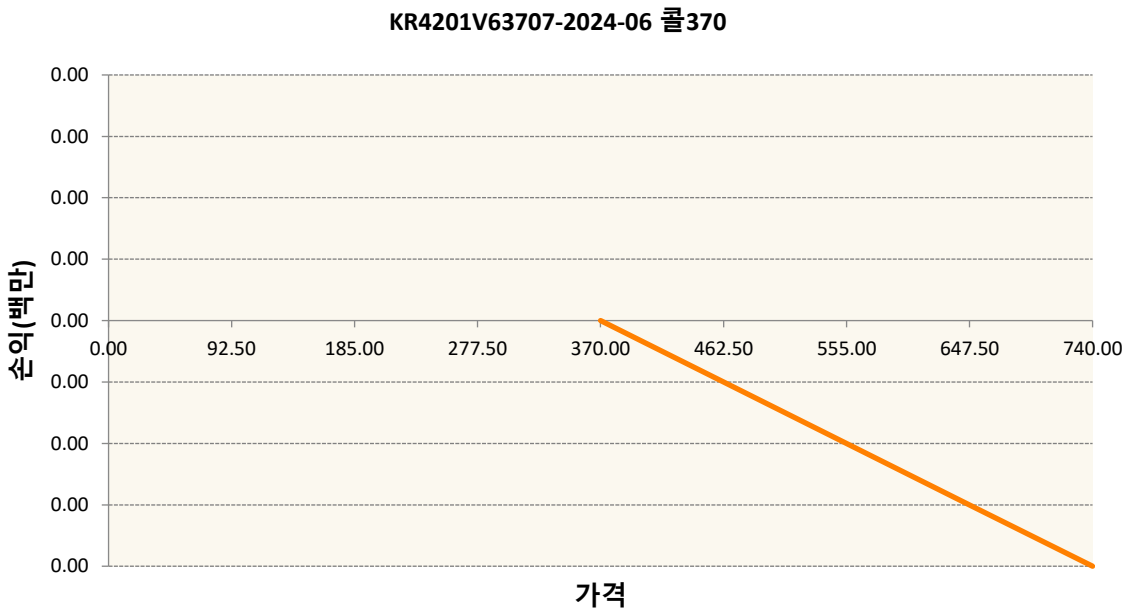
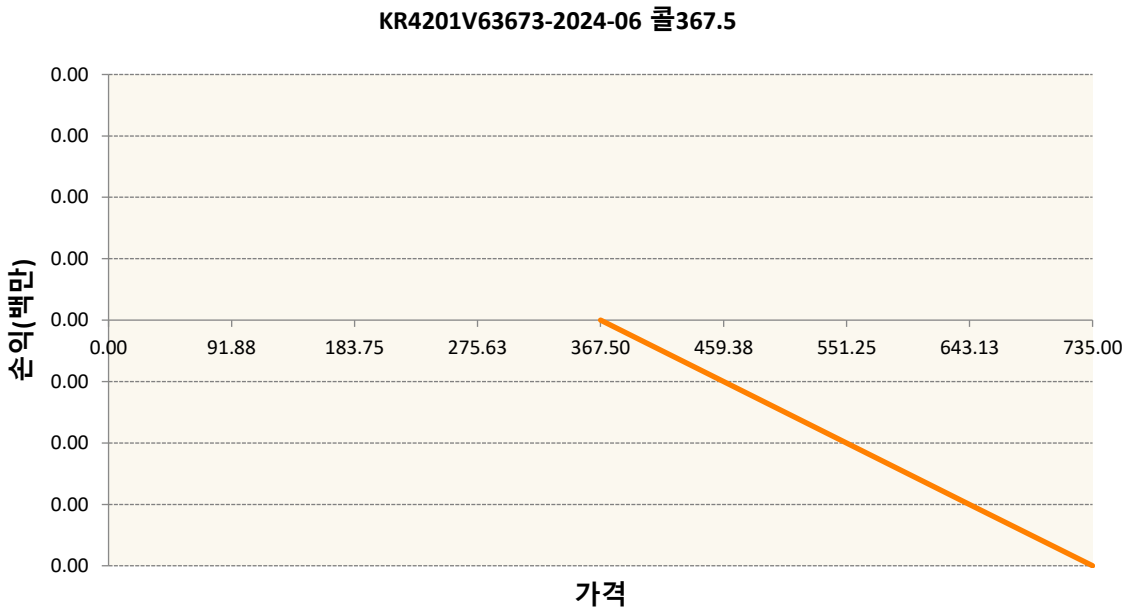
커버드콜모(주식혼합-파생형)

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	46,841	-46,841	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		938	
기초자산의 변동성										
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%			
-8.00%	459	444	428	409	389	367	344			
-5.33%	403	379	353	325	297	269	239			
-2.67%	290	257	225	191	158	125	91			
0%	103	69	34	0	-34	-69	-104			
2.67%	-158	-187	-217	-248	-279	-311	-343			
5.33%	-478	-498	-520	-544	-569	-596	-624			
8.00%	-835	-846	-860	-877	-896	-916	-938			
KR4201V63707							2024-06 콜370		1,496	
기초자산의 변동성										

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	682	662	638	611	580	547	511
-5.33%	608	571	532	490	446	401	355
-2.67%	448	397	344	291	237	183	129
0%	172	115	57	0	-57	-115	-172
2.67%	-228	-279	-331	-385	-439	-493	-548
5.33%	-732	-769	-810	-853	-898	-945	-993
8.00%	-1,306	-1,329	-1,356	-1,386	-1,420	-1,457	-1,496
KR4301V63671 2024-06 풋367.5							444

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-431	-432	-433	-435	-437	-440	-444
-5.33%	-241	-245	-249	-255	-261	-267	-274
-2.67%	-77	-86	-95	-105	-114	-124	-133
0%	30	20	10	0	-10	-20	-31
2.67%	78	72	65	58	50	42	34
5.33%	91	89	86	83	79	74	69
8.00%	94	93	92	91	90	87	85

KR4301V63705 2024-06 풋370							58
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-57	-57	-57	-58	-58	-58	-58
-5.33%	-33	-33	-34	-35	-35	-36	-37
-2.67%	-12	-12	-14	-15	-16	-17	-18
0%	4	3	1	0	-1	-3	-4
2.67%	12	11	10	9	8	6	5
5.33%	14	14	13	13	12	11	11
8.00%	14	14	14	14	14	13	13

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

(단위:백만원)

2,861

공시일	2024-05-20
기준일	2024-05-17

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	1,588	0	1,588	

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	2024-05-20
기준일	2024-05-17

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	4,327	0	4,327	

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	2024-05-20
기준일	2024-05-17

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	15,129	0	15,129	
누계	통화	선도	0	14,951	-14,951	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213E2TC KRW/USD 31-05-24E	585
FXW213E3TC KRW/USD 28-06-24E	417
FXW213E4SC KRW/USD 31-07-24E	193
IE00BD8RGM75	

