

공시일 2024-08-28

기준일 2024-08-27

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	2024-08-28
기준일	2024-08-27

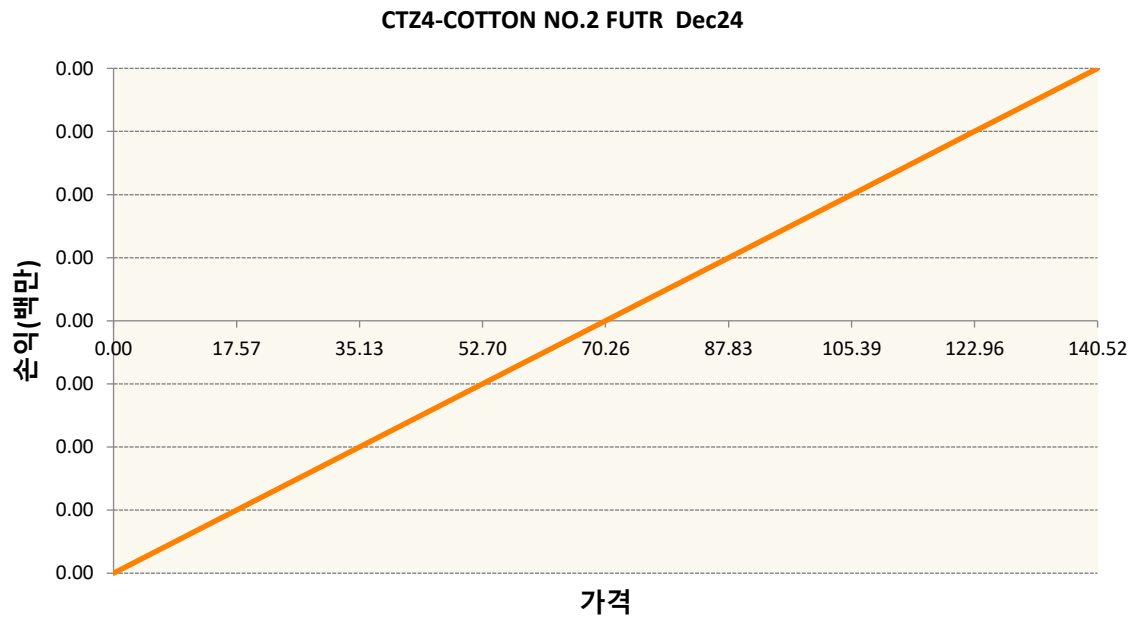
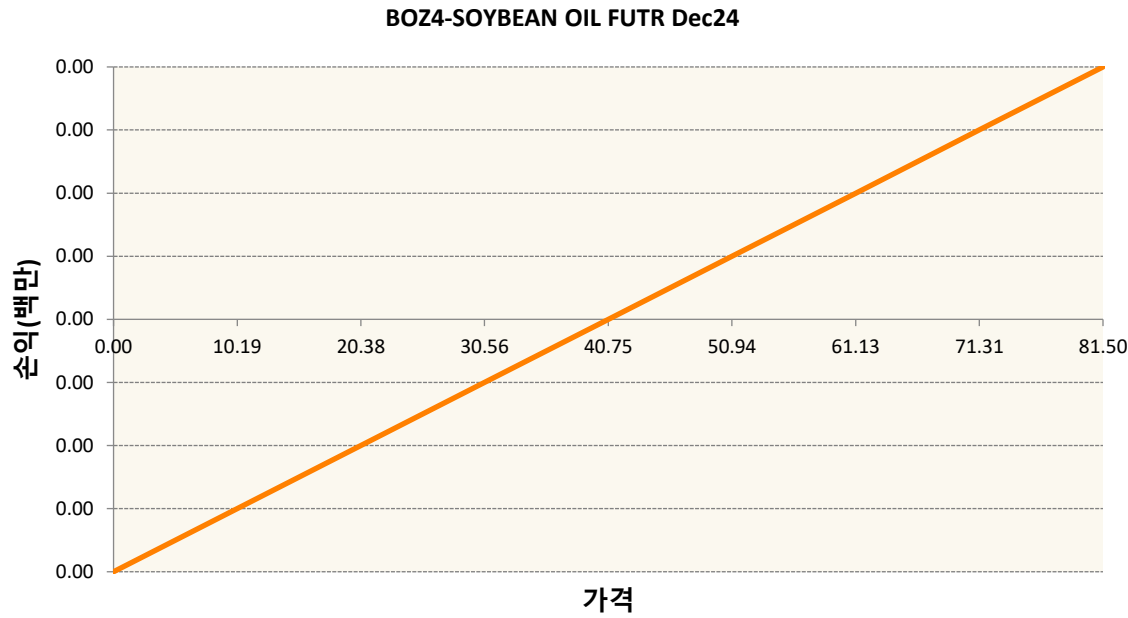
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

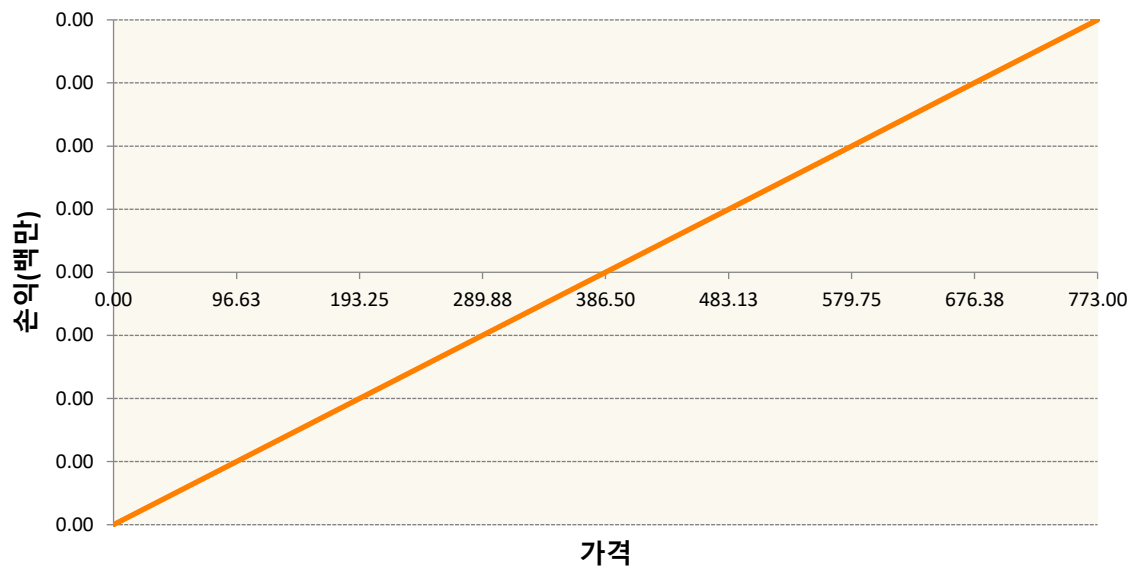
(단위:USD 백만)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	53	-53	장내
누계	유가증권	선물	3,842	0	3,842	
누계	통화	선물	0	412	-412	장내

