

공시일 2024-08-29

기준일 2024-08-28

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	2024-08-29
기준일	2024-08-28

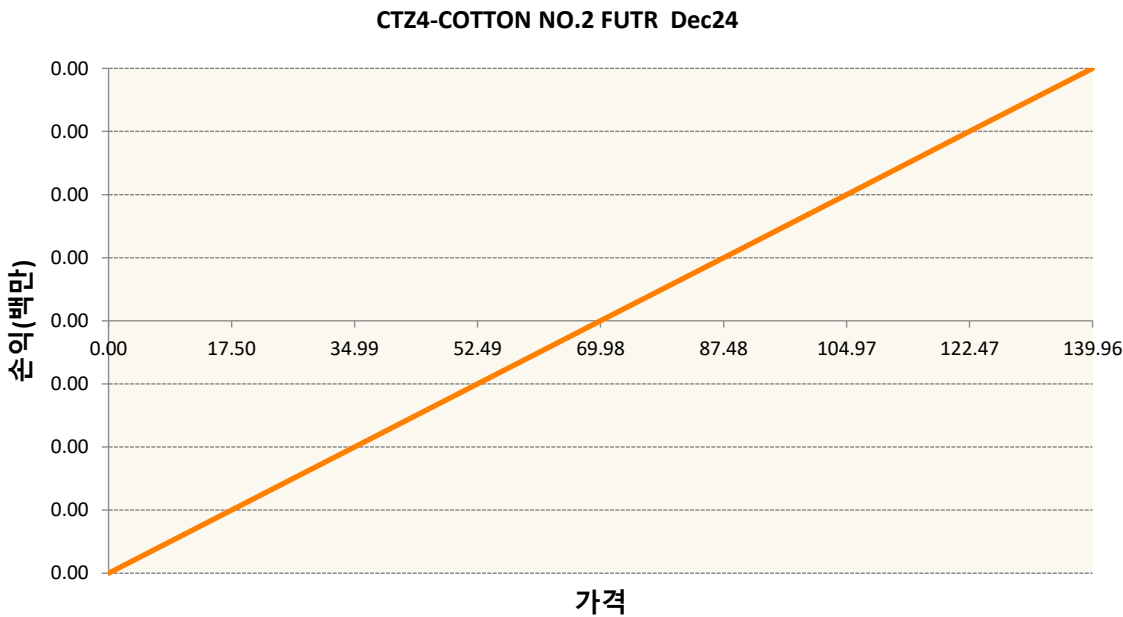
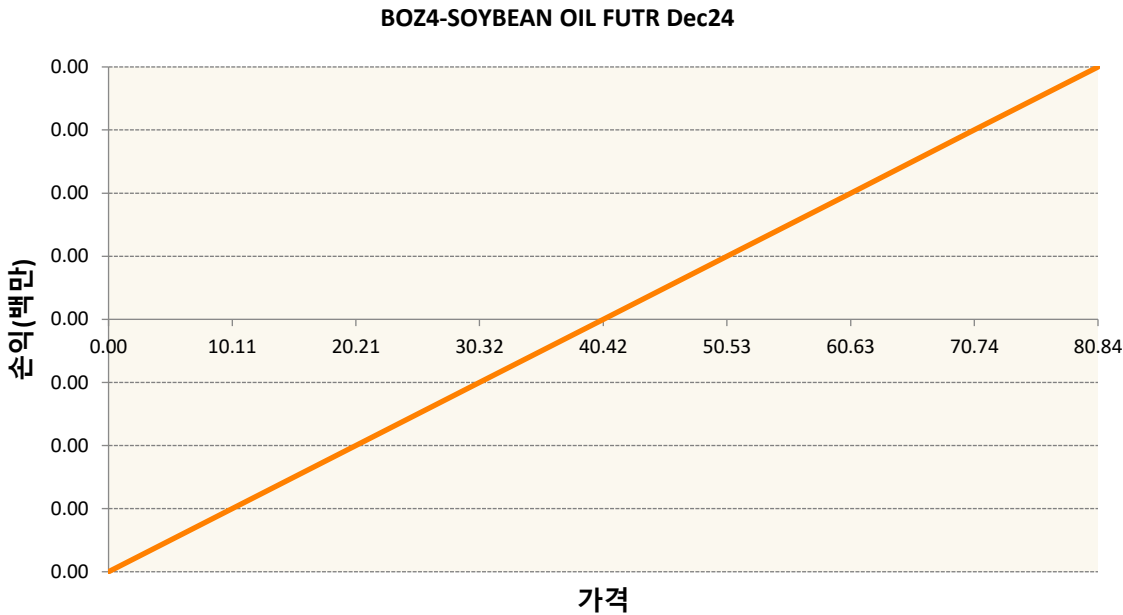
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

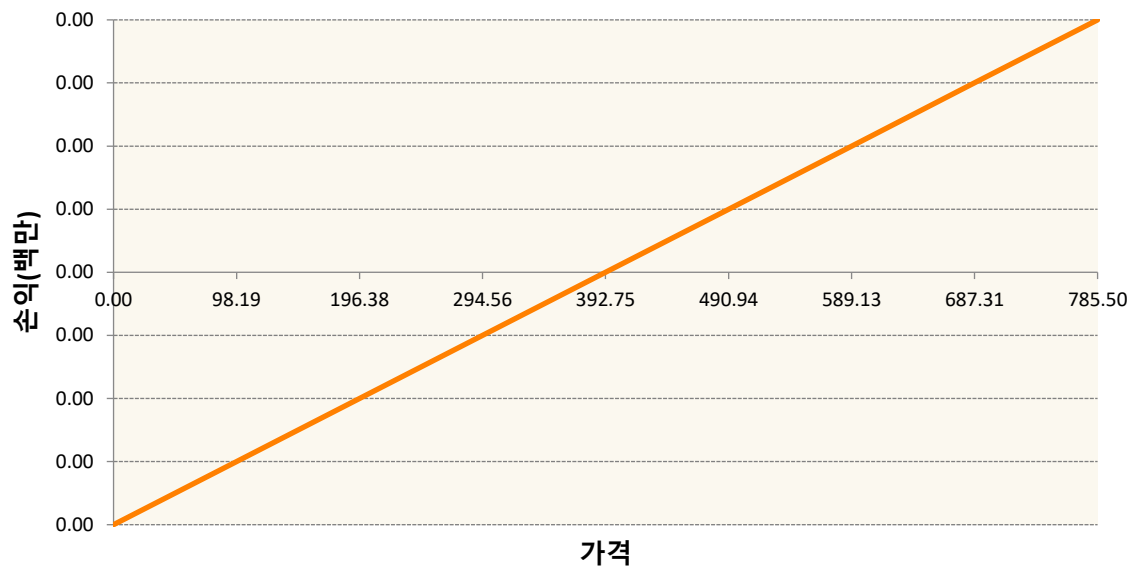
(단위:USD 백만)

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	3,890	0	3,890	
누계	통화	선물	0	414	-414	장내