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

561

공시일	2024-05-20
기준일	2024-05-17

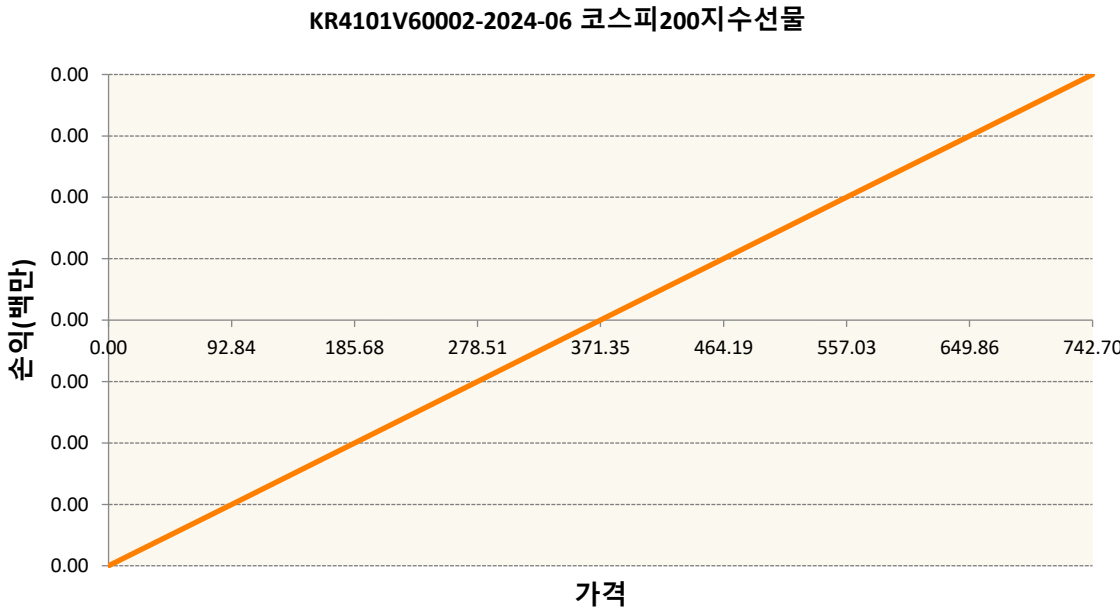
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

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	1,114	0	1,114	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	2024-05-20
기준일	2024-05-17

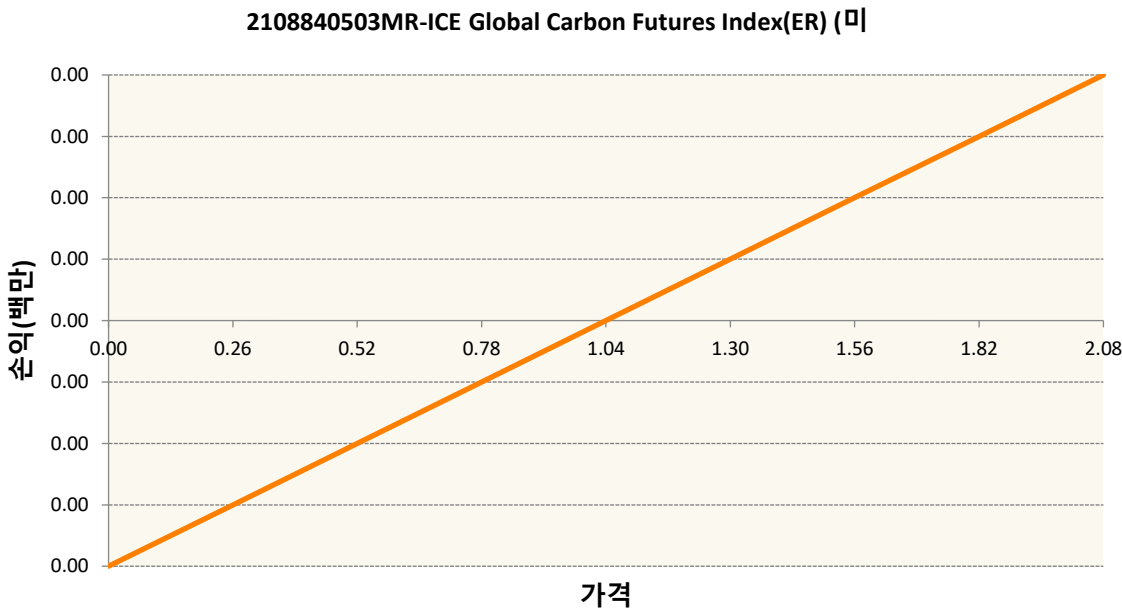
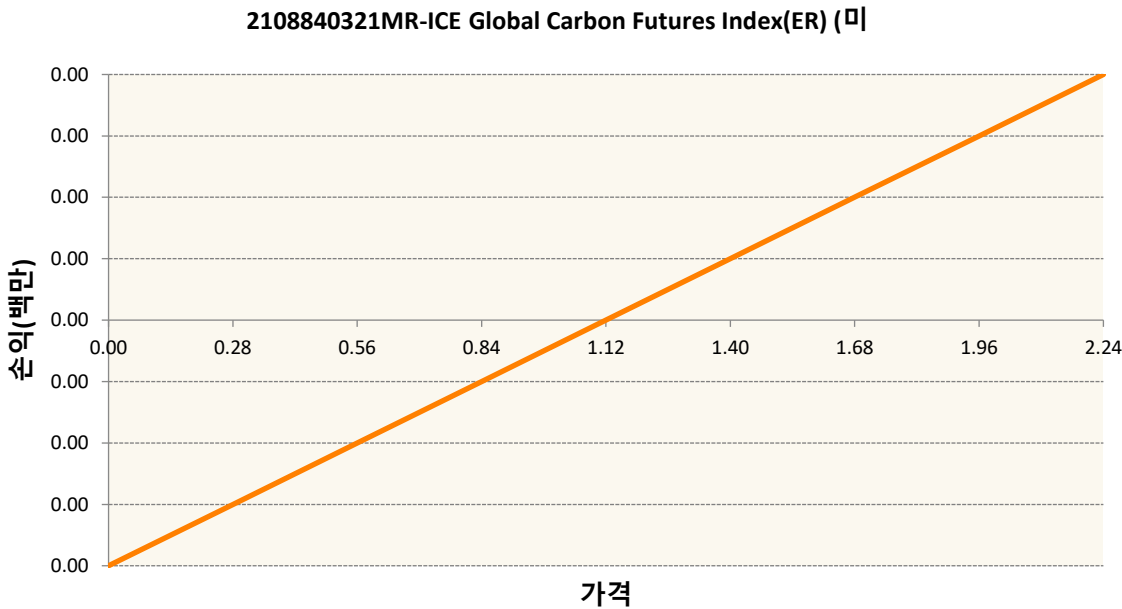
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