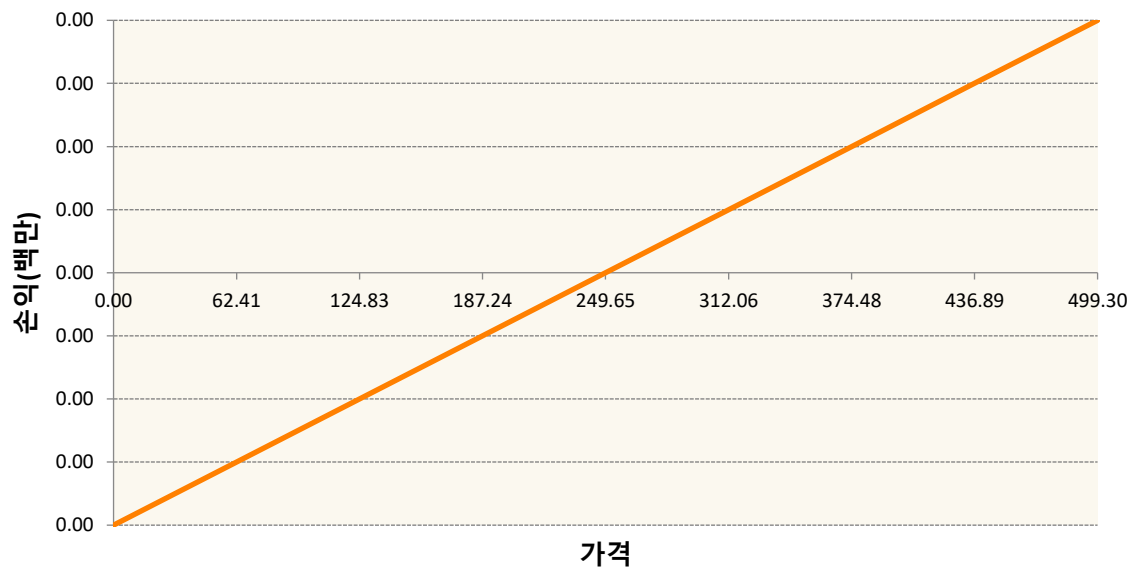
2. 만기시점의 손익구조



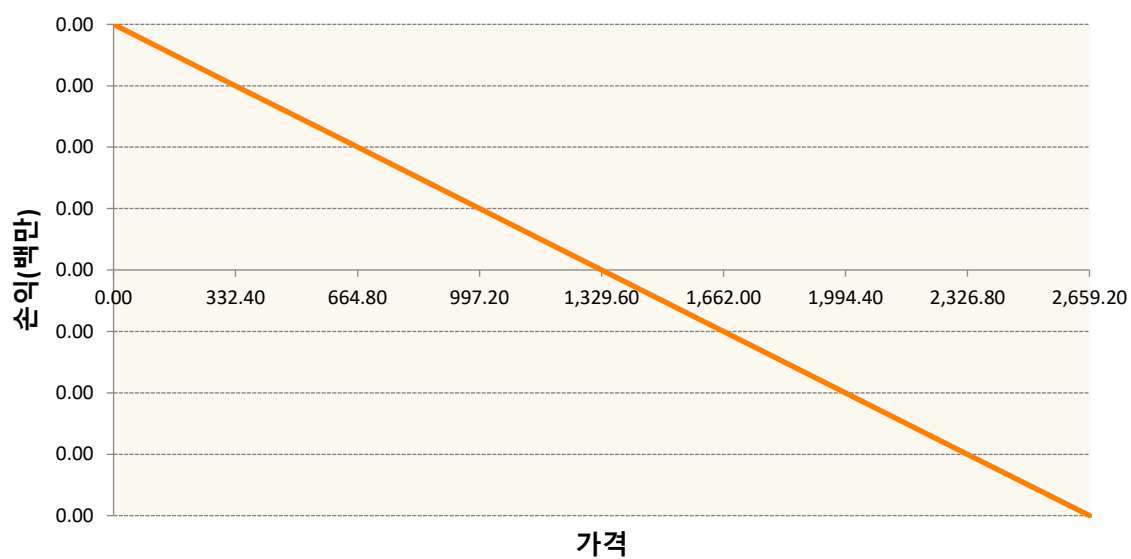
CZ4-CORN FUTURE Dec24



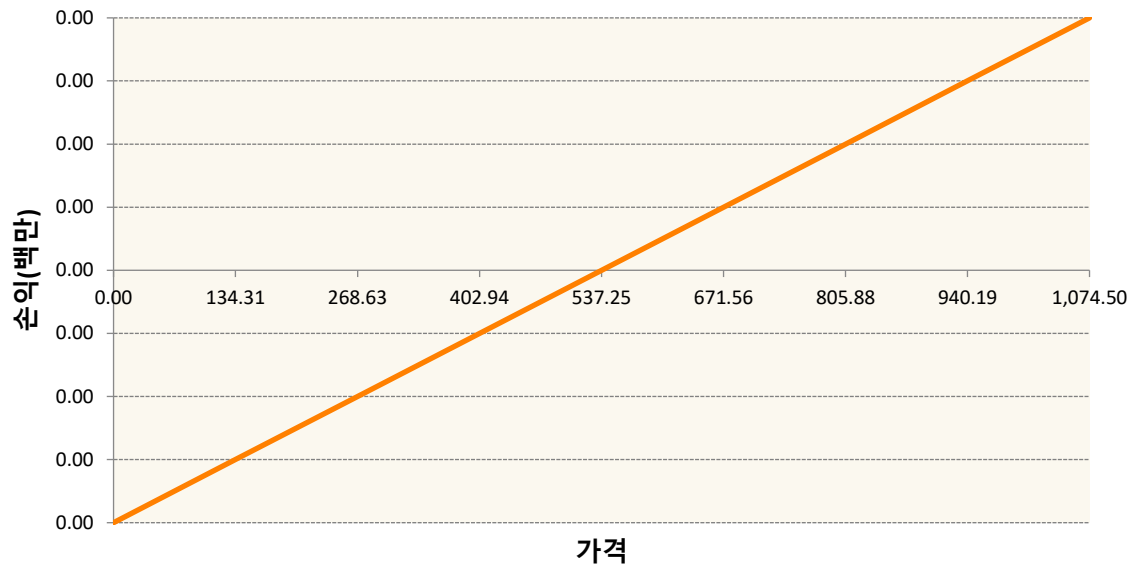
KCZ4-COFFEE 'C' FUTURE Dec24



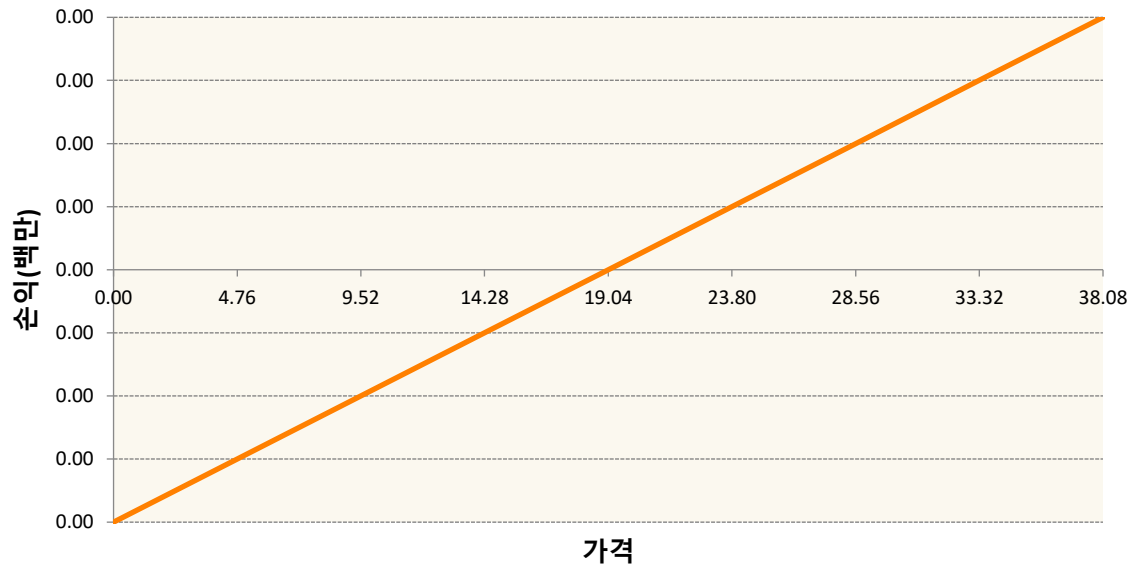
KR4175V90003-2024-09 달러선물



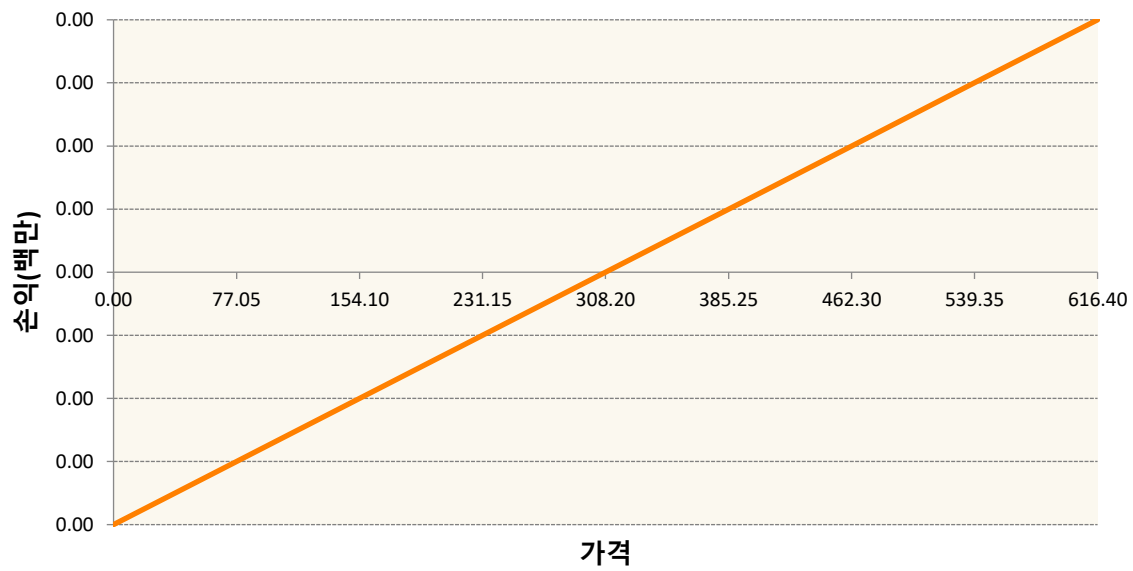
KWZ4-KC HRW WHEAT FUT Dec24

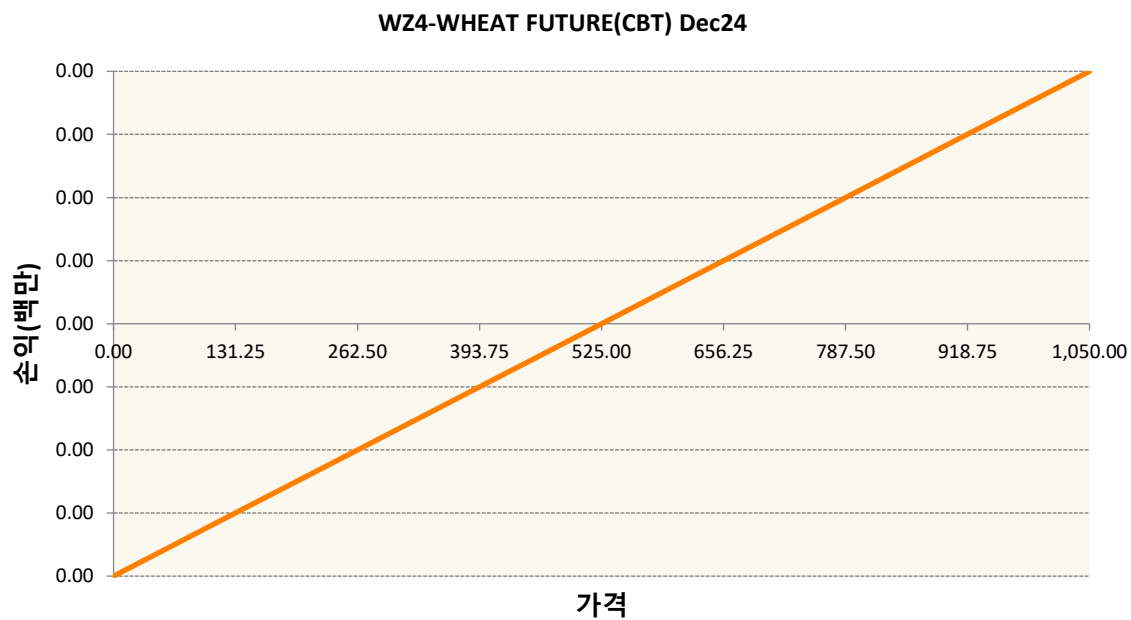
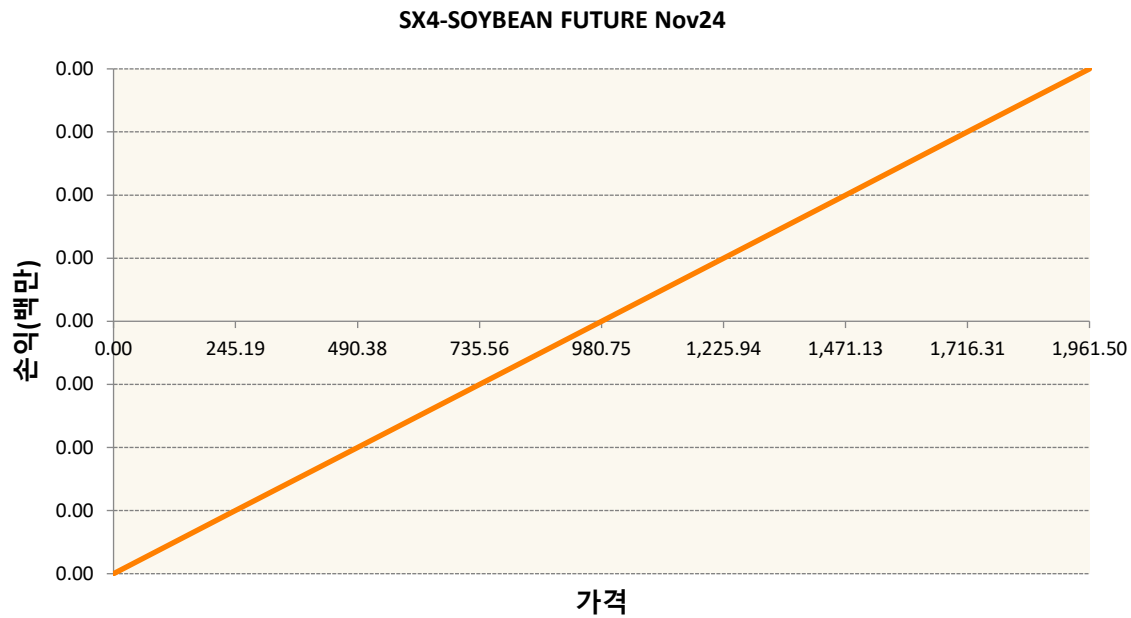


SBV4-Sugar #11 (WORLD) Oct24



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	2024-08-28
기준일	2024-08-27

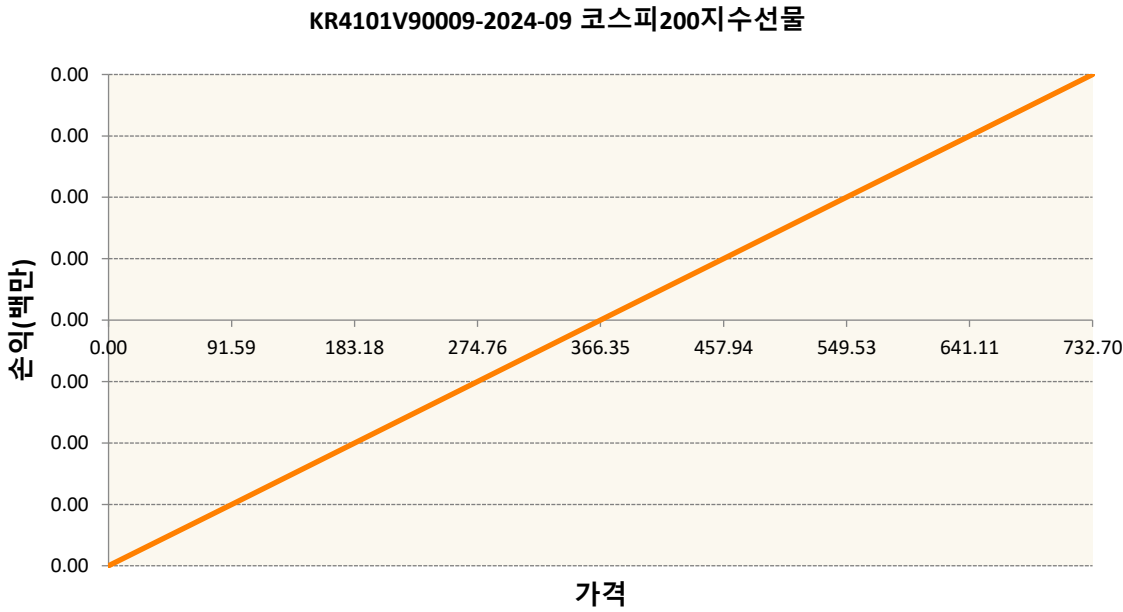
스마트인덱스모

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	2,015	0	2,015	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101V90009		2024-09 코스피200지수선물					160
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-160	-160	-160	-160	-160	-160	-160
-5.33%	-107	-107	-107	-107	-107	-107	-107
-2.67%	-53	-53	-53	-53	-53	-53	-53
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	53	53	53	53	53	53	53
5.33%	107	107	107	107	107	107	107
8.00%	160	160	160	160	160	160	160

공시일	2024-08-28
기준일	2024-08-27

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	235
-----------------------------	-----

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

292

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2024-08-28
기준일	2024-08-27

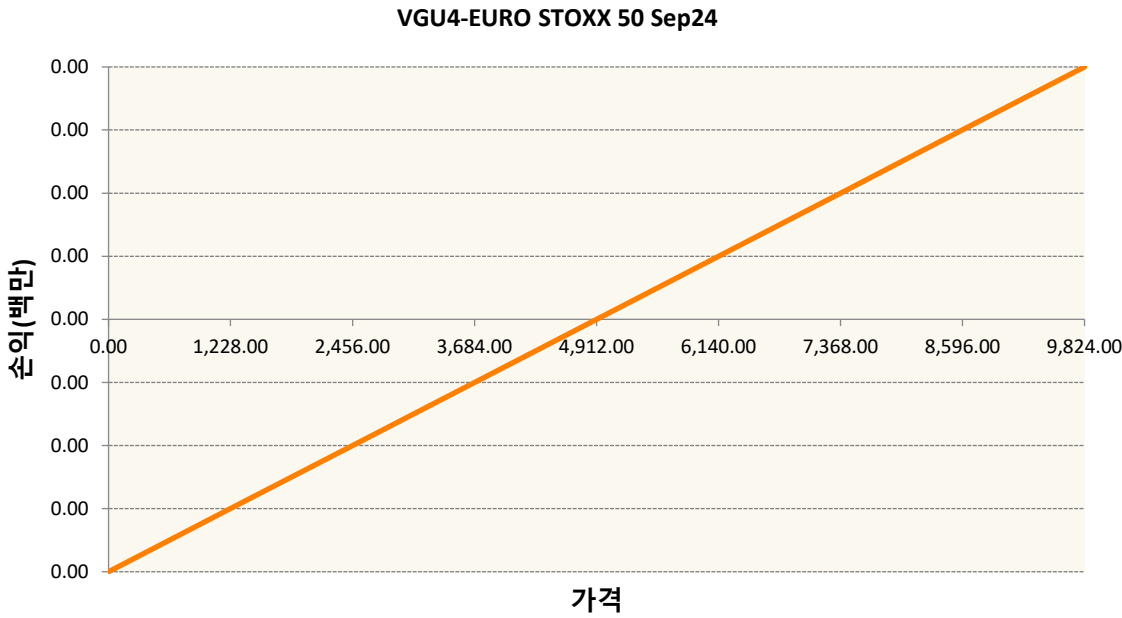
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	947	0	947	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

