

공시일 2024-07-12

기준일 2024-07-11

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	2024-07-12
기준일	2024-07-11

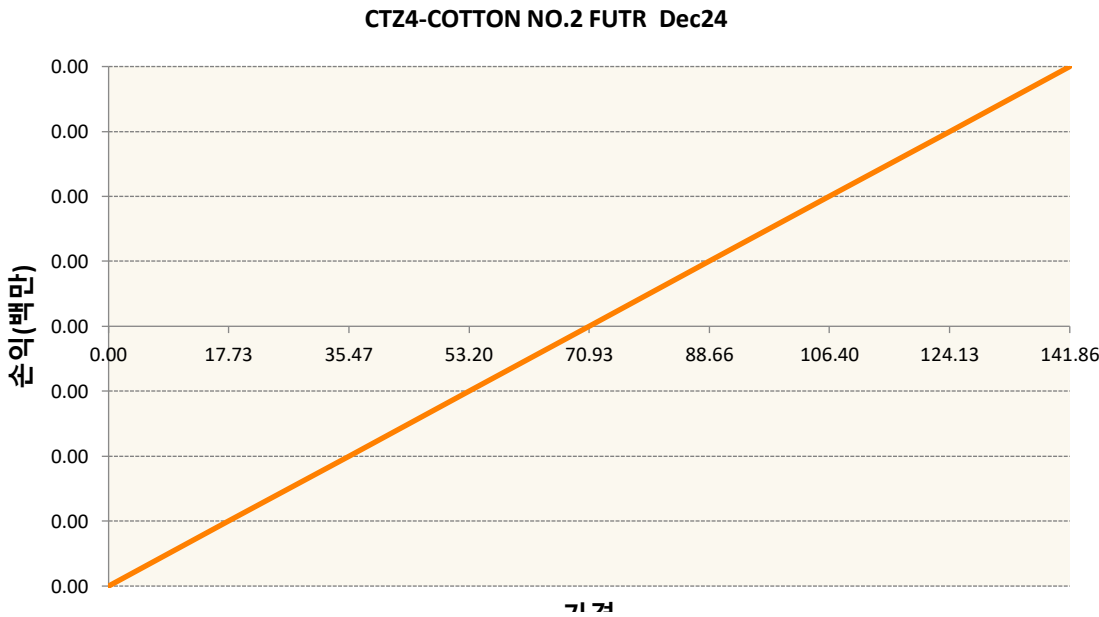
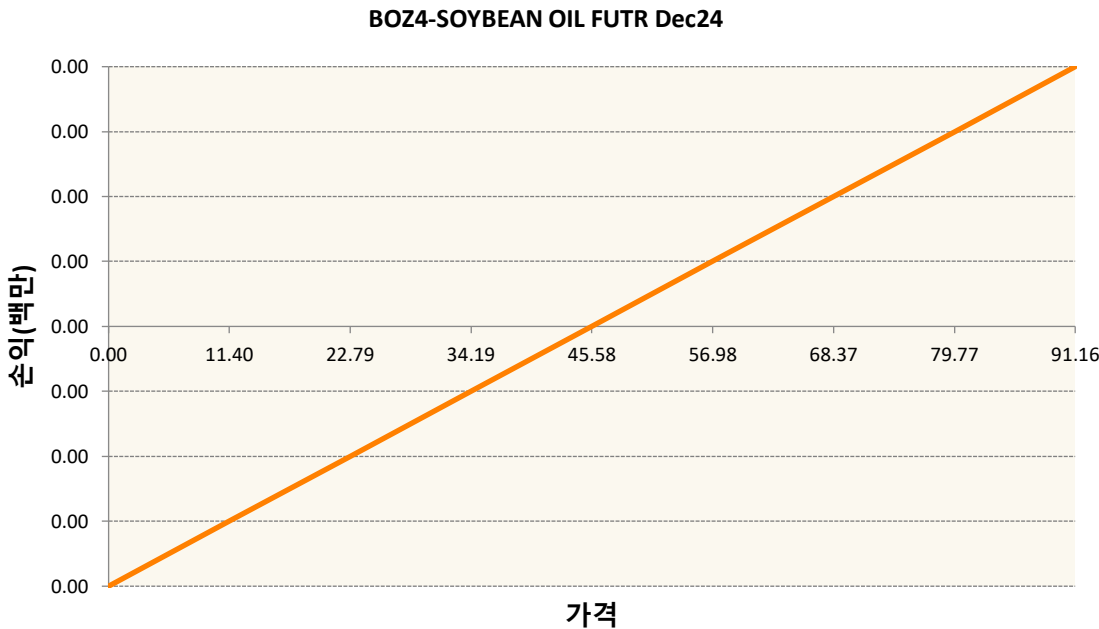
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

(단위:USD 백만)

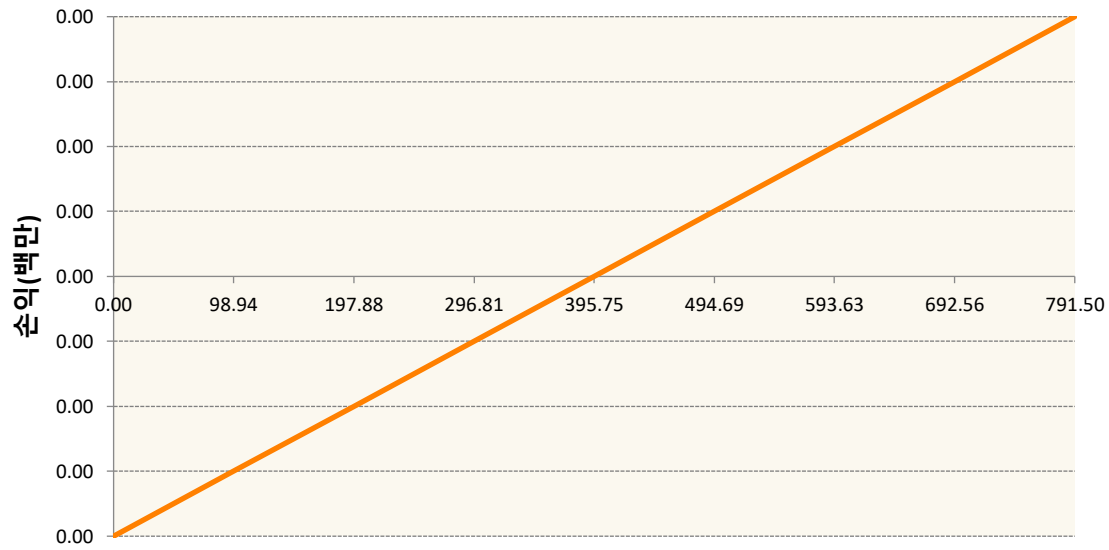
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	316	-316	장내
누계	유가증권	선물	3,885	0	3,885	
누계	통화	선물	0	372	-372	장내

