

공시일	2024-05-22
기준일	2024-05-21

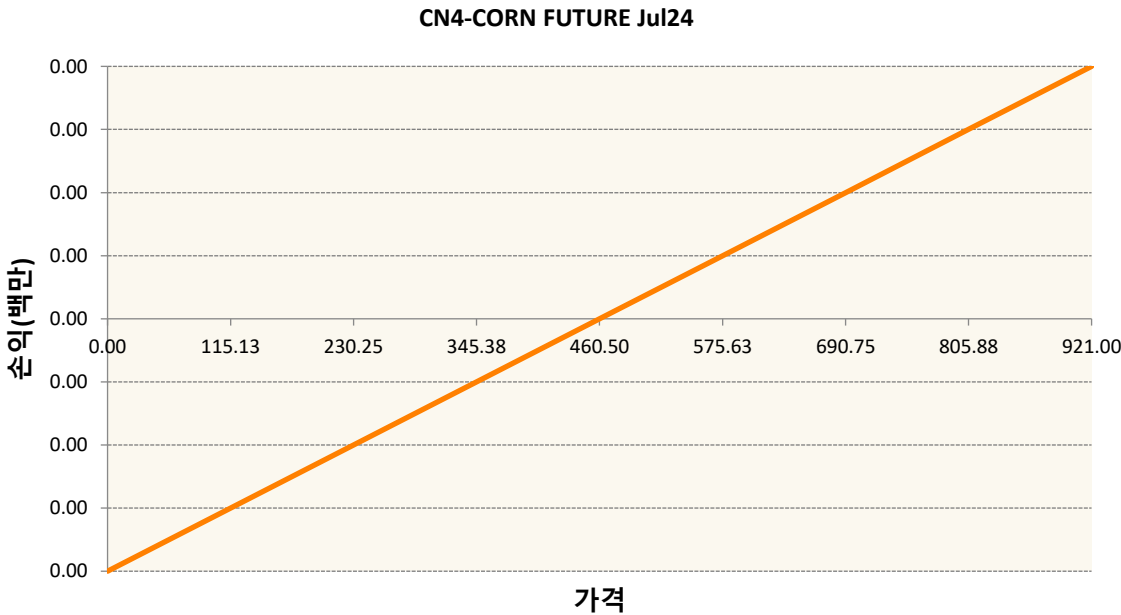
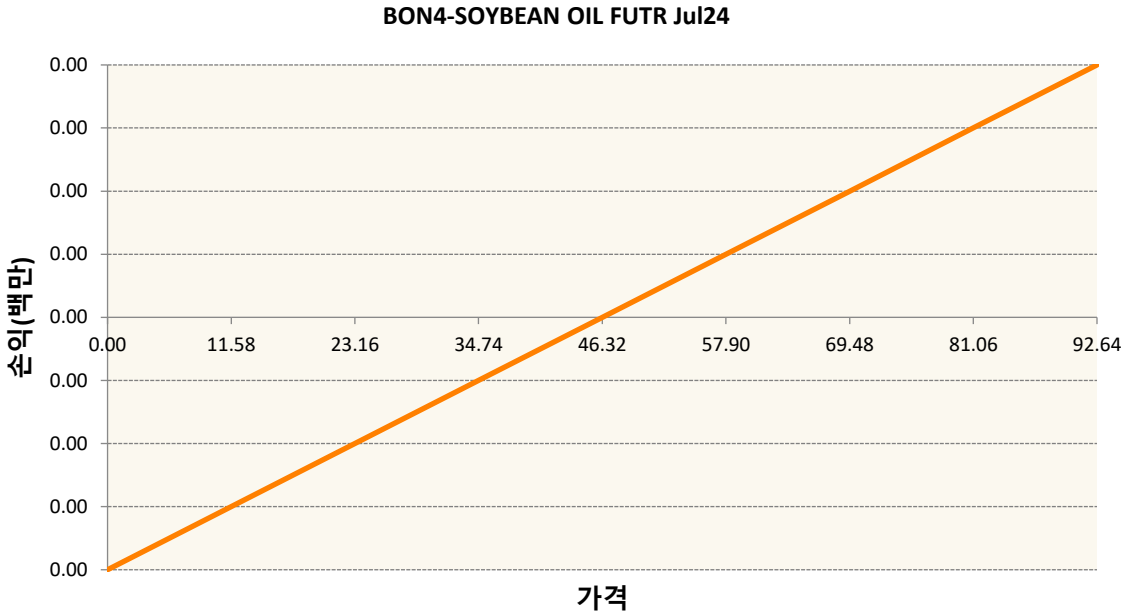
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

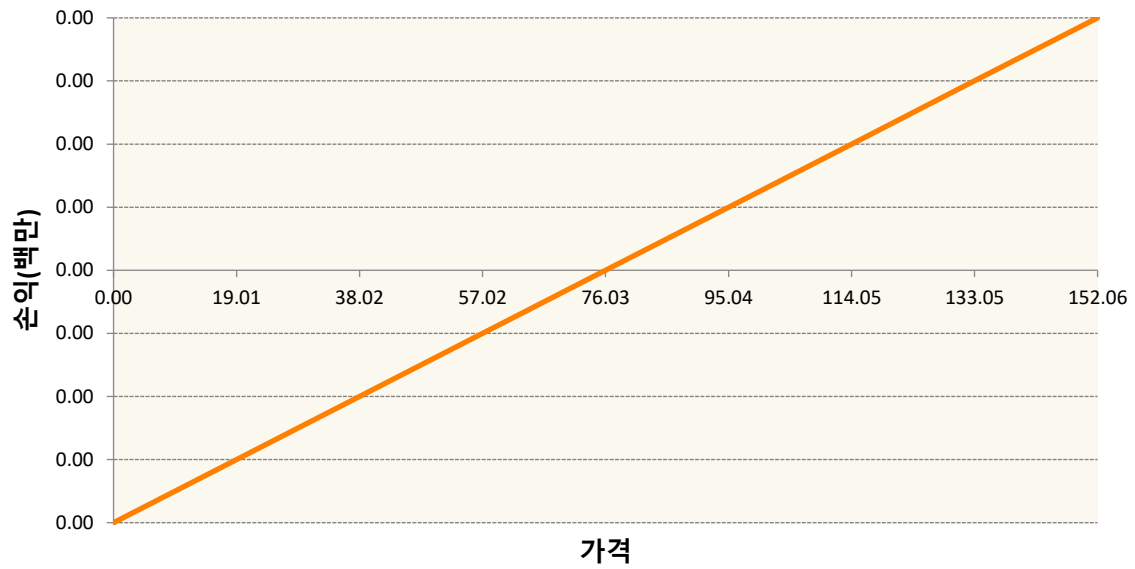
(단위:USD 백만)

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	4,402	0	4,402	
누계	통화	선물	0	544	-544	장내