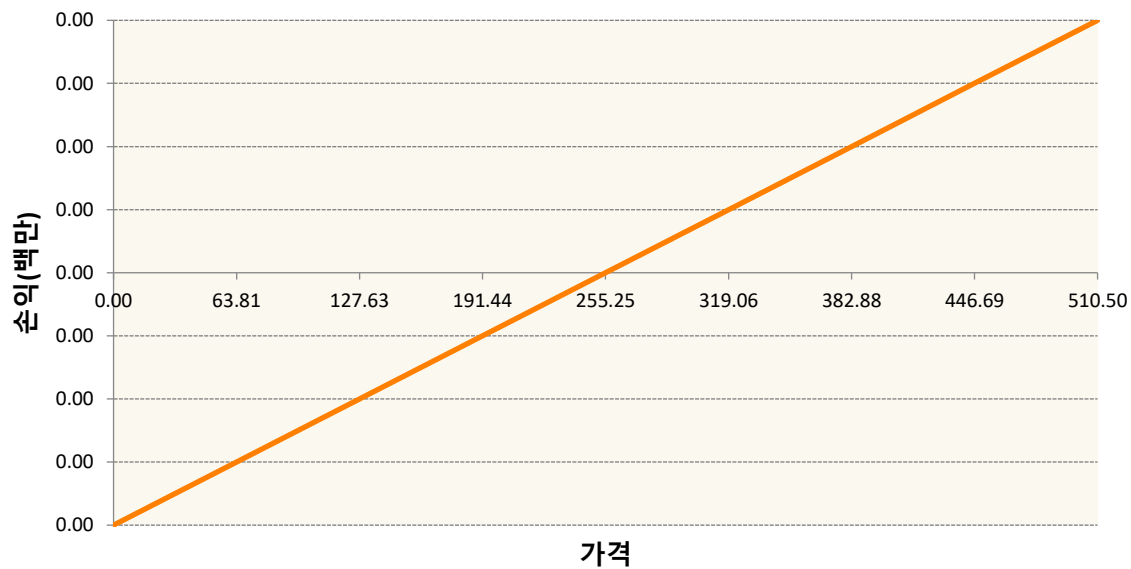
2. 만기시점의 손익구조



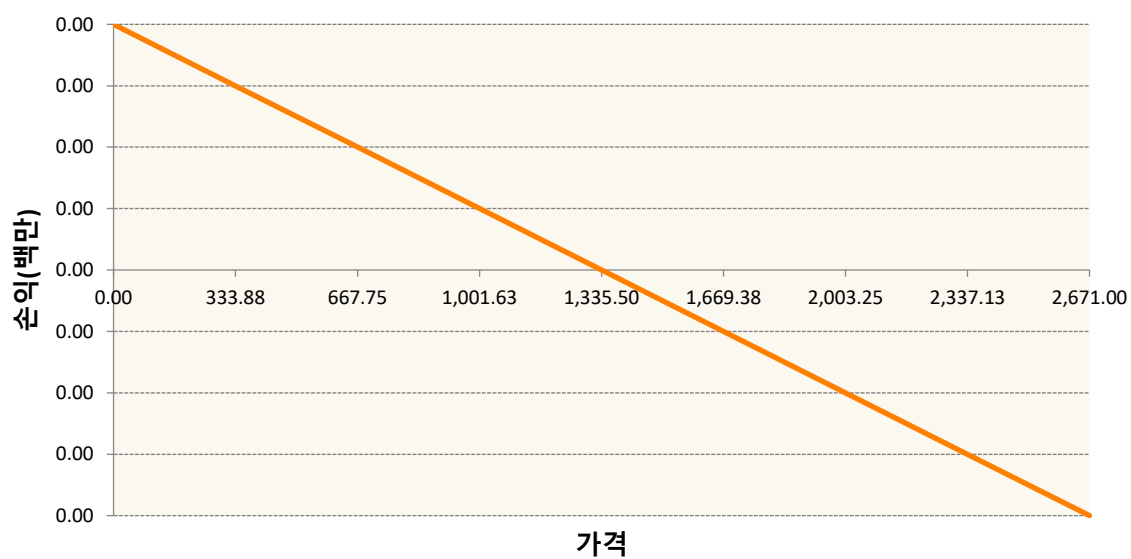
CZ4-CORN FUTURE Dec24



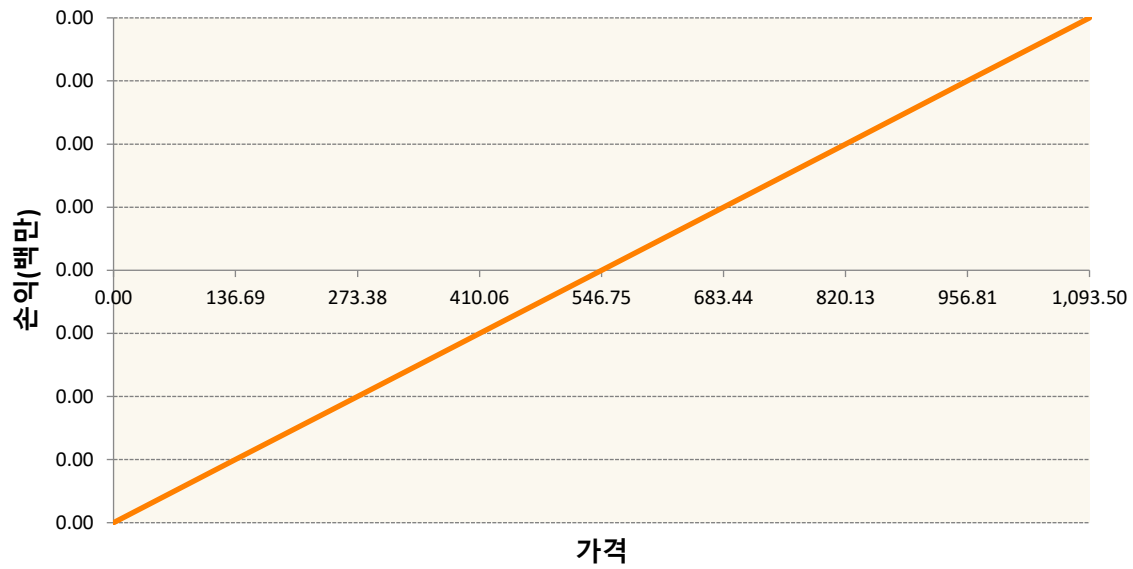
KCZ4-COFFEE 'C' FUTURE Dec24



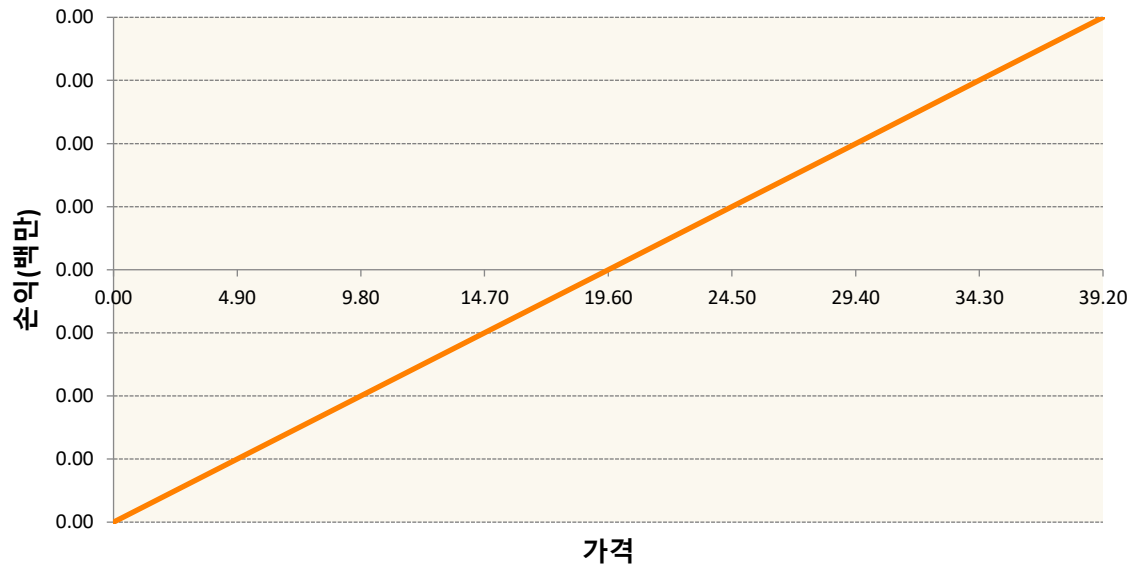
KR4175V90003-2024-09 달러선물



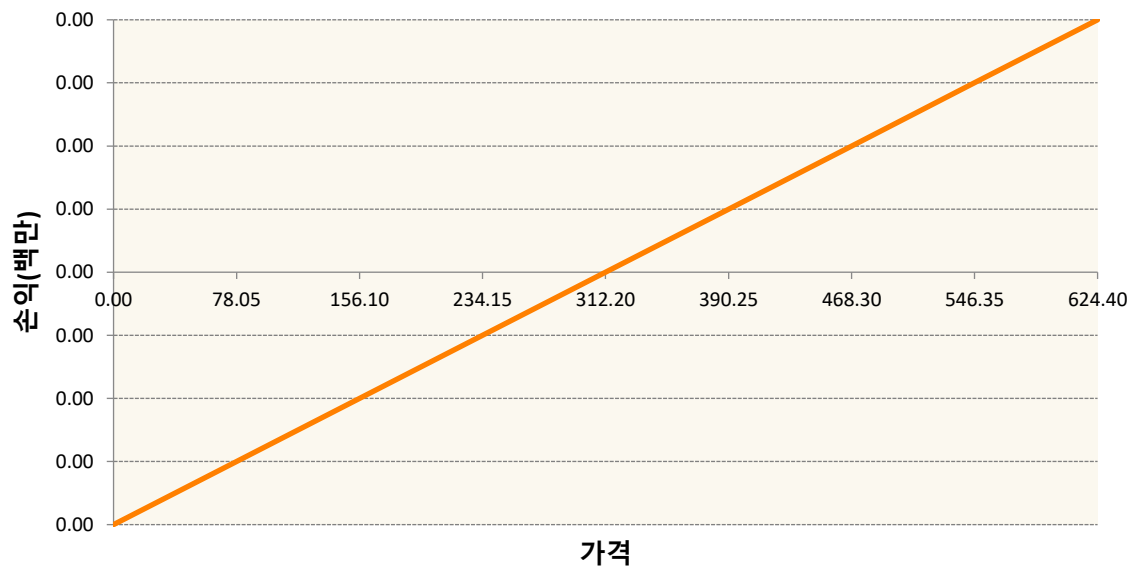
KWZ4-KC HRW WHEAT FUT Dec24

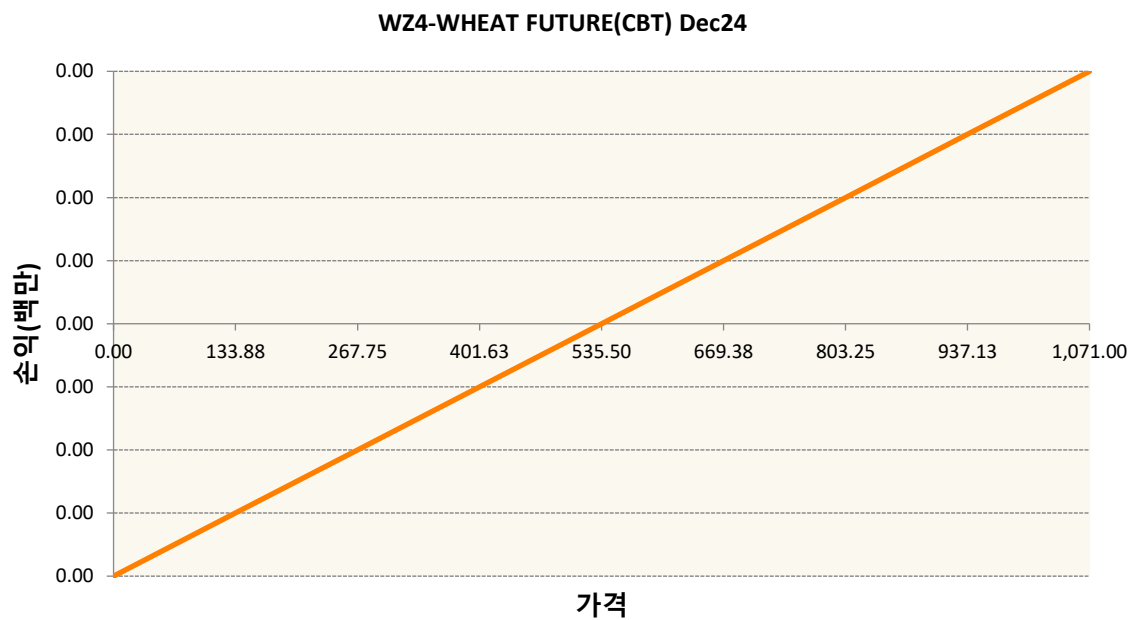
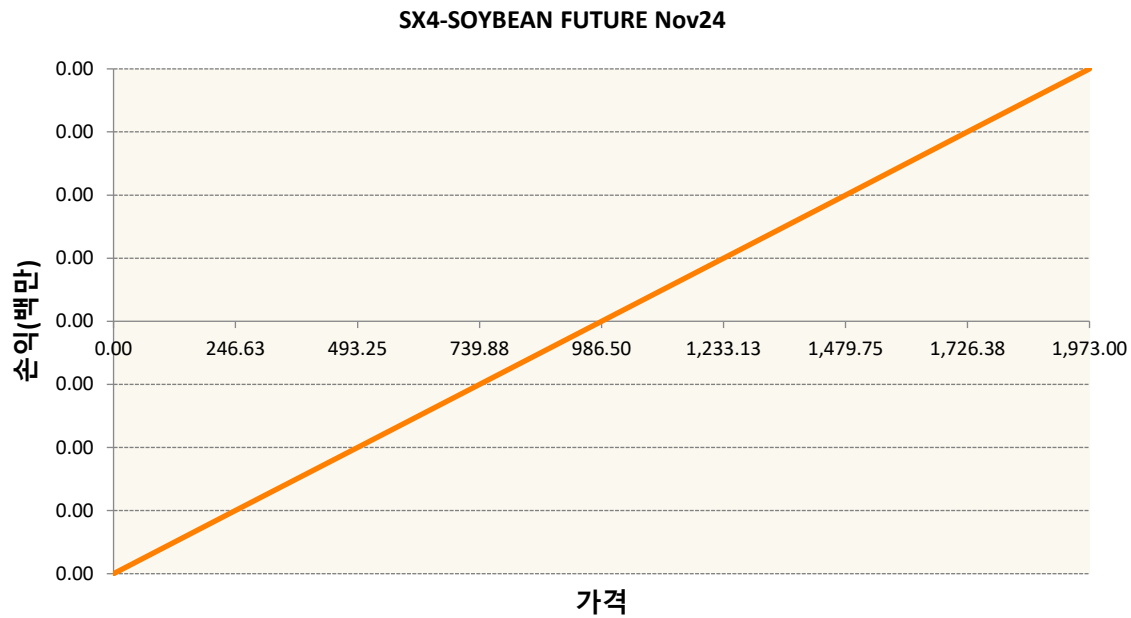


SBV4-Sugar #11 (WORLD) Oct24



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	2024-08-29
기준일	2024-08-28

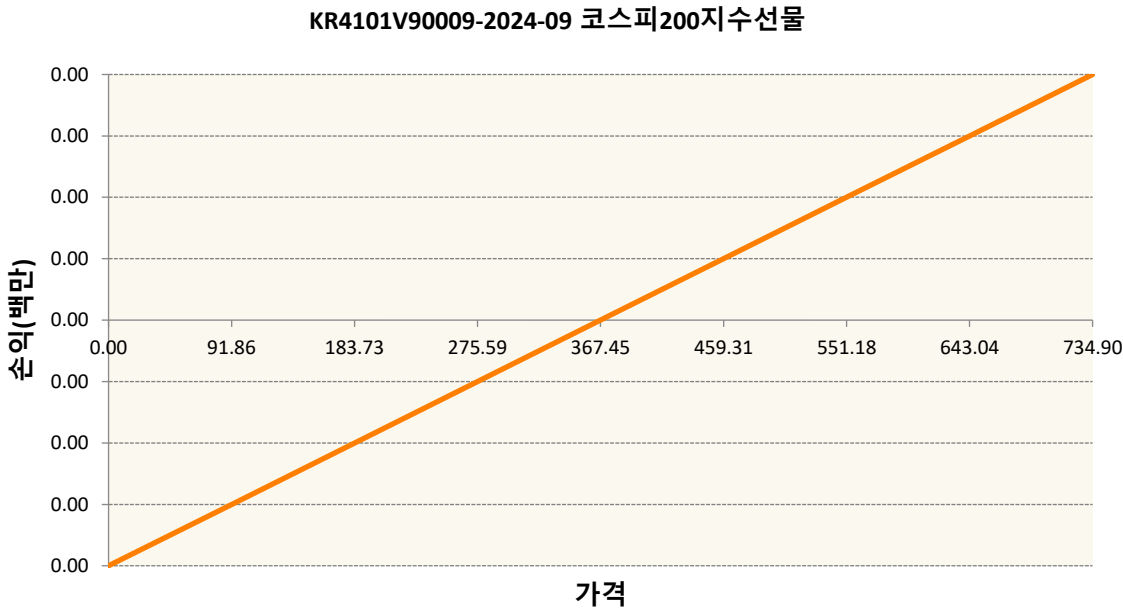
스마트인덱스모

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	2,021	0	2,021	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101V90009		2024-09 코스피200지수선물					161
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-161	-161	-161	-161	-161	-161	-161
-5.33%	-107	-107	-107	-107	-107	-107	-107
-2.67%	-54	-54	-54	-54	-54	-54	-54
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	54	54	54	54	54	54	54
5.33%	107	107	107	107	107	107	107
8.00%	161	161	161	161	161	161	161

공시일	2024-08-29
기준일	2024-08-28

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	232
-----------------------------	-----

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

289

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2024-08-29
기준일	2024-08-28

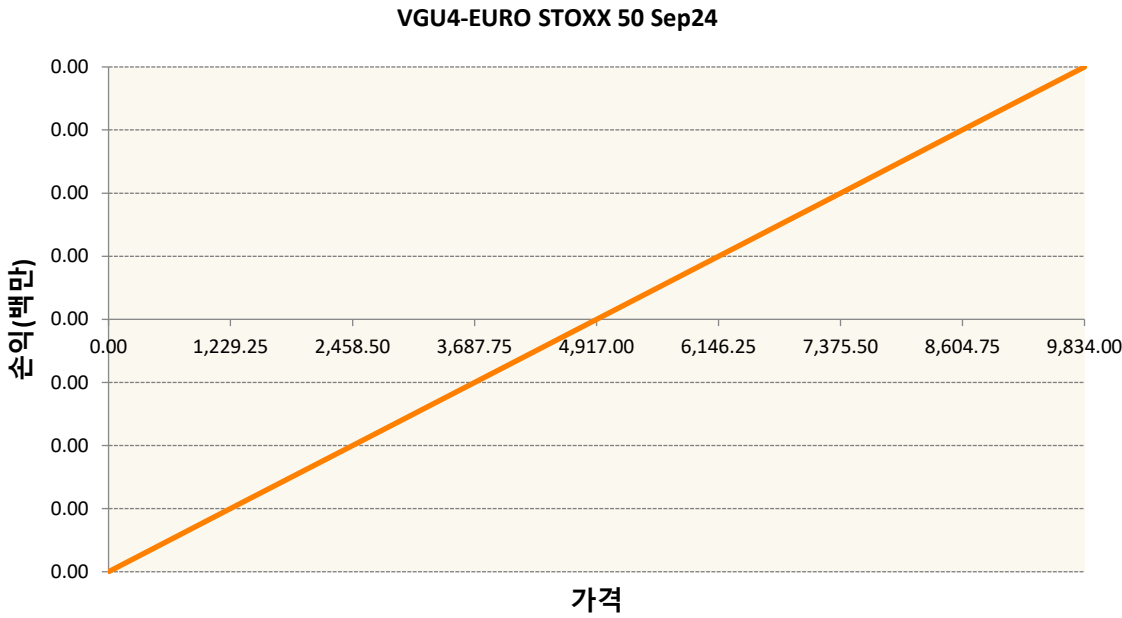
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	948	0	948	

