

공시일 2024-07-04

기준일 2024-07-03

베스트장기채(채권-파생형)

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	2024-07-04
기준일	2024-07-03

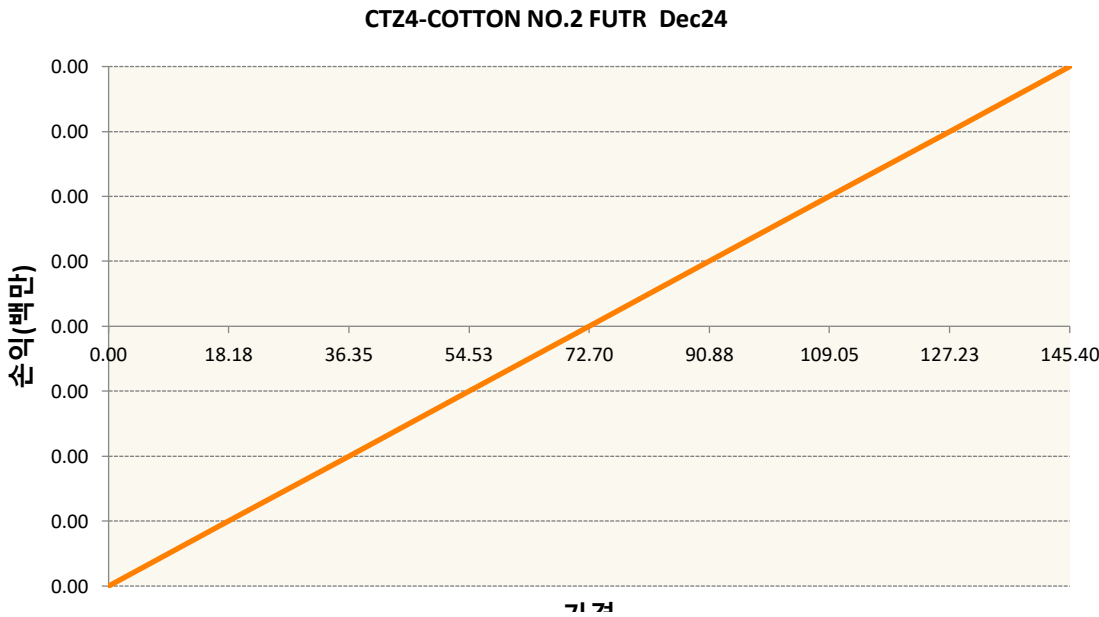
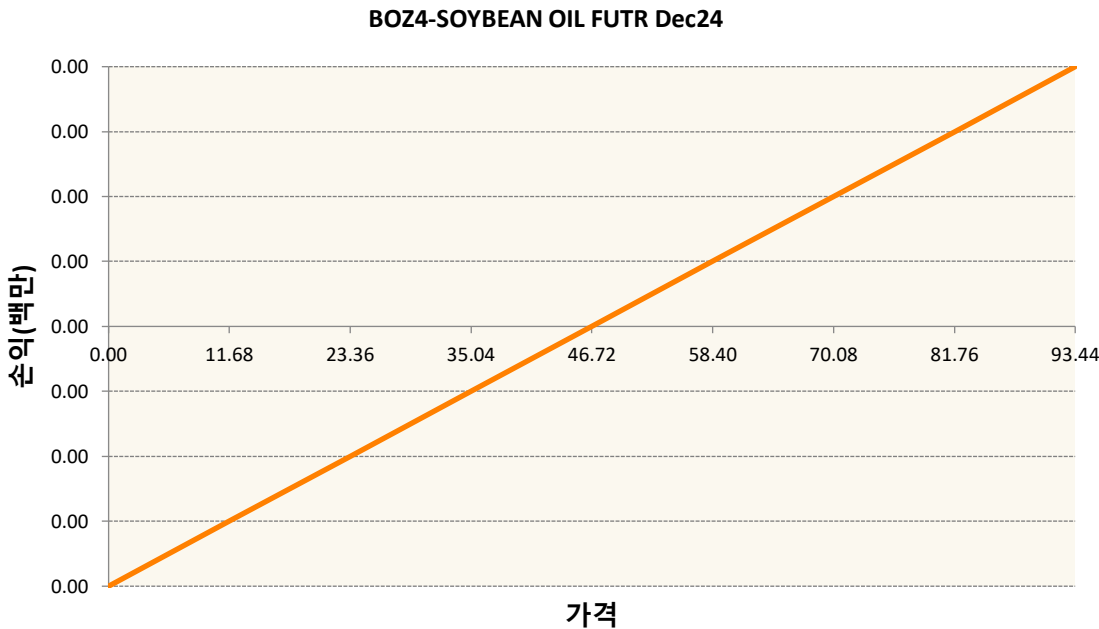
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

(단위:USD 백만)

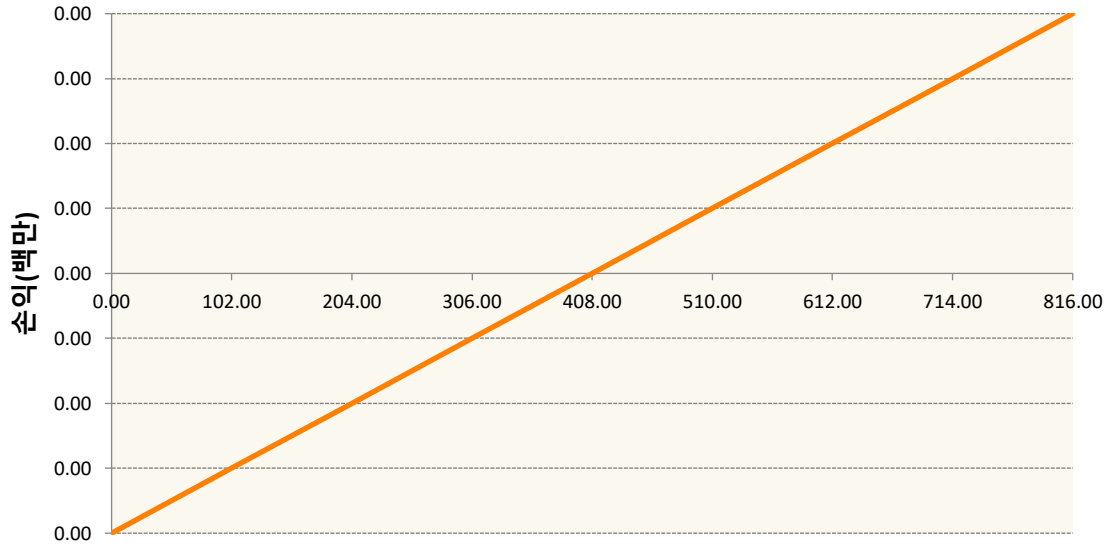
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	4,045	0	4,045	
누계	통화	선물	0	320	-320	장내