2. 만기시점의 손익구조



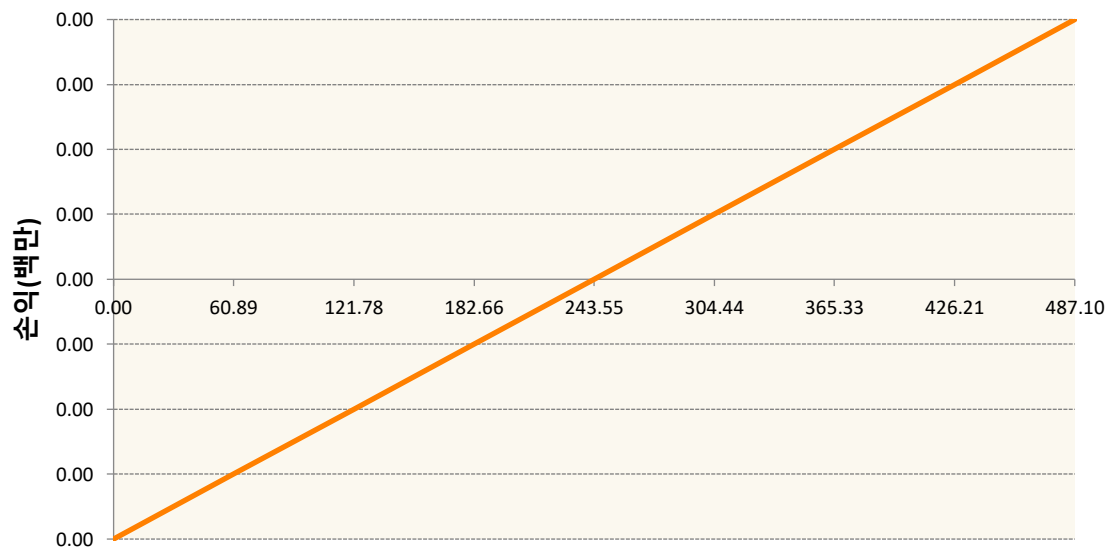
가격

CU4-CORN FUTURE Sep24



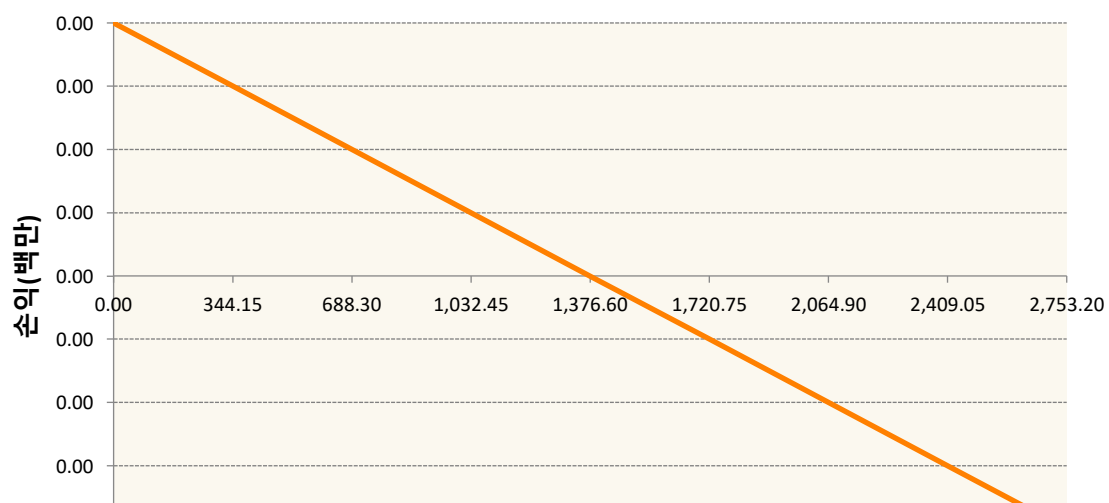
가격

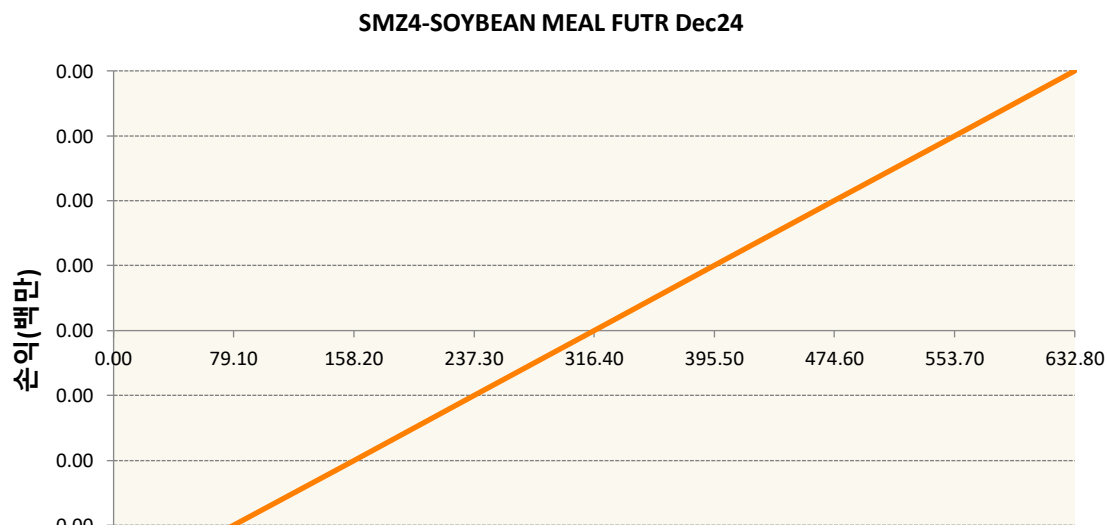
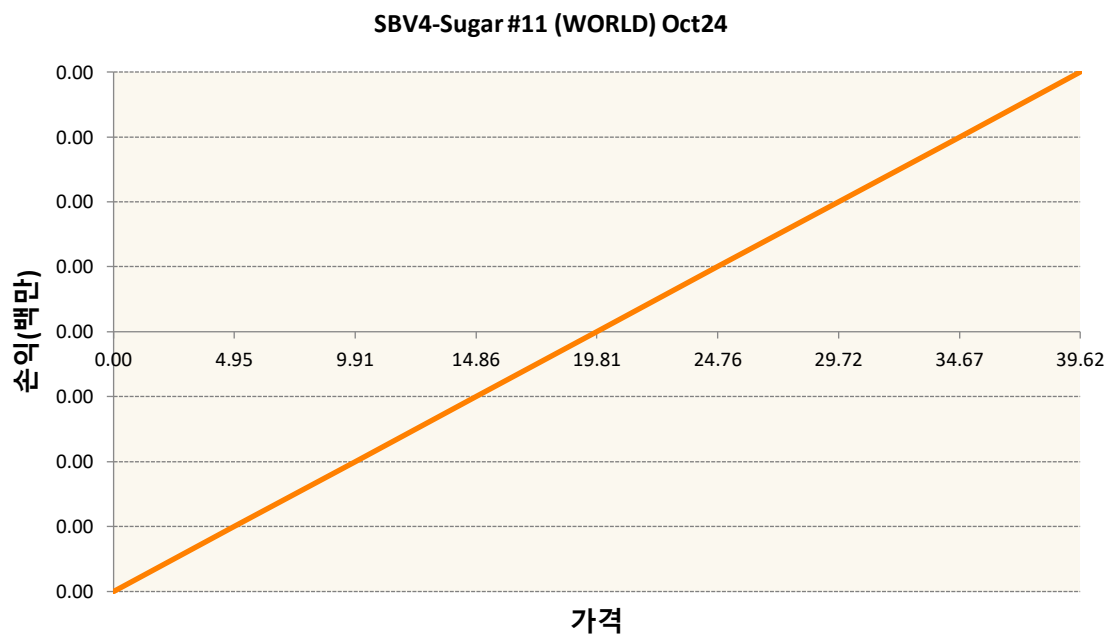
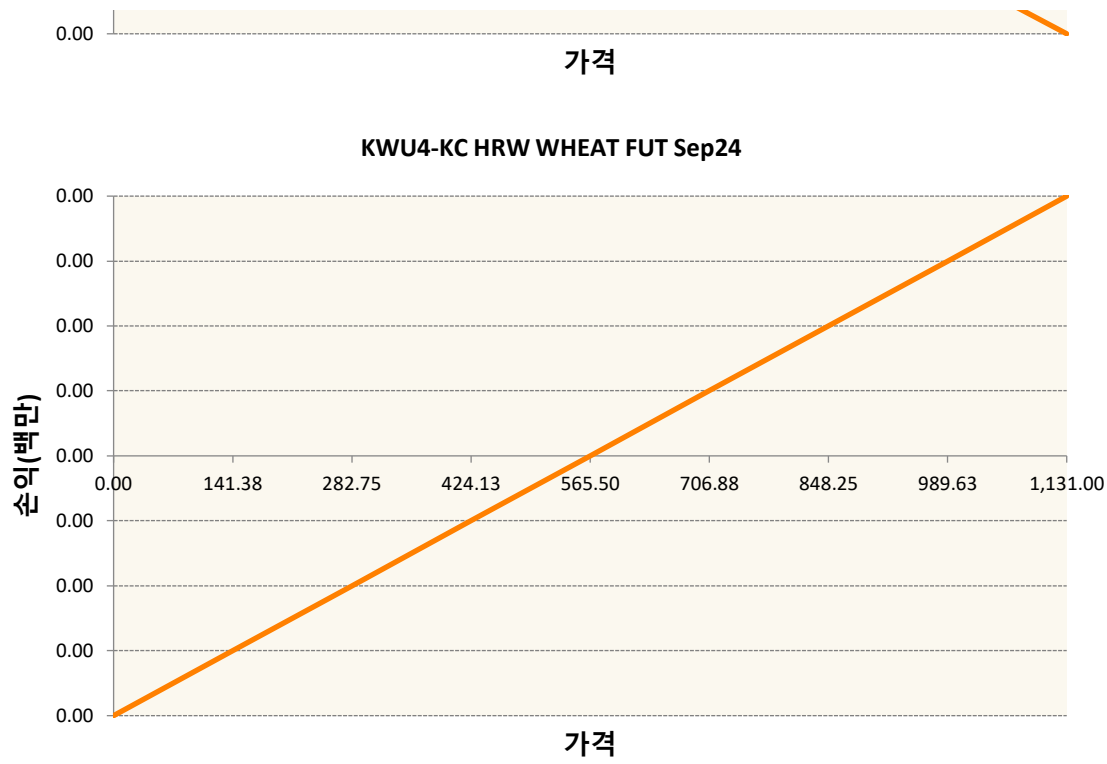
KCU4-COFFEE 'C' FUTURE Sep24



가격

KR4175V80004-2024-08 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	2024-07-12
기준일	2024-07-11

스마트인덱스모

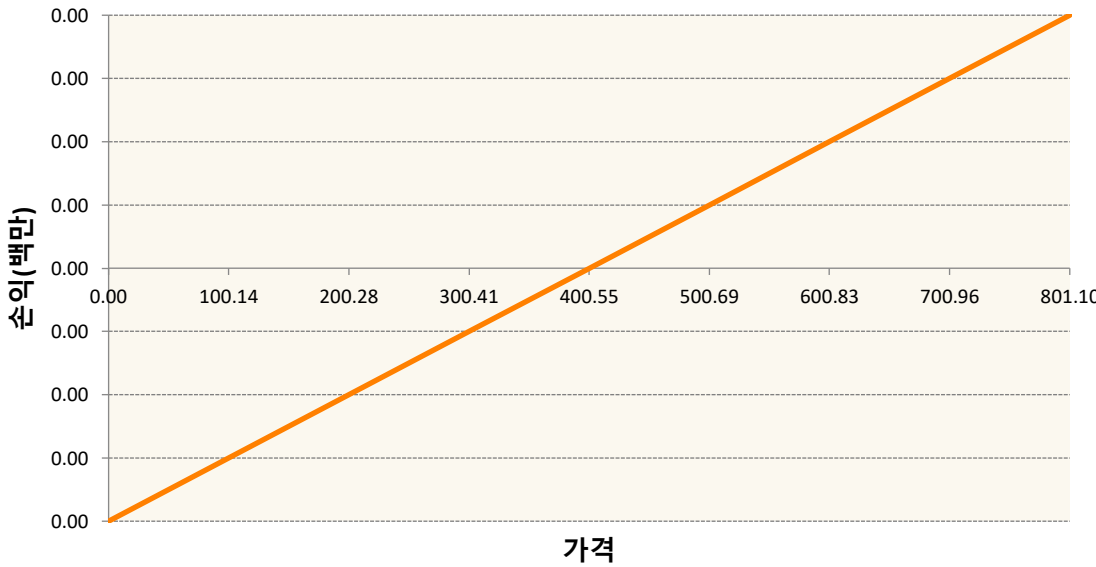
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	100	-100	장내
누계	유가증권	선물	2,103	0	2,103	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101V90009-2024-09 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101V90009		2024-09 코스피200지수선물					167
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-167	-167	-167	-167	-167	-167	-167
-5.33%	-112	-112	-112	-112	-112	-112	-112
-2.67%	-56	-56	-56	-56	-56	-56	-56
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	56	56	56	56	56	56	56
5.33%	112	112	112	112	112	112	112
8.00%	167	167	167	167	167	167	167

공시일	2024-07-12
기준일	2024-07-11

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	243

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2024-07-12
기준일	2024-07-11

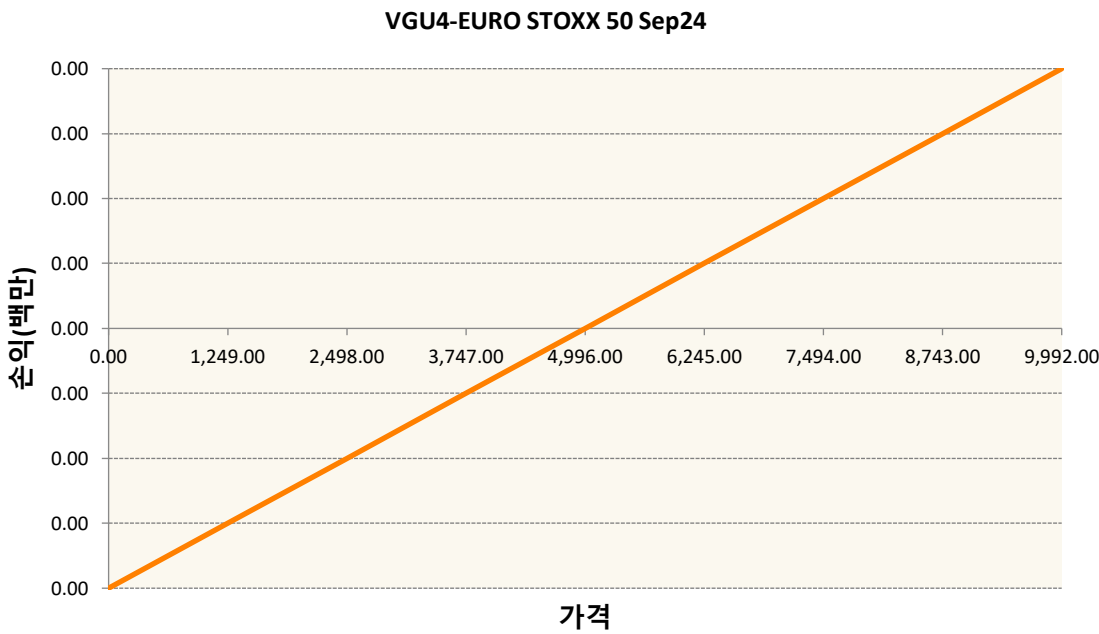
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