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	2024-08-29
기준일	2024-08-28

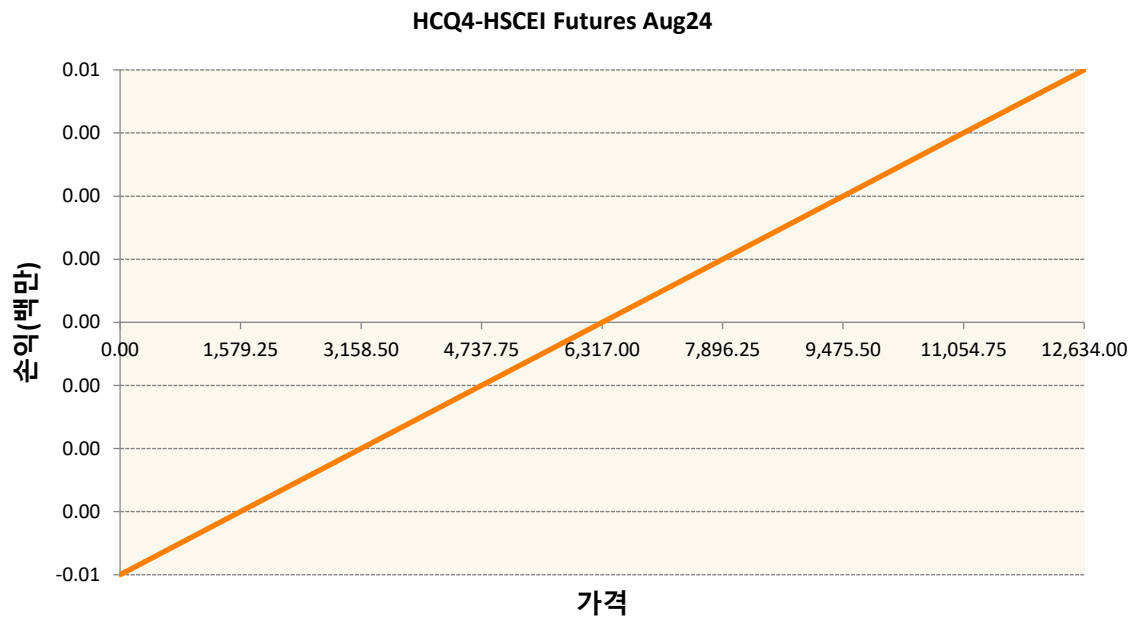
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,673	0	1,673	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCQ4	HSCEI Futures Aug24	134
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

159

공시일	2024-08-29
기준일	2024-08-28

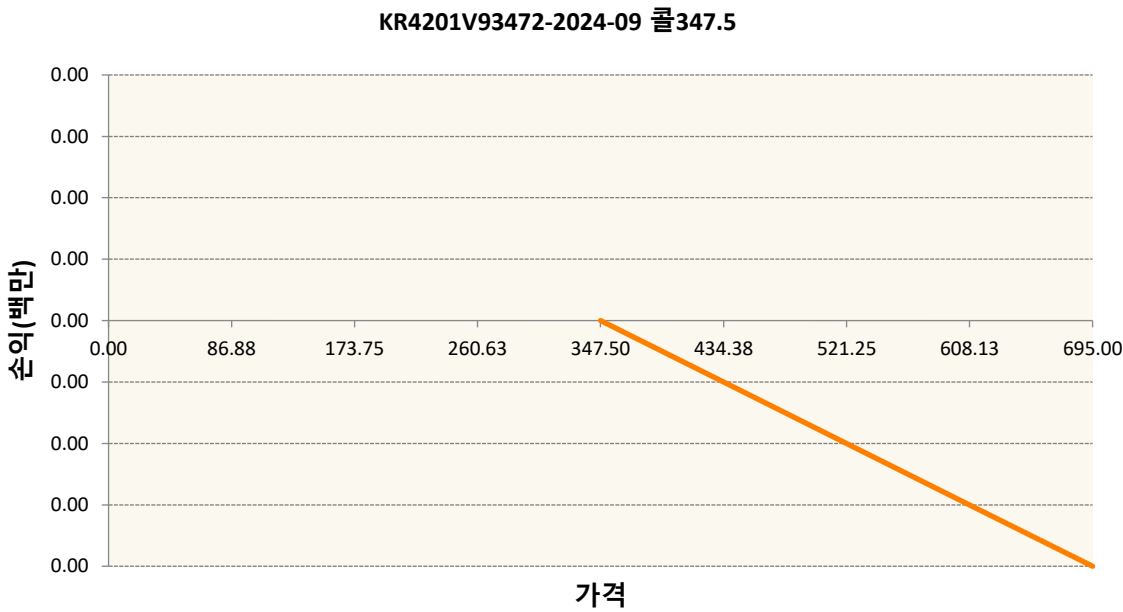
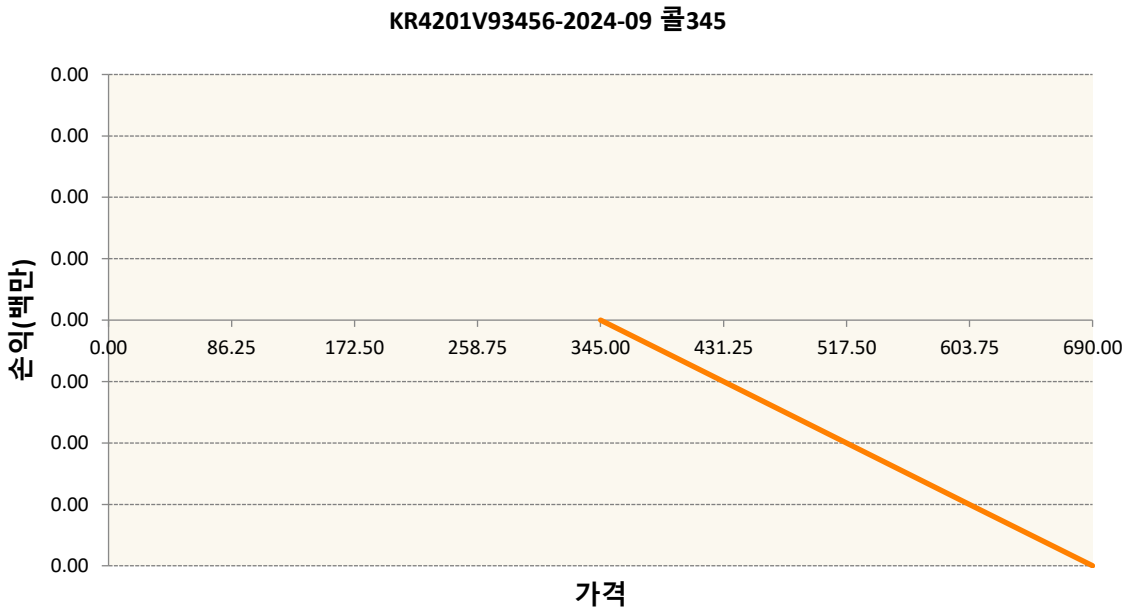
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

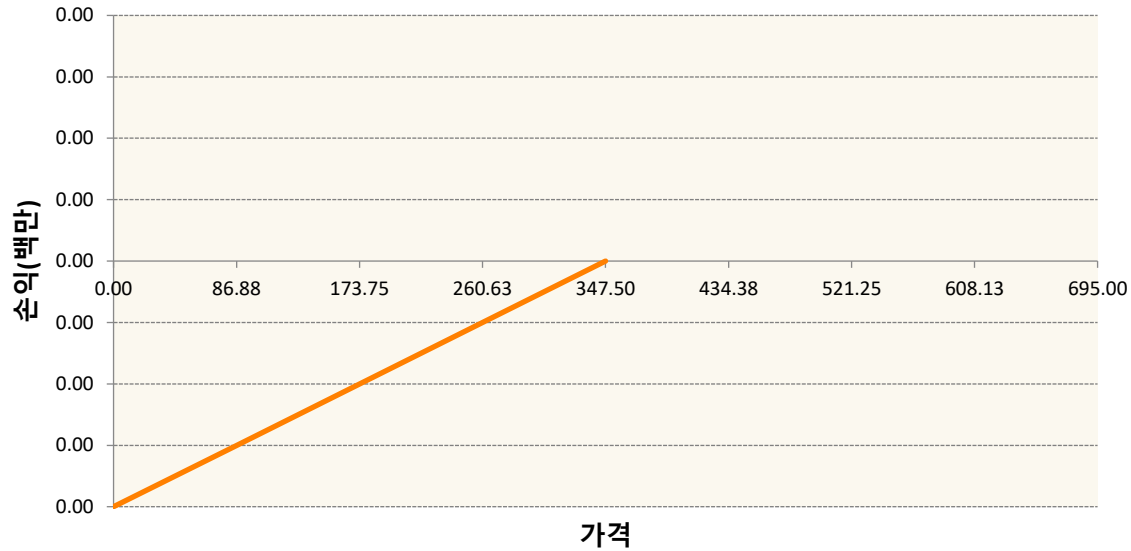
(단위:백만원)

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					1,009
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	706	688	669	650	631	611	591
-5.33%	567	545	523	501	479	457	435
-2.67%	334	317	299	280	261	241	221
0%	32	23	12	0	-13	-28	-43
2.67%	-304	-307	-312	-318	-326	-335	-345
5.33%	-652	-652	-654	-656	-660	-664	-670
8.00%	-1,001	-1,002	-1,002	-1,003	-1,004	-1,006	-1,009
KR4201V93472		2024-09 콜347.5					1,543
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,009	984	957	930	901	872	842
-5.33%	829	795	761	726	692	658	624
-2.67%	505	475	444	412	380	348	315
0%	59	42	22	0	-24	-49	-75
2.67%	-452	-459	-468	-480	-494	-510	-528
5.33%	-987	-989	-992	-997	-1,004	-1,013	-1,023
8.00%	-1,528	-1,528	-1,529	-1,531	-1,534	-1,538	-1,543
KR4301V93470		2024-09 풋347.5					282
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-222	-231	-240	-250	-261	-271	-282
-5.33%	-92	-104	-116	-129	-141	-153	-166
-2.67%	-14	-24	-35	-47	-58	-70	-82
0%	21	15	8	0	-8	-17	-27

2.67%	33	30	27	22	17	12	5
5.33%	35	35	33	32	29	26	22
8.00%	36	36	35	35	34	32	30

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

(단위:백만원)

2,922

공시일	2024-08-29
기준일	2024-08-28

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	2024-08-29
기준일	2024-08-28

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	2024-08-29
기준일	2024-08-28

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	14,546	0	14,546	
누계	통화	선도	0	21,424	-21,424	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213E5W KRW/USD 30-08-24E	573
FXW213E6SC KRW/USD 30-09-24E	359
FXW213E7W KRW/USD 31-10-24E	220
FXW213E8V(KRW/USD 29-11-24E	562
IE00BD8RGM75	

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

776

공시일	2024-08-29
기준일	2024-08-28

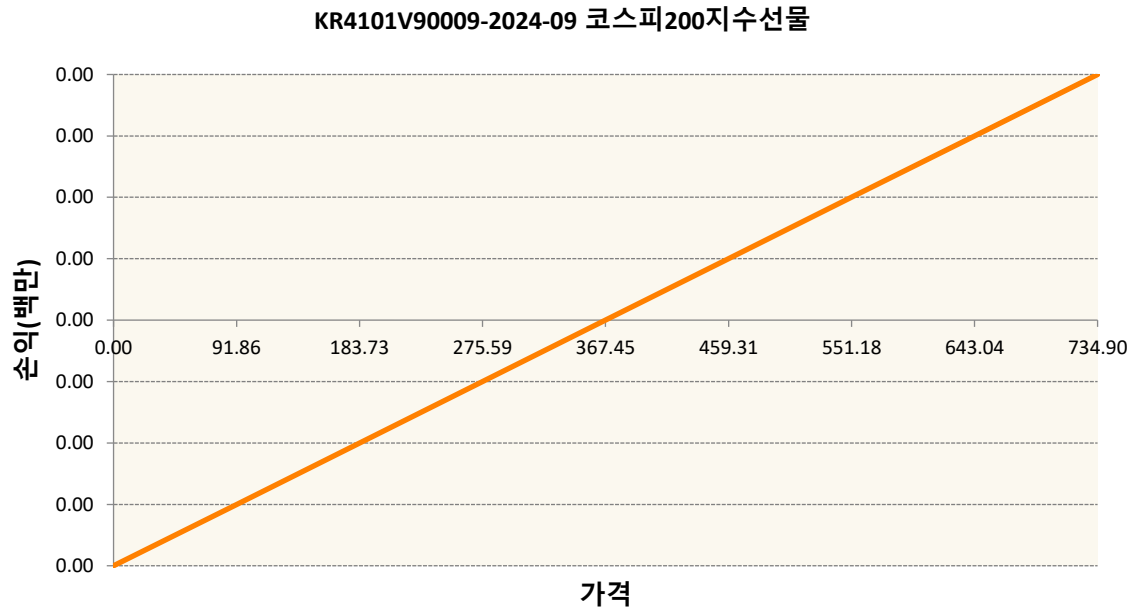
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