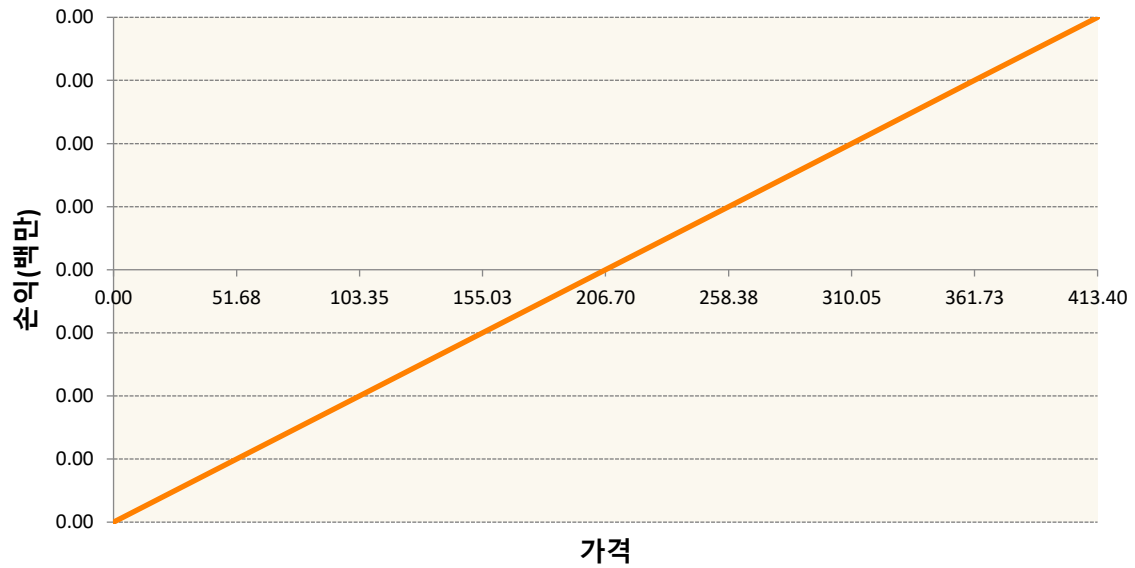
2. 만기시점의 손익구조



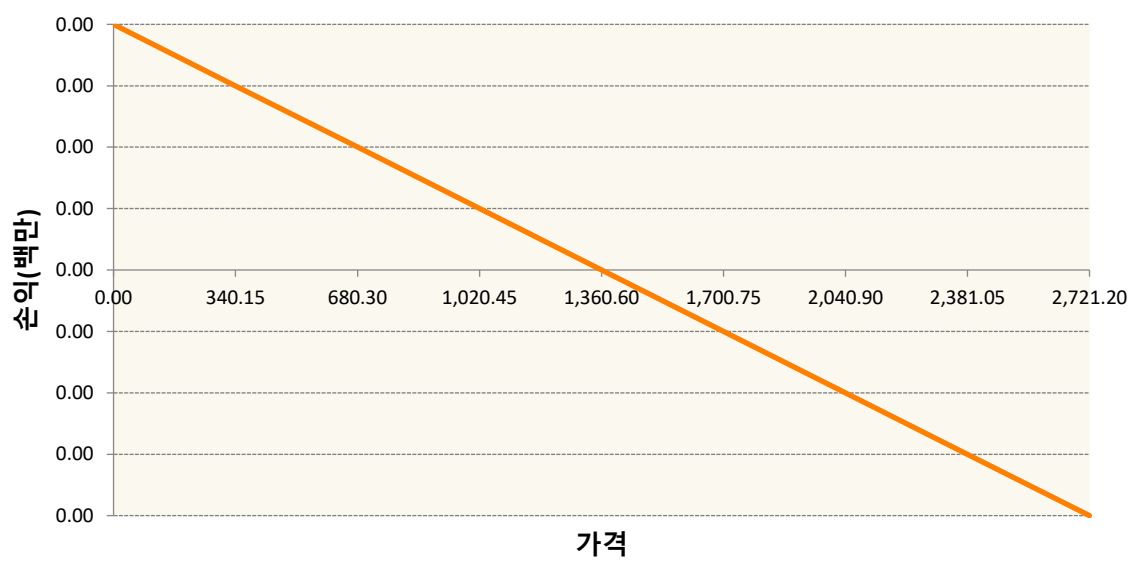
CTN4-COTTON NO.2 FUTR Jul24



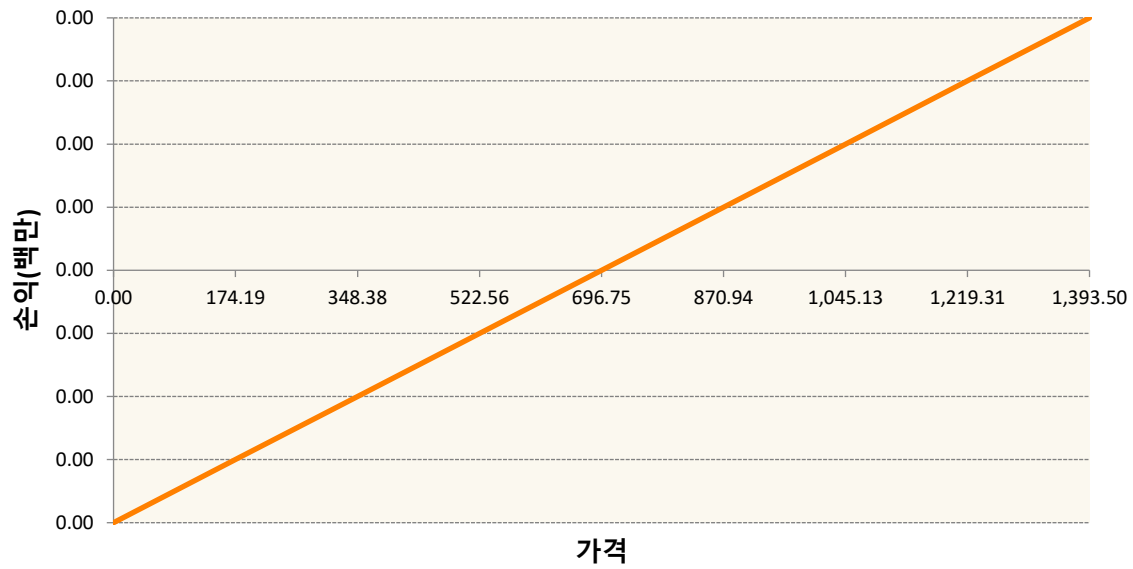
KCN4-COFFEE 'C' FUTURE Jul24



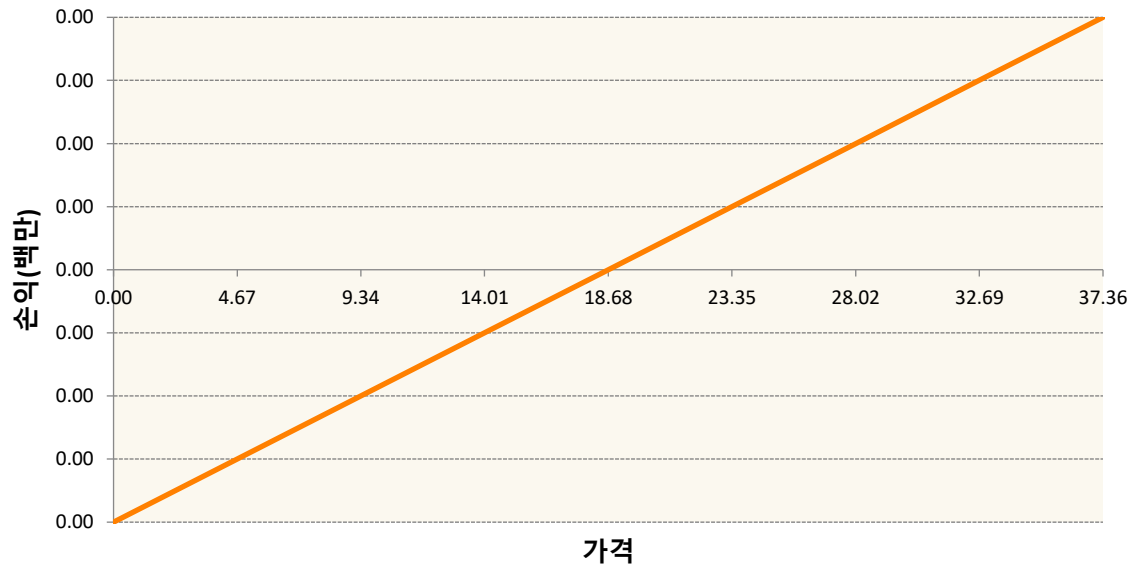
KR4175V60006-2024-06 달러선물



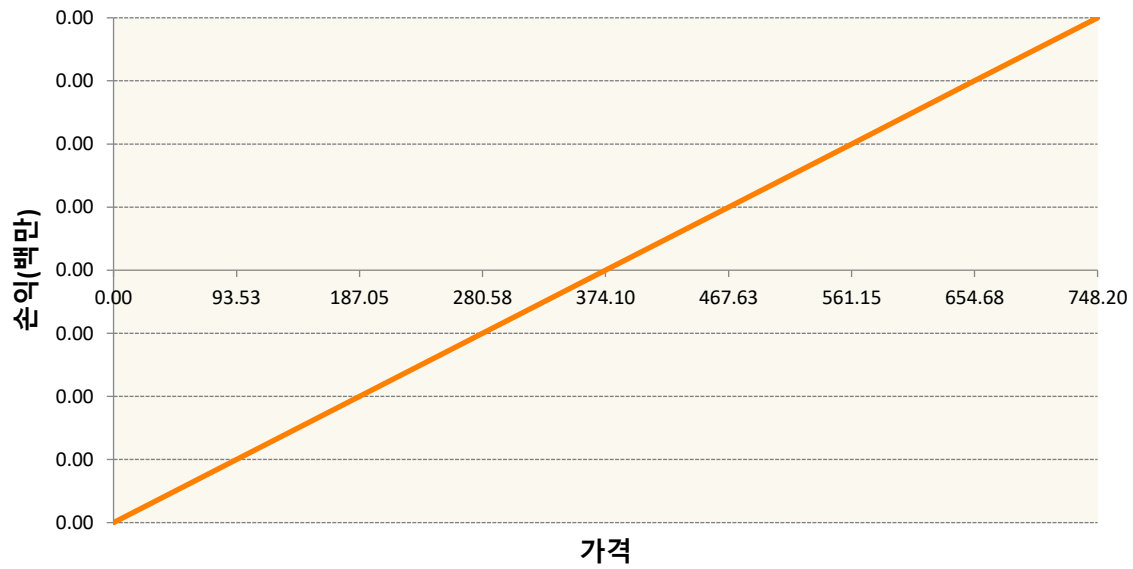
KWN4-KC HRW WHEAT FUT Jul24



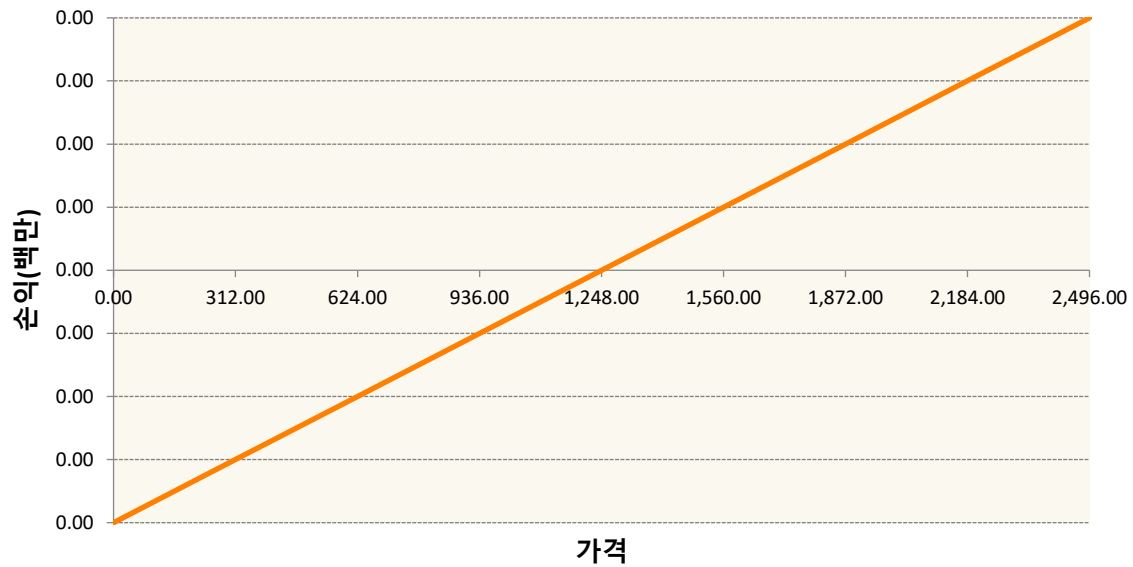
SBN4-Sugar #11 (WORLD) Jul24



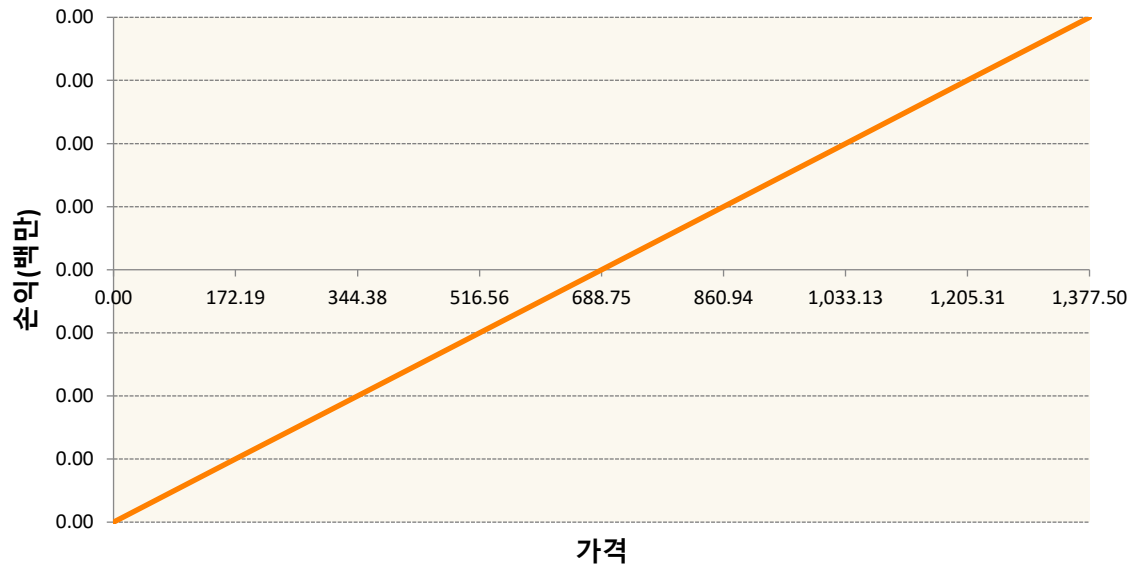
SMN4-SOYBEAN MEAL FUTR Jul24



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	2024-05-22
기준일	2024-05-21

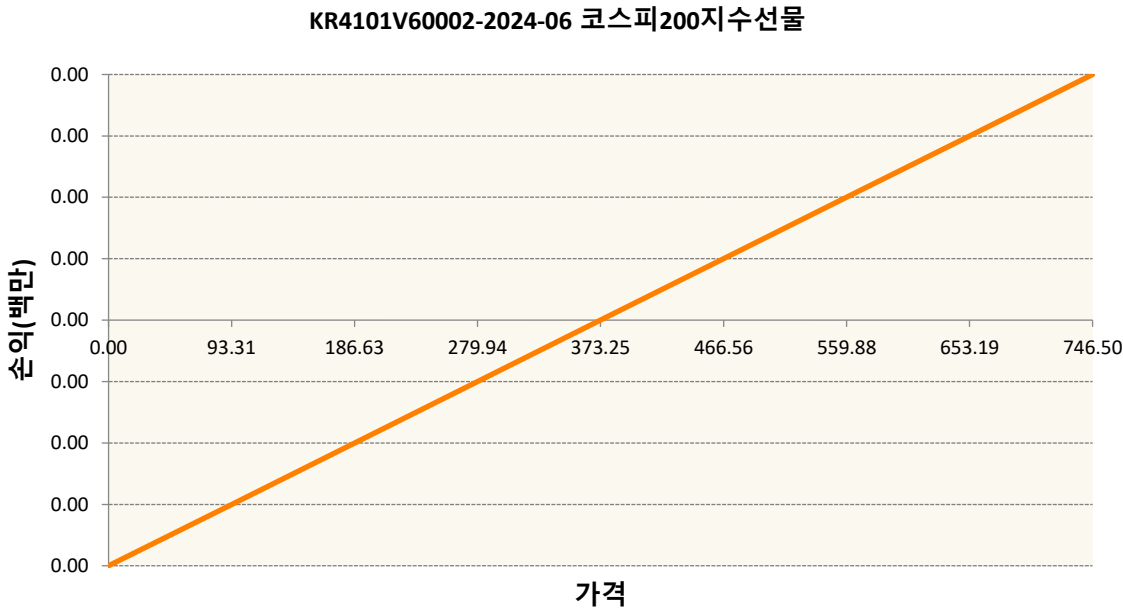
스마트인덱스모

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	1,493	0	1,493	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	2024-05-22
기준일	2024-05-21