2. 만기시점의 손익구조



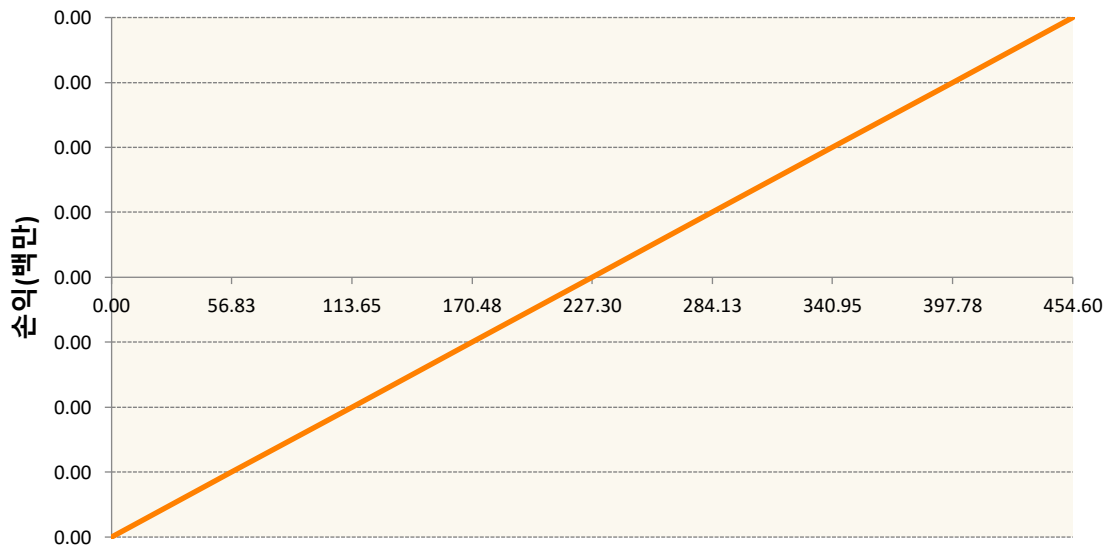
가격

CU4-CORN FUTURE Sep24



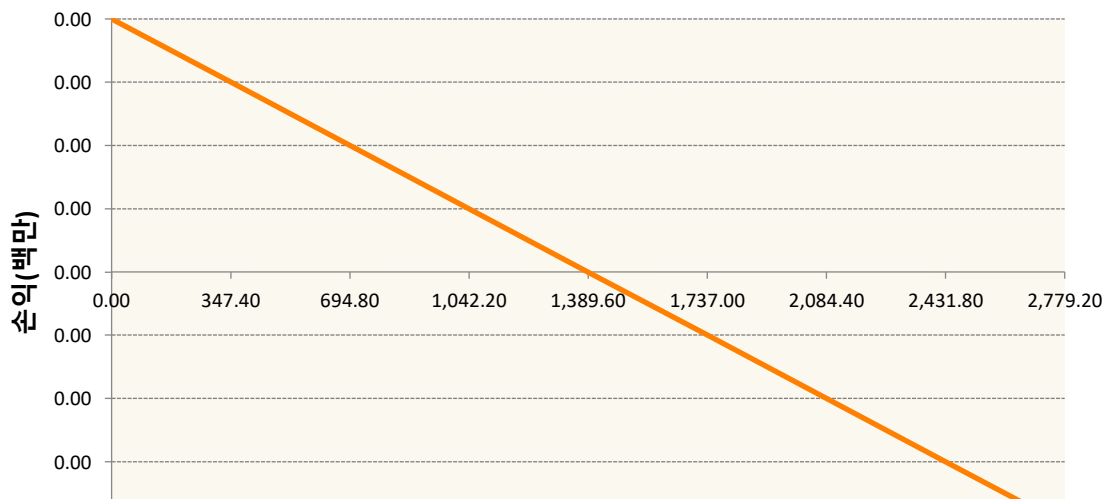
가격

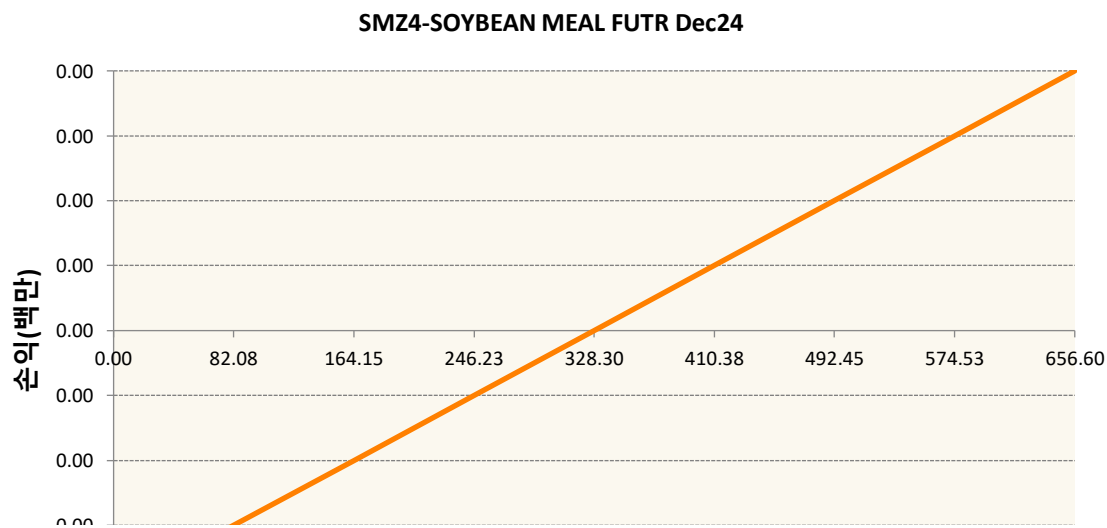
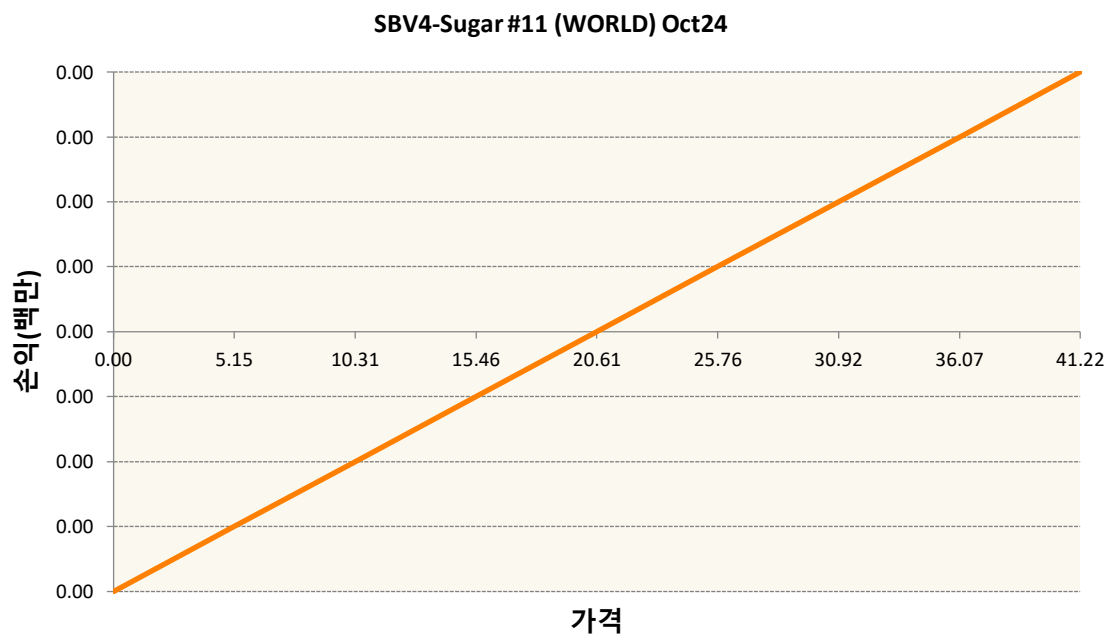
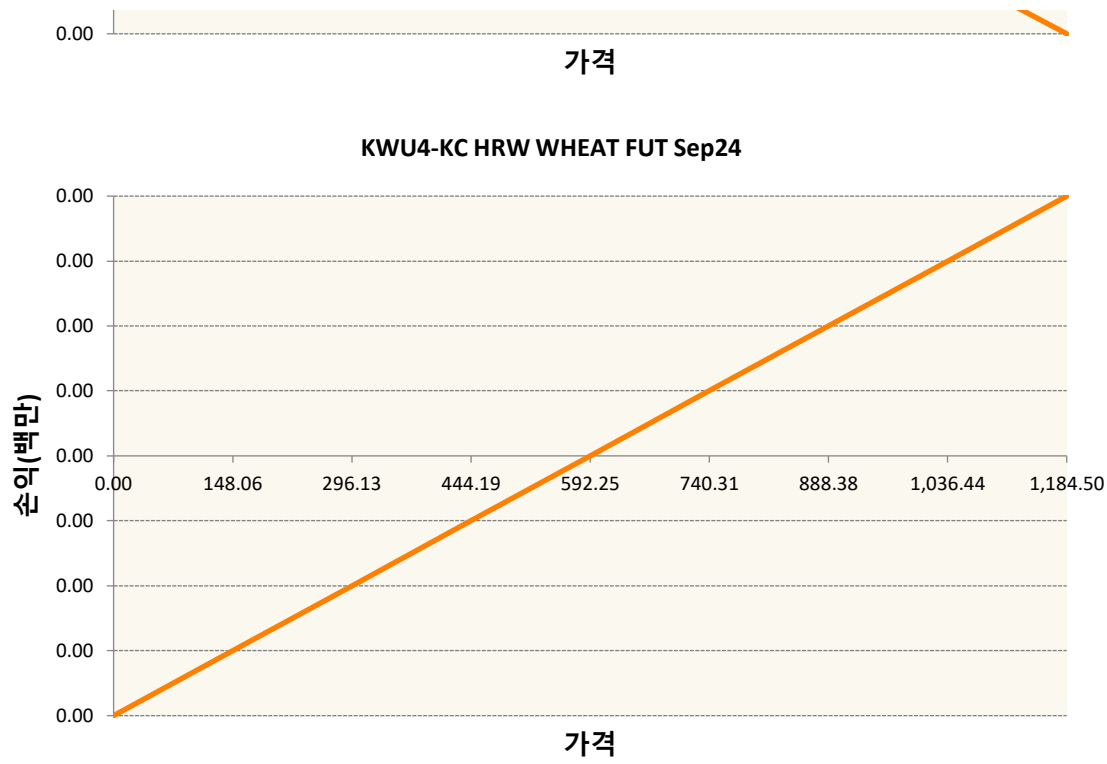
KCU4-COFFEE 'C' FUTURE Sep24

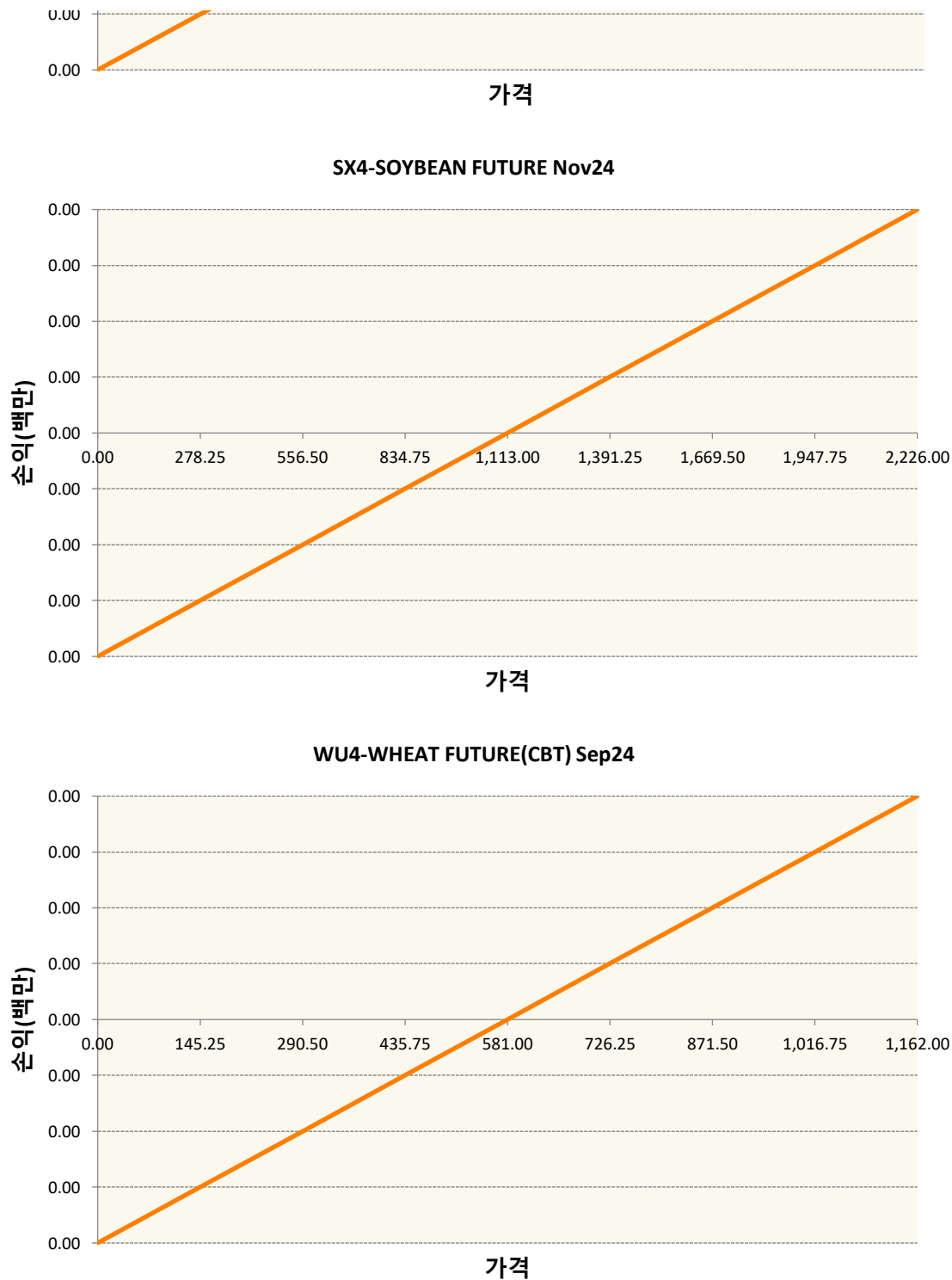


가격

KR4175V70005-2024-07 달러선물







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

공시일	2024-07-04
기준일	2024-07-03

스마트인덱스모

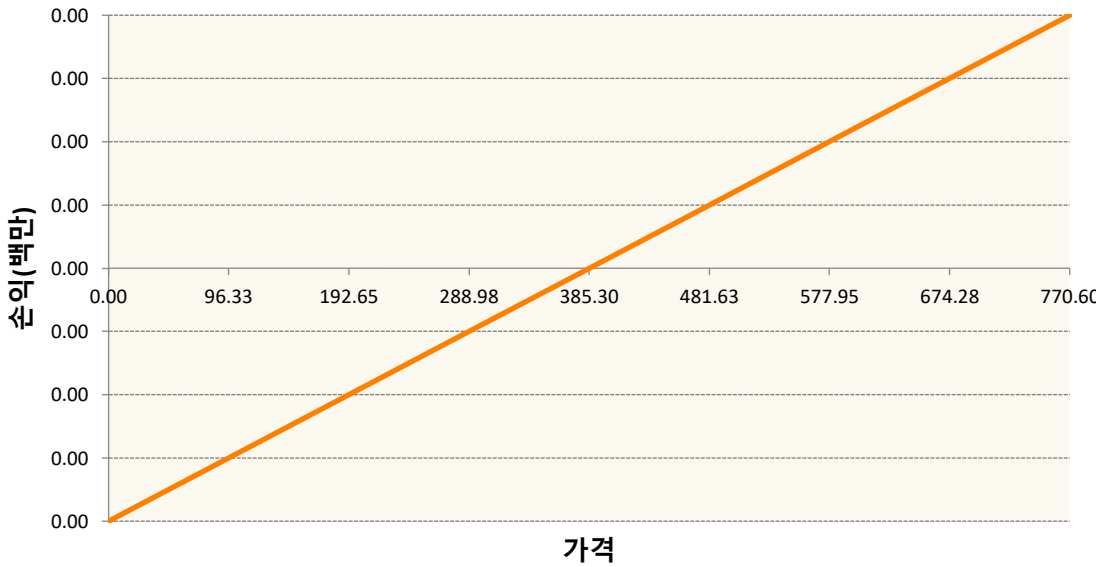
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	1,544	0	1,544	장내
누계	유가증권	선물	2,215	0	2,215	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101V90009-2024-09 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101V90009			2024-09 코스피200지수선물				176
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-176	-176	-176	-176	-176	-176	-176
-5.33%	-118	-118	-118	-118	-118	-118	-118
-2.67%	-59	-59	-59	-59	-59	-59	-59
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	59	59	59	59	59	59	59
5.33%	118	118	118	118	118	118	118
8.00%	176	176	176	176	176	176	176

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

(단위:백만원)

174

공시일	2024-07-04
기준일	2024-07-03

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	3,271	0	3,271	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
SWCSI5000C 신한CSI500미래231226	248

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	300

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2024-07-04
기준일	2024-07-03

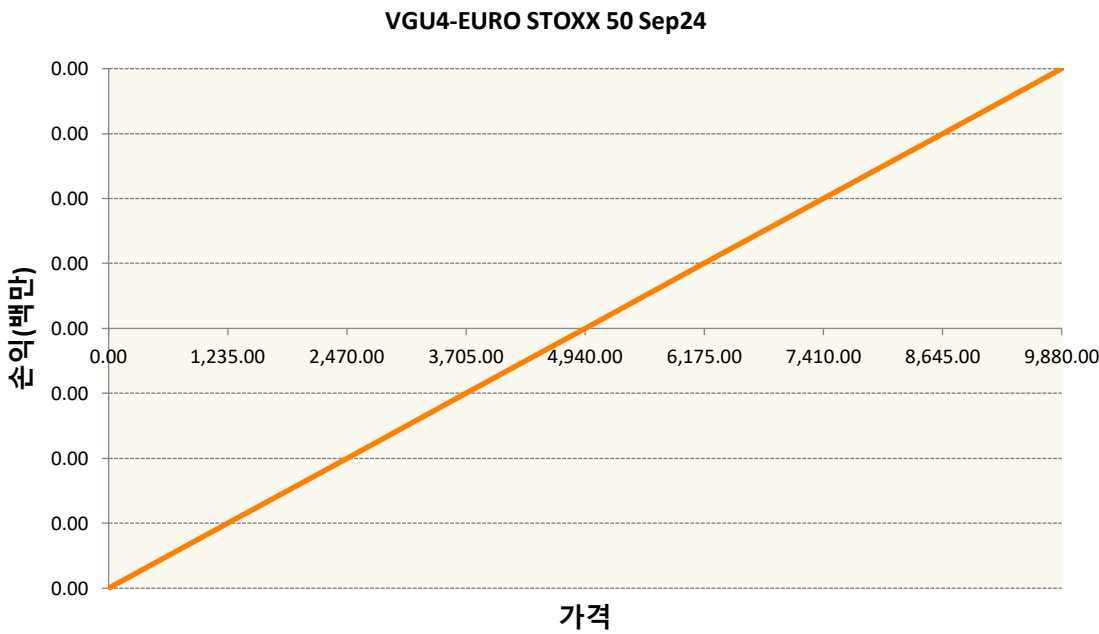
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	952	0	952	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGU4	EURO STOXX 50 Sep24	76
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