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	735	0	735	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	2024-08-29
기준일	2024-08-28

SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

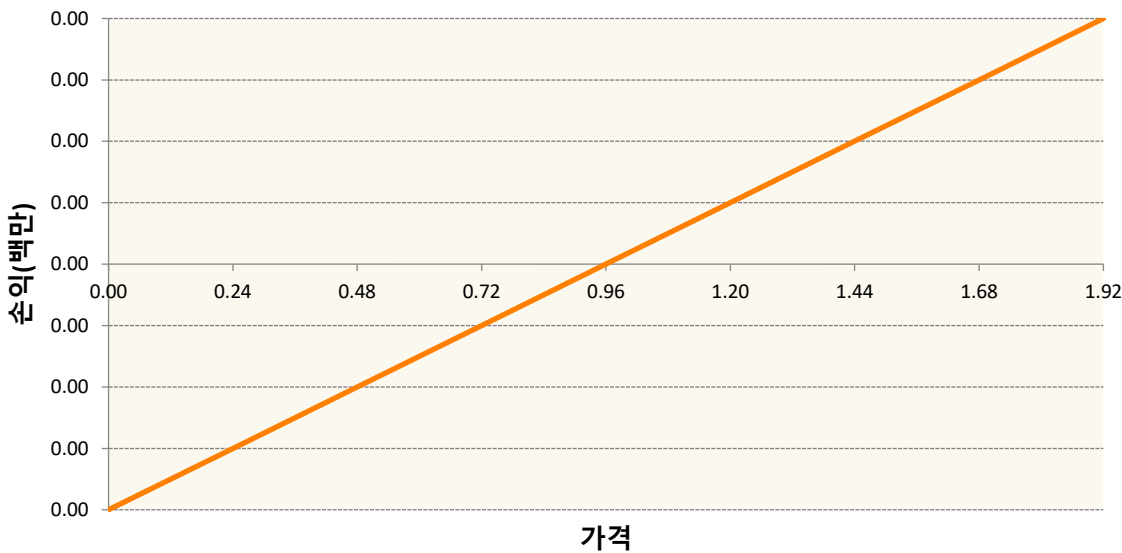
1. 계약금액

(단위:백만원)

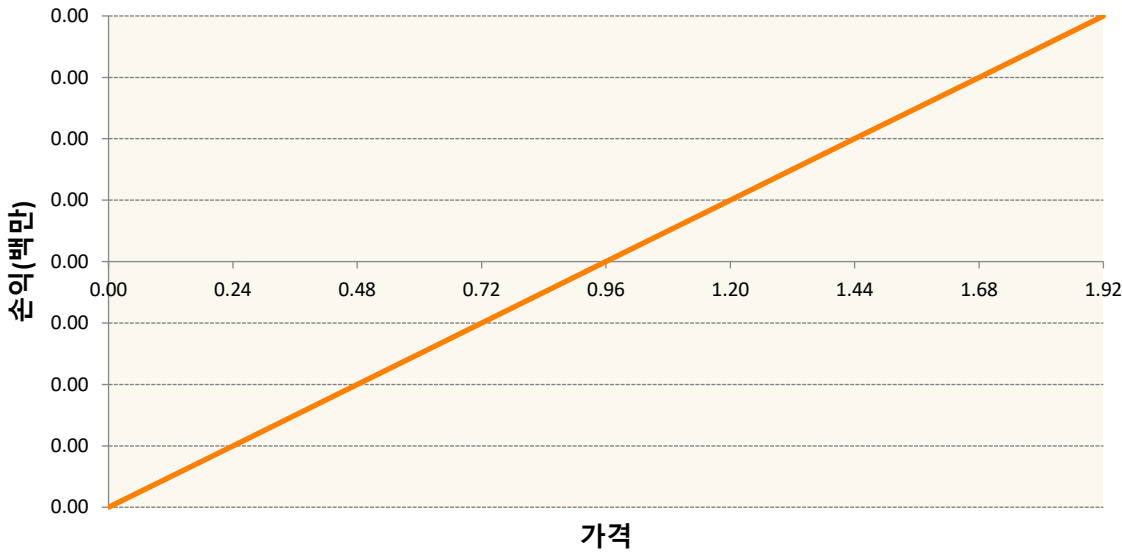
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	15,909	0	15,909	

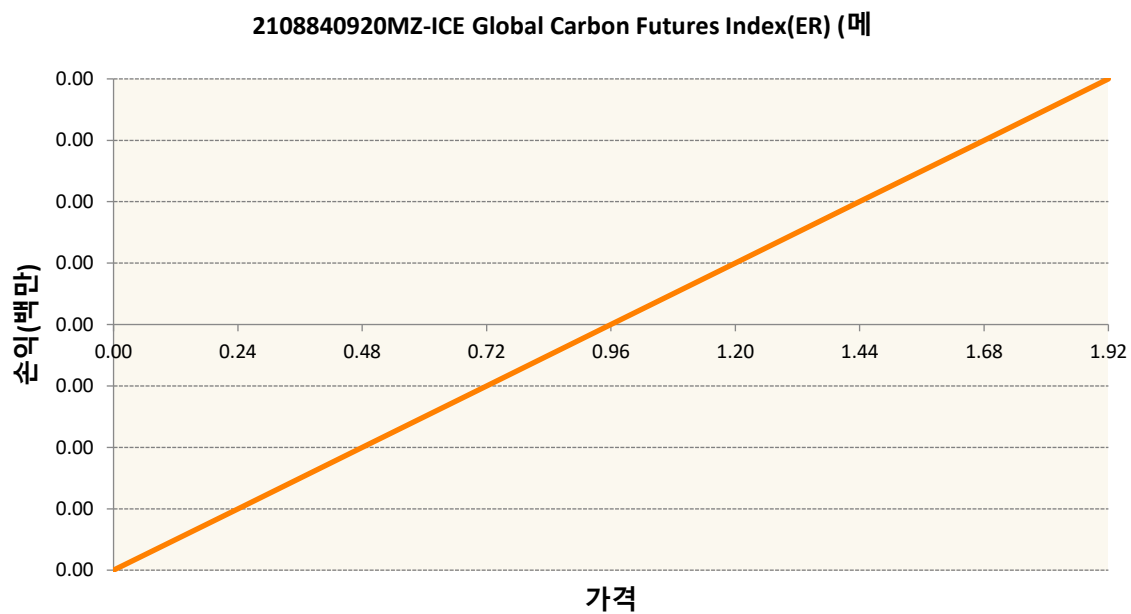
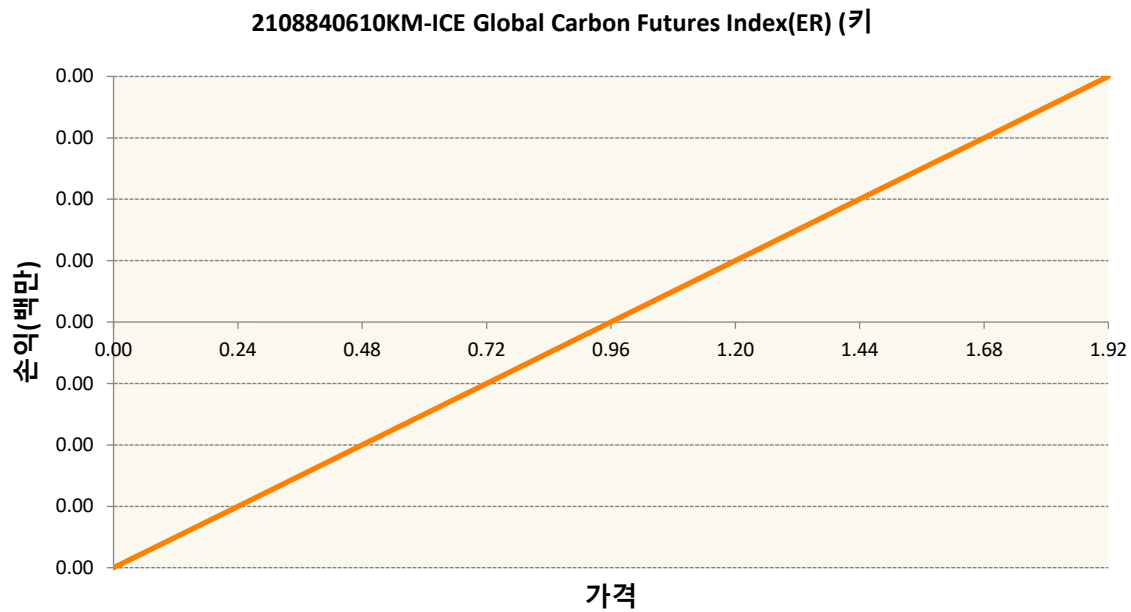
2. 만기시점의 손익구조

2108840321MR-ICE Global Carbon Futures Index(ER) (미



2108840503MR-ICE Global Carbon Futures Index(ER) (미





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108840321IICE Global Carbon Futures Index(ER) (미)		490
2108840503IICE Global Carbon Futures Index(ER) (미)		196
2108840610IICE Global Carbon Futures Index(ER) (키)		392
2108840920IICE Global Carbon Futures Index(ER) (메)		196

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,396

공시일	2024-08-29
기준일	2024-08-28

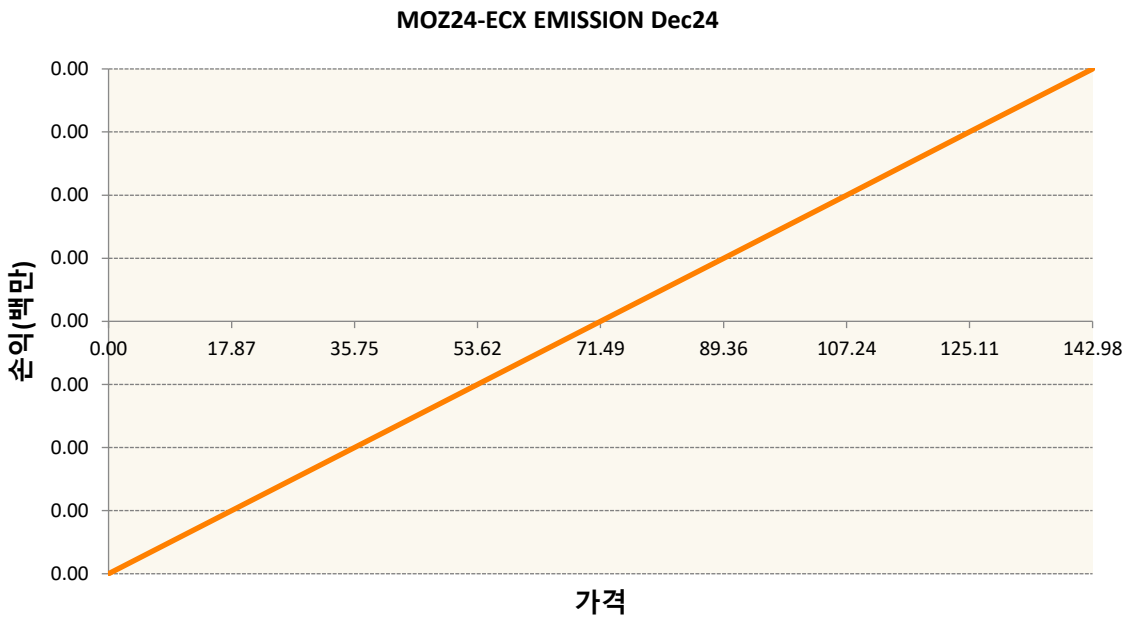
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	9,516	0	9,516	
누계	지수	스왑	373	0	373	장외
누계	통화	선도	0	3,335	-3,335	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213E7W KRW/EUR 30-08-24E	115
FXW213E8V(KRW/EUR 30-09-24E	37
FXW213E8V(KRW/EUR 30-09-24E	115
MOZ24 ECX EMISSION Dec24	761
SWICEUACN ICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX	1

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

(단위:백만원)

1,429

공시일	2024-08-29
기준일	2024-08-28

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)	20
SWCSI00000 신한CSI Index 240620 (메리츠)	20
SWCSI00000 신한CSI Index 240620 (NH)	13

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

(단위:백만원)

93

공시일	2024-08-29
기준일	2024-08-28

SOL차이나육성산업엑티브상장지

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)	18
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(NH)	15
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(메리츠)	22
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(키움)	4