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

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGU4	EURO STOXX 50 Sep24	77
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

52

공시일	2024-07-12
기준일	2024-07-11

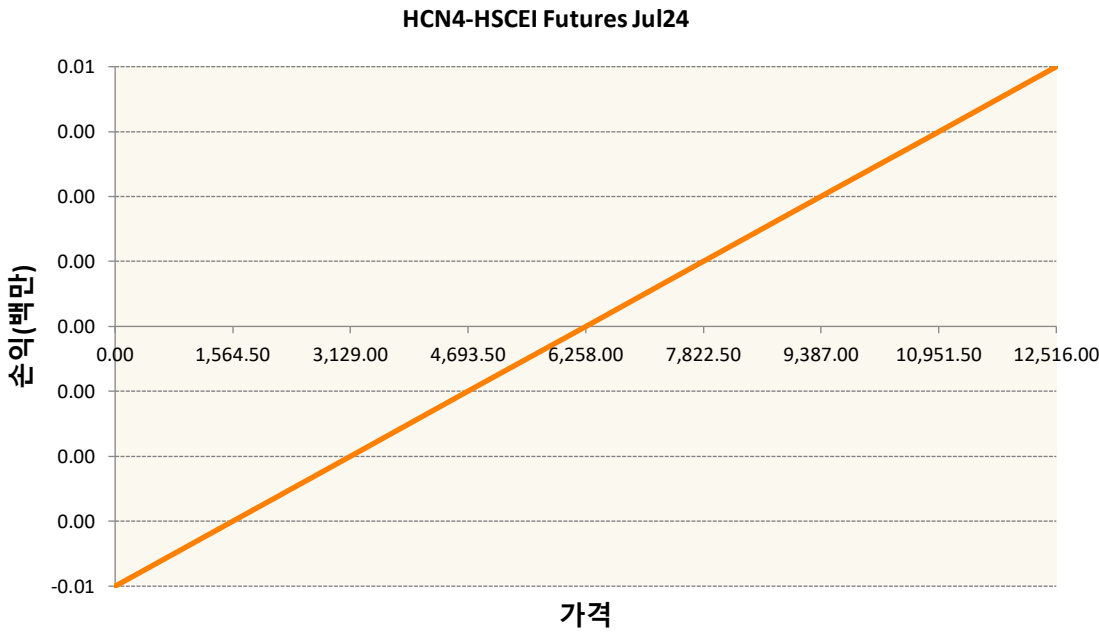
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,558	0	1,558	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCN4	HSCEI Futures Jul24	125
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

153

공시일	2024-07-12
기준일	2024-07-11

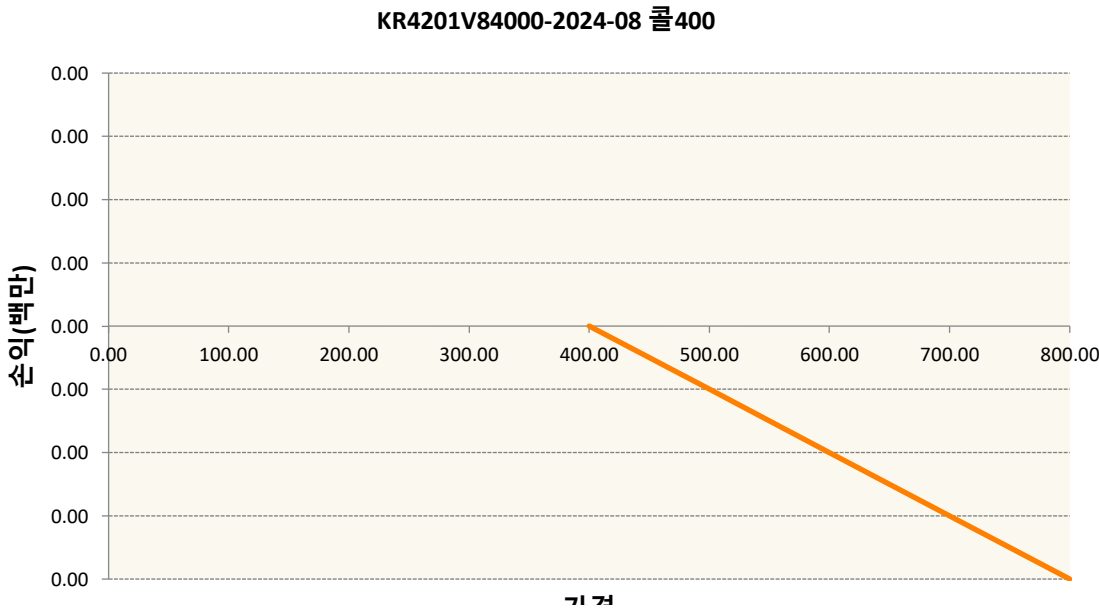
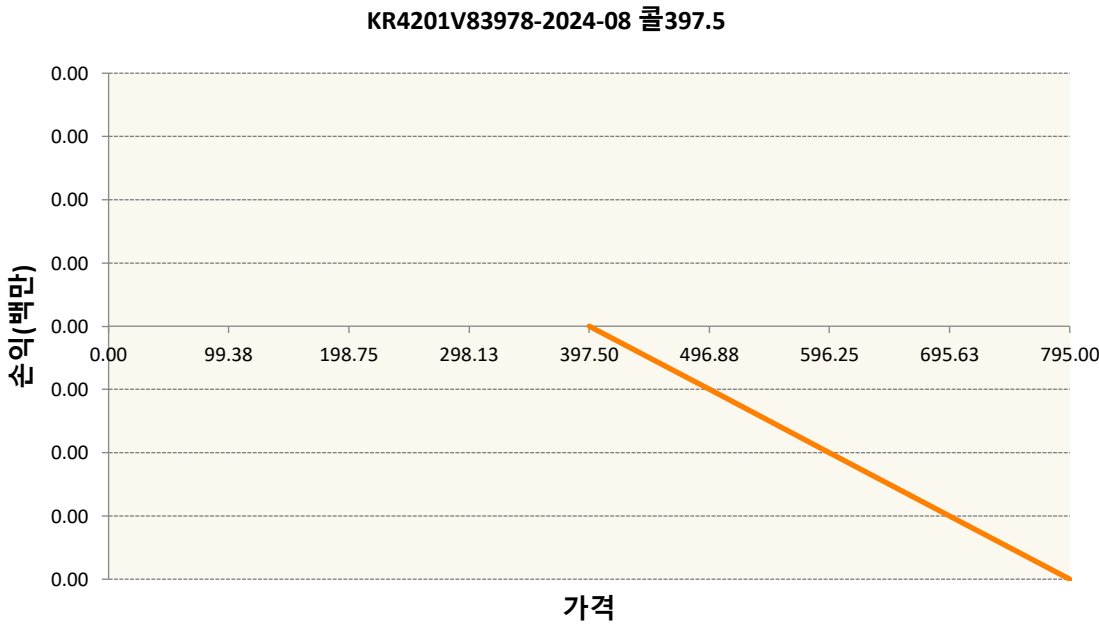
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	31,552	-31,552	장내
누계	유가증권	옵션	0	31,015	-31,015	장내

2. 만기시점의 손익구조



가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201V83978		2024-08 콜397.5					846
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	397	385	370	354	335	316	295
-5.33%	352	330	307	282	257	230	203
-2.67%	258	228	197	167	136	105	73
0%	99	66	33	0	-33	-66	-99
2.67%	-129	-158	-188	-218	-249	-280	-312
5.33%	-413	-435	-458	-482	-508	-535	-563
8.00%	-737	-750	-765	-783	-802	-823	-846
KR4201V84000		2024-08 콜400					1,056
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	465	451	435	415	394	370	344
-5.33%	416	391	363	334	303	270	237
-2.67%	312	275	237	199	160	121	81
0%	127	85	42	0	-42	-85	-127
2.67%	-145	-185	-225	-266	-307	-348	-389
5.33%	-495	-526	-558	-592	-627	-664	-701
8.00%	-901	-920	-943	-968	-996	-1,025	-1,056

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

1,806

공시일	2024-07-12
기준일	2024-07-11

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	1,223	0	1,223	

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	2024-07-12
기준일	2024-07-11

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	4,394	0	4,394	

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	2024-07-12
기준일	2024-07-11

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	15,350	0	15,350	
누계	통화	선도	0	14,753	-14,753	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213E4S(KRW/USD 31-07-24E	197
FXW213E5W KRW/USD 30-08-24E	590
FXW213E6S(KRW/USD 30-09-24E	370
FXW213E7B(KRW/USD 31-07-24E	24

IE00BD8RGM75 * 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

530

공시일	2024-07-12
기준일	2024-07-11

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

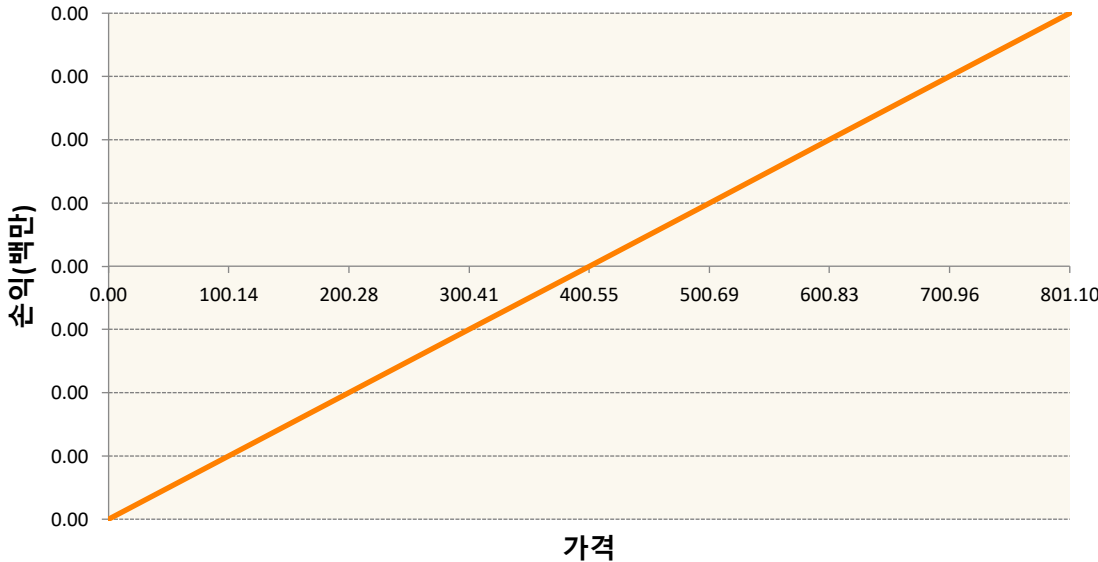
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	100	-100	장내
누계	유가증권	선물	801	0	801	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101V90009-2024-09 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101V90009			2024-09 코스피200지수선물				64
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-64	-64	-64	-64	-64	-64	-64
-5.33%	-43	-43	-43	-43	-43	-43	-43
-2.67%	-21	-21	-21	-21	-21	-21	-21
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	21	21	21	21	21	21	21
5.33%	43	43	43	43	43	43	43
8.00%	64	64	64	64	64	64	64

