

공시일 2024-09-03

기준일 2024-09-02

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	2024-09-03
기준일	2024-09-02

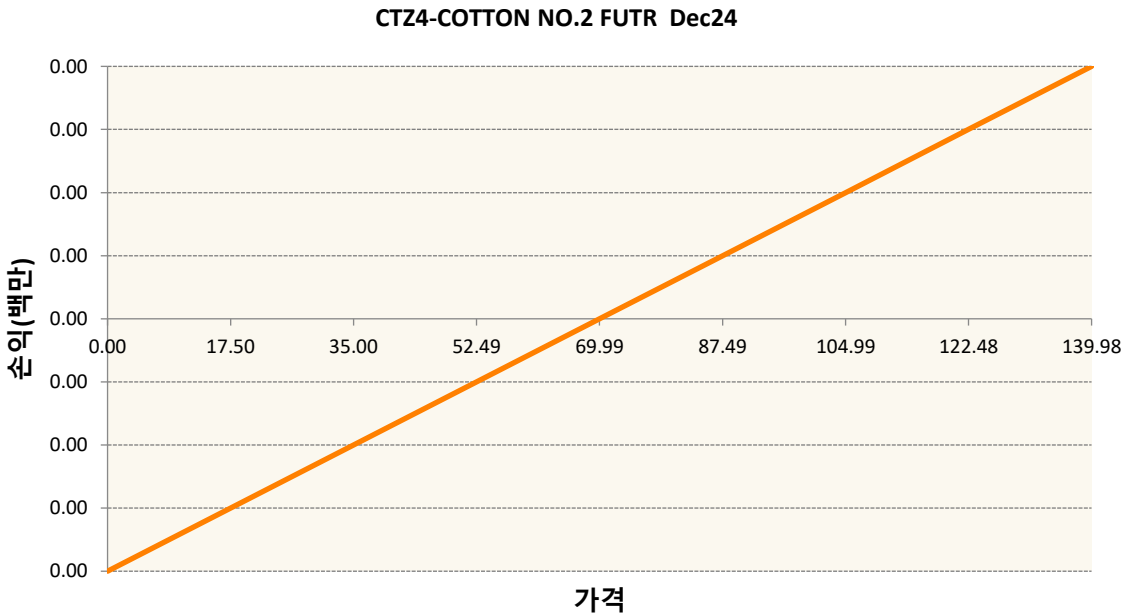
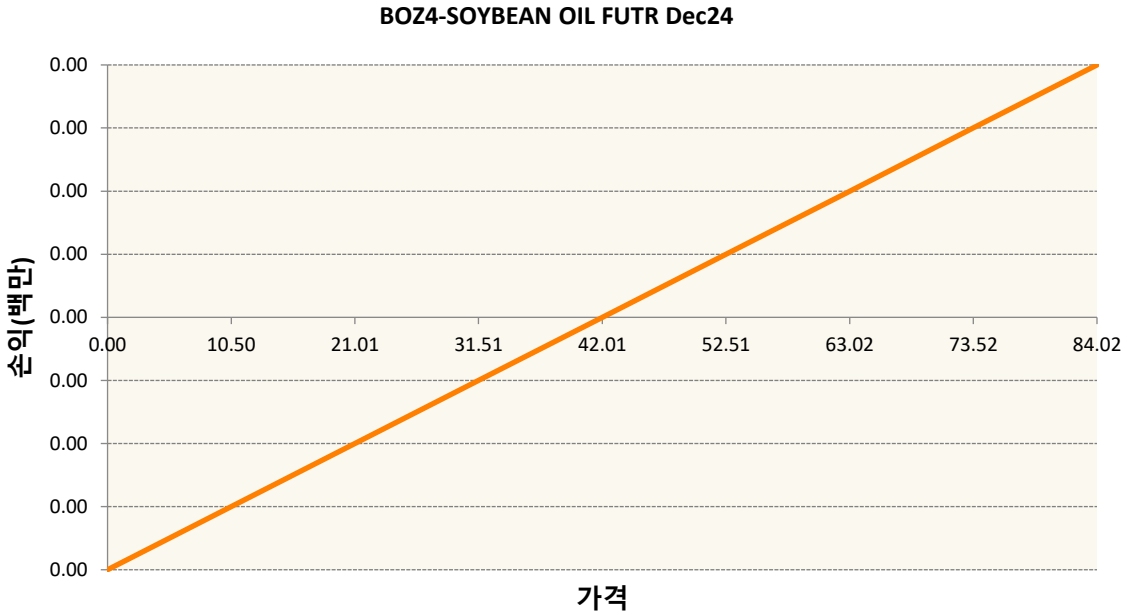
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

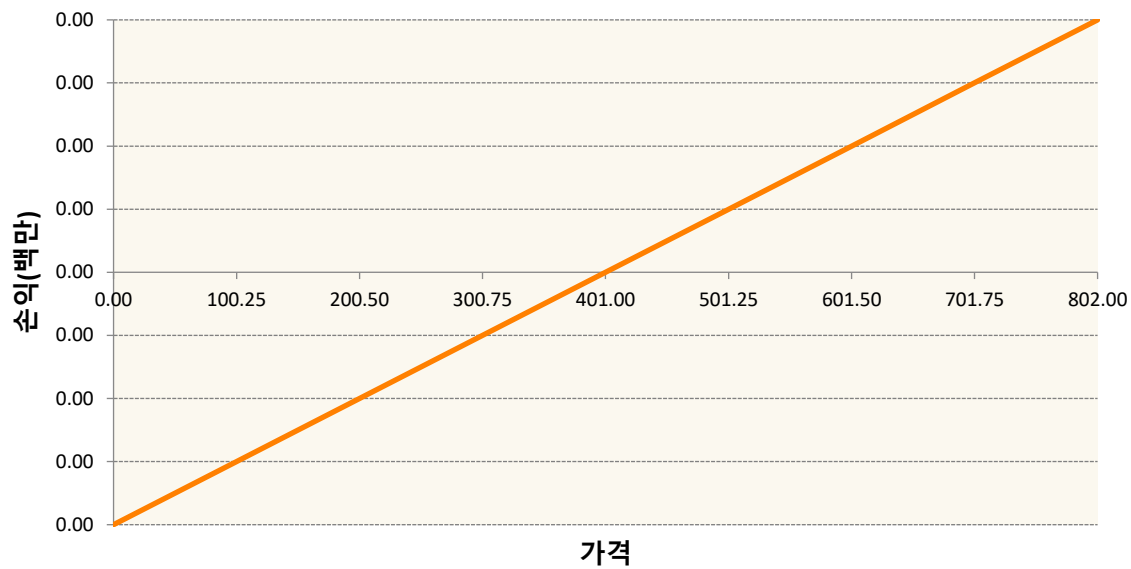
(단위:USD 백만)

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	3,914	0	3,914	
누계	통화	선물	0	468	-468	장내