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

(단위:백만원)

68

공시일	2024-08-29
기준일	2024-08-28

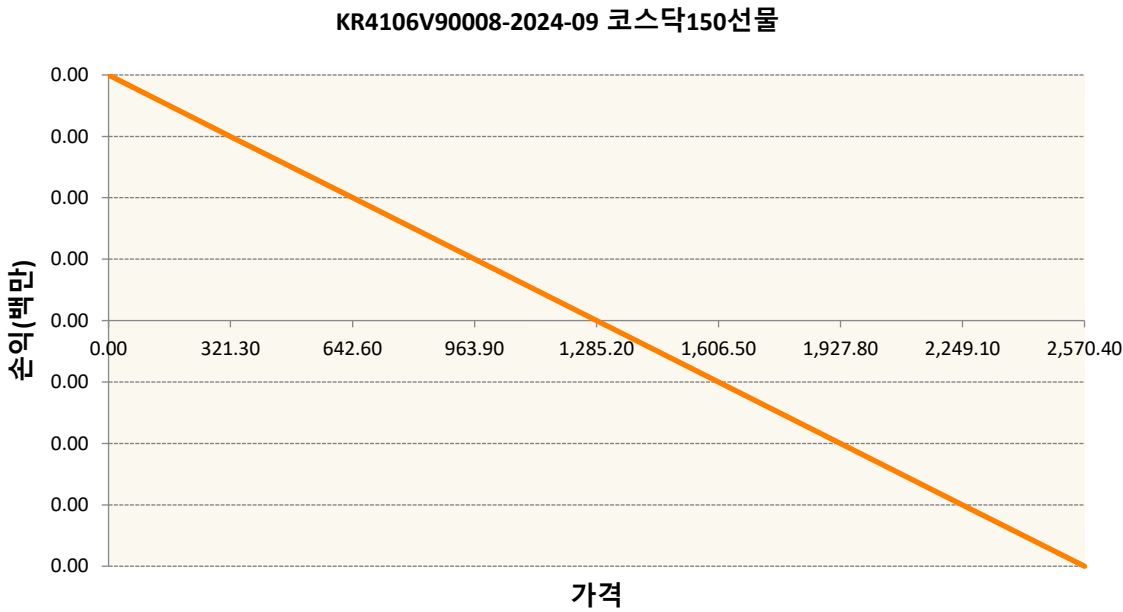
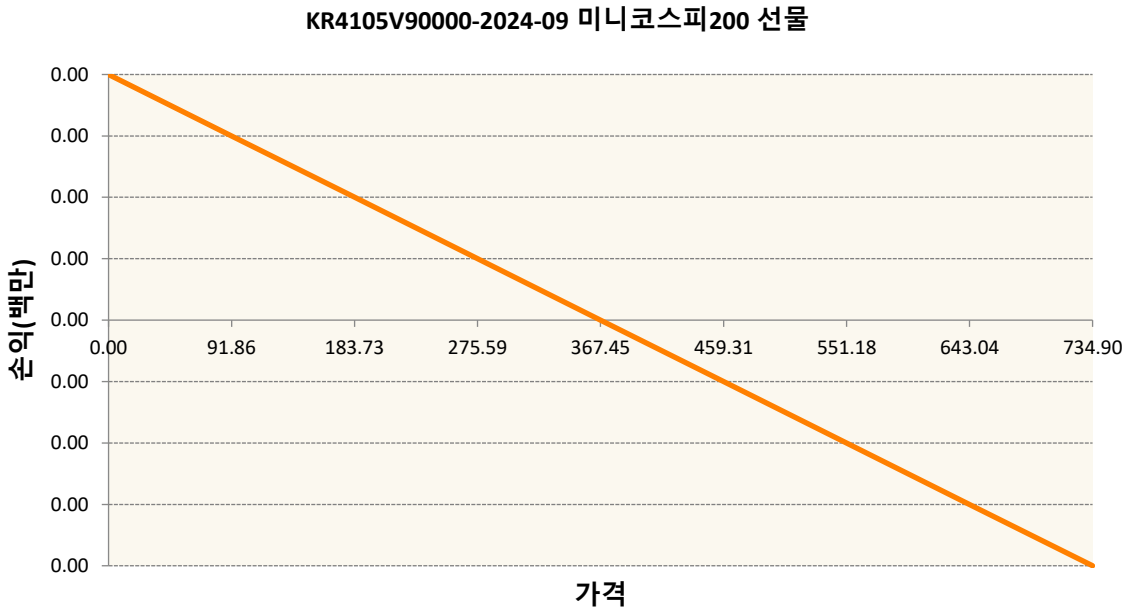
에퀴티알파일반사모혼합자산

1. 계약금액

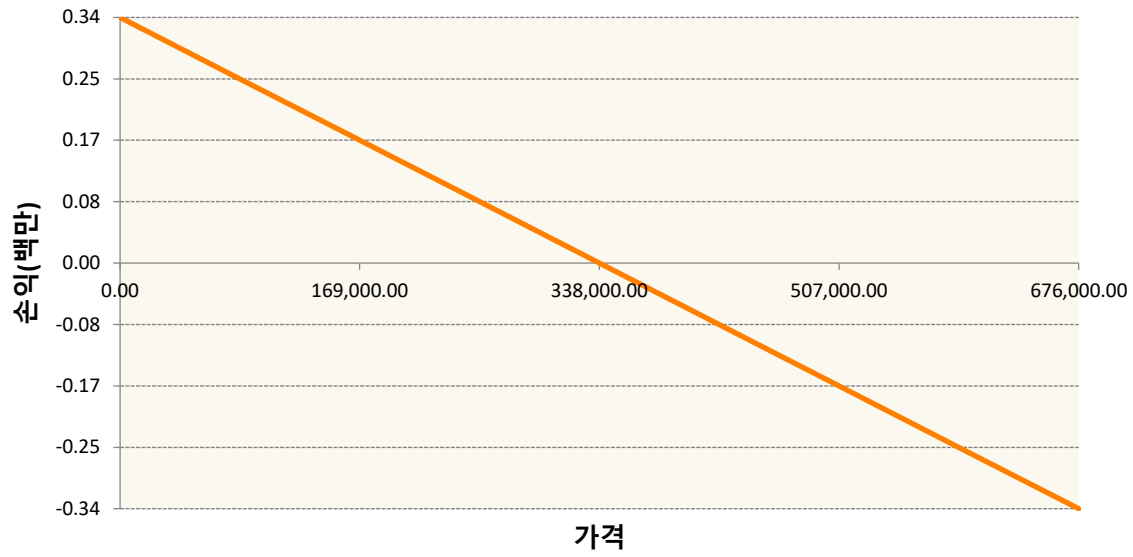
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	6	4	2	장내
누계	유가증권	선물	27	257	-230	장내

