

공시일 2024-08-02

기준일 2024-08-01

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	2024-08-02
기준일	2024-08-01

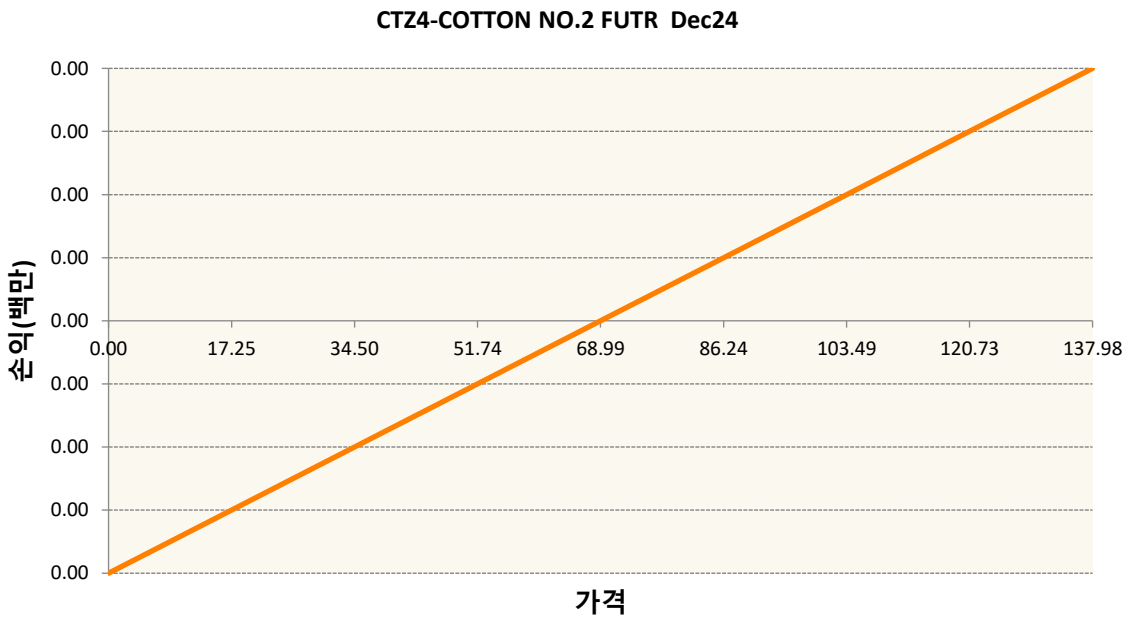
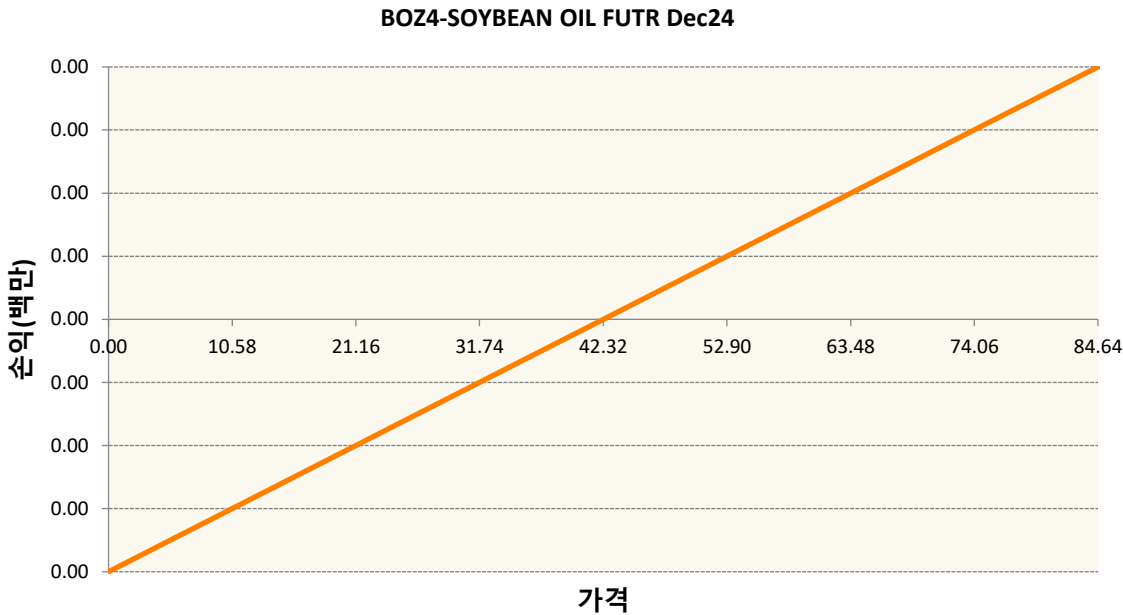
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

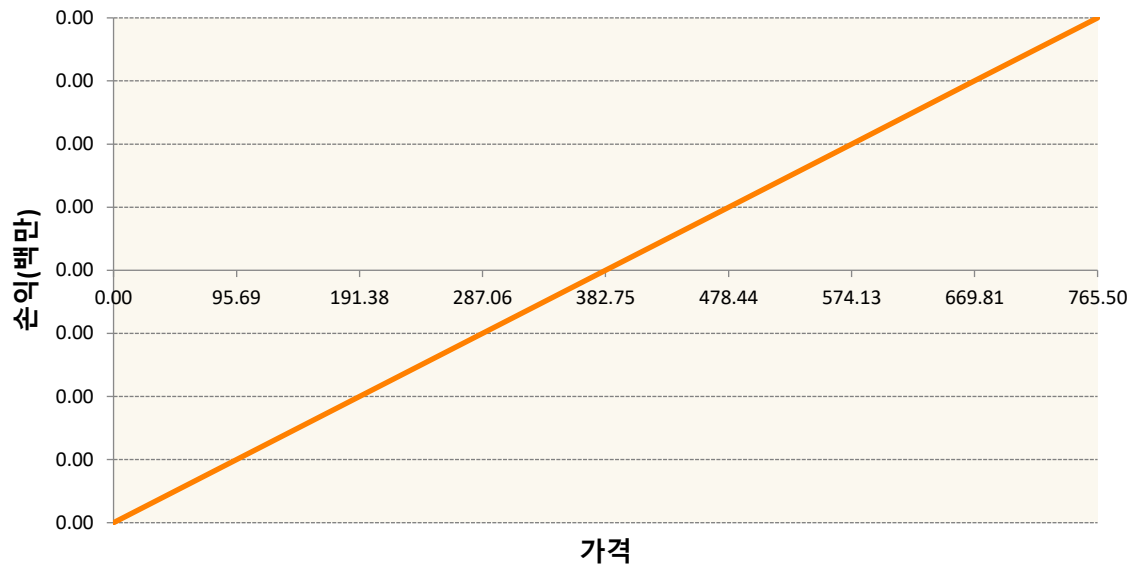
(단위:USD 백만)

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	3,776	0	3,776	
누계	통화	선물	0	301	-301	장내

