공시일	2024-07-22
기준일	2024-07-19

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	2024-07-22
기준일	2024-07-19

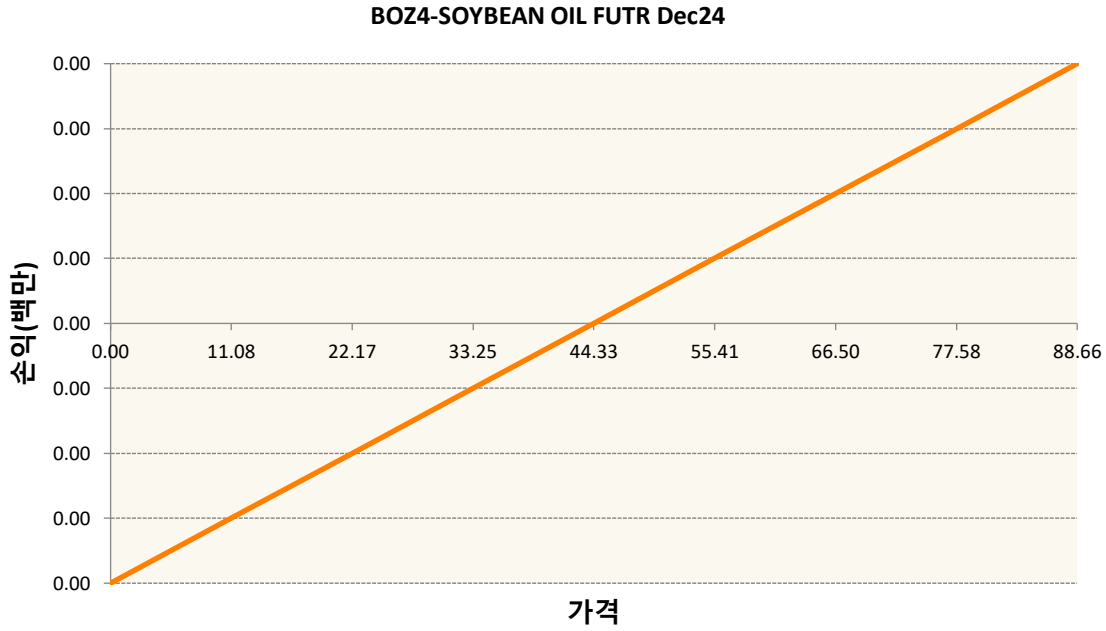
포커스농산물모(채권-파생형)

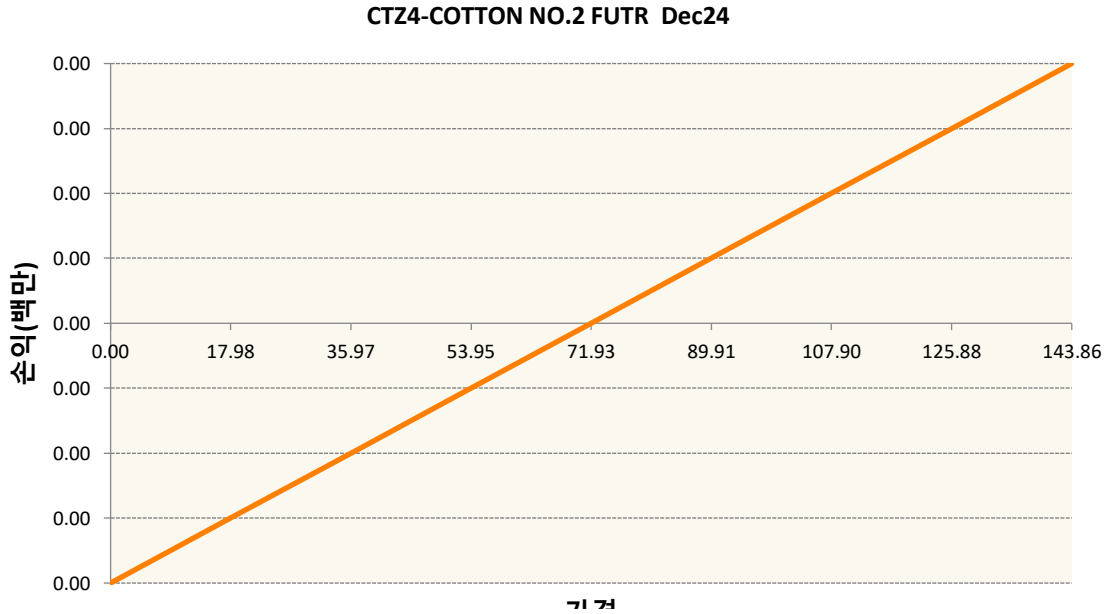
1. 계약금액

(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	3,860	0	3,860	
누계	통화	선물	0	318	-318	장내