공시일	2024-07-12
기준일	2024-07-11

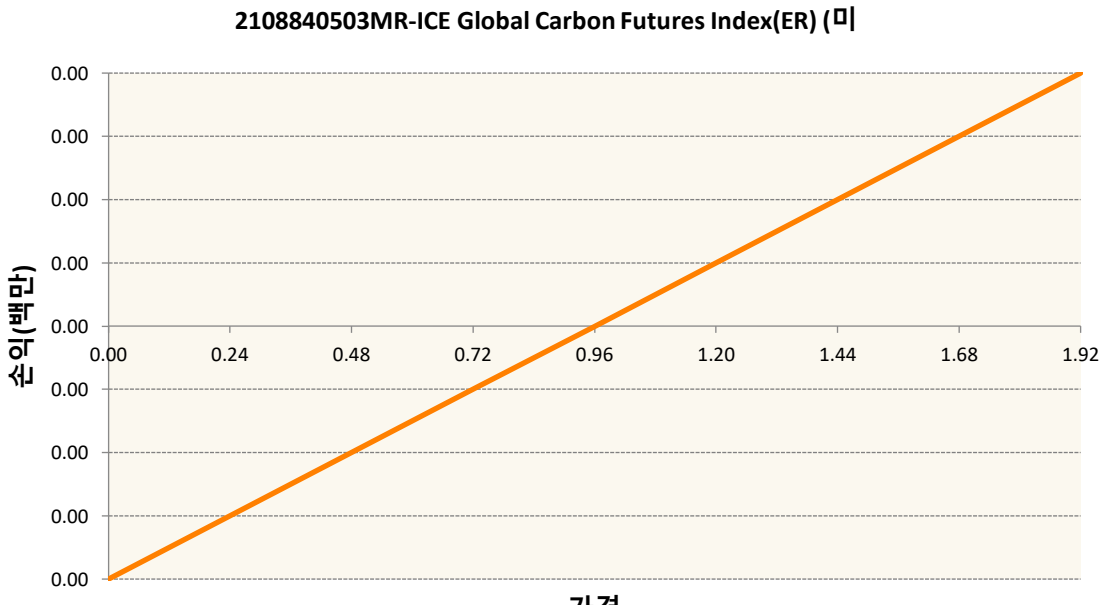
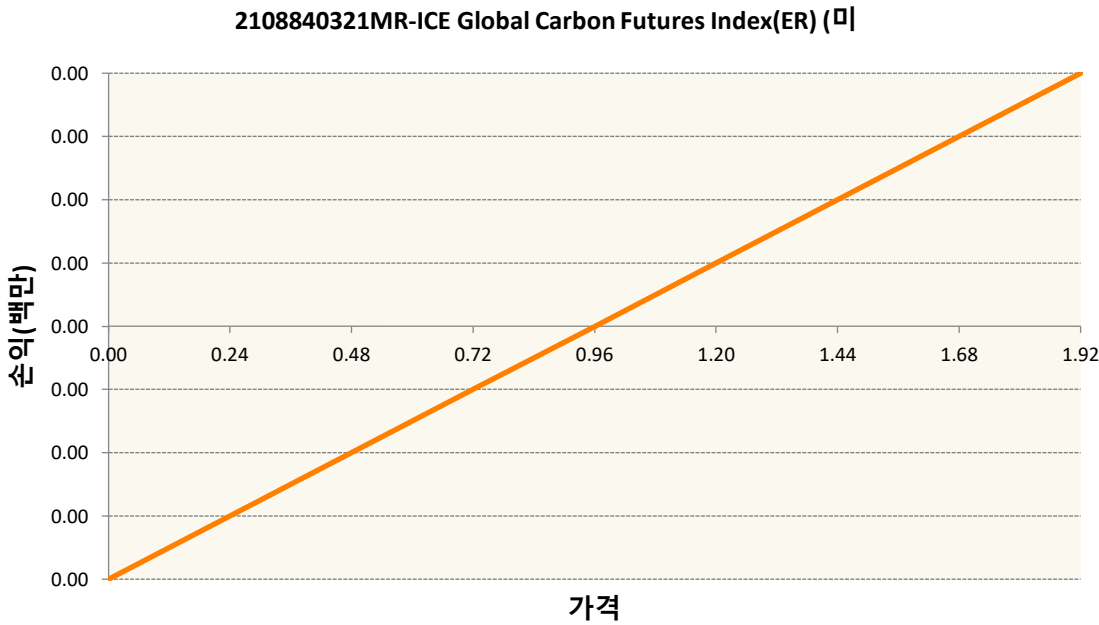
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

1. 계약금액

(단위:백만원)

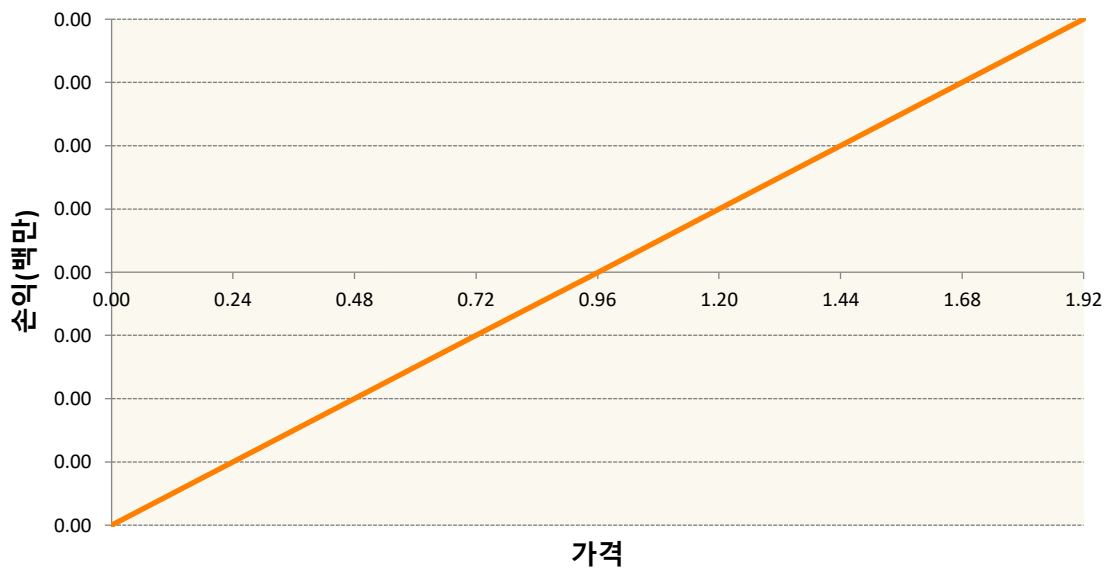
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	15,909	0	15,909	

2. 만기시점의 손익구조

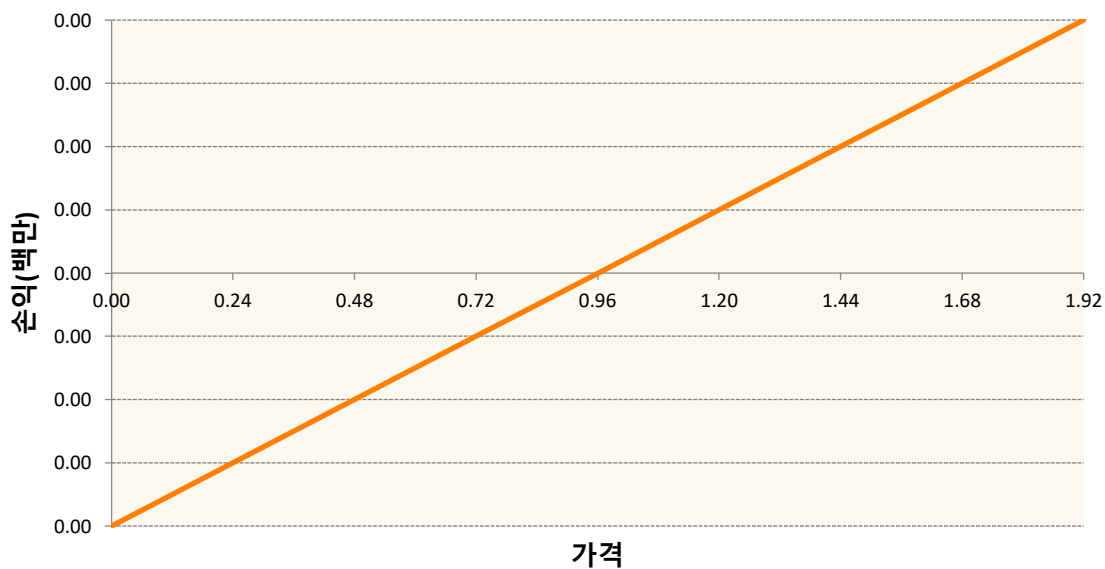


가격

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	489
2108840503 ICE Global Carbon Futures Index(ER) (미	196
2108840610 ICE Global Carbon Futures Index(ER) (키	391
2108840920 ICE Global Carbon Futures Index(ER) (메	196

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

(단위:백만원)