49

공시일	2024-08-28
기준일	2024-08-27

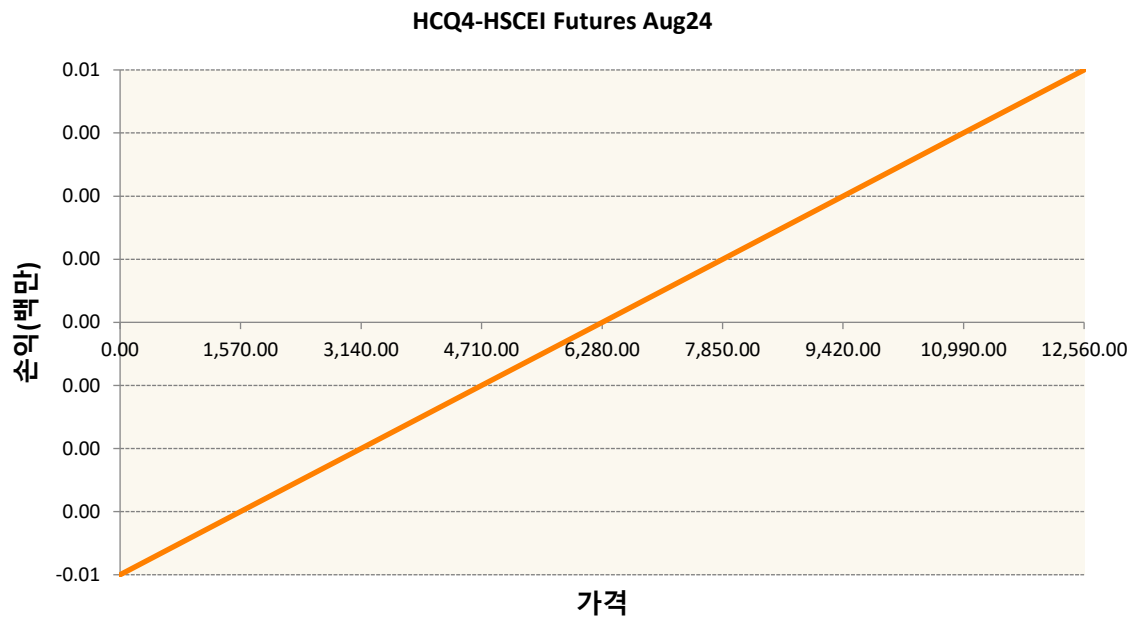
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,663	0	1,663	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCQ4	HSCEI Futures Aug24	133
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

159

공시일	2024-08-28
기준일	2024-08-27

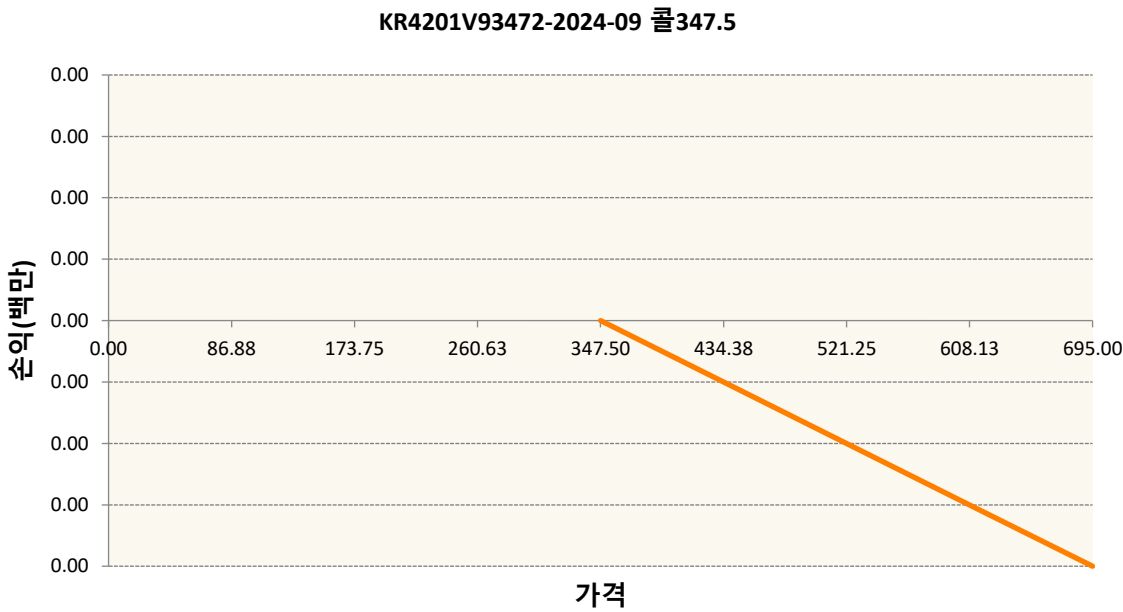
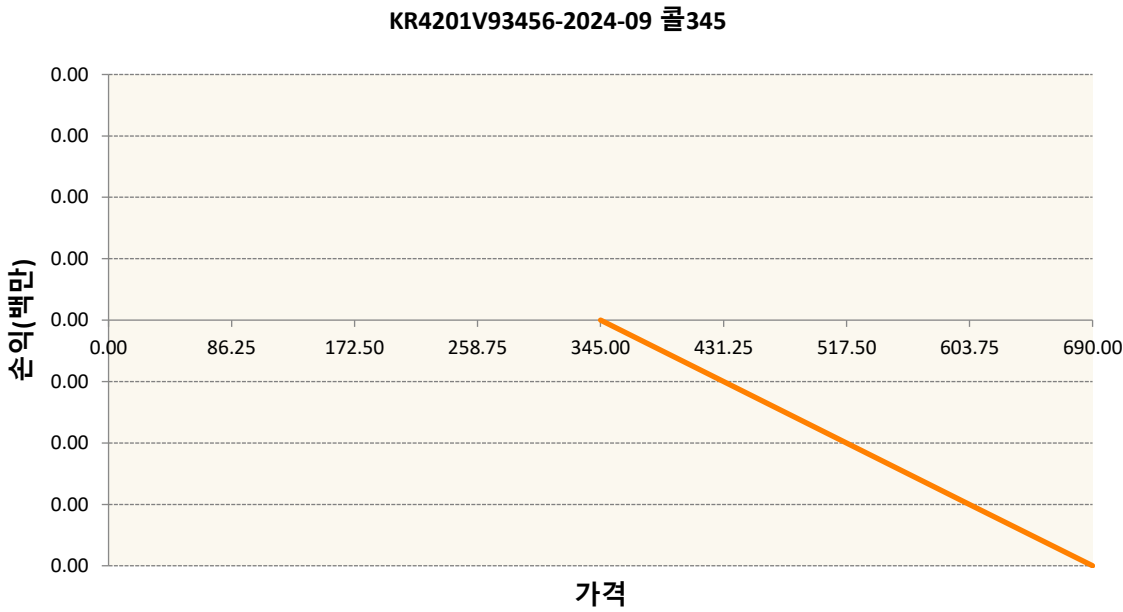
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

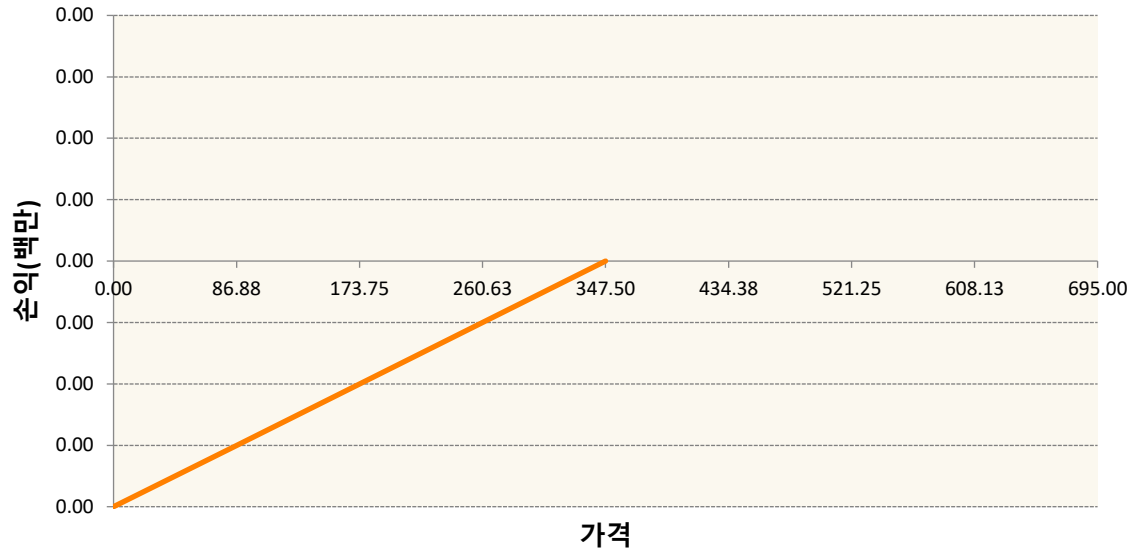
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	38,743	-38,743	장내

2. 만기시점의 손익구조



KR4301V93470-2024-09 풋347.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201V93456		2024-09 콜345					999
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	691	672	653	633	613	592	571
-5.33%	556	533	510	487	464	441	418
-2.67%	332	313	293	273	252	231	210
0%	37	26	14	0	-15	-31	-48
2.67%	-295	-299	-305	-312	-321	-332	-343
5.33%	-640	-641	-644	-647	-651	-657	-664
8.00%	-989	-989	-990	-991	-993	-996	-999
KR4201V93472		2024-09 콜347.5					1,527
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	987	961	934	905	876	845	814
-5.33%	813	777	742	706	670	635	599
-2.67%	500	468	435	401	367	333	298
0%	67	47	25	0	-26	-53	-82
2.67%	-435	-444	-456	-470	-487	-505	-525
5.33%	-967	-969	-974	-981	-989	-1,000	-1,012
8.00%	-1,506	-1,507	-1,508	-1,511	-1,514	-1,520	-1,527
KR4301V93470		2024-09 풋347.5					278
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-234	-240	-247	-254	-262	-269	-278
-5.33%	-94	-104	-114	-124	-134	-144	-154
-2.67%	-15	-23	-32	-41	-51	-60	-70
0%	14	10	6	0	-6	-13	-20

2.67%	21	20	18	16	13	10	6
5.33%	22	22	21	21	20	18	16
8.00%	22	22	22	22	22	21	20

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

(단위:백만원)

2,872

공시일	2024-08-28
기준일	2024-08-27

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	1,216	0	1,216	

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	2024-08-28
기준일	2024-08-27

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	4,326	0	4,326	

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	2024-08-28
기준일	2024-08-27

H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	239	-239	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	14,485	0	14,485	
누계	통화	선도	0	14,308	-14,308	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213E5W KRW/USD 30-08-24E	570
FXW213E6SC KRW/USD 30-09-24E	357
FXW213E7W KRW/USD 31-10-24E	218
IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

518

공시일	2024-08-28
기준일	2024-08-27

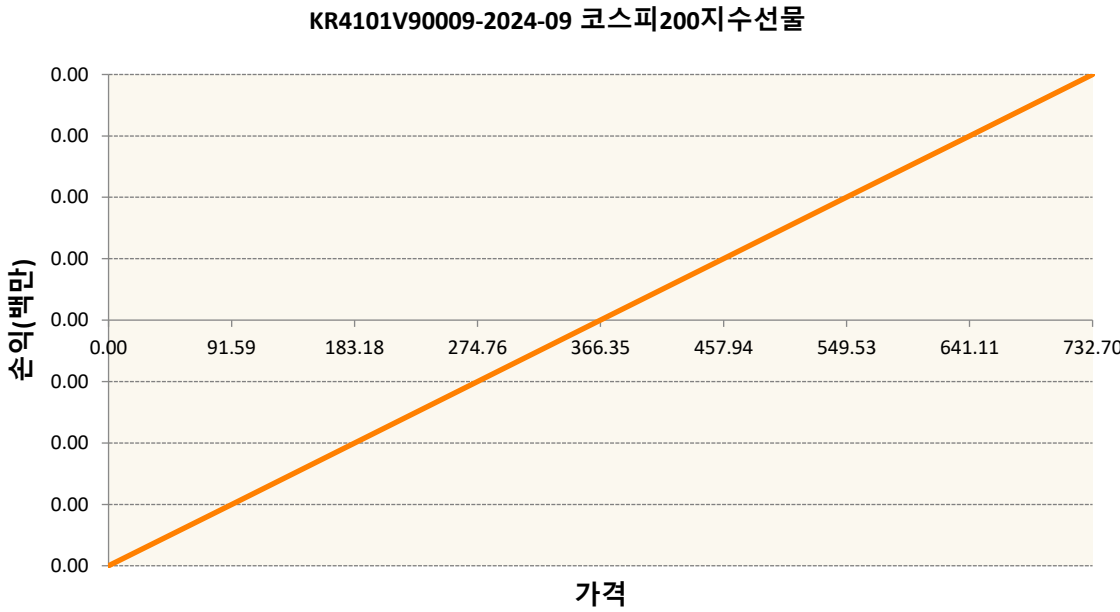
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