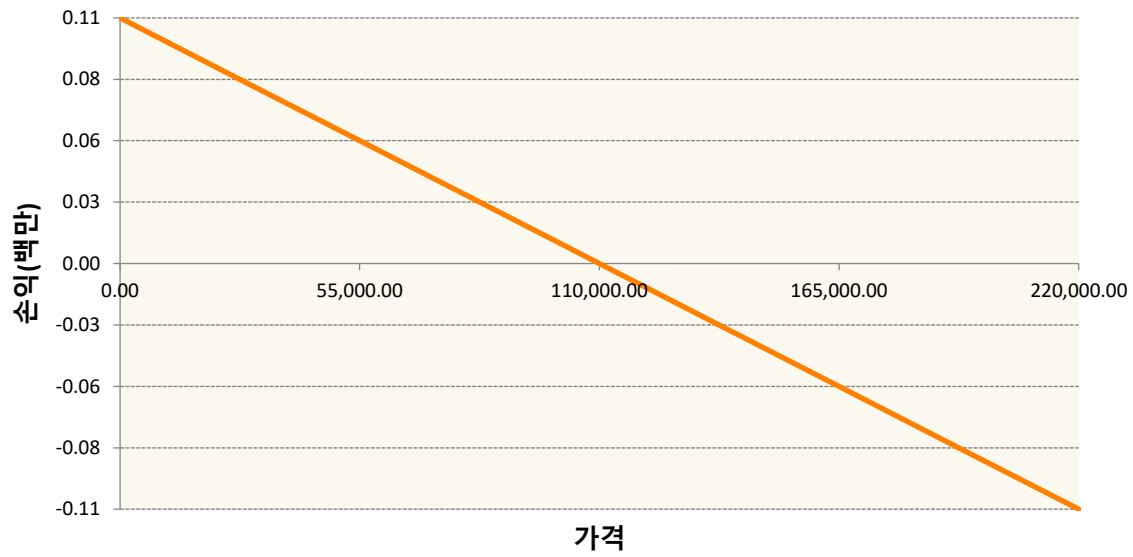
2. 만기시점의 손익구조



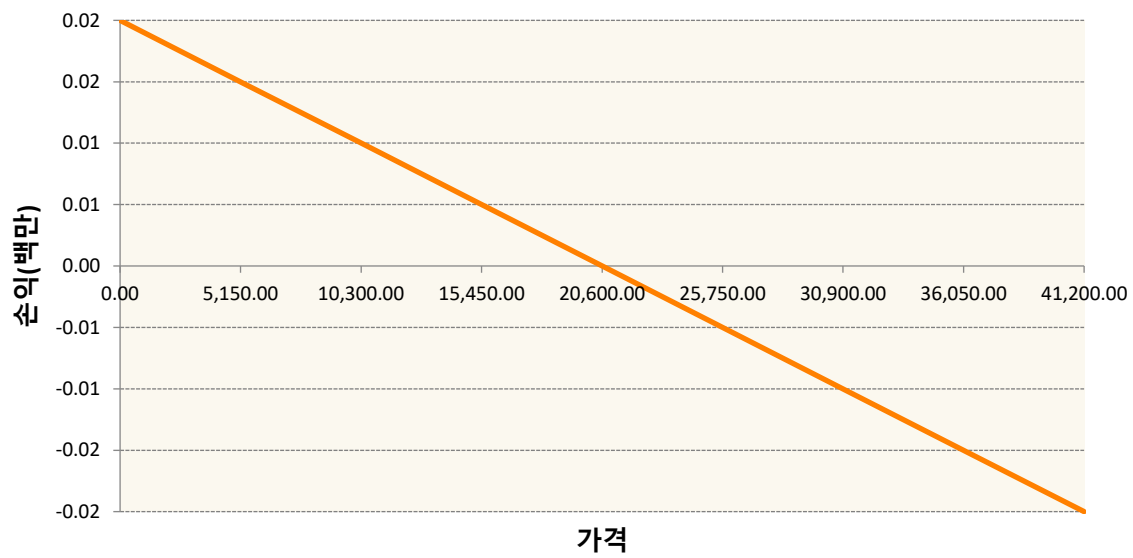
KR4113V90004-2024-09 POSCO홀딩스개별선물



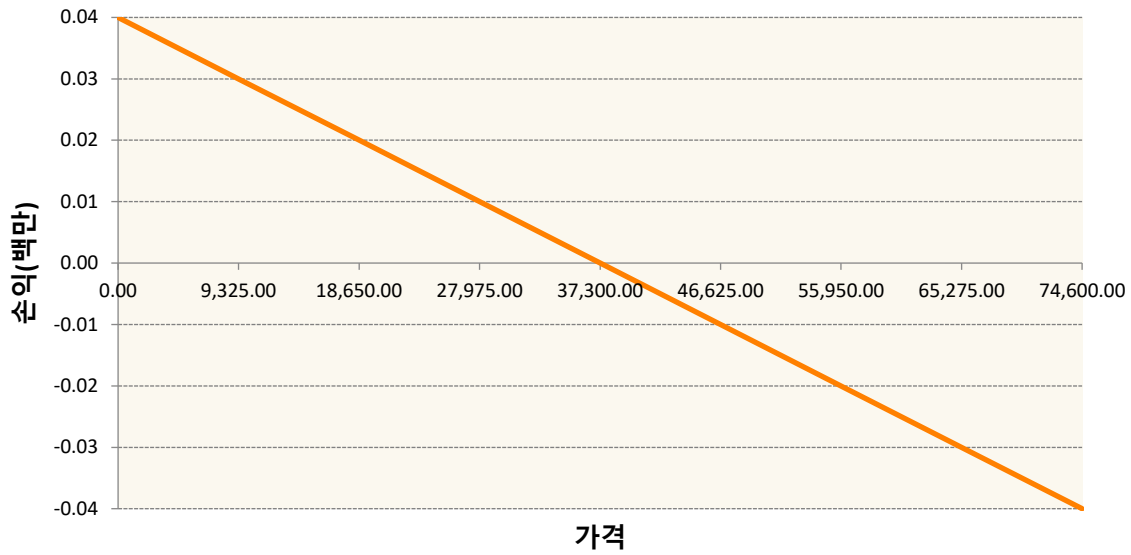
KR4136V90005-2024-09 KT&G개별선물



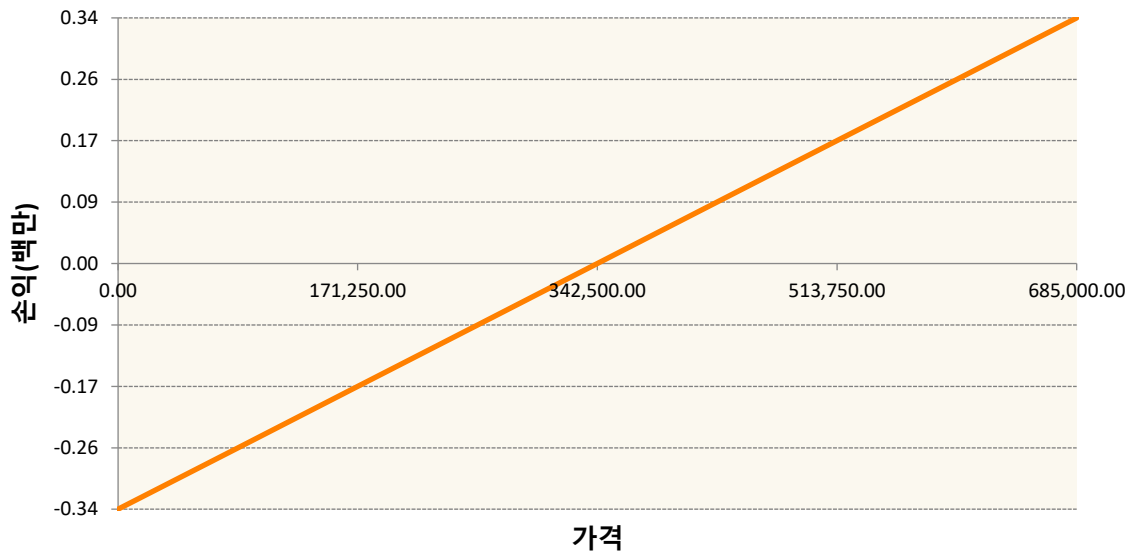
KR4151V90004-2024-09 GS건설개별선물



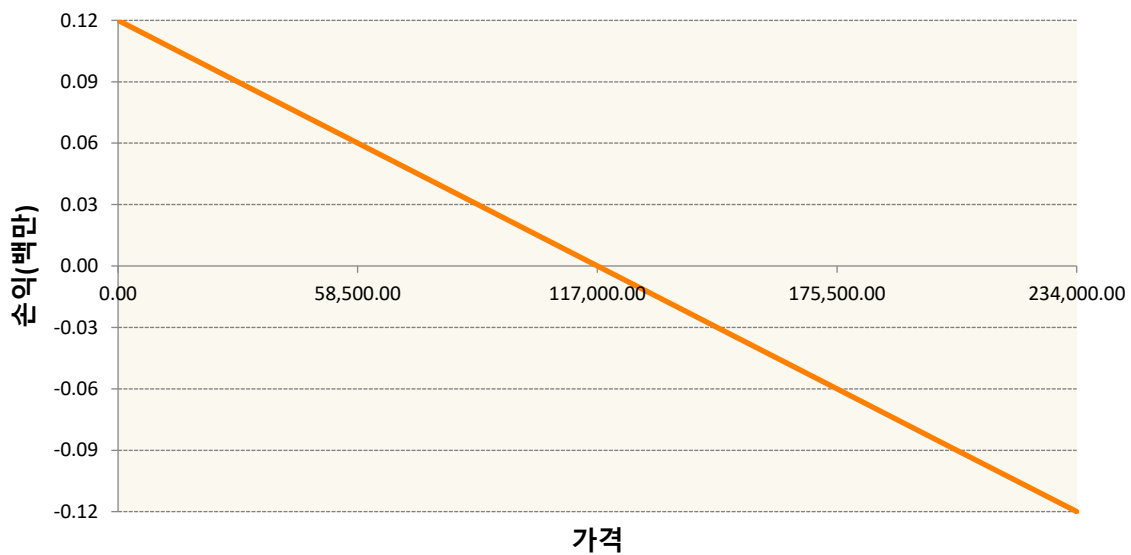
KR41CFV90004-2024-09 카카오개별선물



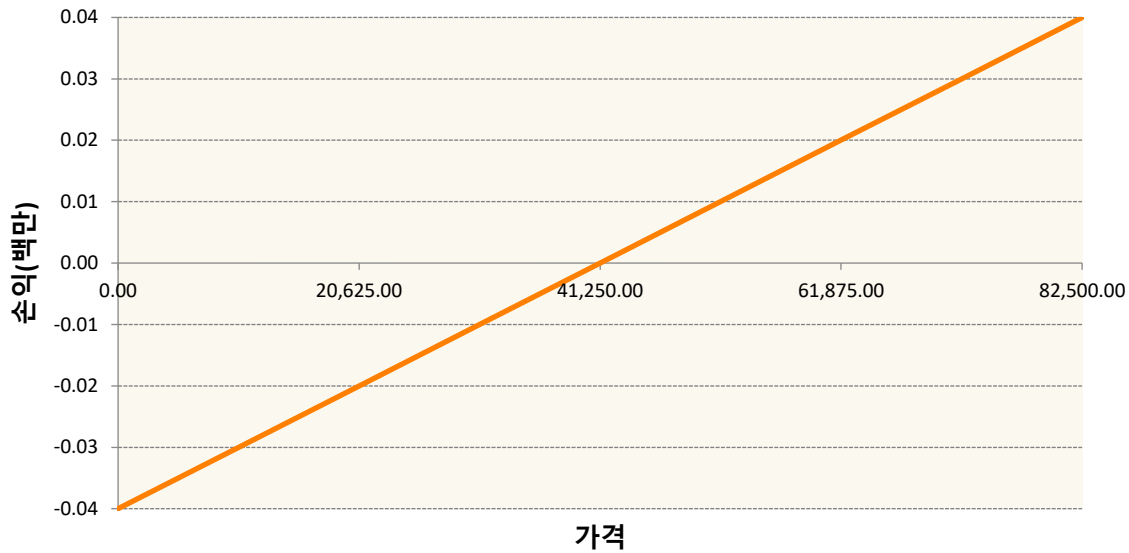
KR41CTV90005-2024-09 삼성화재개별선물



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	0.27
KR4136V900 2024-09 KT&G개별선물	1
KR4151V900 2024-09 GS건설개별선물	0.43
KR41CFV900 2024-09 카카오개별선물	1
KR41CTV900 2024-09 삼성화재개별선물	1
KR41D0V900 2024-09 DB손해보험개별선물	1
KR41GNV900 2024-09 금양개별선물	1

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

공시일	2024-08-29
기준일	2024-08-28

코리아인덱스(주식-파생형)(종)

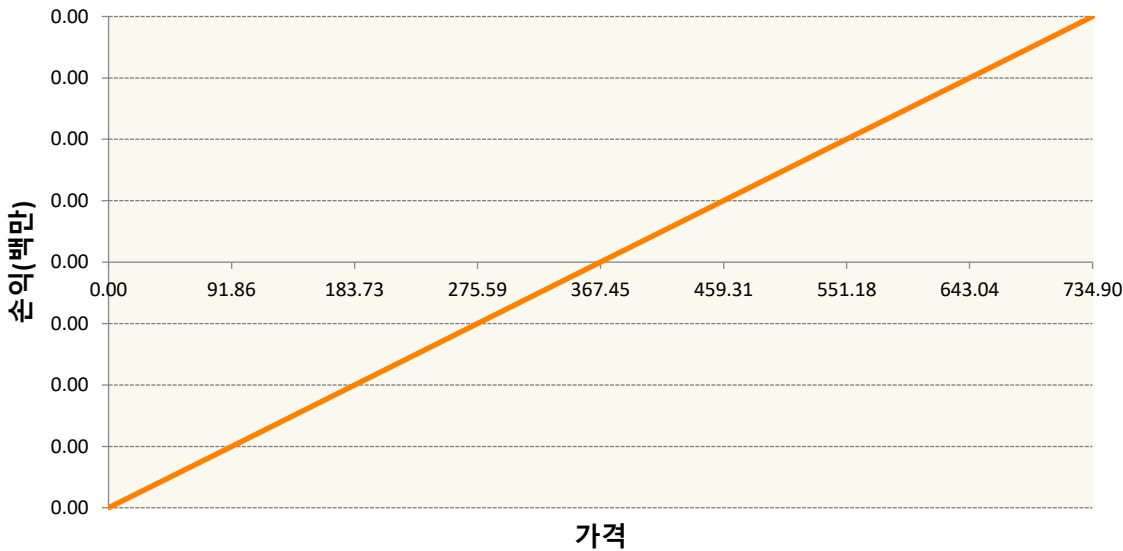
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	6,798	0	6,798	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101V90009-2024-09 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101V90009		2024-09 코스피200지수선물					541
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-541	-541	-541	-541	-541	-541	-541
-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%	541	541	541	541	541	541	541

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

(단위:백만원)

642

공시일	2024-08-29
기준일	2024-08-28

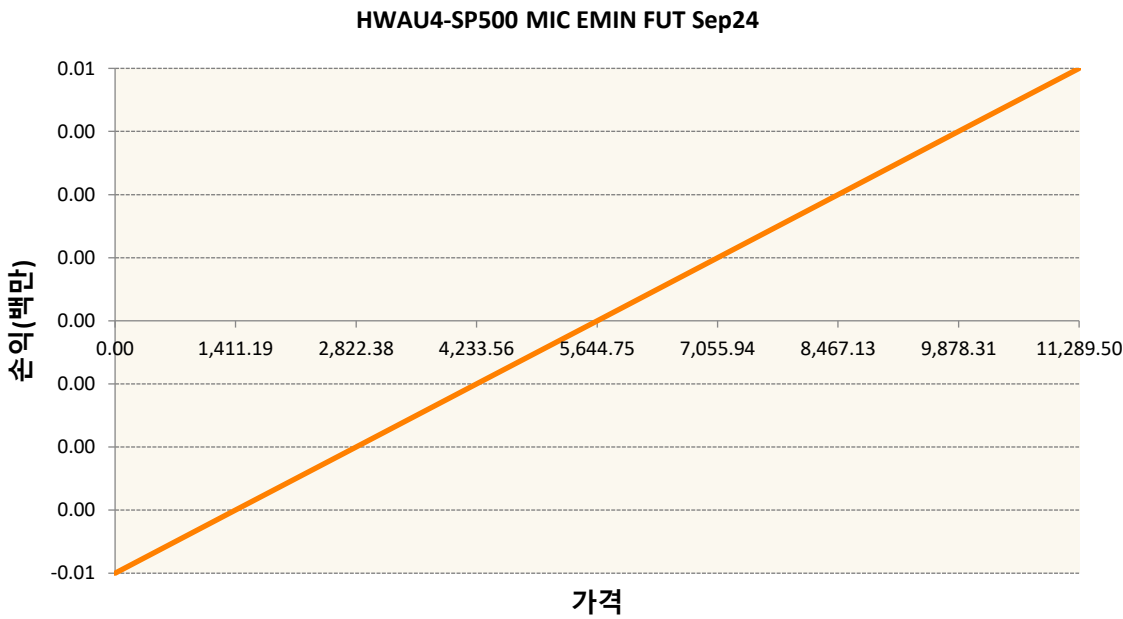
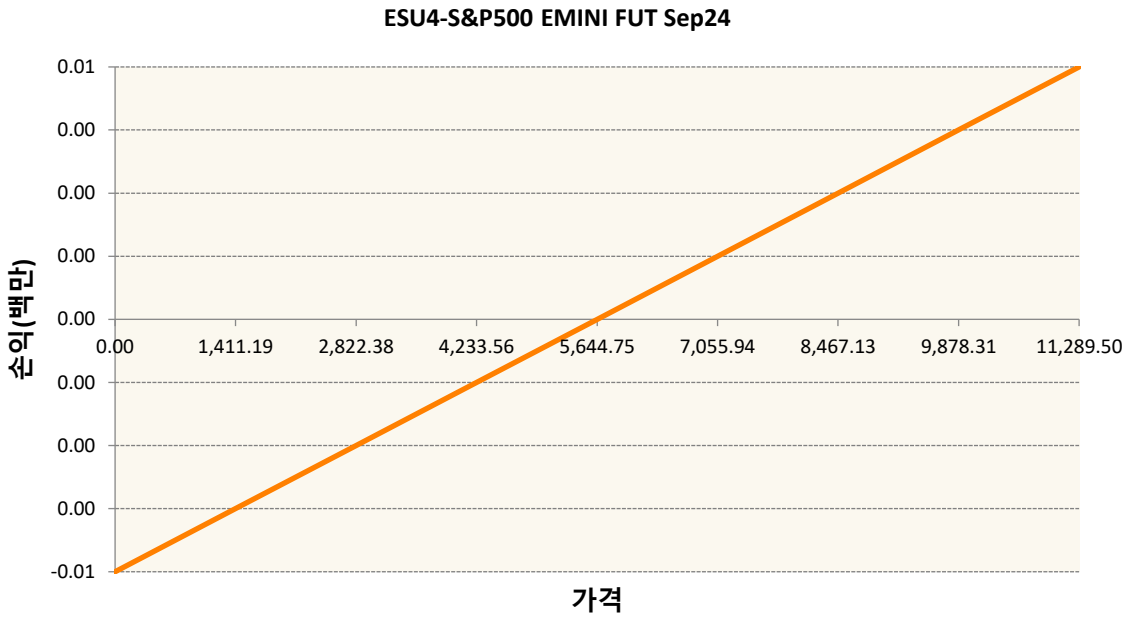
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