51

공시일	2024-07-04
기준일	2024-07-03

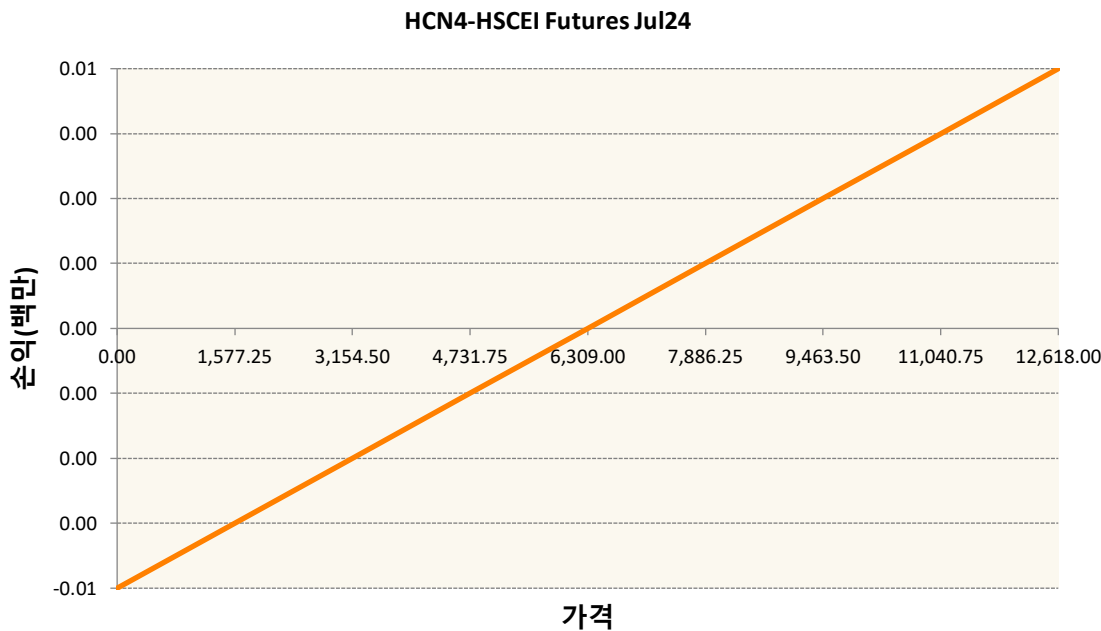
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,570	0	1,570	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCN4	HSCEI Futures Jul24	126
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

155

공시일	2024-07-04
기준일	2024-07-03

커버드콜모(주식혼합-파생형)

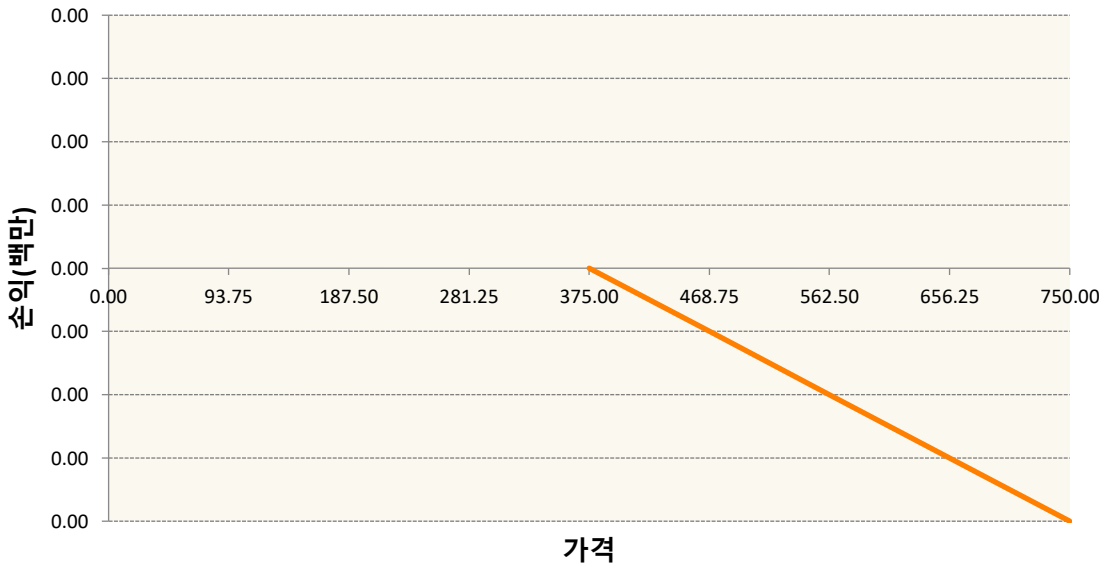
1. 계약금액

(단위:백만원)

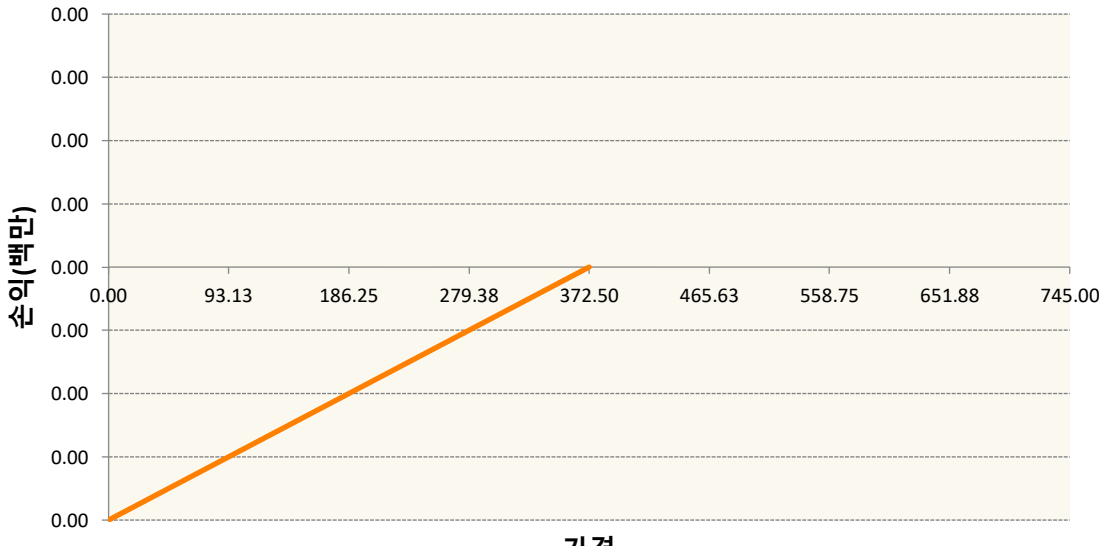
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	44,875	-44,875	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4201V73755-2024-07 콜375

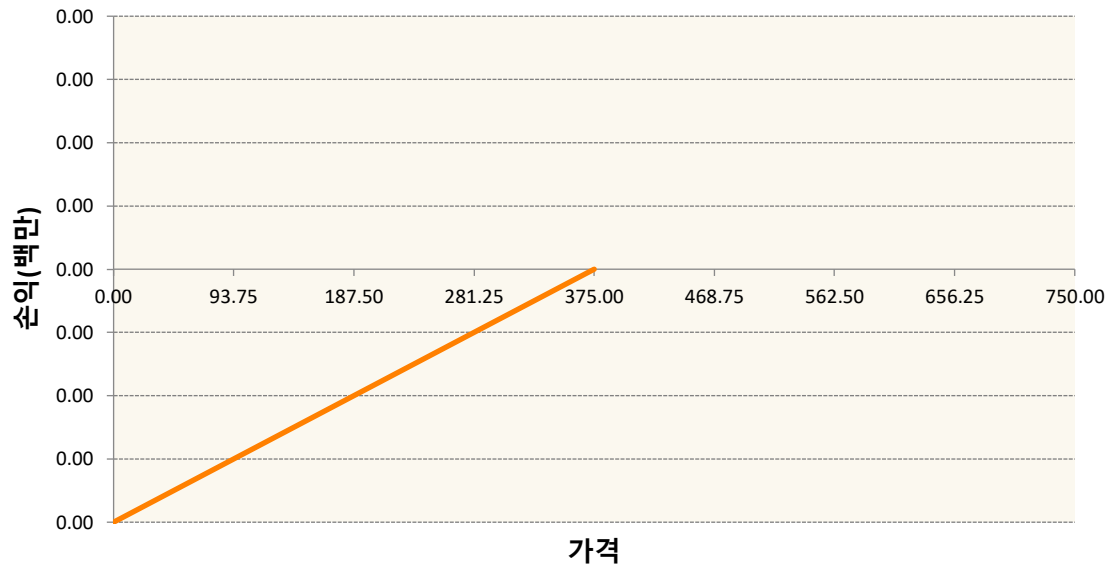


KR4301V73720-2024-07 풋372.5



가격

KR4301V73753-2024-07 풋375



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201V73755 2024-07 콜375		2,797					
		기초자산의 변동성					
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,102	1,094	1,084	1,070	1,054	1,035	1,013
-5.33%	1,033	1,004	972	938	902	864	825
-2.67%	750	701	651	602	553	503	454
0%	124	84	43	0	-44	-89	-134
2.67%	-768	-784	-804	-827	-853	-882	-913
5.33%	-1,763	-1,767	-1,772	-1,780	-1,791	-1,805	-1,821
8.00%	-2,780	-2,780	-2,781	-2,783	-2,786	-2,791	-2,797
KR4301V73720 2024-07 풋372.5		237					
		기초자산의 변동성					
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-223	-224	-226	-228	-231	-234	-237
-5.33%	-108	-113	-117	-122	-127	-132	-138
-2.67%	-26	-32	-38	-44	-51	-57	-63
0%	13	9	5	0	-5	-10	-15
2.67%	24	23	21	19	16	13	10
5.33%	26	26	25	25	24	22	21
8.00%	26	26	26	26	26	25	25
KR4301V73753 2024-07 풋375		154					
		기초자산의 변동성					
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-147	-148	-148	-149	-151	-152	-154
-5.33%	-76	-78	-80	-83	-85	-88	-91

-2.67%	-20	-24	-28	-31	-35	-39	-43
0%	9	6	3	0	-3	-7	-10
2.67%	19	18	16	14	12	10	8
5.33%	21	20	20	19	19	18	16
8.00%	21	21	21	21	20	20	20

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

(단위:백만원)

3,495

공시일	2024-07-04
기준일	2024-07-03

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	1,170	0	1,170	

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	2024-07-04
기준일	2024-07-03

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	4,205	0	4,205	

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	2024-07-04
기준일	2024-07-03

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	14,690	0	14,690	
누계	통화	선도	0	14,580	-14,580	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213E4S(KRW/USD 31-07-24E	199
FXW213E5W KRW/USD 30-08-24E	595
FXW213E6S(KRW/USD 30-09-24E	373
IE00BD8RGM75	

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

528

공시일	2024-07-04
기준일	2024-07-03

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

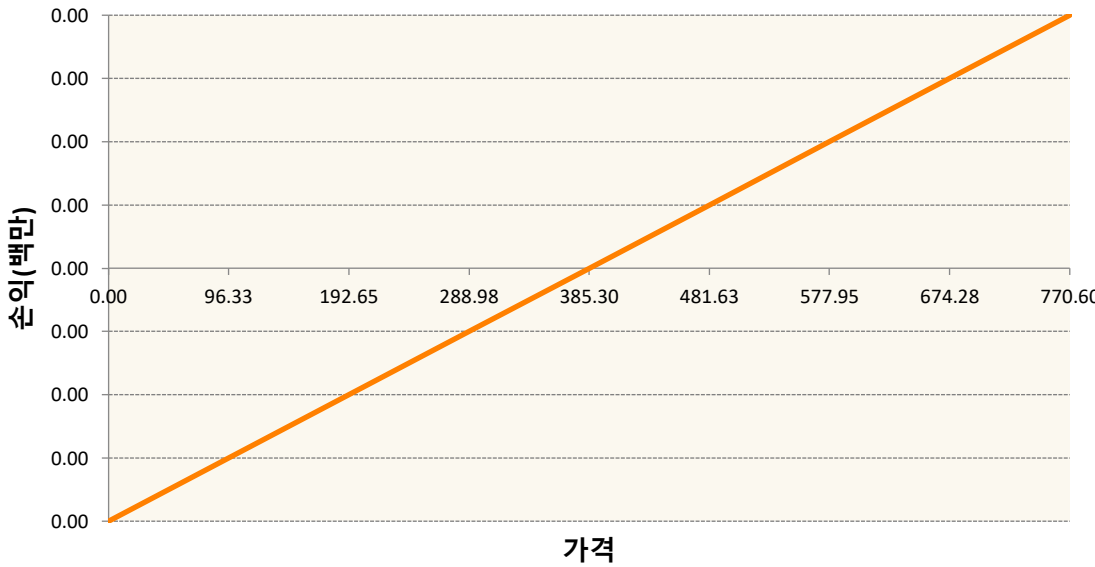
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	963	0	963	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101V90009-2024-09 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101V90009			2024-09 코스피200지수선물				77
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-77	-77	-77	-77	-77	-77	-77
-5.33%	-51	-51	-51	-51	-51	-51	-51
-2.67%	-26	-26	-26	-26	-26	-26	-26
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	26	26	26	26	26	26	26
5.33%	51	51	51	51	51	51	51
8.00%	77	77	77	77	77	77	77