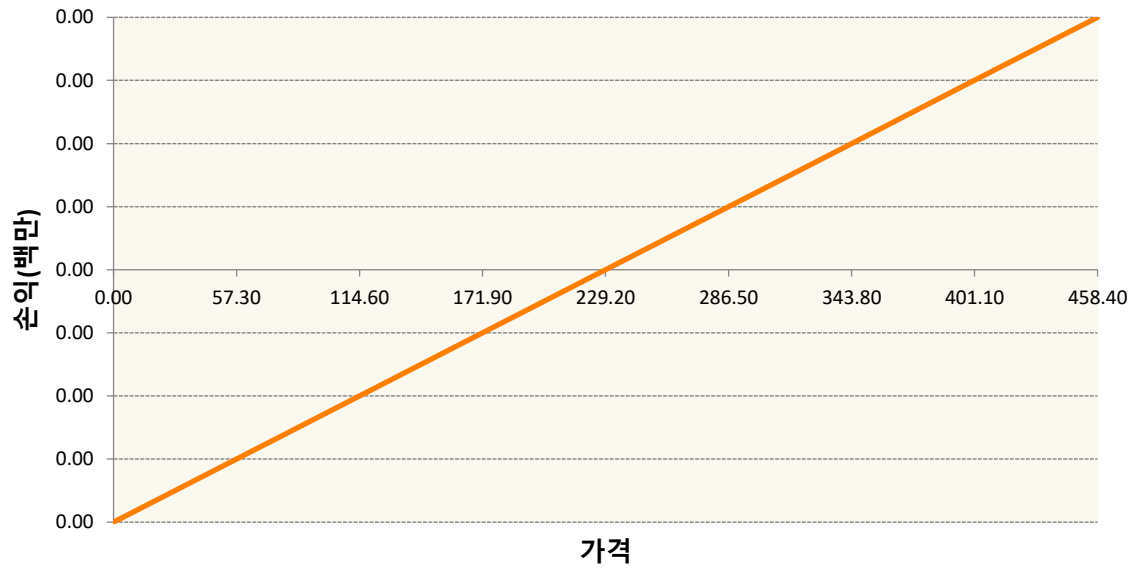
2. 만기시점의 손익구조



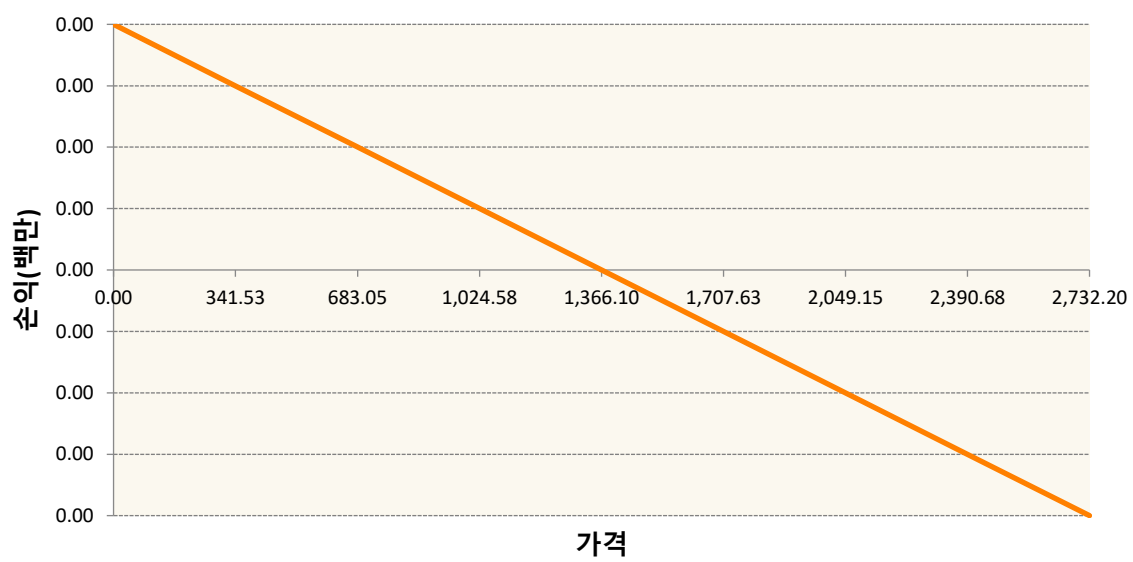
CU4-CORN FUTURE Sep24



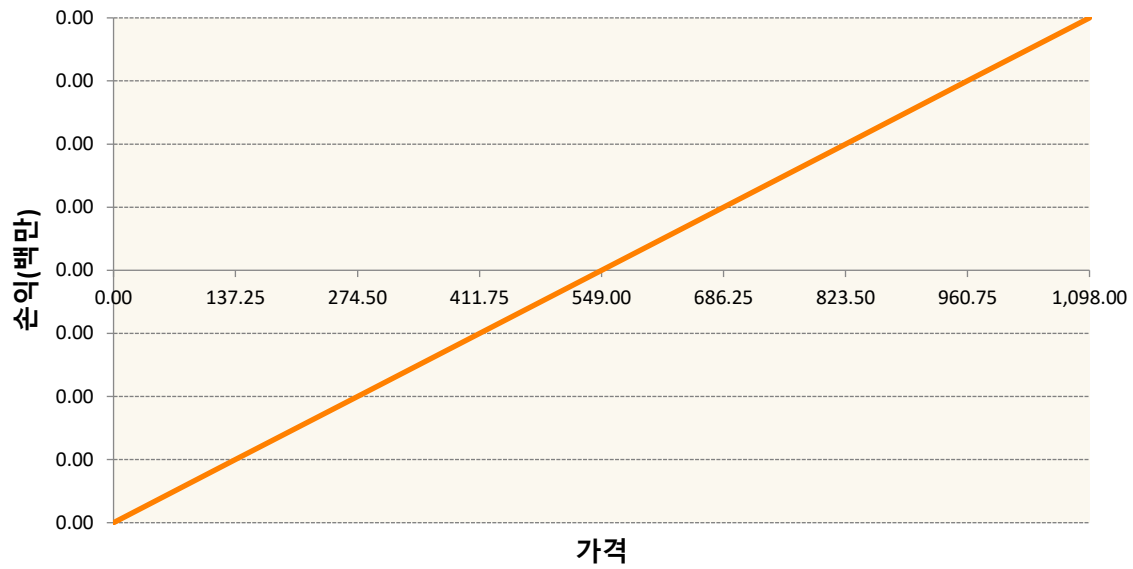
KCU4-COFFEE 'C' FUTURE Sep24



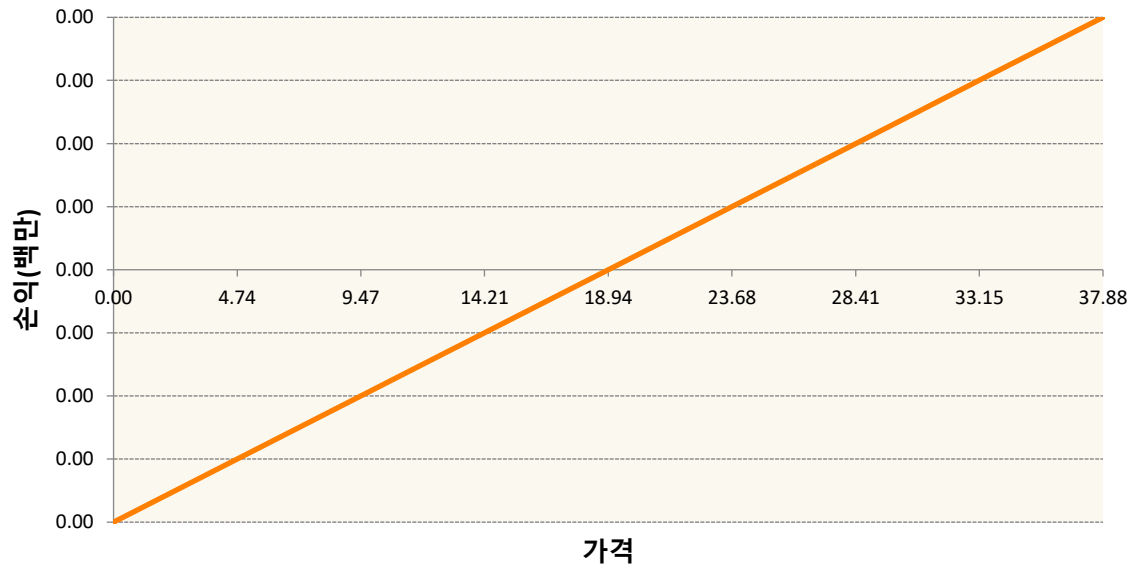
KR4175V80004-2024-08 달러선물



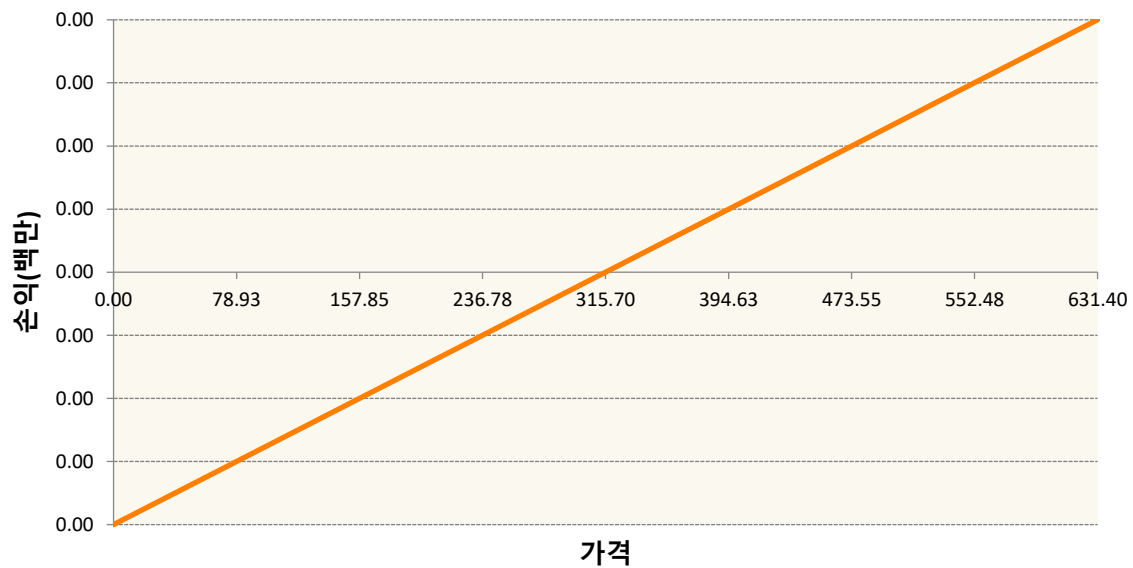
KWU4-KC HRW WHEAT FUT Sep24

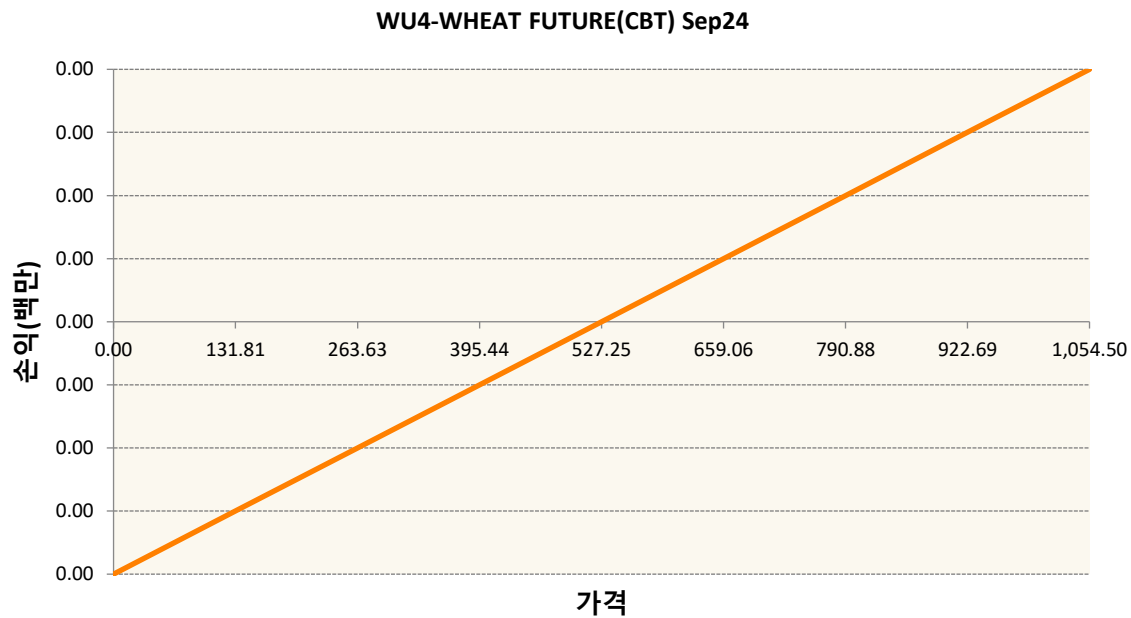
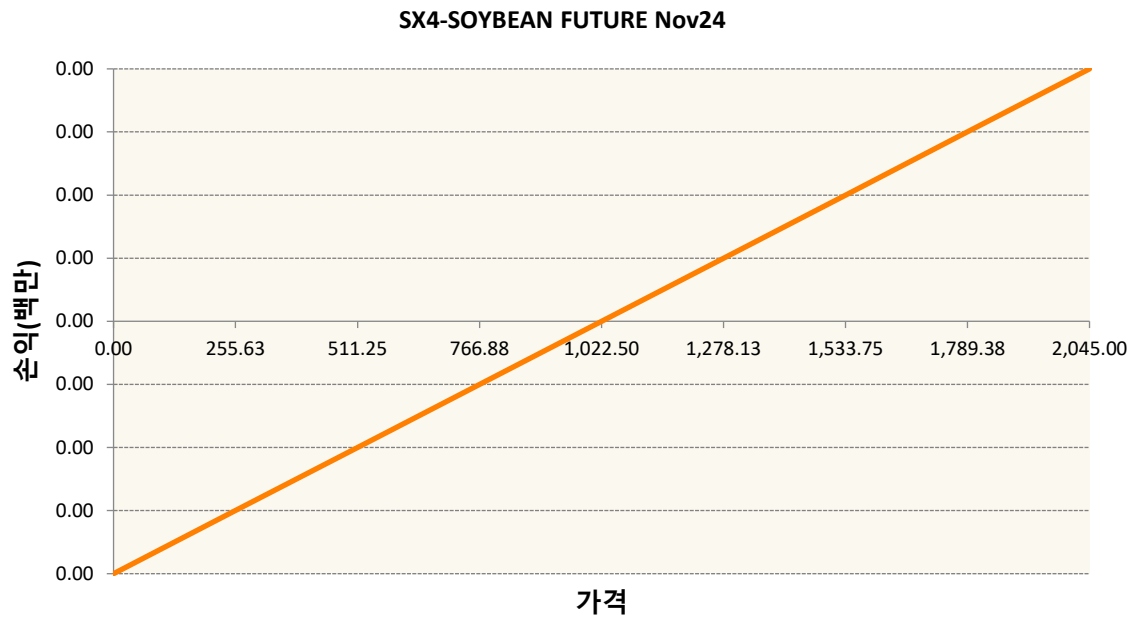


