

공시일 2024-09-09

기준일 2024-09-06

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	2024-09-09
기준일	2024-09-06

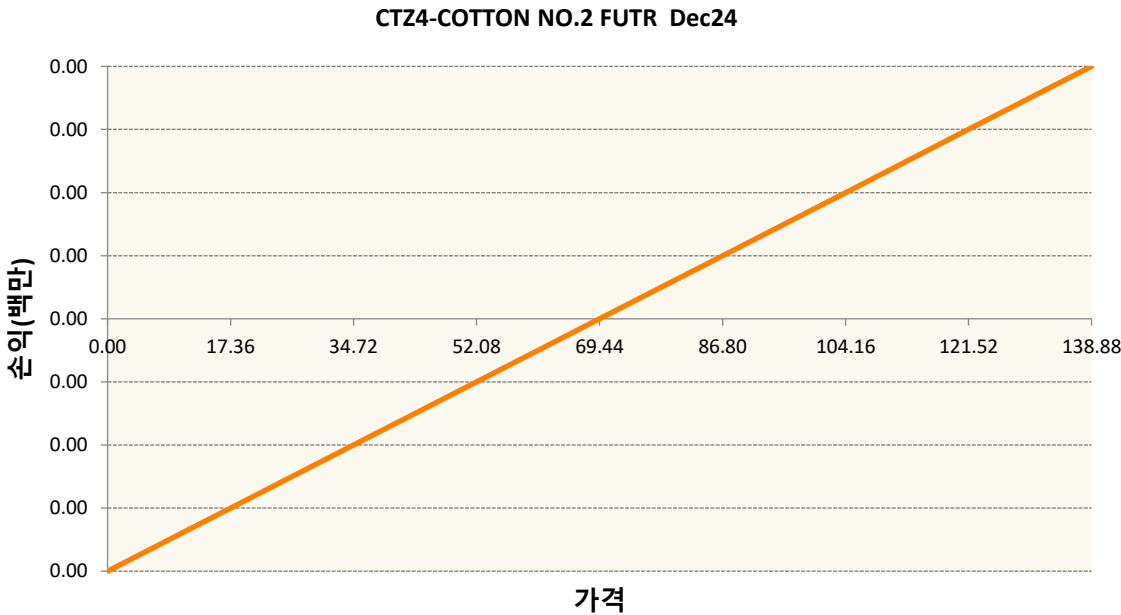
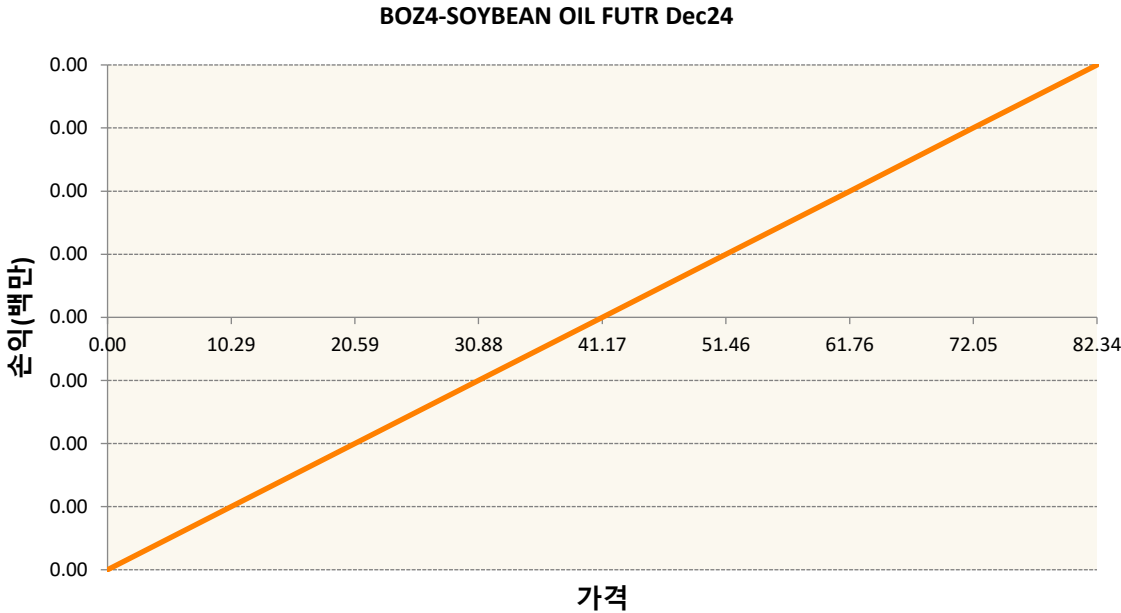
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

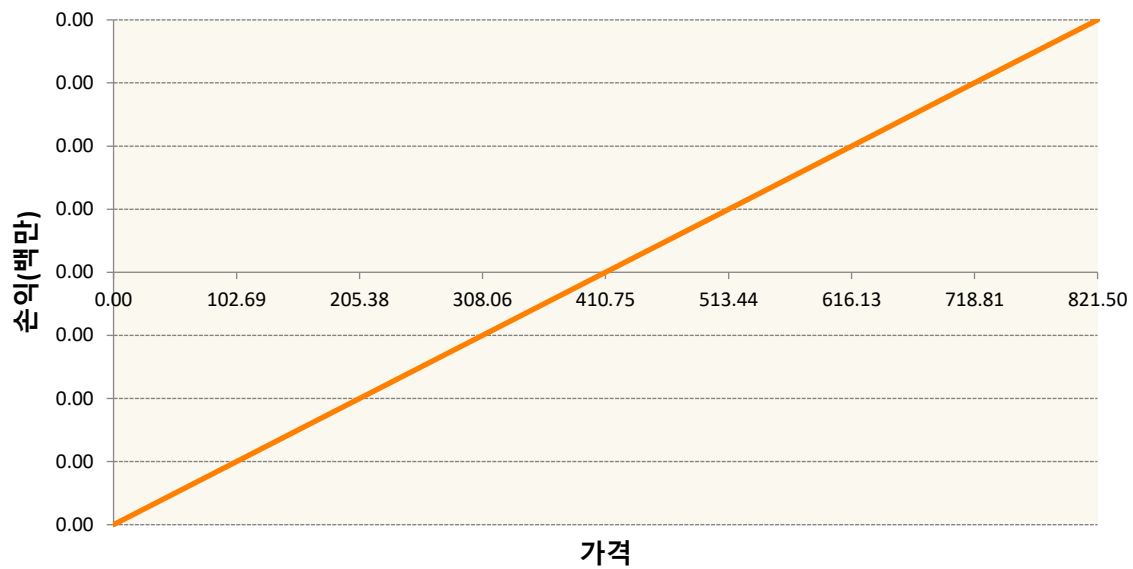
(단위:USD 백만)