1,440

공시일	2024-07-12
기준일	2024-07-11

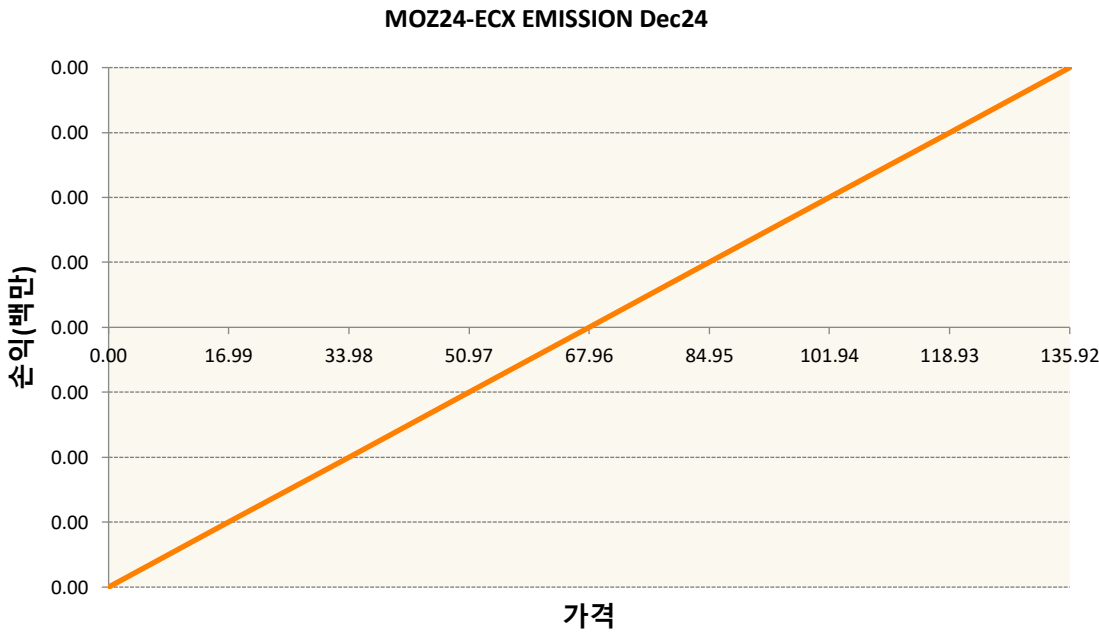
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	9,114	0	9,114	
누계	지수	스왑	373	0	373	장외
누계	통화	선도	1,329	2,769	-1,440	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213E6V₩/USD 31-07-24E	106
FXW213E6V₩/EUR 31-07-24E	115
FXW213E6VUSD/₩ 31-07-24E	106
MOZ24 ECX EMISSION Dec24	729
SWICEUACNICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX	0.25

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

(단위:백만원)

공시일	2024-07-12
기준일	2024-07-11

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)	11
SWCSI0000C 신한CSI Index 240620 (미래)	17
SWCSI0000C 신한CSI Index 240620 (메리츠)	17
SWCSI0000C 신한CSI Index 240620 (NH)	11

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

(단위:백만원)

77

공시일	2024-07-12
기준일	2024-07-11

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)	9
SWSTAR000 신한 STAR 50 Index 231226(NH)	8
SWSTAR000 신한 STAR 50 Index 231226(메리츠)	11
SWSTAR000 신한 STAR 50 Index 231226(키움)	2

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

(단위:백만원)

35

공시일	2024-07-12
기준일	2024-07-11

에퀴티알파일반사모혼합자산

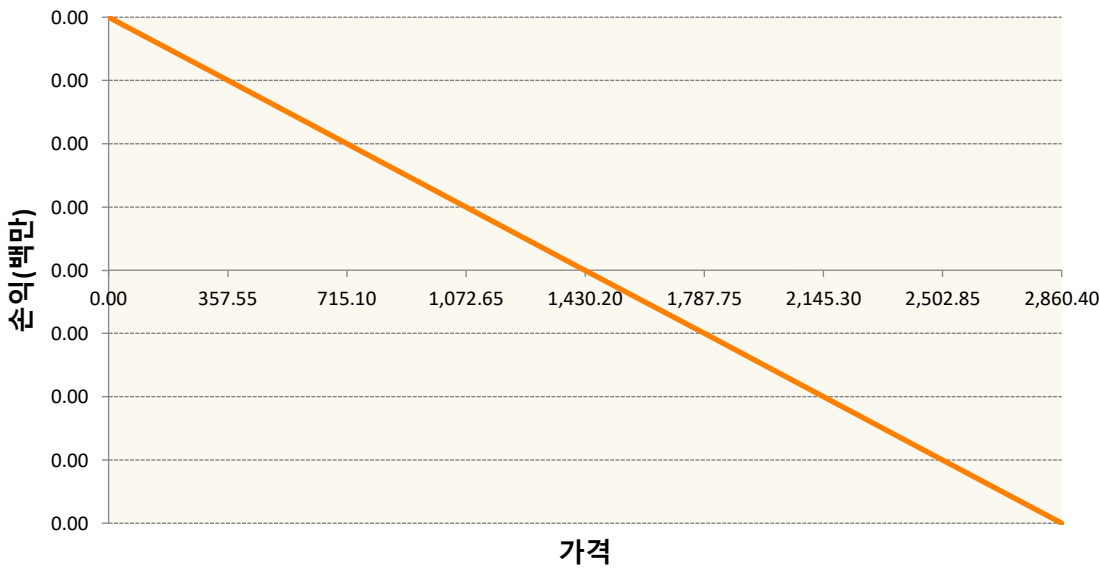
1. 계약금액

(단위:백만원)

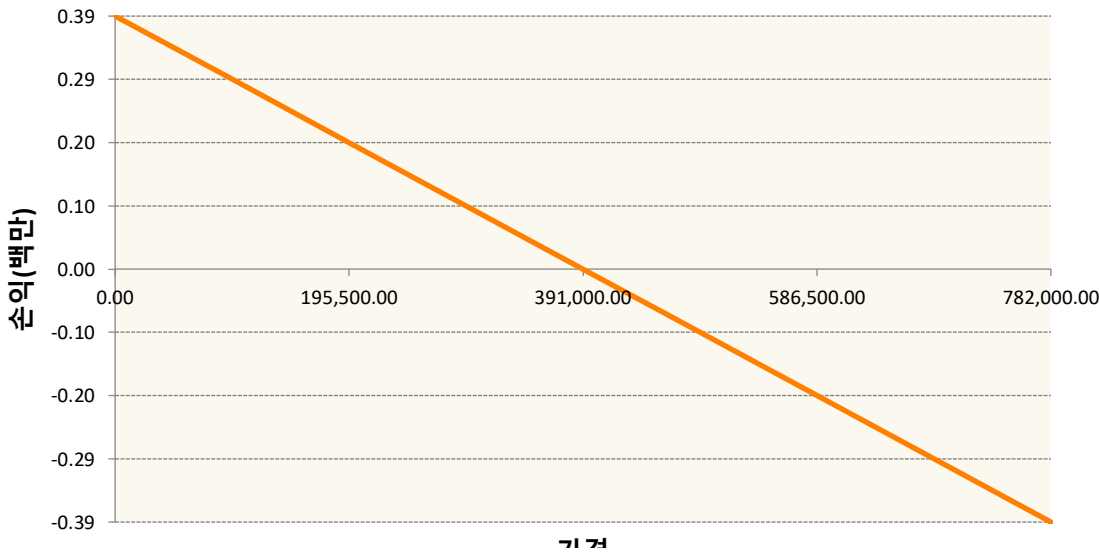
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	12	-12	장내
누계	유가증권	선물	0	55	-55	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4106V90008-2024-09 코스닥150선물

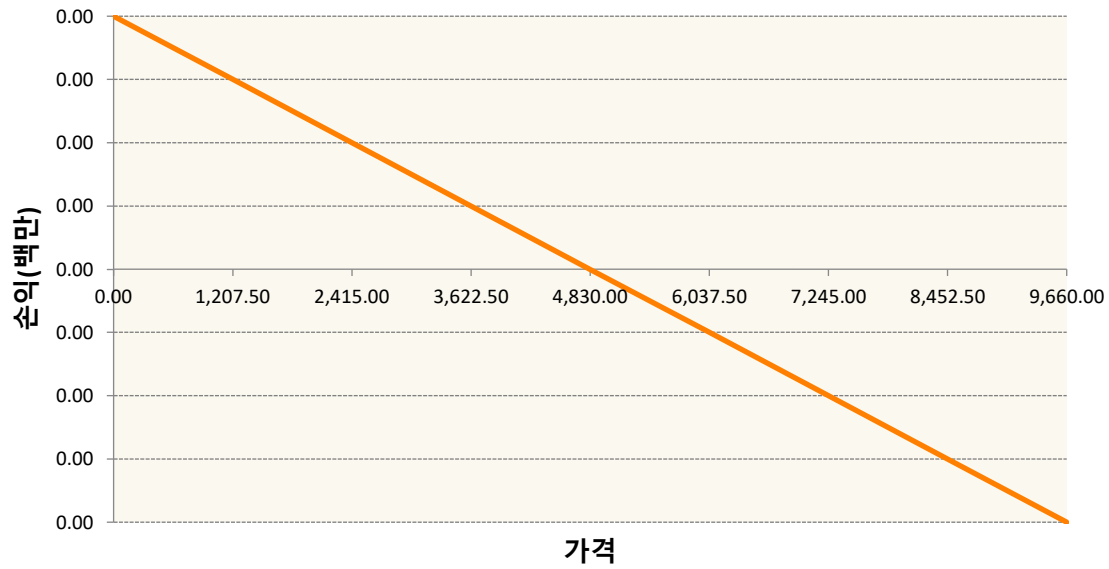


KR4113V80005-2024-08 POSCO홀딩스개별선물



가격

KR41CYV80006-2024-08 한온시스템개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4106V90C 2024-09 코스닥150선물	3
KR4113V80C 2024-08 POSCO홀딩스개별선물	1
KR41CYV80C 2024-08 한온시스템개별선물	0.34

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

8

공시일	2024-07-12
기준일	2024-07-11

코리아인덱스(주식-파생형)(종)

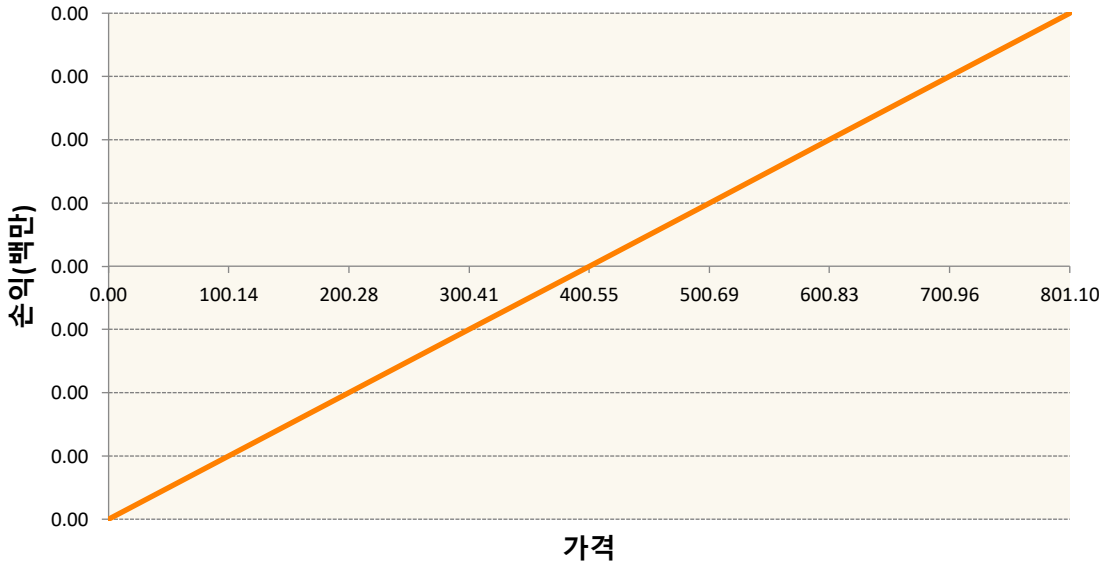
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	7,110	0	7,110	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101V90009-2024-09 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101V90009		2024-09 코스피200지수선물					566
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-566	-566	-566	-566	-566	-566	-566
-5.33%	-377	-377	-377	-377	-377	-377	-377
-2.67%	-189	-189	-189	-189	-189	-189	-189
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	189	189	189	189	189	189	189
5.33%	377	377	377	377	377	377	377
8.00%	566	566	566	566	566	566	566