공시일	2024-07-04
기준일	2024-07-03

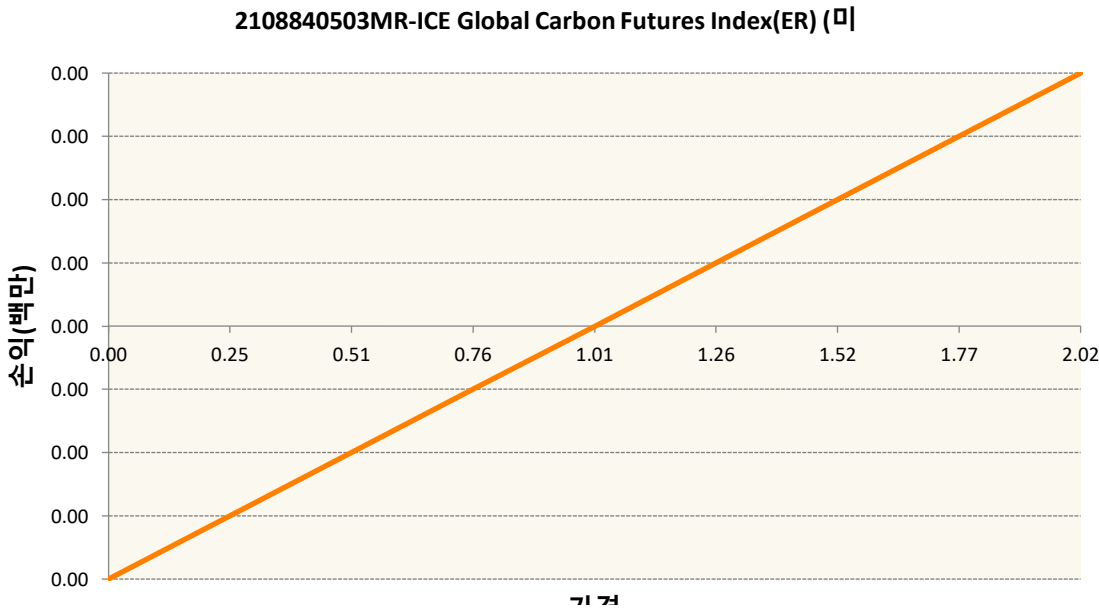
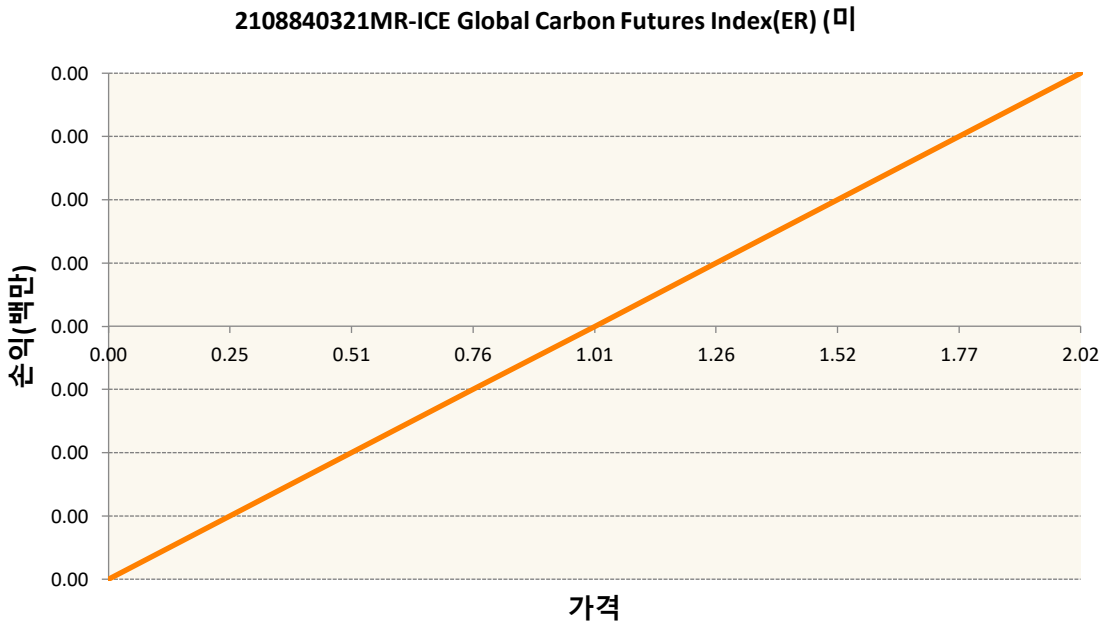
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

1. 계약금액

(단위:백만원)

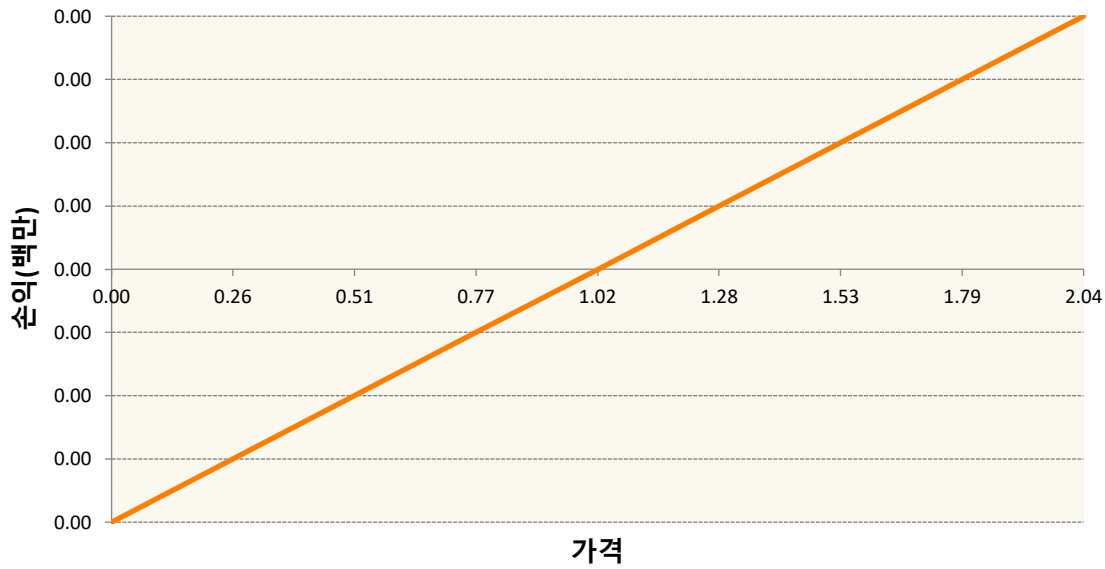
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	16,788	0	16,788	

2. 만기시점의 손익구조

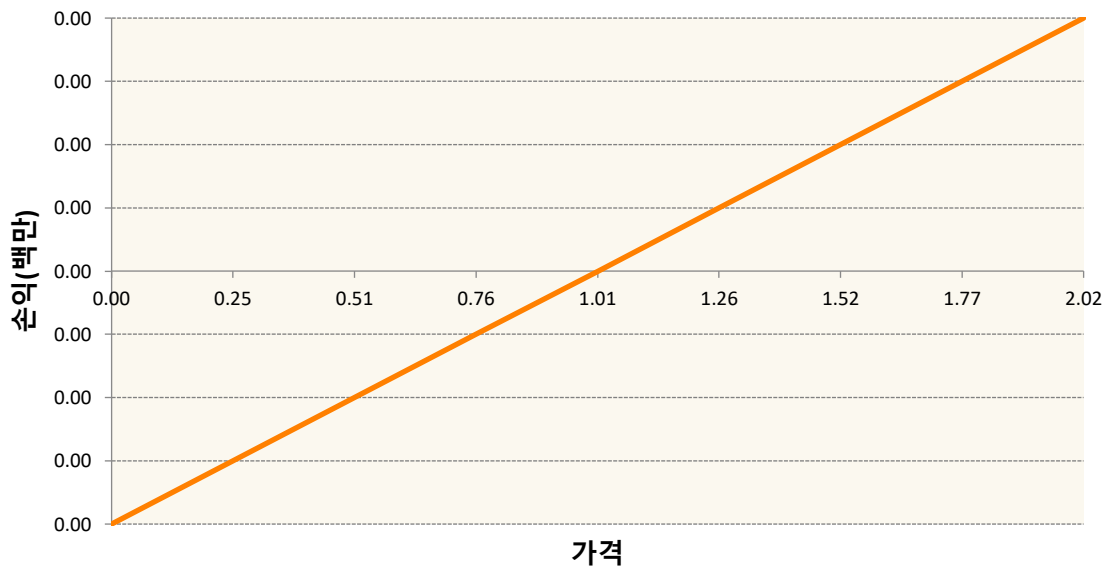


가격

2108840610KM-ICE Global Carbon Futures Index(ER) (키



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



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2108840321 ICE Global Carbon Futures Index(ER) (미	517
2108840503 ICE Global Carbon Futures Index(ER) (미	207
2108840610 ICE Global Carbon Futures Index(ER) (키	413
2108840920 ICE Global Carbon Futures Index(ER) (메	207

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

(단위:백만원)

1,529

공시일	2024-07-04
기준일	2024-07-03

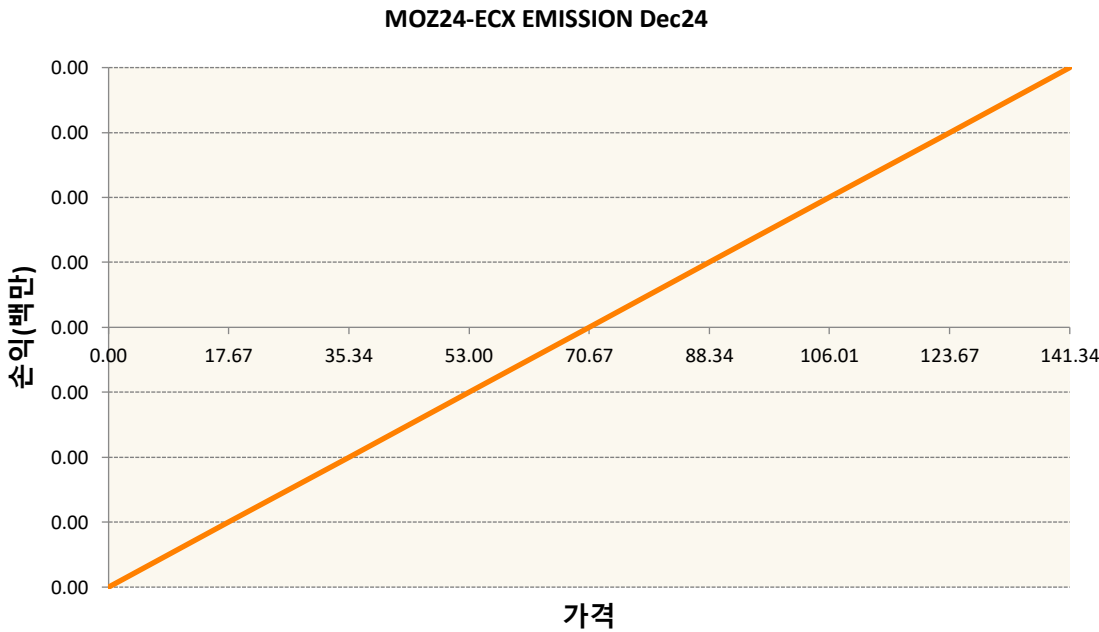
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	9,499	0	9,499	
누계	지수	스왑	373	0	373	장외
누계	통화	선도	1,341	2,780	-1,440	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213E6V₩/USD 31-07-24E	107
FXW213E6V₩/EUR 31-07-24E	115
FXW213E6VUSD/₩ 31-07-24E	107
MOZ24 ECX EMISSION Dec24	760
SWICEUACNICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX	1

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

(단위:백만원)

공시일	2024-07-04
기준일	2024-07-03

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	4,278	0	4,278	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI0000C 신한CSI Index 240620 (키움)	8
SWCSI0000C 신한CSI Index 240620 (미래)	12
SWCSI0000C 신한CSI Index 240620 (메리츠)	12
SWCSI0000C 신한CSI Index 240620 (NH)	8

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

(단위:백만원)

55

공시일	2024-07-04
기준일	2024-07-03

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	5,838	0	5,838	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)	9
SWSTAR000 신한 STAR 50 Index 231226(메리츠)	12
SWSTAR000 신한 STAR 50 Index 231226(키움)	3

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

(단위:백만원)