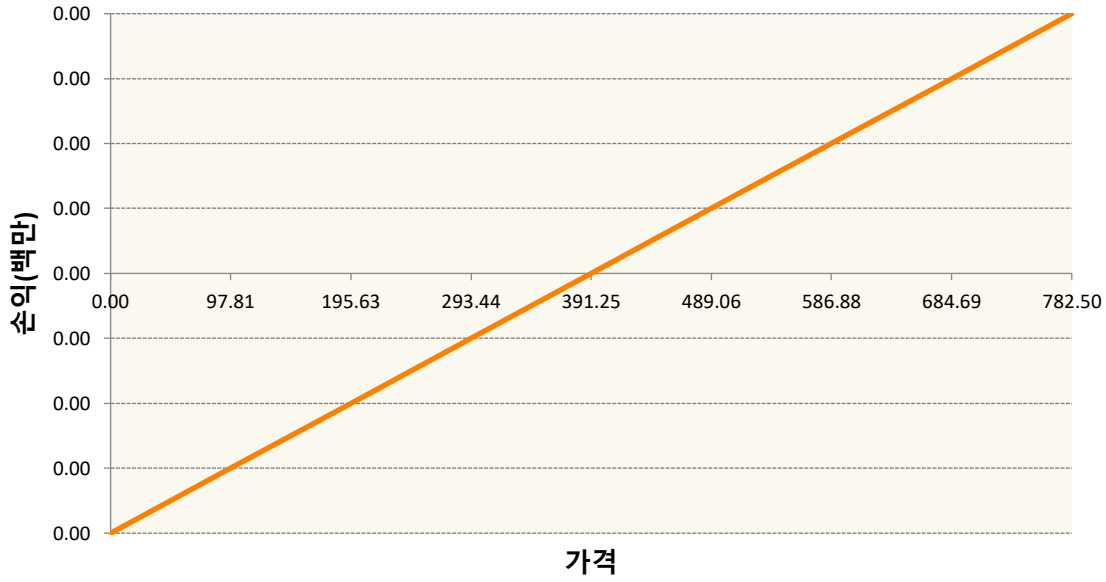
2. 만기시점의 손익구조



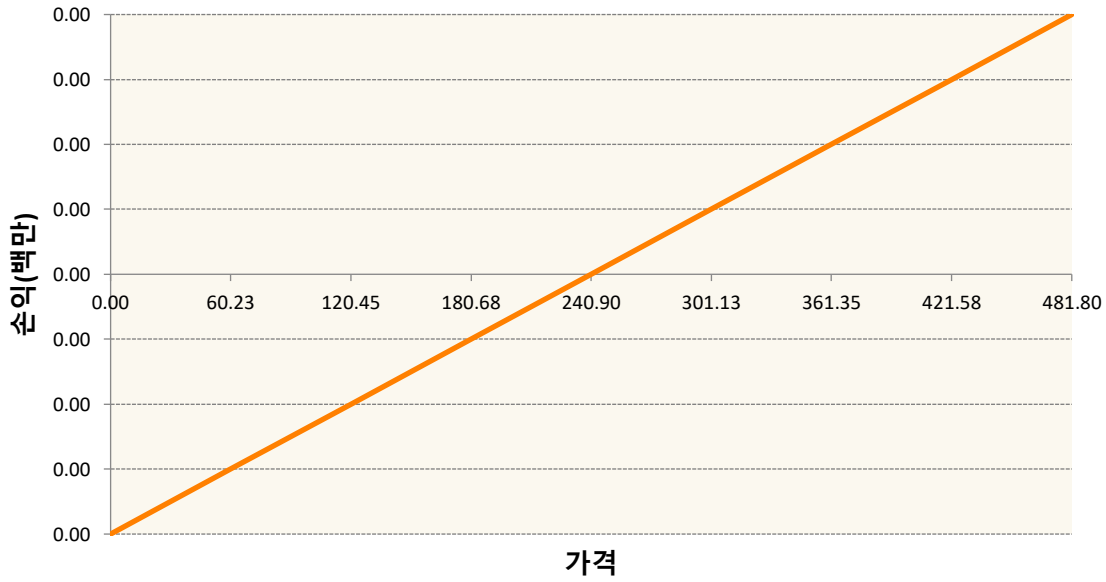


가격

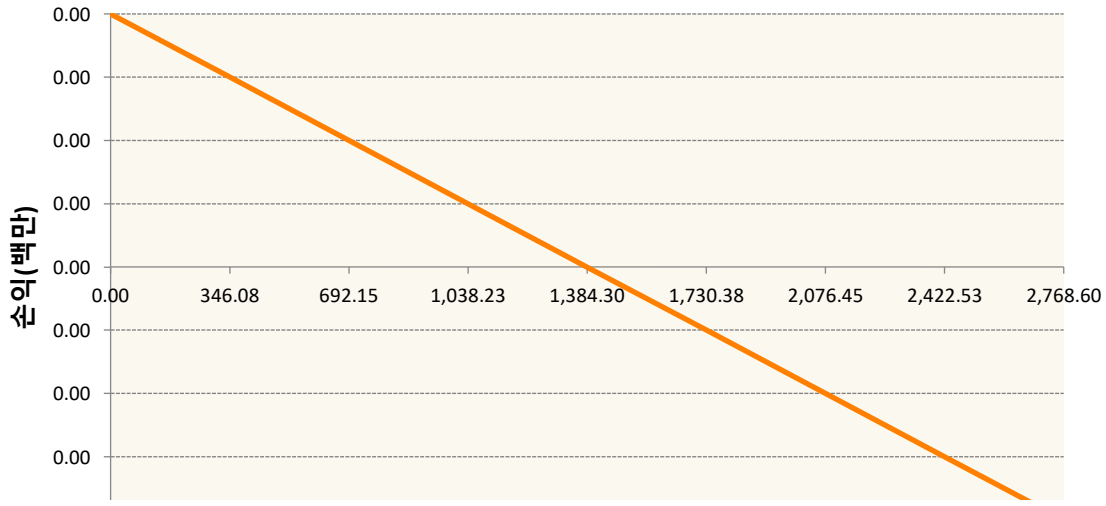
CU4-CORN FUTURE Sep24

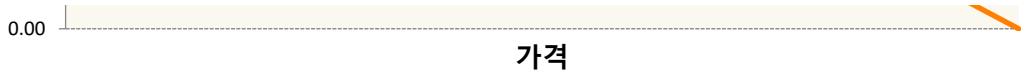


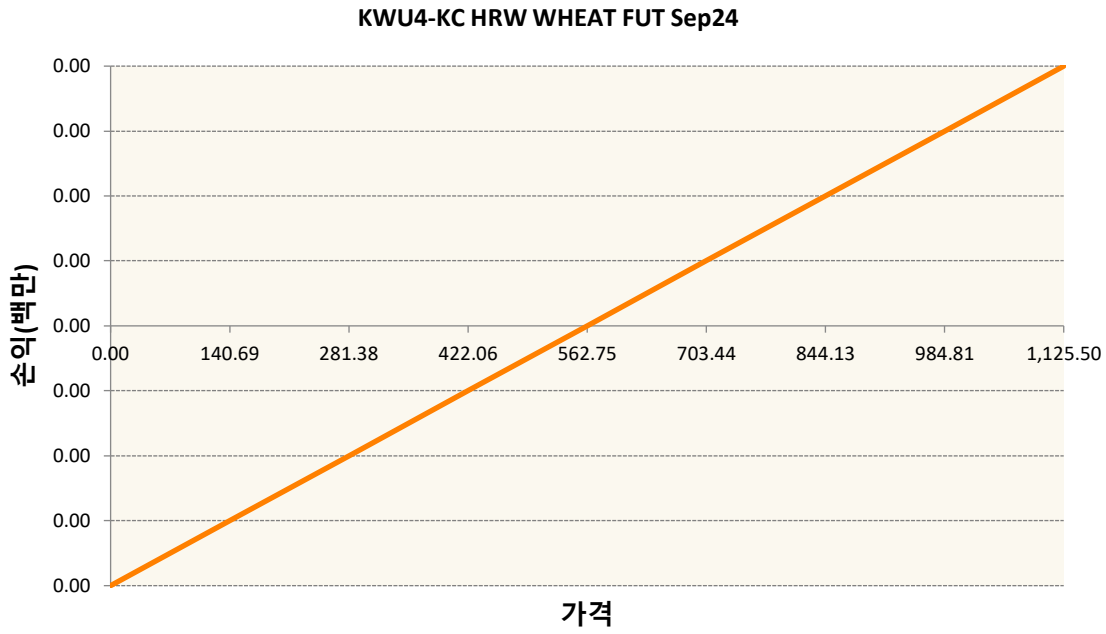
KCU4-COFFEE 'C' FUTURE Sep24

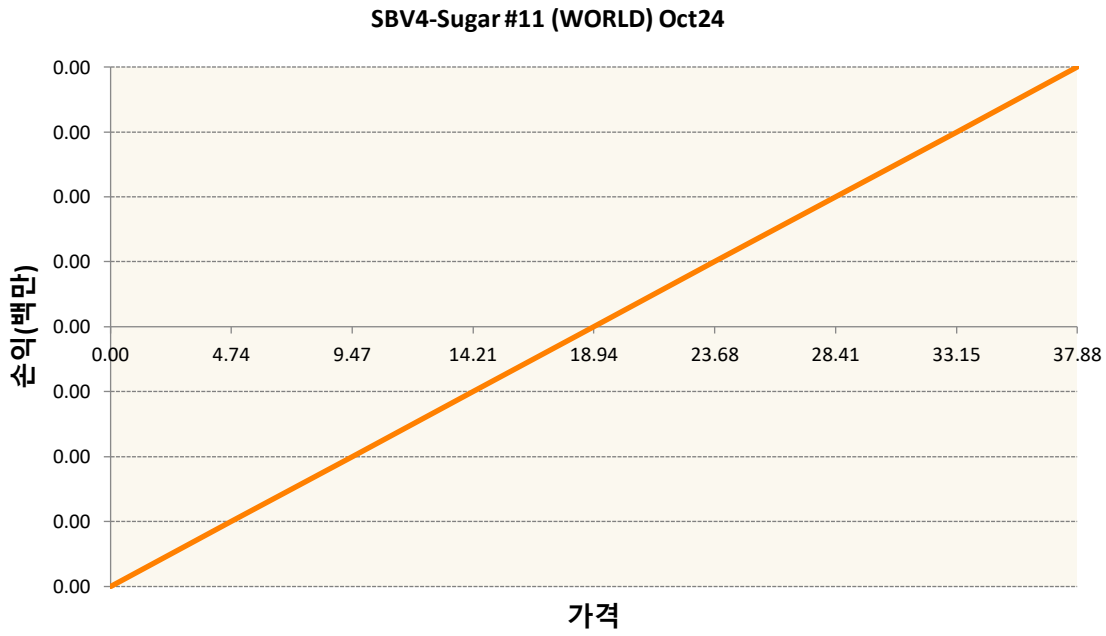


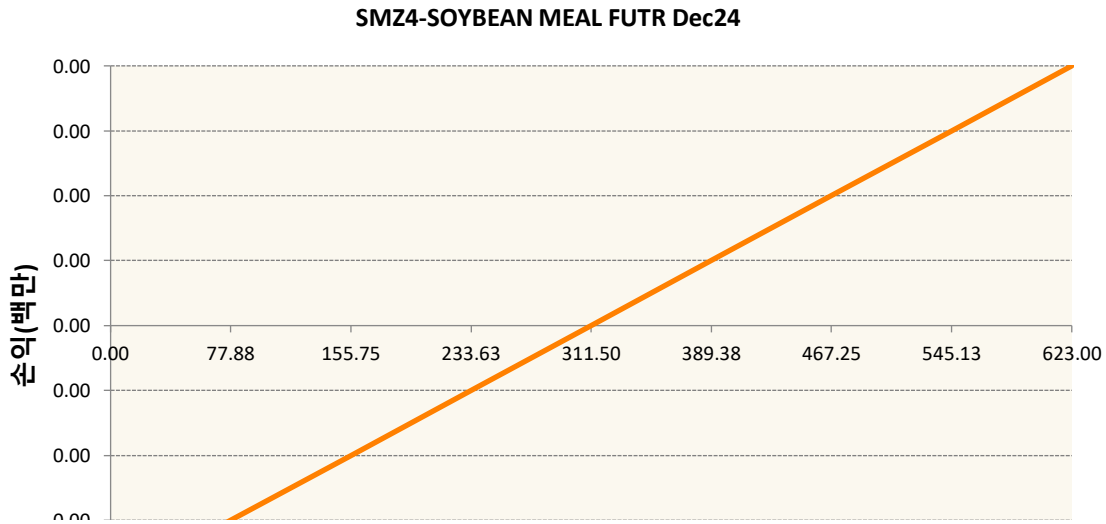
KR4175V80004-2024-08 달러선물

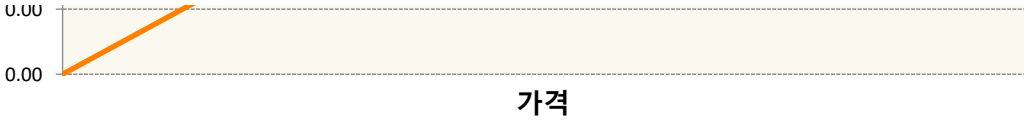


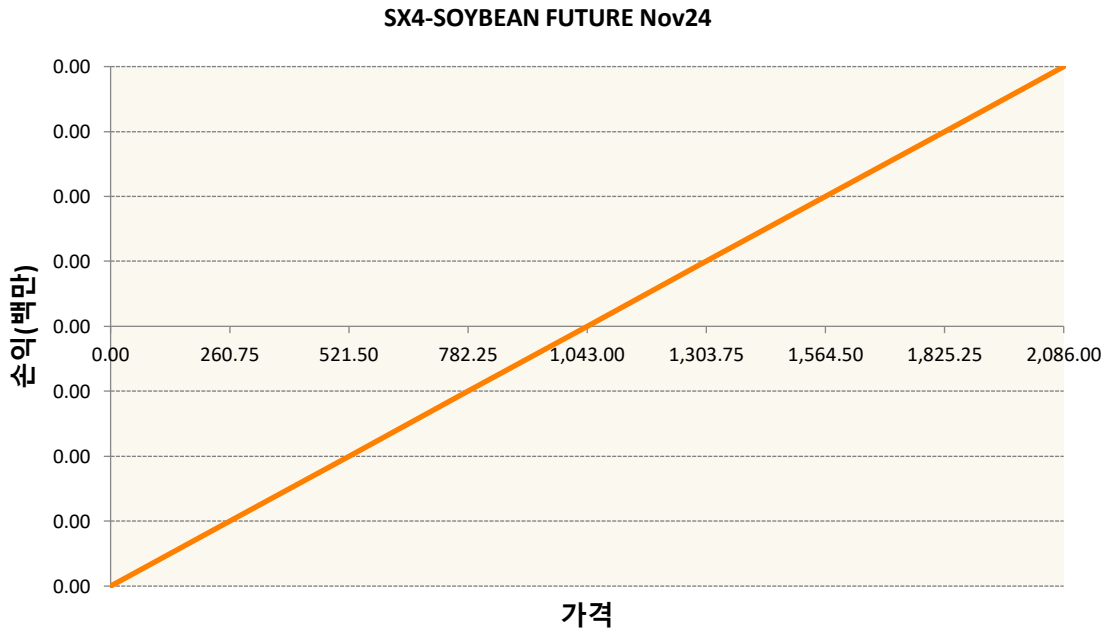

0.00
가격

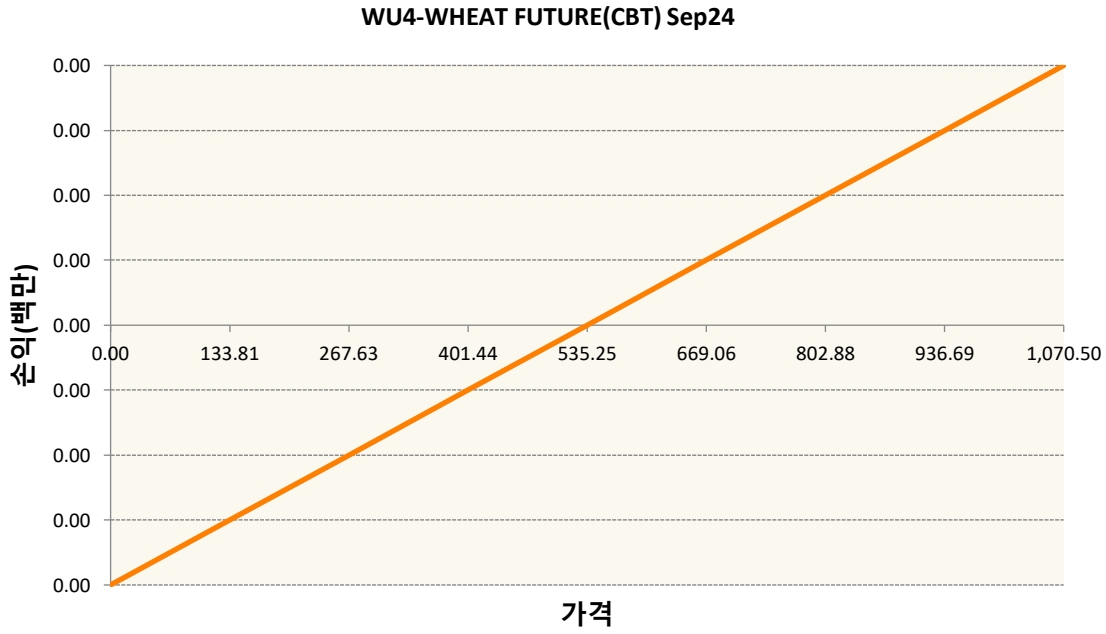

KWU4-KC HRW WHEAT FUT Sep24
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
140.69
281.38
422.06
562.75
703.44
844.13
984.81
1,125.50
손익(백만)
가격


SBV4-Sugar #11 (WORLD) Oct24
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
4.74
9.47
14.21
18.94
23.68
28.41
33.15
37.88
손익(백만)
가격


SMZ4-SOYBEAN MEAL FUTR Dec24
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
77.88
155.75
233.63
311.50
389.38
467.25
545.13
623.00
손익(백만)







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

공시일	2024-07-22
기준일	2024-07-19

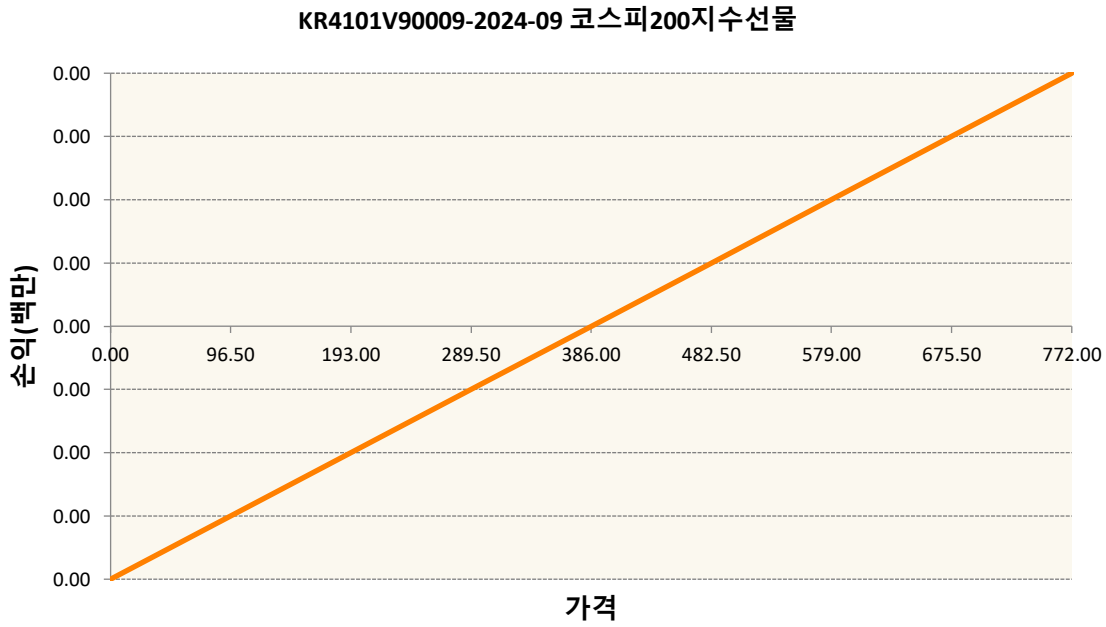
스마트인덱스모

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	2,413	0	2,413	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101V90009	2024-09 코스피200지수선물						192
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-192	-192	-192	-192	-192	-192	-192
-5.33%	-128	-128	-128	-128	-128	-128	-128
-2.67%	-64	-64	-64	-64	-64	-64	-64
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	64	64	64	64	64	64	64
5.33%	128	128	128	128	128	128	128
8.00%	192	192	192	192	192	192	192