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	10,138	0	10,138	
누계	유가증권	선물	2,106	0	2,106	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESU4	S&P500 EMINI FUT Sep24	811
HWAU4	SP500 MIC EMIN FUT Sep24	168

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

공시일	2024-08-29
기준일	2024-08-28

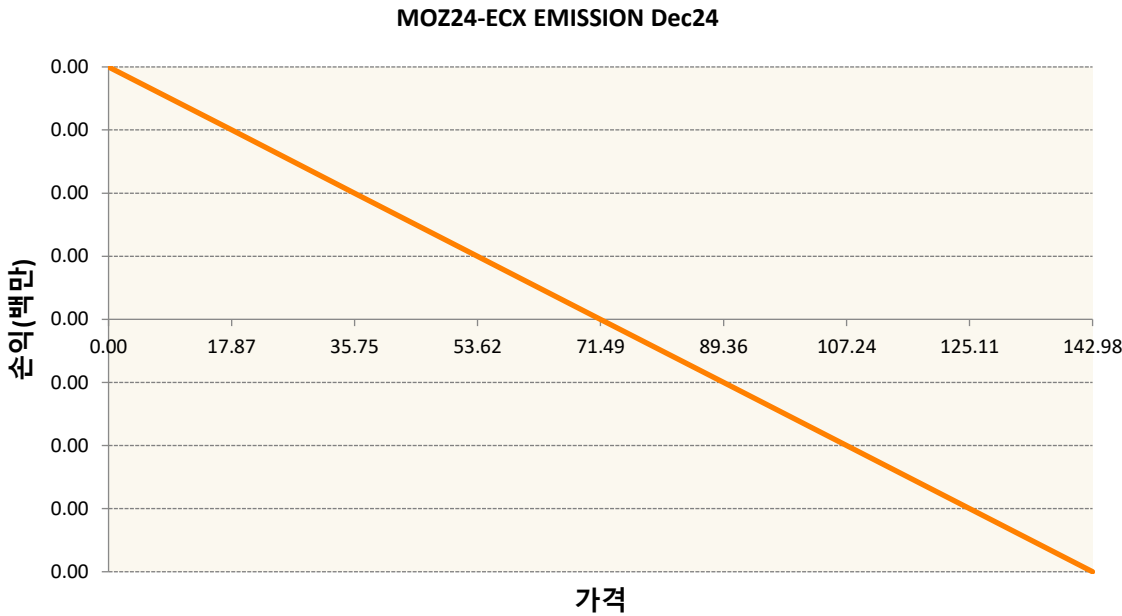
SOL유럽탄소배출권선물인버스ICE특별자산상

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	5,151	-5,151	
누계	지수	스왑	373	0	373	장외
누계	통화	선도	0	2,580	-2,580	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213E7W KRW/EUR 30-08-24E	118
FXW213E8V(KRW/EUR 30-09-24E	88
MOZ24 ECX EMISSION Dec24	412
SWICEUACN ICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX	1

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

(단위:백만원)

809

공시일	2024-08-29
기준일	2024-08-28

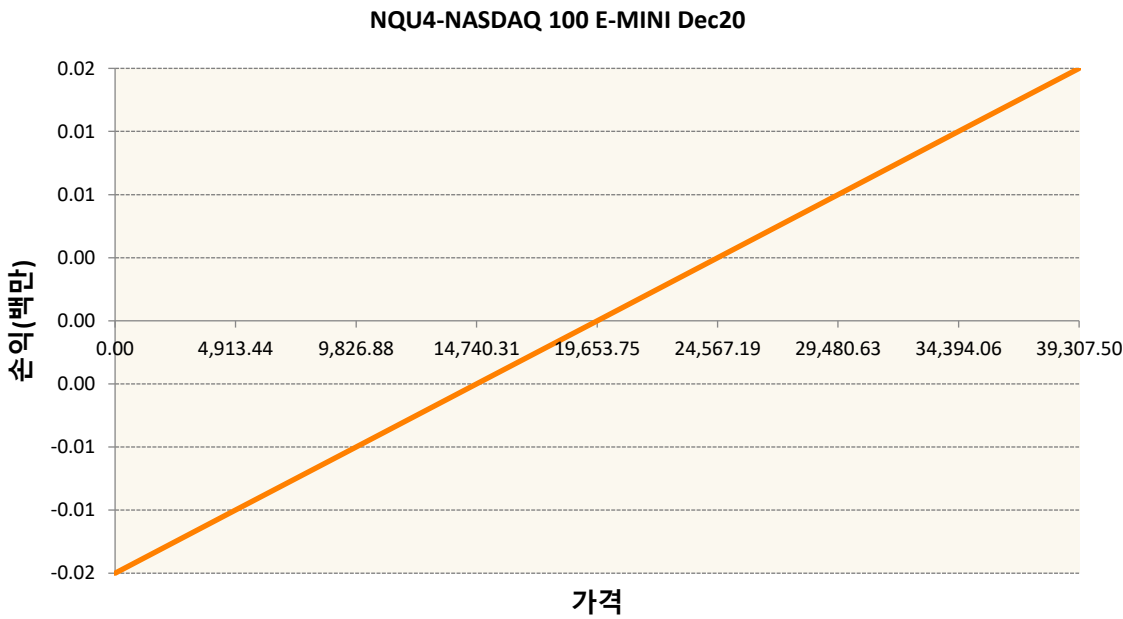
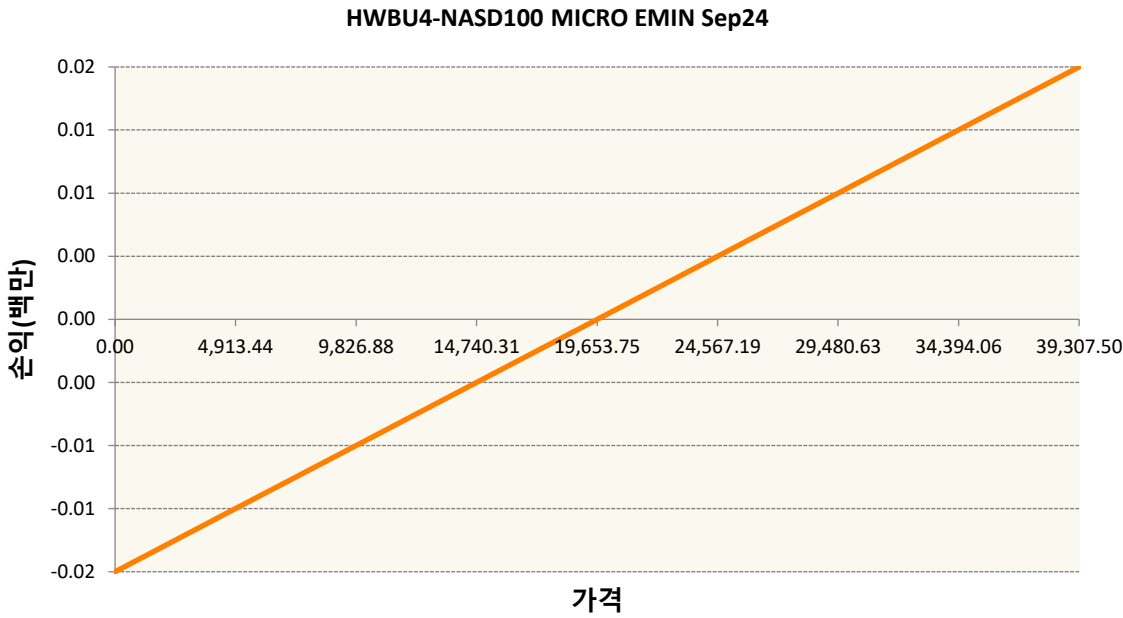
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

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	6,496	0	6,496	
누계	유가증권	선물	1,958	0	1,958	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
HWBU4	NASD100 MICRO EMIN Sep24		157
NQU4	NASDAQ 100 E-MINI Dec20		520

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)			(단위:백만원)
			535

공시일	2024-08-29
기준일	2024-08-28

SOL미국30년국채커버드콜(합성)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	79,032	0	79,032	장외
누계	지수	스왑	189,355	0	189,355	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWKEDI0000 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	717
SWKEDI0000 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	3,105
SWKEDI0000 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	242
SWKEDI0000 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	4,865
SWKEDI0000 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	6,353

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

(단위:백만원)

9,021

공시일	2024-08-29
기준일	2024-08-28

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	14
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	14
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	14
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	14

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

(단위:백만원)

61

공시일	2024-08-29
기준일	2024-08-28

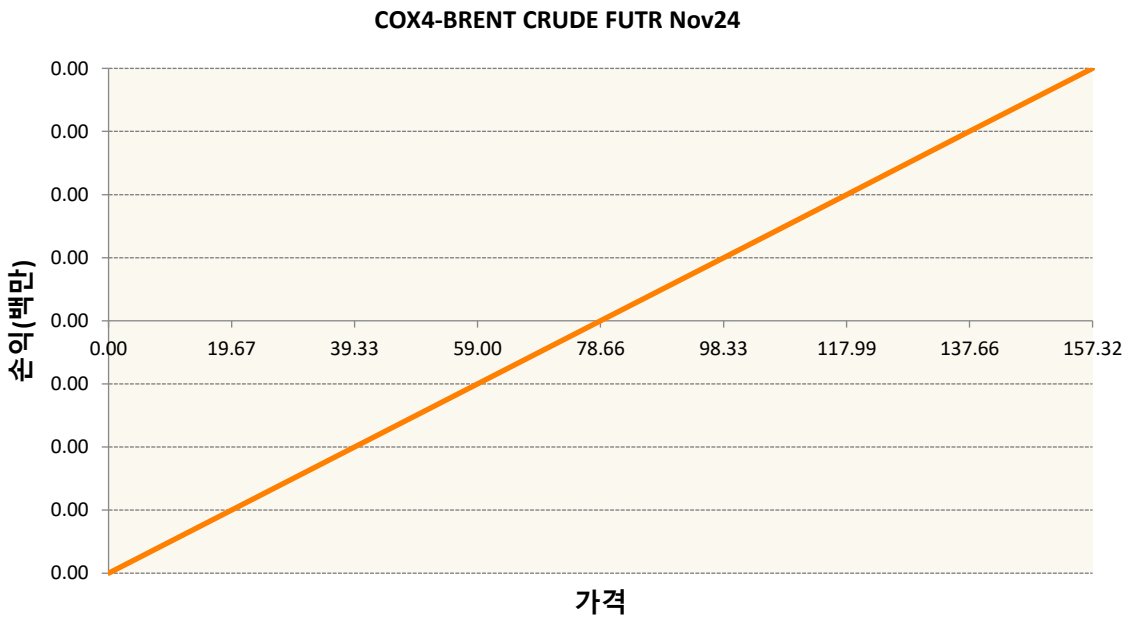
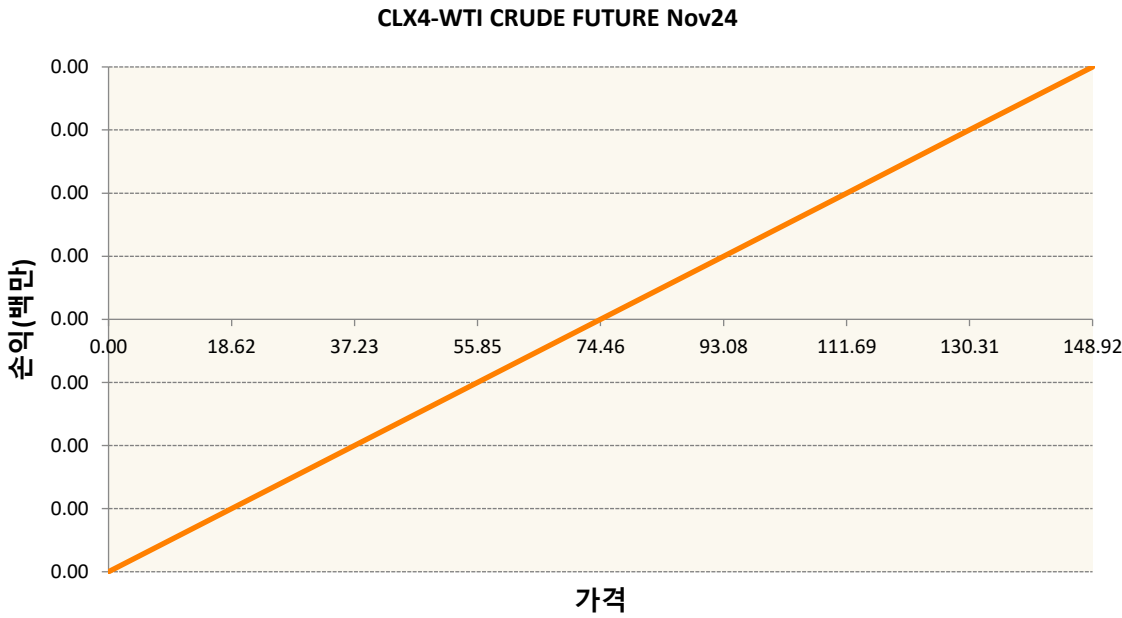
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