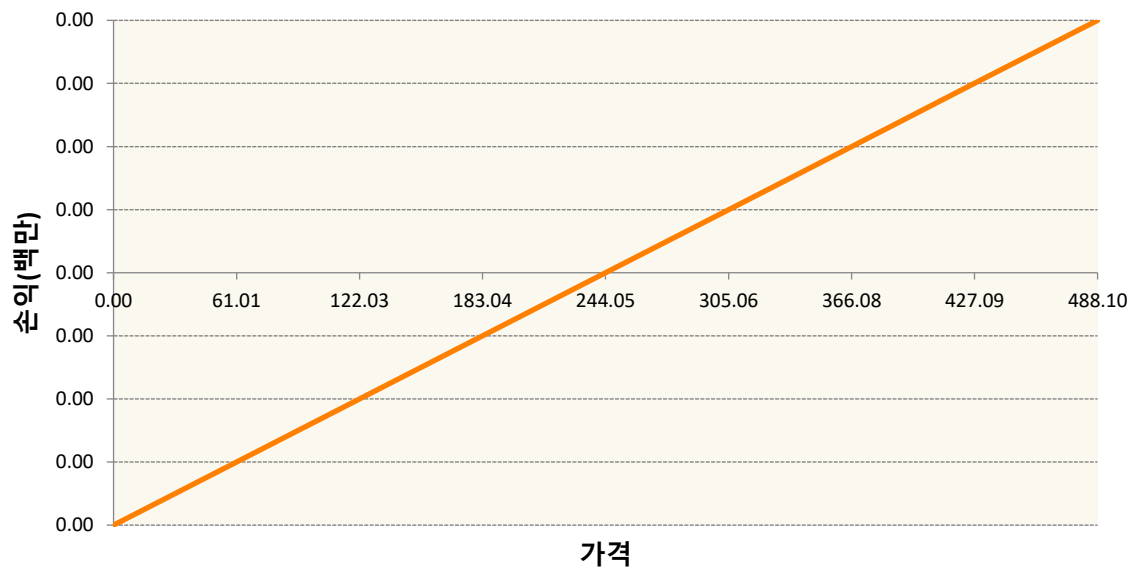
2. 만기시점의 손익구조



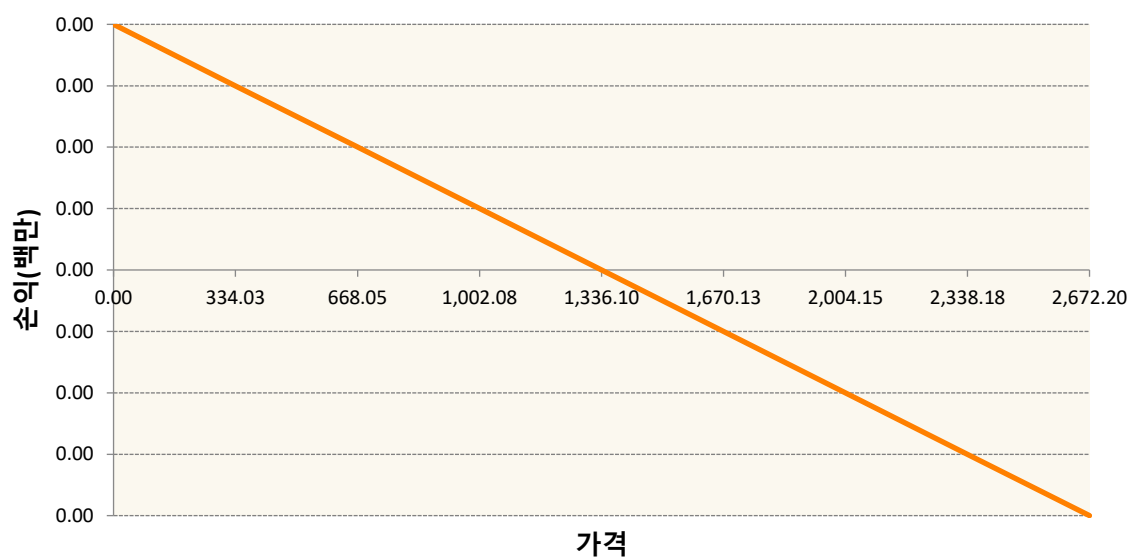
CZ4-CORN FUTURE Dec24



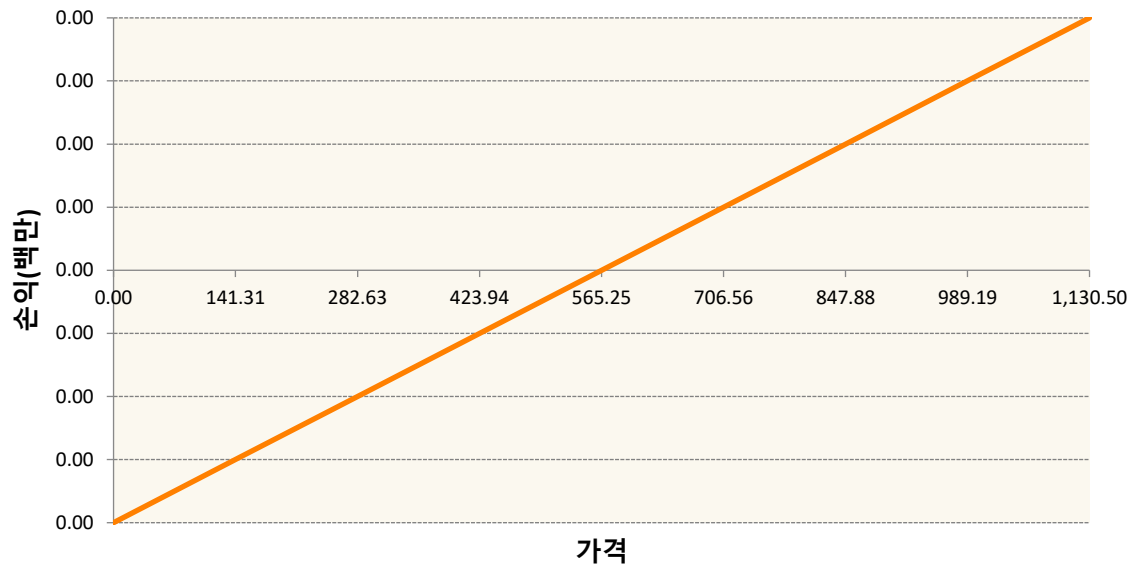
KCZ4-COFFEE 'C' FUTURE Dec24



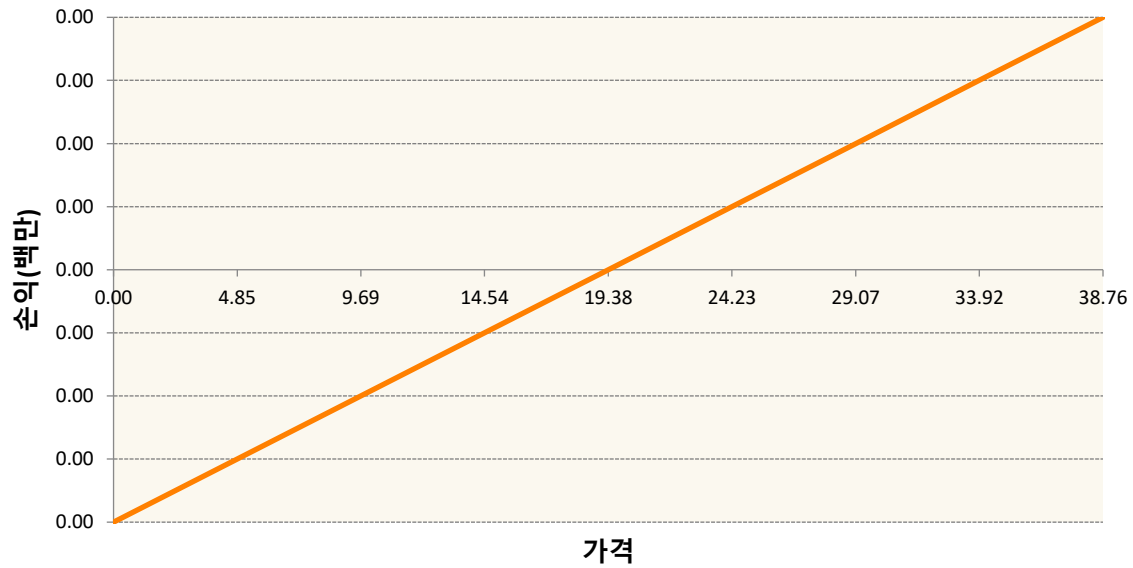
KR4175V90003-2024-09 달러선물



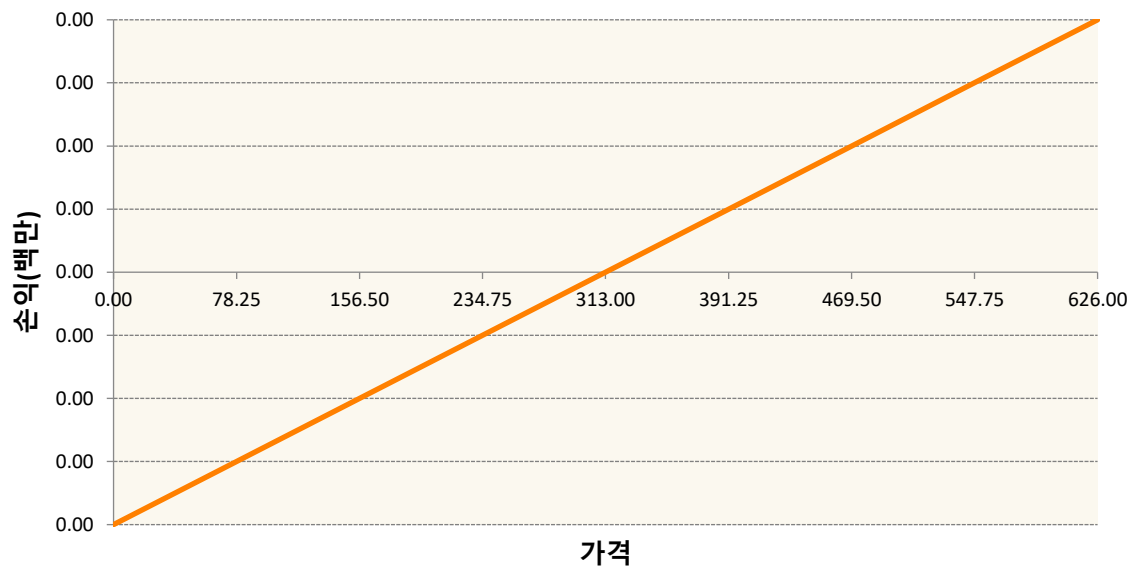
KWZ4-KC HRW WHEAT FUT Dec24

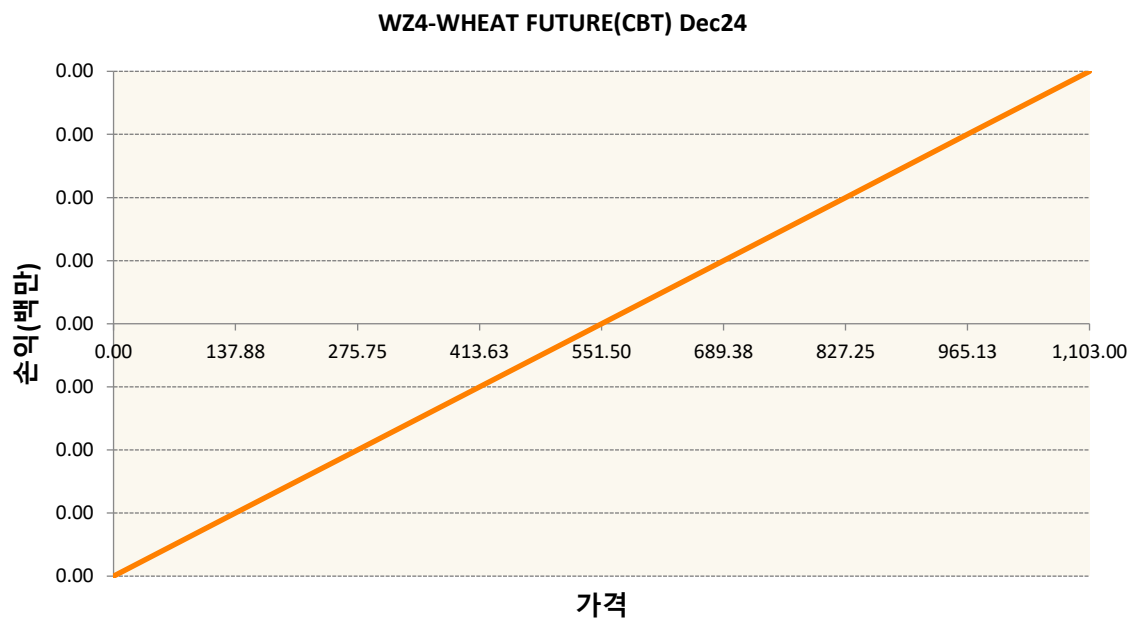
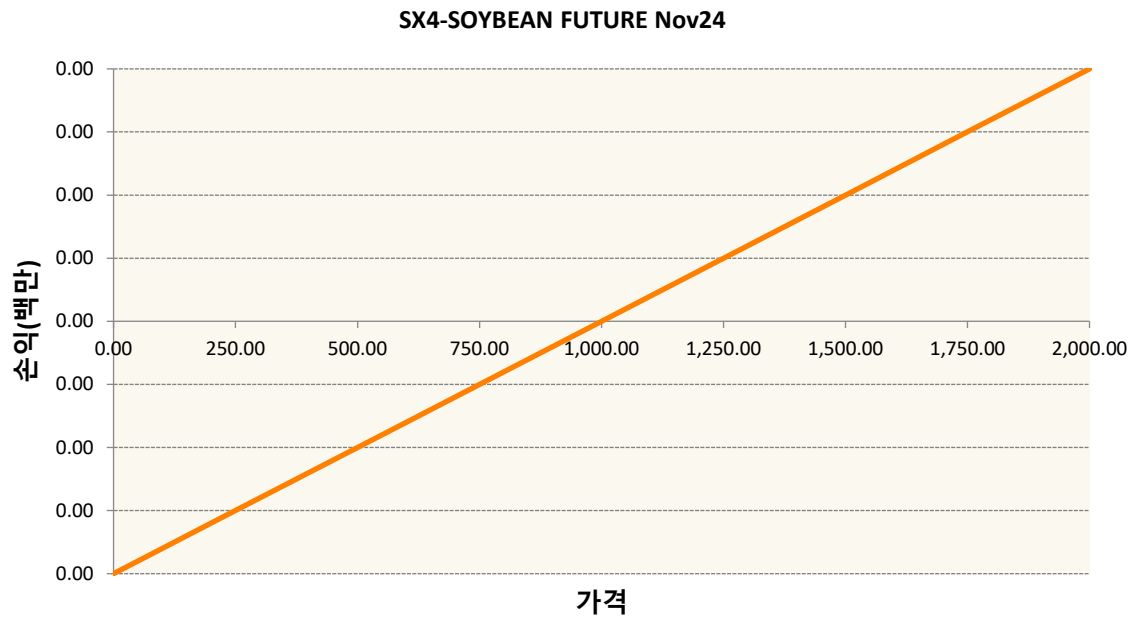


SBV4-Sugar #11 (WORLD) Oct24



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	2024-09-03
기준일	2024-09-02

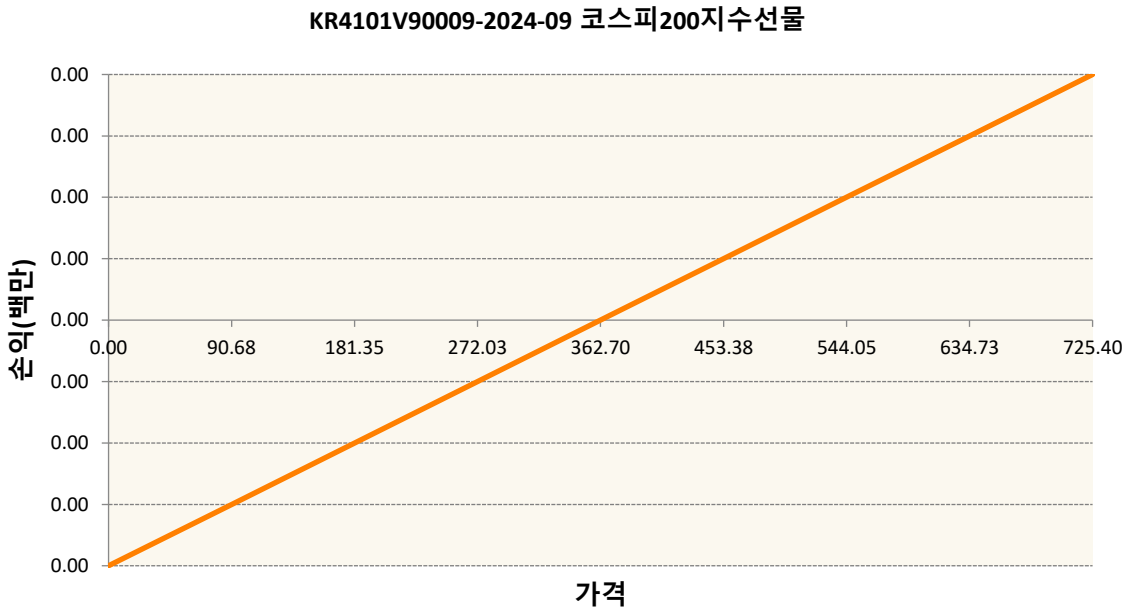
스마트인덱스모

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	1,995	0	1,995	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101V90009		2024-09 코스피200지수선물					159
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-159	-159	-159	-159	-159	-159	-159
-5.33%	-106	-106	-106	-106	-106	-106	-106
-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%	106	106	106	106	106	106	106
8.00%	159	159	159	159	159	159	159