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

190

공시일	2024-07-22
기준일	2024-07-19

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	245

* 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	2024-07-22
기준일	2024-07-19

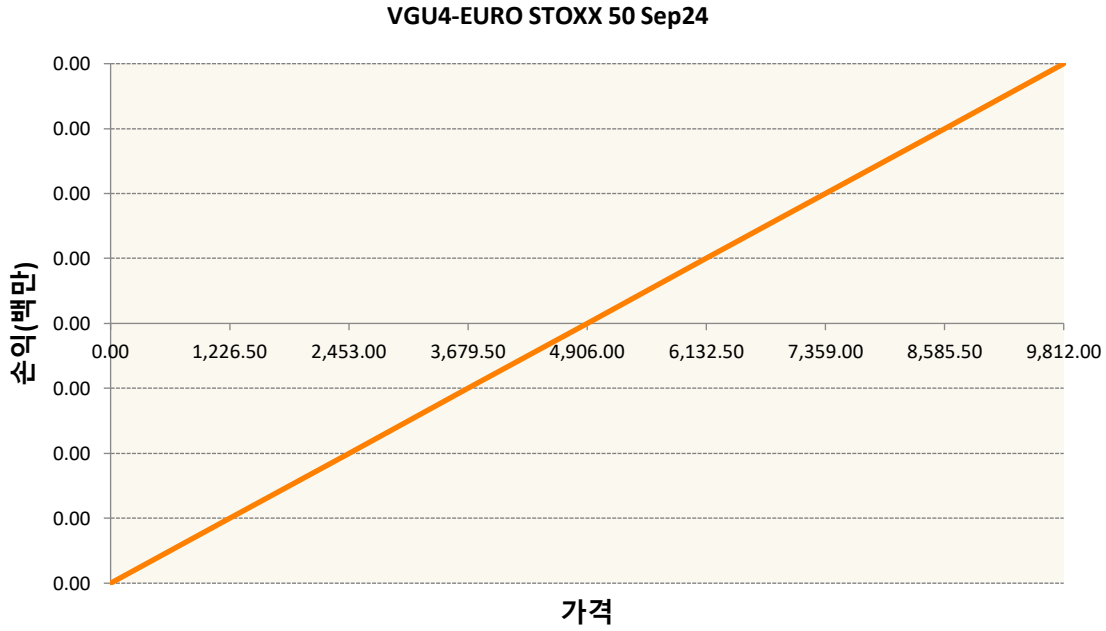
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	946	0	946	

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	2024-07-22
기준일	2024-07-19

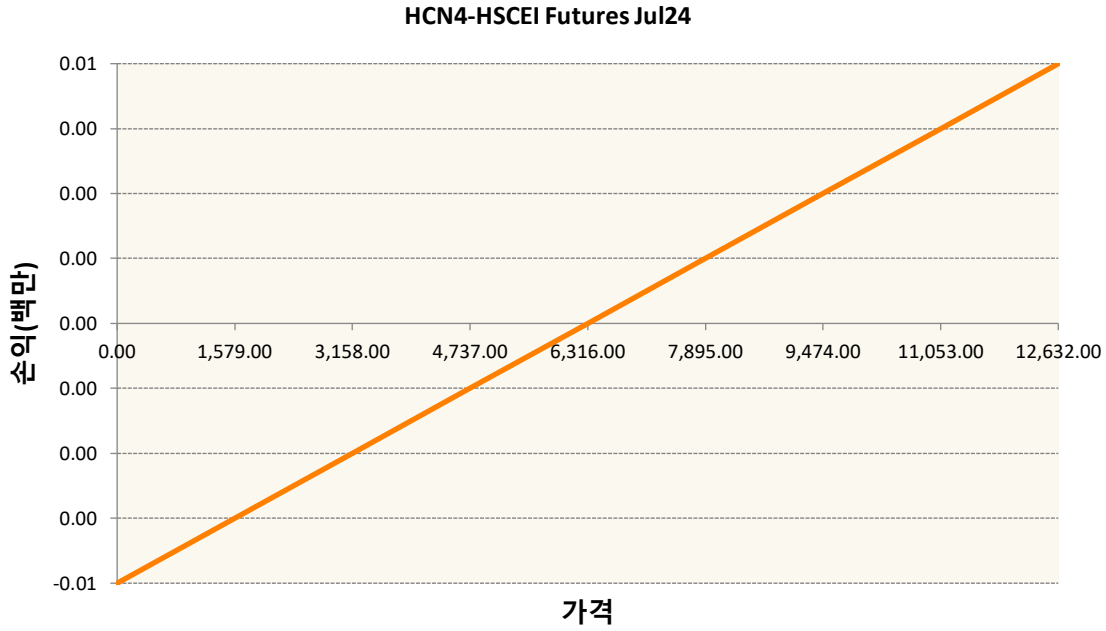
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,572	0	1,572	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCN4	HSCEI Futures Jul24	126

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

(단위:백만원)

153

공시일	2024-07-22
기준일	2024-07-19

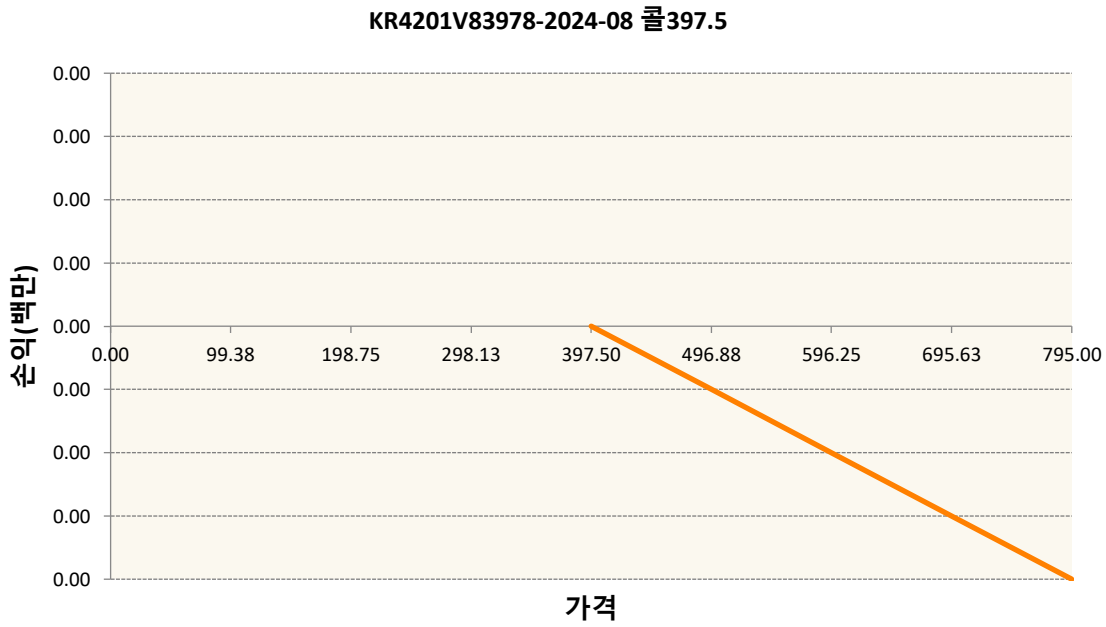
커버드콜모(주식혼합-파생형)

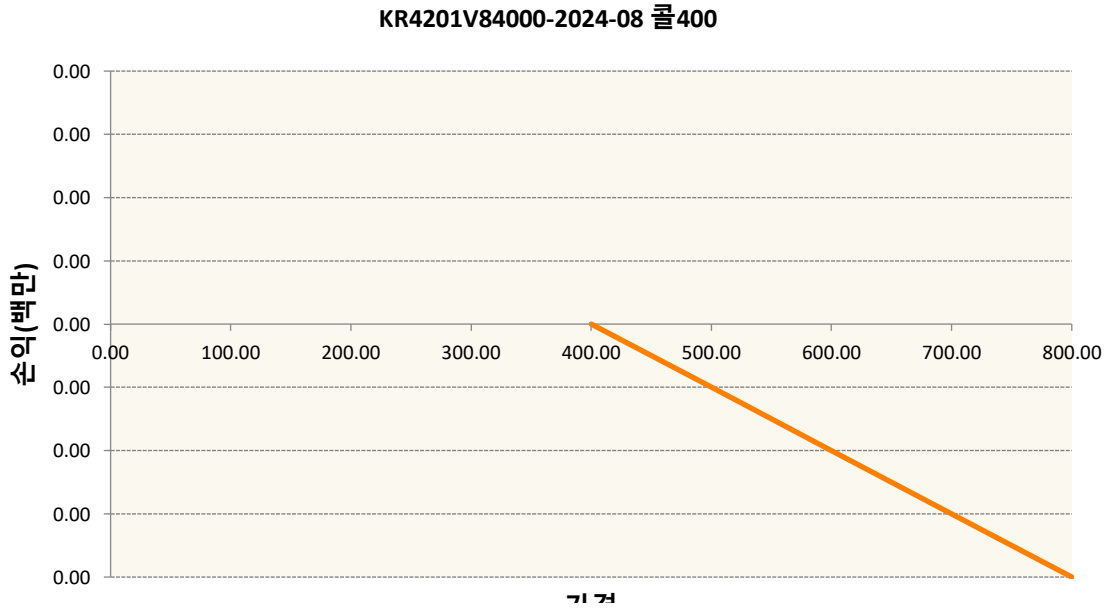
1. 계약금액

(단위:백만원)

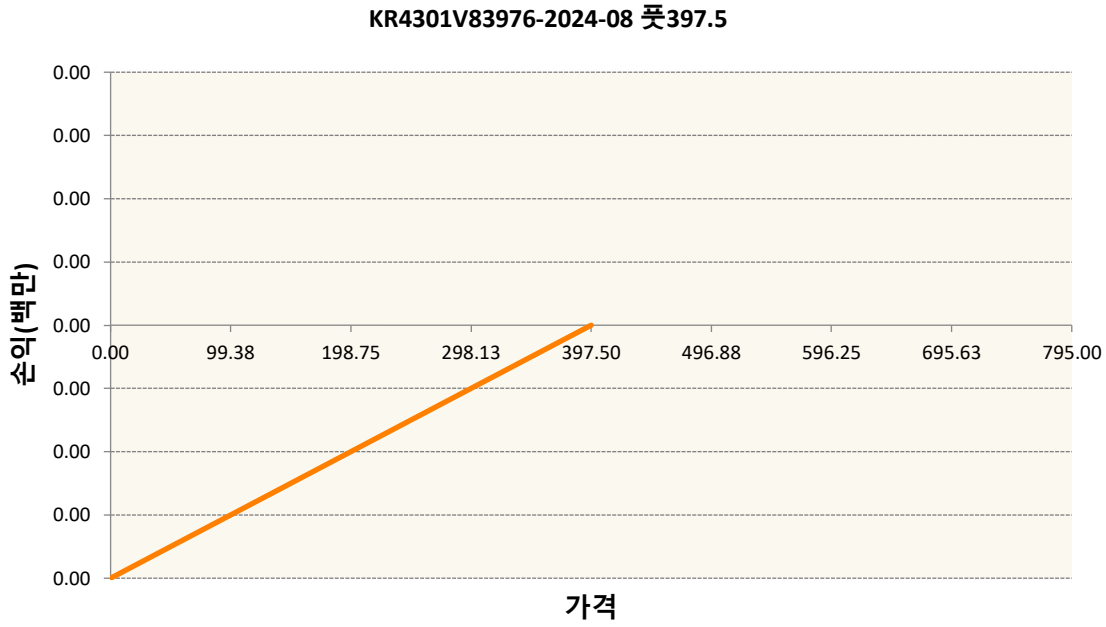
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	45,531	-45,531	장내