SBV4-Sugar #11 (WORLD) Oct24



SMZ4-SOYBEAN MEAL FUTR Dec24





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

공시일	2024-08-02
기준일	2024-08-01

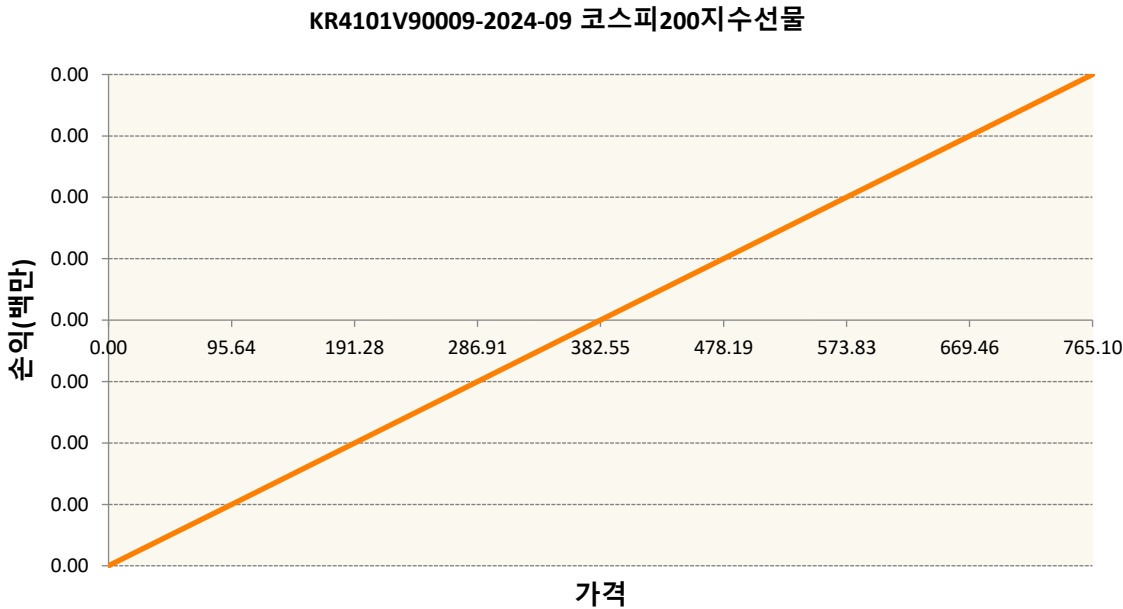
스마트인덱스모

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	290	0	290	장내
누계	유가증권	선물	3,730	0	3,730	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101V90009		2024-09 코스피200지수선물					297
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-297	-297	-297	-297	-297	-297	-297
-5.33%	-198	-198	-198	-198	-198	-198	-198
-2.67%	-99	-99	-99	-99	-99	-99	-99
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	99	99	99	99	99	99	99
5.33%	198	198	198	198	198	198	198
8.00%	297	297	297	297	297	297	297

공시일	2024-08-02
기준일	2024-08-01

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)

SWCSI50000 신한CSI500미래231226	247
-----------------------------	-----

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

310

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2024-08-02
기준일	2024-08-01

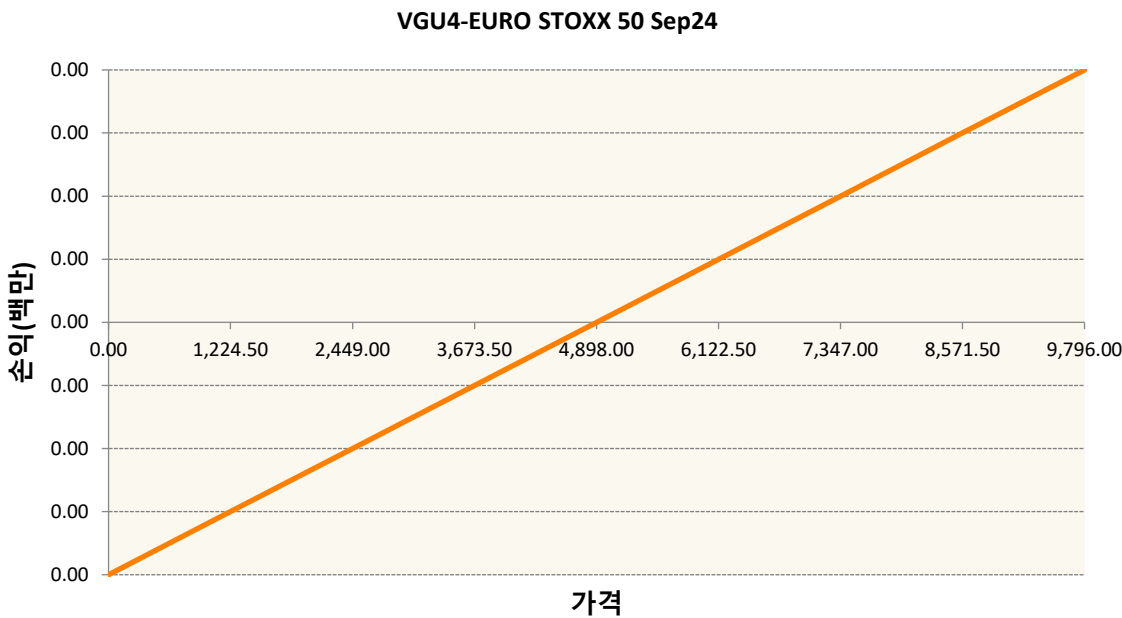
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	944	0	944	

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	2024-08-02
기준일	2024-08-01

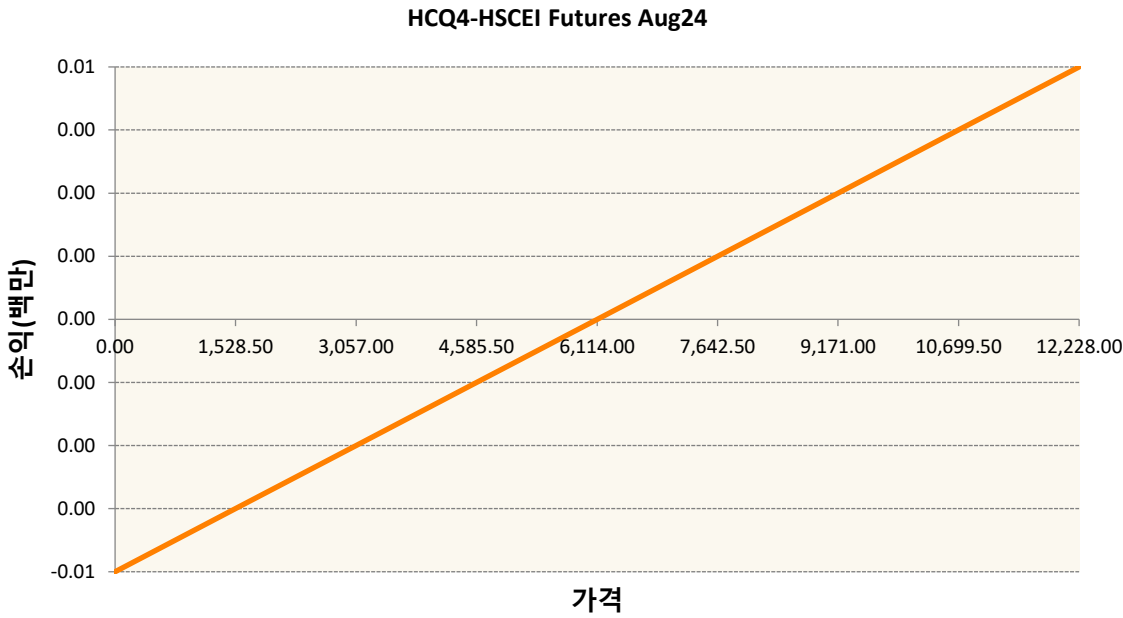
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,518	0	1,518	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCQ4	HSCEI Futures Aug24	121
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

147

공시일	2024-08-02
기준일	2024-08-01

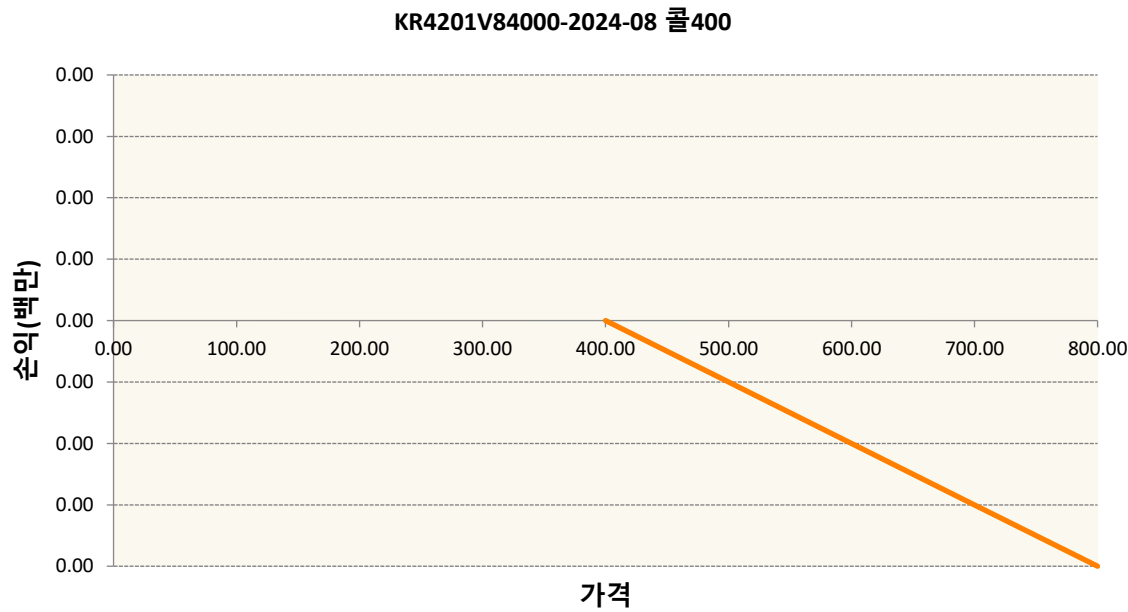
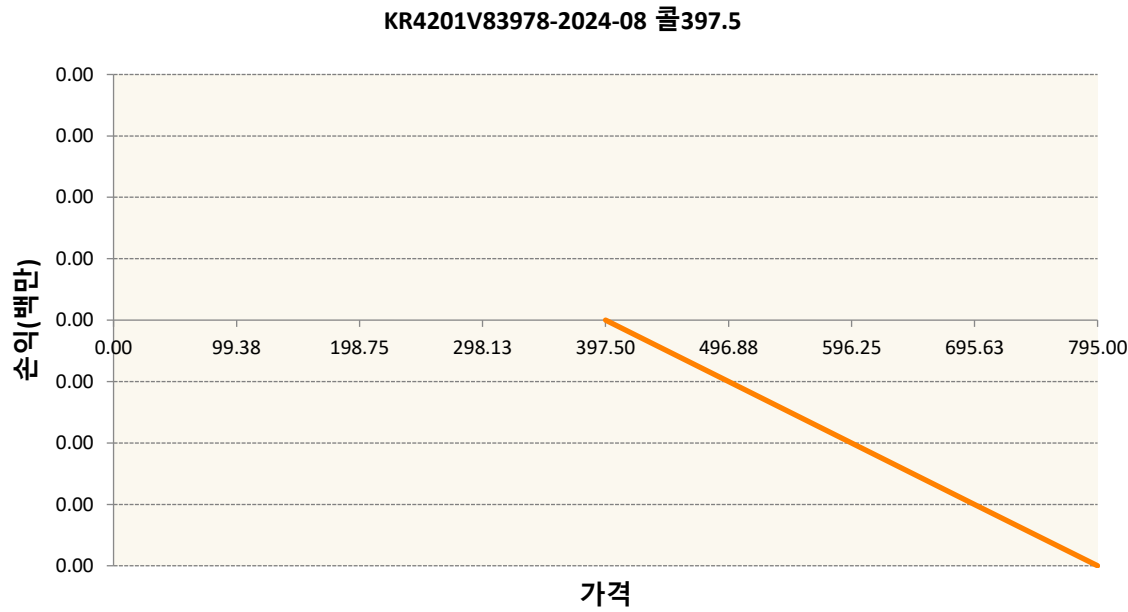
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