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	275
-----------------------------	-----

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

334

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2024-05-22
기준일	2024-05-21

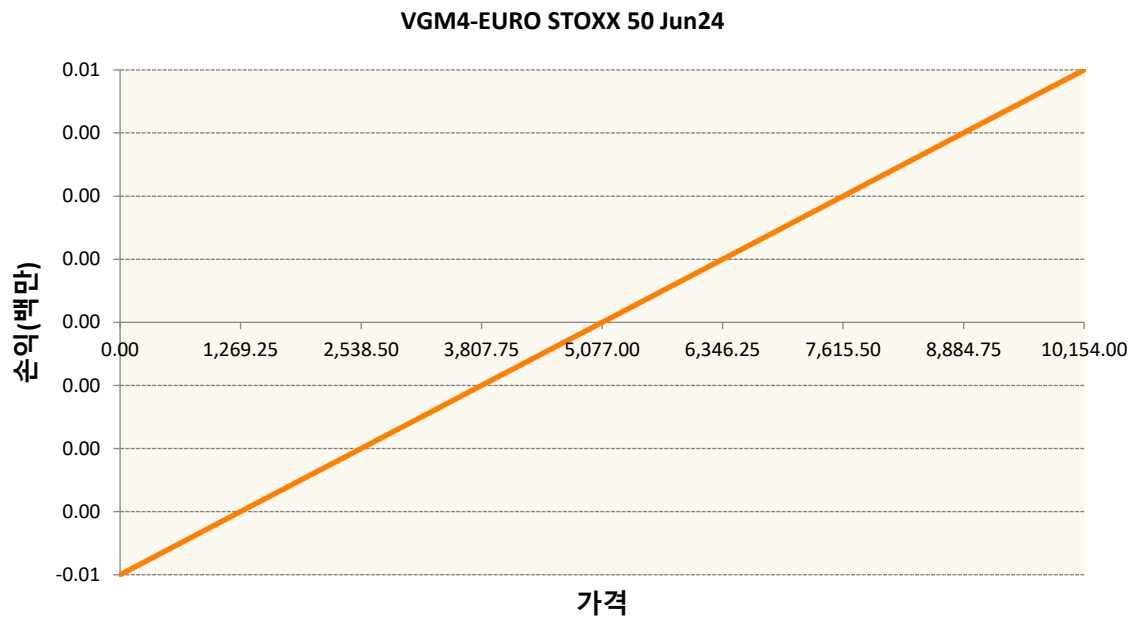
유로인덱스모(주식-파생형)

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	948	0	948	
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)

61

공시일	2024-05-22
기준일	2024-05-21

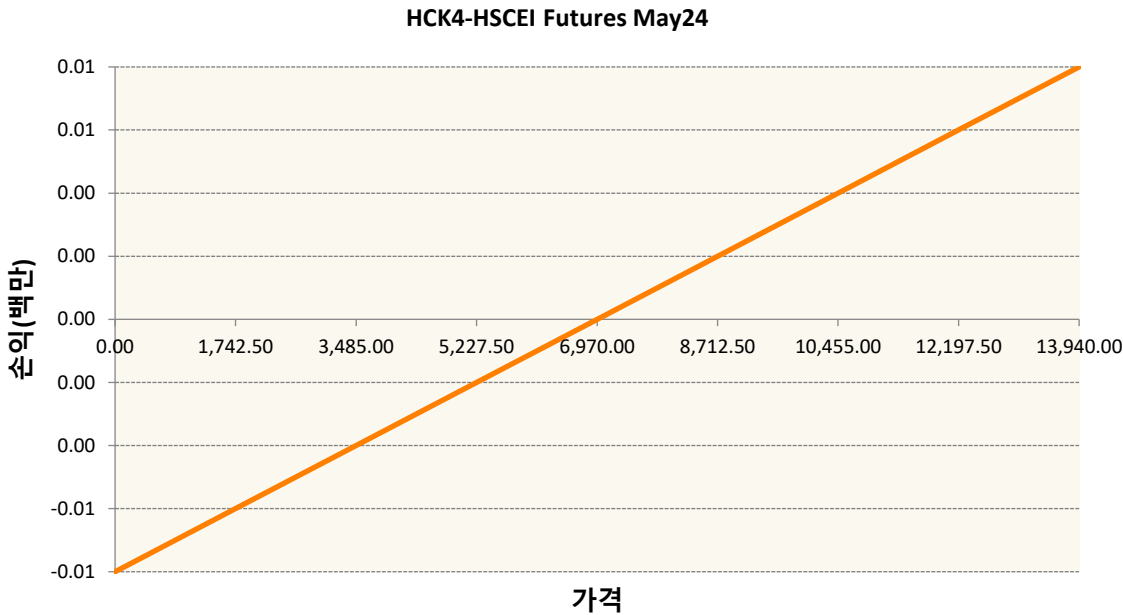
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,406	0	1,406	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCK4	HSCEI Futures May24	112
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

141

공시일	2024-05-22
기준일	2024-05-21

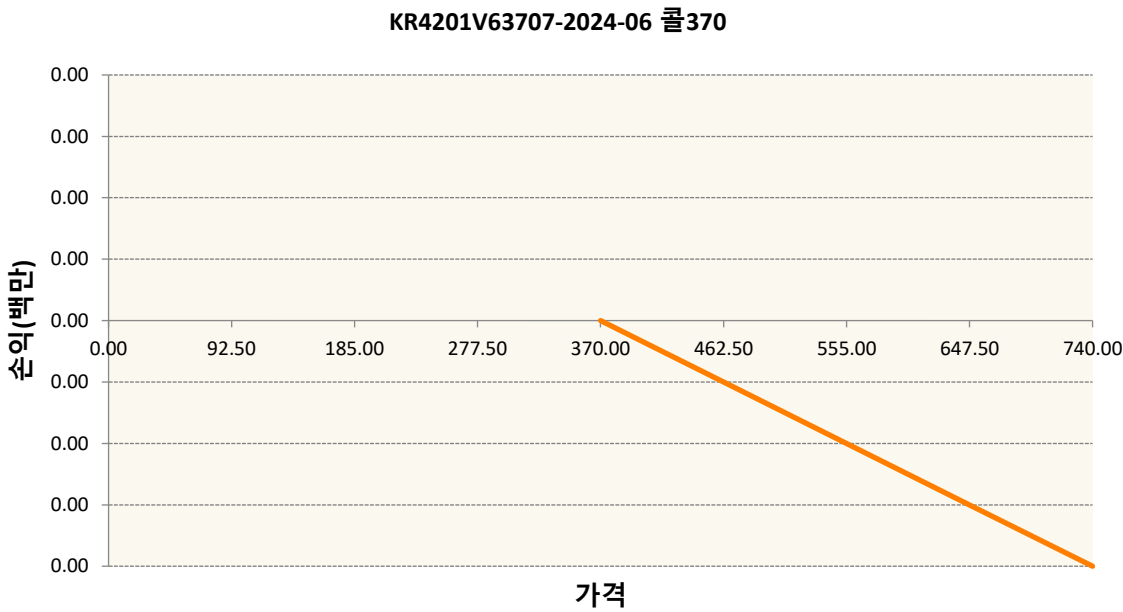
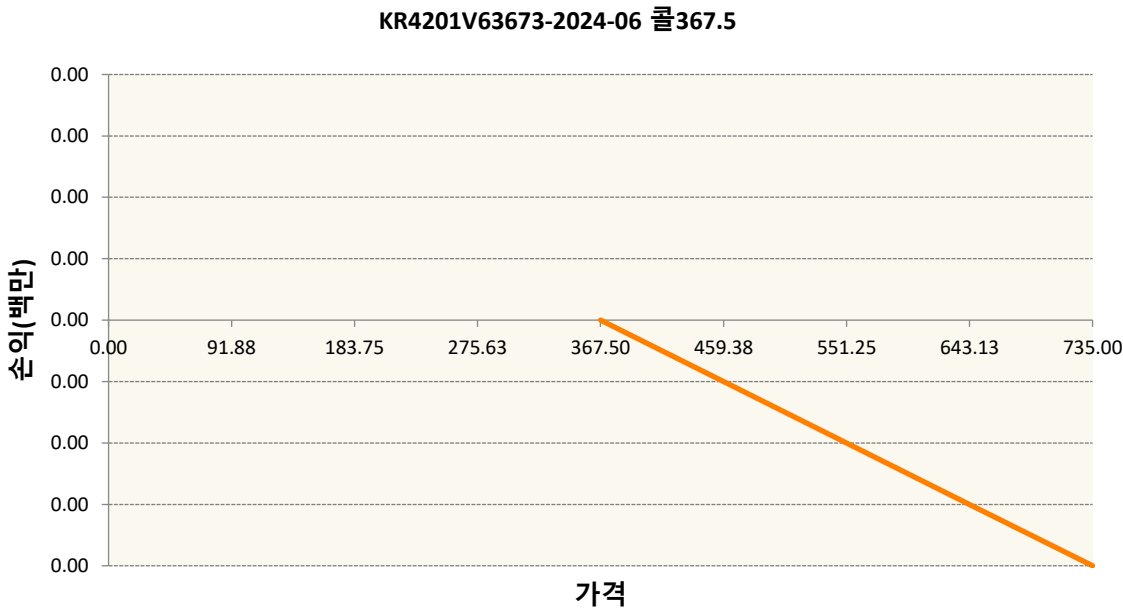
커버드콜모(주식혼합-파생형)

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

(단위:백만원)