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

(단위:백만원)

561

공시일	2024-07-12
기준일	2024-07-11

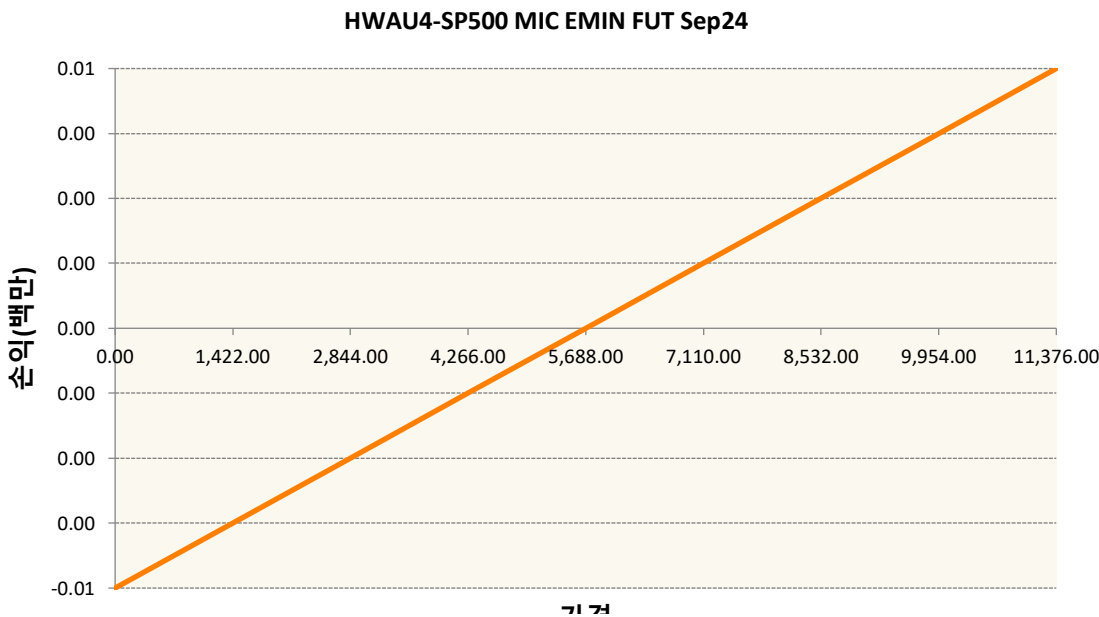
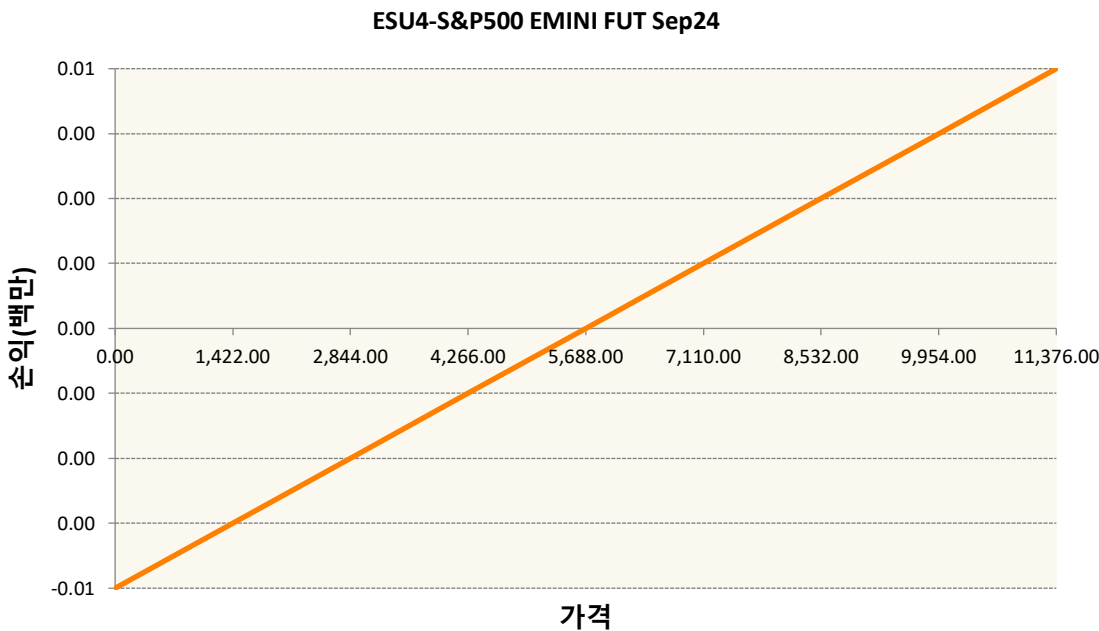
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

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	8,679	0	8,679	
누계	유가증권	선물	2,841	0	2,841	장내

2. 만기시점의 손익구조



가액

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESU4	S&P500 EMINI FUT Sep24	694
HWAU4	SP500 MIC EMIN FUT Sep24	227

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	548

공시일	2024-07-12
기준일	2024-07-11

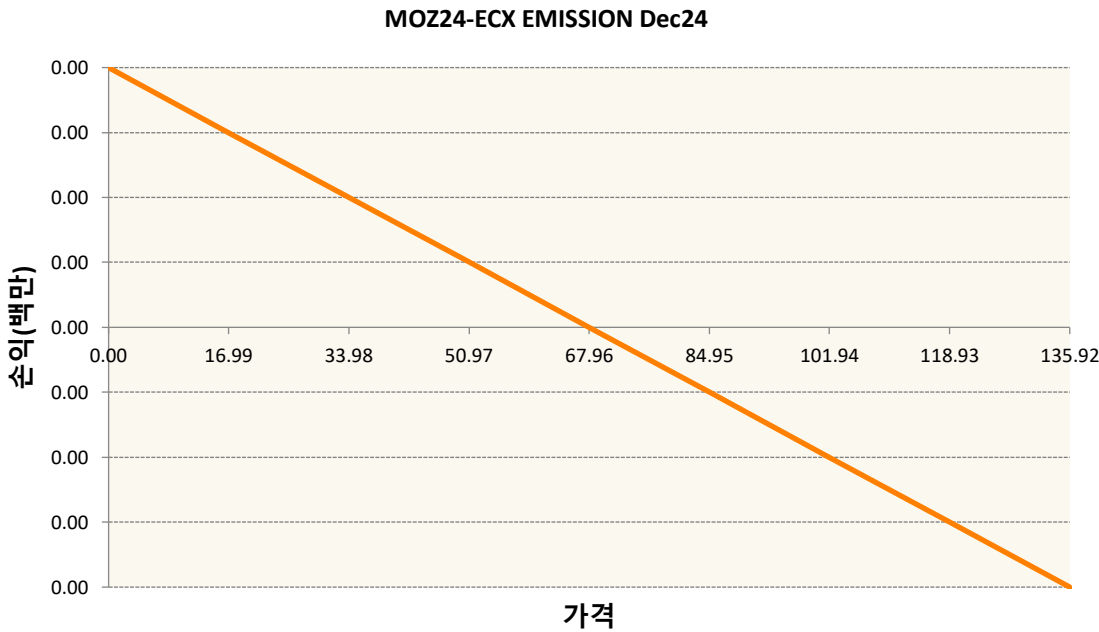
SOL유럽탄소배출권선물인버스ICE특별자산상

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	5,987	-5,987	
누계	지수	스왑	373	0	373	장외
누계	통화	선도	981	2,492	-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	78
FXW213E6V(KRW/EUR 31-07-24E	85
FXW213E6V(USD/KRW 31-07-24E	78
MOZ24 ECX EMISSION Dec24	479
SWICEUACNICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX	0.22