2. 만기시점의 손익구조





가격



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201V83978	2024-08 콜397.5						891
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	208	206	203	198	191	182	171
-5.33%	201	194	184	172	158	141	123
-2.67%	173	155	135	113	89	64	37
0%	94	64	32	0	-33	-67	-102
2.67%	-71	-109	-147	-186	-224	-263	-301
5.33%	-341	-377	-414	-452	-490	-528	-566
8.00%	-707	-734	-763	-793	-825	-858	-891
KR4201V84000	2024-08 콜400						824
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	174	172	170	166	160	153	143
-5.33%	169	163	155	145	133	119	103
-2.67%	148	133	116	97	75	52	28
0%	85	58	30	0	-31	-63	-95
2.67%	-54	-90	-127	-164	-201	-238	-276
5.33%	-292	-330	-368	-405	-443	-481	-519
8.00%	-629	-659	-690	-722	-755	-789	-824
KR4301V83976	2024-08 풋397.5						572
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-571	-571	-571	-571	-571	-572	-572
-5.33%	-369	-369	-370	-371	-372	-373	-375

-2.67%	-169	-171	-173	-176	-180	-184	-188
0%	20	14	7	0	-7	-15	-24
2.67%	169	159	149	139	128	118	108
5.33%	256	247	238	228	218	208	198
8.00%	289	284	279	273	267	260	253

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

2,109

공시일	2024-07-22
기준일	2024-07-19

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	1,247	0	1,247	

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	2024-07-22
기준일	2024-07-19

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	4,435	0	4,435	

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	2024-07-22
기준일	2024-07-19

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	15,497	0	15,497	
누계	통화	선도	0	15,184	-15,184	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213E4S(	KRW/USD	31-07-24E	198
FXW213E5W	KRW/USD	30-08-24E	594
FXW213E6S(	KRW/USD	30-09-24E	372
FXW213E7B(	KRW/USD	31-07-24E	24
FXW213E7G	KRW/USD	31-07-24E	28

IE00BD8RGM75 * 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

544

공시일	2024-07-22
기준일	2024-07-19

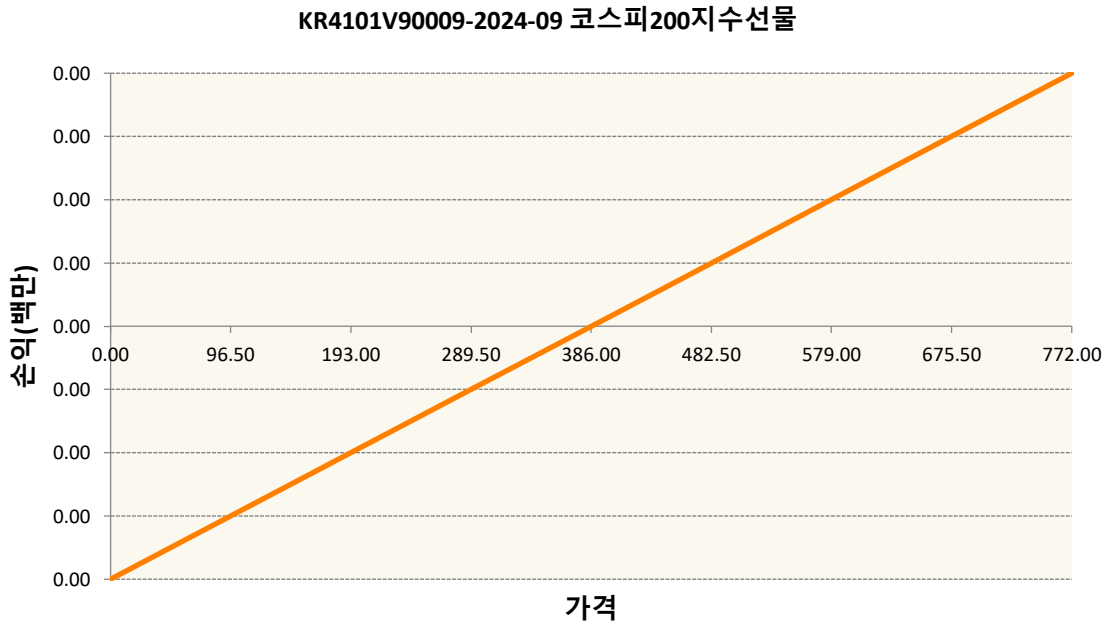
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

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	772	0	772	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101V90009	2024-09 코스피200지수선물						61
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-61	-61	-61	-61	-61	-61	-61
-5.33%	-41	-41	-41	-41	-41	-41	-41
-2.67%	-20	-20	-20	-20	-20	-20	-20
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	20	20	20	20	20	20	20
5.33%	41	41	41	41	41	41	41
8.00%	61	61	61	61	61	61	61

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

61

공시일	2024-07-22
기준일	2024-07-19

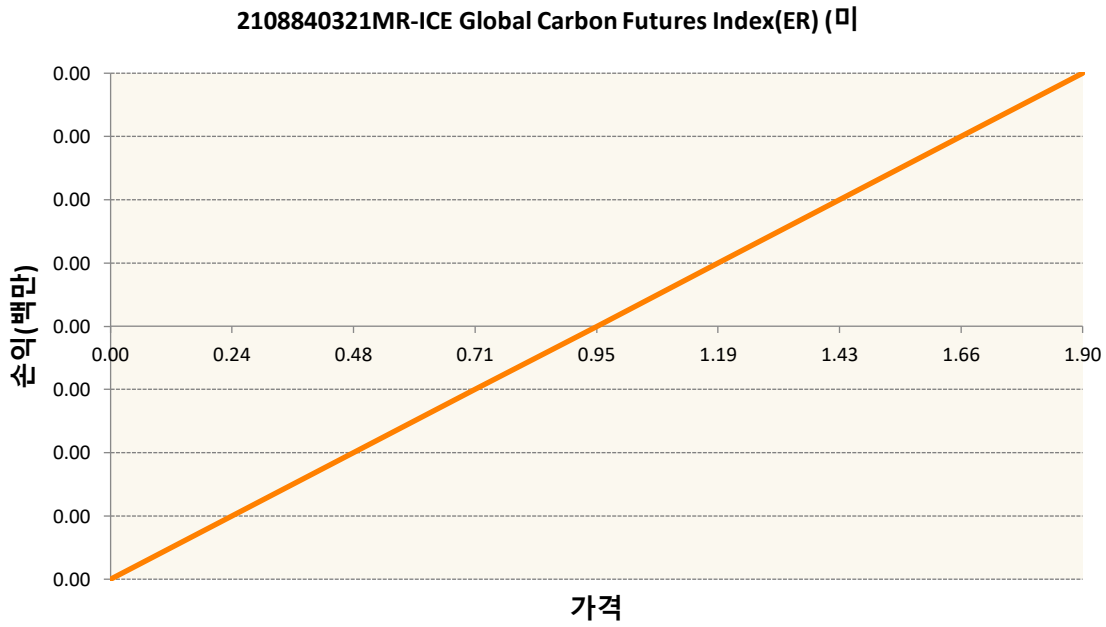
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

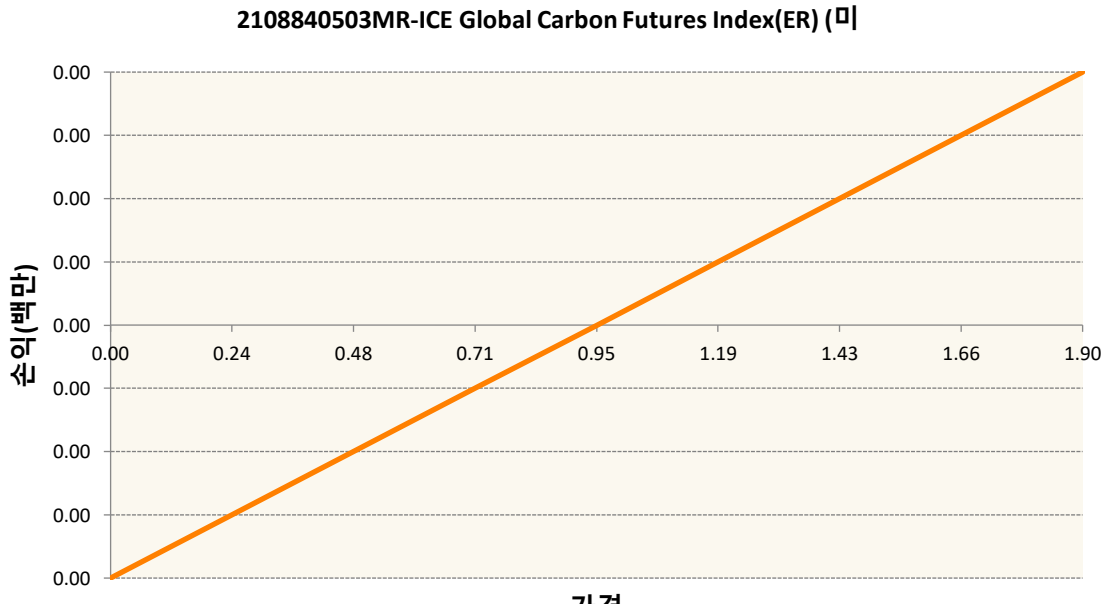
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	15,743	0	15,743	

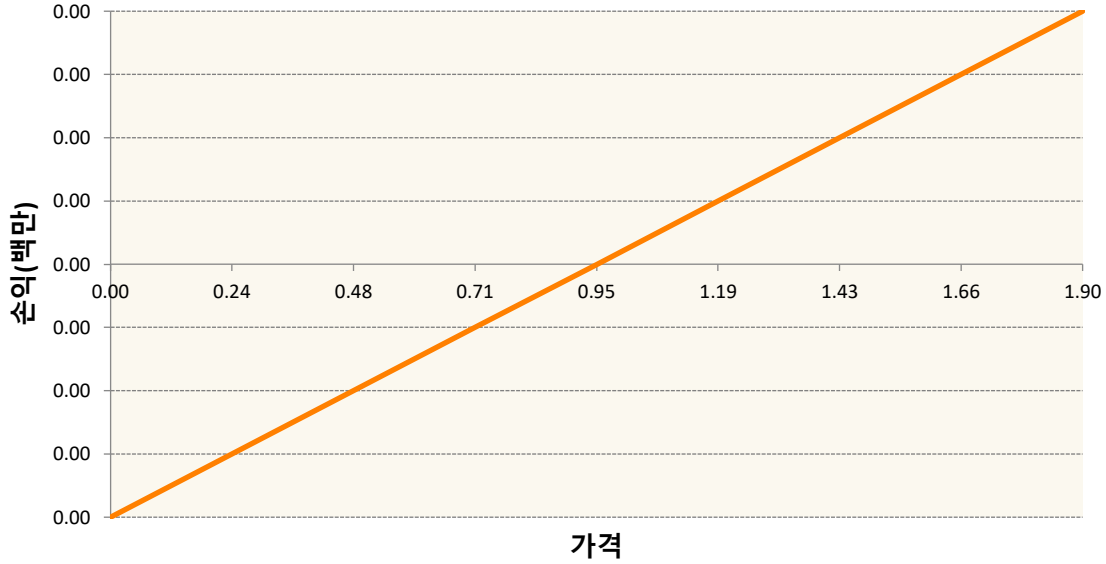
2. 만기시점의 손익구조



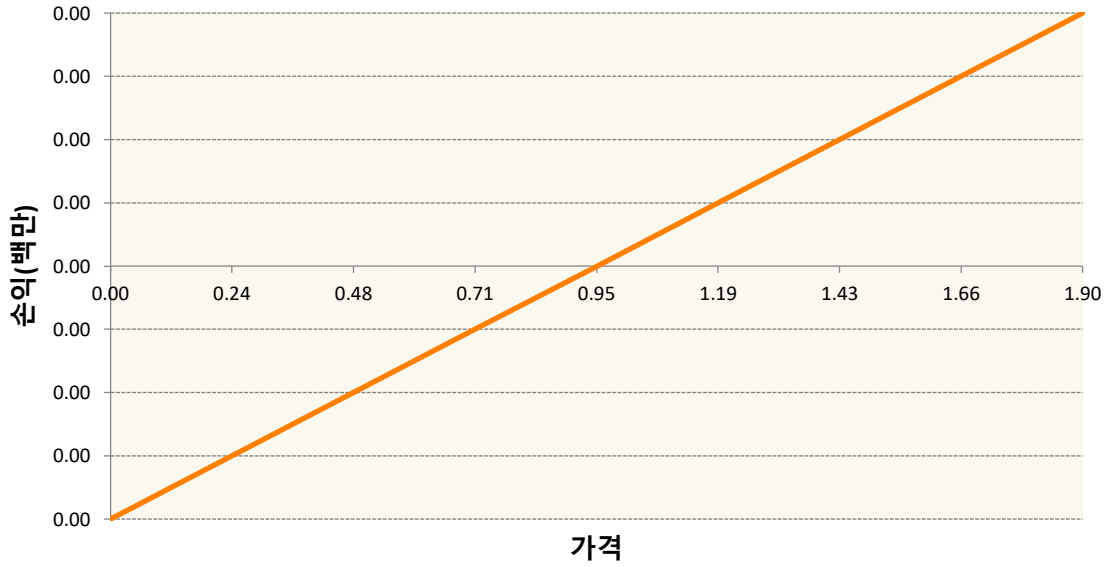


가격

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	484
2108840503 ICE Global Carbon Futures Index(ER) (미	194
2108840610 ICE Global Carbon Futures Index(ER) (키	387
2108840920 ICE Global Carbon Futures Index(ER) (메	194