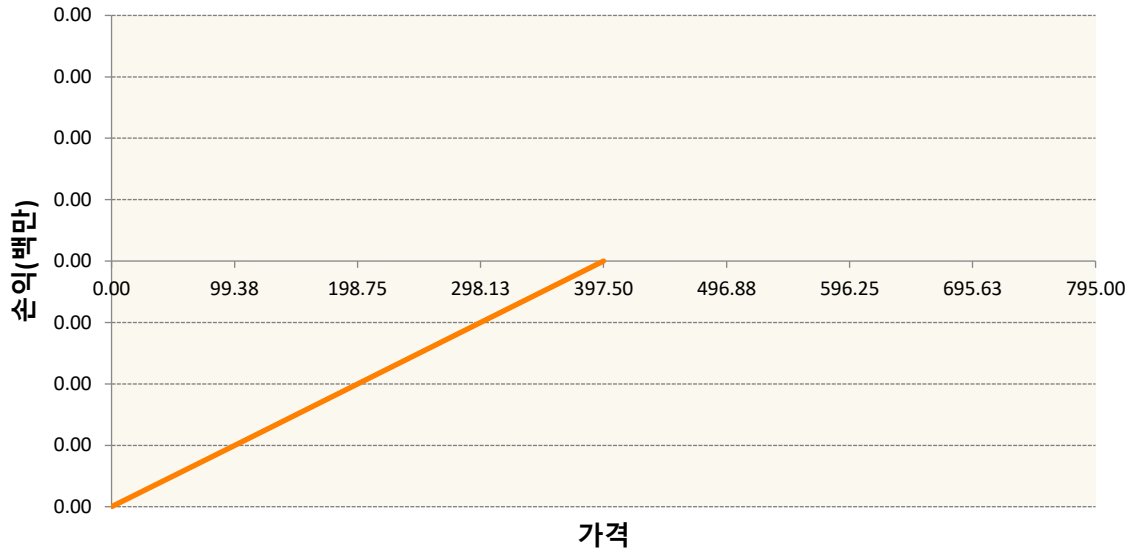
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	45,929	-45,929	장내

2. 만기시점의 손익구조



KR4301V83976-2024-08 풋397.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201V83978		2024-08 콜397.5						726
		기초자산의 변동성						
가격		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	38	38	38	38	38	38	38	38
-5.33%	38	38	38	38	38	37	36	34
-2.67%	37	36	34	32	28	23	17	17
0%	26	19	10	0	-12	-24	-38	-38
2.67%	-44	-63	-83	-103	-124	-145	-166	-166
5.33%	-261	-283	-305	-327	-349	-372	-395	-395
8.00%	-637	-649	-662	-677	-692	-709	-726	-726
KR4201V84000		2024-08 콜400						636
		기초자산의 변동성						
가격		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	26	26	26	26	26	26	26	26
-5.33%	26	26	26	26	26	25	24	23
-2.67%	26	25	24	22	19	15	11	11
0%	19	14	8	0	-9	-20	-31	-31
2.67%	-29	-45	-62	-79	-98	-117	-136	-136
5.33%	-199	-222	-244	-267	-290	-312	-335	-335
8.00%	-534	-548	-564	-581	-599	-617	-636	-636
KR4301V83976		2024-08 풋397.5						629
		기초자산의 변동성						
가격		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-629	-629	-629	-629	-629	-629	-629	-629
-5.33%	-419	-419	-419	-419	-419	-419	-419	-419
-2.67%	-208	-208	-208	-208	-208	-208	-208	-209
0%	2	2	1	0	-1	-3	-5	-5

2.67%	200	196	191	187	182	176	171
5.33%	323	317	311	305	299	293	287
8.00%	351	350	348	346	343	340	337

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

(단위:백만원)

1,640

공시일	2024-08-02
기준일	2024-08-01

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	1,221	0	1,221	

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	2024-08-02
기준일	2024-08-01

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	4,344	0	4,344	

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	2024-08-02
기준일	2024-08-01

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	14,934	0	14,934	
누계	통화	선도	0	14,687	-14,687	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213E5W KRW/USD 30-08-24E	585
FXW213E6SC KRW/USD 30-09-24E	366
FXW213E7W KRW/USD 31-10-24E	224
IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

511

공시일	2024-08-02
기준일	2024-08-01

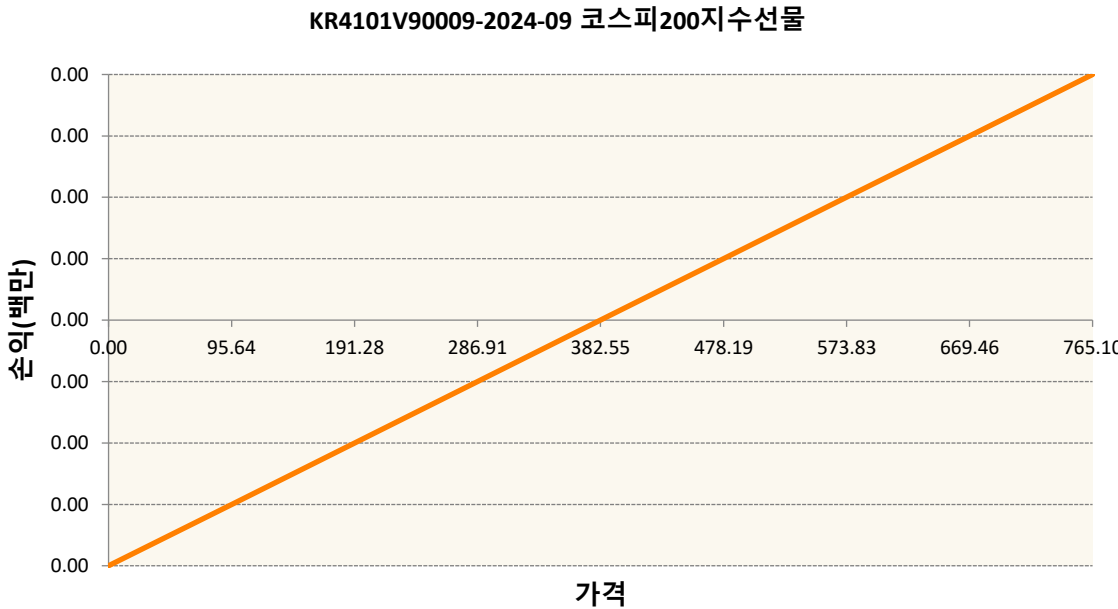
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

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	765	0	765	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

공시일	2024-08-02
기준일	2024-08-01

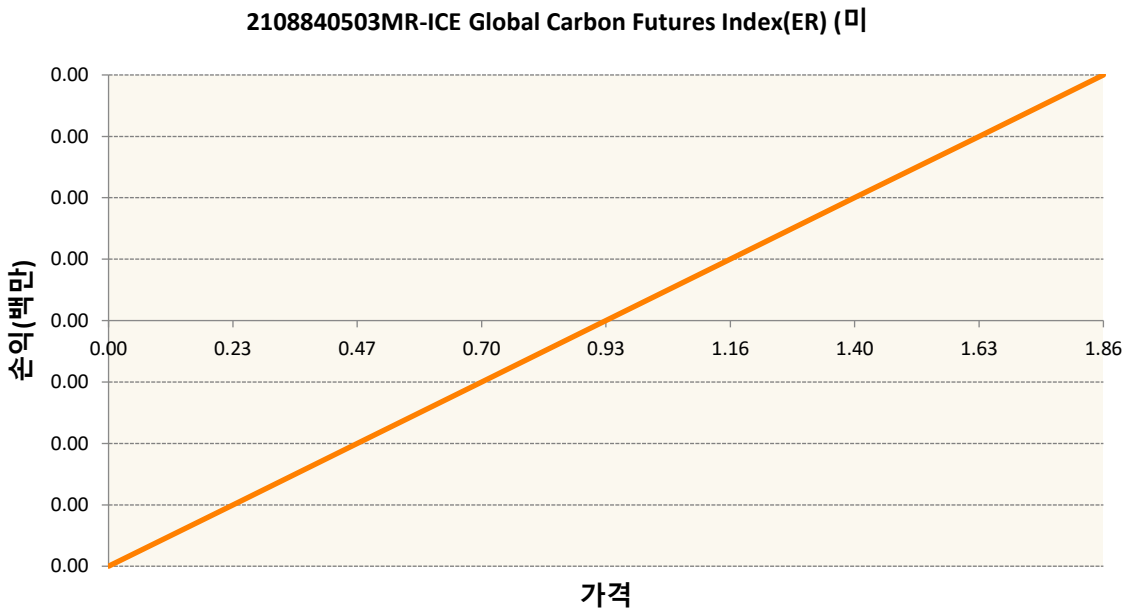
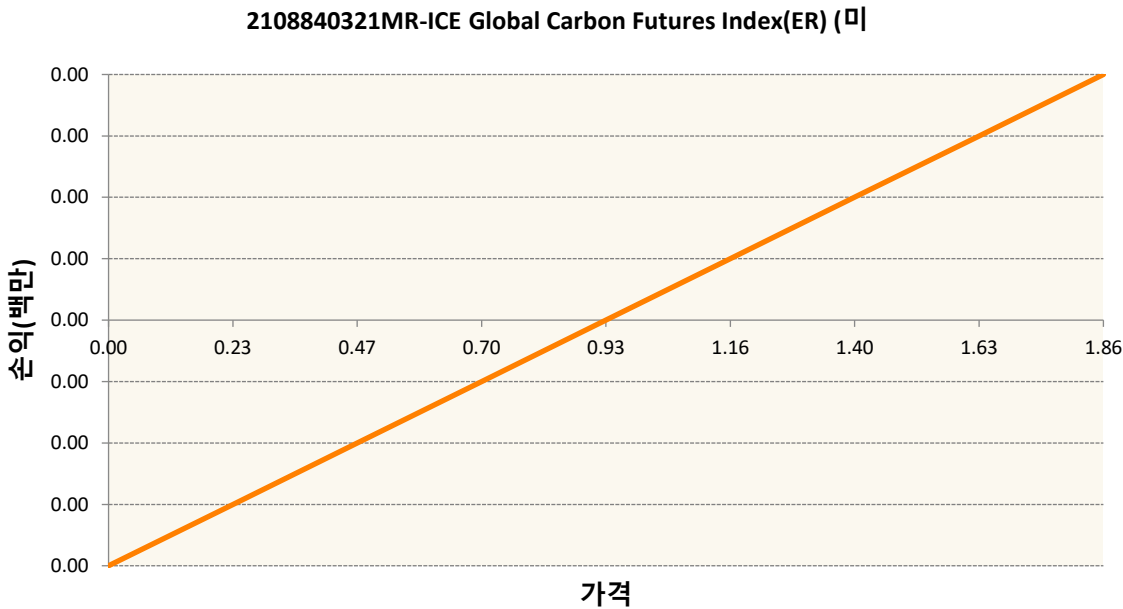
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