공시일	2024-07-12
기준일	2024-07-11

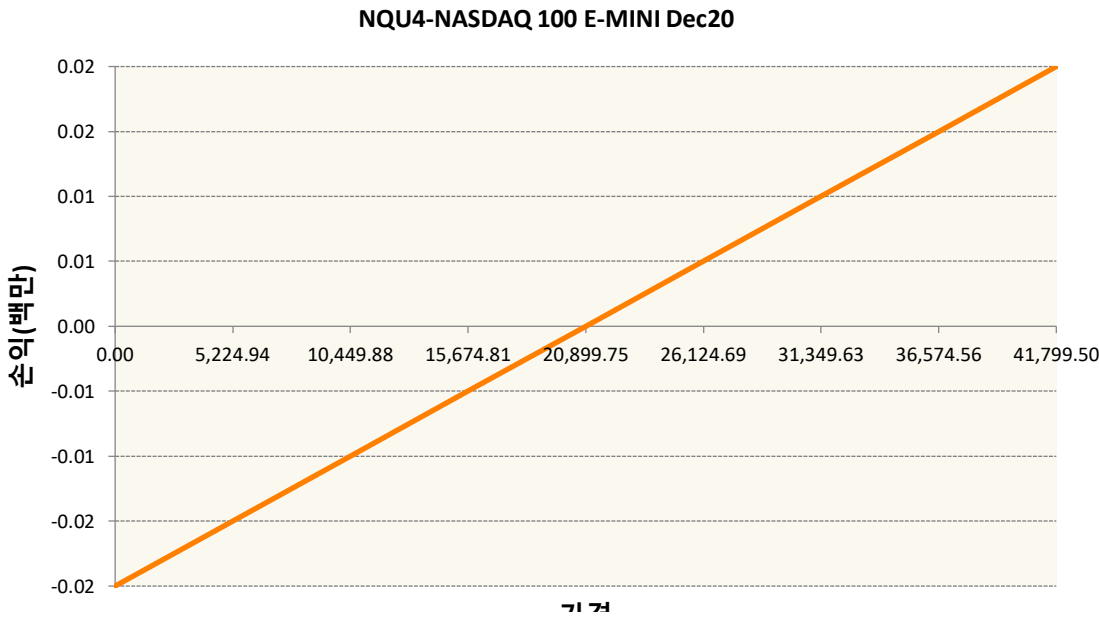
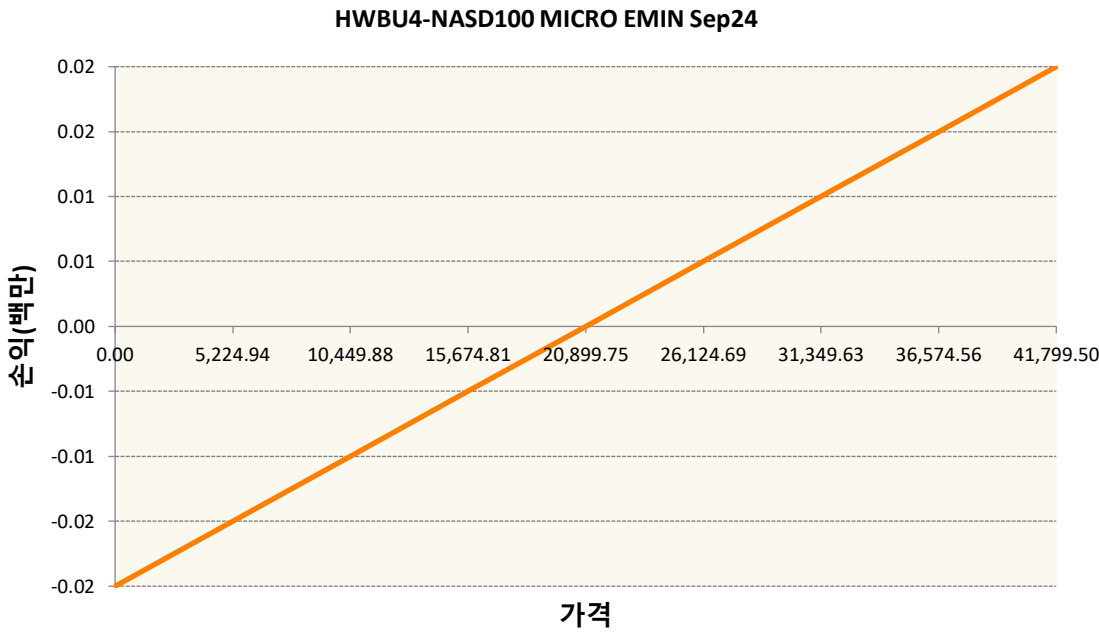
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

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	7,531	0	7,531	
누계	유가증권	선물	3,710	0	3,710	장내

2. 만기시점의 손익구조



가역

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HWBU4	NASD100 MICRO EMIN Sep24	297
NQU4	NASDAQ 100 E-MINI Dec20	602

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	663

공시일	2024-07-12
기준일	2024-07-11

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	167,305	0	167,305	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWKEDI000(KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	700
SWKEDI000(KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	6,582
SWKEDI000(KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	3,627
SWKEDI000(KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	2,446

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

(단위:백만원)

8,011

공시일	2024-07-12
기준일	2024-07-11

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	29
SWSOL0000 SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	29
SWSOL0000 SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	29
SWSOL0000 SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	29

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

(단위:백만원)

116

공시일	2024-07-12
기준일	2024-07-11

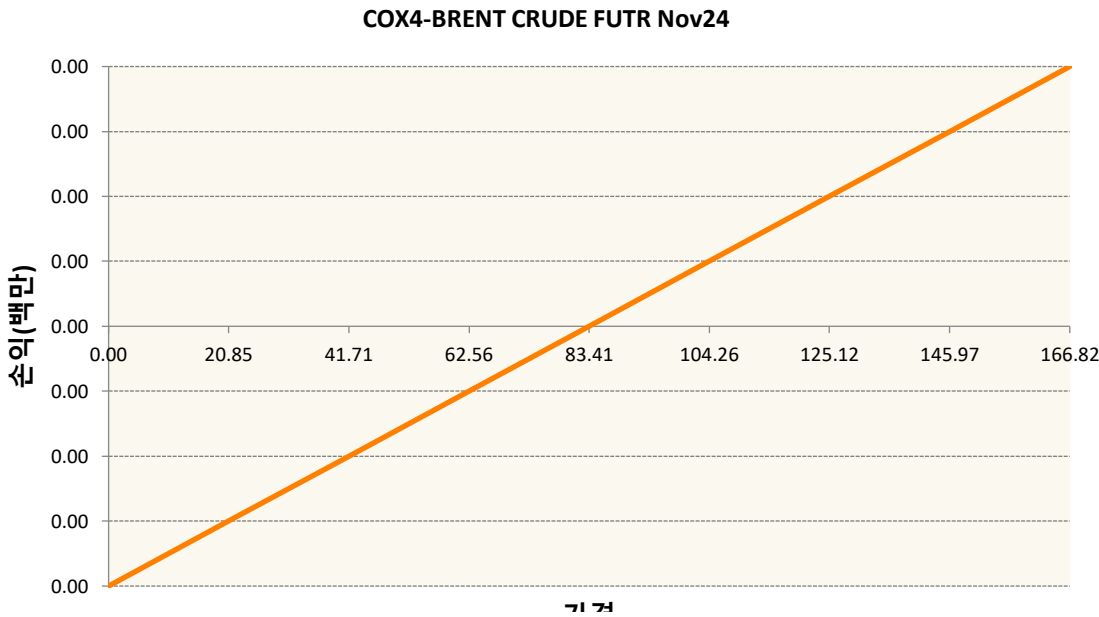
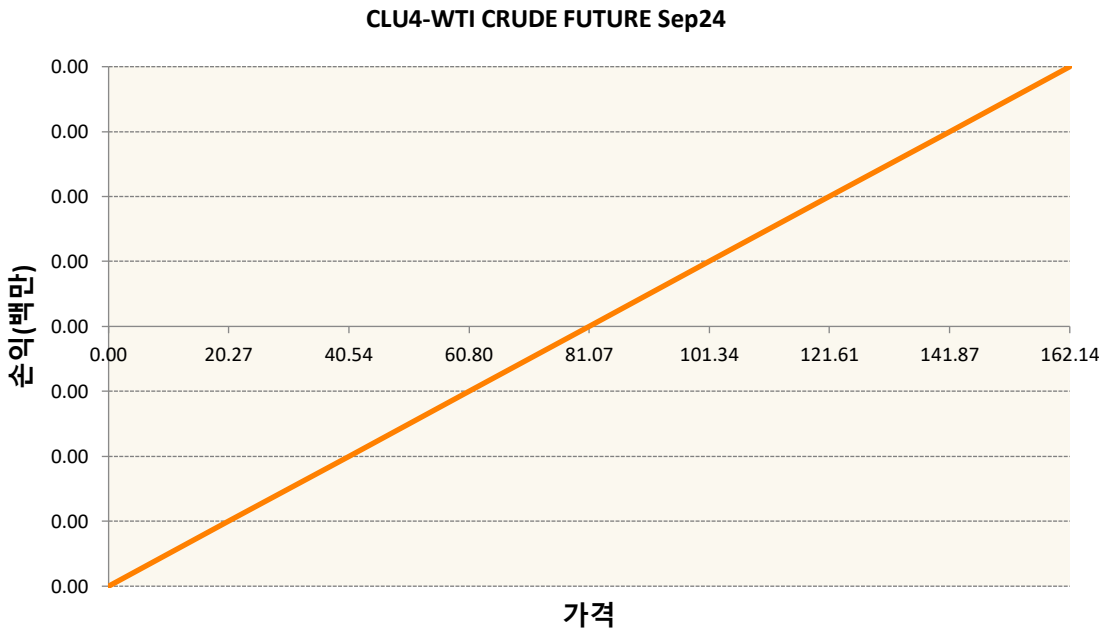
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

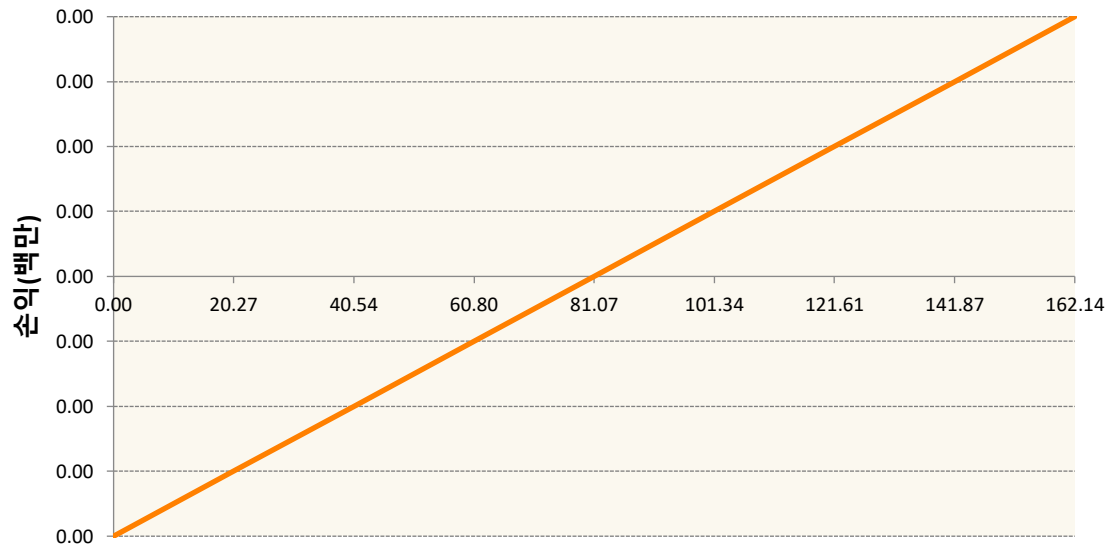
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	110	-110	장내
누계	유가증권	선물	922	0	922	
누계	통화	선물	0	110	-110	장내