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	733	0	733	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101V90009			2024-09 코스피200지수선물				58
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-58	-58	-58	-58	-58	-58	-58
-5.33%	-39	-39	-39	-39	-39	-39	-39
-2.67%	-19	-19	-19	-19	-19	-19	-19
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	19	19	19	19	19	19	19
5.33%	39	39	39	39	39	39	39
8.00%	58	58	58	58	58	58	58

공시일	2024-08-28
기준일	2024-08-27

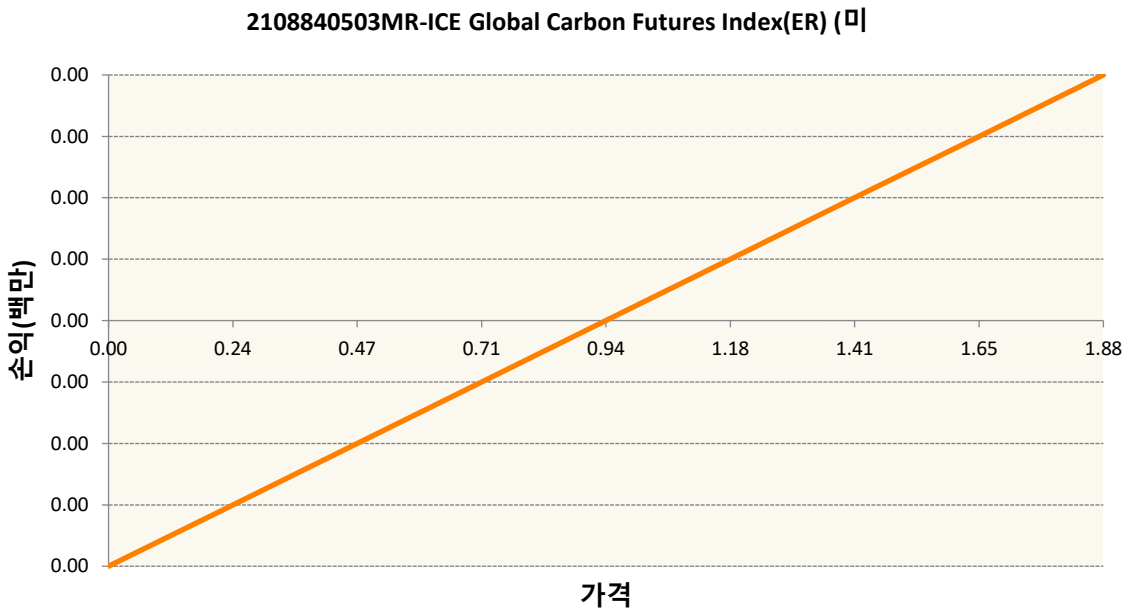
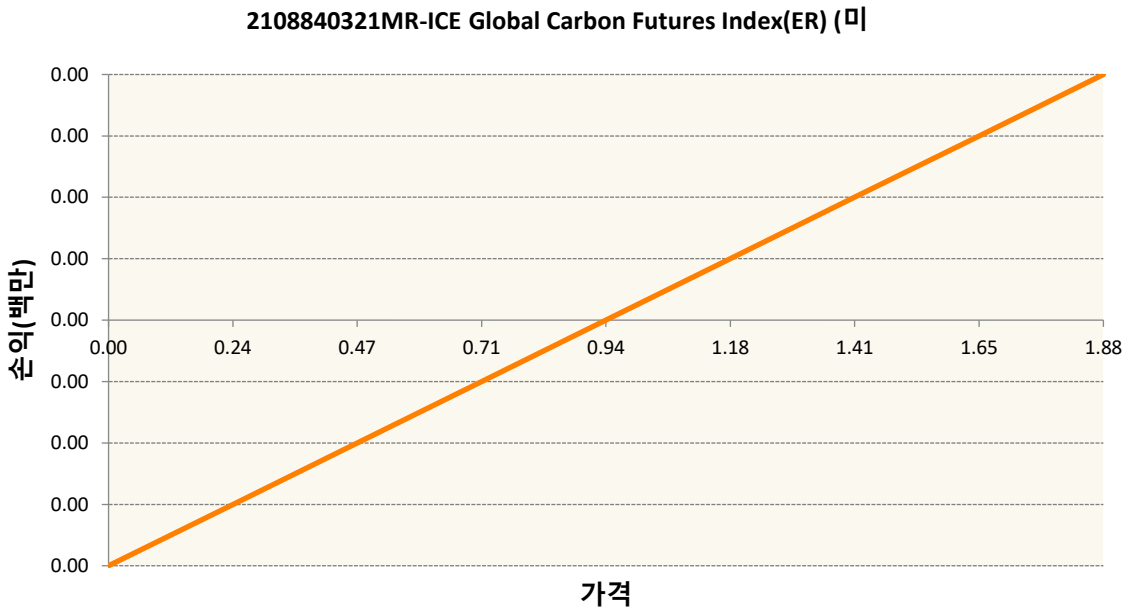
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

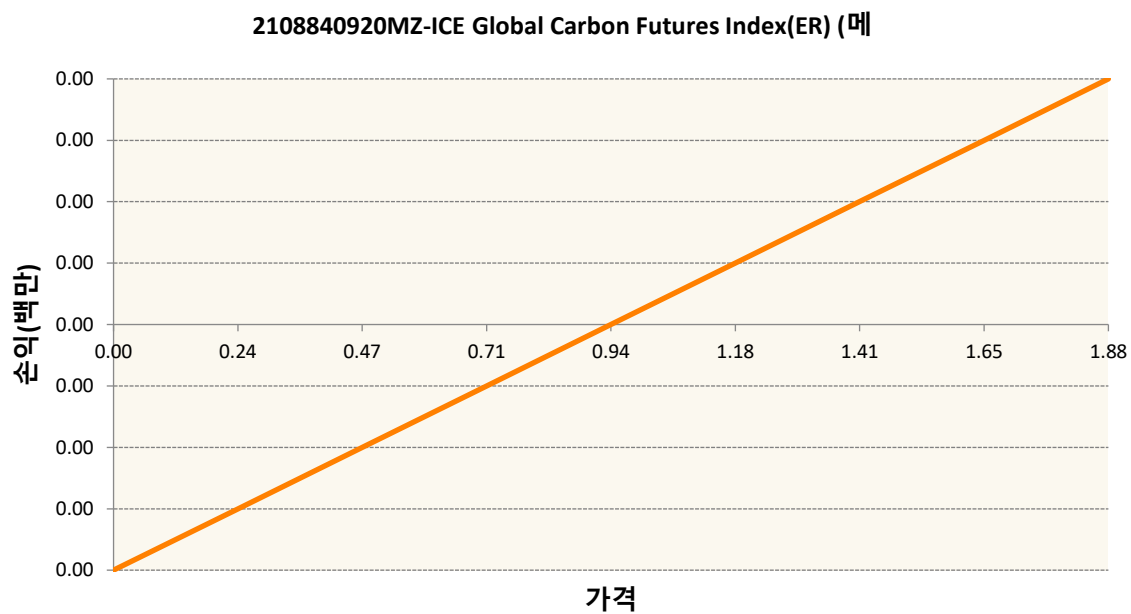
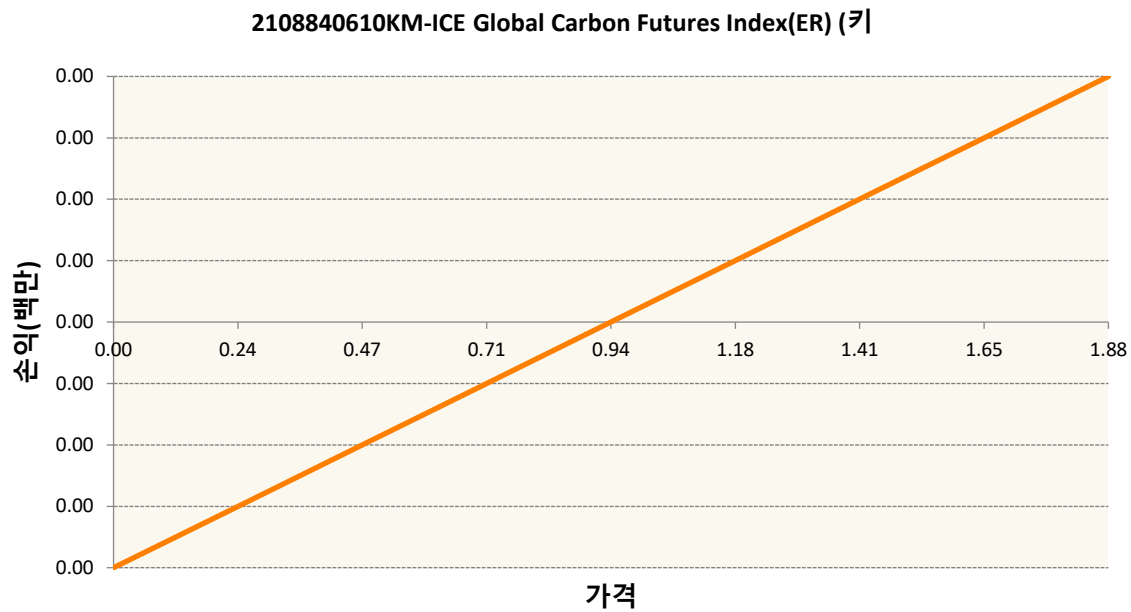
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	15,577	0	15,577	

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108840321IICE Global Carbon Futures Index(ER) (미)		480
2108840503IICE Global Carbon Futures Index(ER) (미)		192
2108840610IICE Global Carbon Futures Index(ER) (키)		384
2108840920IICE Global Carbon Futures Index(ER) (메)		192

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)		(단위:백만원)
		1,373

공시일	2024-08-28
기준일	2024-08-27

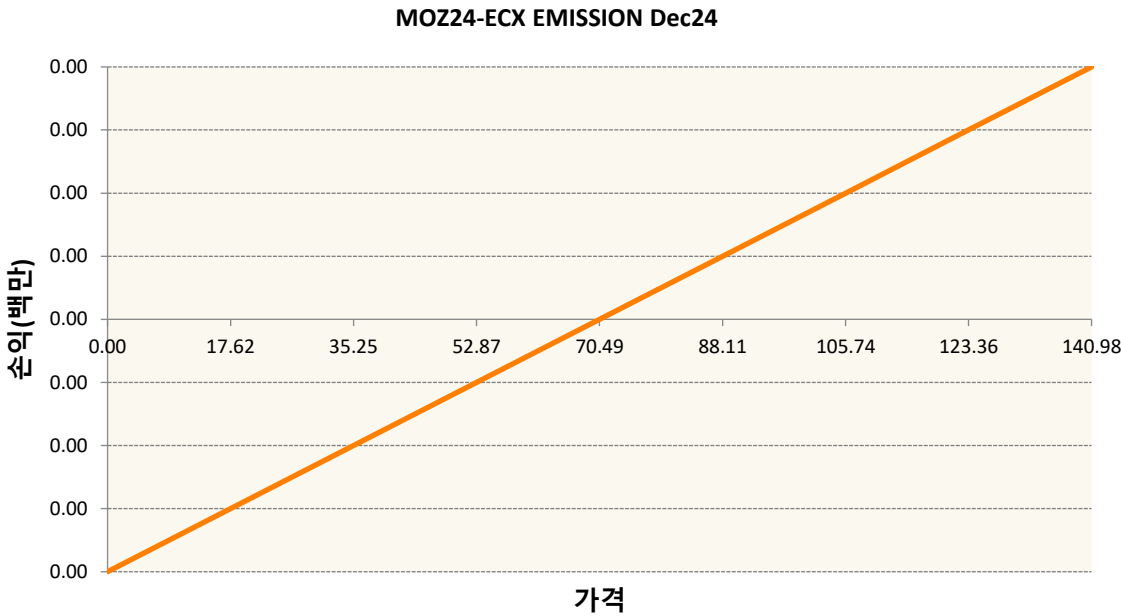
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	9,379	0	9,379	
누계	지수	스왑	373	0	373	장외
누계	통화	선도	0	1,433	-1,433	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213E7W KRW/EUR 30-08-24E	115
MOZ24 ECX EMISSION Dec24	750
SWICEUACN ICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX	1

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

(단위:백만원)

1,325

공시일	2024-08-28
기준일	2024-08-27

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)	13
SWCSI00000 신한CSI Index 240620 (미래)	19
SWCSI00000 신한CSI Index 240620 (메리츠)	19
SWCSI00000 신한CSI Index 240620 (NH)	13

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

(단위:백만원)

91

공시일	2024-08-28
기준일	2024-08-27

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)	17
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(NH)	14
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(메리츠)	20
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(키움)	4