38

공시일	2024-07-04
기준일	2024-07-03

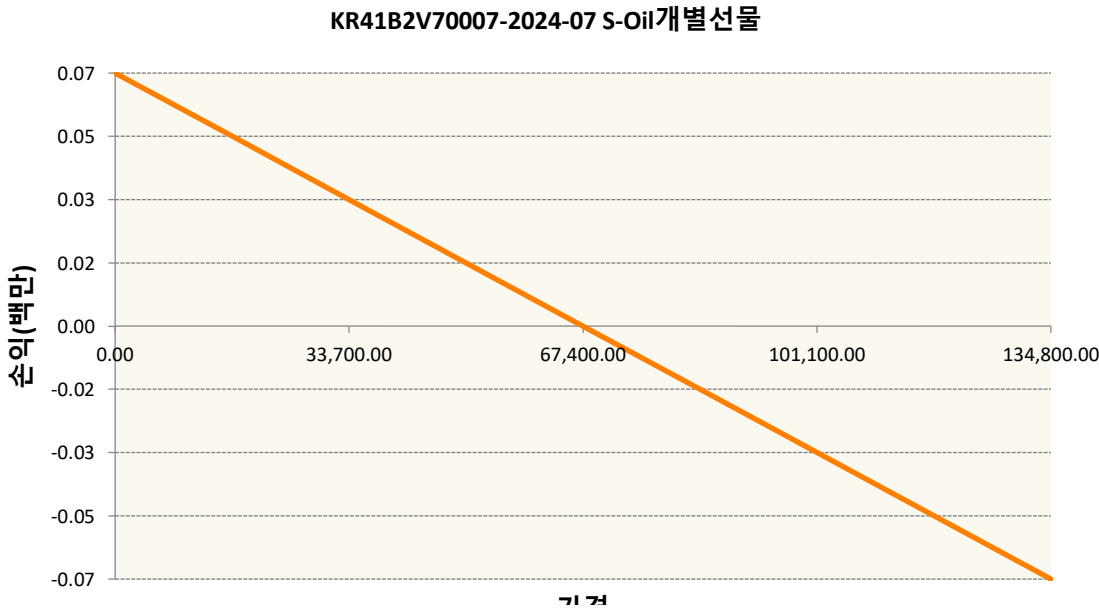
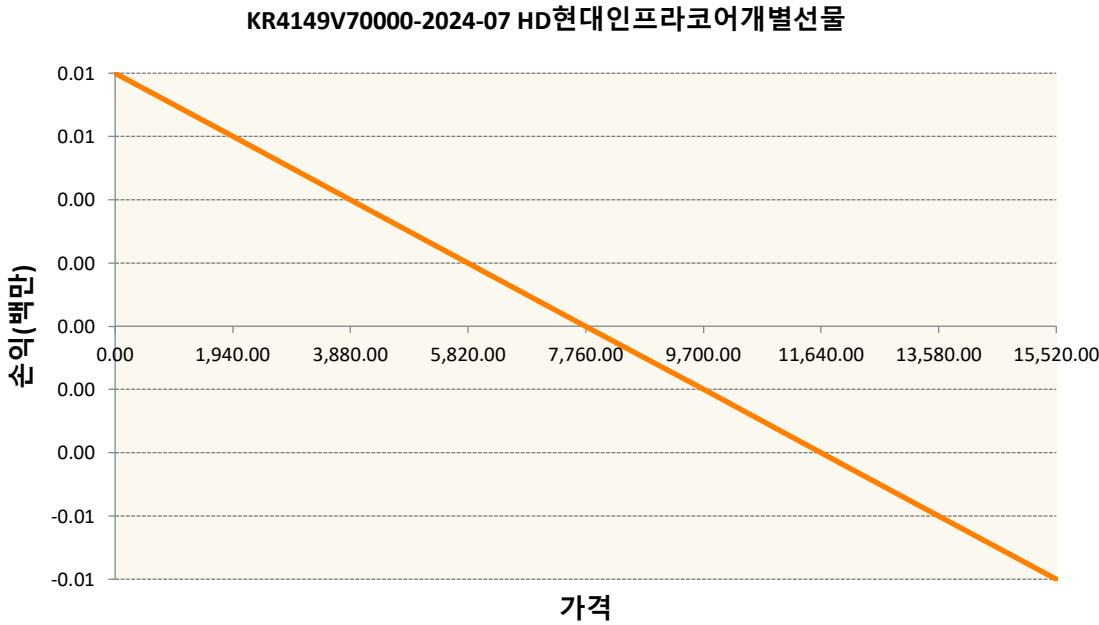
에퀴티알파일반사모혼합자산

1. 계약금액

(단위:백만원)

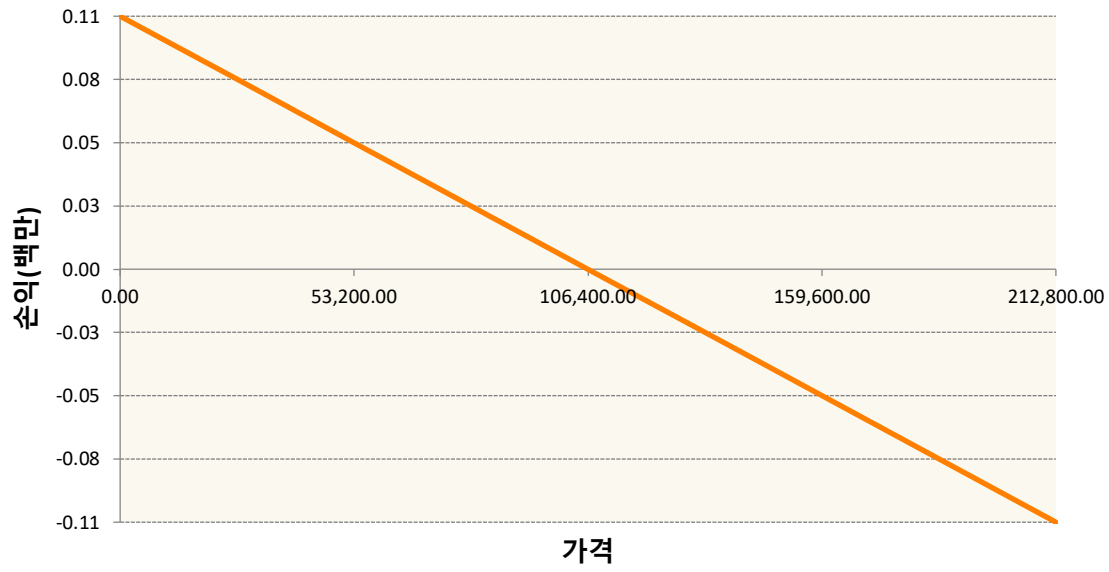
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	14	-14	장내
누계	유가증권	선물	41	69	-28	장내

2. 만기시점의 손익구조

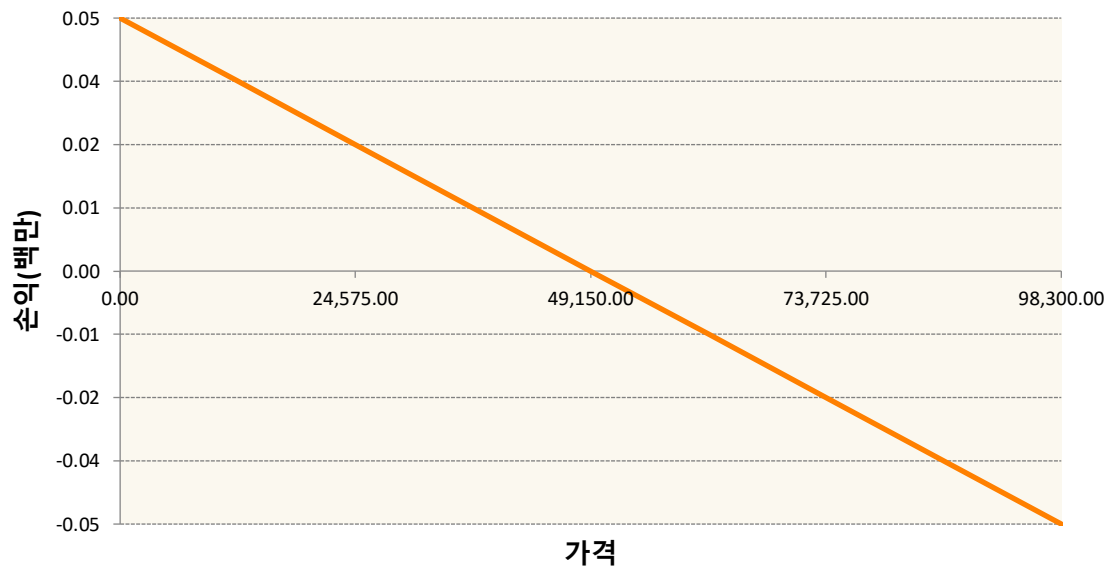


가격

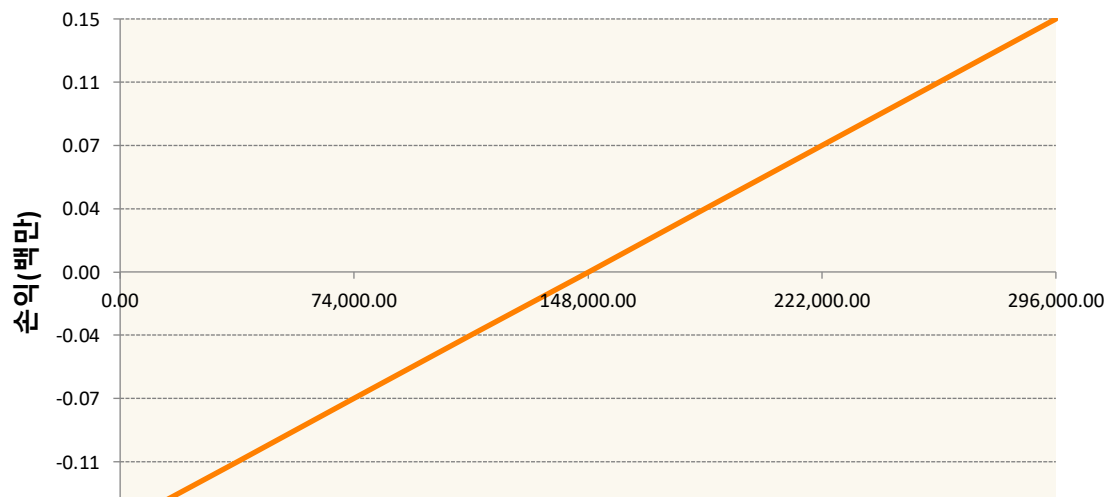
KR41BBV70007-2024-07 롯데케미칼개별선물

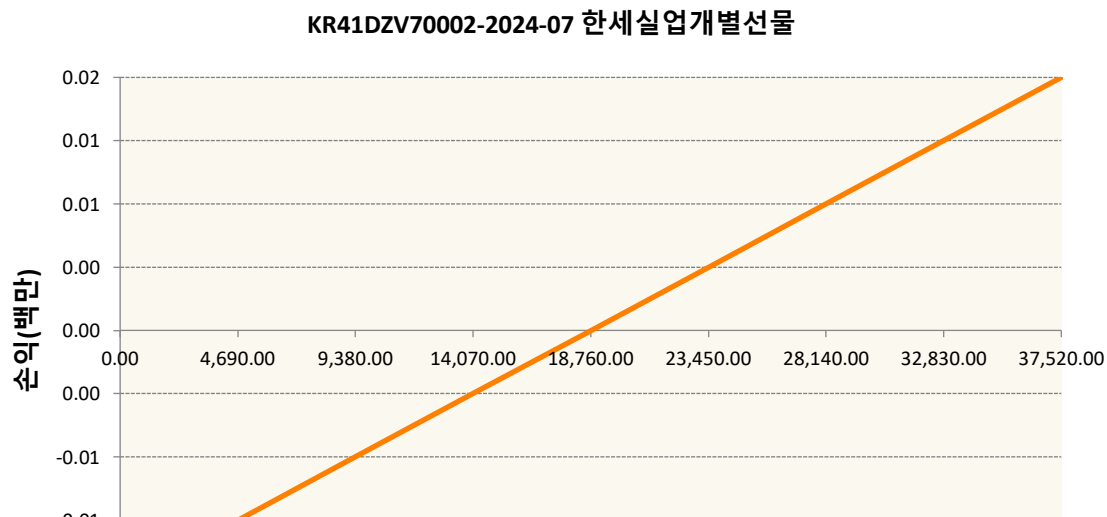
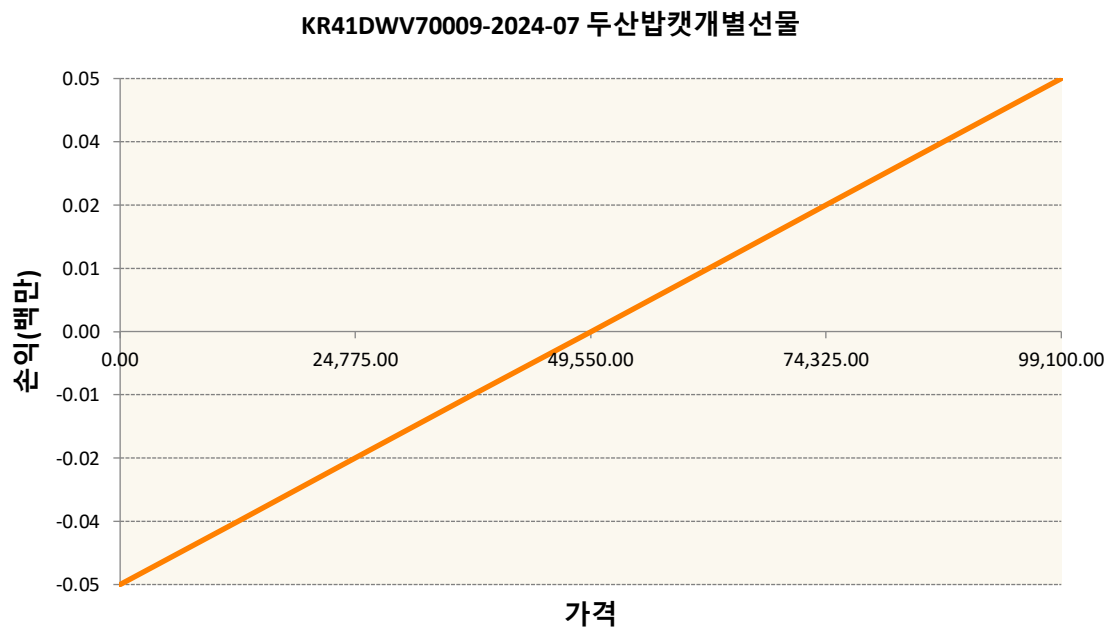
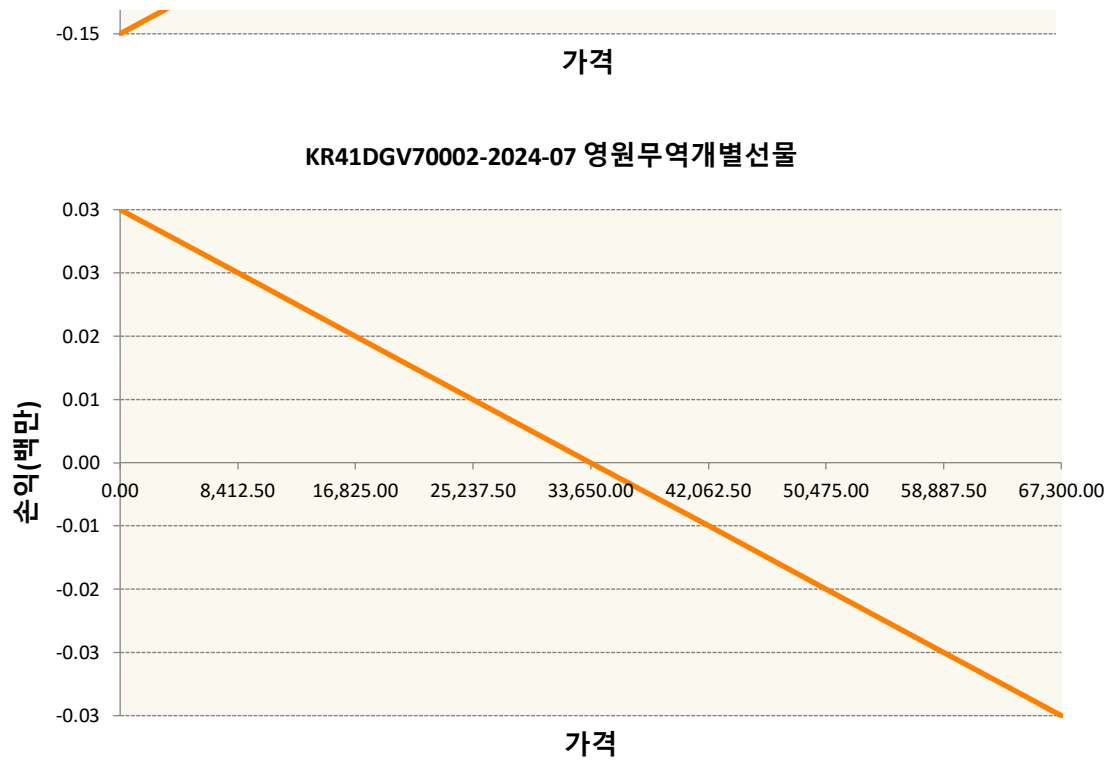