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	3,973	0	3,973	
누계	통화	선물	0	464	-464	장내

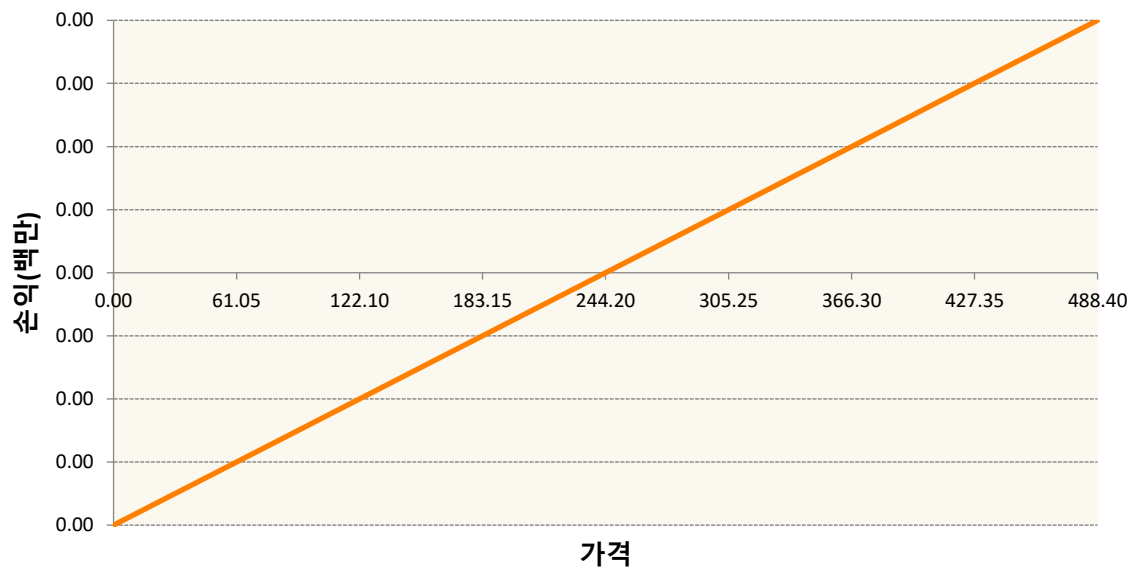
2. 만기시점의 손익구조



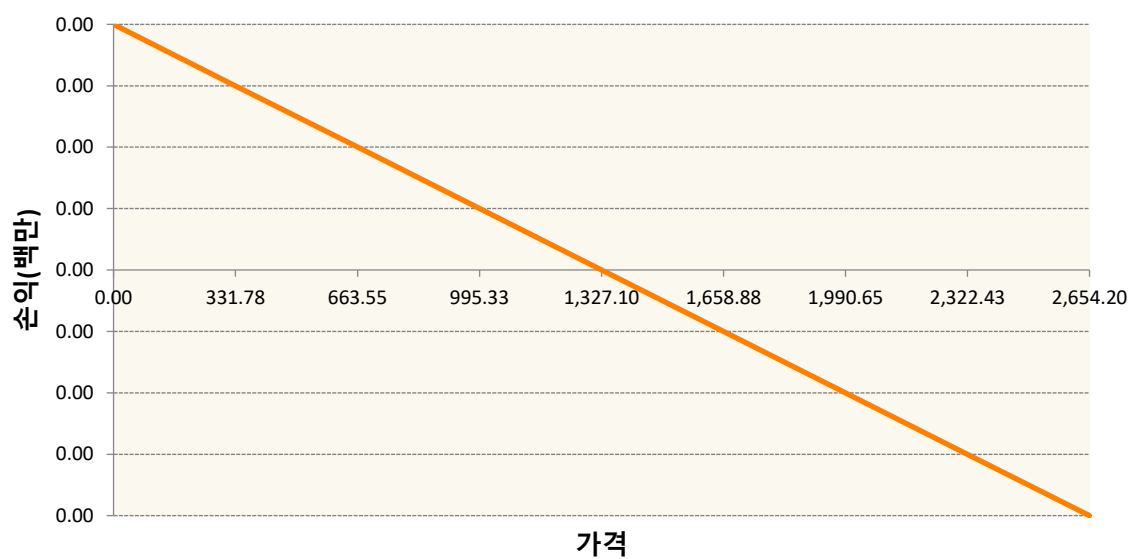
CZ4-CORN FUTURE Dec24



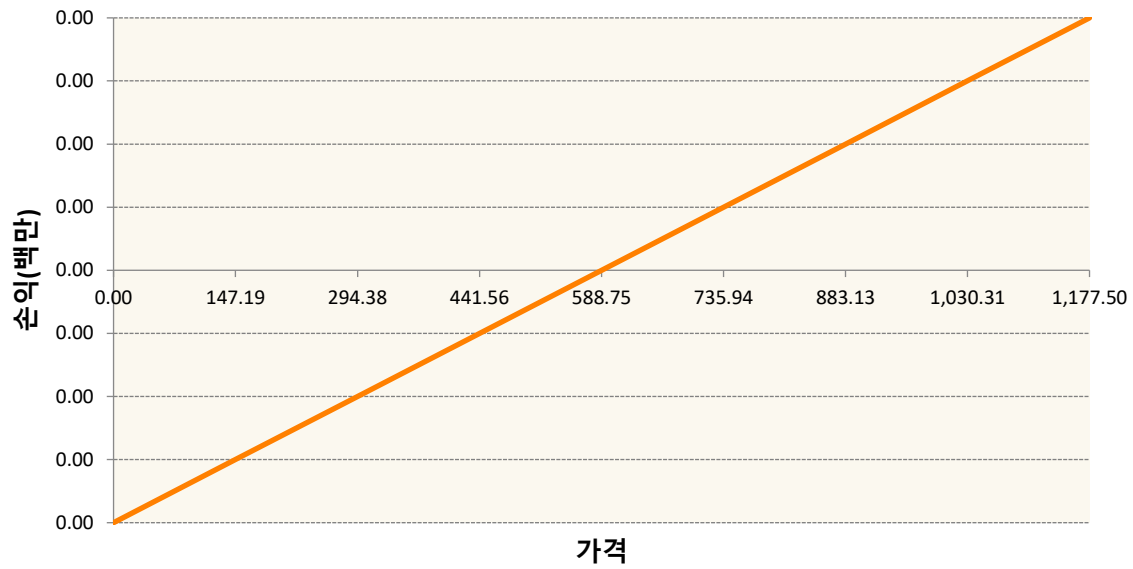
KCZ4-COFFEE 'C' FUTURE Dec24



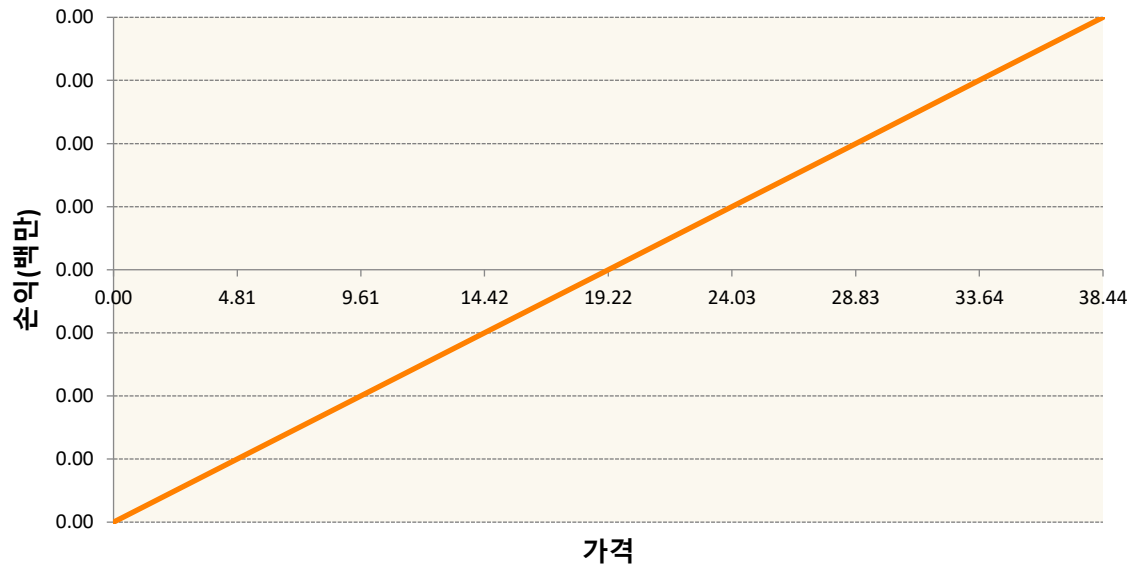
KR4175V90003-2024-09 달러선물



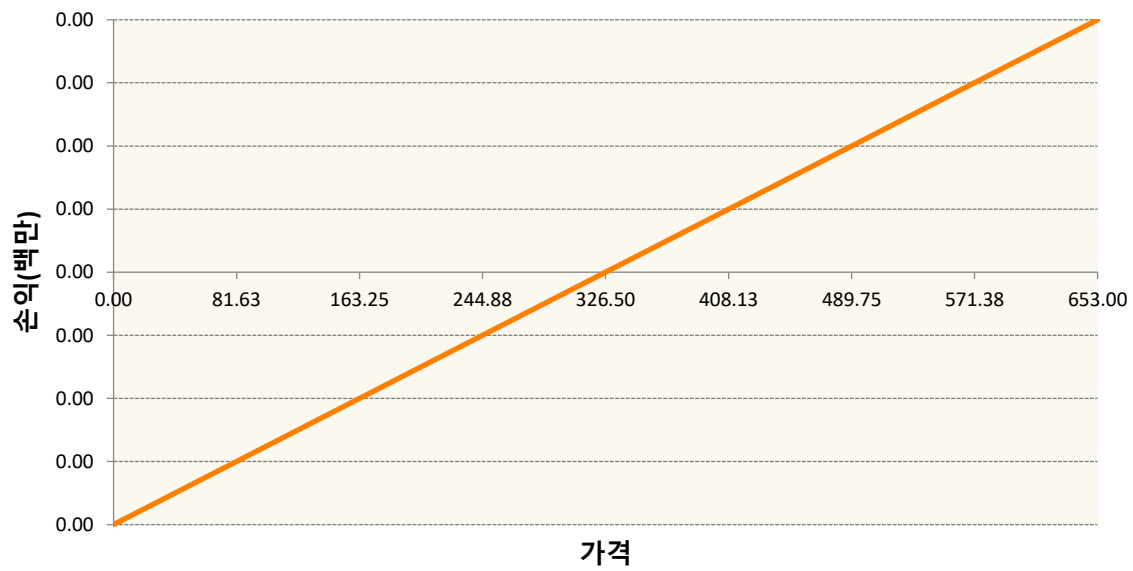
KWZ4-KC HRW WHEAT FUT Dec24