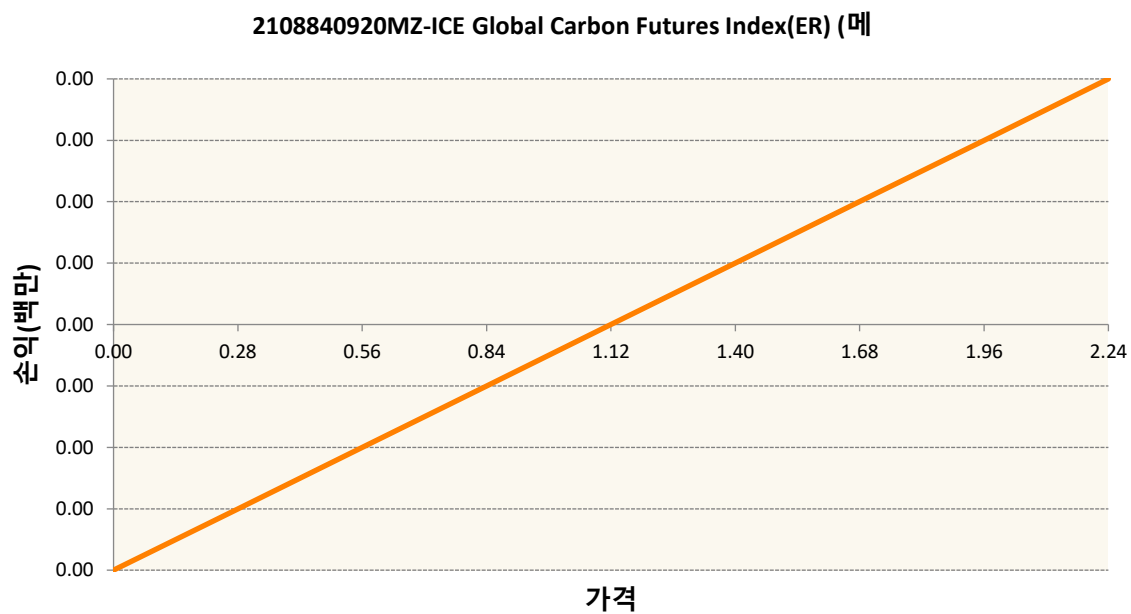
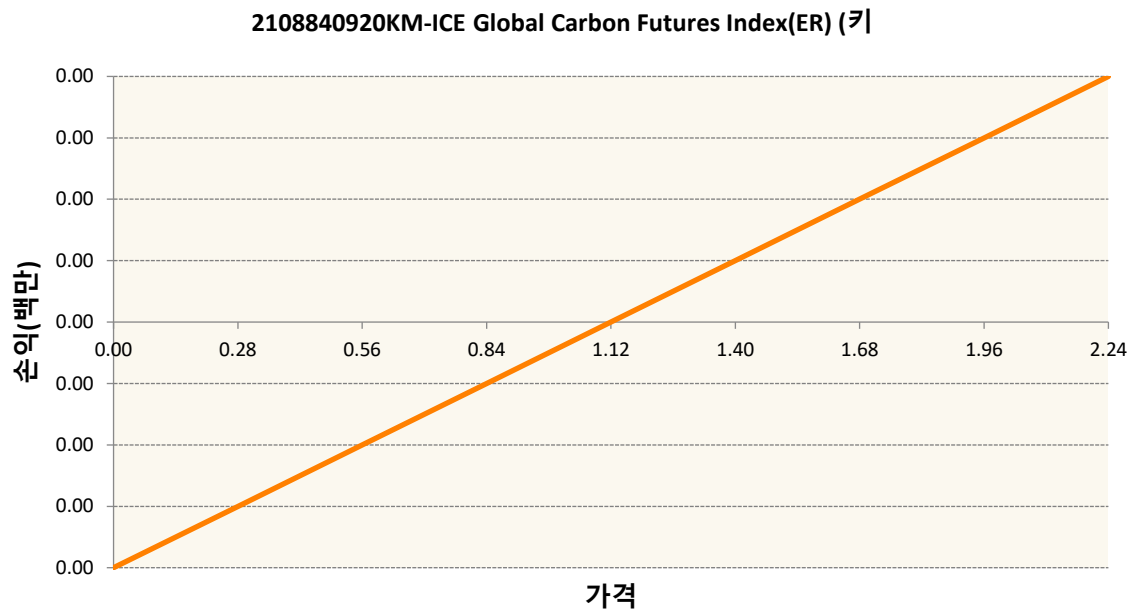
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	23,087	0	23,087	

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108840321IICE Global Carbon Futures Index(ER) (미)		486
2108840503IICE Global Carbon Futures Index(ER) (미)		194
2108840920IICE Global Carbon Futures Index(ER) (키)		971
2108840920IICE Global Carbon Futures Index(ER) (메)		194

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	2,169

공시일	2024-05-20
기준일	2024-05-17

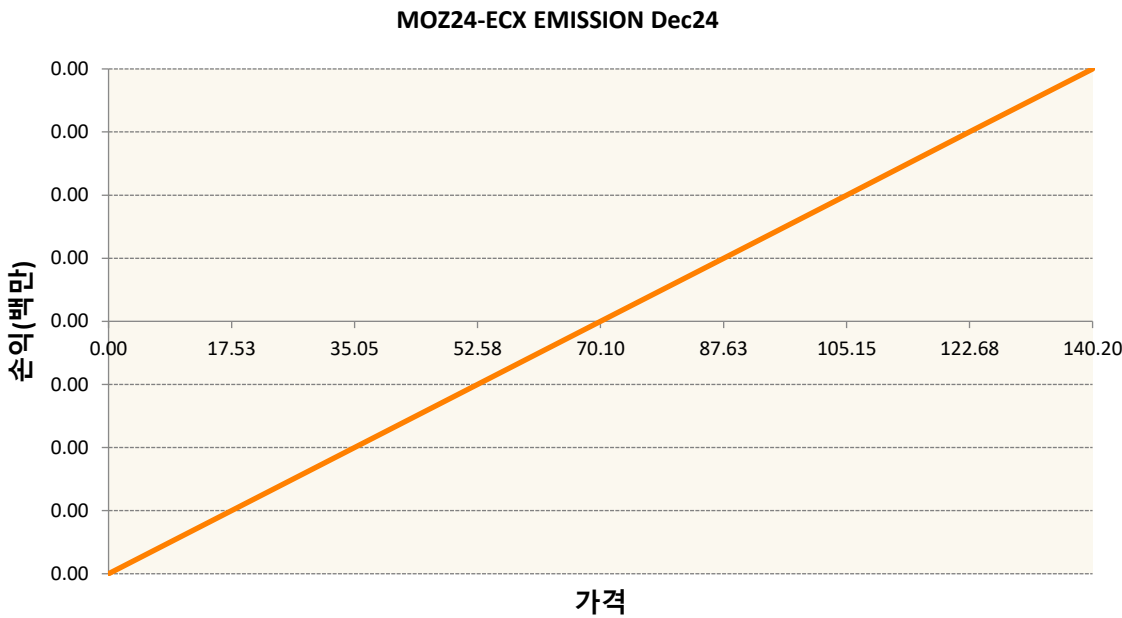
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	10,504	0	10,504	
누계	지수	스왑	331	0	331	장외
누계	통화	선도	0	2,675	-2,675	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213E4W KRW/EUR 31-05-24E	23
FXW213E4W KRW/EUR 31-05-24E	191
MOZ24 ECX EMISSION Dec24	840
SWICEUACN ICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX	4

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

(단위:백만원)

1,660

공시일	2024-05-20
기준일	2024-05-17

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)	13
SWCSI00000 신한CSI Index 230622 (메리츠)	13
SWCSI00000 신한CSI Index 230922 (키움)	9
SWCSI00000 신한CSI Index 231013 (NH)	9

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

(단위:백만원)

60

공시일	2024-05-20
기준일	2024-05-17

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)	12
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(NH)	10
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(메리츠)	14
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(키움)	3

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

(단위:백만원)