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,424

공시일	2024-07-22
기준일	2024-07-19

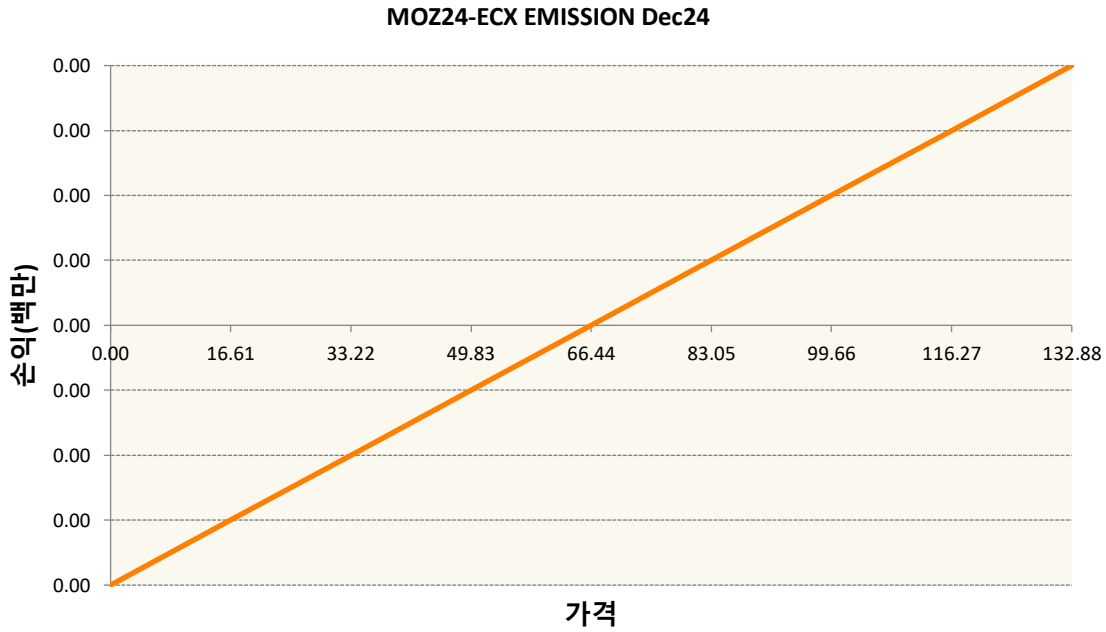
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	8,884	0	8,884	
누계	지수	스왑	373	0	373	장외
누계	통화	선도	1,337	2,792	-1,455	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213E6VI	KRW/USD 31-07-24E	107
FXW213E6VI	KRW/EUR 31-07-24E	116
FXW213E6VI	USD/KRW 31-07-24E	107
MOZ24	ECX EMISSION Dec24	711
SWICEUACN	ICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX	1

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

(단위:백만원)

	1,388

공시일	2024-07-22
기준일	2024-07-19

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)

SWCSI00000C 신한CSI Index 240620 (키움)	7
SWCSI00000C 신한CSI Index 240620 (미래)	11
SWCSI00000C 신한CSI Index 240620 (메리츠)	11
SWCSI00000C 신한CSI Index 240620 (NH)	7

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

(단위:백만원)

51

공시일	2024-07-22
기준일	2024-07-19

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)	4
SWSTAR000 신한 STAR 50 Index 231226(NH)	3
SWSTAR000 신한 STAR 50 Index 231226(메리츠)	5
SWSTAR000 신한 STAR 50 Index 231226(키움)	1

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

(단위:백만원)

15

공시일	2024-07-22
기준일	2024-07-19

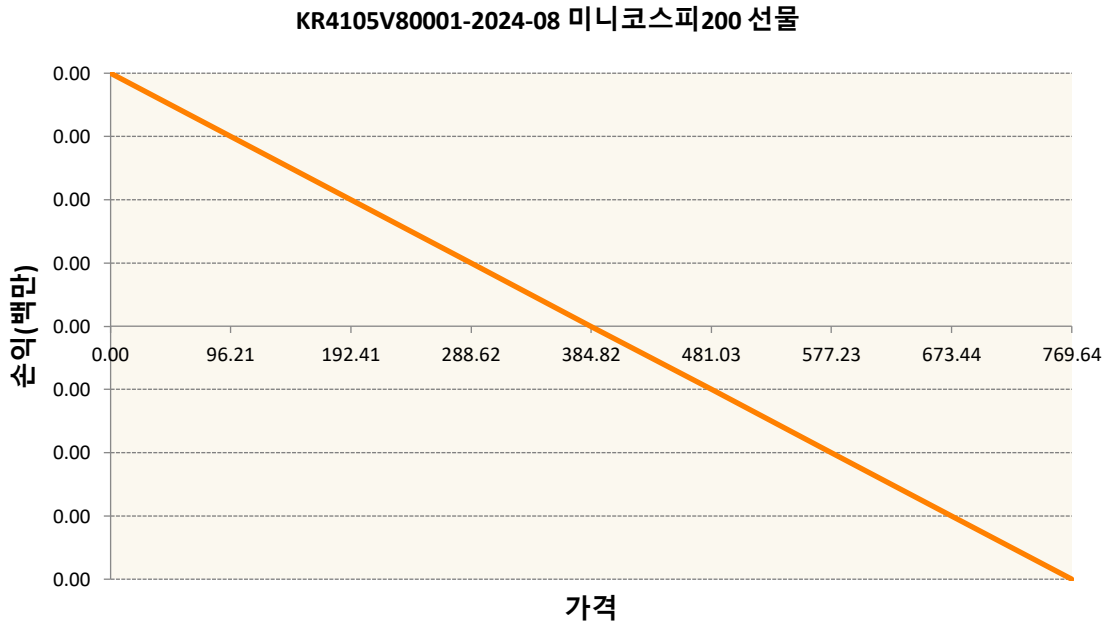
에쿼티알파일반사모혼합자산

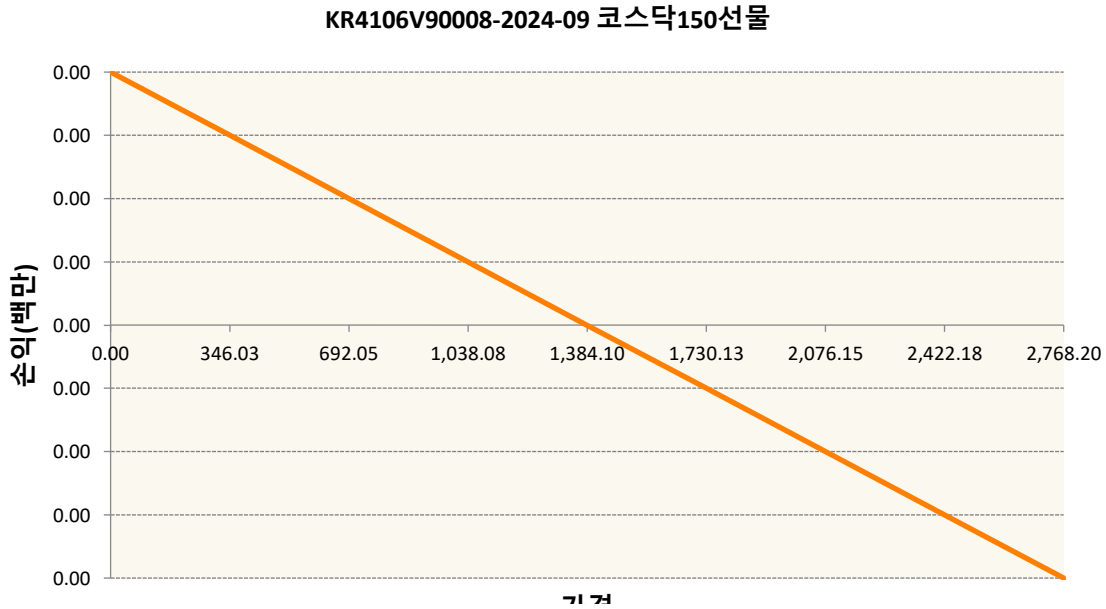
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	96	-96	장내
누계	유가증권	선물	0	234	-234	장내