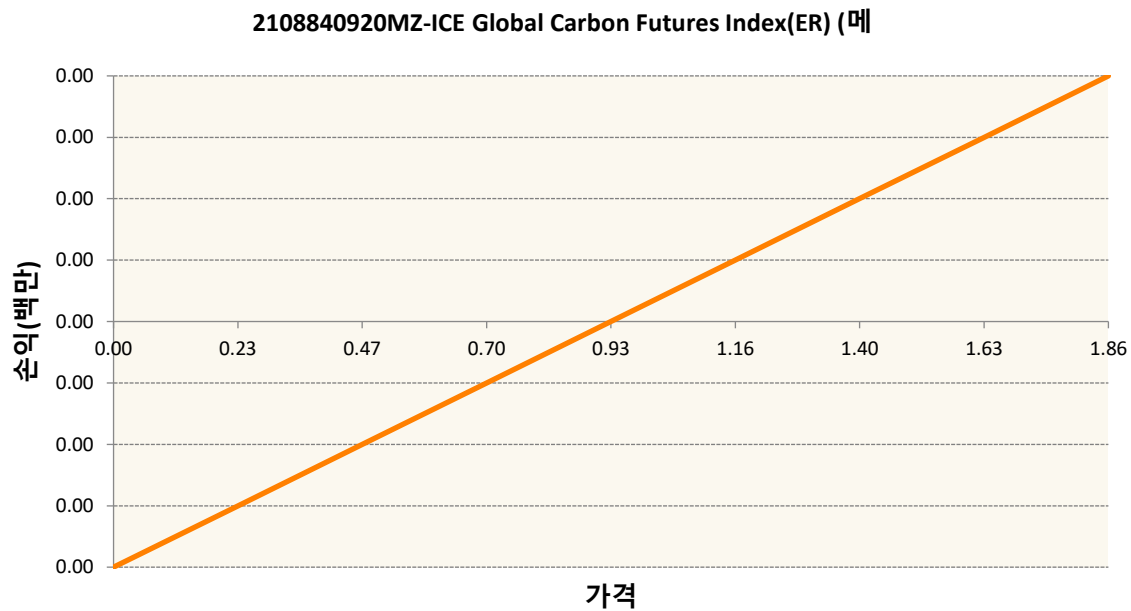
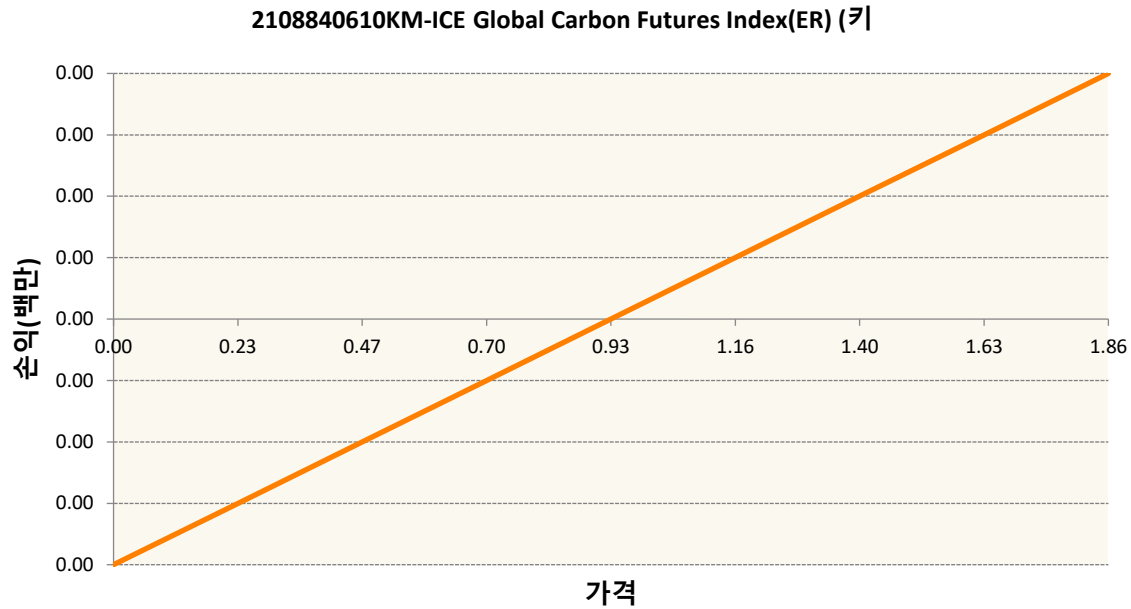
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	15,411	0	15,411	

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108840321IICE Global Carbon Futures Index(ER) (미)		475
2108840503IICE Global Carbon Futures Index(ER) (미)		190
2108840610IICE Global Carbon Futures Index(ER) (키)		380
2108840920IICE Global Carbon Futures Index(ER) (메)		190

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,388

공시일	2024-08-02
기준일	2024-08-01

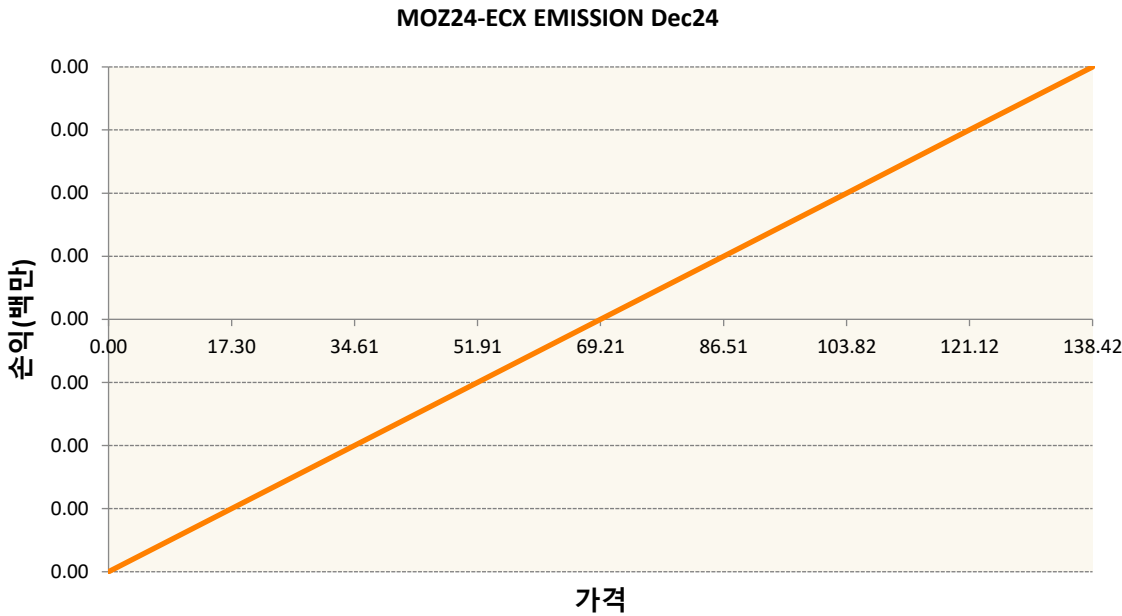
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	9,205	0	9,205	
누계	지수	스왑	373	0	373	장외
누계	통화	선도	0	1,424	-1,424	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213E7W KRW/EUR 30-08-24E	114
MOZ24 ECX EMISSION Dec24	736
SWICEUACN ICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX	0.28

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

(단위:백만원)

1,329

공시일	2024-08-02
기준일	2024-08-01

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)

SWCSI00000 신한CSI Index 240620 (키움)	8
SWCSI00000 신한CSI Index 240620 (미래)	11
SWCSI00000 신한CSI Index 240620 (메리츠)	11
SWCSI00000 신한CSI Index 240620 (NH)	8

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

(단위:백만원)