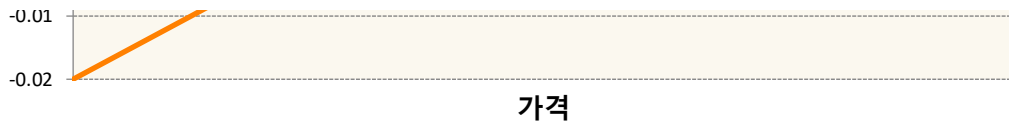
KR41BMV70004-2024-07 한국항공우주개별선물



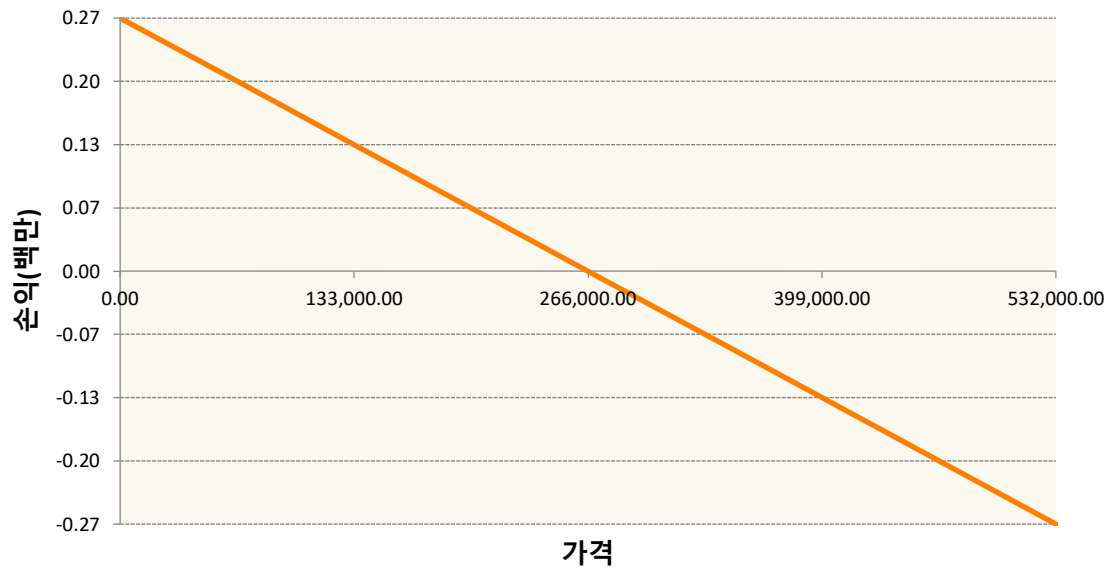
KR41C3V70004-2024-07 금호석유개별선물



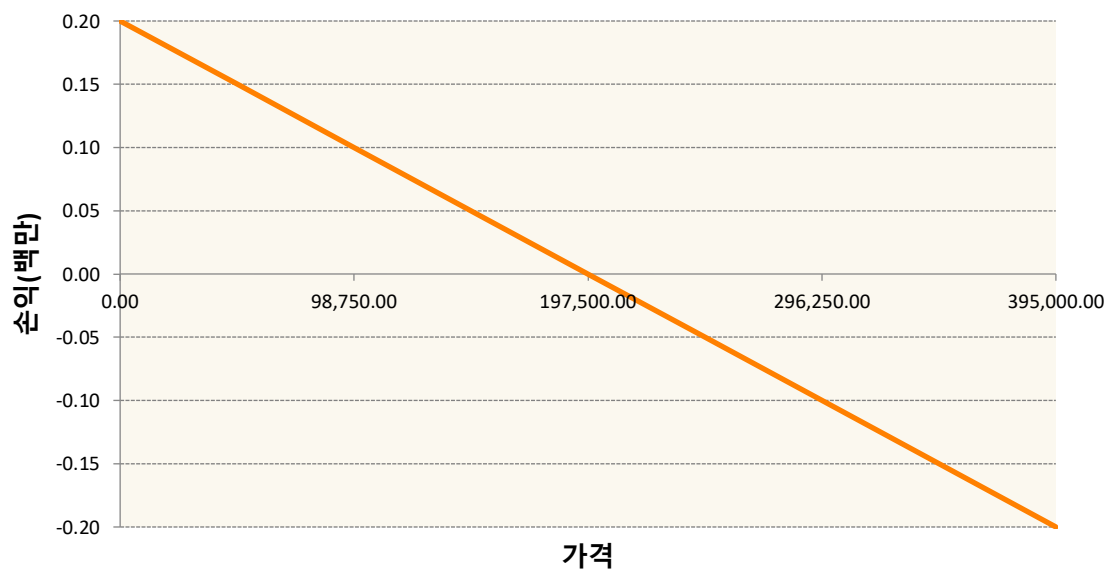




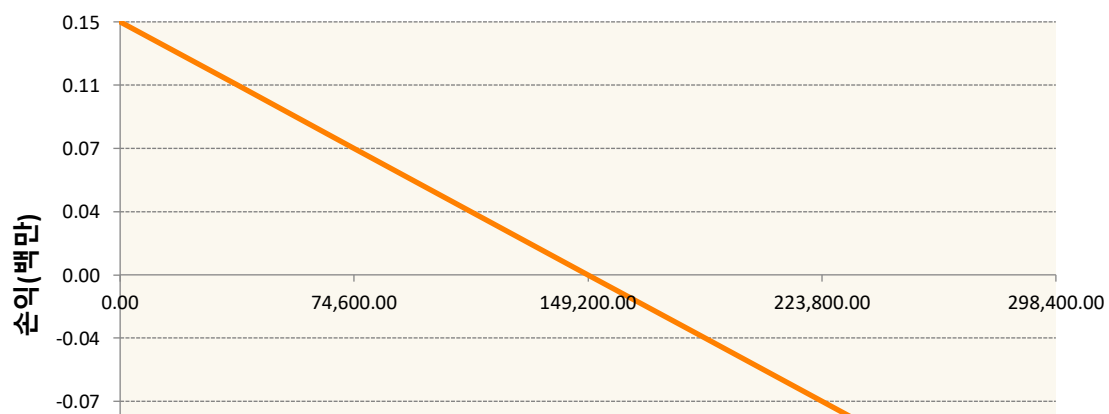
KR41E8V70001-2024-07 포스코퓨처엠개별선물

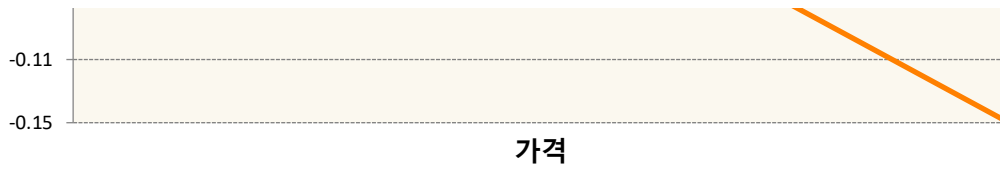


KR41FCV70006-2024-07 하이브개별선물



KR41FMV70005-2024-07 엘앤에프개별선물





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
KR4149V70C 2024-07 HD현대인프라코어개별선물		1
KR41B2V70C 2024-07 S-Oil개별선물		1
KR41BBV70C 2024-07 롯데케미칼개별선물		1
KR41BMV70 2024-07 한국항공우주개별선물		0.39
KR41C3V70C 2024-07 금호석유개별선물		1
KR41DGV70C 2024-07 영원무역개별선물		0.35
KR41DWV7C 2024-07 두산밥캣개별선물		1
KR41DZV70C 2024-07 한세실업개별선물		1
KR41E8V70C 2024-07 포스코퓨처엠개별선물		0.43
KR41FCV70C 2024-07 하이브개별선물		1
KR41FMV70C 2024-07 엘앤에프개별선물		1

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	20

공시일	2024-07-04
기준일	2024-07-03

코리아인덱스(주식-파생형)(종)

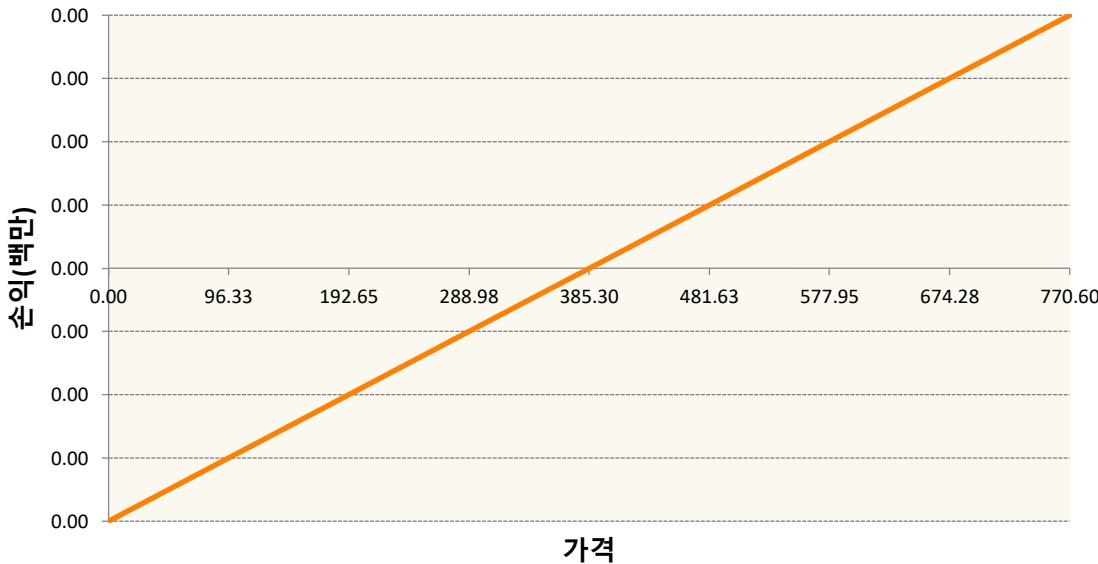
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	3,371	-3,371	장내
누계	유가증권	선물	6,935	0	6,935	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101V90009-2024-09 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101V90009		2024-09 코스피200지수선물					552
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-552	-552	-552	-552	-552	-552	-552
-5.33%	-368	-368	-368	-368	-368	-368	-368
-2.67%	-184	-184	-184	-184	-184	-184	-184
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	184	184	184	184	184	184	184
5.33%	368	368	368	368	368	368	368
8.00%	552	552	552	552	552	552	552