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

(단위:백만원)

64

공시일	2024-08-28
기준일	2024-08-27

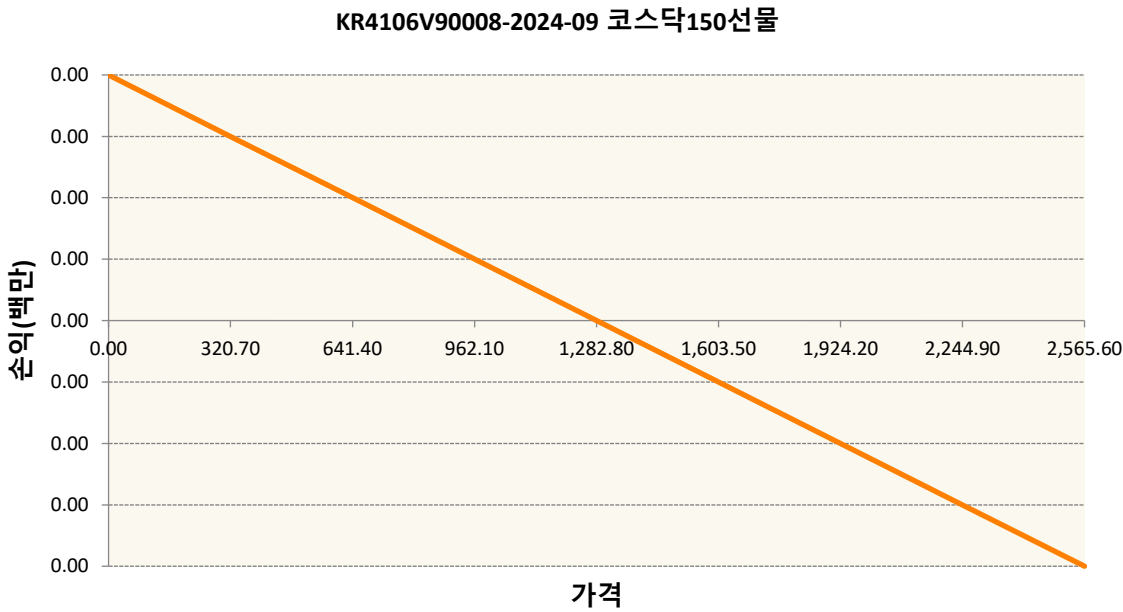
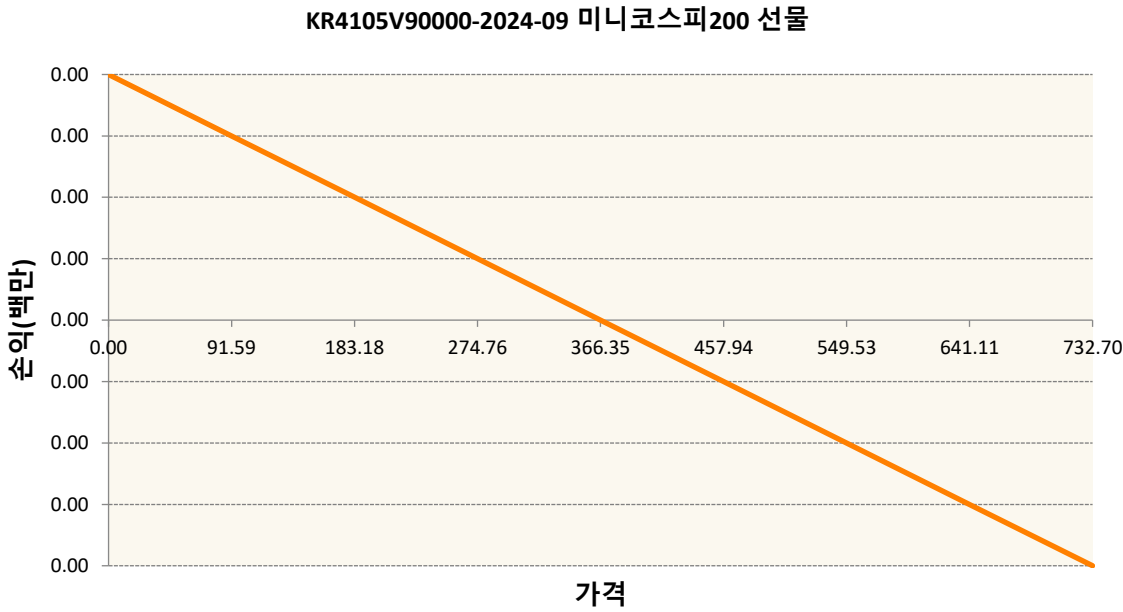
에퀴티알파일반사모혼합자산

1. 계약금액

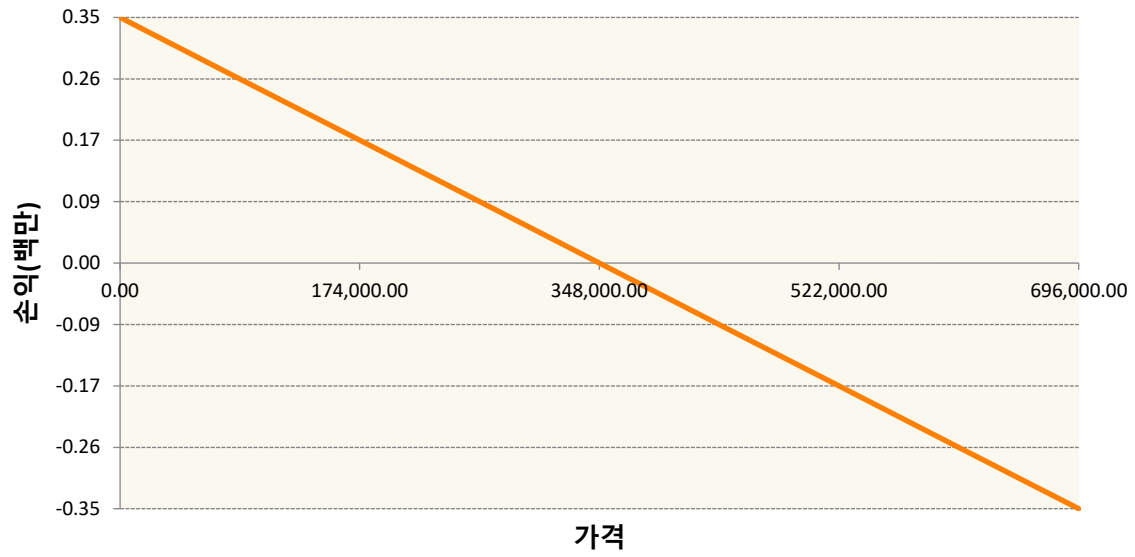
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	11	-11	장내
누계	유가증권	선물	22	252	-230	장내