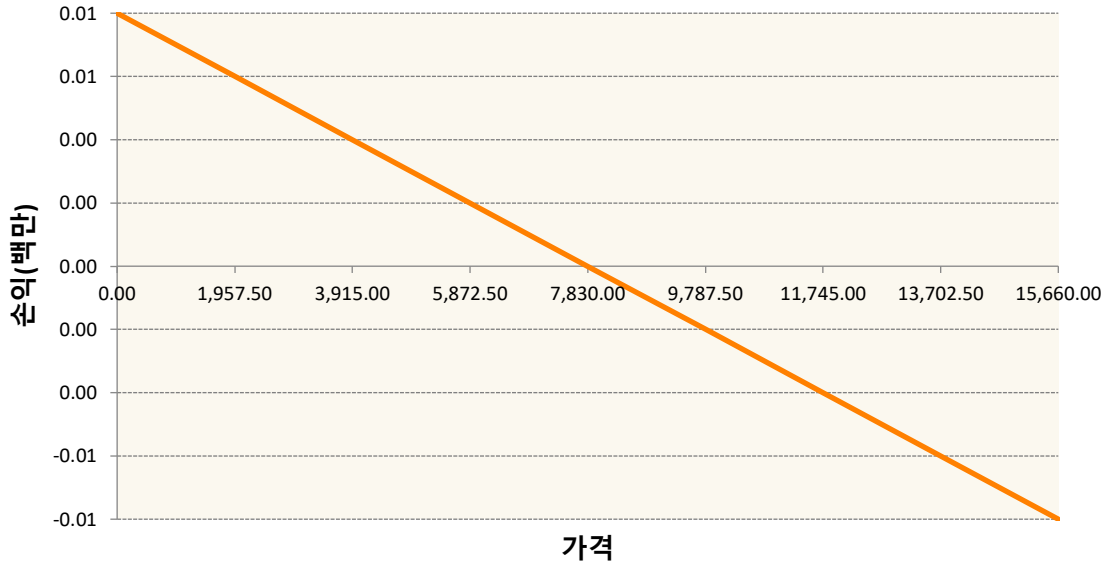
2. 만기시점의 손익구조



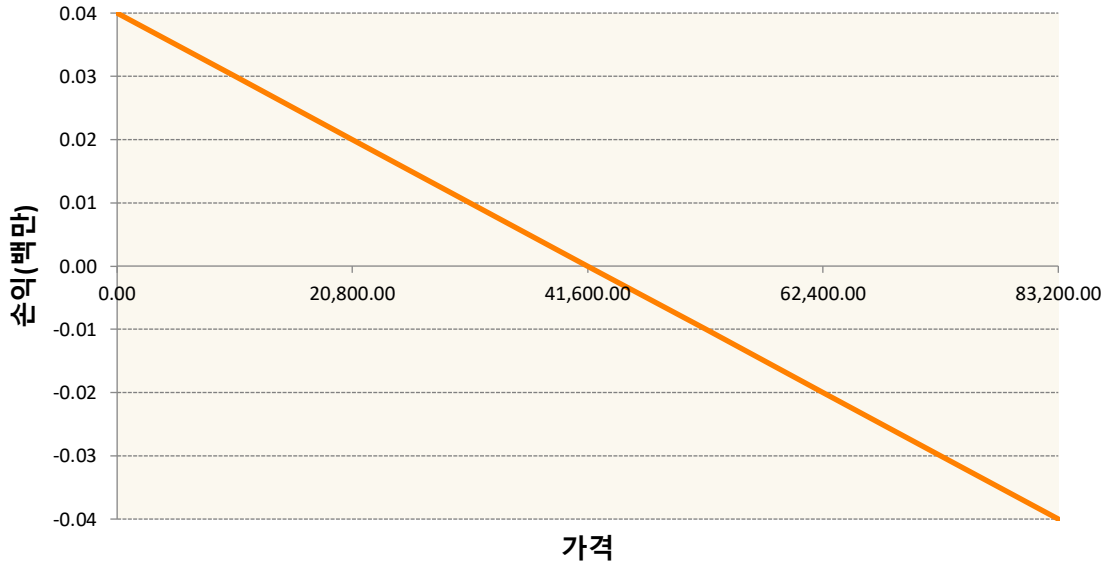


가격

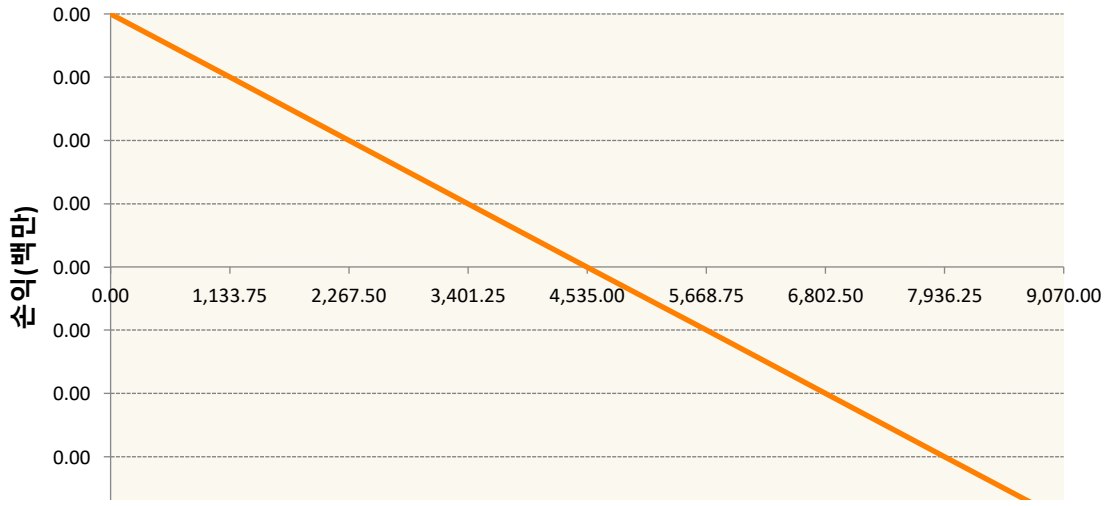
KR4149V80009-2024-08 HD현대인프라코어개별선물

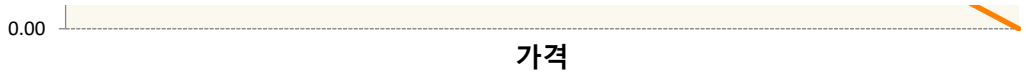


KR41CFV80005-2024-08 카카오개별선물



KR41CYV80006-2024-08 한온시스템개별선물





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
KR4105V80C	2024-08	미니코스피200 선물	2
KR4106V90C	2024-09	코스닥150선물	9
KR4149V80C	2024-08	HD현대인프라코어개별선물	1
KR41CFV80C	2024-08	카카오개별선물	0.5
KR41CYV80C	2024-08	한온시스템개별선물	1

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	21

공시일	2024-07-22
기준일	2024-07-19

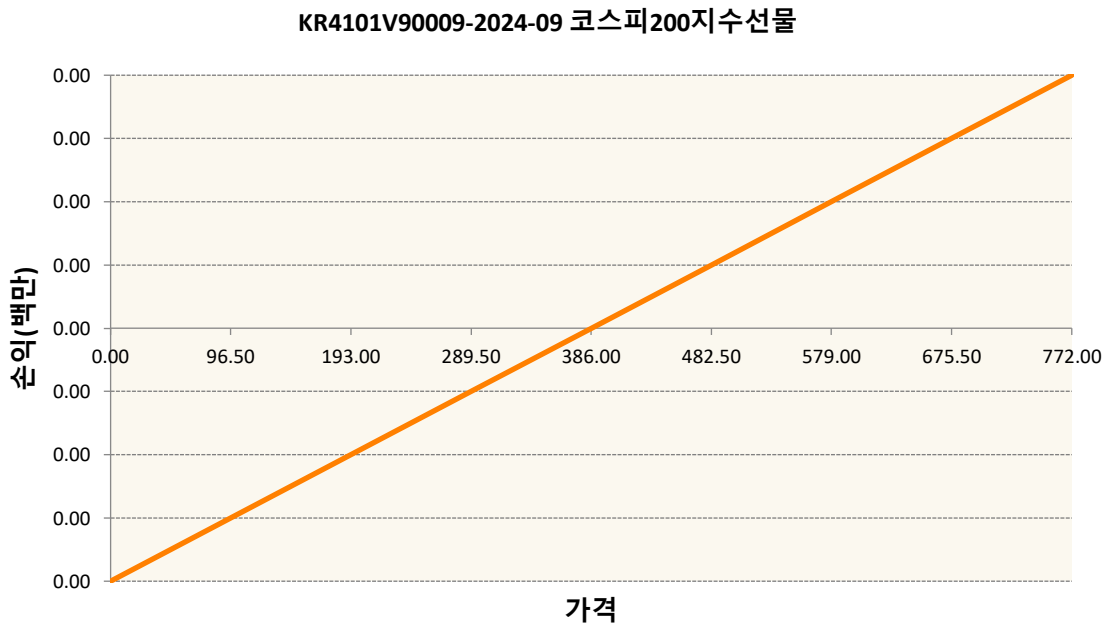
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

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	9,650	0	9,650	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101V90009	2024-09 코스피200지수선물	768

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-768	-768	-768	-768	-768	-768	-768
-5.33%	-512	-512	-512	-512	-512	-512	-512
-2.67%	-256	-256	-256	-256	-256	-256	-256
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	256	256	256	256	256	256	256
5.33%	512	512	512	512	512	512	512
8.00%	768	768	768	768	768	768	768

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

760

공시일	2024-07-22
기준일	2024-07-19

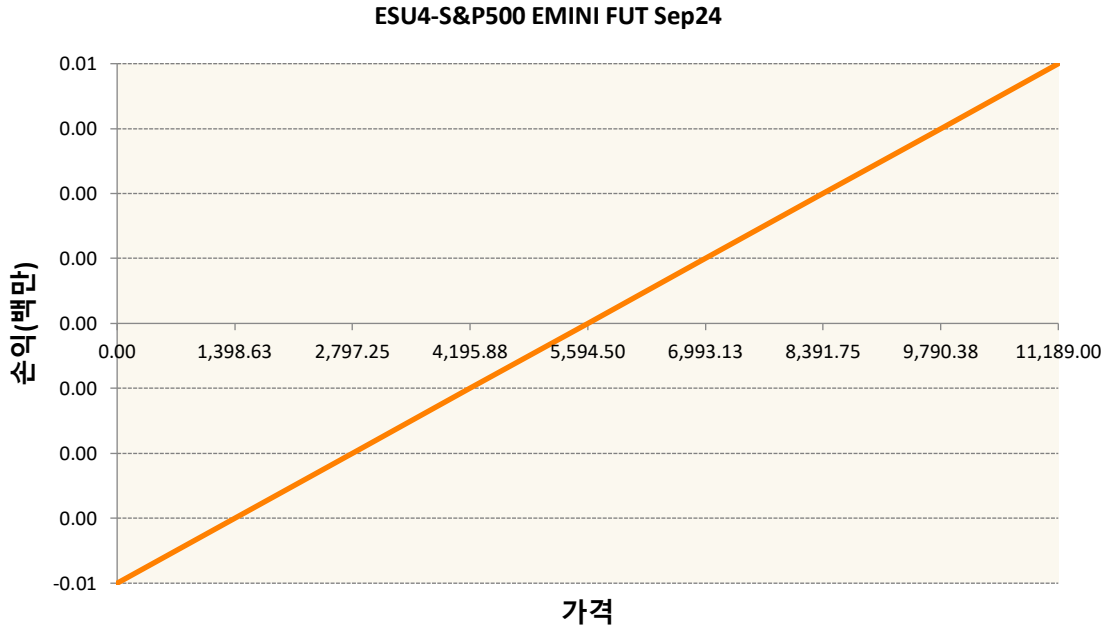
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

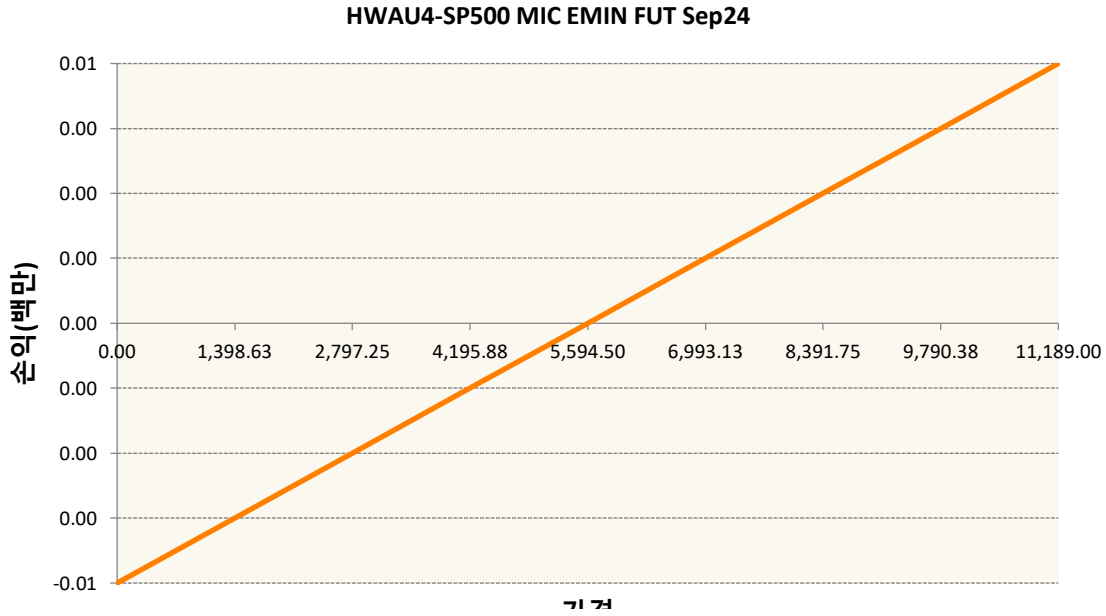
1. 계약금액

(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	8,538	0	8,538	
누계	유가증권	선물	2,795	0	2,795	장내

2. 만기시점의 손익구조





가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESU4	S&P500 EMINI FUT Sep24	683
HWAU4	SP500 MIC EMIN FUT Sep24	224