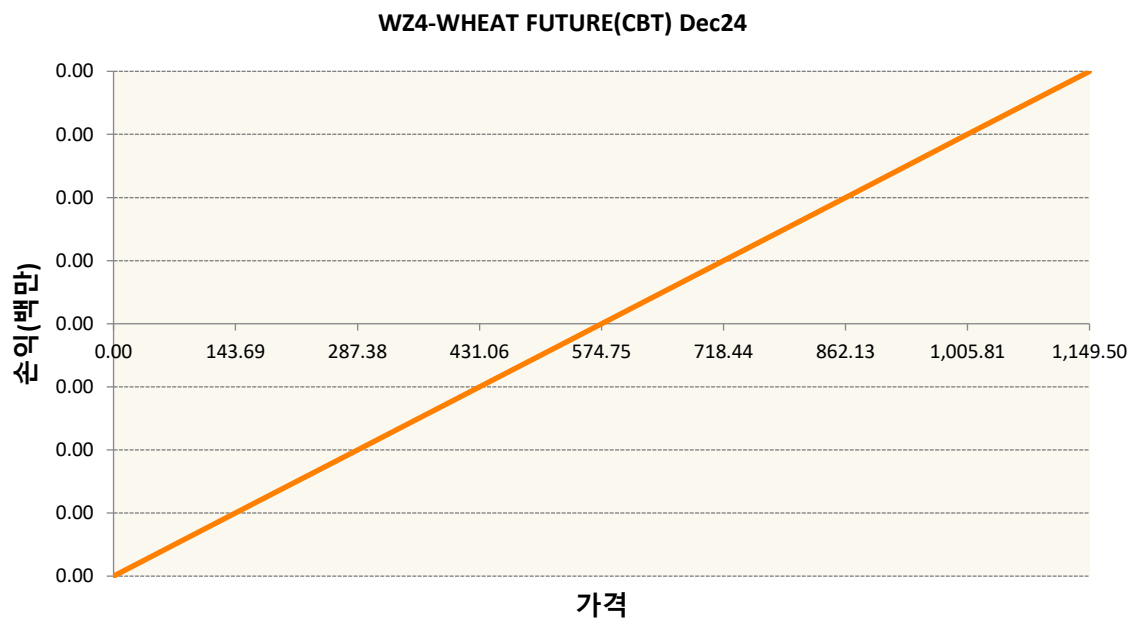
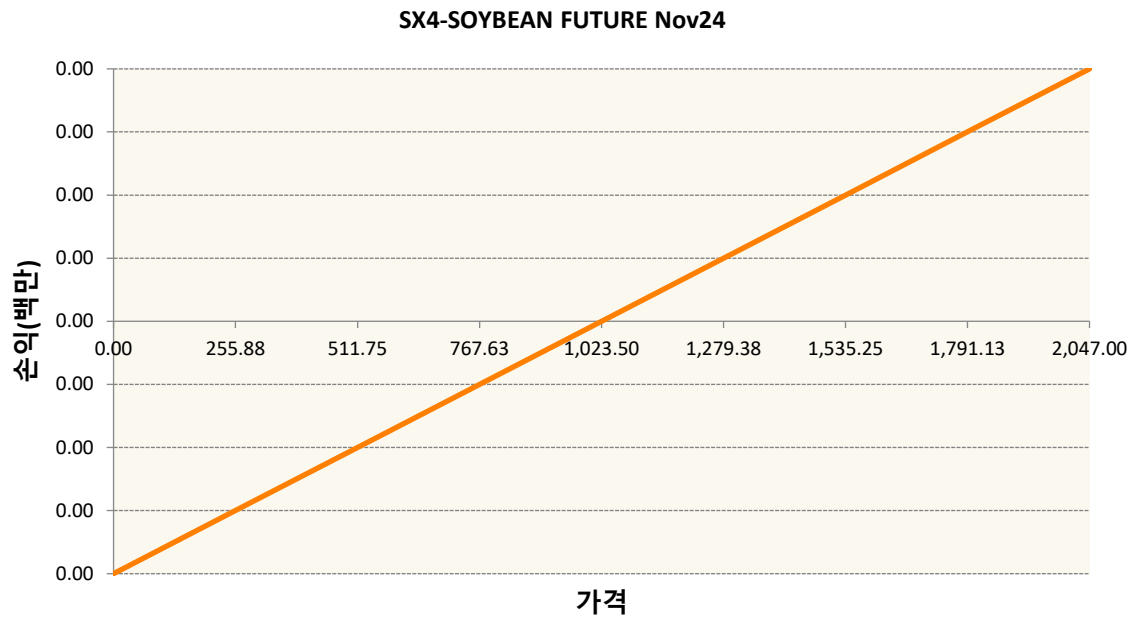


SBV4-Sugar #11 (WORLD) Oct24



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	2024-09-09
기준일	2024-09-06

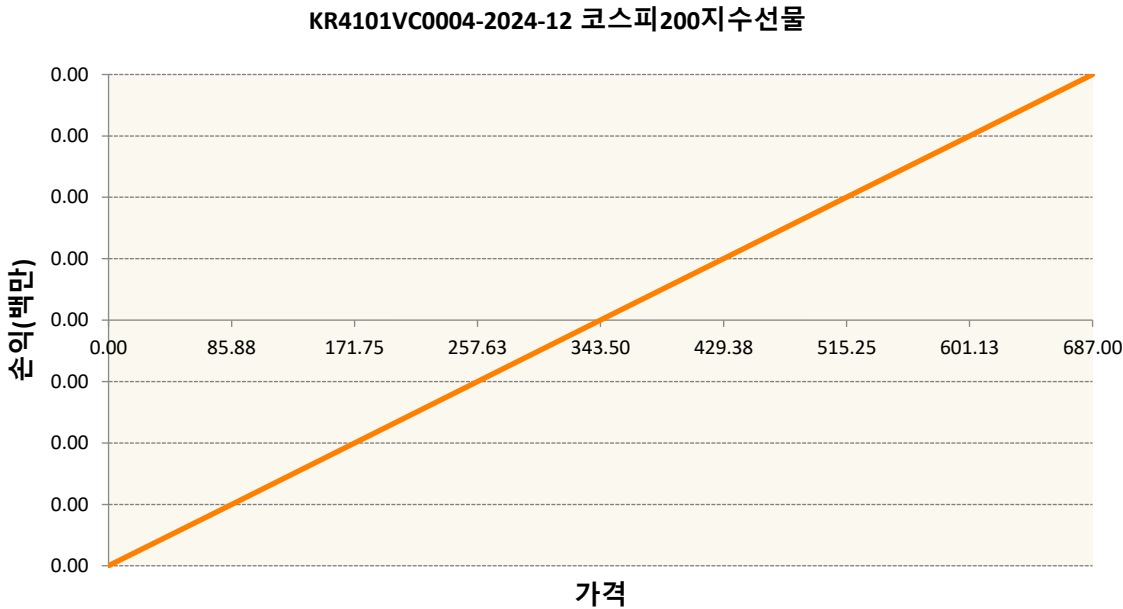
스마트인덱스모

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	1,632	0	1,632	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101VC0004			2024-12 코스피200지수선물				130
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-130	-130	-130	-130	-130	-130	-130
-5.33%	-87	-87	-87	-87	-87	-87	-87
-2.67%	-43	-43	-43	-43	-43	-43	-43
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	43	43	43	43	43	43	43
5.33%	87	87	87	87	87	87	87
8.00%	130	130	130	130	130	130	130

공시일	2024-09-09
기준일	2024-09-06

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	238
-----------------------------	-----