43

공시일	2024-05-20
기준일	2024-05-17

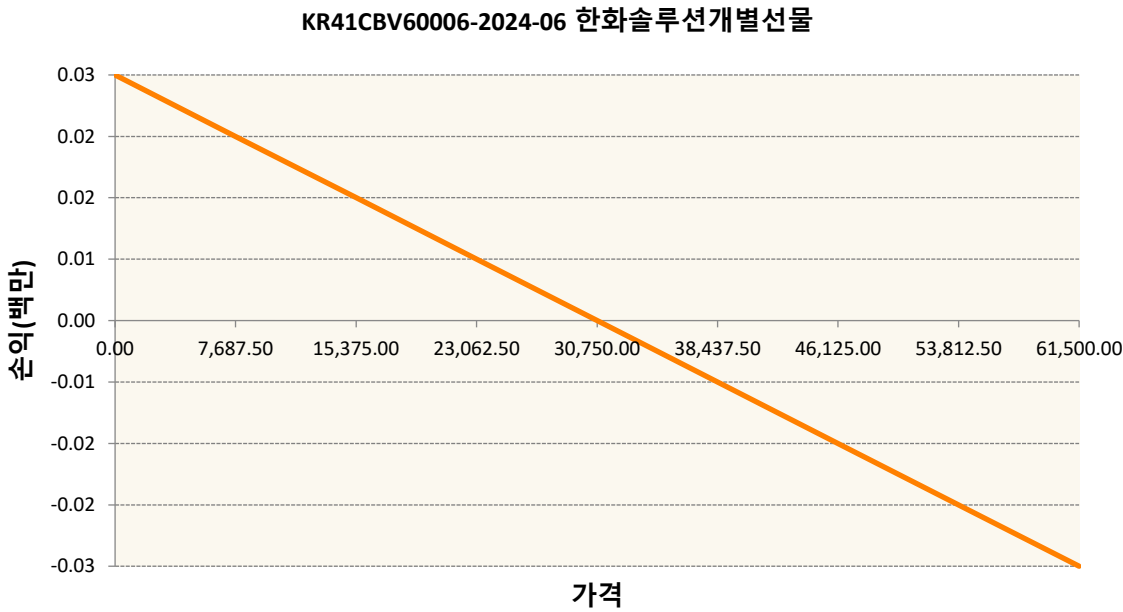
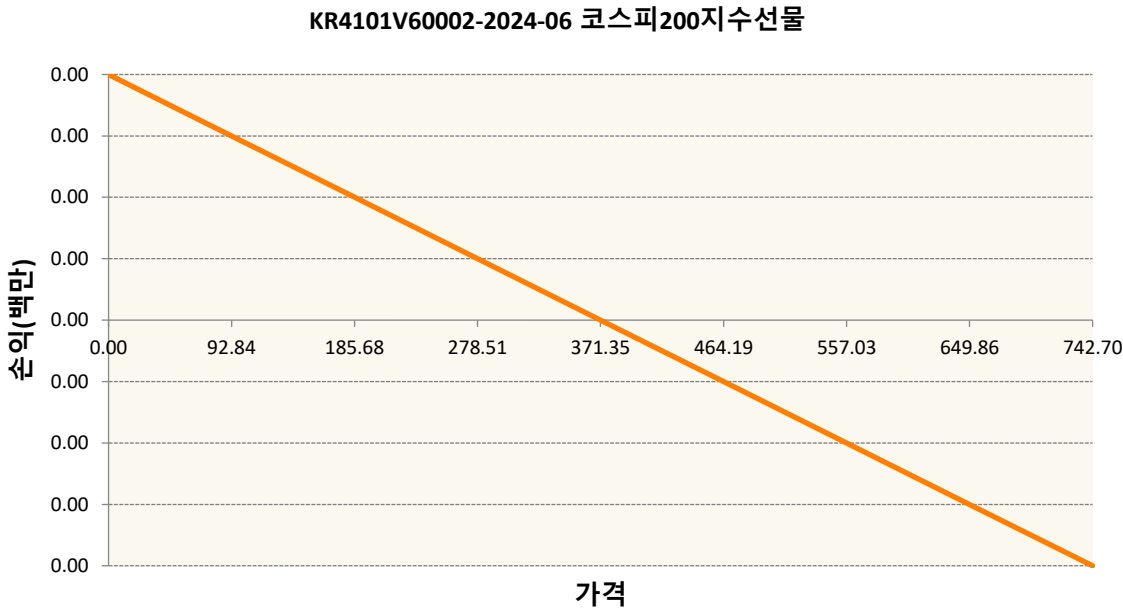
에퀴티알파일반사모혼합자산

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	381	-381	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
KR4101V600 2024-06 코스피200지수선물		30
KR41CBV600 2024-06 한화솔루션개별선물		1

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	31

공시일	2024-05-20
기준일	2024-05-17

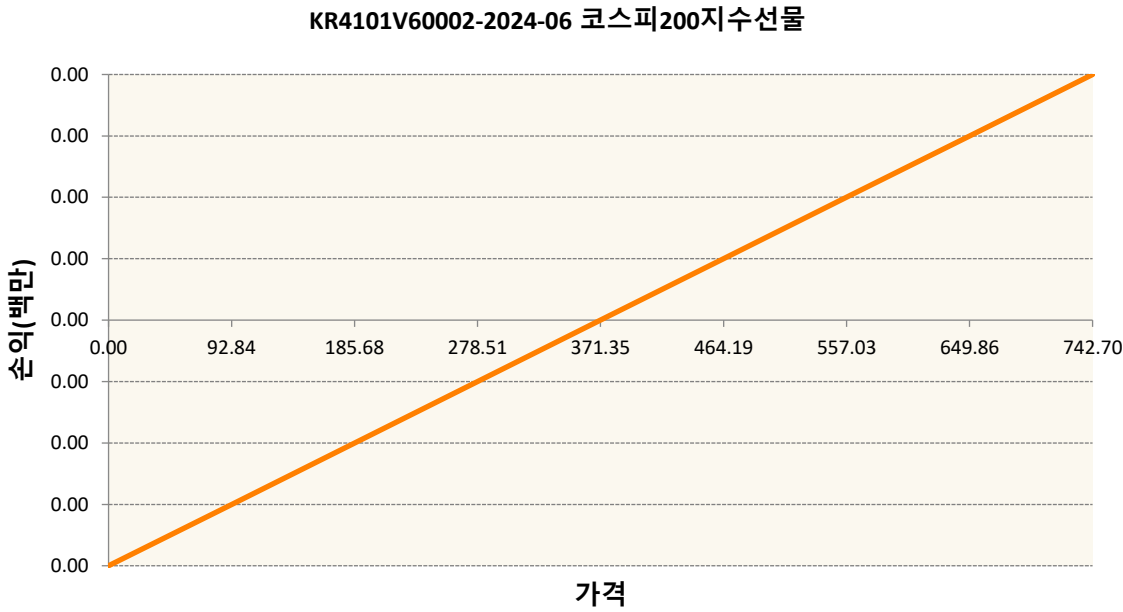
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

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	9,748	0	9,748	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101V60002		2024-06 코스피200지수선물					778
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-778	-778	-778	-778	-778	-778	-778
-5.33%	-519	-519	-519	-519	-519	-519	-519
-2.67%	-259	-259	-259	-259	-259	-259	-259
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	259	259	259	259	259	259	259
5.33%	519	519	519	519	519	519	519
8.00%	778	778	778	778	778	778	778