공시일	2024-09-03
기준일	2024-09-02

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	240
-----------------------------	-----

* 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	2024-09-03
기준일	2024-09-02

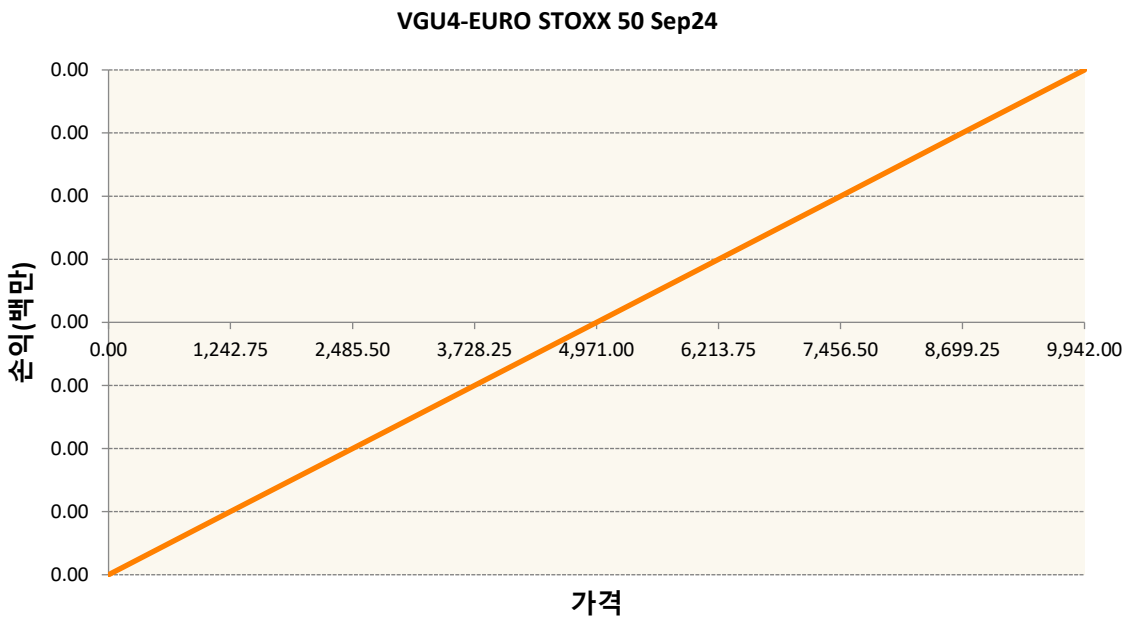
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	958	0	958	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGU4 EURO STOXX 50 Sep24

77

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

(단위:백만원)

49

공시일	2024-09-03
기준일	2024-09-02

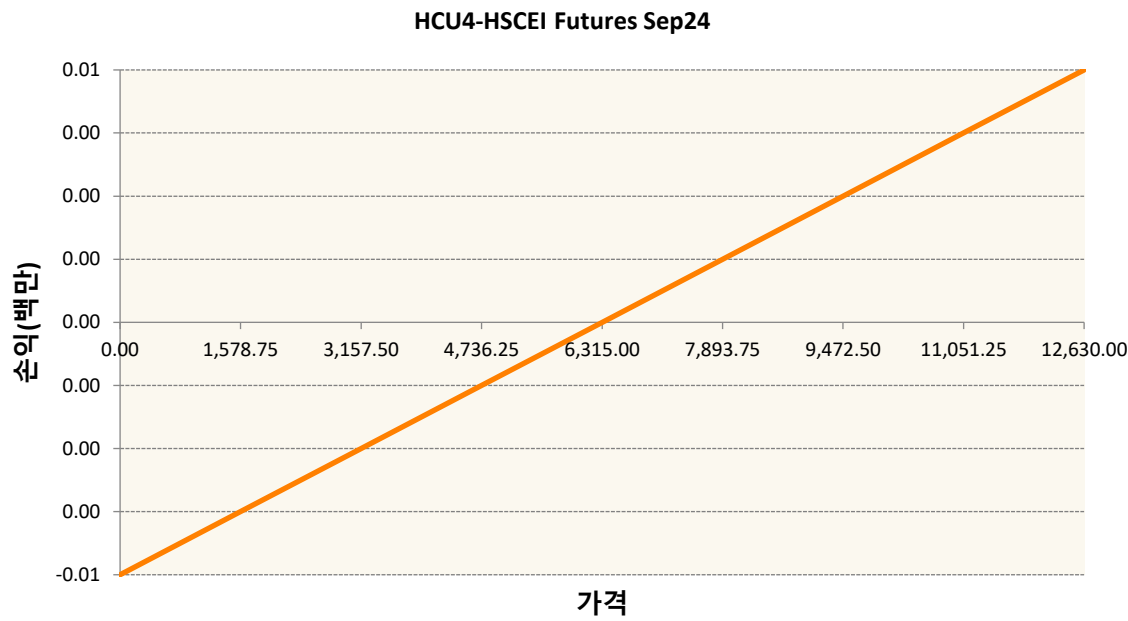
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,566	0	1,566	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCU4	HSCEI Futures Sep24	125
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

150

공시일	2024-09-03
기준일	2024-09-02

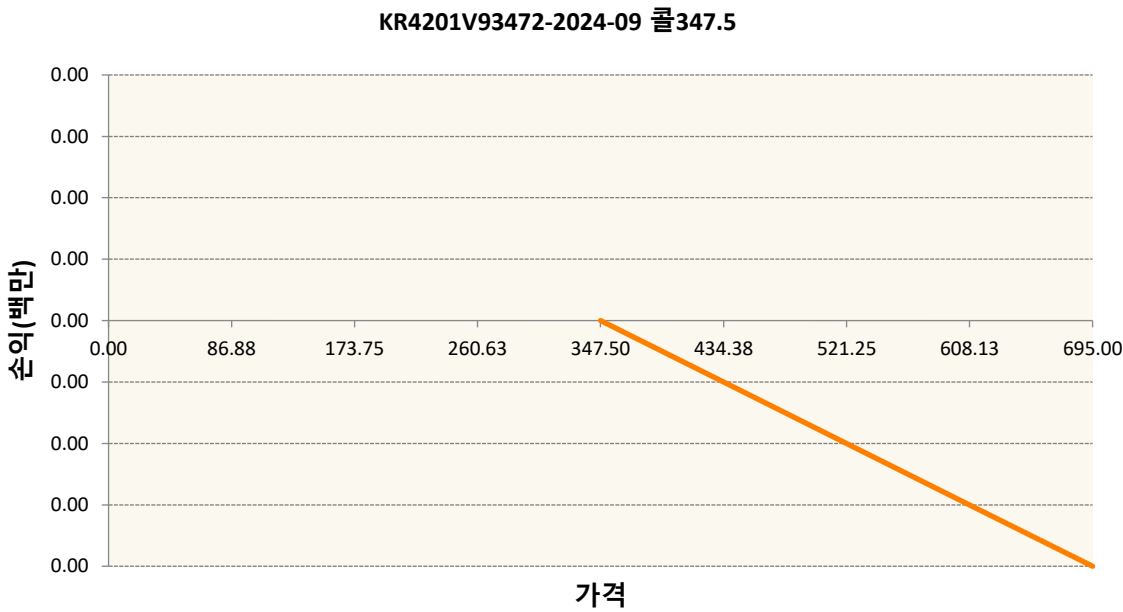
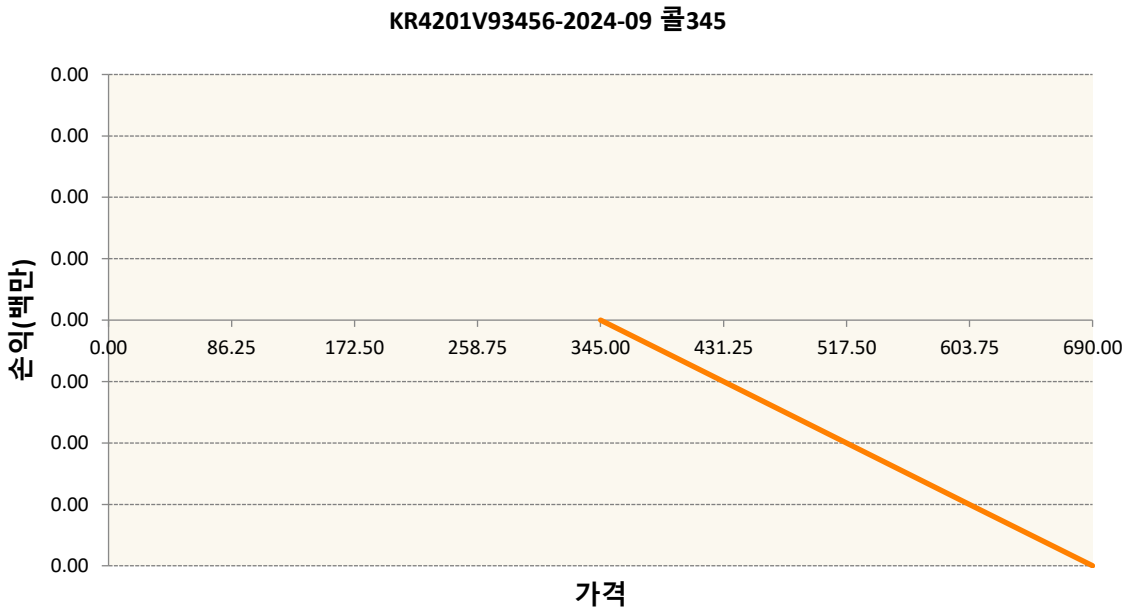
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

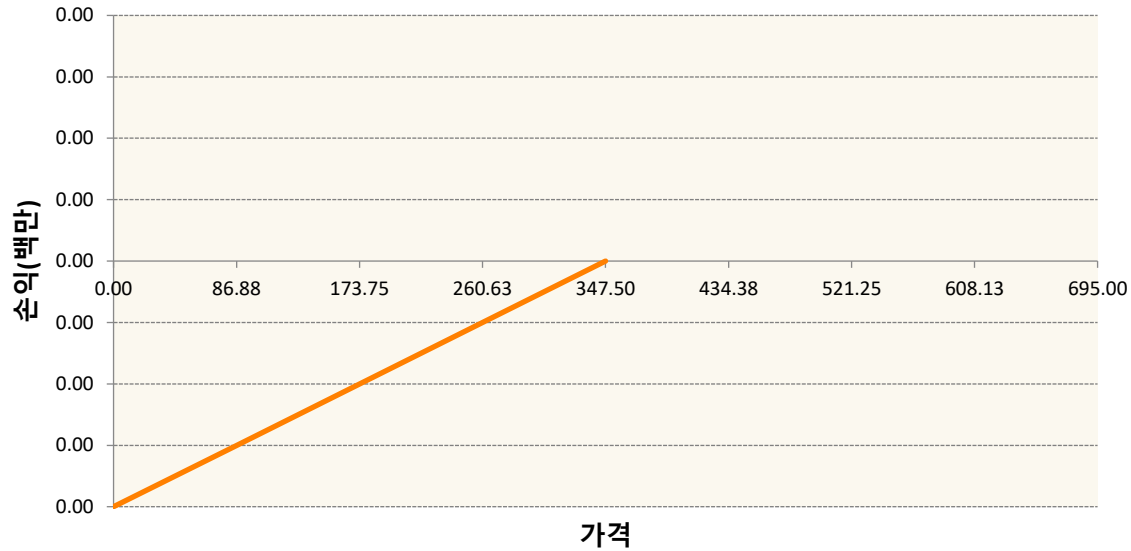
(단위:백만원)