1. 계약금액

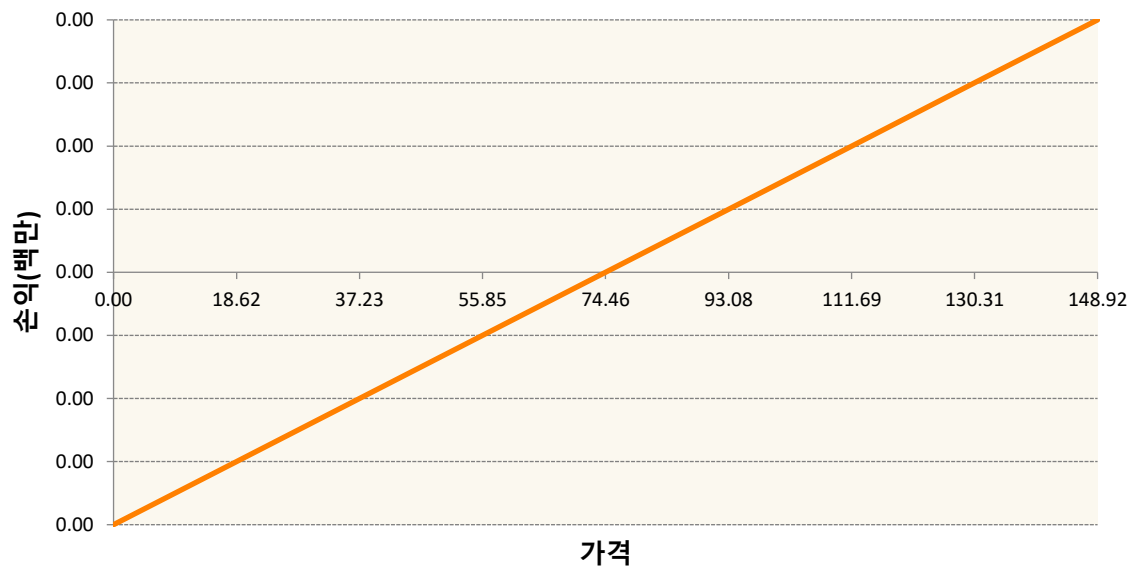
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	13	0	13	장내
누계	유가증권	선물	862	0	862	
누계	통화	선물	0	120	-120	장내

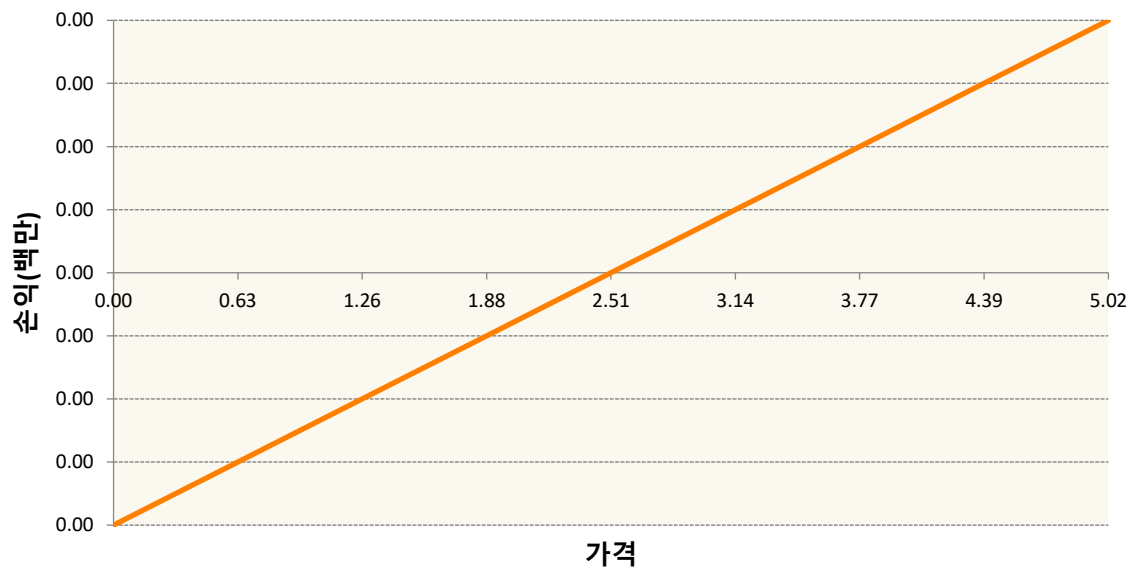
2. 만기시점의 손익구조



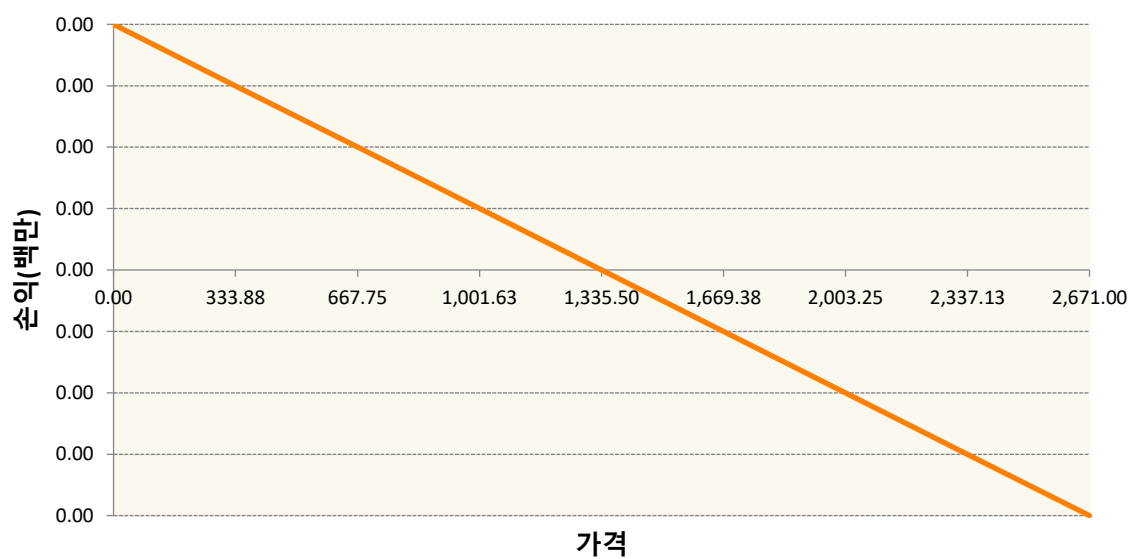
ECX4-E-mini Crude Oil Nov24



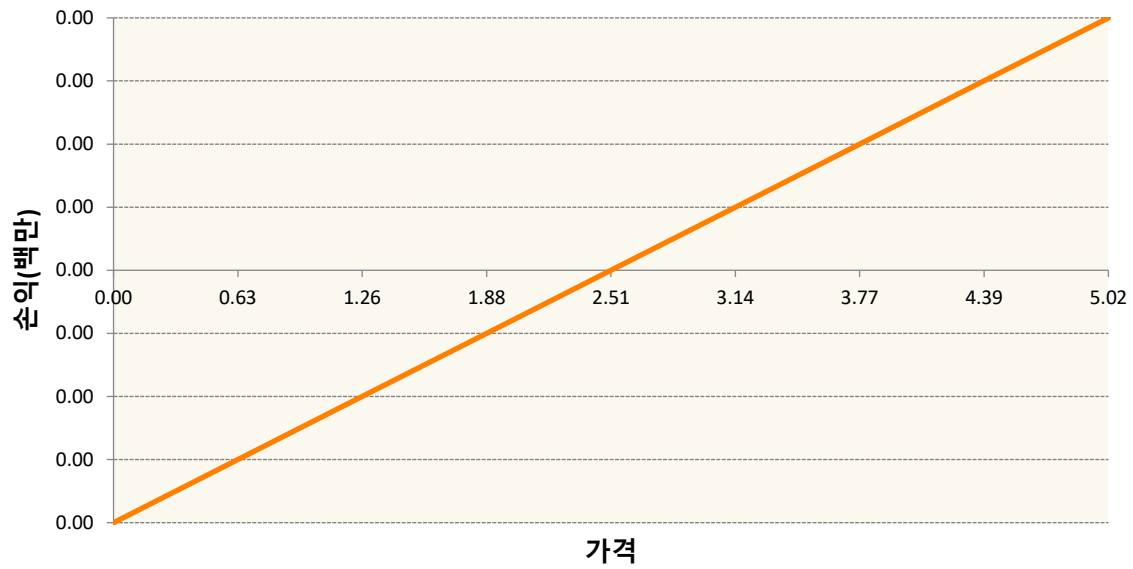
EOX4-E-MINI NATURAL GA Nov24



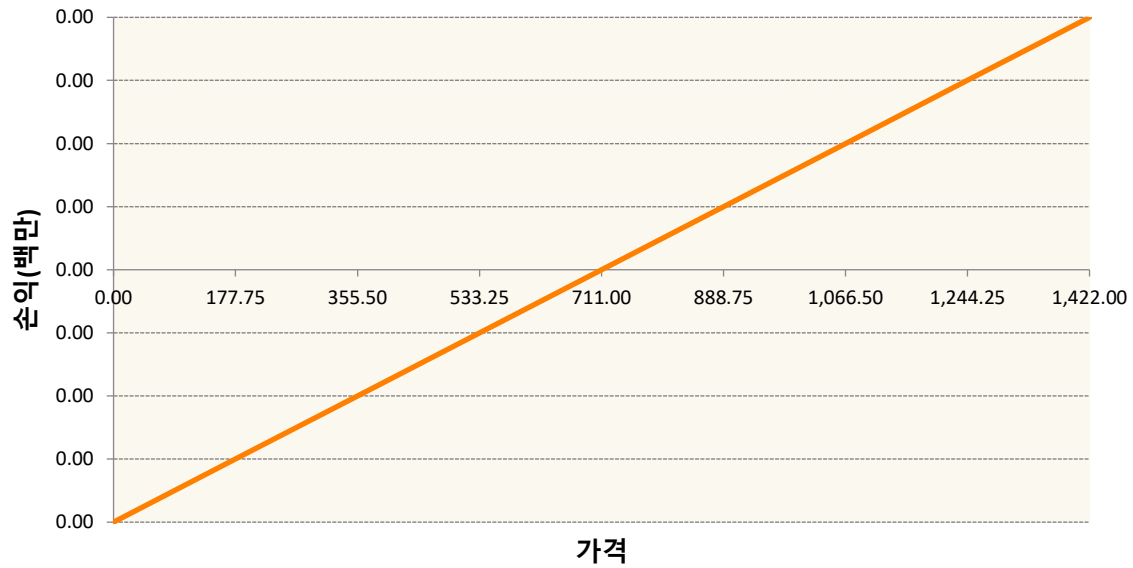
KR4175V90003-2024-09 달러선물



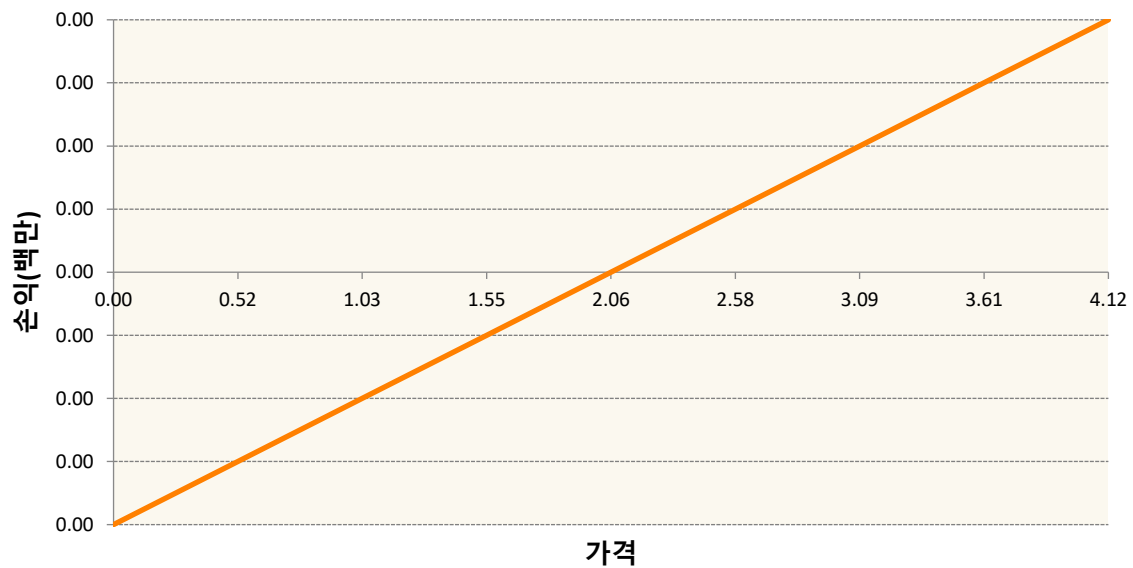
NGX24-NATURAL GAS FUTR Nov24



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		17
ECX4	E-mini Crude Oil Nov24		8
EOX4	E-MINI NATURAL GA Nov24		4
KR4175V900 2024-09 달러선물			10
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)
	143