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

297

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2024-09-09
기준일	2024-09-06

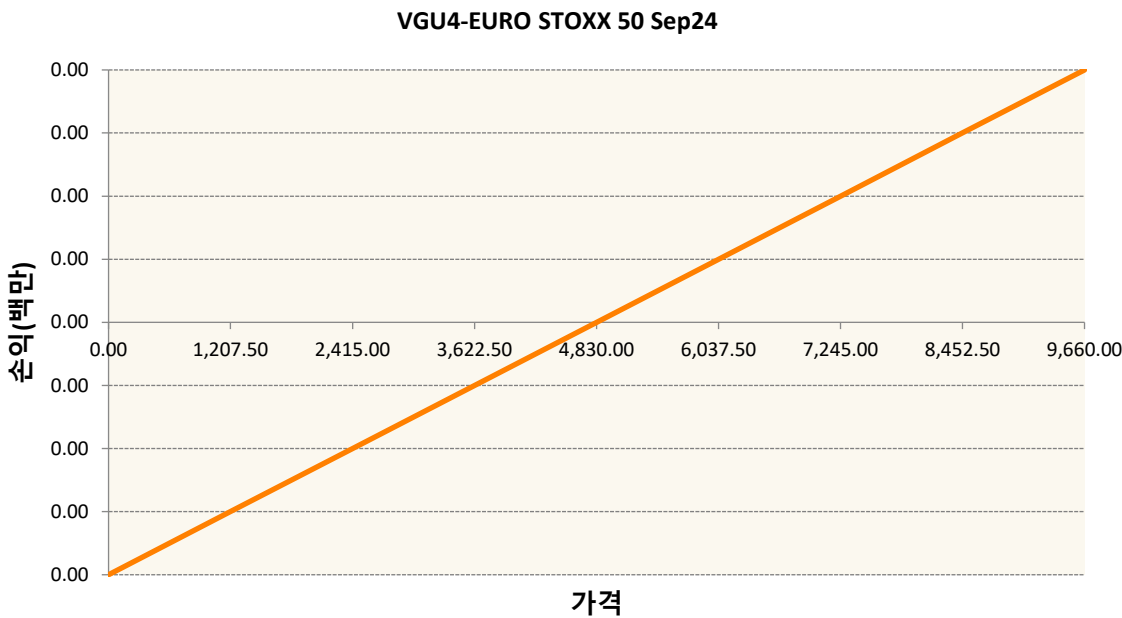
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	931	0	931	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGU4 EURO STOXX 50 Sep24

75

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

(단위:백만원)

48

공시일	2024-09-09
기준일	2024-09-06

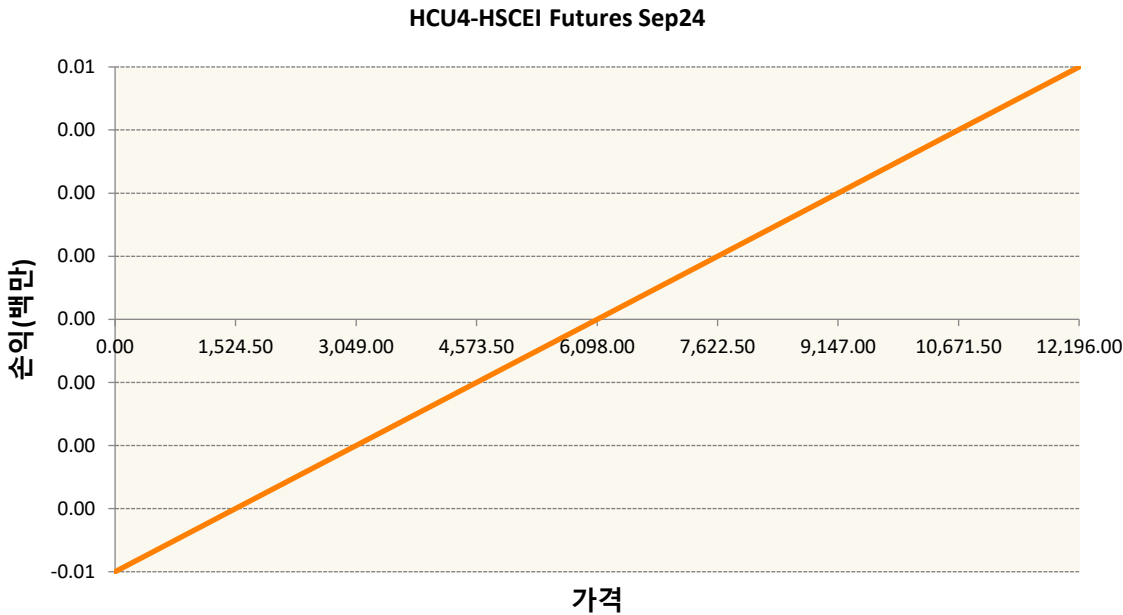
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,512	0	1,512	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCU4	HSCEI Futures Sep24	121
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