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						1,008
		기초자산의 변동성						
가격		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	626	615	603	591	577	564	549	
-5.33%	529	511	494	476	458	440	422	
-2.67%	322	307	291	275	259	242	226	
0%	25	18	9	0	-10	-22	-34	
2.67%	-312	-314	-316	-320	-325	-331	-338	
5.33%	-658	-658	-659	-660	-661	-664	-667	
8.00%	-1,005	-1,005	-1,005	-1,005	-1,006	-1,006	-1,008	
KR4201V93472		2024-09 콜347.5						1,540
		기초자산의 변동성						
가격		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	868	855	840	823	805	786	766	
-5.33%	754	728	702	675	649	622	595	
-2.67%	478	452	426	399	372	345	318	
0%	48	34	18	0	-19	-39	-60	
2.67%	-463	-467	-473	-481	-491	-502	-515	
5.33%	-997	-998	-999	-1,002	-1,005	-1,010	-1,016	
8.00%	-1,534	-1,535	-1,535	-1,535	-1,536	-1,538	-1,540	
KR4301V93470		2024-09 풋347.5						296
		기초자산의 변동성						
가격		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-277	-279	-282	-285	-288	-292	-296	
-5.33%	-112	-119	-125	-132	-139	-146	-153	
-2.67%	-18	-25	-31	-38	-45	-52	-59	
0%	8	6	3	0	-4	-8	-12	

2.67%	11	11	10	9	8	7	5
5.33%	11	11	11	11	11	10	10
8.00%	11	11	11	11	11	11	11

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

(단위:백만원)

2,981

공시일	2024-09-03
기준일	2024-09-02

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	1,210	0	1,210	

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	2024-09-03
기준일	2024-09-02

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	4,302	0	4,302	

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	2024-09-03
기준일	2024-09-02

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	14,405	0	14,405	
누계	통화	선도	268	14,254	-13,986	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213E6SC KRW/USD 30-09-24E	359
FXW213E7W KRW/USD 31-10-24E	219
FXW213E8V(KRW/USD 29-11-24E	562
FXW213E8X(USD/KRW 30-09-24E	21
IE00BD8RGM75	

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

522

공시일	2024-09-03
기준일	2024-09-02

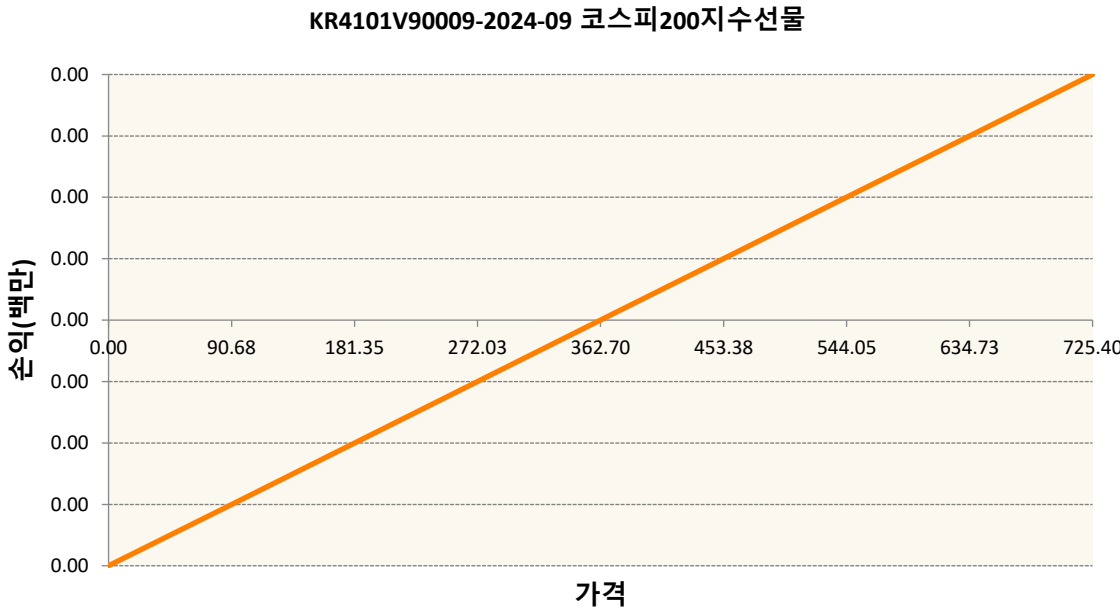
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

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	725	0	725	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	2024-09-03
기준일	2024-09-02

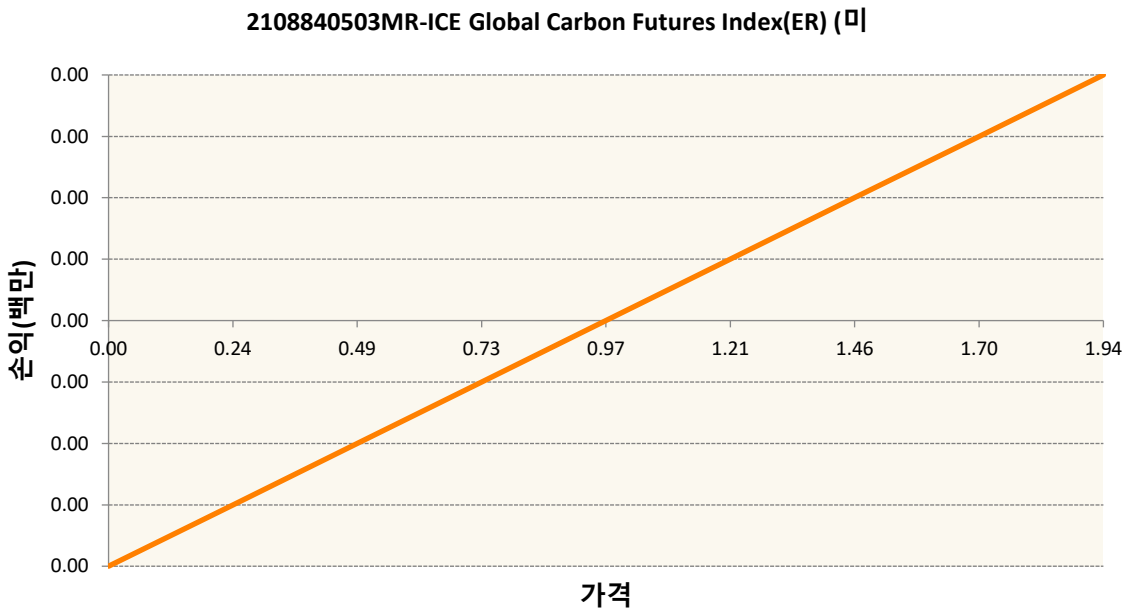
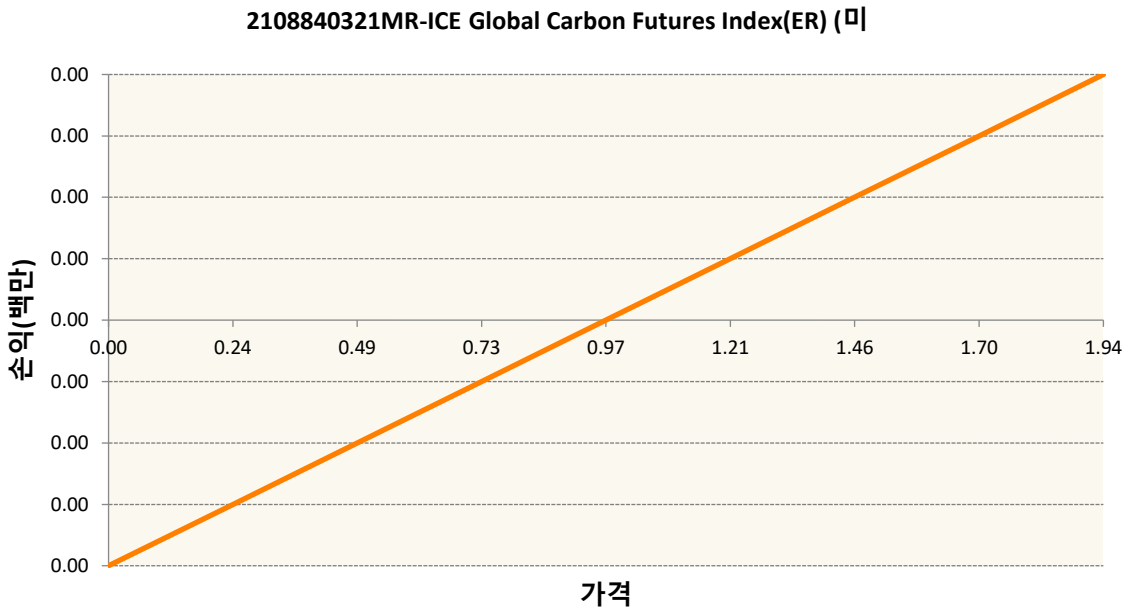
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

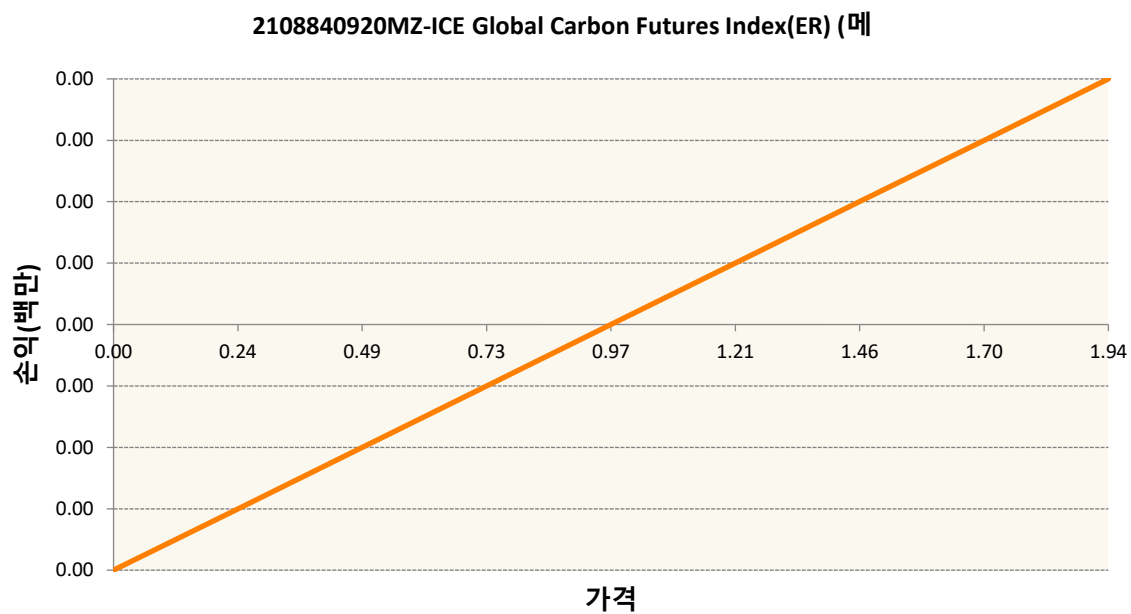
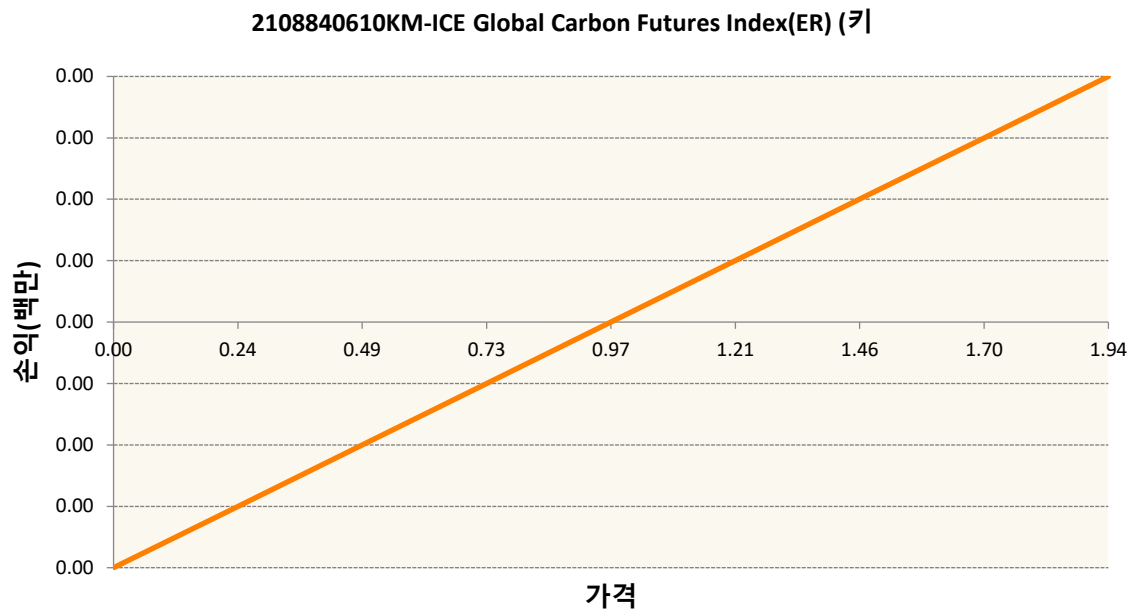
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	16,074	0	16,074	