공시일	2024-05-20
기준일	2024-05-17

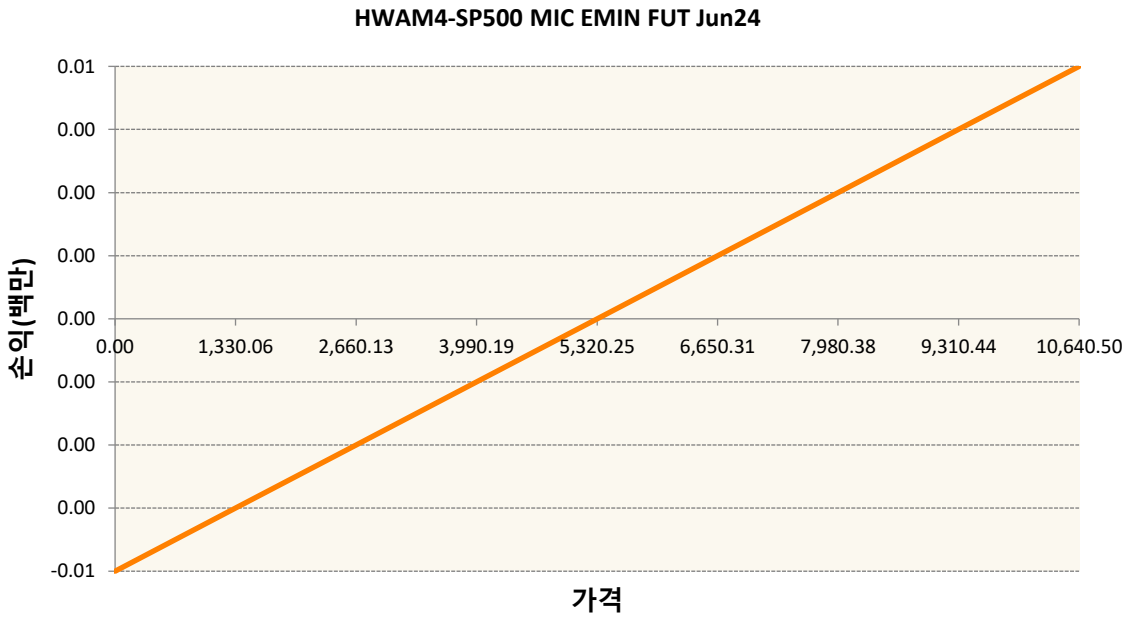
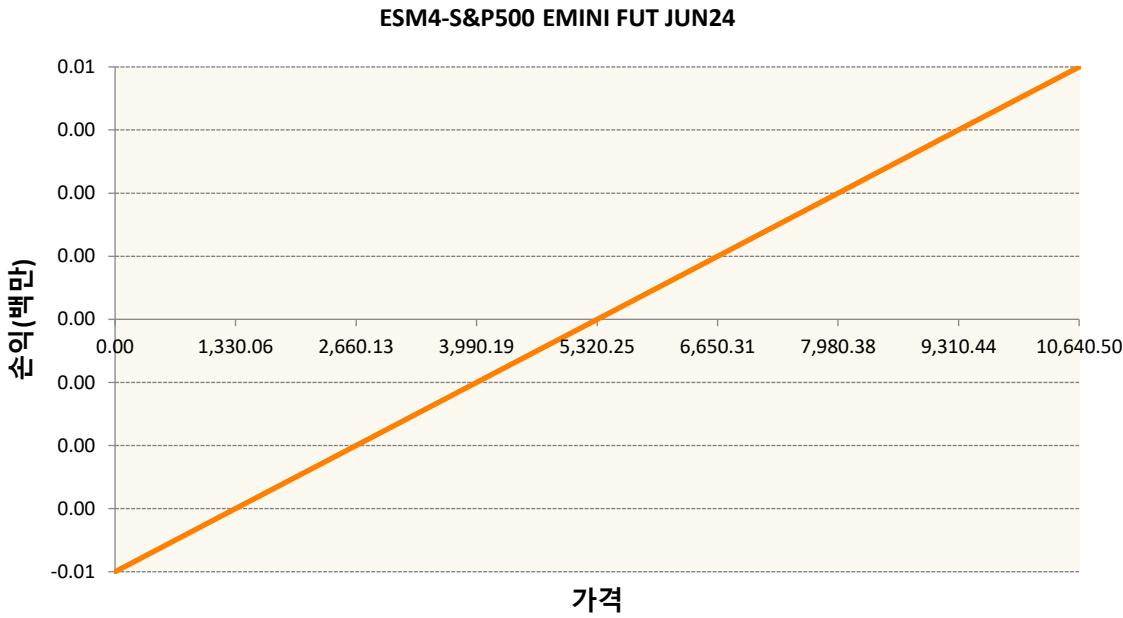
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

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	5,307	0	5,307	
누계	유가증권	선물	2,443	0	2,443	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESM4	S&P500 EMINI FUT JUN24	425
HWAM4	SP500 MIC EMIN FUT Jun24	195

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	399

공시일	2024-05-20
기준일	2024-05-17

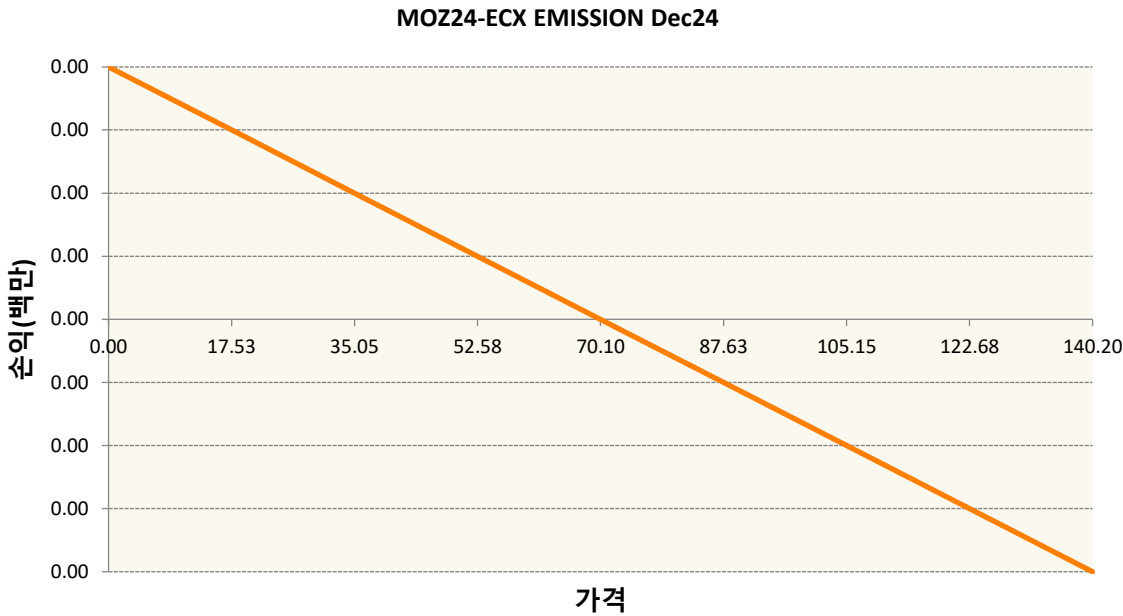
SOL유럽탄소배출권선물인버스ICE특별자산상

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	4,831	-4,831	
누계	지수	스왑	331	0	331	장외
누계	통화	선도	0	1,447	-1,447	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)

777

공시일	2024-05-20
기준일	2024-05-17

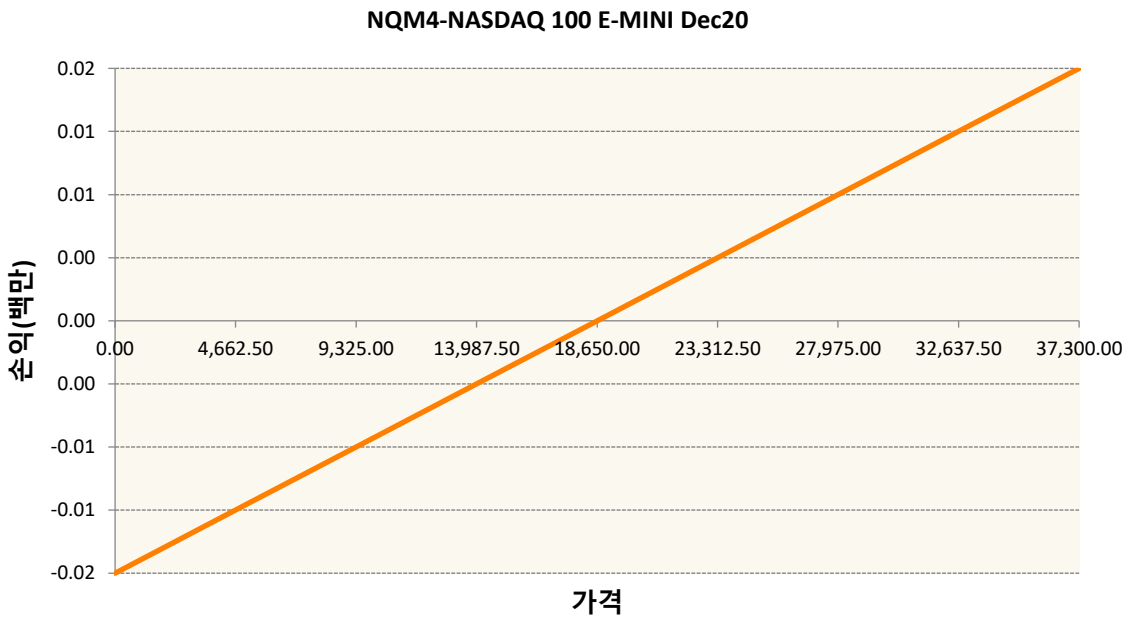
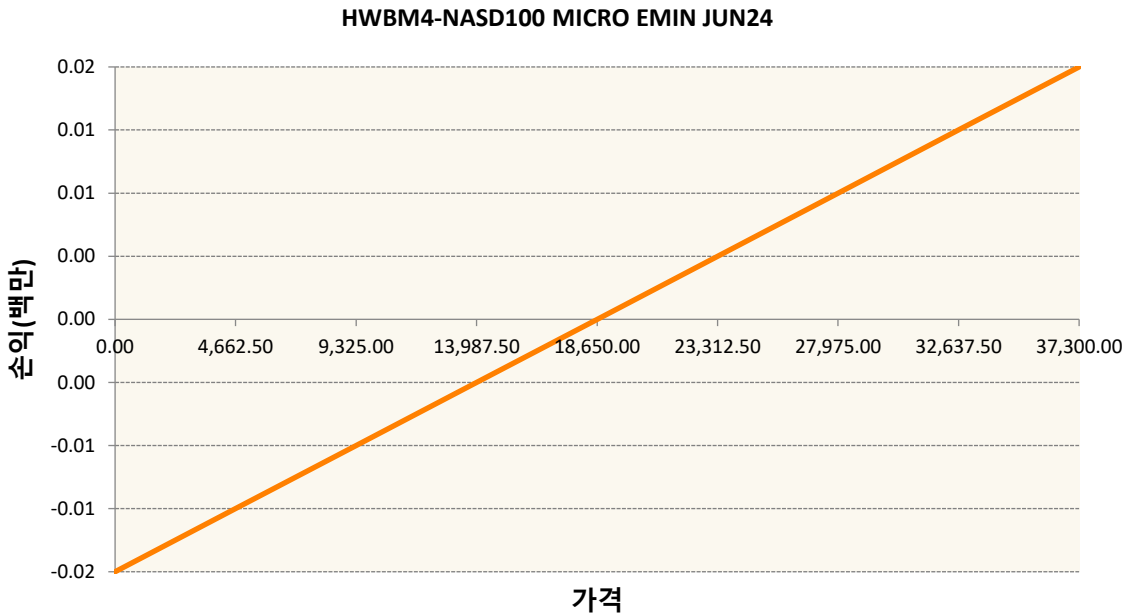
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