KR4201V63673		2024-06 콜367.5					1,028
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	326	324	322	319	315	310	304
-5.33%	313	305	297	287	276	264	251
-2.67%	244	227	209	192	174	156	138
0%	55	37	18	0	-19	-37	-56
2.67%	-256	-266	-276	-288	-301	-315	-329
5.33%	-629	-631	-635	-640	-646	-653	-661
8.00%	-1,017	-1,017	-1,018	-1,019	-1,022	-1,024	-1,028
KR4201V63707		2024-06 콜370					1,630
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	444	442	440	436	431	424	416
-5.33%	431	422	411	398	383	366	348
-2.67%	350	325	300	273	246	218	190
0%	94	63	32	0	-32	-63	-95
2.67%	-373	-393	-414	-437	-462	-487	-513
5.33%	-969	-976	-984	-995	-1,008	-1,022	-1,038
8.00%	-1,605	-1,606	-1,608	-1,611	-1,616	-1,622	-1,630
KR4301V63671 2024-06 풋367.5							440

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-429	-429	-431	-432	-434	-437	-440
-5.33%	-237	-241	-246	-251	-256	-262	-268
-2.67%	-75	-83	-92	-101	-110	-119	-128
0%	28	19	9	0	-9	-19	-28
2.67%	68	63	58	52	45	39	31
5.33%	78	76	74	72	69	65	61
8.00%	79	79	78	77	76	75	73

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	-57	-58	-58	-58
-5.33%	-33	-33	-34	-34	-35	-35	-36
-2.67%	-11	-12	-13	-14	-15	-16	-17
0%	4	2	1	0	-1	-2	-4
2.67%	10	10	9	8	7	6	5
5.33%	12	12	12	11	11	10	10
8.00%	12	12	12	12	12	12	12

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

(단위:백만원)

3,455

공시일	2024-05-22
기준일	2024-05-21

H2O글로벌본드(USD)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	413	-413	
누계	유가증권	수익증권	1,184	0	1,184	

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	2024-05-22
기준일	2024-05-21

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	4,352	0	4,352	

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	2024-05-22
기준일	2024-05-21

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	15,219	0	15,219	
누계	통화	선도	0	15,317	-15,317	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
FXW213E5M KRW/USD 31-05-24E	22
IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

575

공시일	2024-05-22
기준일	2024-05-21

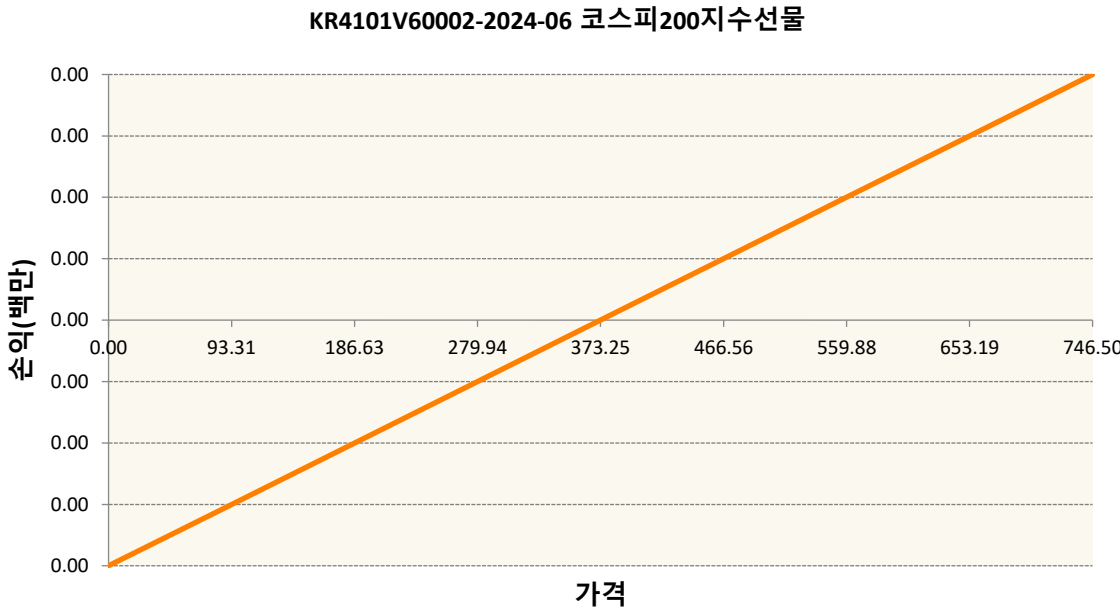
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

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	1,120	0	1,120	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	2024-05-22
기준일	2024-05-21

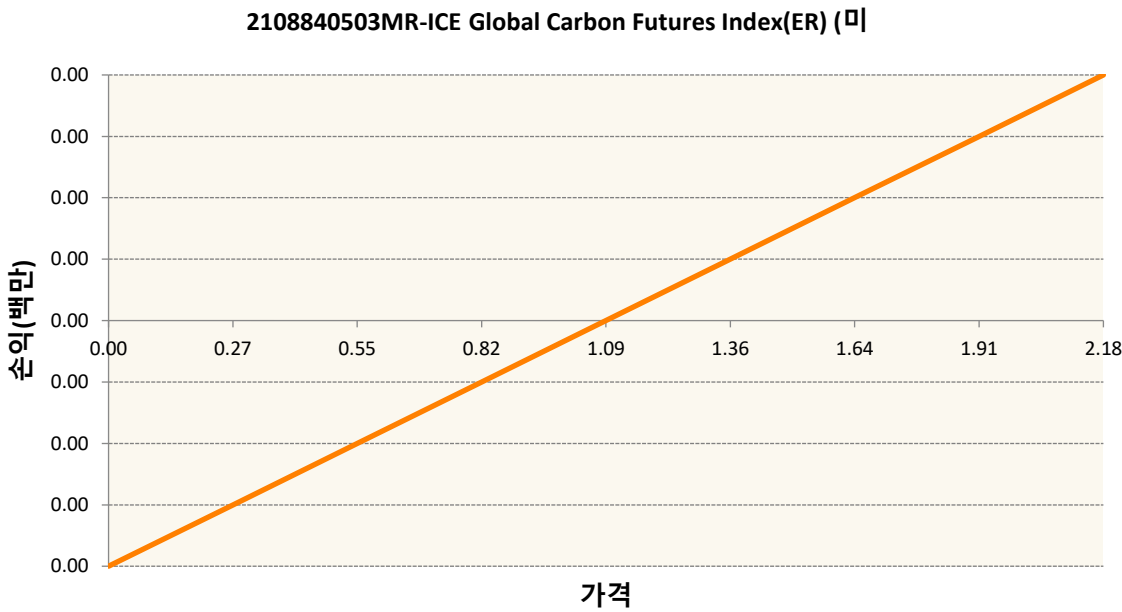
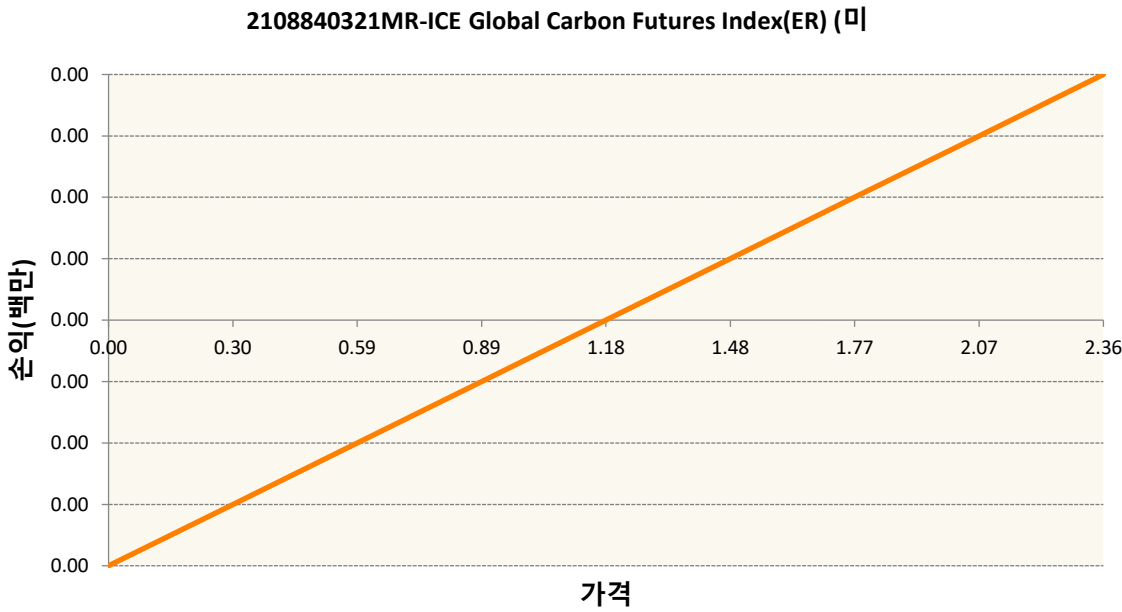
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

1. 계약금액

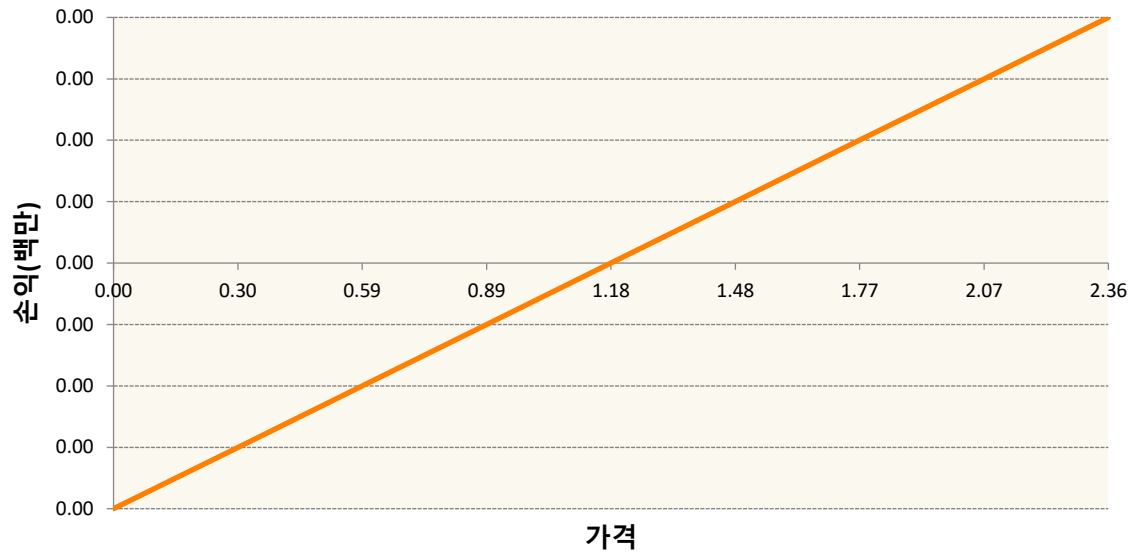
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	24,310	0	24,310	