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108840321IICE Global Carbon Futures Index(ER) (미)		493
2108840503IICE Global Carbon Futures Index(ER) (미)		197
2108840610IICE Global Carbon Futures Index(ER) (키)		394
2108840920IICE Global Carbon Futures Index(ER) (메)		197

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)		(단위:백만원)
		1,385

공시일	2024-09-03
기준일	2024-09-02

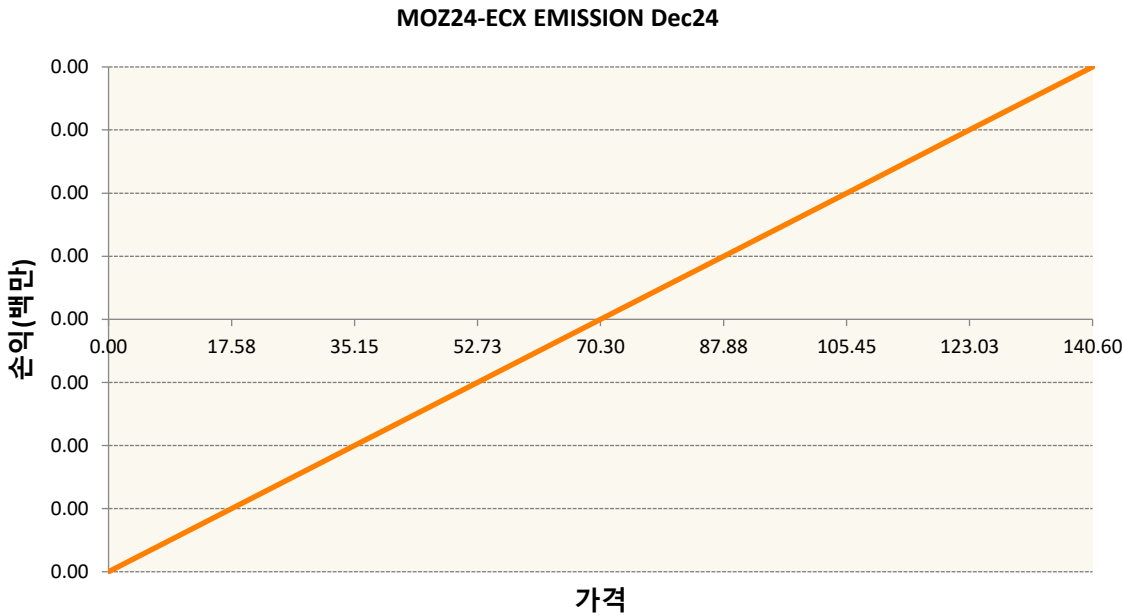
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	9,459	0	9,459	
누계	지수	스왑	373	0	373	장외
누계	통화	선도	0	1,882	-1,882	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213E8V(KRW/EUR 30-09-24E	36
FXW213E8V(KRW/EUR 30-09-24E	114
MOZ24 ECX EMISSION Dec24	757
SWICEUACN ICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX	1

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

(단위:백만원)

1,354

공시일	2024-09-03
기준일	2024-09-02

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)	10
SWCSI00000 신한CSI Index 240620 (미래)	15
SWCSI00000 신한CSI Index 240620 (메리츠)	15
SWCSI00000 신한CSI Index 240620 (NH)	10

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

(단위:백만원)

71

공시일	2024-09-03
기준일	2024-09-02

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)	14
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(NH)	12
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(메리츠)	17
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(키움)	3

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

(단위:백만원)

53

공시일	2024-09-03
기준일	2024-09-02

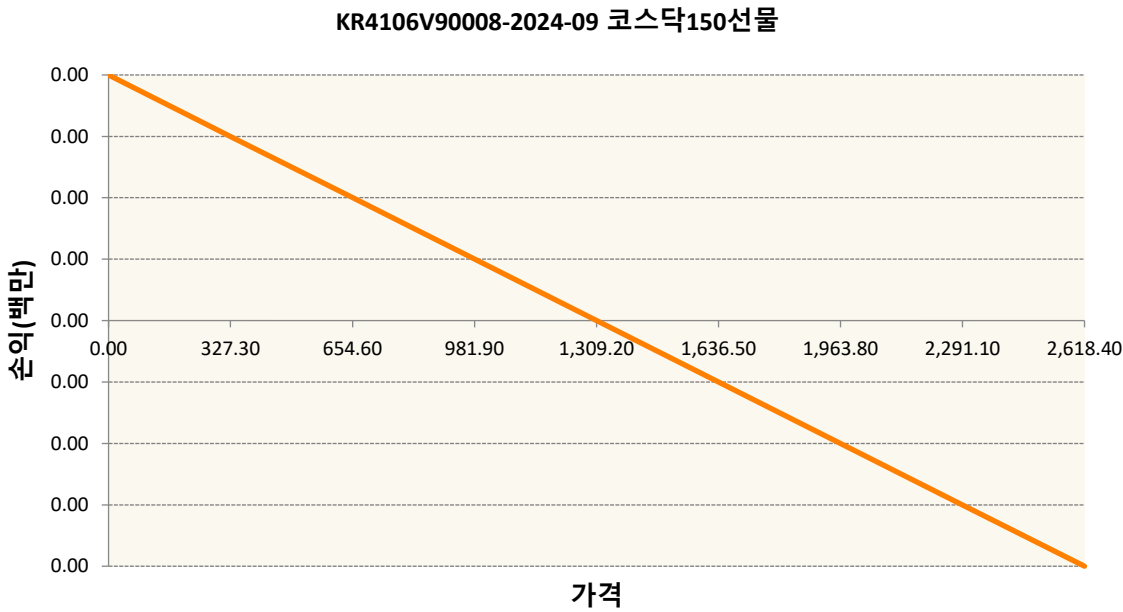
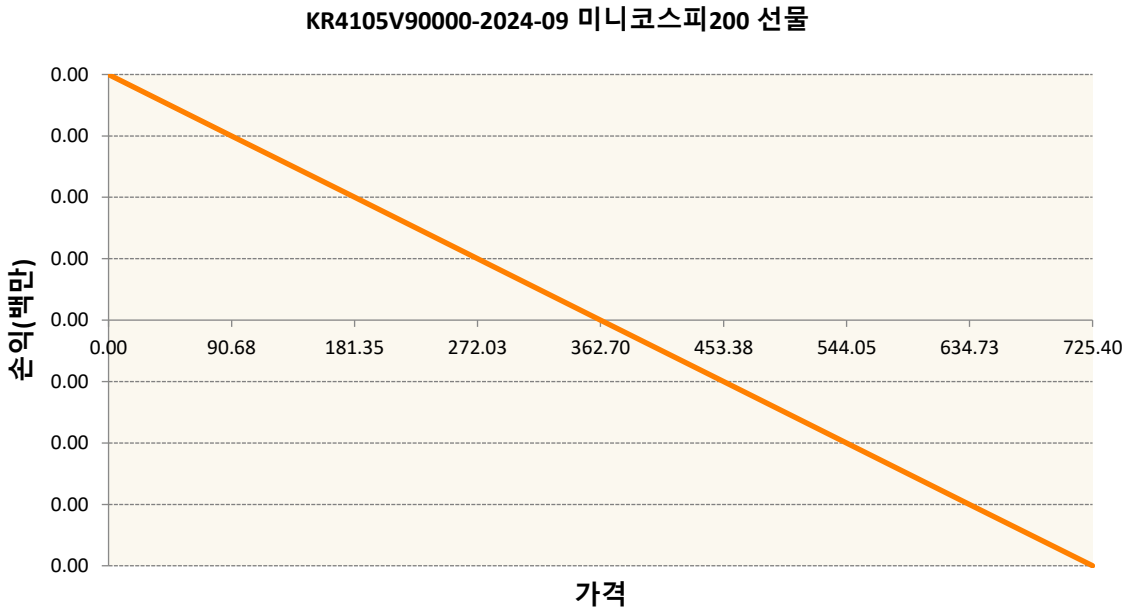
에퀴티알파일반사모혼합자산

1. 계약금액

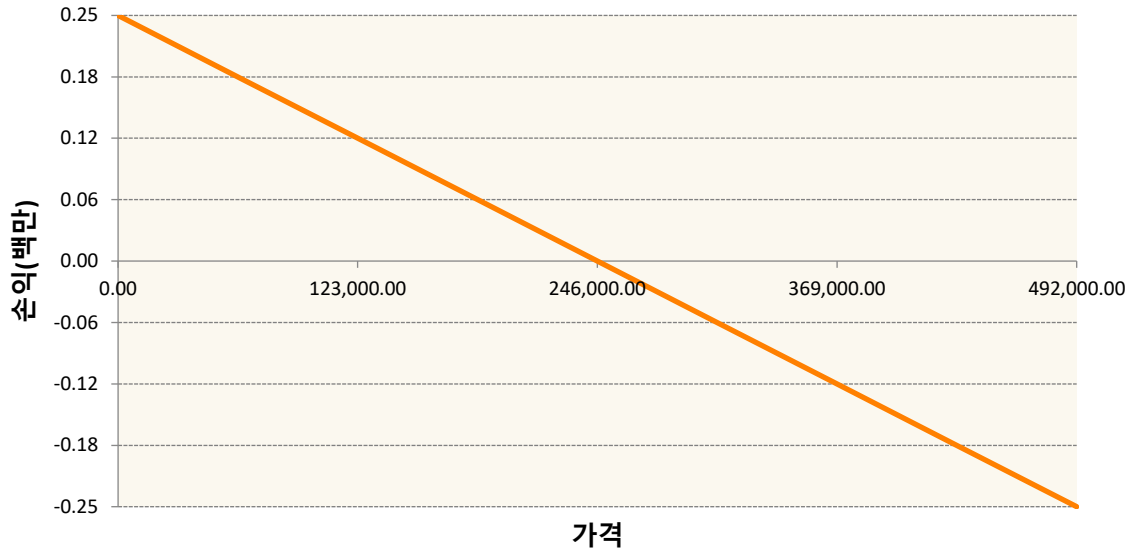
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	74	274	-201	장내
누계	유가증권	선물	17	534	-517	장내