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	2,466	0	2,466	
누계	유가증권	선물	2,379	0	2,379	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
HWBM4	NASD100 MICRO EMIN JUN24		190
NQM4	NASDAQ 100 E-MINI Dec20		197

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

공시일	2024-05-20
기준일	2024-05-17

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	155,473	0	155,473	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	951
SWKEDI0000 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	8,840
SWKEDI0000 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	2,384

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

(단위:백만원)

7,852

공시일 2024-05-20

기준일 2024-05-17

SOL미국테크TOP10인버스상장지수(주식혼합

1. 계약금액

* 해당 펀드는 파생상품을 포함하지 않음

2. 만기시점의 손익구조

* 해당 펀드는 파생상품을 포함하지 않음

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

* 해당 펀드는 파생상품을 포함하지 않음

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

* 해당 펀드는 파생상품을 포함하지 않음

공시일	2024-05-20
기준일	2024-05-17

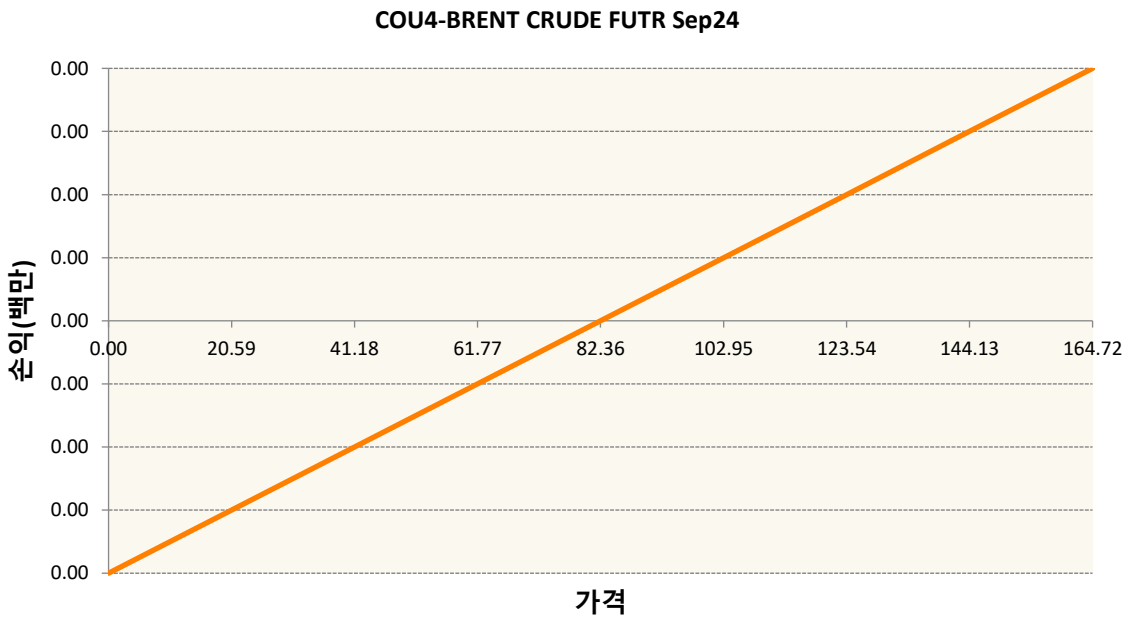
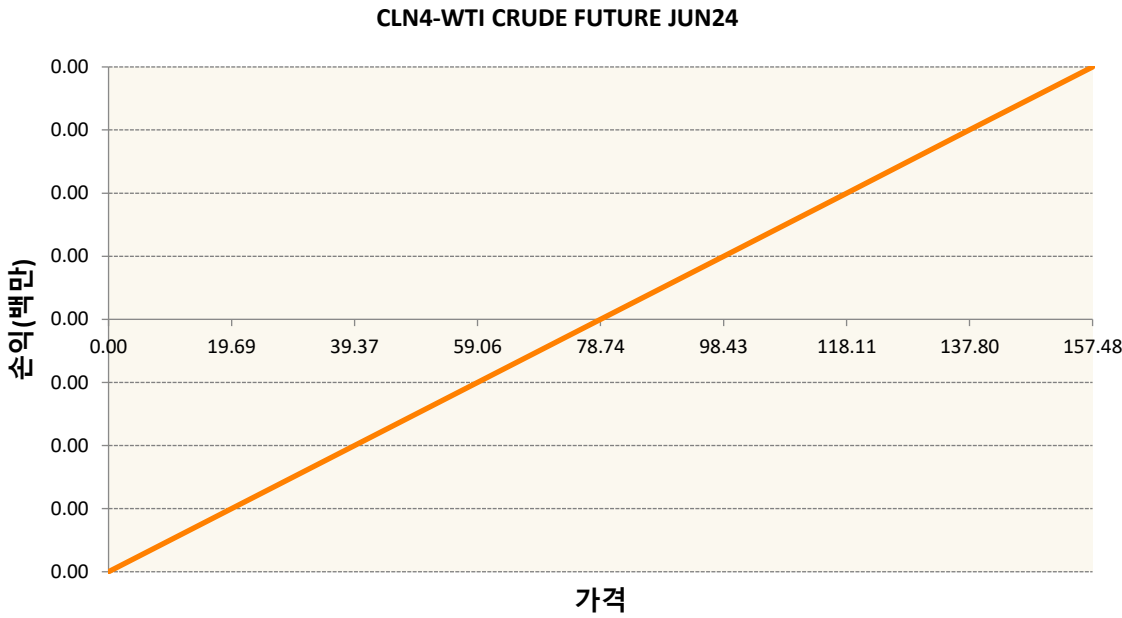
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