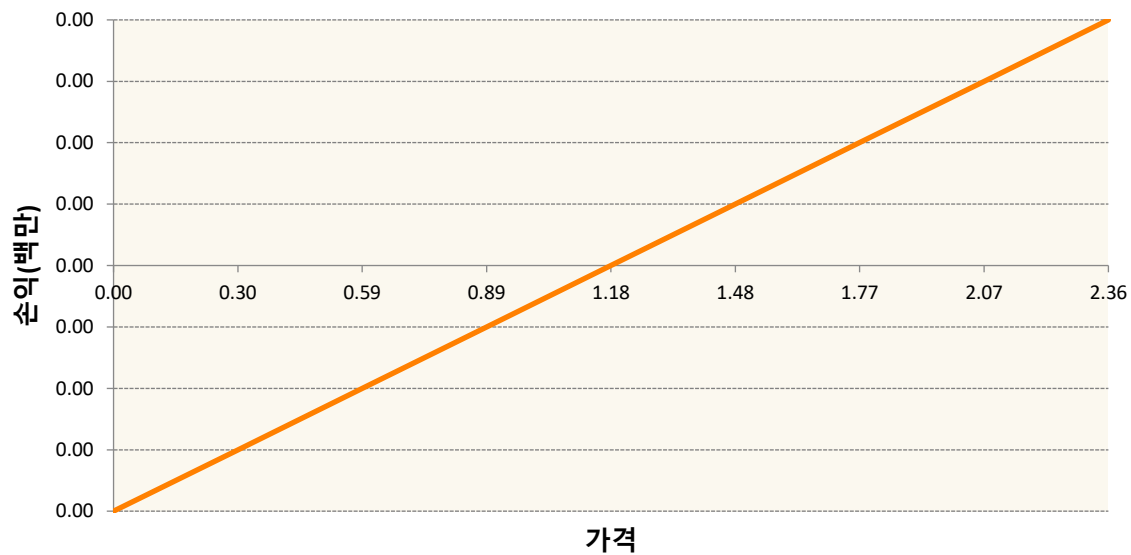
2. 만기시점의 손익구조



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
2108840503ICE Global Carbon Futures Index(ER) (미
2108840920ICE Global Carbon Futures Index(ER) (키
2108840920ICE Global Carbon Futures Index(ER) (메

511
205
1,023
205

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

(단위:백만원)

2,295

공시일	2024-05-22
기준일	2024-05-21

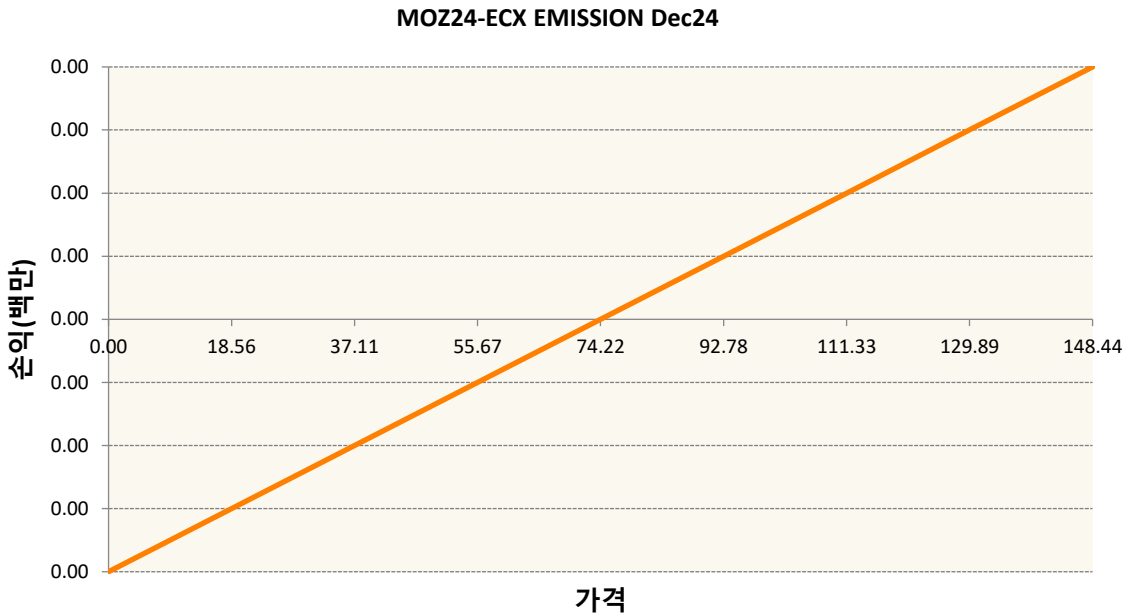
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	11,145	0	11,145	
누계	지수	스왑	331	0	331	장외
누계	통화	선도	0	2,691	-2,691	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	892
SWICEUACN ICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX	6

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

(단위:백만원)

1,766

공시일	2024-05-22
기준일	2024-05-21

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)	8
SWCSI00000 신한CSI Index 231013 (NH)	9

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

(단위:백만원)

59

공시일	2024-05-22
기준일	2024-05-21

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)	8
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(메리츠)	12
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(키움)	2

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

(단위:백만원)

36

공시일	2024-05-22
기준일	2024-05-21

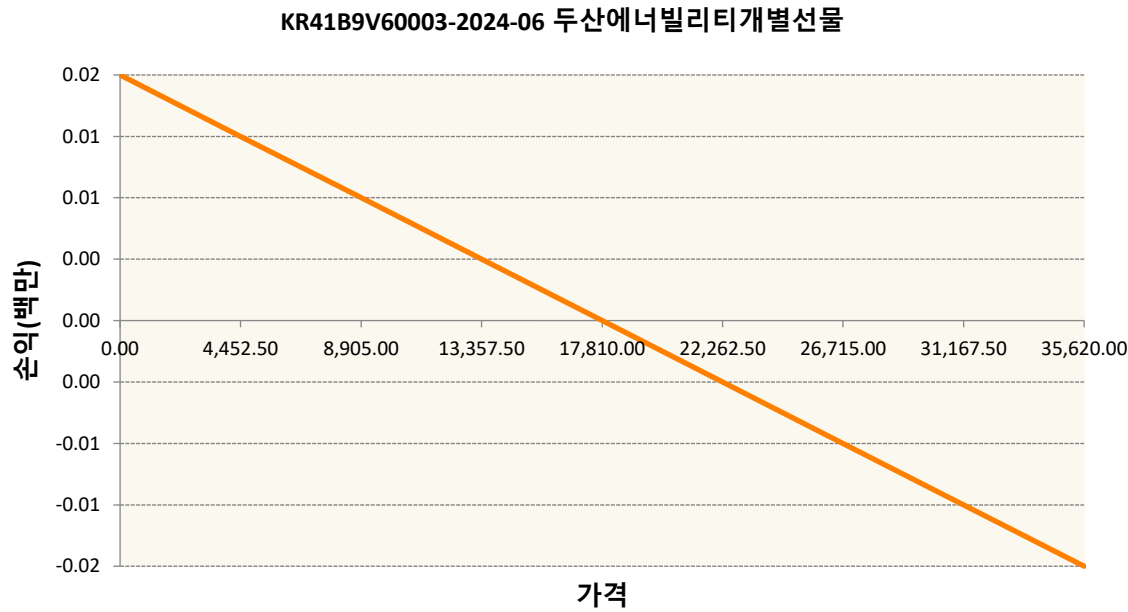
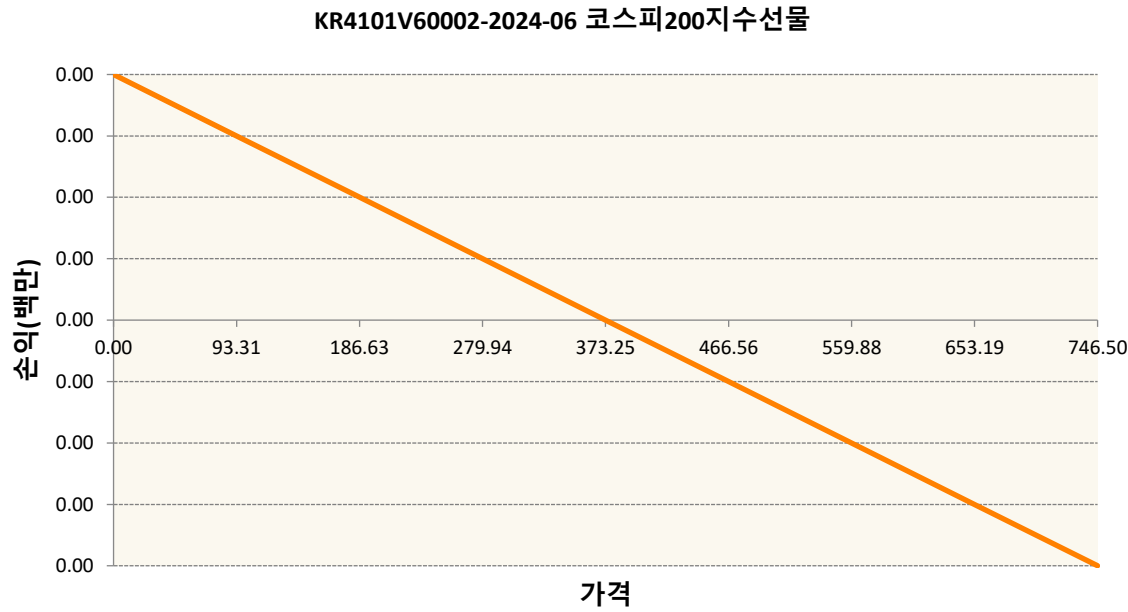
에퀴티알파일반사모혼합자산

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	4	-4	장내
누계	유가증권	선물	0	377	-377	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
KR4101V600 2024-06 코스피200지수선물		30
KR41B9V600 2024-06 두산에너지빌리티개별선물		0.3

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	29

공시일	2024-05-22
기준일	2024-05-21

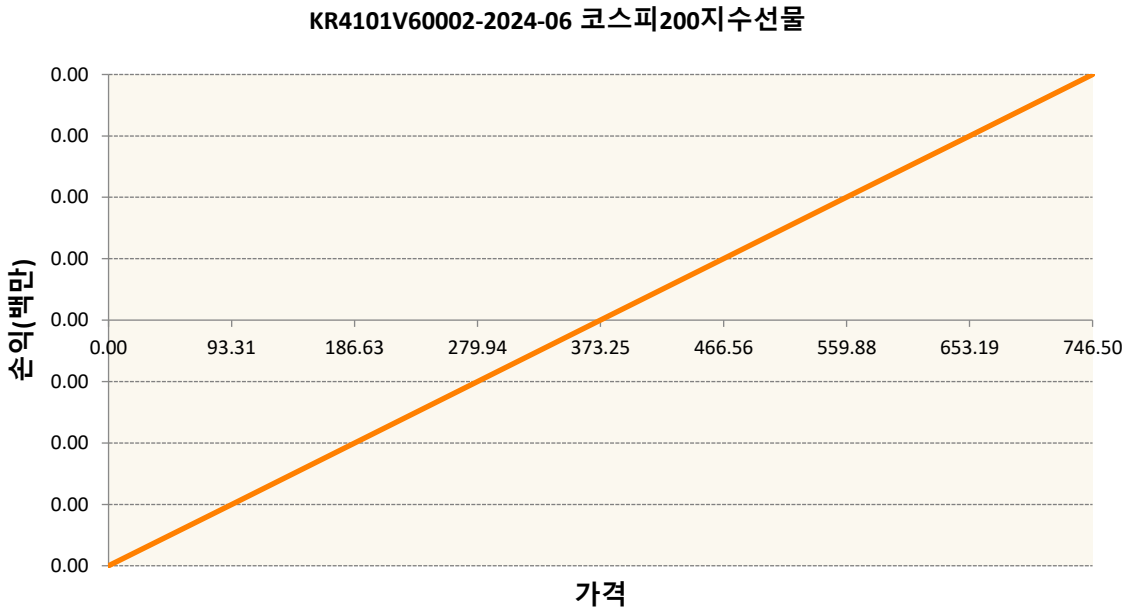
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	1,866	0	1,866	장내
누계	유가증권	선물	11,664	0	11,664	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101V60002		2024-06 코스피200지수선물					929
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-929	-929	-929	-929	-929	-929	-929
-5.33%	-619	-619	-619	-619	-619	-619	-619
-2.67%	-310	-310	-310	-310	-310	-310	-310
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	310	310	310	310	310	310	310
5.33%	619	619	619	619	619	619	619
8.00%	929	929	929	929	929	929	929