53

공시일	2024-08-02
기준일	2024-08-01

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	2024-08-02
기준일	2024-08-01

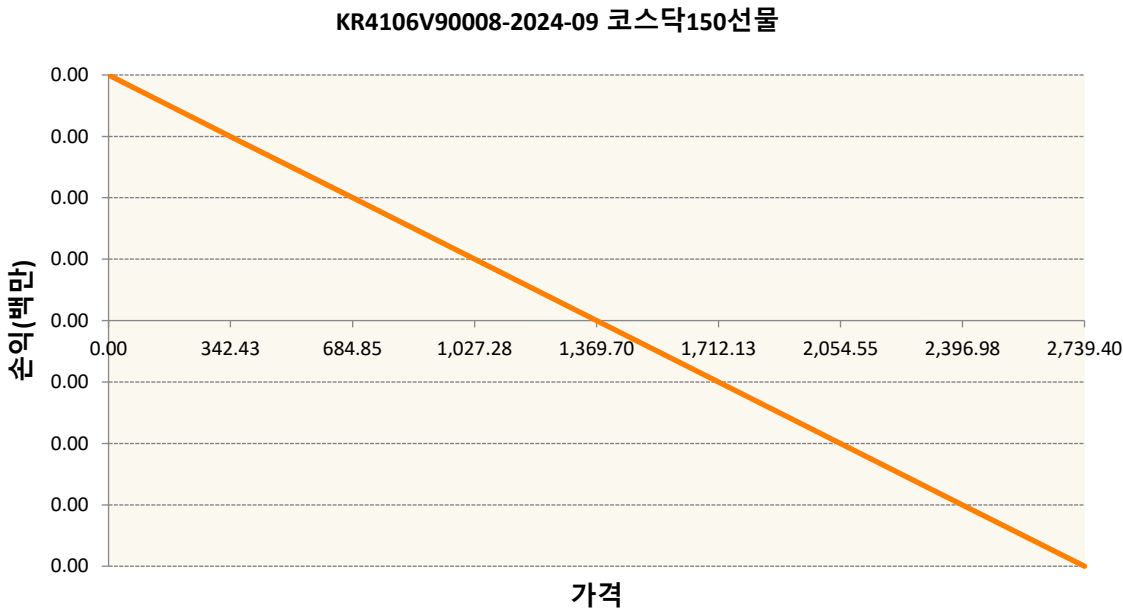
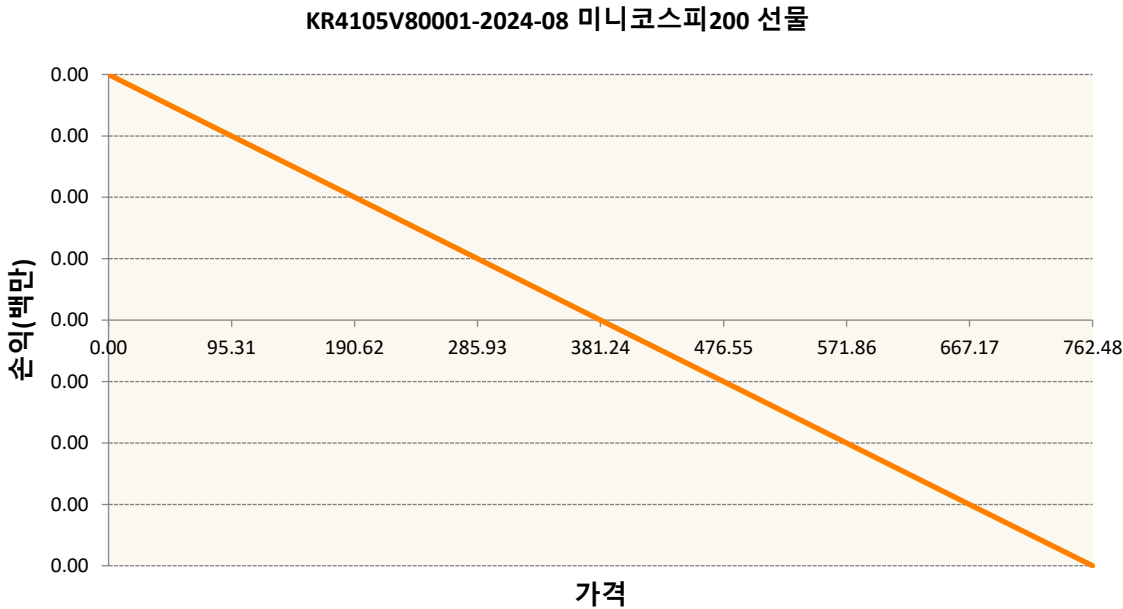
에퀴티알파일반사모혼합자산

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	191	-191	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
KR4105V800 2024-08 미니코스피200 선물		2
KR4106V900 2024-09 코스닥150선물		8

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)		(단위:백만원)
		14

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

(단위:백만원)

1,347

공시일	2024-08-02
기준일	2024-08-01

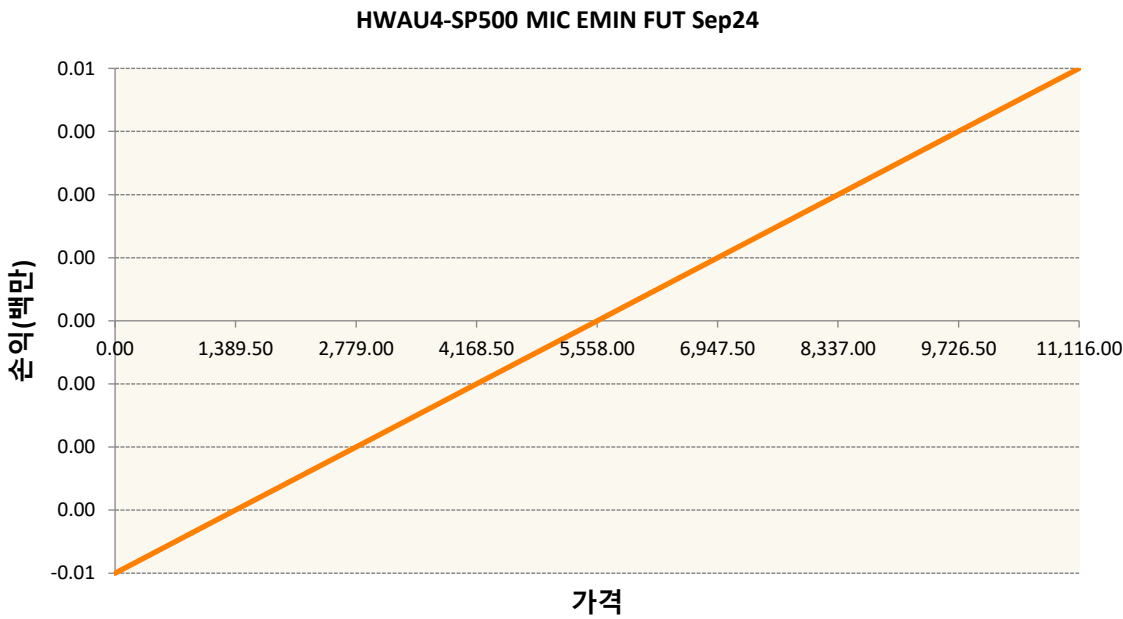
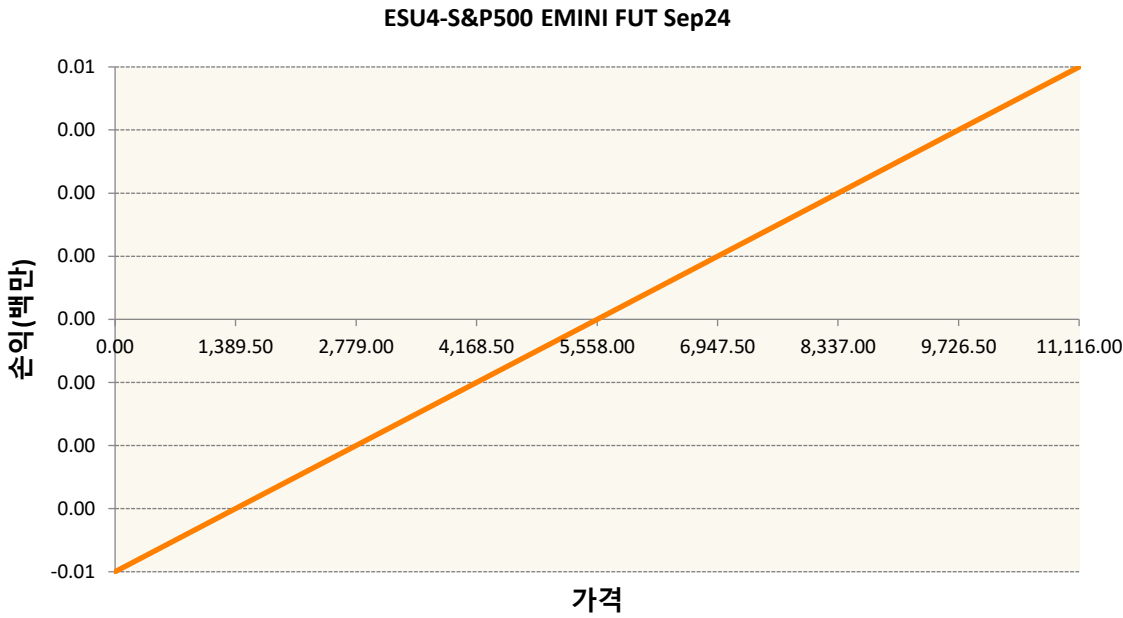
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

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	9,247	0	9,247	
누계	유가증권	선물	1,851	0	1,851	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESU4	S&P500 EMINI FUT Sep24	740
HWAU4	SP500 MIC EMIN FUT Sep24	148

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	529

공시일	2024-08-02
기준일	2024-08-01

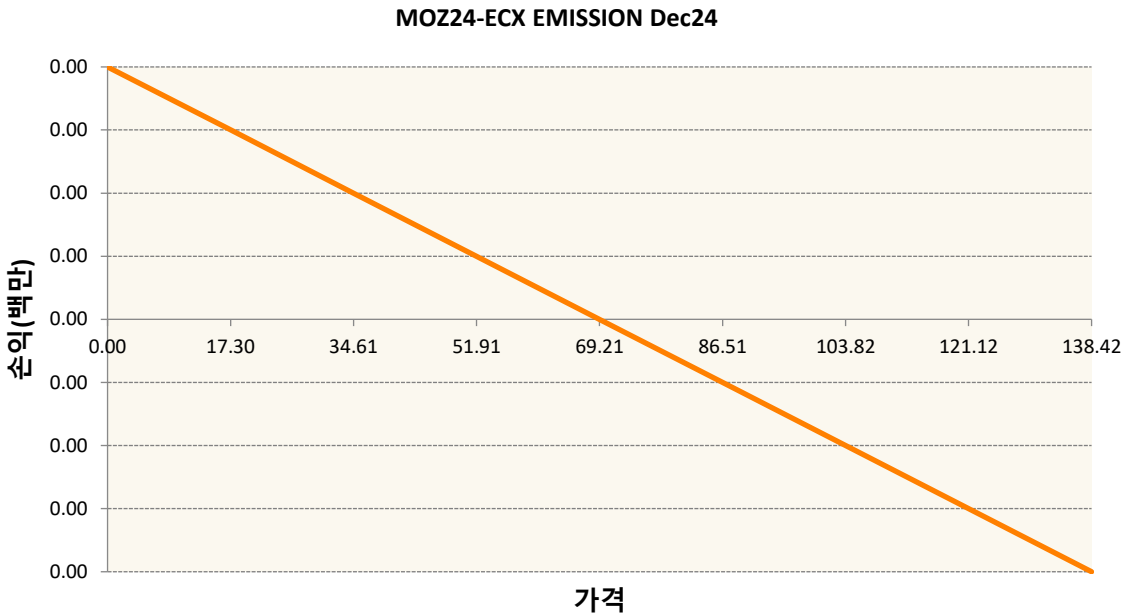
SOL유럽탄소배출권선물인버스ICE특별자산상

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	5,655	-5,655	
누계	지수	스왑	373	0	373	장외
누계	통화	선도	0	1,459	-1,459	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213E7W KRW/EUR 30-08-24E	117
MOZ24 ECX EMISSION Dec24	452
SWICEUACN ICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX	0.33

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

(단위:백만원)