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

(단위:백만원)

546

공시일	2024-07-04
기준일	2024-07-03

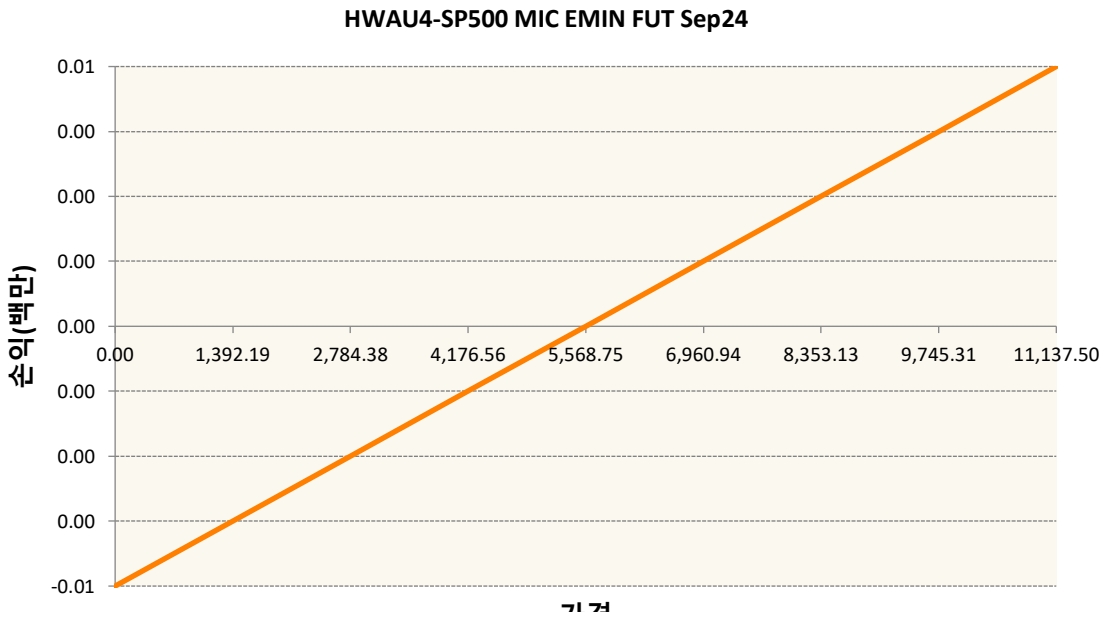
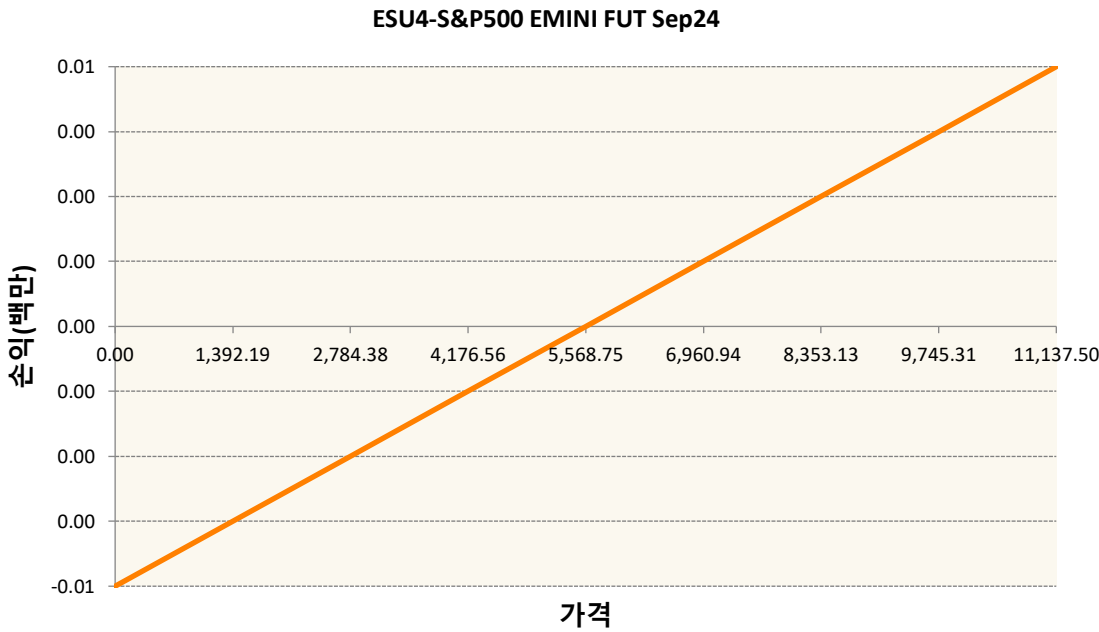
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

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	10,436	0	10,436	
누계	유가증권	선물	2,706	0	2,706	장내

2. 만기시점의 손익구조



가역

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESU4	S&P500 EMINI FUT Sep24	835
HWAU4	SP500 MIC EMIN FUT Sep24	216

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	634

공시일	2024-07-04
기준일	2024-07-03

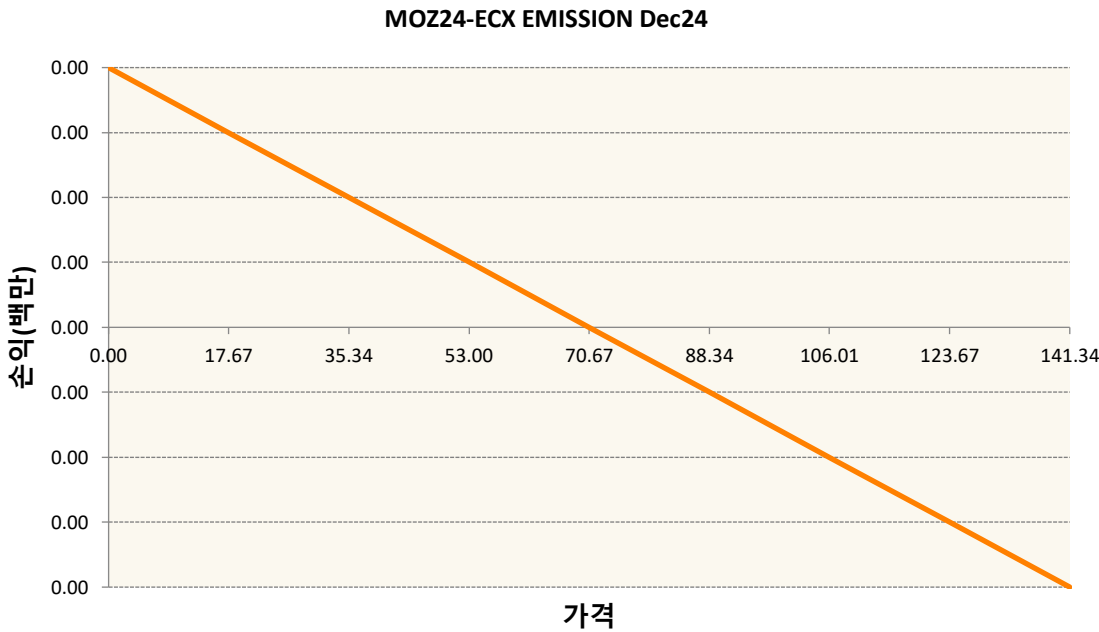
SOL유럽탄소배출권선물인버스ICE특별자산상

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	5,355	-5,355	
누계	지수	스왑	373	0	373	장외
누계	통화	선도	989	2,501	-1,511	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213E6S(KRW/EUR 31-07-24E	36
FXW213E6V(KRW/USD 31-07-24E	79
FXW213E6V(KRW/EUR 31-07-24E	85
FXW213E6V(USD/KRW 31-07-24E	79
MOZ24 ECX EMISSION Dec24	428
SWICEUACNICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX	1

공시일	2024-07-04
기준일	2024-07-03

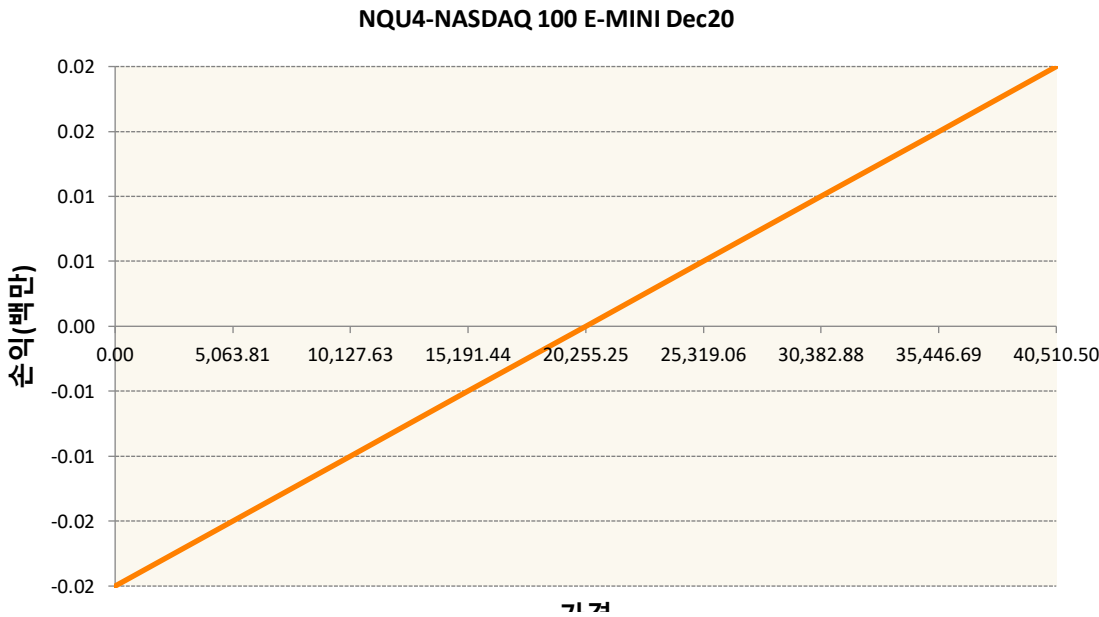
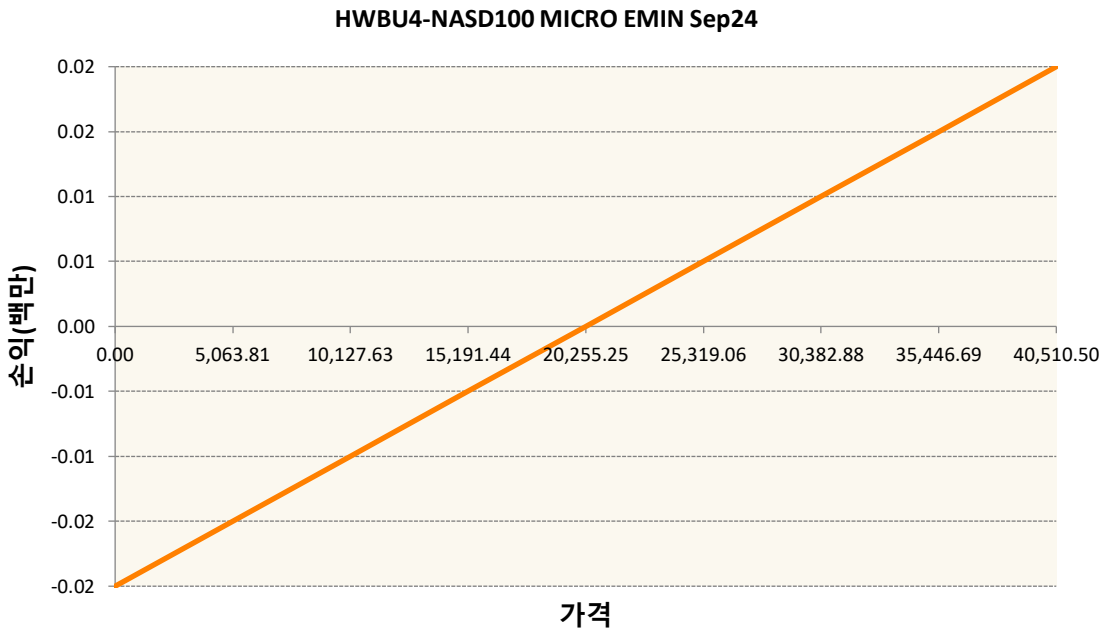
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

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	6,741	0	6,741	
누계	유가증권	선물	3,430	0	3,430	장내

2. 만기시점의 손익구조



가역

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HWBU4	NASD100 MICRO EMIN Sep24	274
NQU4	NASDAQ 100 E-MINI Dec20	539

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	614

공시일	2024-07-04
기준일	2024-07-03

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	166,671	0	166,671	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWKEDI000(KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	691
SWKEDI000(KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	2,296
SWKEDI000(KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	6,497
SWKEDI000(KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	3,580

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

(단위:백만원)