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

(단위:백만원)

895

공시일	2024-05-22
기준일	2024-05-21

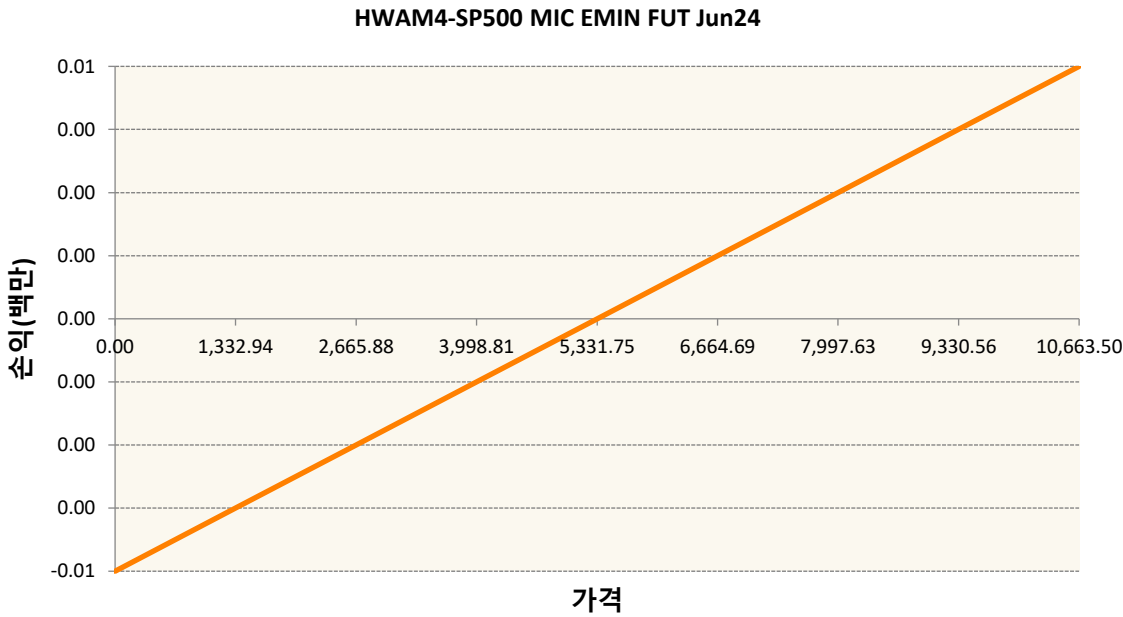
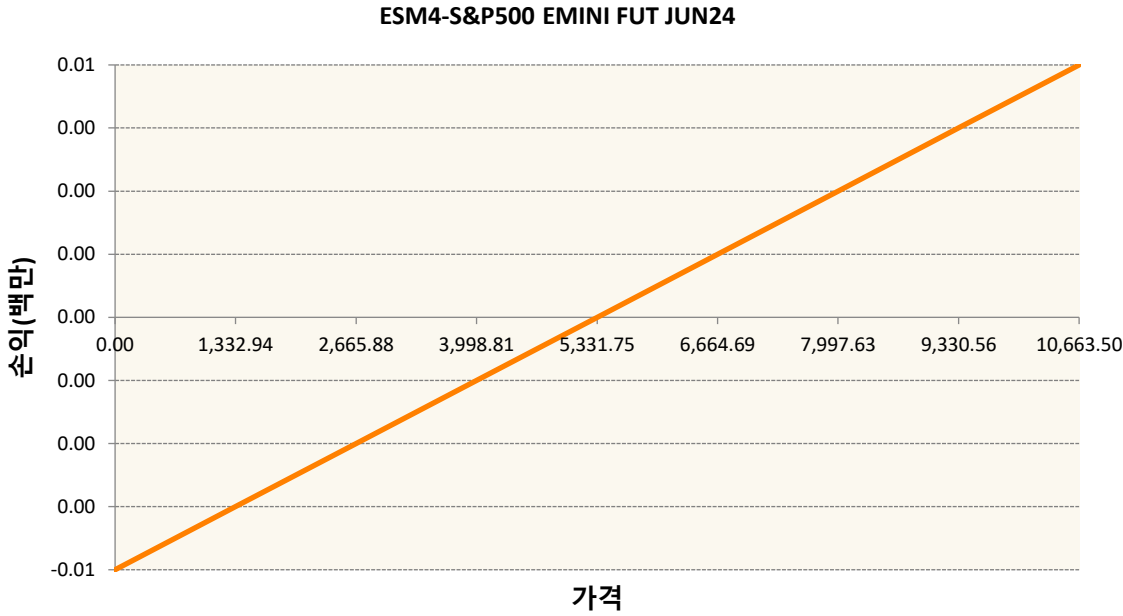
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

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	5,319	0	5,319	
누계	유가증권	선물	2,448	0	2,448	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESM4	S&P500 EMINI FUT JUN24	426
HWAM4	SP500 MIC EMIN FUT Jun24	196

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

공시일	2024-05-22
기준일	2024-05-21

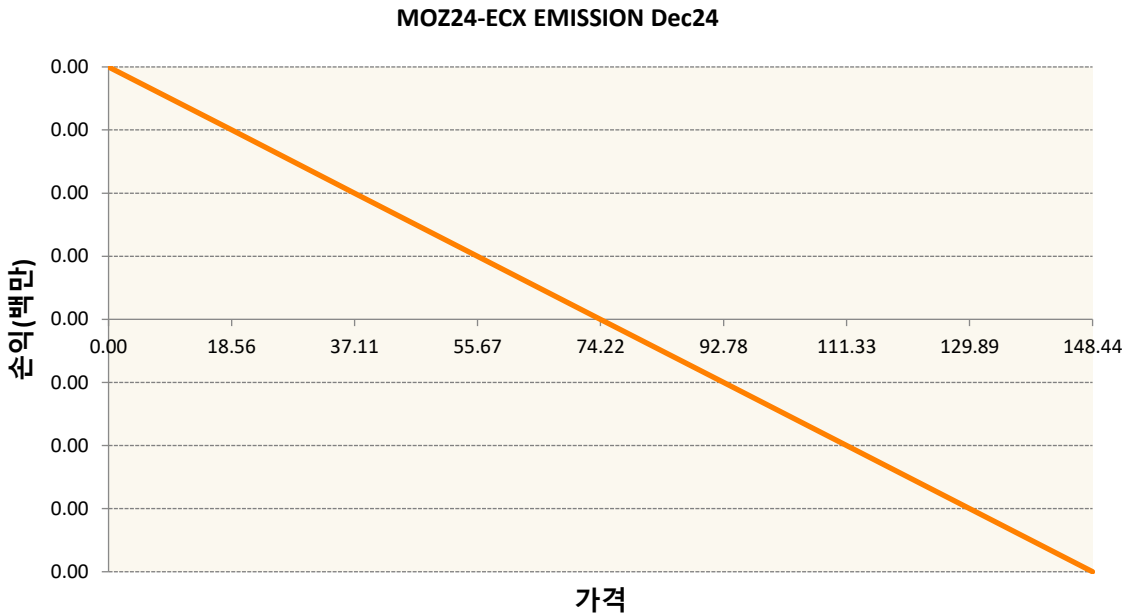
SOL유럽탄소배출권선물인버스ICE특별자산상

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	4,000	-4,000	
누계	지수	스왑	331	0	331	장외
누계	통화	선도	0	1,456	-1,456	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213E4W KRW/EUR 31-05-24E	9
FXW213E4W KRW/EUR 31-05-24E	108
MOZ24 ECX EMISSION Dec24	320
SWICEUACN ICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX	6

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

(단위:백만원)

663

공시일	2024-05-22
기준일	2024-05-21

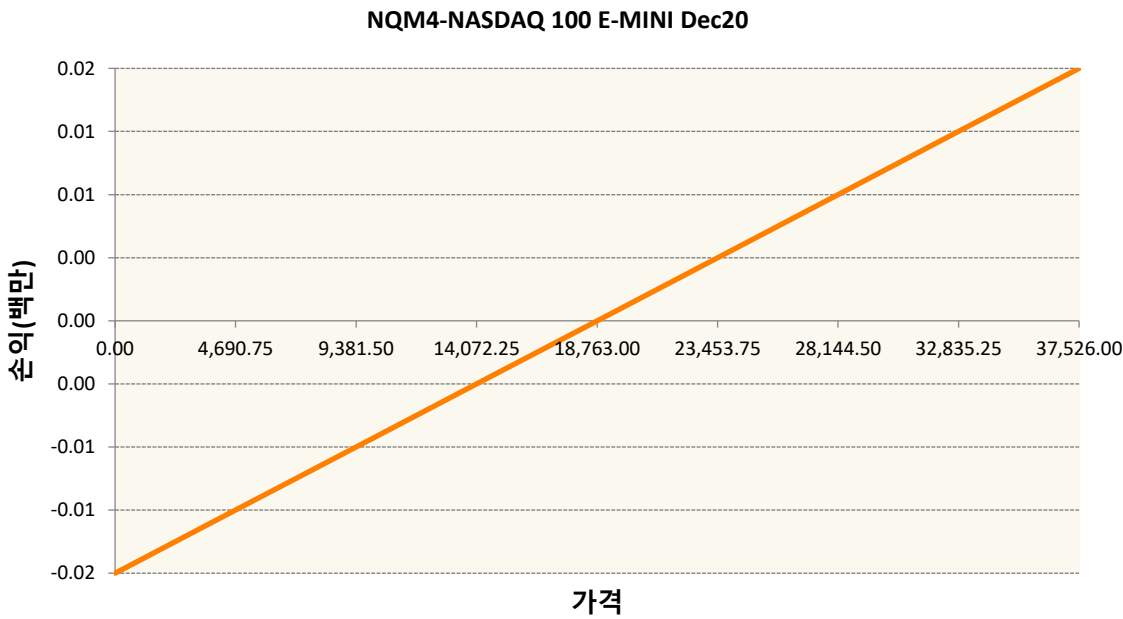
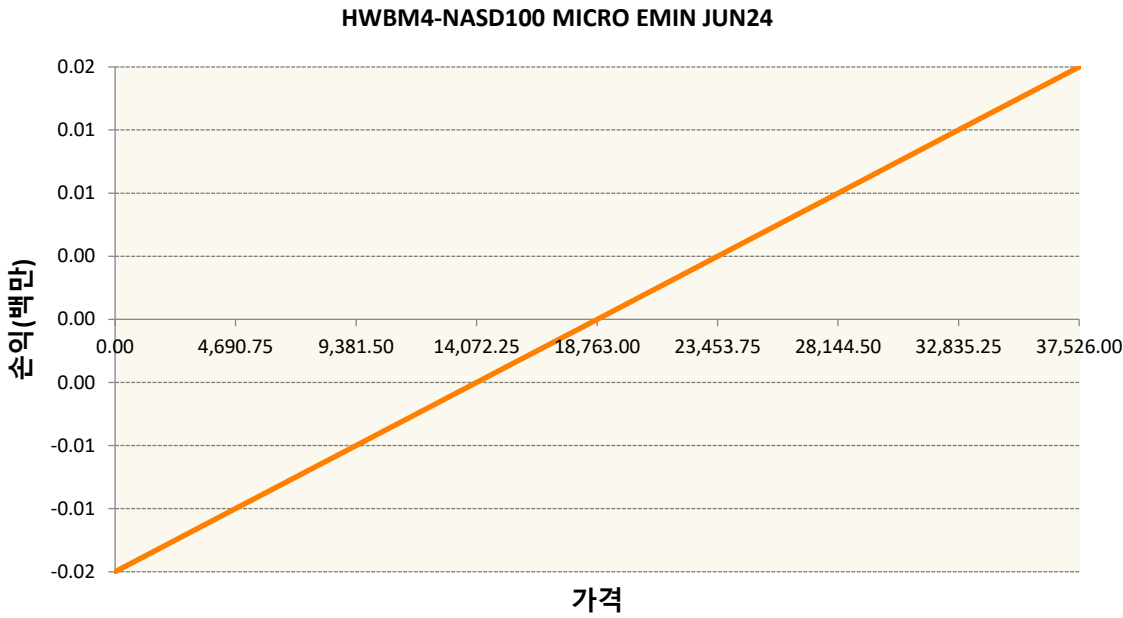
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