842

공시일	2024-08-02
기준일	2024-08-01

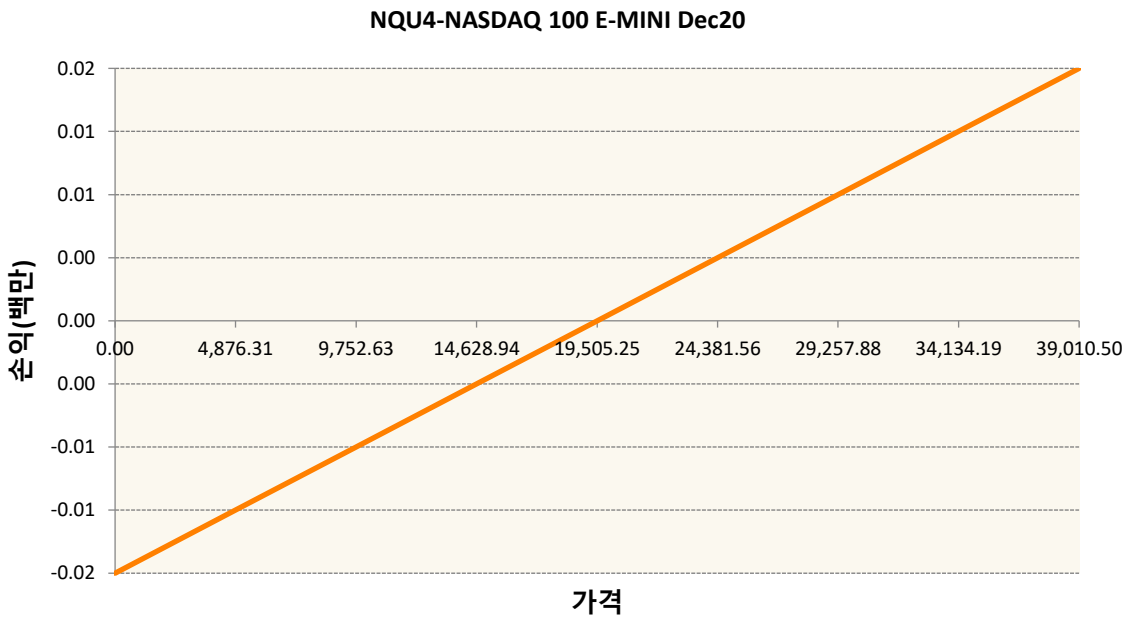
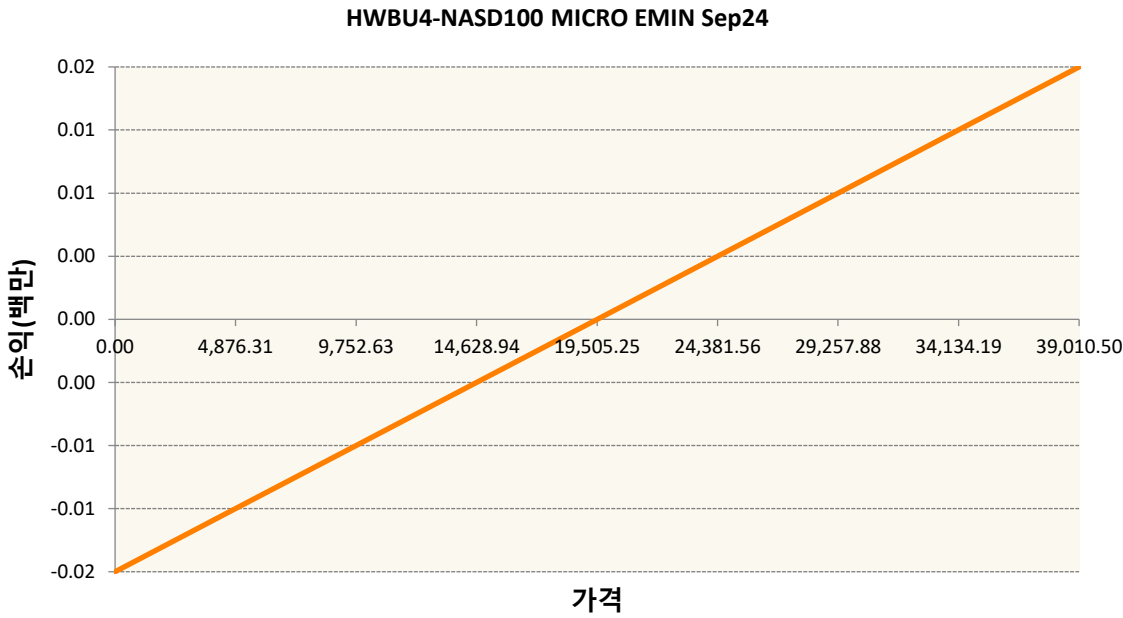
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

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	5,401	0	5,401	
누계	유가증권	선물	2,166	0	2,166	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HWBU4	NASD100 MICRO EMIN Sep24	173
NQU4	NASDAQ 100 E-MINI Dec20	432

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	460

공시일	2024-08-02
기준일	2024-08-01

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	184,615	0	184,615	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWKEDI0000 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	709
SWKEDI0000 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	3,070
SWKEDI0000 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	4,445
SWKEDI0000 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	6,586

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

(단위:백만원)

8,756

공시일	2024-08-02
기준일	2024-08-01

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	15
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	15
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	15
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	15

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

(단위:백만원)

63

공시일	2024-08-02
기준일	2024-08-01

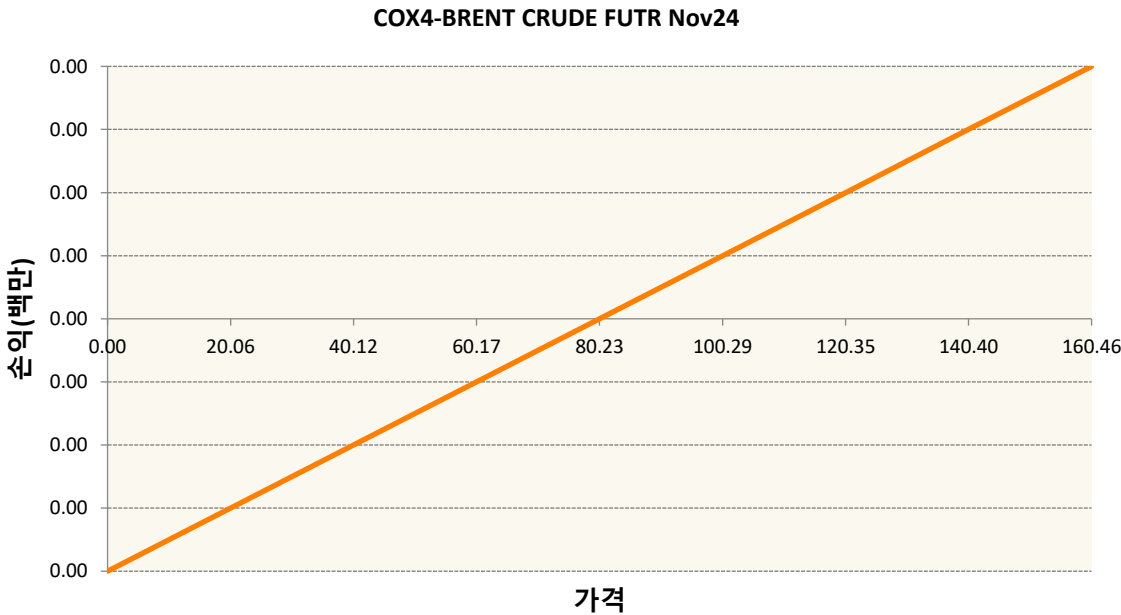
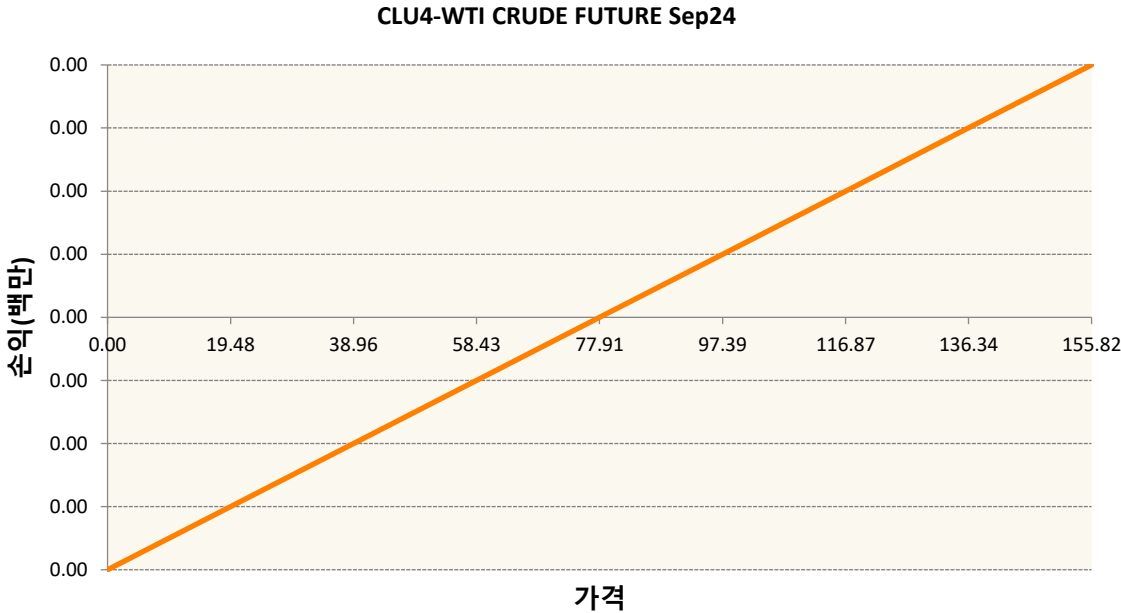
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

1. 계약금액

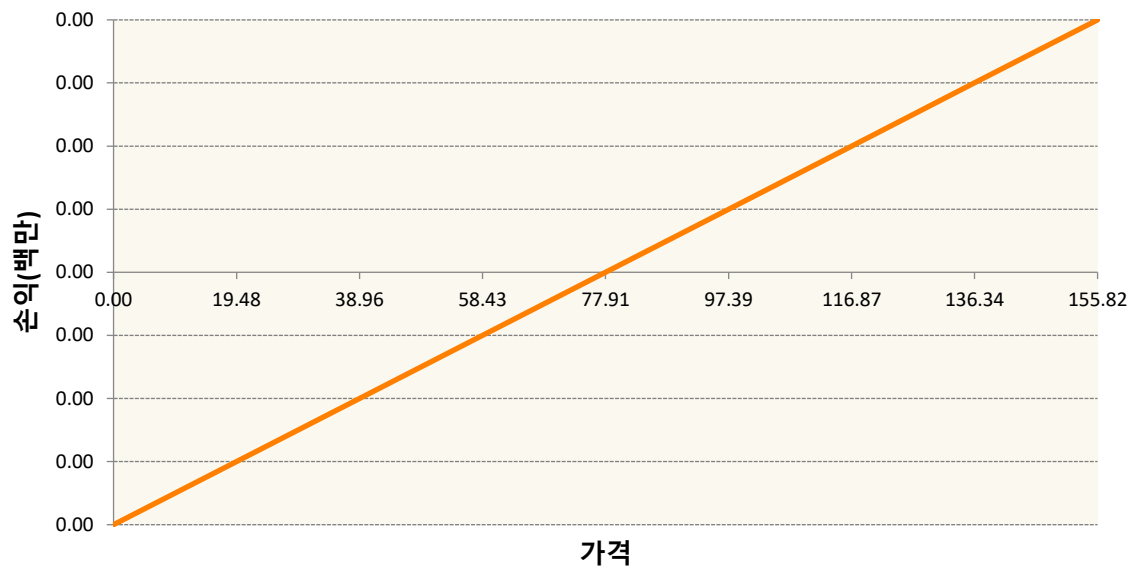
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	14	-14	장내
누계	유가증권	선물	863	0	863	
누계	통화	선물	0	123	-123	장내