1. 계약금액

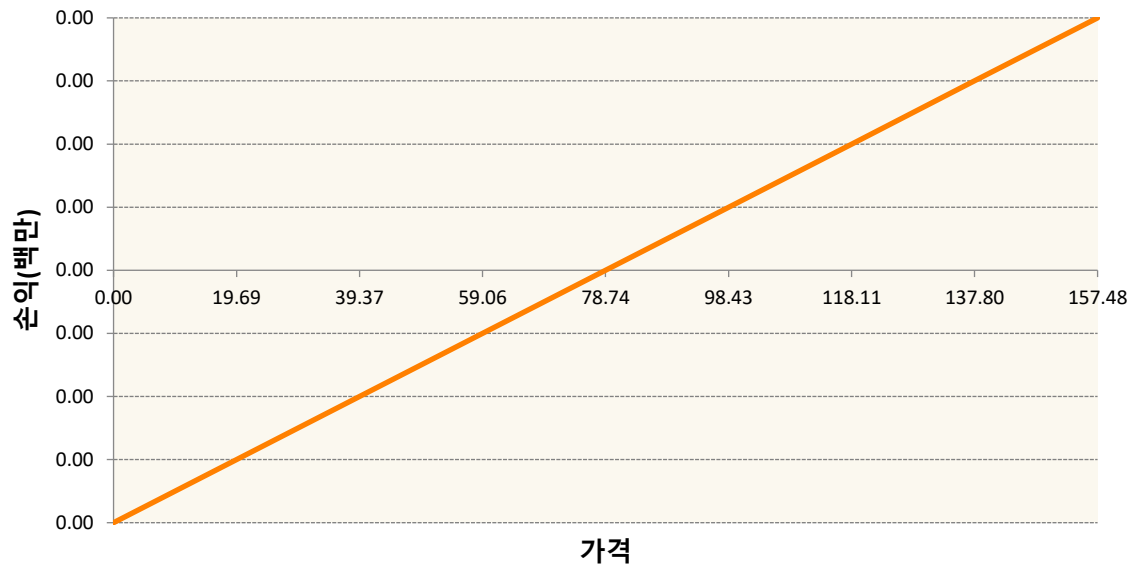
(단위:백만원)

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	1,174	0	1,174	
누계	통화	선물	0	189	-189	장내