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	2,481	0	2,481	
누계	유가증권	선물	2,245	0	2,245	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
HWBM4	NASD100 MICRO EMIN JUN24		180
NQM4	NASDAQ 100 E-MINI Dec20		198

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)			(단위:백만원)
			291

공시일	2024-05-22
기준일	2024-05-21

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	950
SWKEDI0000 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	8,836
SWKEDI0000 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	2,383

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

(단위:백만원)

7,836

공시일	2024-05-22
기준일	2024-05-21

SOL미국테크TOP10인버스상장지수(주식혼합)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	5,970	0	5,970	장외
누계	지수	스왑	5,970	0	5,970	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	2
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	2
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	2

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

(단위:백만원)

6

공시일	2024-05-22
기준일	2024-05-21

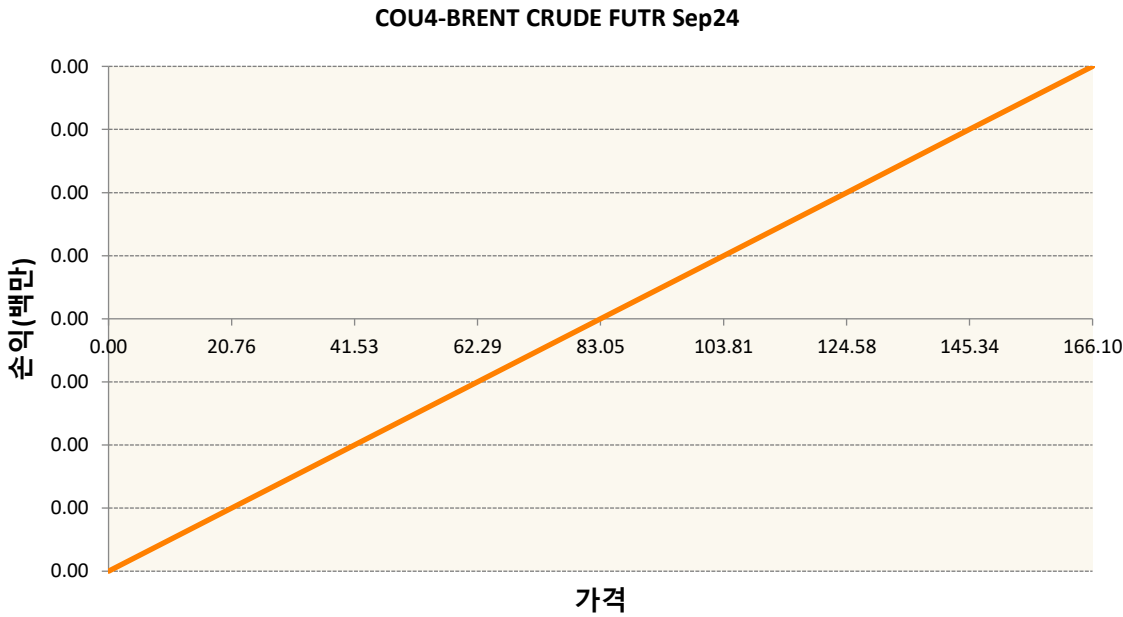
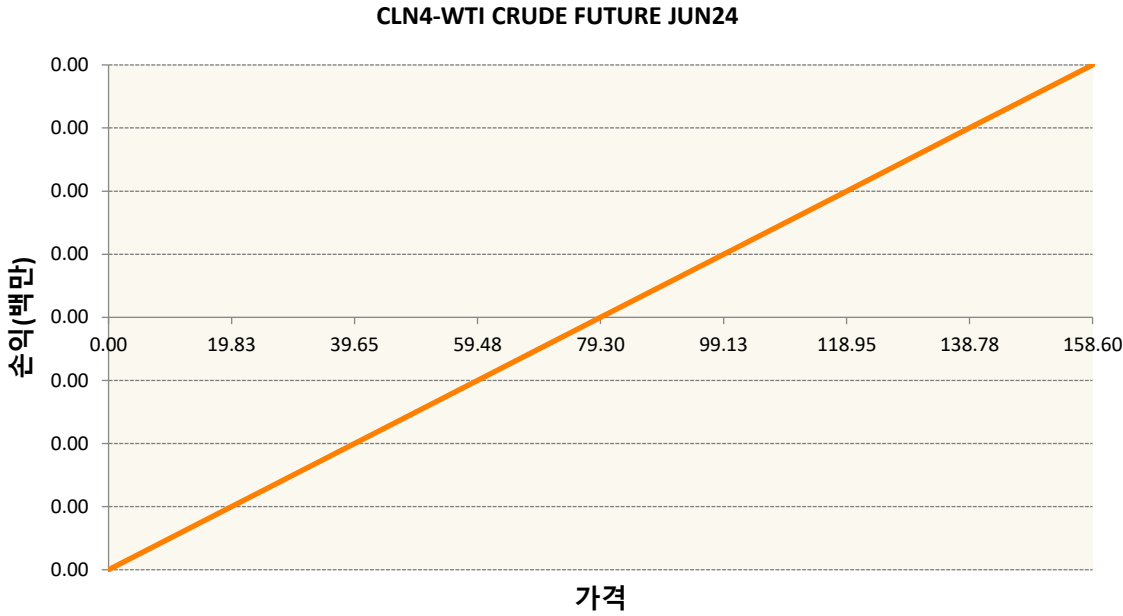
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

1. 계약금액

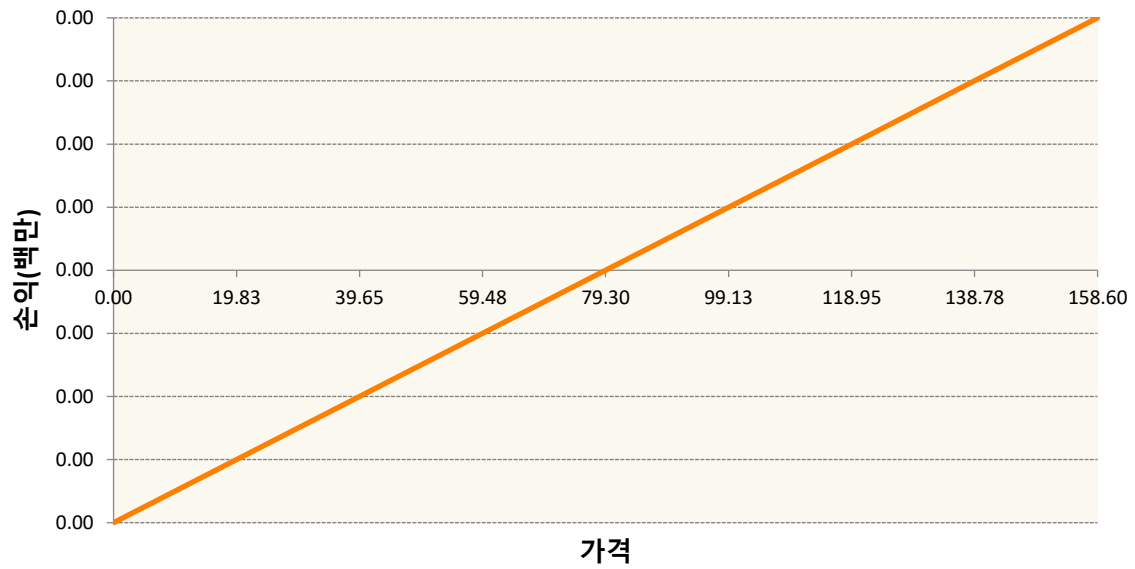
(단위:백만원)

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	1,149	0	1,149	
누계	통화	선물	0	190	-190	장내