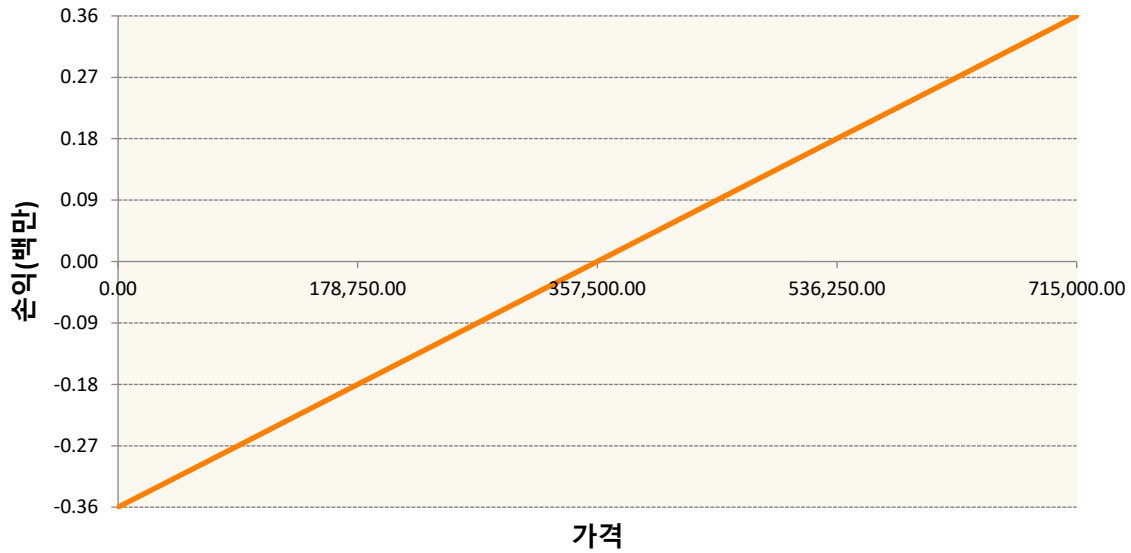
2. 만기시점의 손익구조



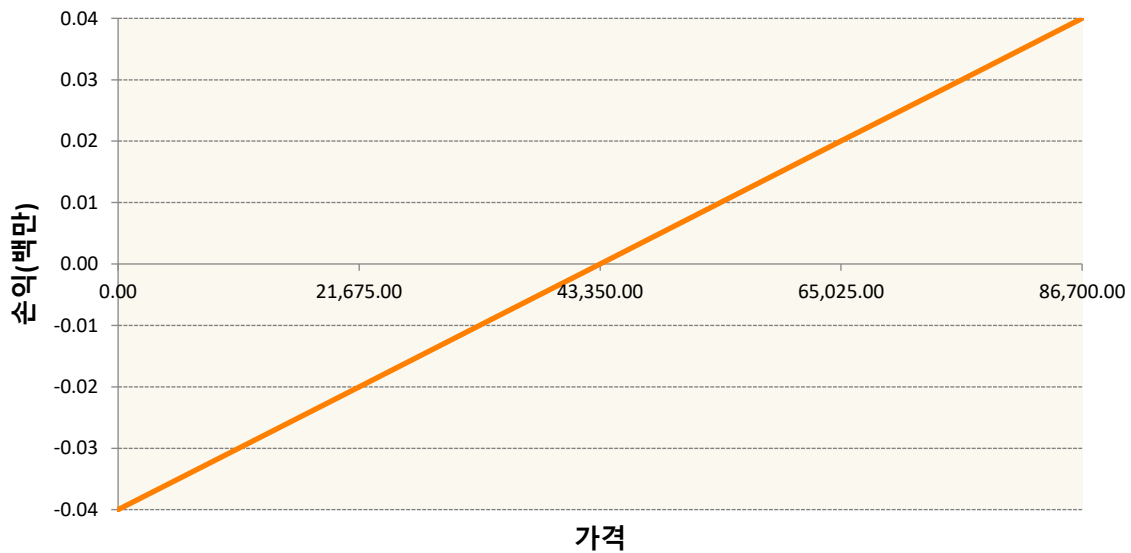
KR4116V90007-2024-09 현대차개별선물



KR41CTV90005-2024-09 삼성화재개별선물



KR41GNV90009-2024-09 금양개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4105V900 2024-09 미니코스피200 선물	7
KR4106V900 2024-09 코스닥150선물	2
KR4116V900 2024-09 현대차개별선물	4
KR41CTV900 2024-09 삼성화재개별선물	1
KR41GNV900 2024-09 금양개별선물	1

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

24

공시일	2024-09-03
기준일	2024-09-02

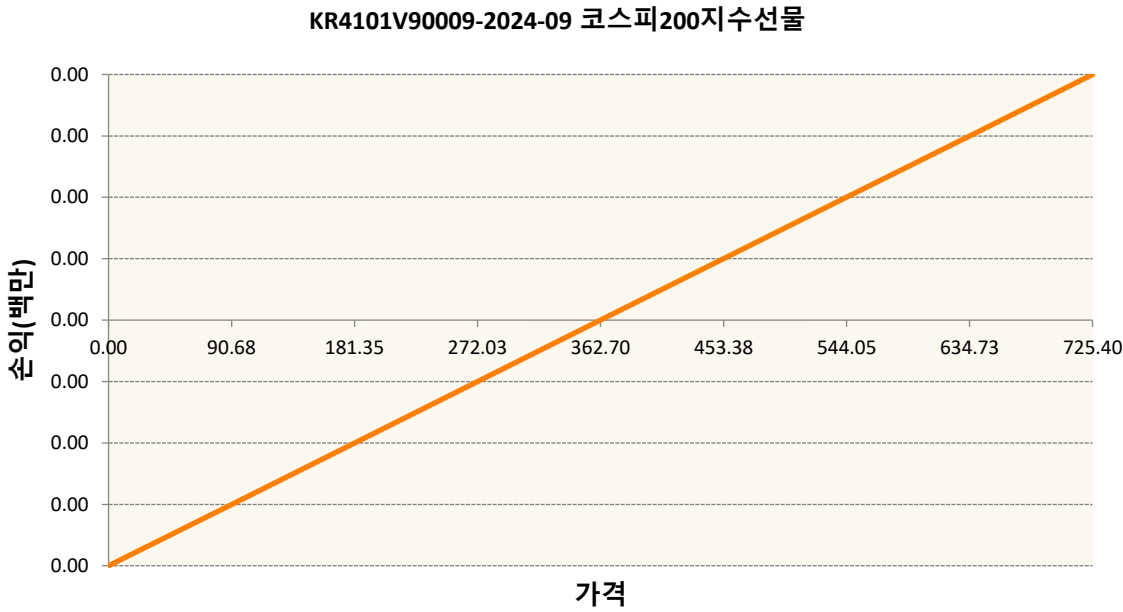
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	2,992	-2,992	장내
누계	유가증권	선물	3,718	0	3,718	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

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

(단위:백만원)

352

공시일	2024-09-03
기준일	2024-09-02

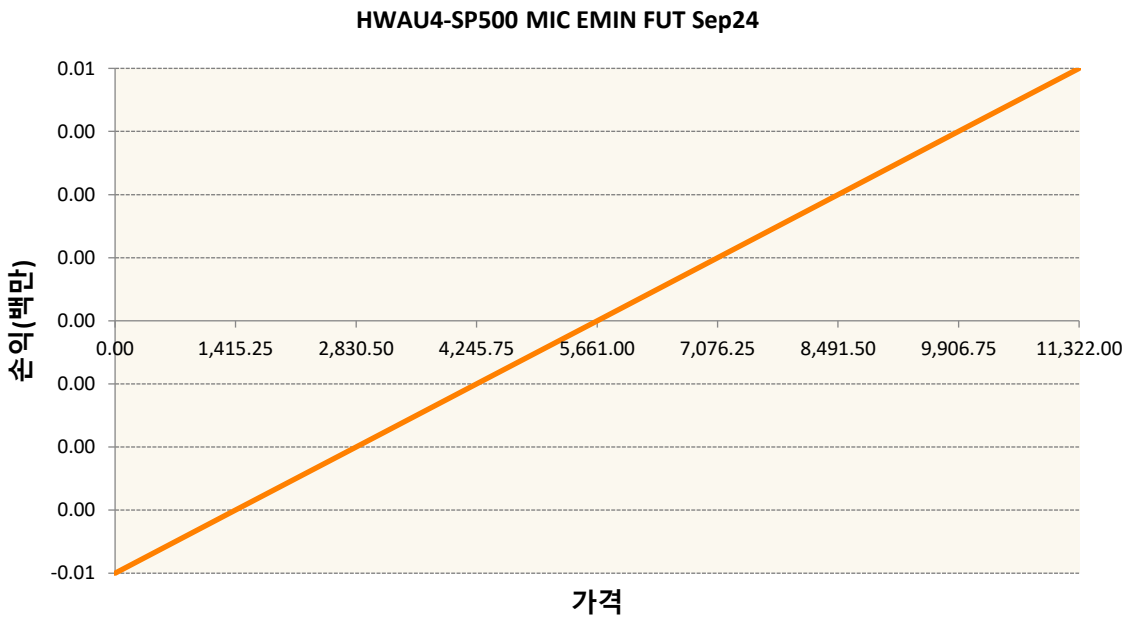
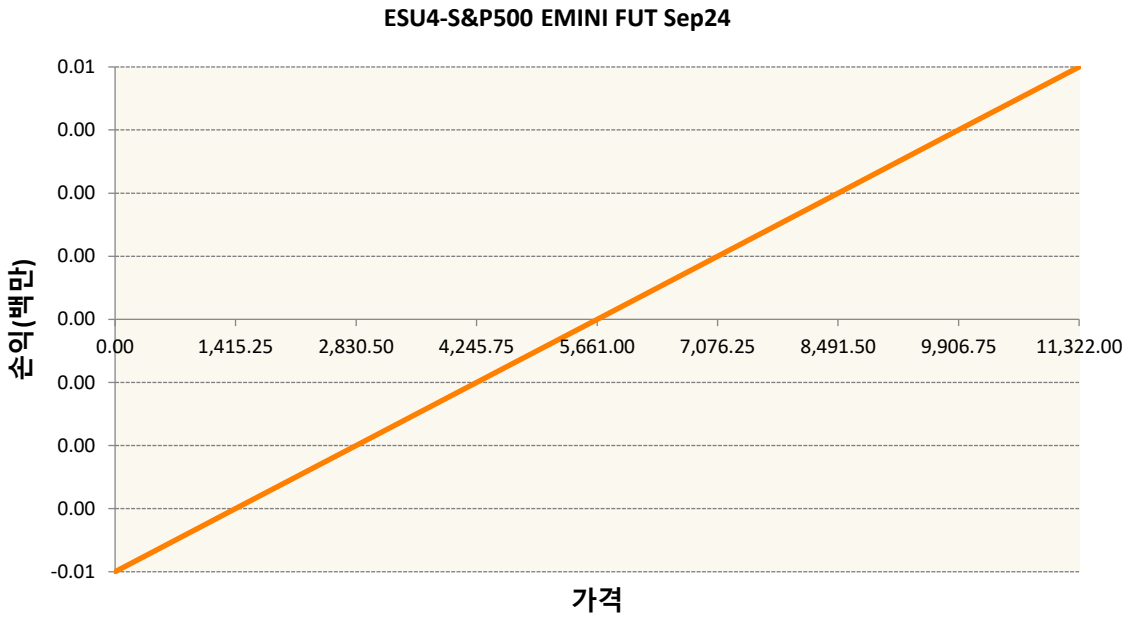
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

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	11,678	0	11,678	
누계	유가증권	선물	1,876	0	1,876	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESU4	S&P500 EMINI FUT Sep24	934
HWAU4	SP500 MIC EMIN FUT Sep24	150