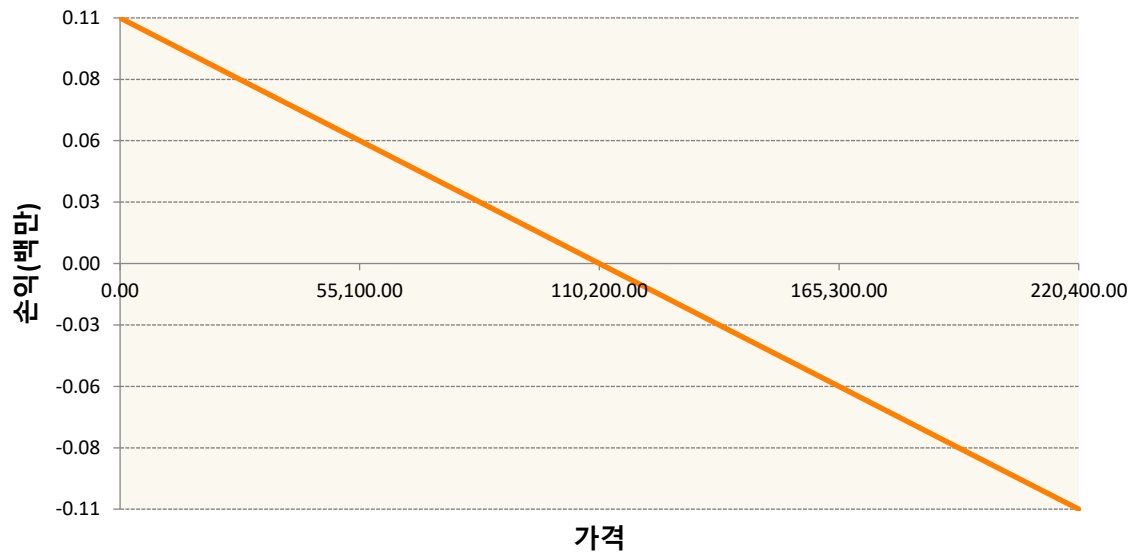
2. 만기시점의 손익구조



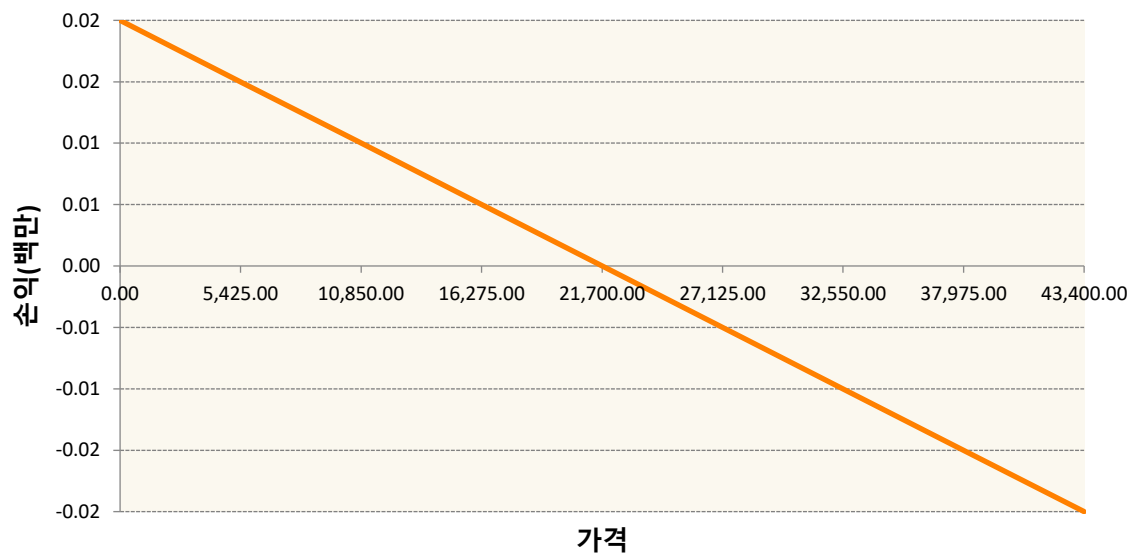
KR4113V90004-2024-09 POSCO홀딩스개별선물



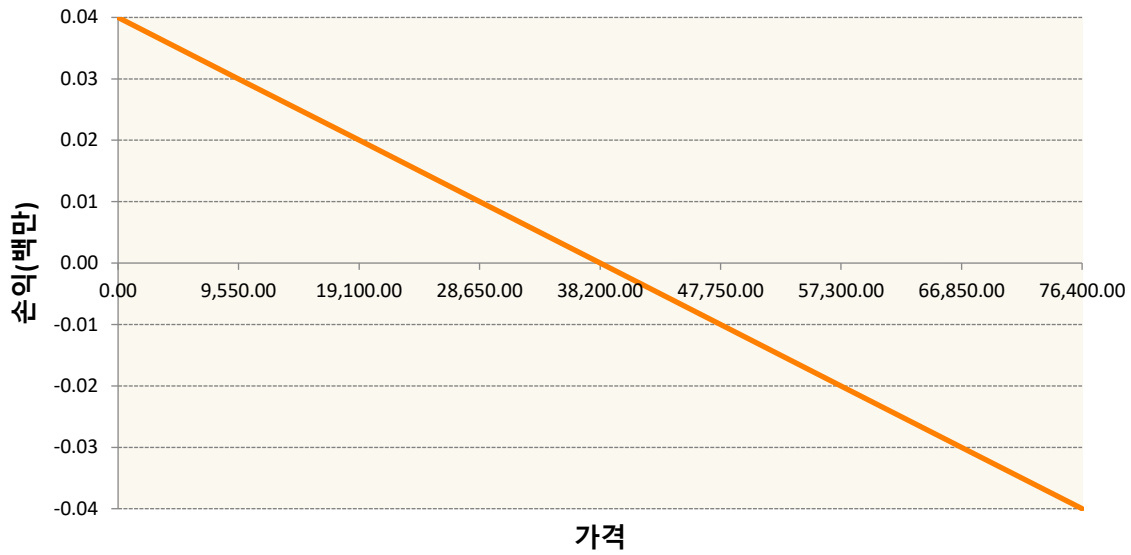
KR4136V90005-2024-09 KT&G개별선물



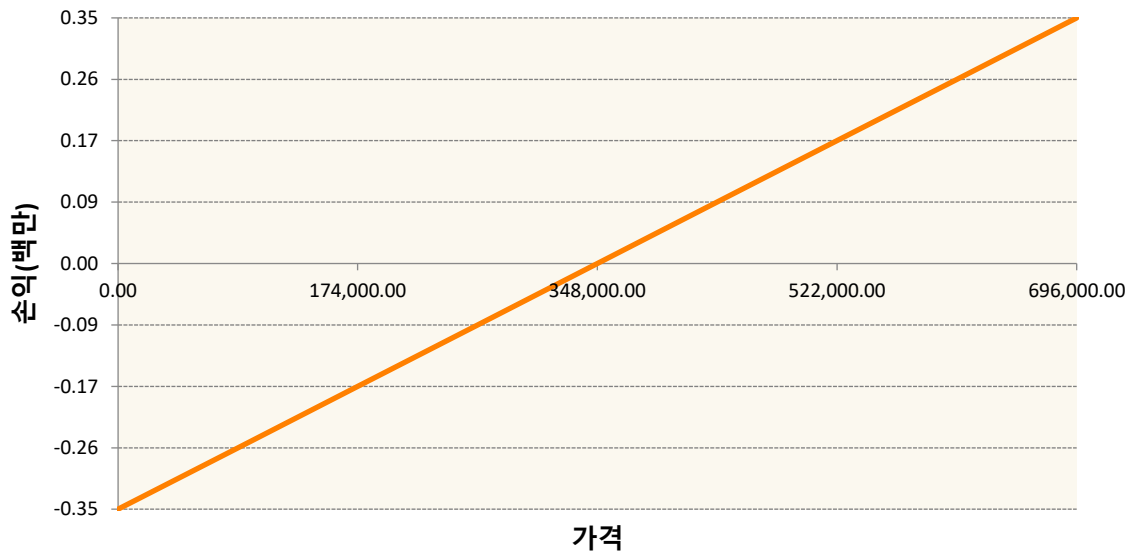
KR4151V90004-2024-09 GS건설개별선물



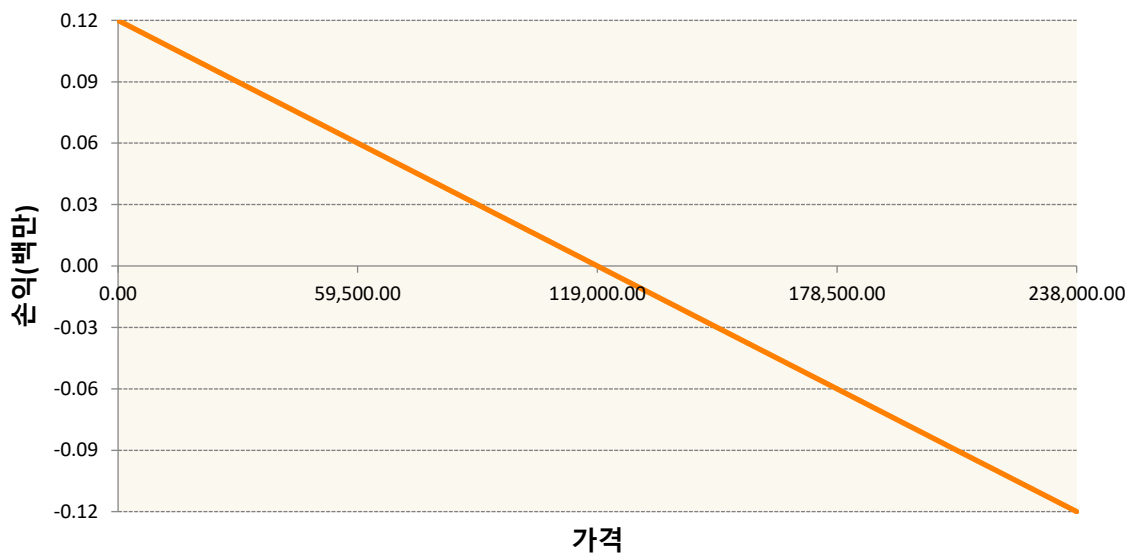
KR41CFV90004-2024-09 카카오개별선물



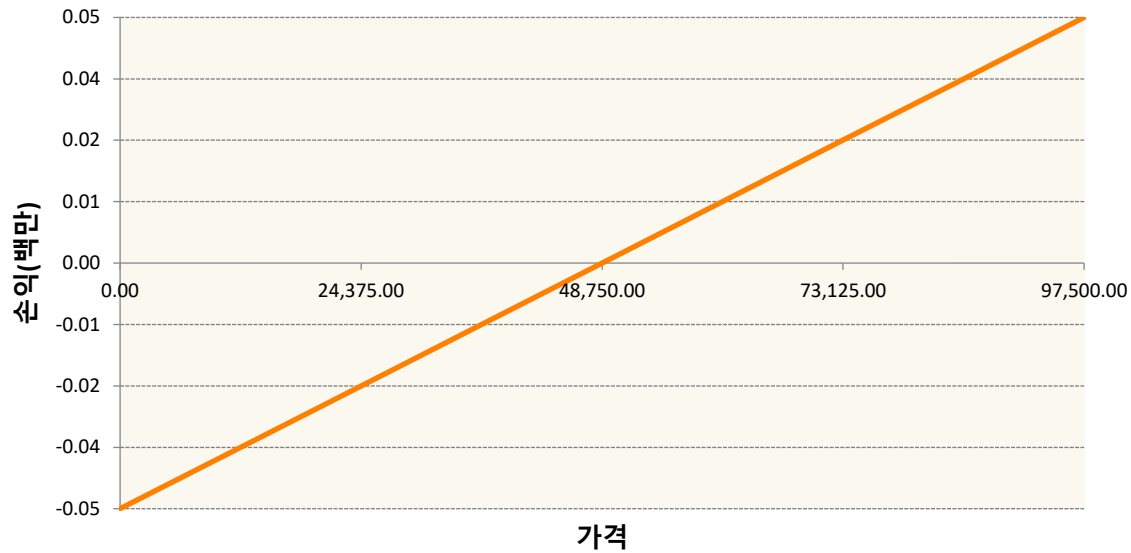
KR41CTV90005-2024-09 삼성화재개별선물



KR41D0V90007-2024-09 DB손해보험개별선물



KR41GNV90009-2024-09 금양개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4105V900 2024-09 미니코스피200 선물	3
KR4106V900 2024-09 코스닥150선물	3
KR4113V900 2024-09 POSCO홀딩스개별선물	0.28
KR4136V900 2024-09 KT&G개별선물	0.44
KR4151V900 2024-09 GS건설개별선물	0.45
KR41CFV900 2024-09 카카오개별선물	1
KR41CTV900 2024-09 삼성화재개별선물	1
KR41D0V900 2024-09 DB손해보험개별선물	1
KR41GNV900 2024-09 금양개별선물	0.39

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

(단위:백만원)

19

공시일	2024-08-28
기준일	2024-08-27

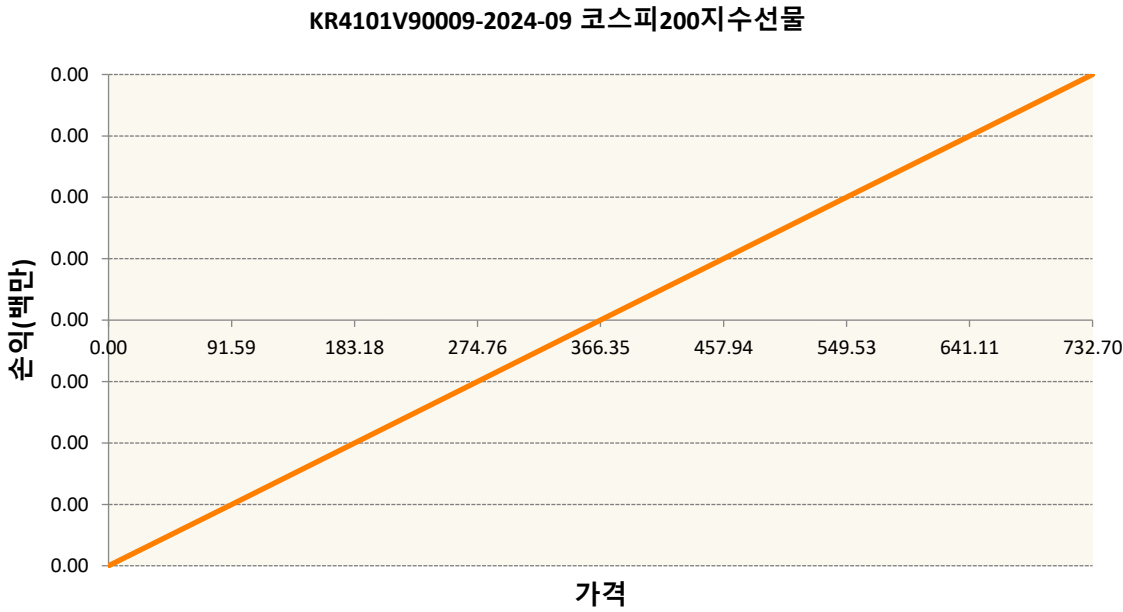
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

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	6,777	0	6,777	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101V90009		2024-09 코스피200지수선물					540
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-540	-540	-540	-540	-540	-540	-540
-5.33%	-360	-360	-360	-360	-360	-360	-360
-2.67%	-180	-180	-180	-180	-180	-180	-180
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	180	180	180	180	180	180	180
5.33%	360	360	360	360	360	360	360
8.00%	540	540	540	540	540	540	540

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

(단위:백만원)

640

공시일	2024-08-28
기준일	2024-08-27

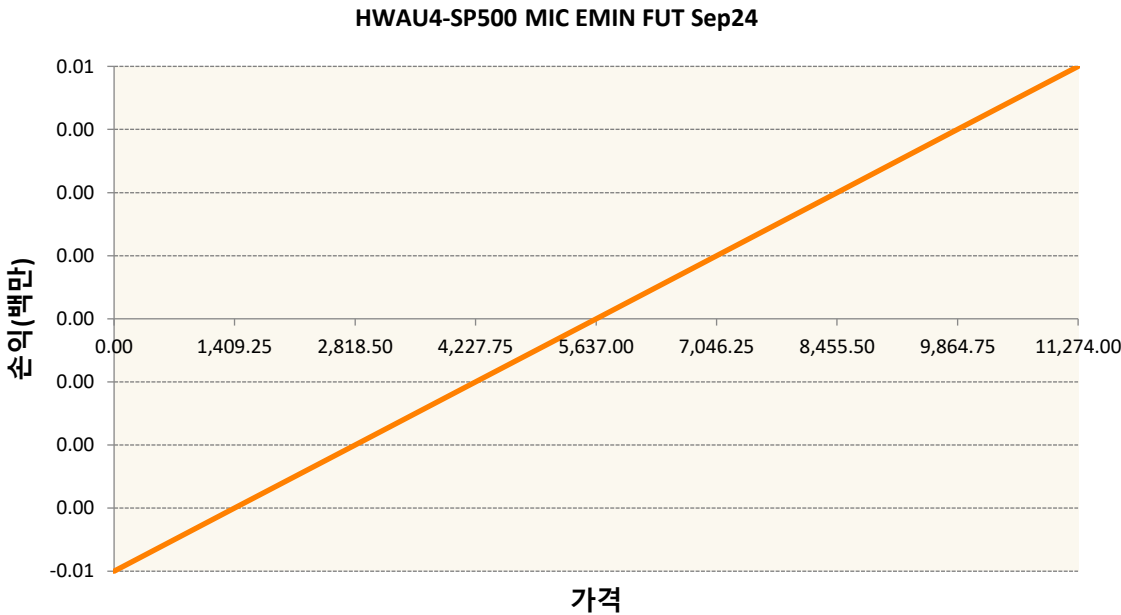
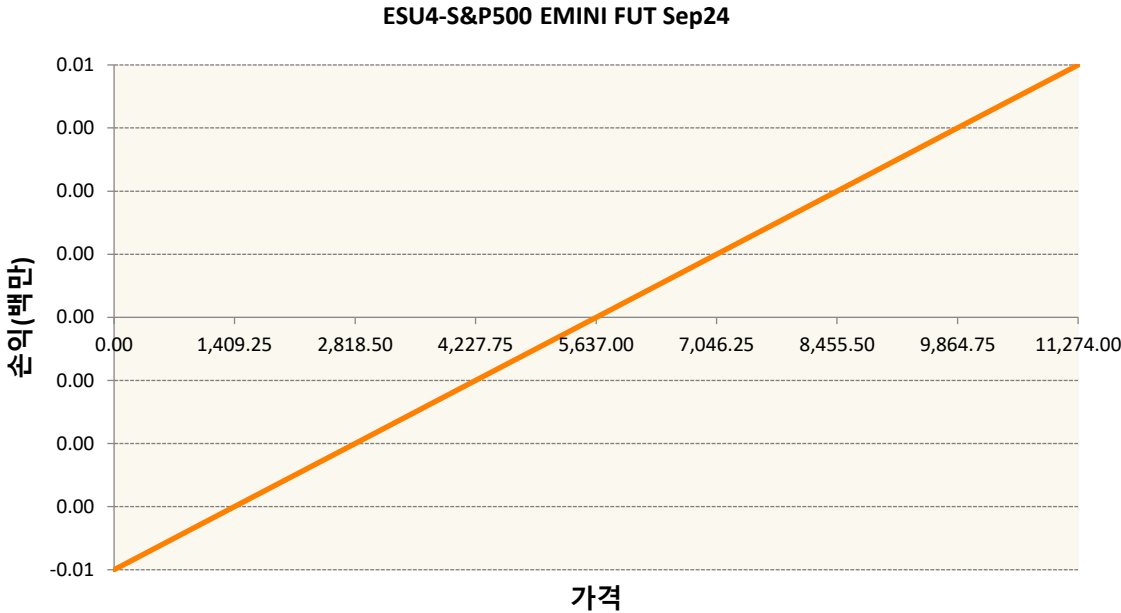
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