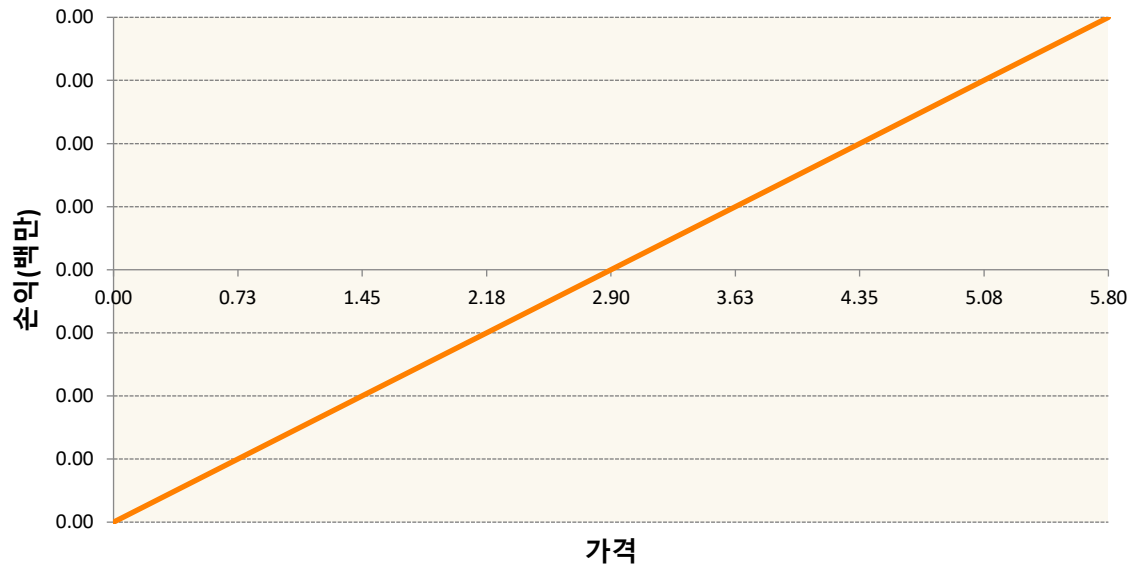
2. 만기시점의 손익구조



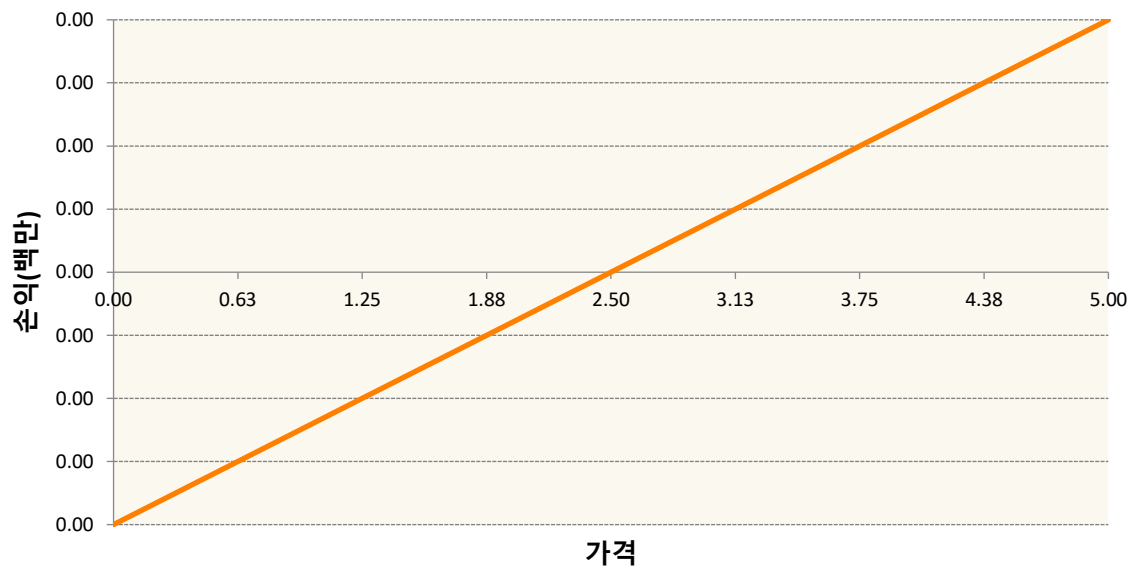
ECN4-E-mini Crude Oil Jul24



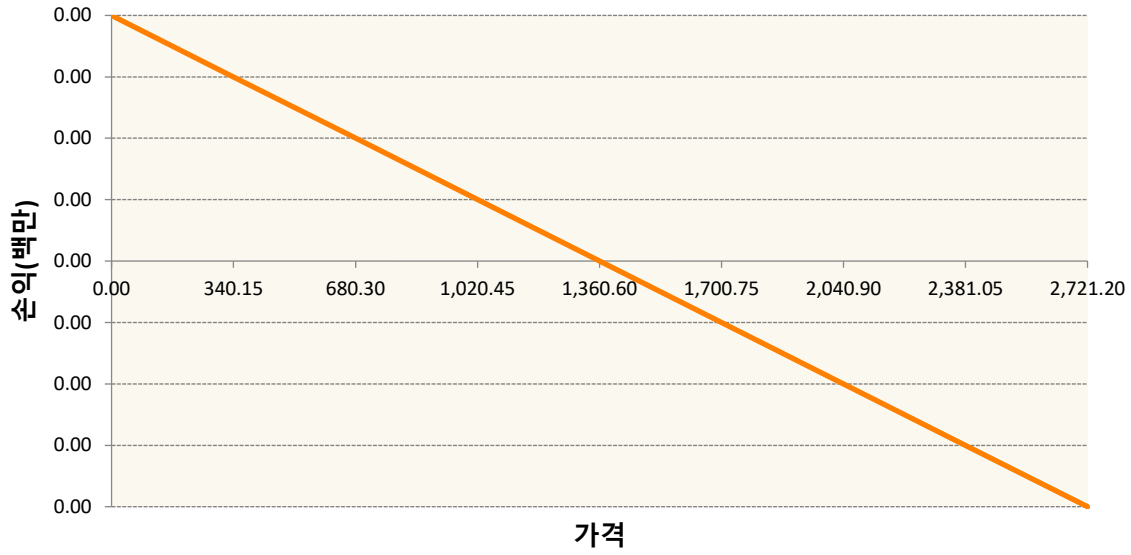
EON4-E-MINI NATURAL GAS Jul24



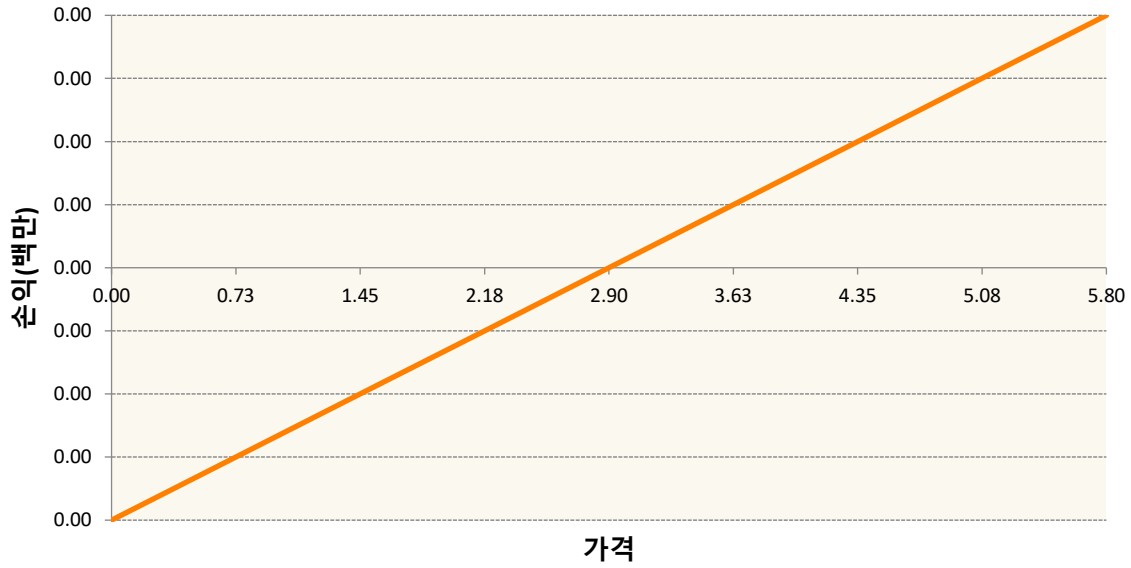
HON4-NY Harb ULSD Fut Jul24



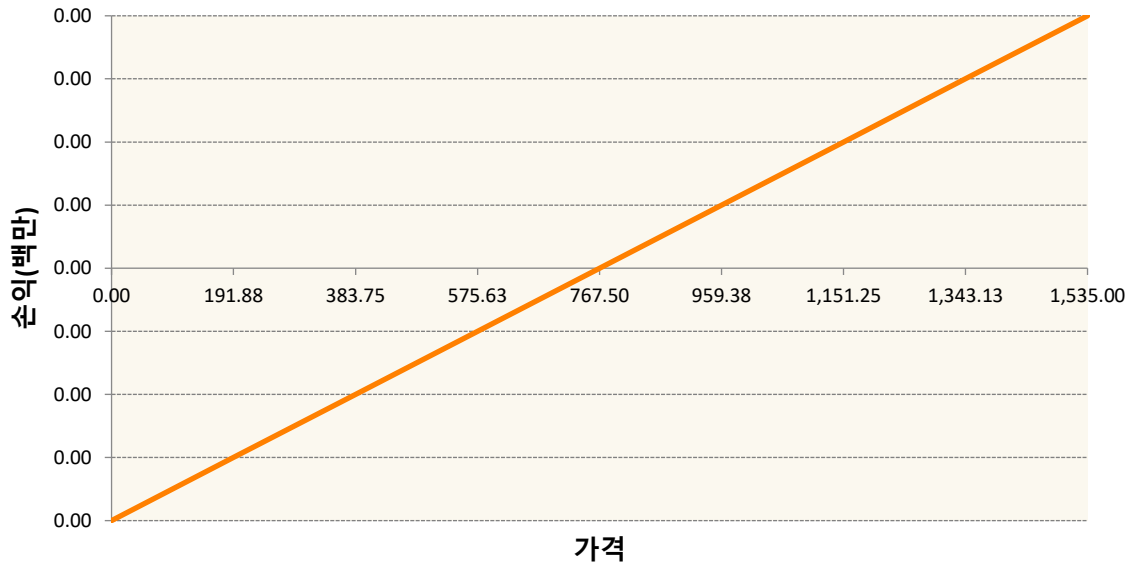
KR4175V60006-2024-06 달러선물

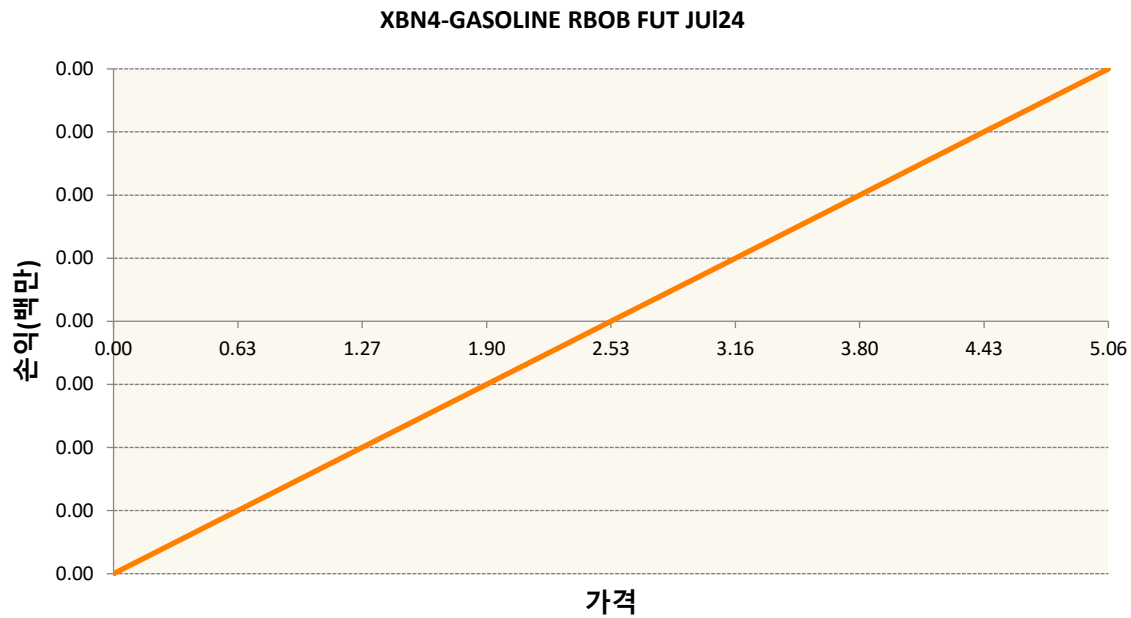


NGN24-NATURAL GAS FUTR JUL24



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	4
EON4	E-MINI NATURAL GAS JUL24	2
HON4	NY Harb ULSD Fut Jul24	11
KR4175V600 2024-06 달러선물		15
NGN24	NATURAL GAS FUTR JUL24	19
QSN4	Low Su Gasoil G JUL24	8
XBN4	GASOLINE RBOB FUT JUL24	12

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