144

공시일	2024-09-09
기준일	2024-09-06

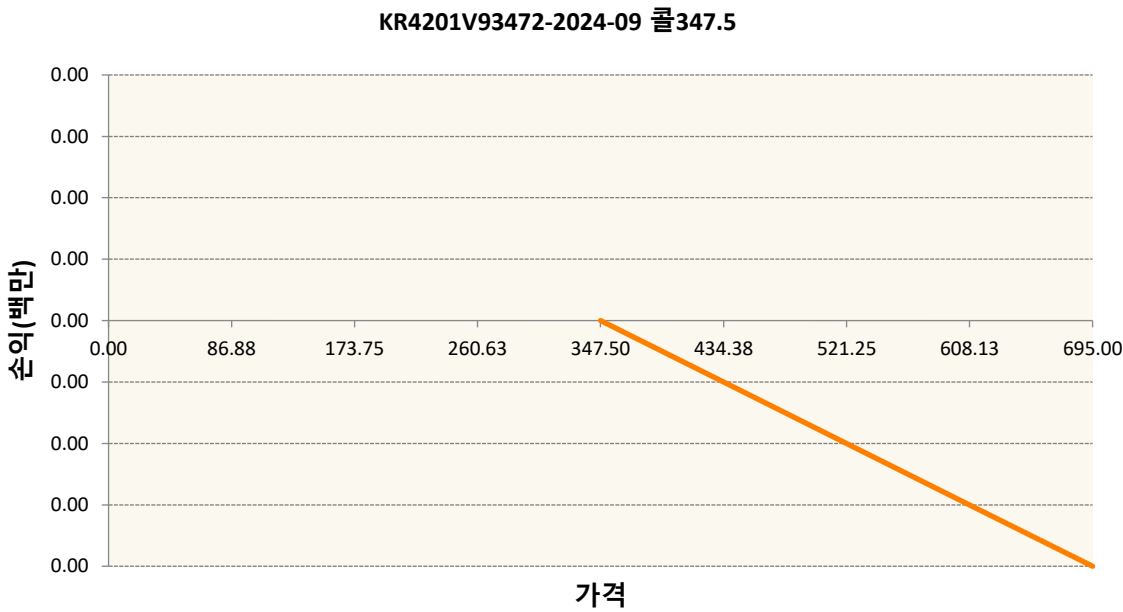
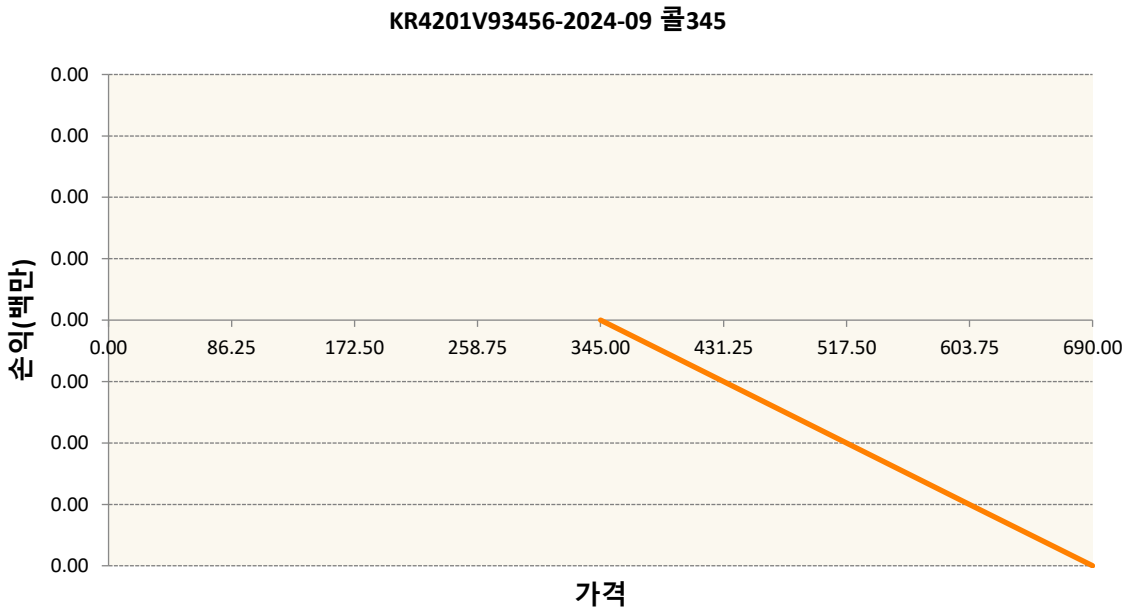
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

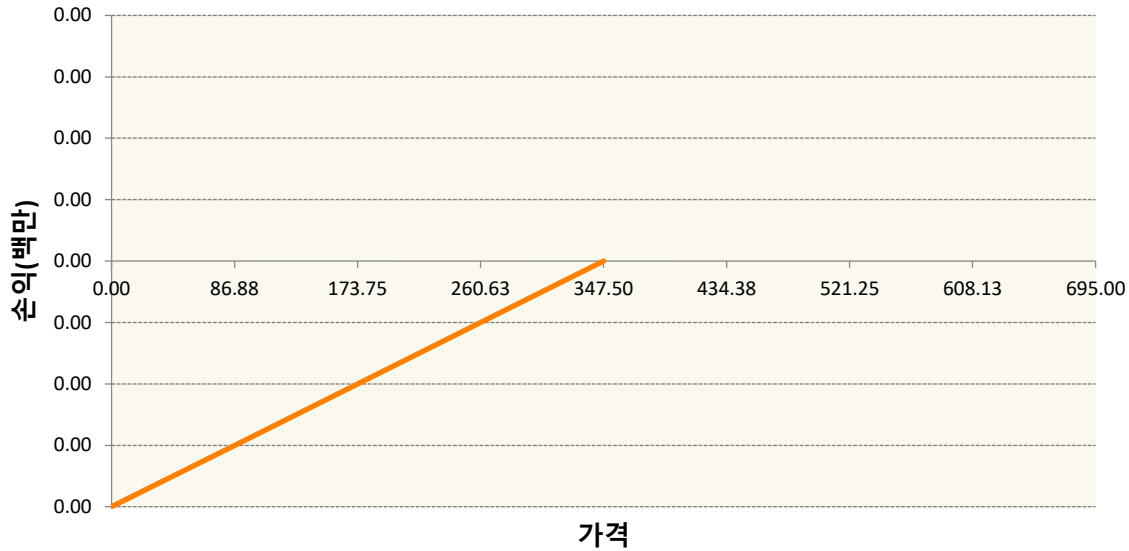
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	39,524	-39,524	장내

2. 만기시점의 손익구조



KR4301V93470-2024-09 풋347.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201V93456		2024-09 콜345					781
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	142	142	141	141	140	138	137
-5.33%	140	139	136	133	129	124	118
-2.67%	124	117	108	99	88	78	66
0%	45	30	15	0	-15	-30	-46
2.67%	-149	-162	-175	-189	-203	-217	-231
5.33%	-438	-443	-449	-457	-465	-474	-483
8.00%	-764	-765	-766	-769	-772	-776	-781
KR4201V93472		2024-09 콜347.5					1,132
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	166	166	166	166	165	163	161
-5.33%	165	164	162	158	154	148	141
-2.67%	151	142	132	120	107	93	78
0%	65	44	22	0	-22	-45	-67
2.67%	-185	-207	-230	-253	-276	-300	-323
5.33%	-601	-611	-624	-638	-654	-670	-688
8.00%	-1,095	-1,098	-1,102	-1,107	-1,114	-1,122	-1,132
KR4301V93470		2024-09 풋347.5					520
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-519	-519	-519	-519	-519	-519	-520
-5.33%	-327	-328	-328	-329	-331	-332	-334
-2.67%	-140	-142	-146	-149	-154	-158	-164
0%	22	15	8	0	-8	-16	-23

2.67%	122	114	106	98	90	82	73
5.33%	156	153	149	144	139	133	128
8.00%	163	162	161	159	157	155	152