7,904

공시일	2024-07-04
기준일	2024-07-03

SOL미국테크TOP10인버스상장지수(주식혼합)

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	7,960	0	7,960	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

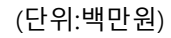
SWSOL0000 SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	24
SWSOL0000 SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	24
SWSOL0000 SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	24
SWSOL0000 SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	24

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

(단위:백만원)

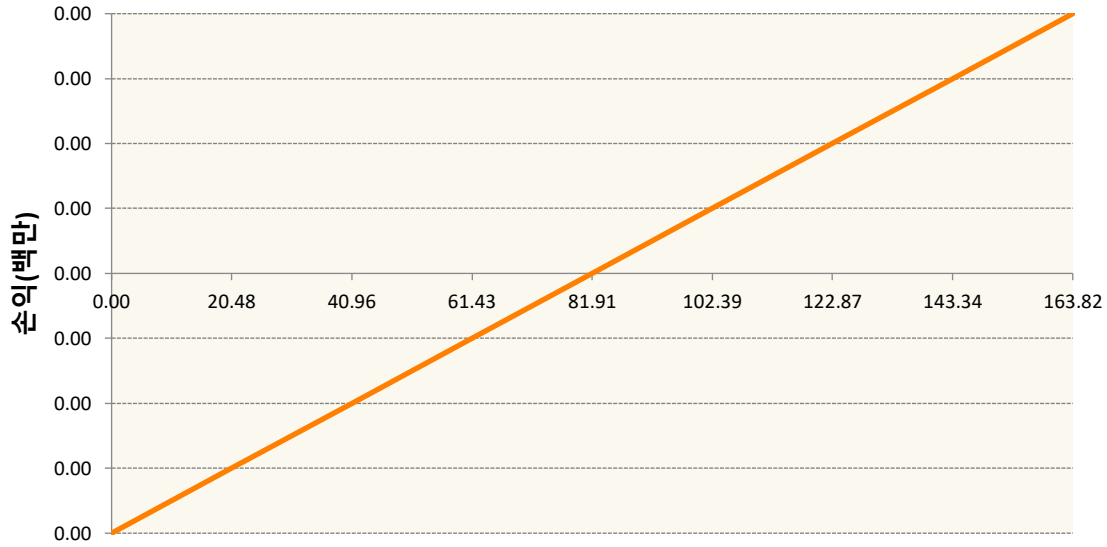
97

기준일 2024-07-03



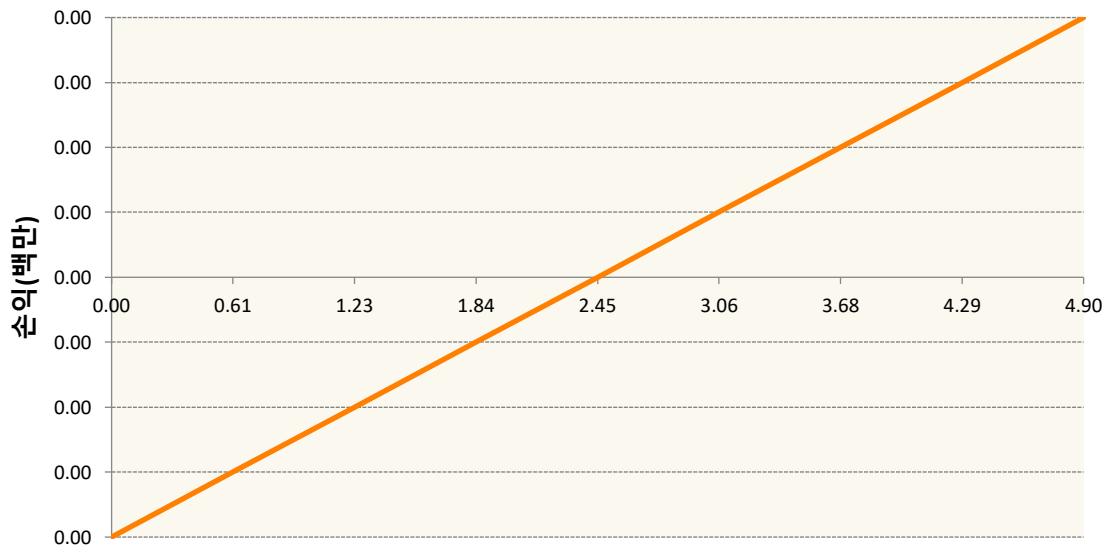
가격

ECU4-E-mini Crude Oil Sep24



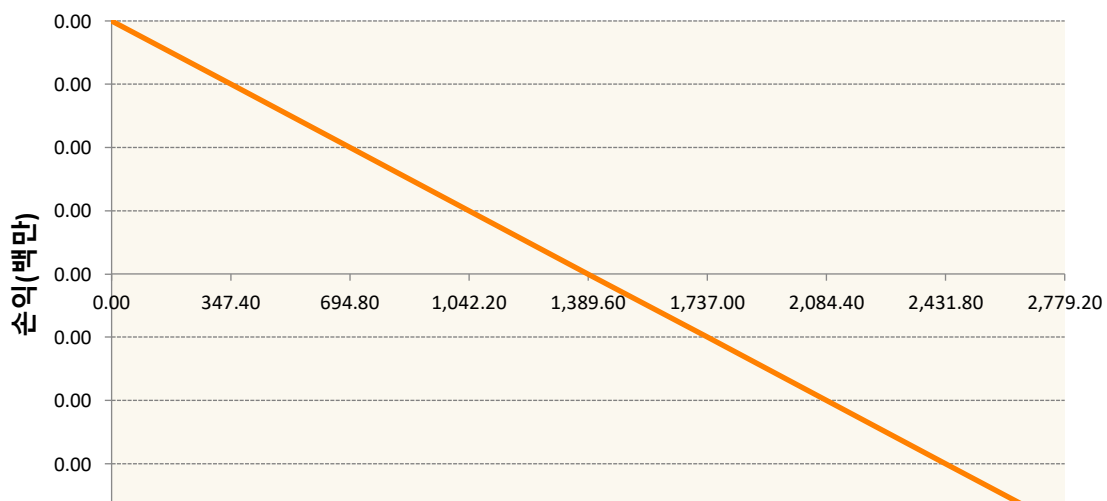
가격

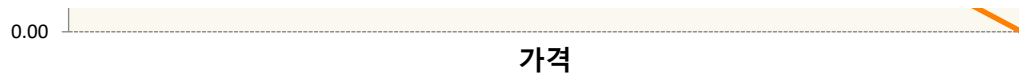
EOU4-E-MINI NATURAL GAS Sep24



가격

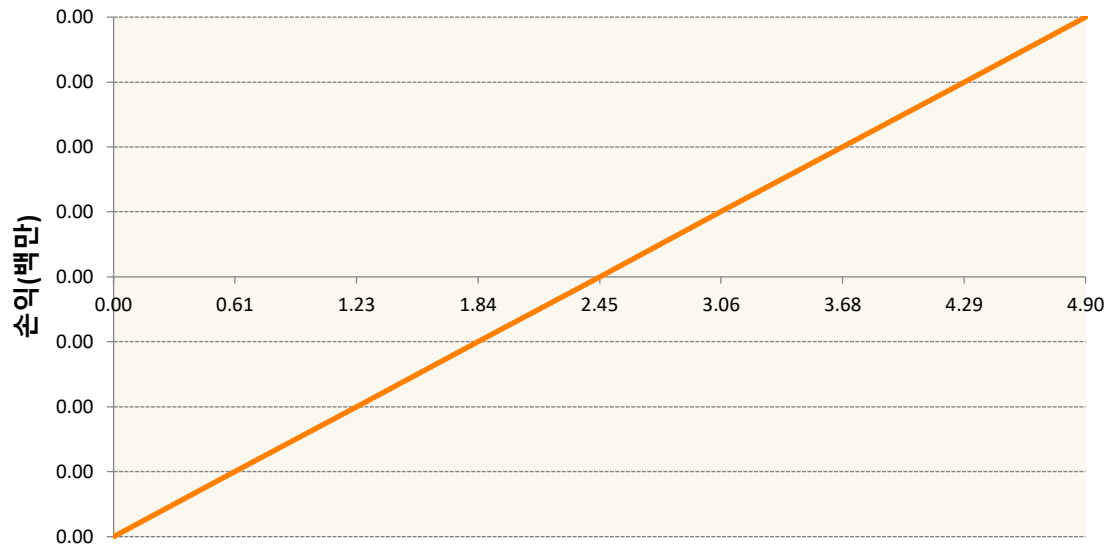
KR4175V70005-2024-07 달러선물





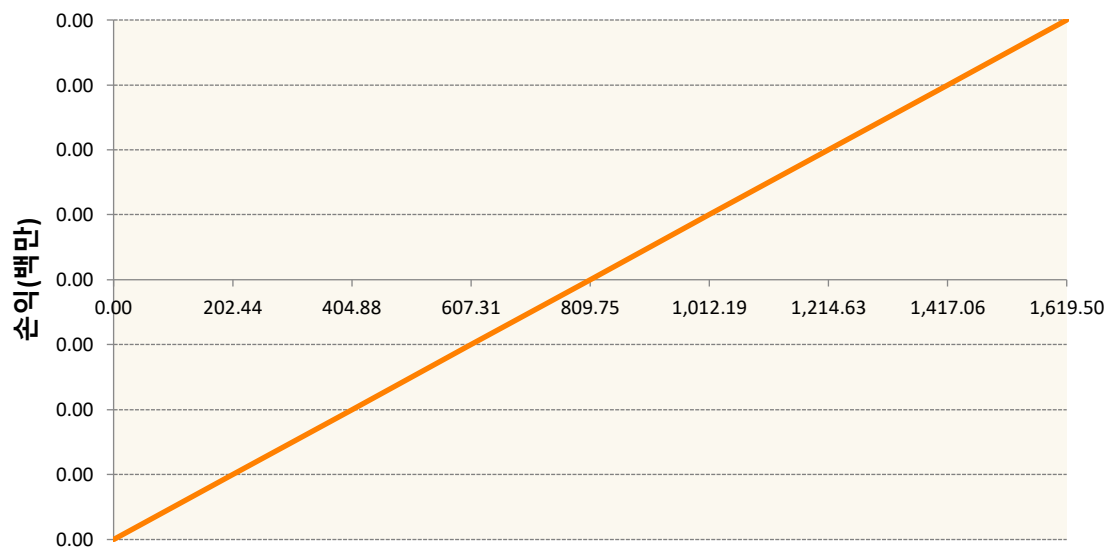
가격

NGU24-NATURAL GAS FUTR Sep24



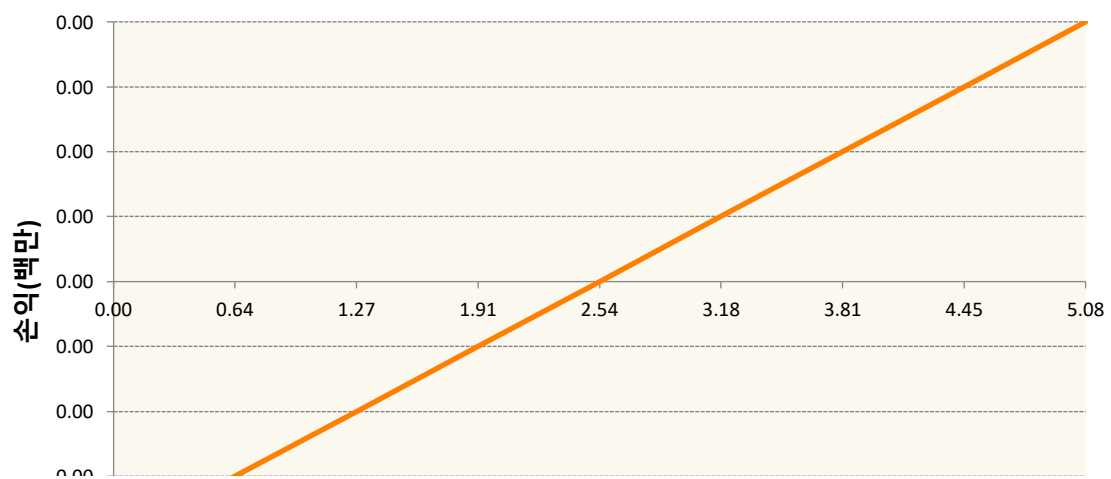
가격

QSU4-Low Su Gasoil G Sep24

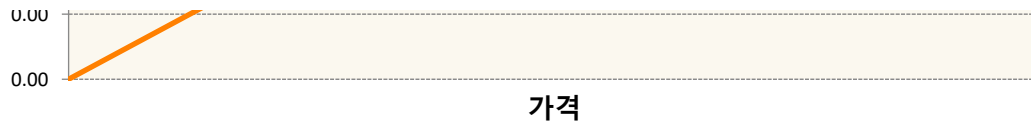


가격

XBU4-GASOLINE RBOB FUT Sep24



손익(백만)



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLU4	WTI CRUDE FUTURE Sep24	9
COU4	BRENT CRUDE FUTR Sep24	19
ECU4	E-mini Crude Oil Sep24	9
EOU4	E-MINI NATURAL GAS Sep24	2
KR4175V70C 2024-07 달러선물		11
NGU24	NATURAL GAS FUTR Sep24	16
QSU4	Low Su Gasoil G Sep24	9
XBU4	GASOLINE RBOB FUT Sep24	12

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

161