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	656

공시일	2024-09-03
기준일	2024-09-02

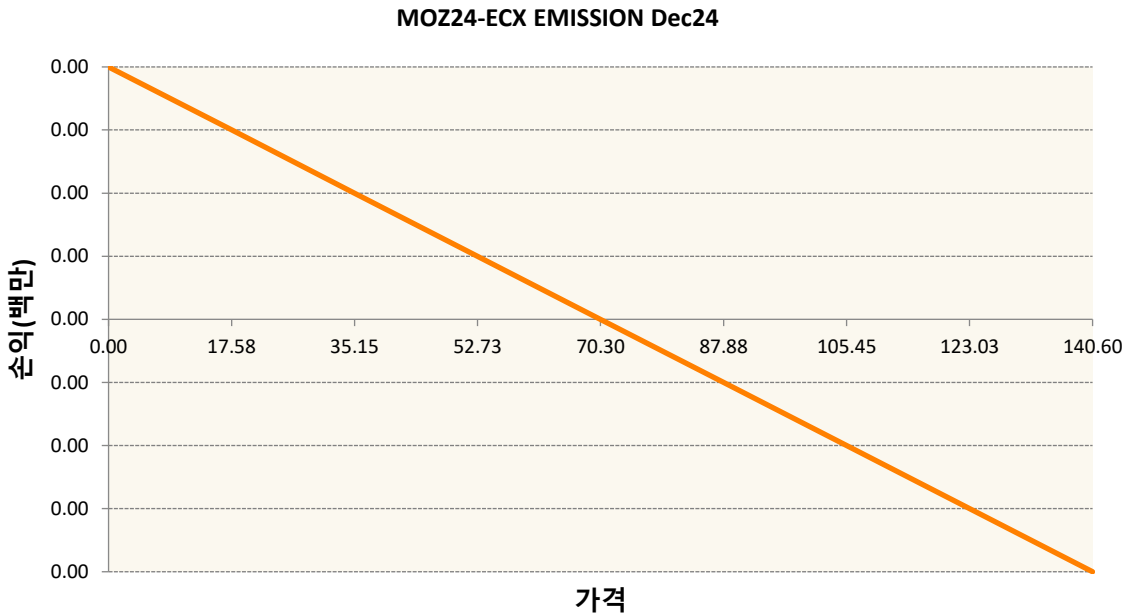
SOL유럽탄소배출권선물인버스ICE특별자산상

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	5,556	-5,556	
누계	지수	스왑	373	0	373	장외
누계	통화	선도	0	1,097	-1,097	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213E8V(KRW/EUR 30-09-24E	88
MOZ24 ECX EMISSION Dec24	444
SWICEUACN ICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX	1

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

(단위:백만원)

795

공시일	2024-09-03
기준일	2024-09-02

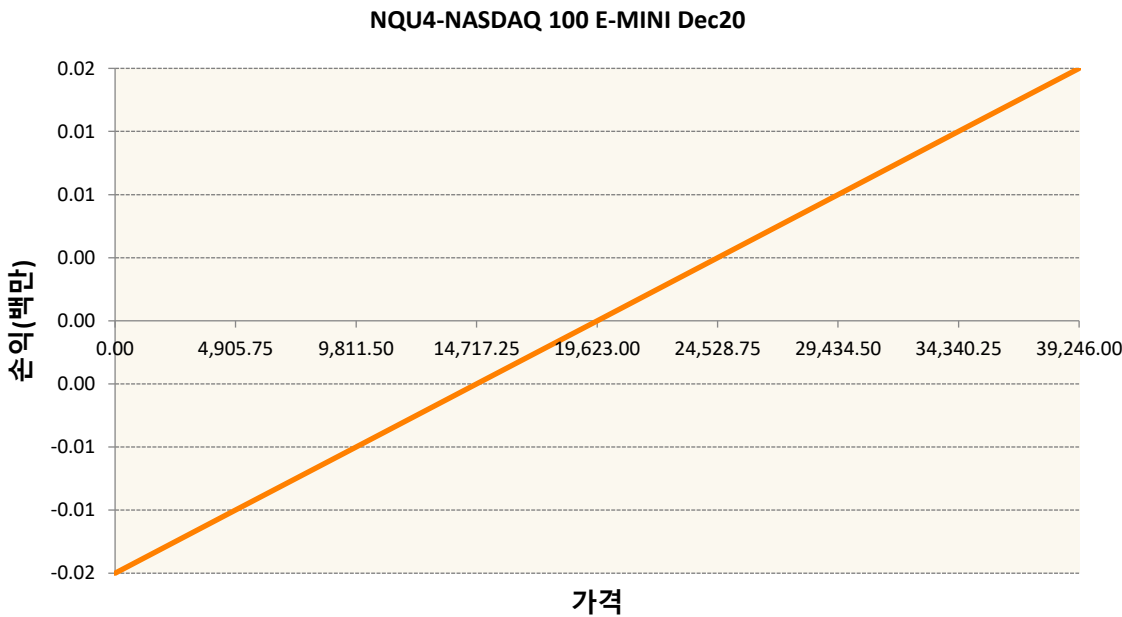
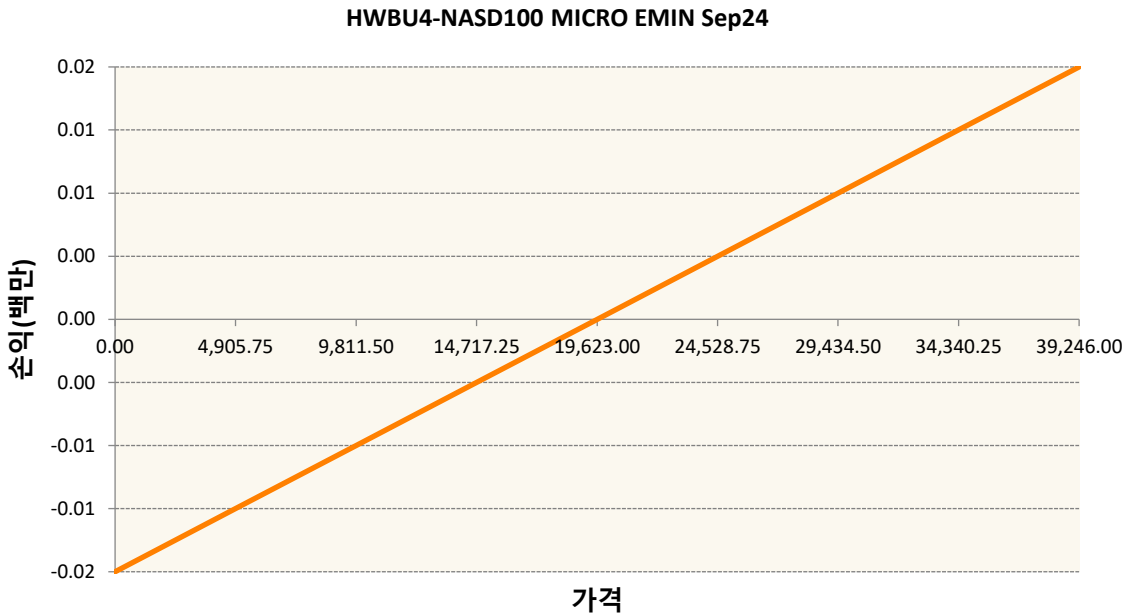
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

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	6,486	0	6,486	
누계	유가증권	선물	1,737	0	1,737	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
HWBU4	NASD100 MICRO EMIN Sep24		139
NQU4	NASDAQ 100 E-MINI Dec20		519

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)			(단위:백만원)
			523

공시일	2024-09-03
기준일	2024-09-02

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	189,465	0	189,465	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWKEDI0000 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	4,810
SWKEDI0000 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	6,281
SWKEDI0000 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	702
SWKEDI0000 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	3,276

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

(단위:백만원)

8,895

공시일	2024-09-03
기준일	2024-09-02

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	2024-09-03
기준일	2024-09-02

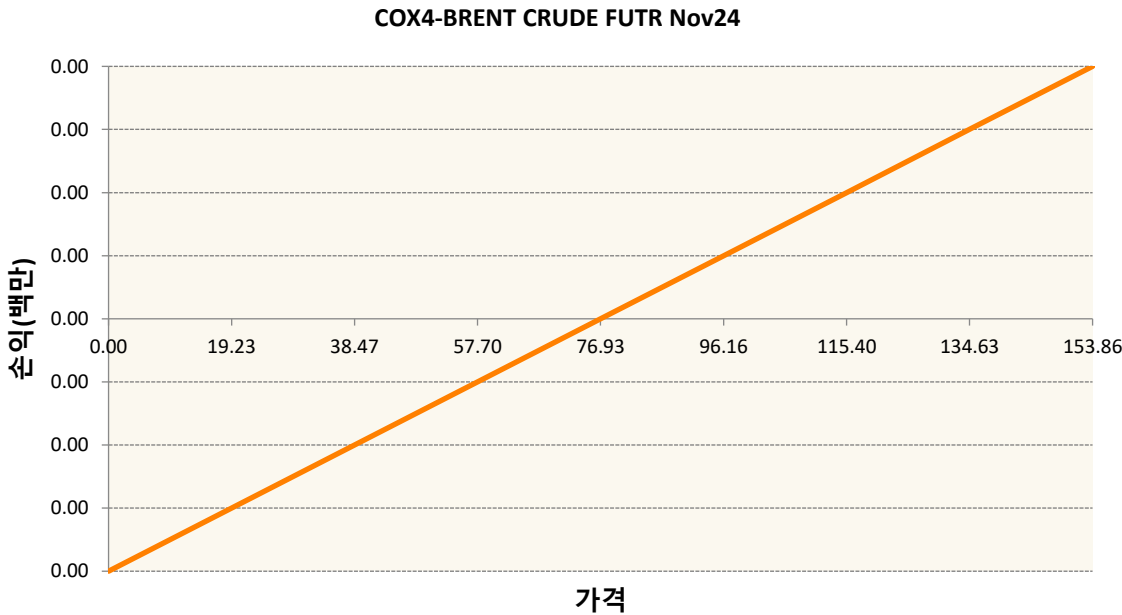
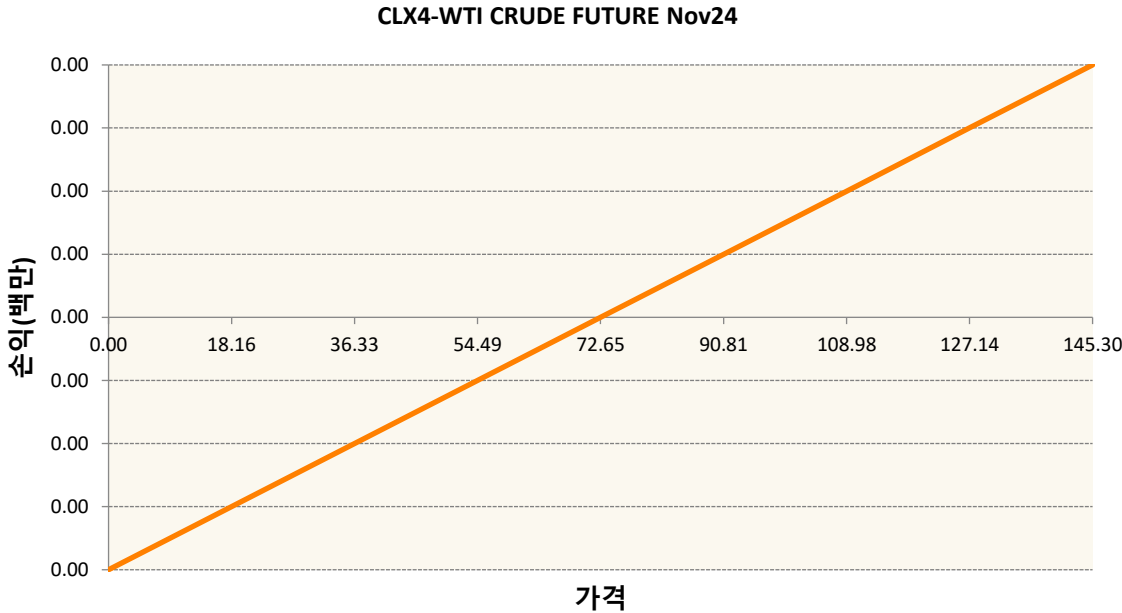
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