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	10,123	0	10,123	
누계	유가증권	선물	2,103	0	2,103	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESU4	S&P500 EMINI FUT Sep24	810
HWAU4	SP500 MIC EMIN FUT Sep24	168

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	593

공시일	2024-08-28
기준일	2024-08-27

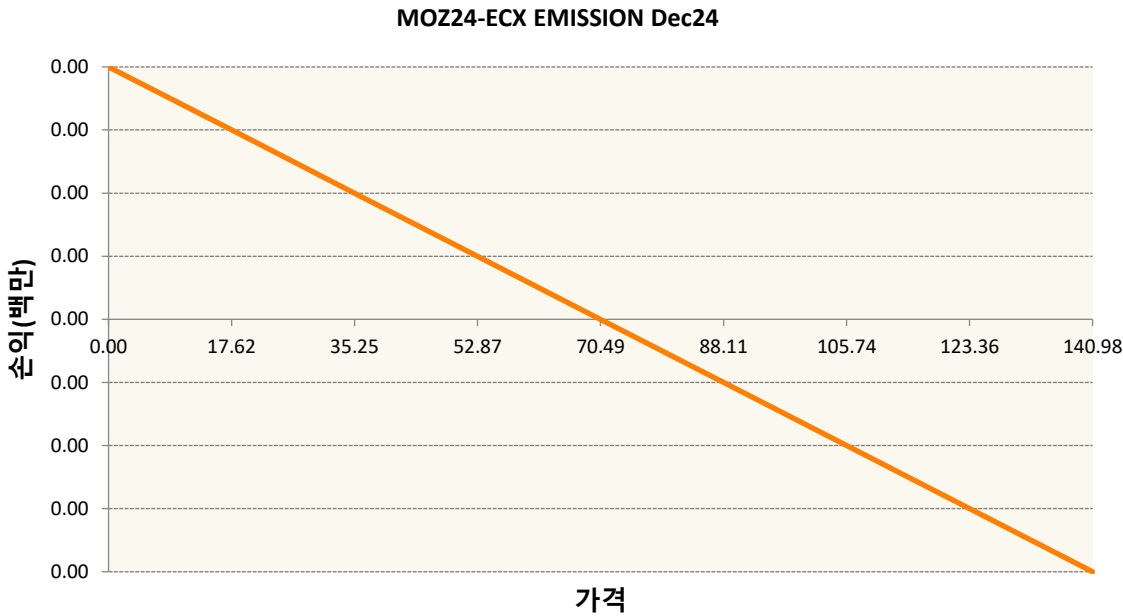
SOL유럽탄소배출권선물인버스ICE특별자산상

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	5,437	-5,437	
누계	지수	스왑	373	0	373	장외
누계	통화	선도	0	1,468	-1,468	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213E7W KRW/EUR 30-08-24E	117
MOZ24 ECX EMISSION Dec24	435
SWICEUACN ICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX	1

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

(단위:백만원)

797

공시일	2024-08-28
기준일	2024-08-27

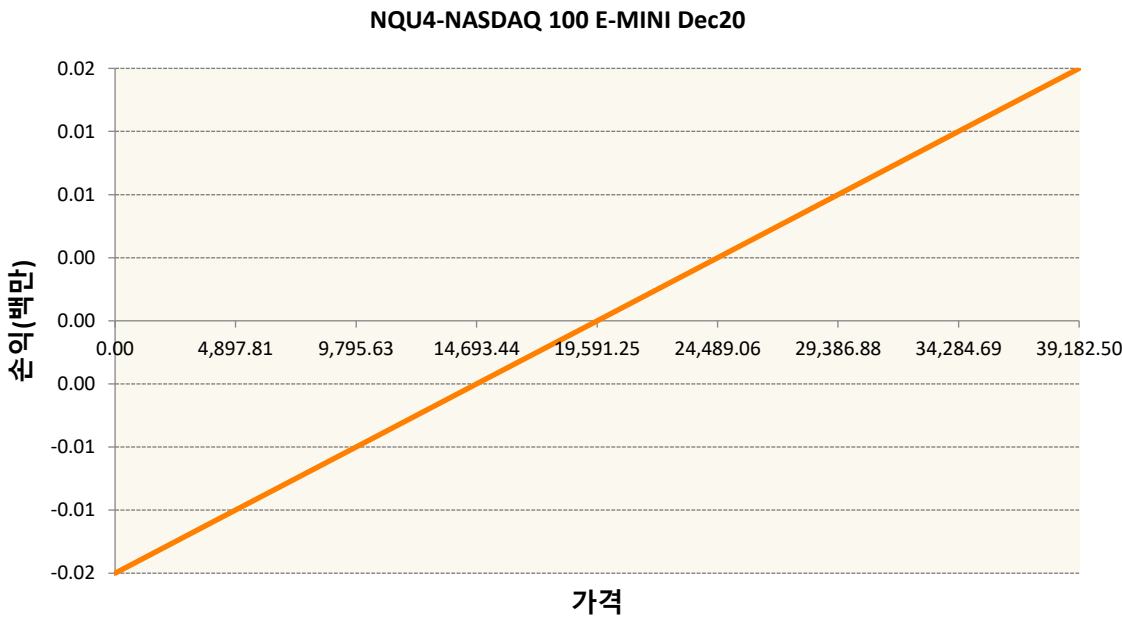
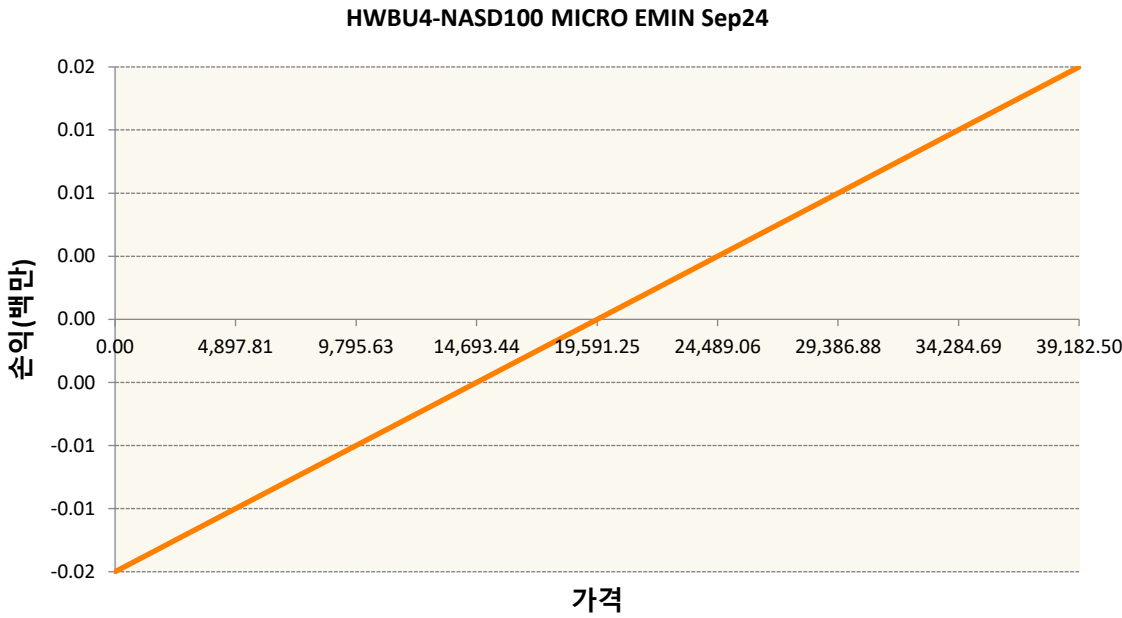
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

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	6,476	0	6,476	
누계	유가증권	선물	1,952	0	1,952	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HWBU4	NASD100 MICRO EMIN Sep24	156
NQU4	NASDAQ 100 E-MINI Dec20	518

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	534

공시일	2024-08-28
기준일	2024-08-27

SOL미국30년국채커버드콜(합성)

1. 계약금액 (단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	60,383	0	60,383	장외
누계	지수	스왑	188,616	0	188,616	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
SWKEDI0000 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	714
SWKEDI0000 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	3,090
SWKEDI0000 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	241
SWKEDI0000 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	6,225
SWKEDI0000 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	4,841

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	8,921

공시일	2024-08-28
기준일	2024-08-27

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	13
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	13
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	13
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	13

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

(단위:백만원)

57

공시일	2024-08-28
기준일	2024-08-27

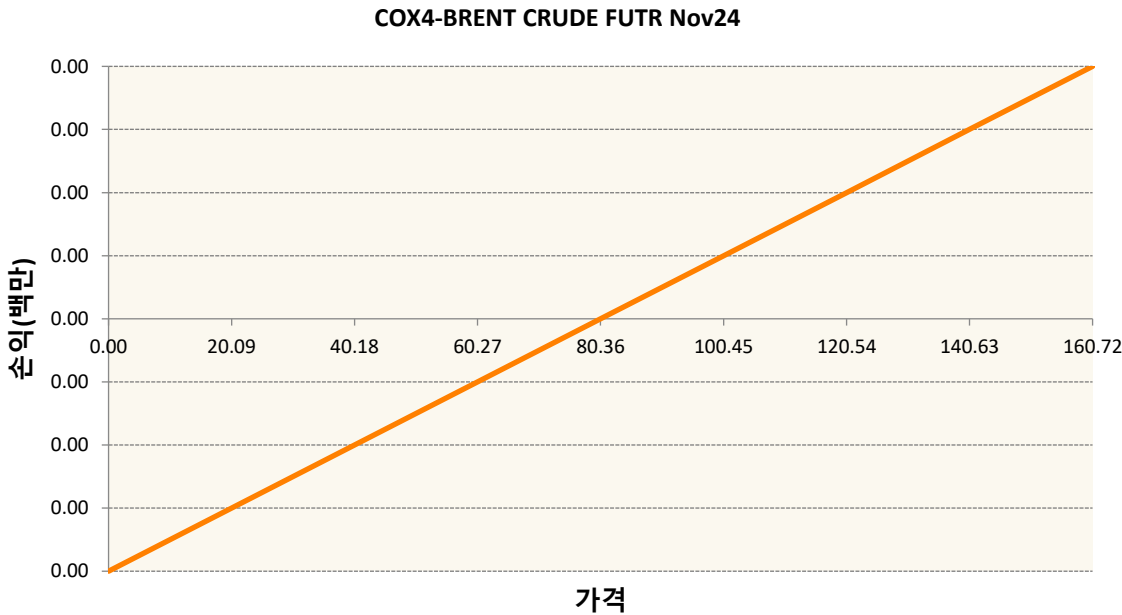
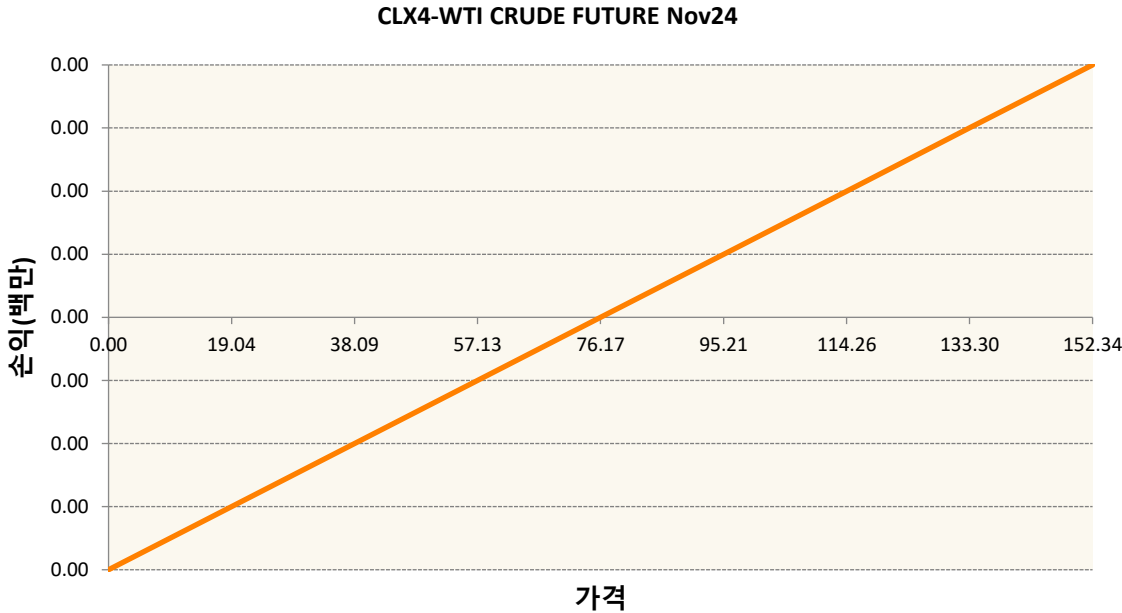
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