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

(단위:백만원)

2,591

공시일	2024-09-09
기준일	2024-09-06

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	1,207	0	1,207	

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	2024-09-09
기준일	2024-09-06

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	4,199	0	4,199	

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	2024-09-09
기준일	2024-09-06

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	14,373	0	14,373	
누계	통화	선도	266	14,139	-13,873	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213E6SC KRW/USD 30-09-24E	356
FXW213E7W KRW/USD 31-10-24E	218
FXW213E8V(KRW/USD 29-11-24E	558
FXW213E8X(USD/KRW 30-09-24E	21
IE00BD8RGM75	

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

518

공시일	2024-09-09
기준일	2024-09-06

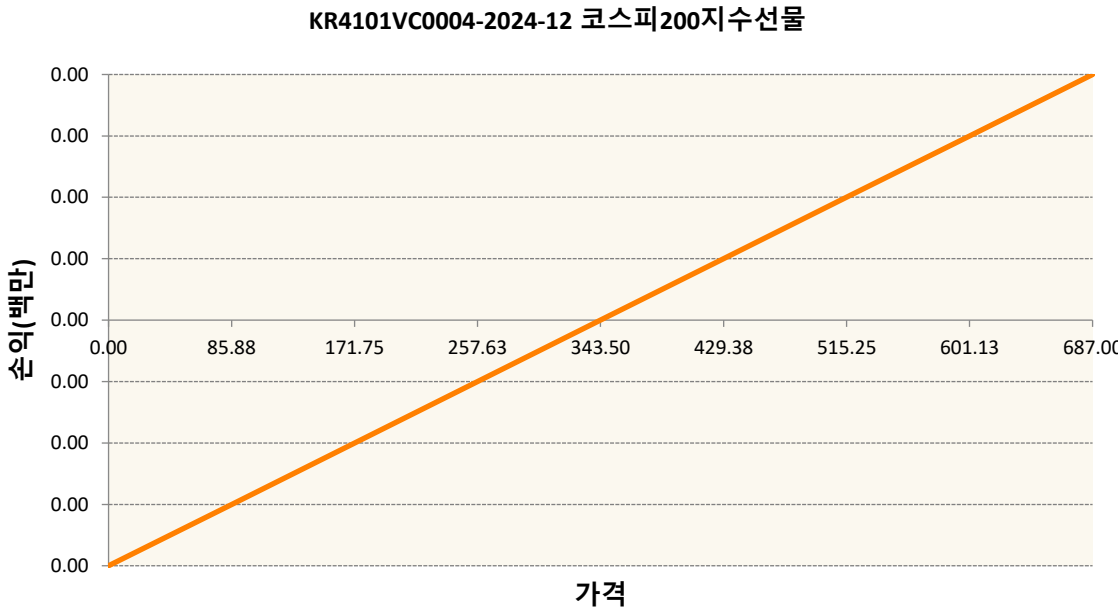
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

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	687	0	687	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101VC0004			2024-12 코스피200지수선물				55
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-55	-55	-55	-55	-55	-55	-55
-5.33%	-37	-37	-37	-37	-37	-37	-37
-2.67%	-18	-18	-18	-18	-18	-18	-18
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	18	18	18	18	18	18	18
5.33%	37	37	37	37	37	37	37
8.00%	55	55	55	55	55	55	55

공시일	2024-09-09
기준일	2024-09-06

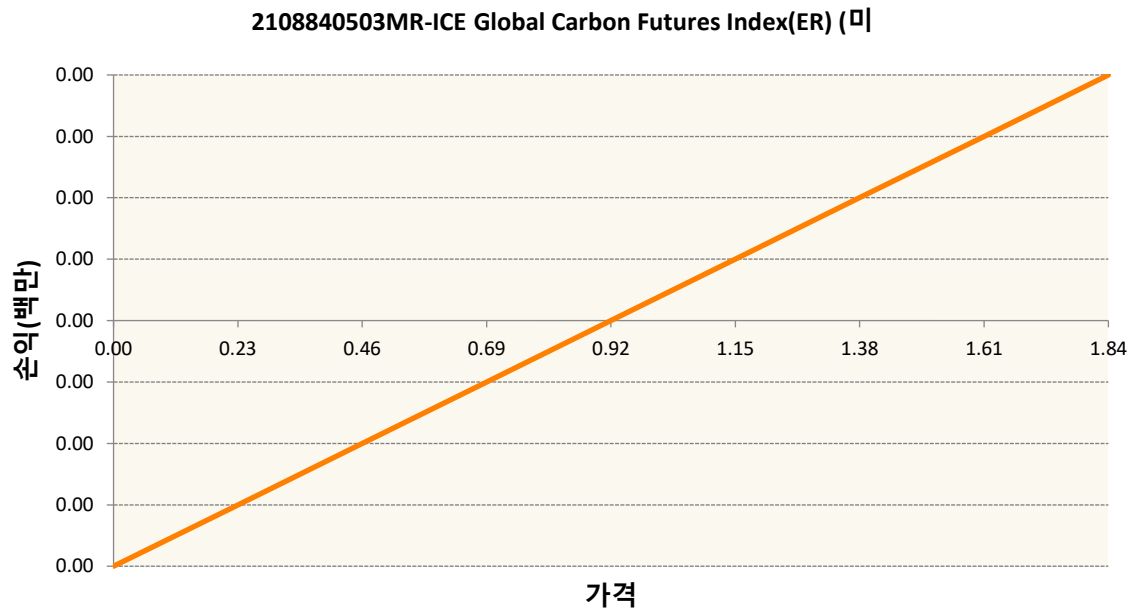
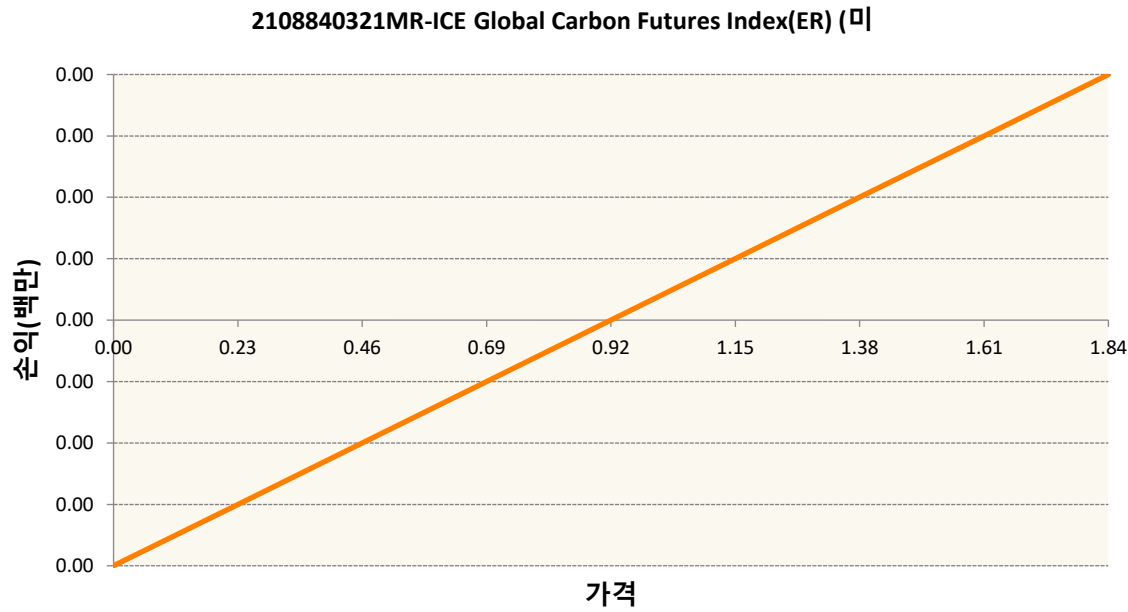
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