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	537

공시일	2024-07-22
기준일	2024-07-19

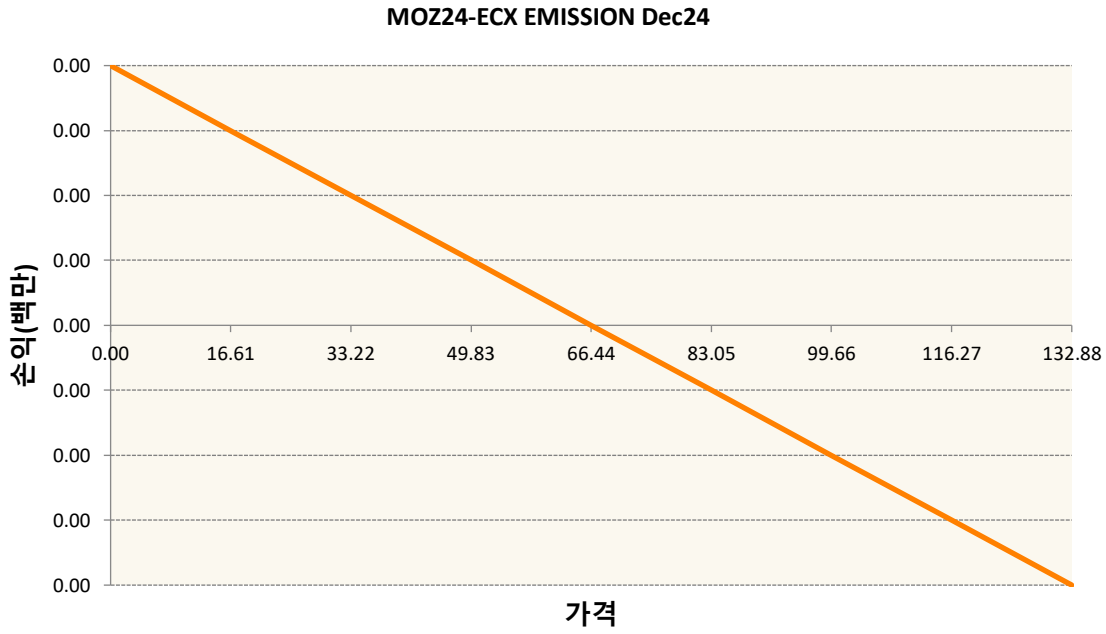
SOL유럽탄소배출권선물인버스ICE특별자산상

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	6,304	-6,304	
누계	지수	스왑	373	0	373	장외
누계	통화	선도	987	2,514	-1,527	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213E6S(	KRW/EUR 31-07-24E	36
FXW213E6VI	KRW/USD 31-07-24E	79
FXW213E6VI	KRW/EUR 31-07-24E	86
FXW213E6VI	USD/KRW 31-07-24E	79
MOZ24	ECX EMISSION Dec24	504
SWICEUACN	ICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX	1

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

1,010

공시일	2024-07-22
기준일	2024-07-19

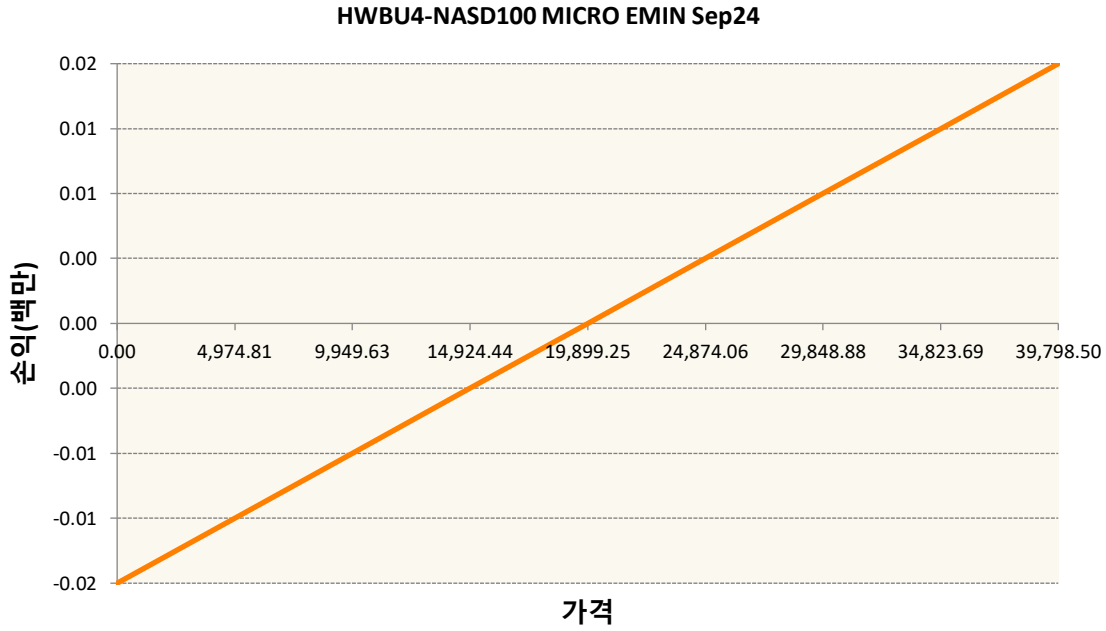
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

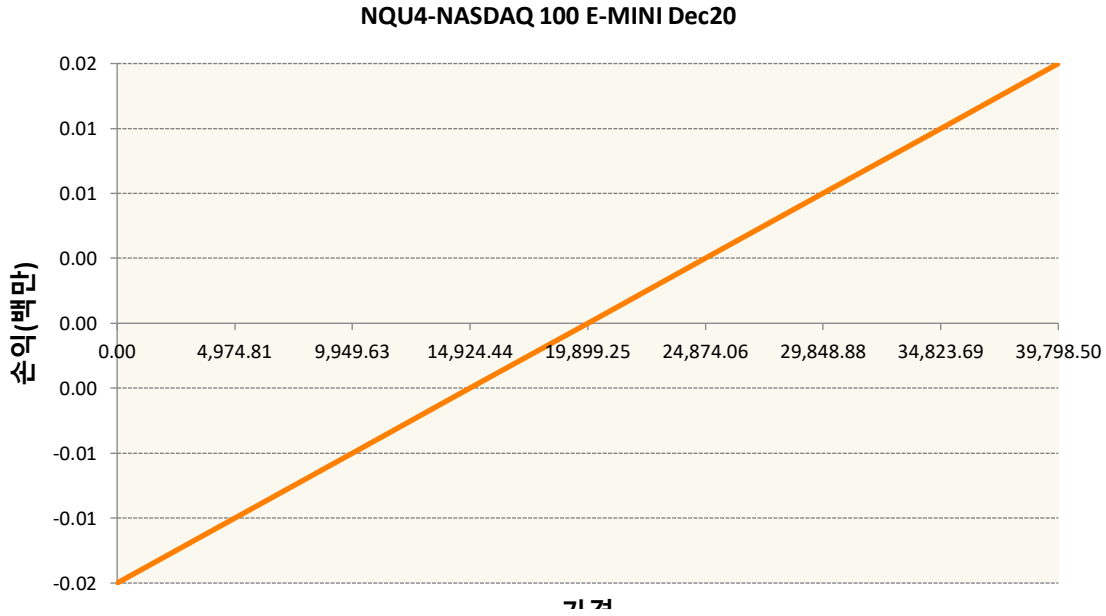
1. 계약금액

(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	7,172	0	7,172	
누계	유가증권	선물	3,534	0	3,534	장내

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HWBU4	NASD100 MICRO EMIN Sep24	283
NQU4	NASDAQ 100 E-MINI Dec20	574

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

633

공시일	2024-07-22
기준일	2024-07-19

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	170,690	0	170,690	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWKEDI000(	KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	711
SWKEDI000(	KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	6,685
SWKEDI000(	KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	3,684
SWKEDI000(	KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	2,727

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

(단위:백만원)

8,306

공시일	2024-07-22
기준일	2024-07-19

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	20
SWSOL0000 SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	20
SWSOL0000 SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	20
SWSOL0000 SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	20

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

(단위:백만원)

83

공시일	2024-07-22
기준일	2024-07-19

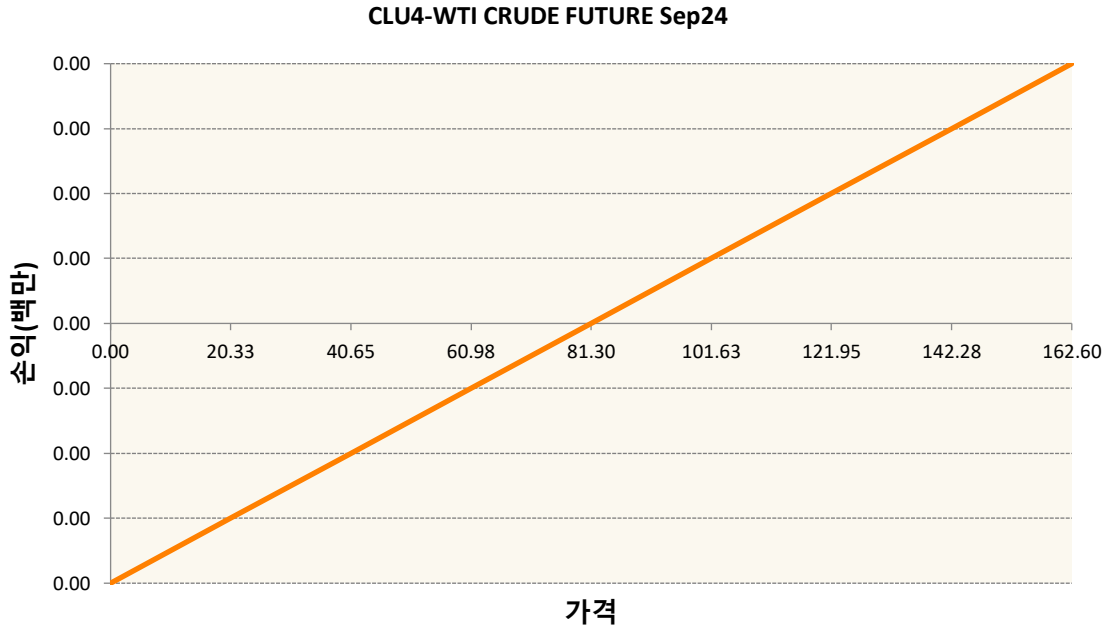
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

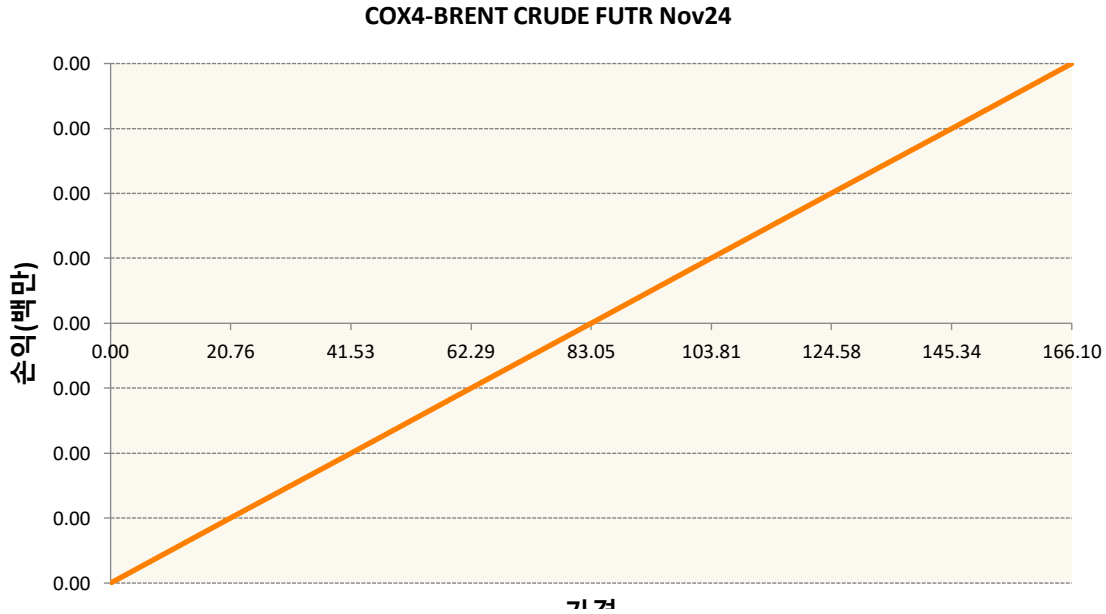
1. 계약금액

(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	896	0	896	
누계	통화	선물	0	111	-111	장내