1. 계약금액

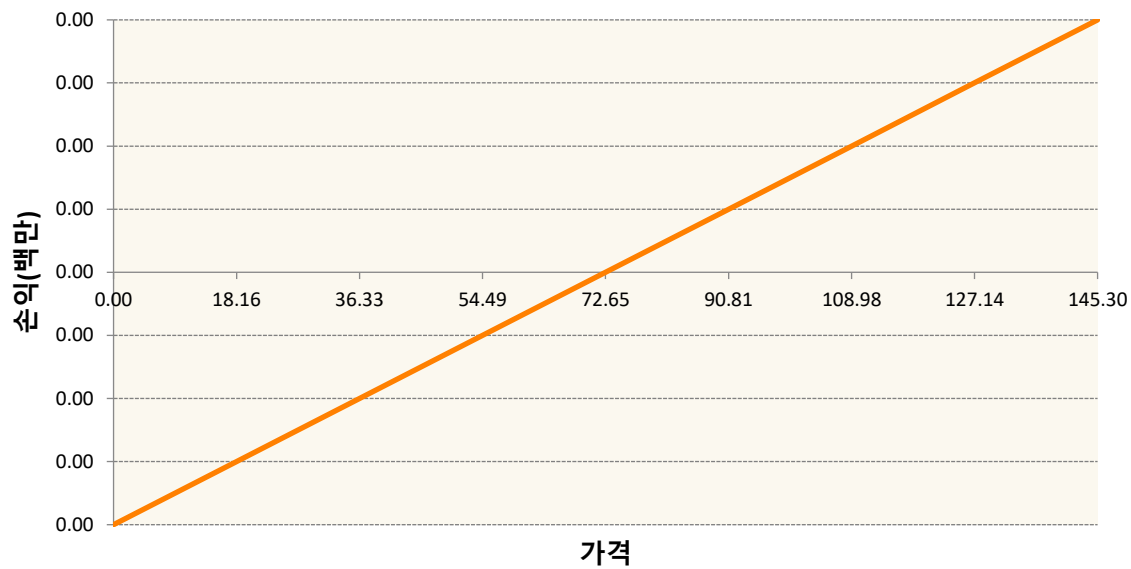
(단위:백만원)

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	850	0	850	
누계	통화	선물	0	107	-107	장내

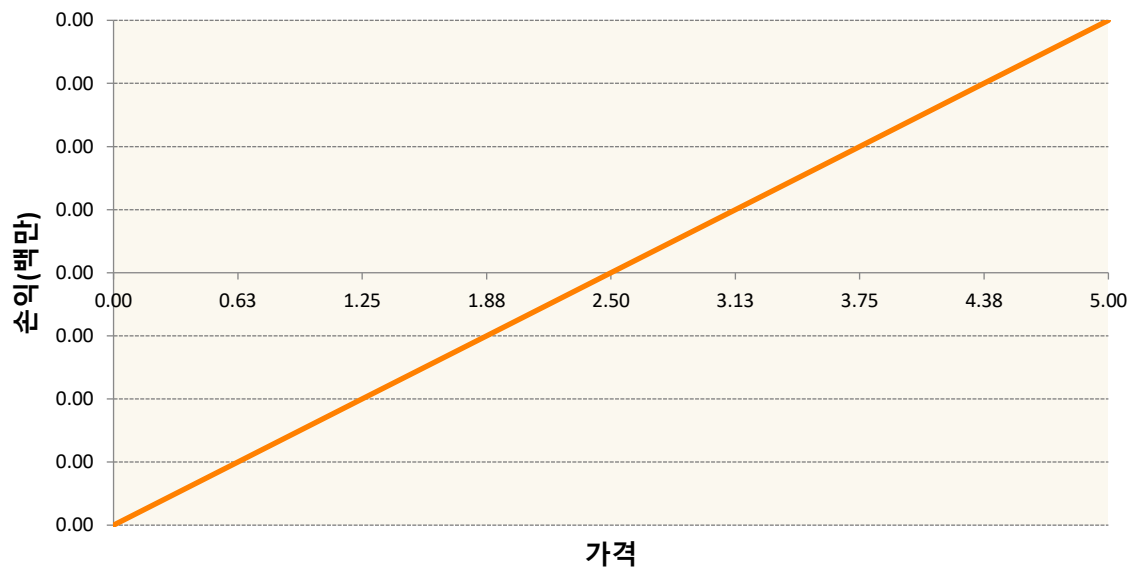
2. 만기시점의 손익구조



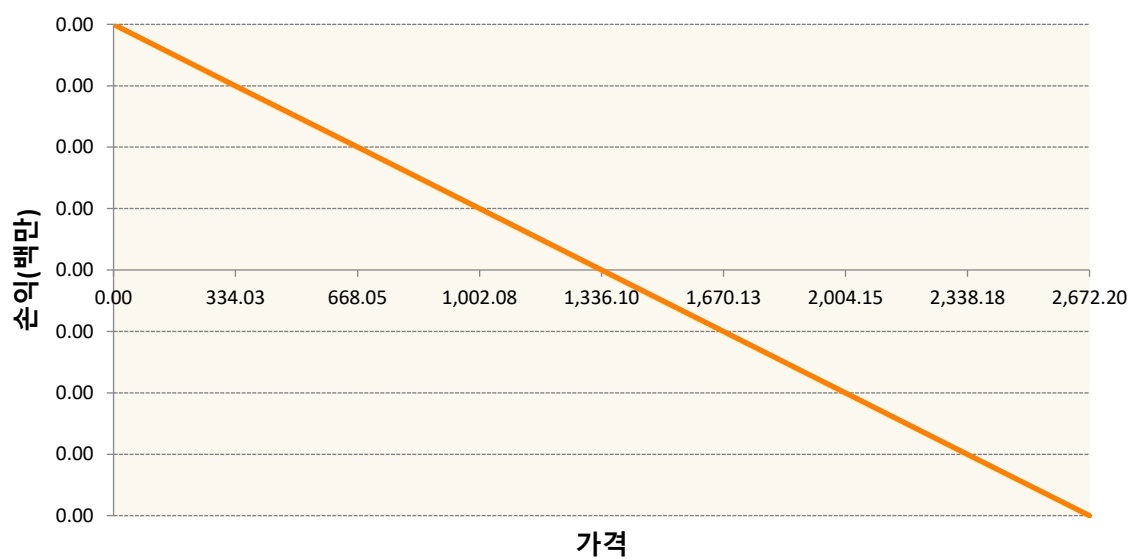
ECX4-E-mini Crude Oil Nov24



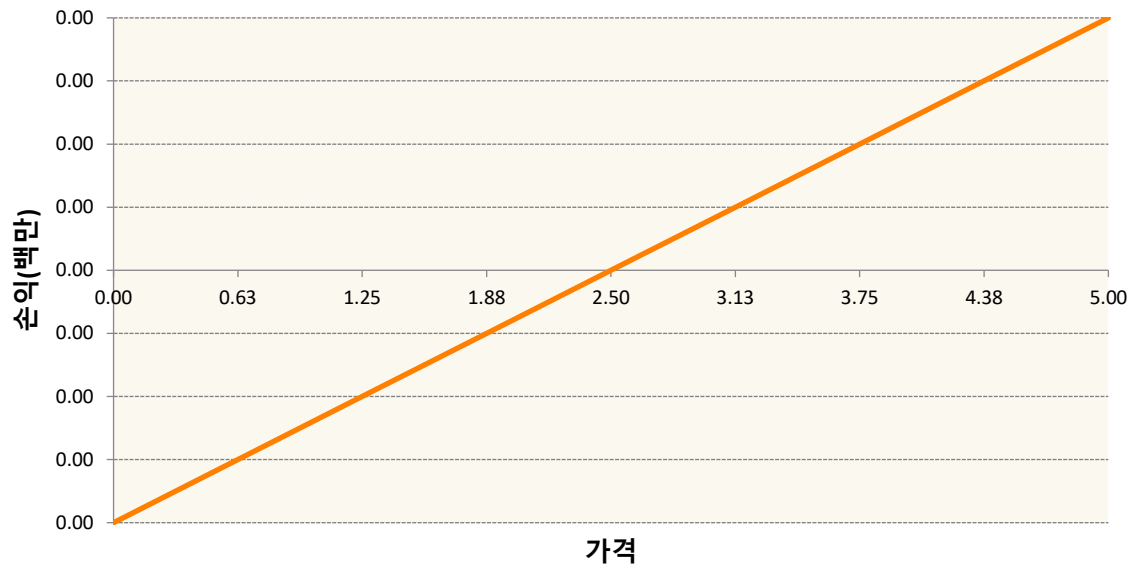
EOX4-E-MINI NATURAL GA Nov24



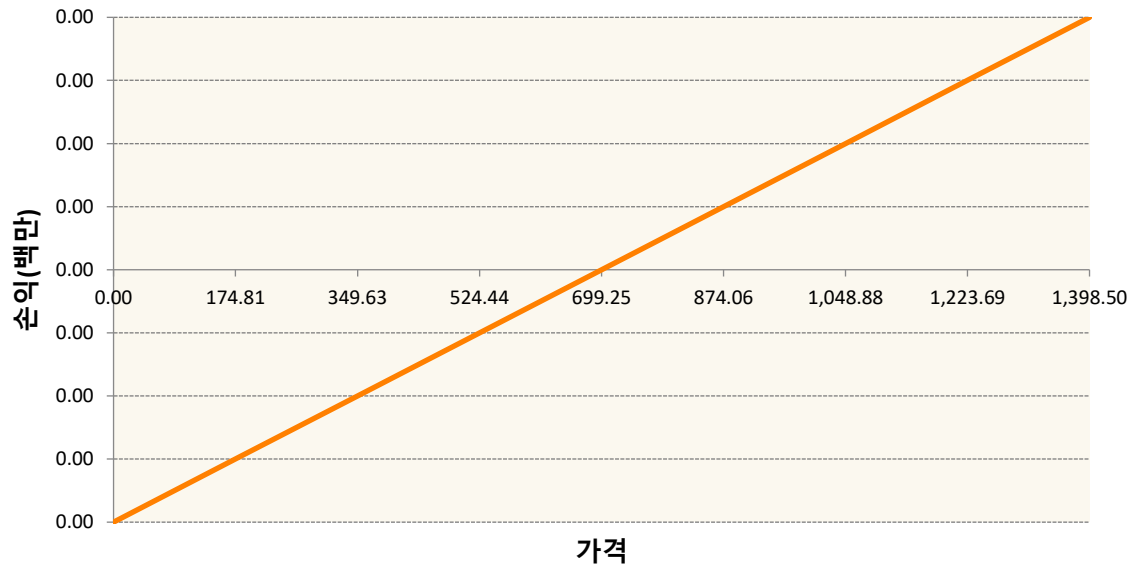
KR4175V90003-2024-09 달러선물



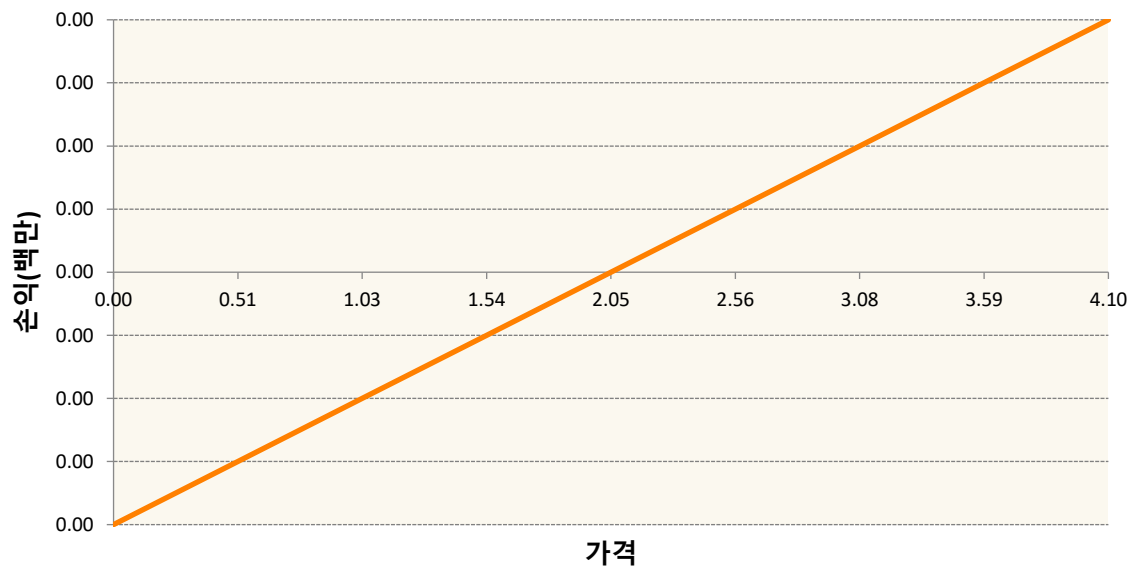
NGX24-NATURAL GAS FUTR Nov24



QX4-Low Su Gasoil G Nov24



XB4-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		9
NGX24	NATURAL GAS FUTR Nov24	14
QSX4	Low Su Gasoil G Nov24	8
XBX4	GASOLINE RBOB FUT Nov24	9

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

141