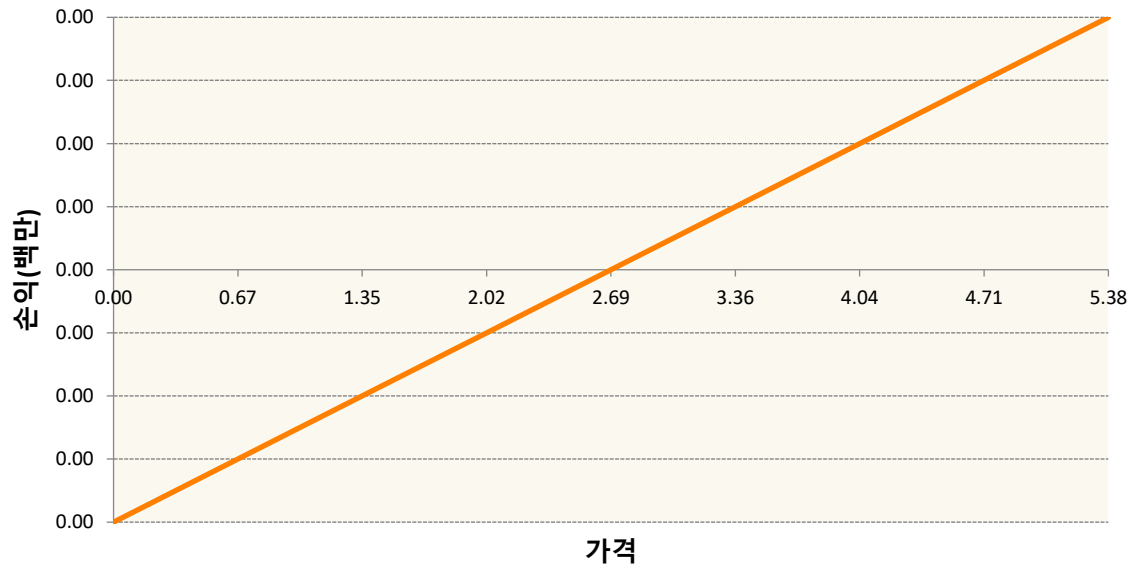
2. 만기시점의 손익구조



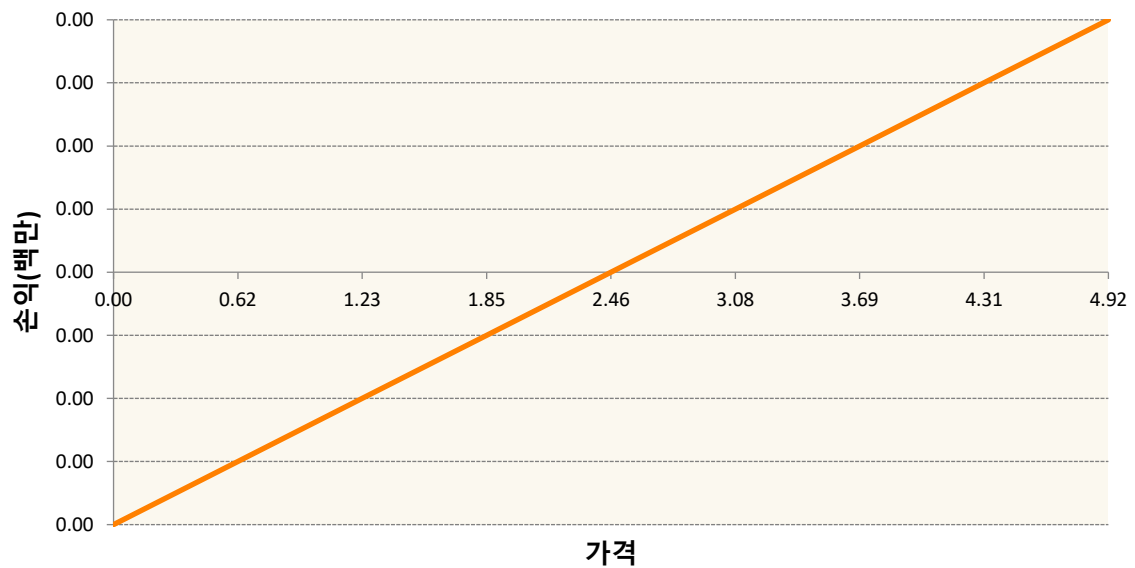
ECN4-E-mini Crude Oil Jul24



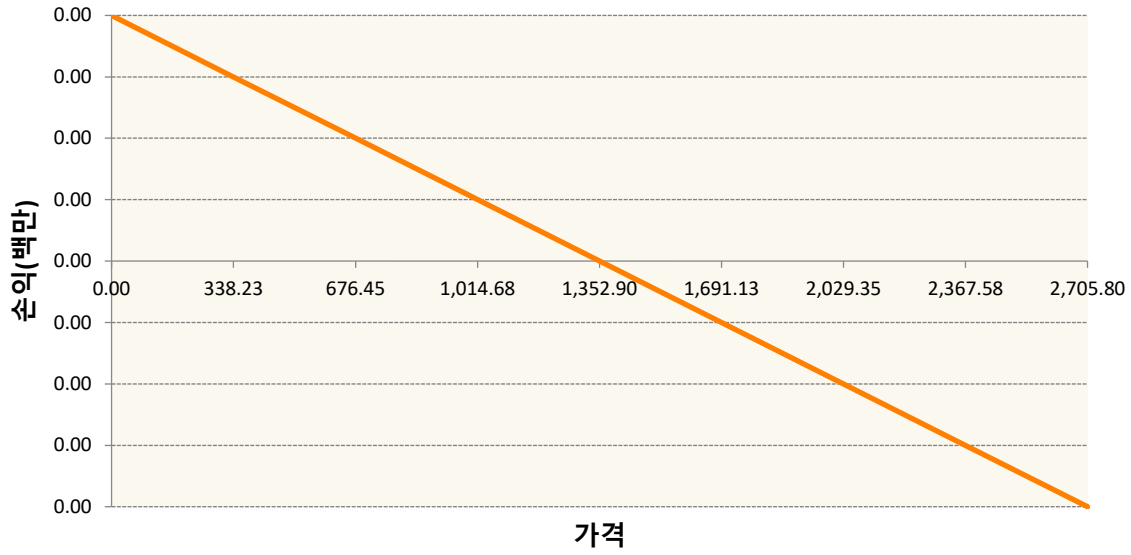
EON4-E-MINI NATURAL GAS Jul24



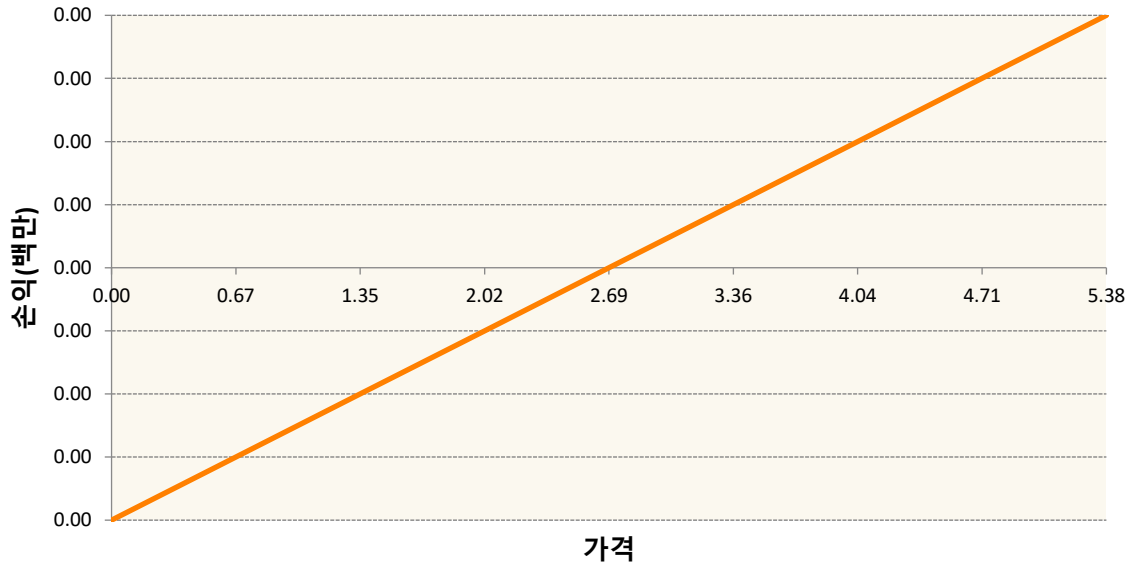
HON4-NY Harb ULSD Fut Jul24



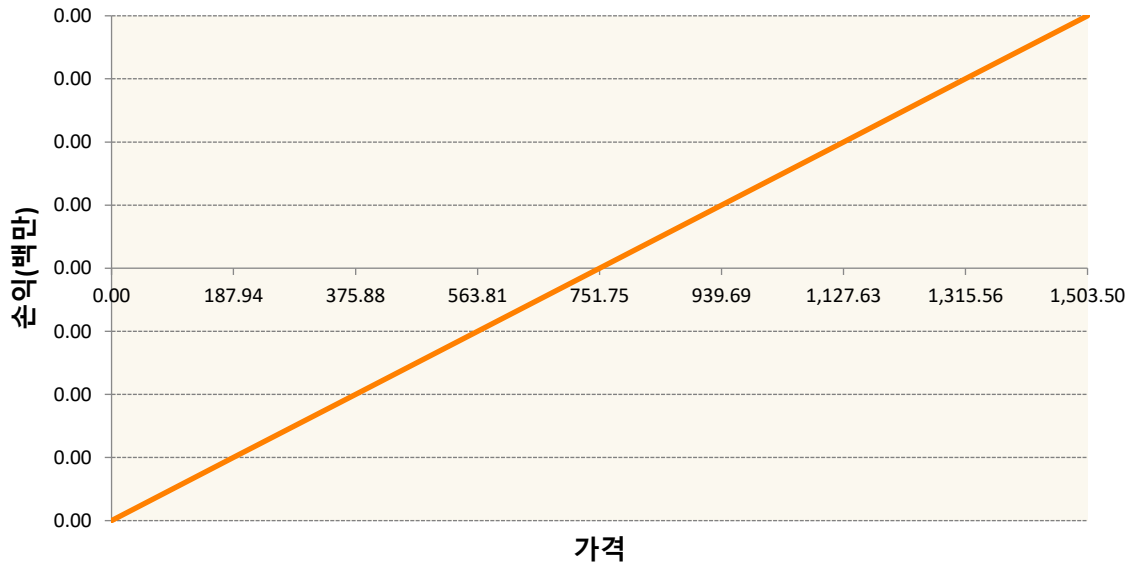
KR4175V60006-2024-06 달러선물

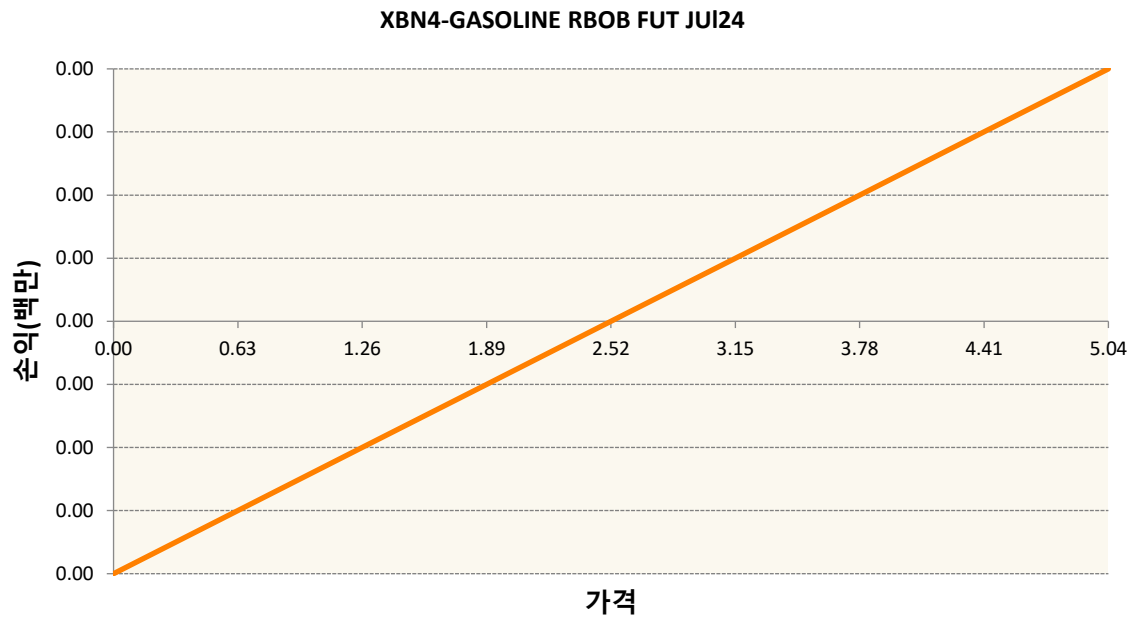


NGN24-NATURAL GAS FUTR JUL24



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
KR4175V600 2024-06 달러선물		15
NGN24	NATURAL GAS FUTR JUL24	17
QSN4	Low Su Gasoil G JUL24	8
XBN4	GASOLINE RBOB FUT JUL24	11

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	204