2. 만기시점의 손익구조



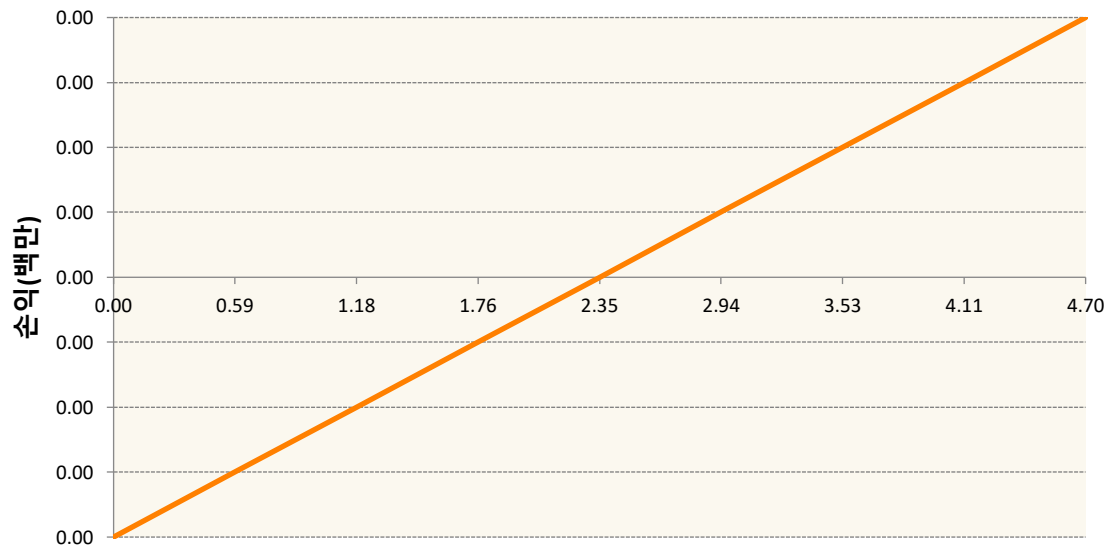
가격

ECU4-E-mini Crude Oil Sep24



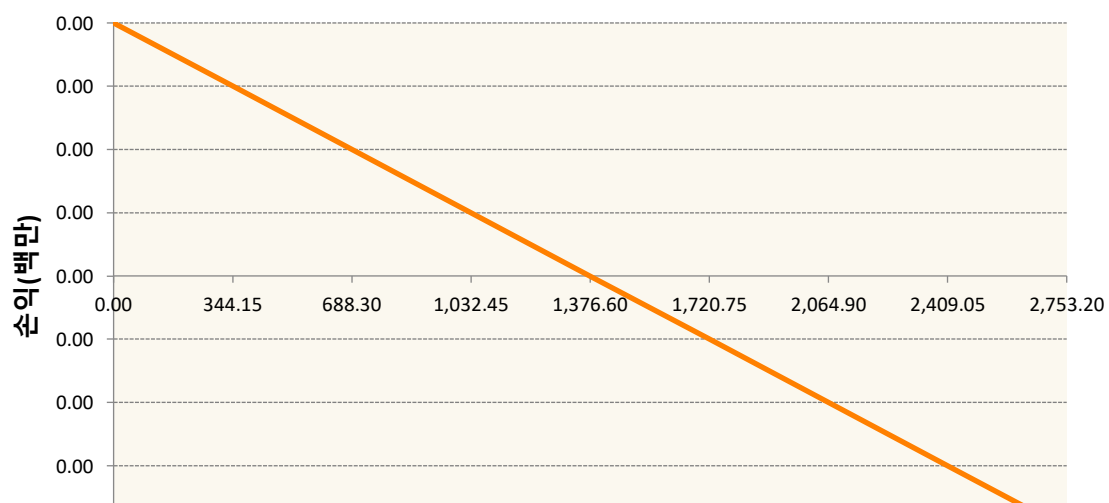
가격

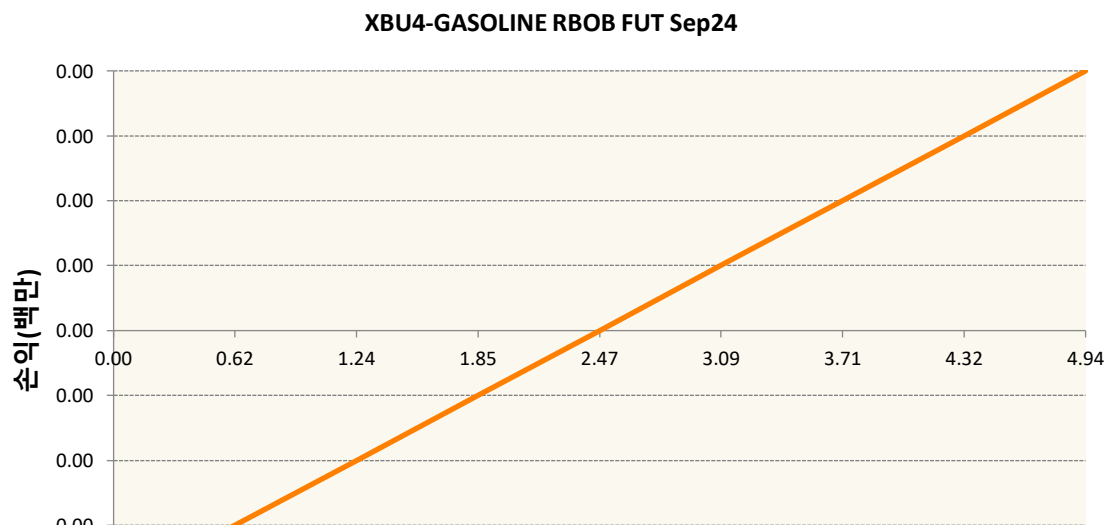
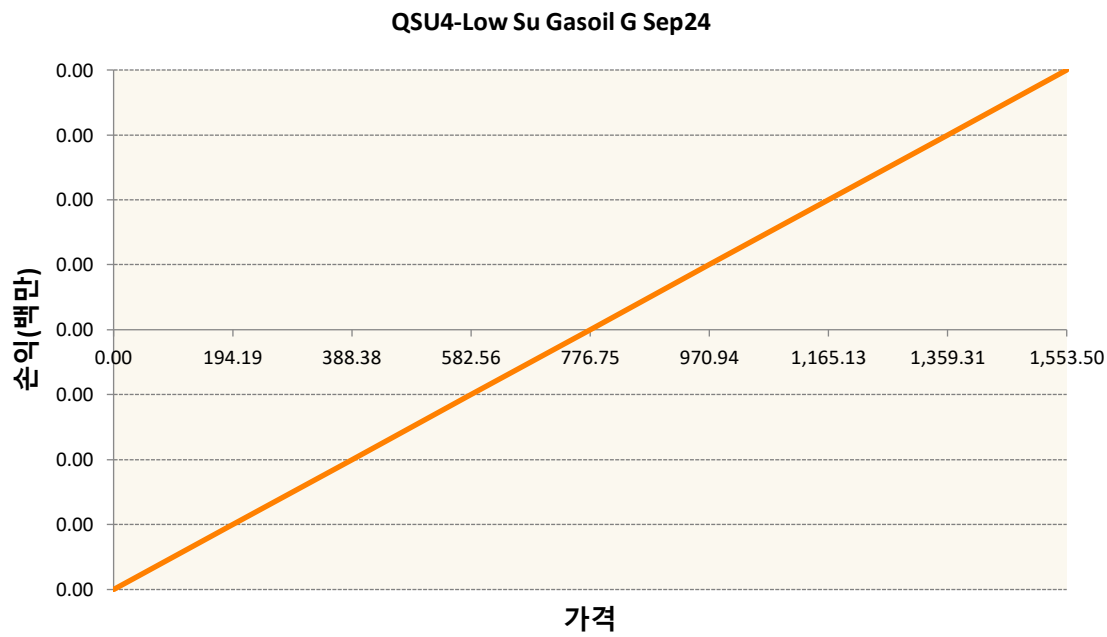
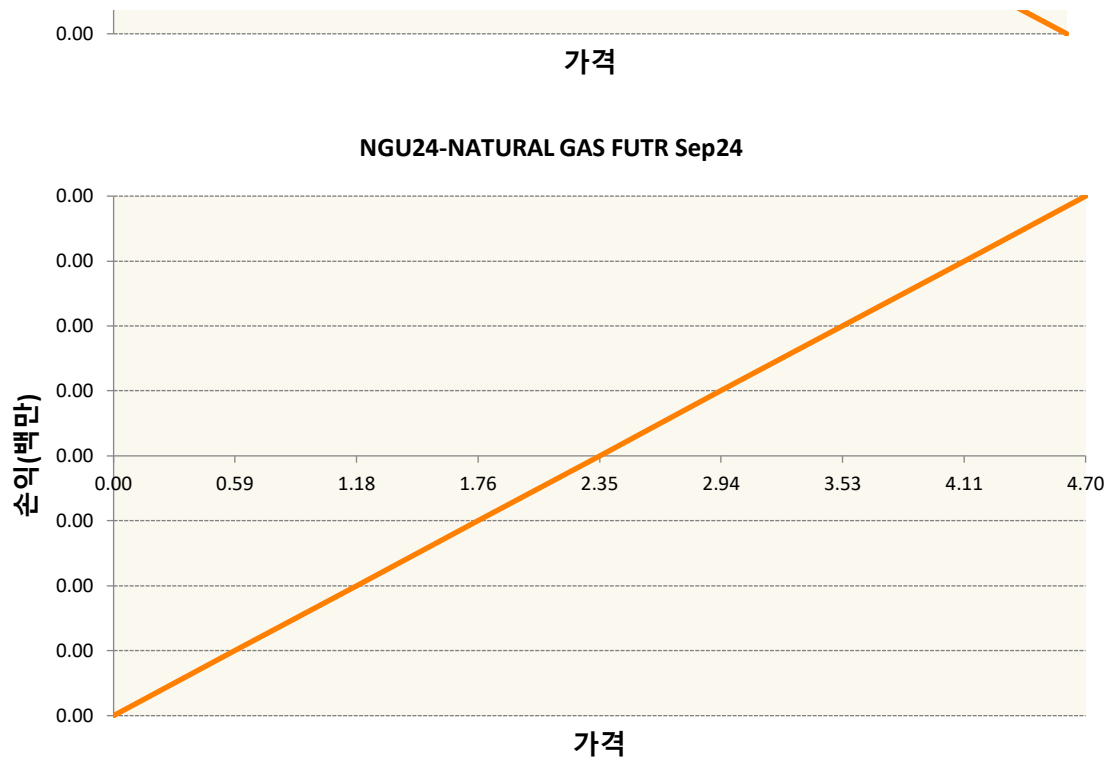
EOU4-E-MINI NATURAL GAS Sep24

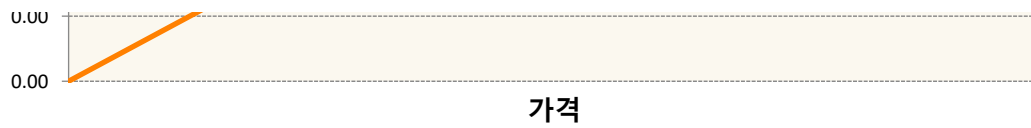


가격

KR4175V80004-2024-08 달러선물







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLU4	WTI CRUDE FUTURE Sep24	9
COX4	BRENT CRUDE FUTR Nov24	18
ECU4	E-mini Crude Oil Sep24	9
EOU4	E-MINI NATURAL GAS Sep24	2
KR4175V80C 2024-08 달러선물		9
NGU24	NATURAL GAS FUTR Sep24	15
QSU4	Low Su Gasoil G Sep24	9
XBU4	GASOLINE RBOB FUT Sep24	11

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

153