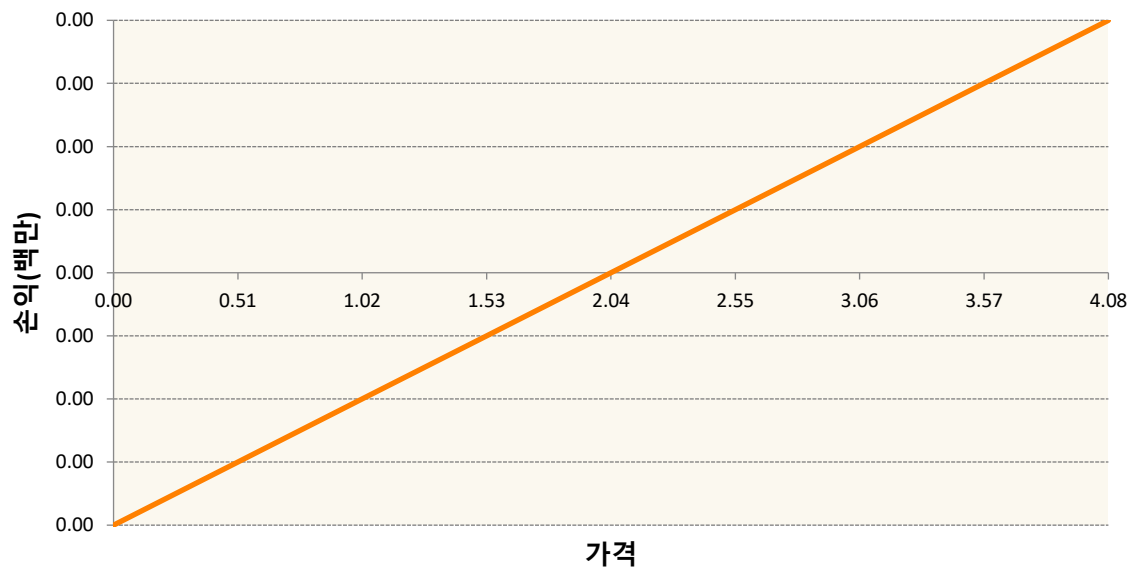
2. 만기시점의 손익구조



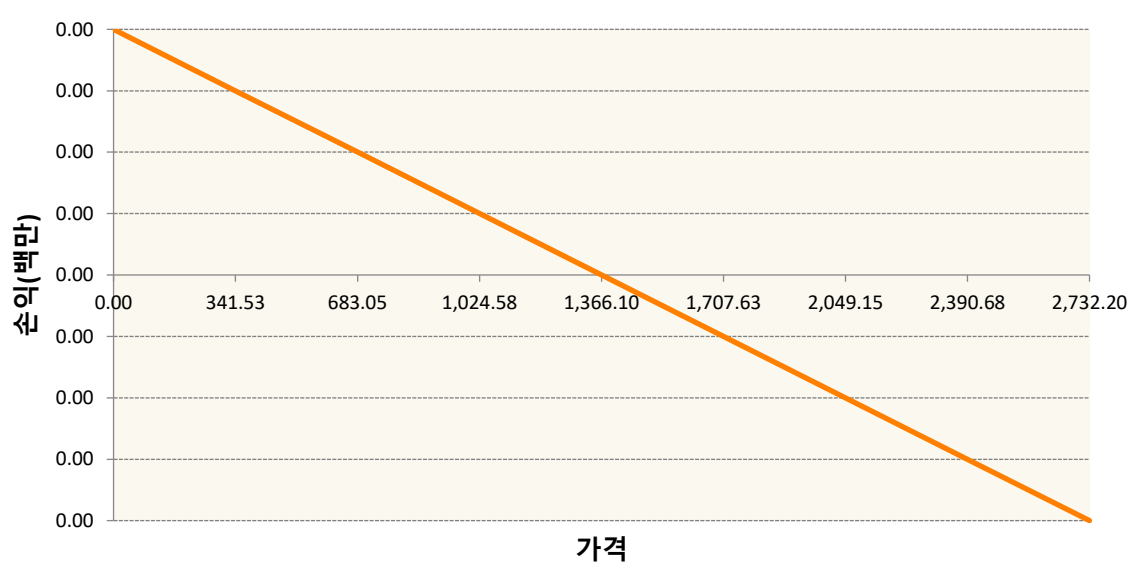
ECU4-E-mini Crude Oil Sep24



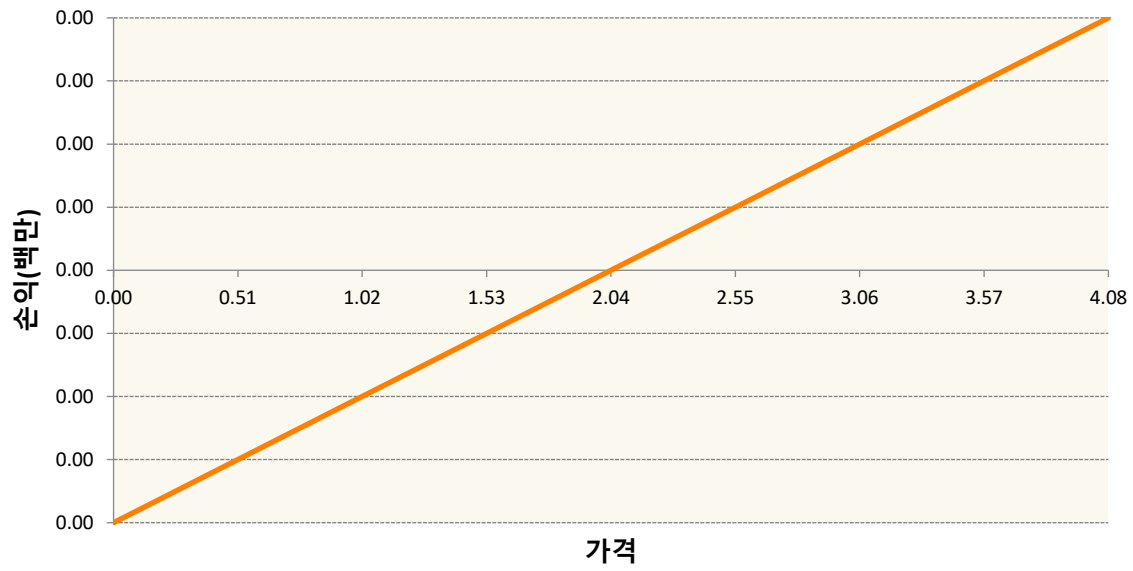
EOU4-E-MINI NATURAL GAS Sep24



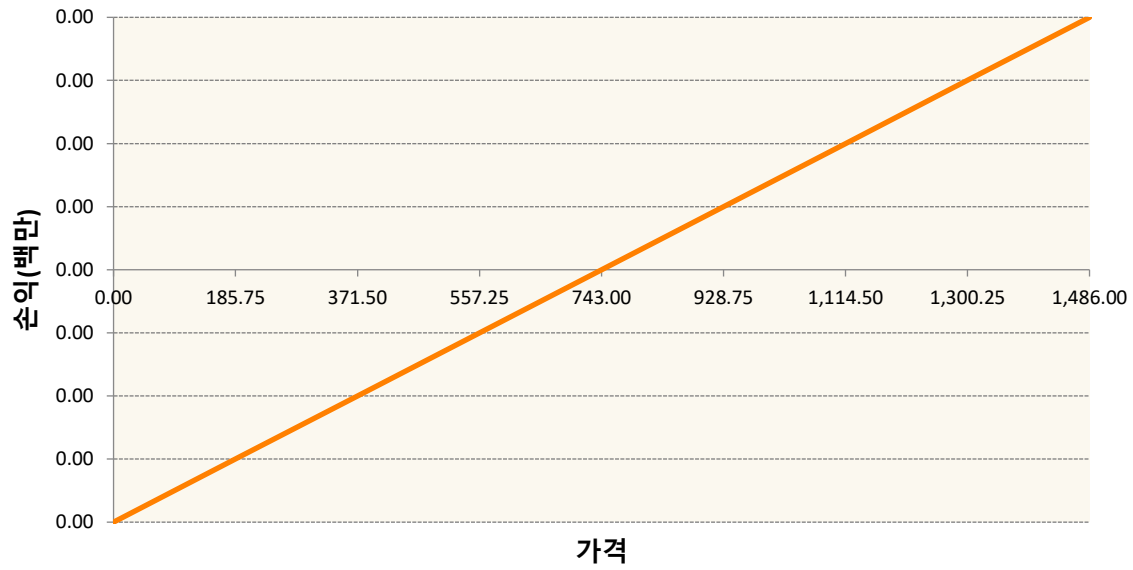
KR4175V80004-2024-08 달러선물



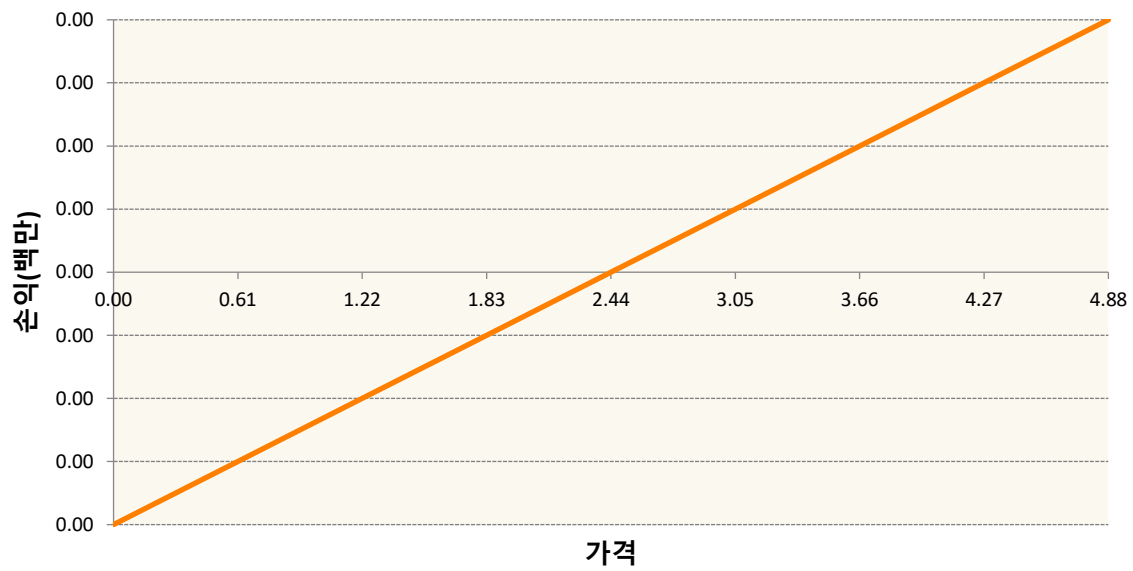
NGU24-NATURAL GAS FUTR Sep24



QSU4-Low Su Gasoil G Sep24



XBU4-GASOLINE RBOB FUT Sep24



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
KR4175V800 2024-08 달러선물		10
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)

141