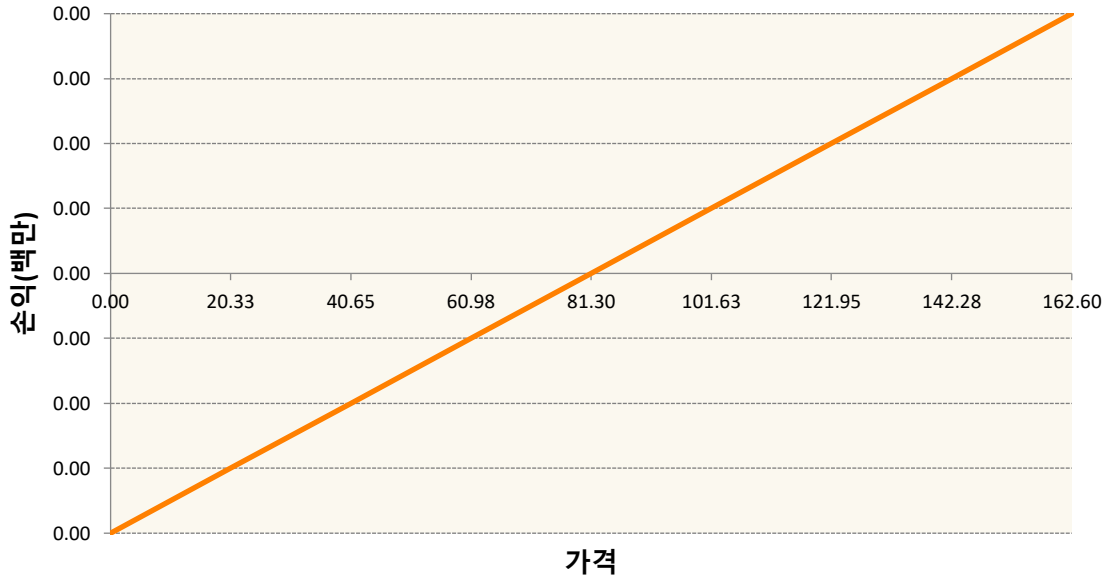
2. 만기시점의 손익구조



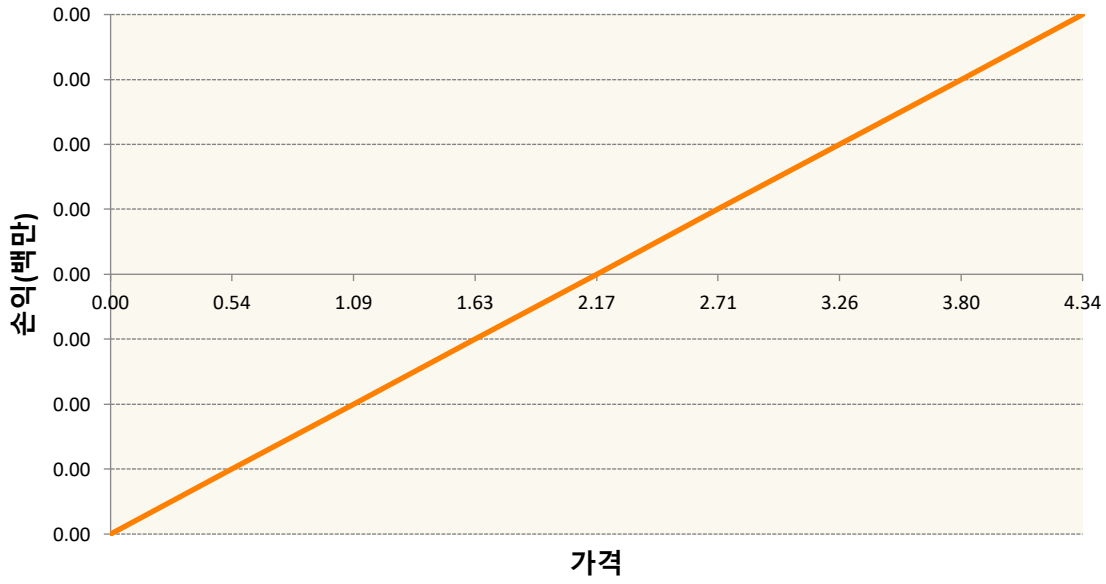


가격

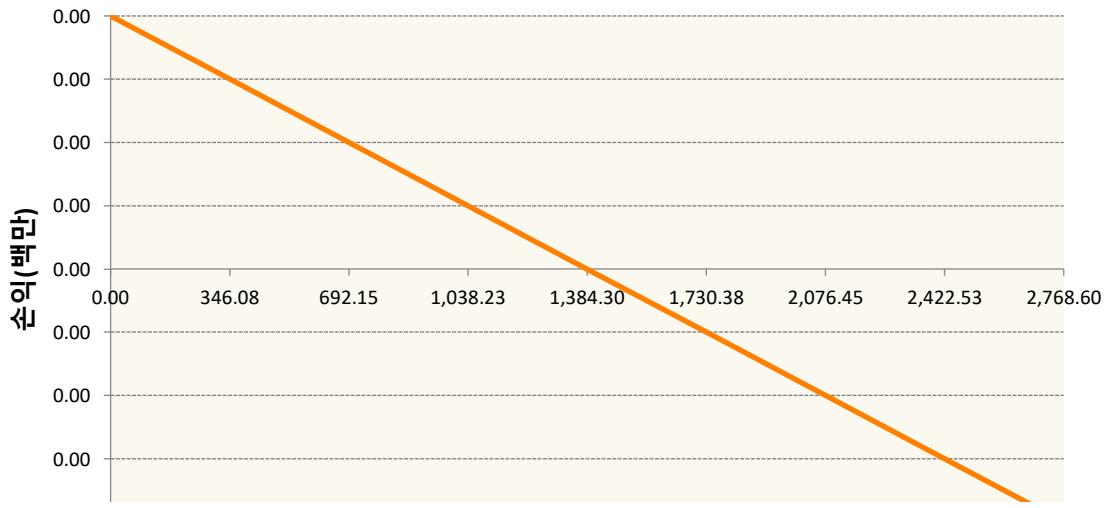
ECU4-E-mini Crude Oil Sep24

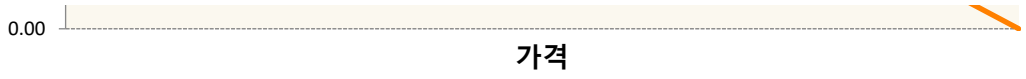


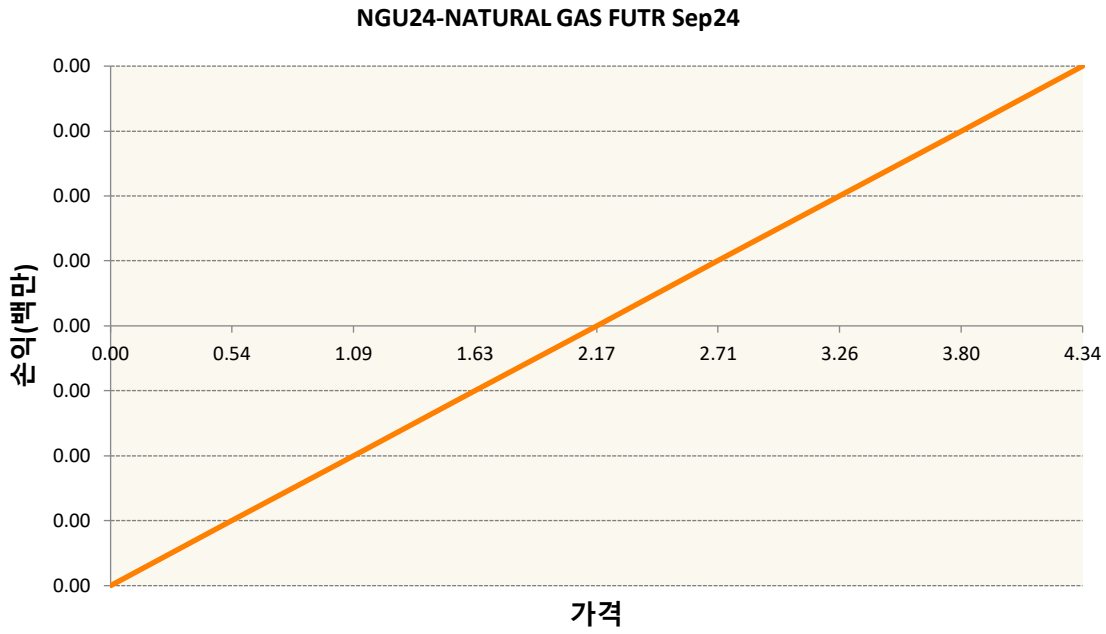
EOU4-E-MINI NATURAL GAS Sep24

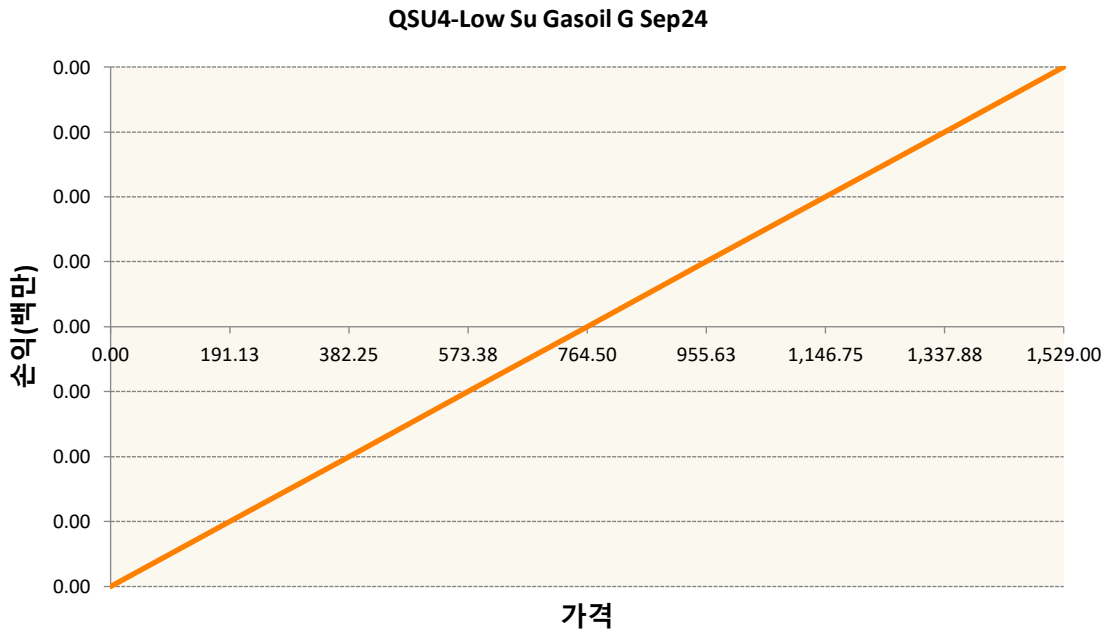


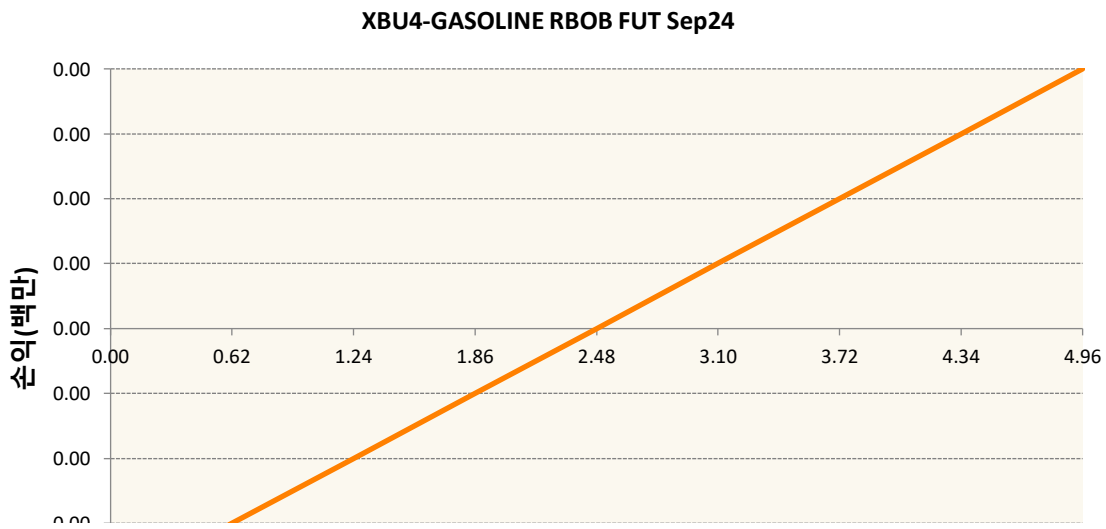
KR4175V80004-2024-08 달러선물




0.00
가격


NGU24-NATURAL GAS FUTR Sep24
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
손익(백만)
0.00
0.54
1.09
1.63
2.17
2.71
3.26
3.80
4.34
가격


QSU4-Low Su Gasoil G Sep24
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
손익(백만)
0.00
191.13
382.25
573.38
764.50
955.63
1,146.75
1,337.88
1,529.00
가격


XBU4-GASOLINE RBOB FUT Sep24
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
손익(백만)
0.00
0.62
1.24
1.86
2.48
3.10
3.72
4.34
4.96

가격

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	1
KR4175V80(	2024-08 달러선물	9
NGU24	NATURAL GAS FUTR Sep24	14
QSU4	Low Su Gasoil G Sep24	8
XBU4	GASOLINE RBOB FUT Sep24	11

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	146