1. 계약금액

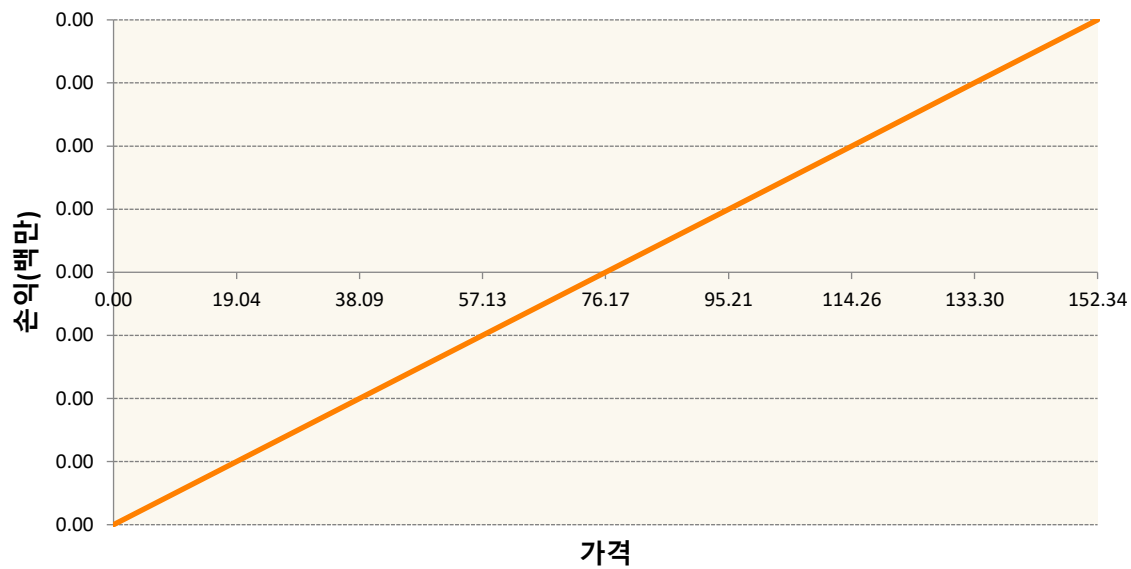
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	13	-13	장내
누계	유가증권	선물	879	0	879	
누계	통화	선물	0	133	-133	장내

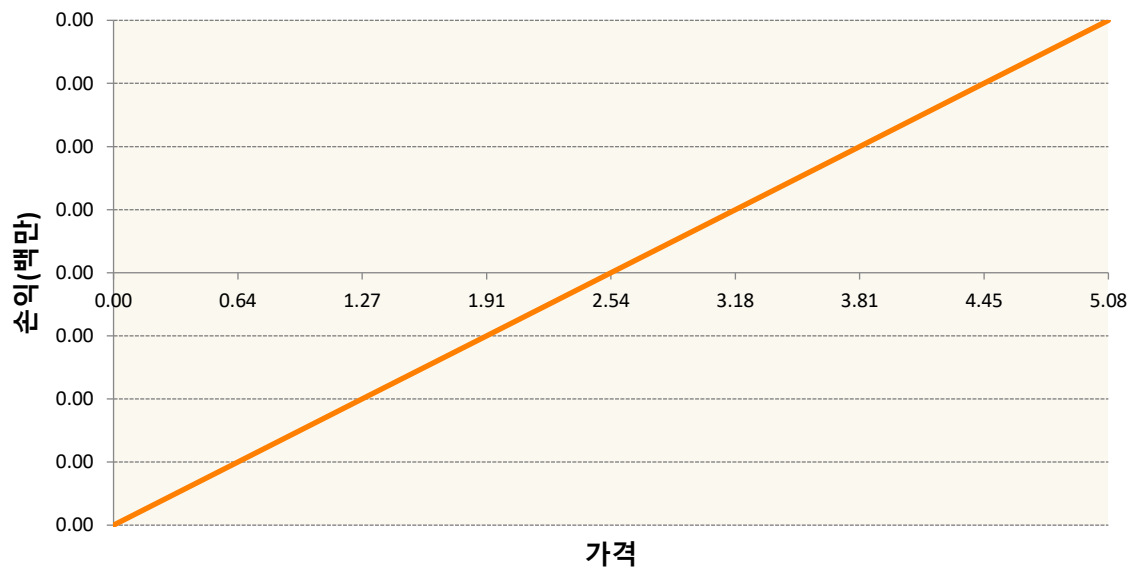
2. 만기시점의 손익구조



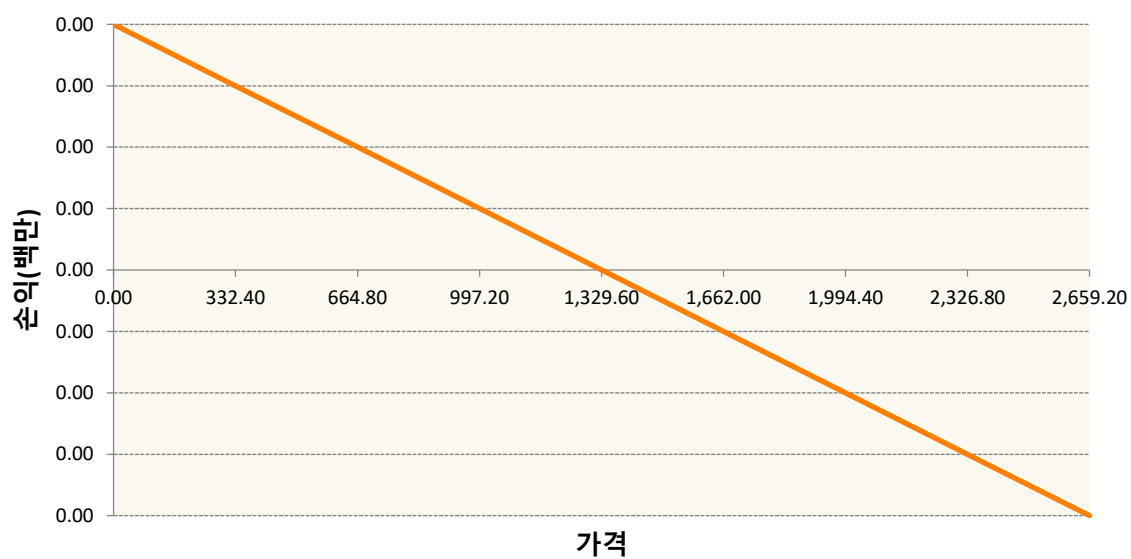
ECX4-E-mini Crude Oil Nov24



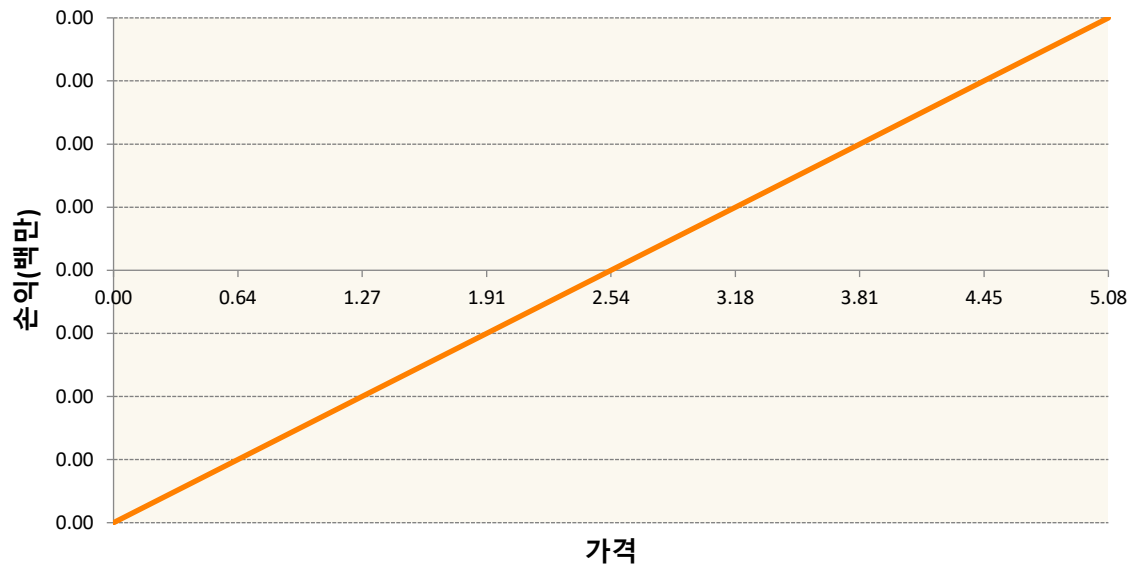
EOX4-E-MINI NATURAL GA Nov24



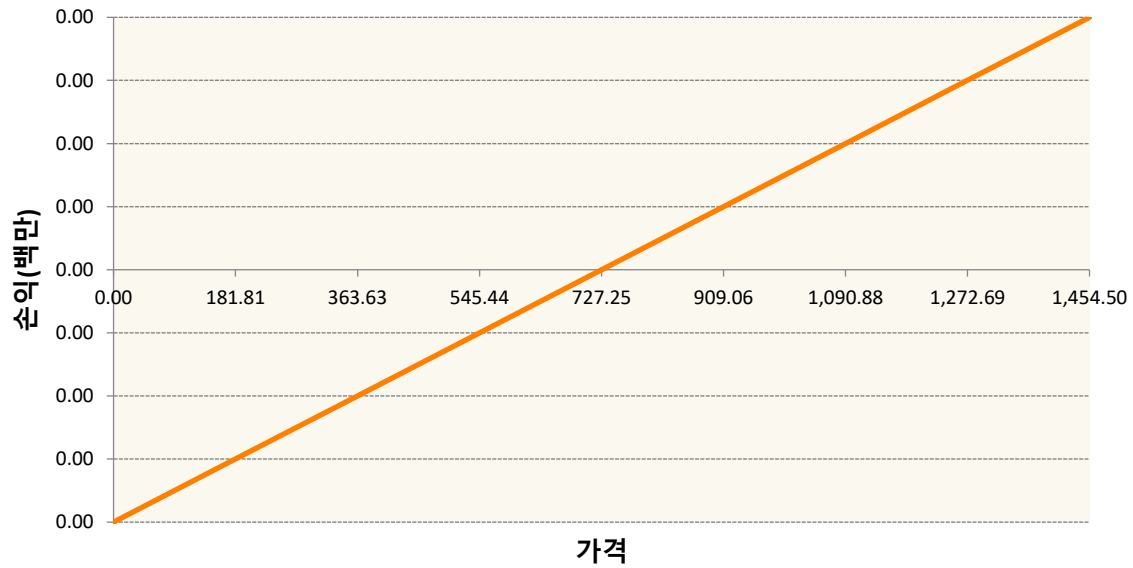
KR4175V90003-2024-09 달러선물



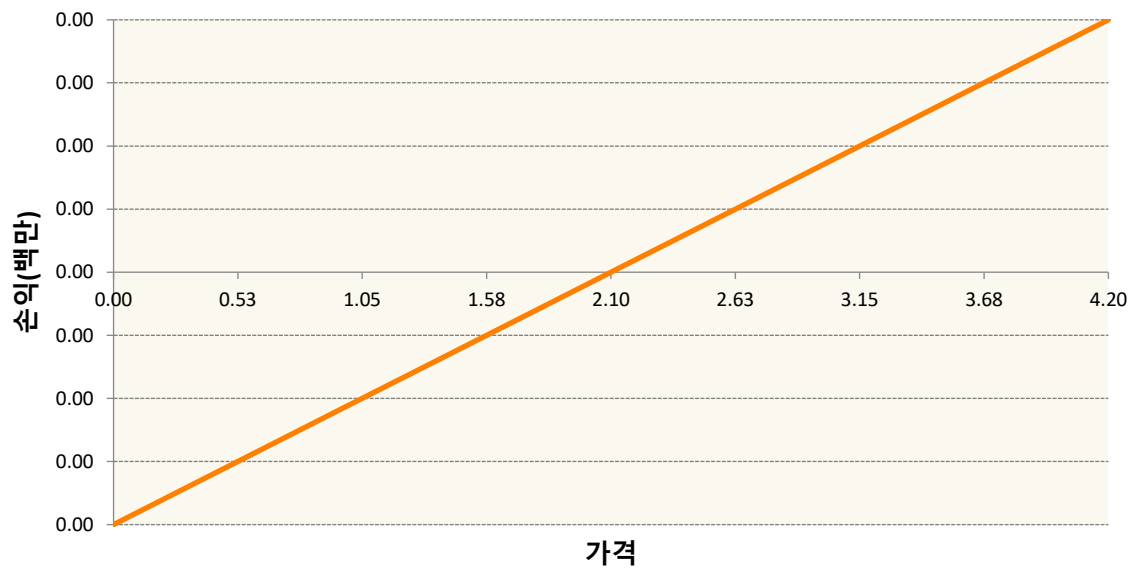
NGX24-NATURAL GAS FUTR Nov24



QSX4-Low Su Gasoil G Nov24



XBX4-GASOLINE RBOB FUT Nov24



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLX4	WTI CRUDE FUTURE Nov24	8
COX4	BRENT CRUDE FUTR Nov24	18
ECX4	E-mini Crude Oil Nov24	8
EOX4	E-MINI NATURAL GA Nov24	4
KR4175V900 2024-09 달러선물		11
NGX24	NATURAL GAS FUTR Nov24	14
QSX4	Low Su Gasoil G Nov24	8
XBX4	GASOLINE RBOB FUT Nov24	10

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

146