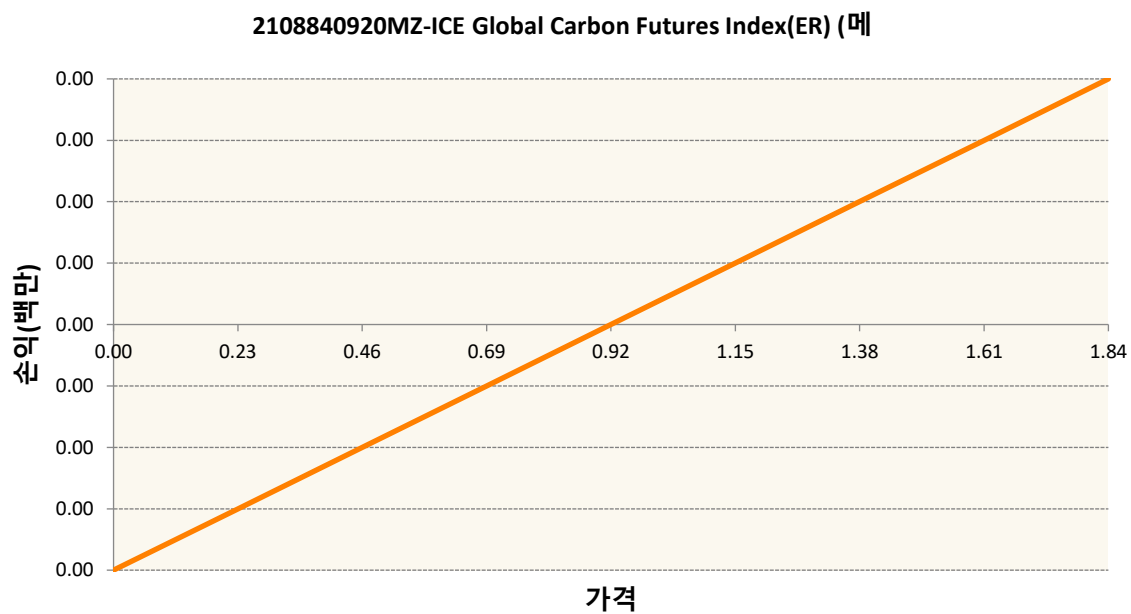
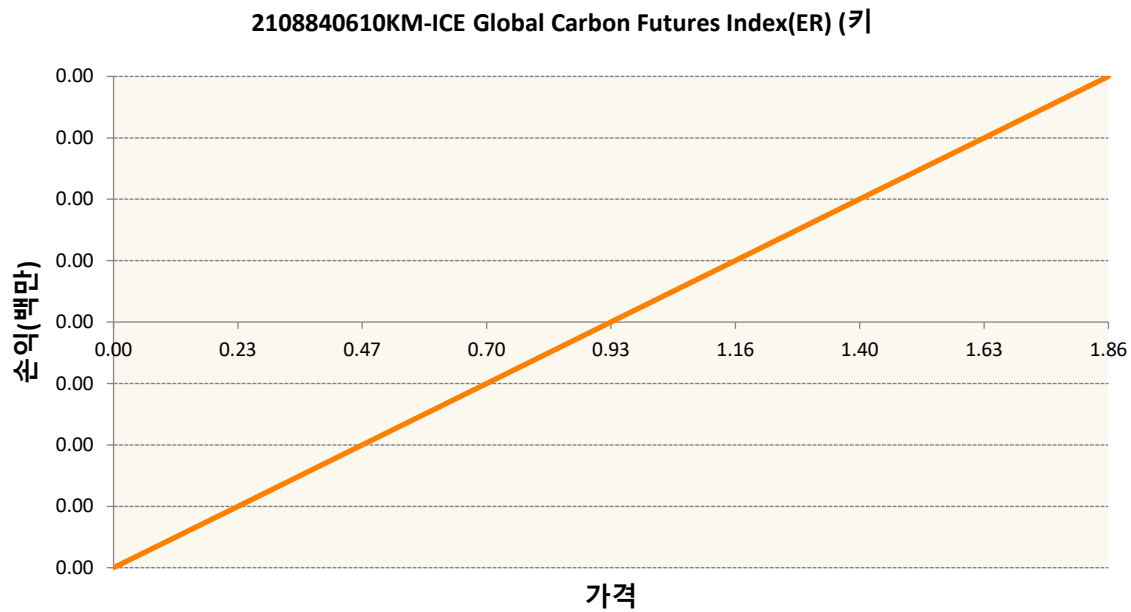
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	15,297	0	15,297	

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108840321IICE Global Carbon Futures Index(ER) (미)		471
2108840503IICE Global Carbon Futures Index(ER) (미)		188
2108840610IICE Global Carbon Futures Index(ER) (키)		377
2108840920IICE Global Carbon Futures Index(ER) (메)		188

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,327

공시일	2024-09-09
기준일	2024-09-06

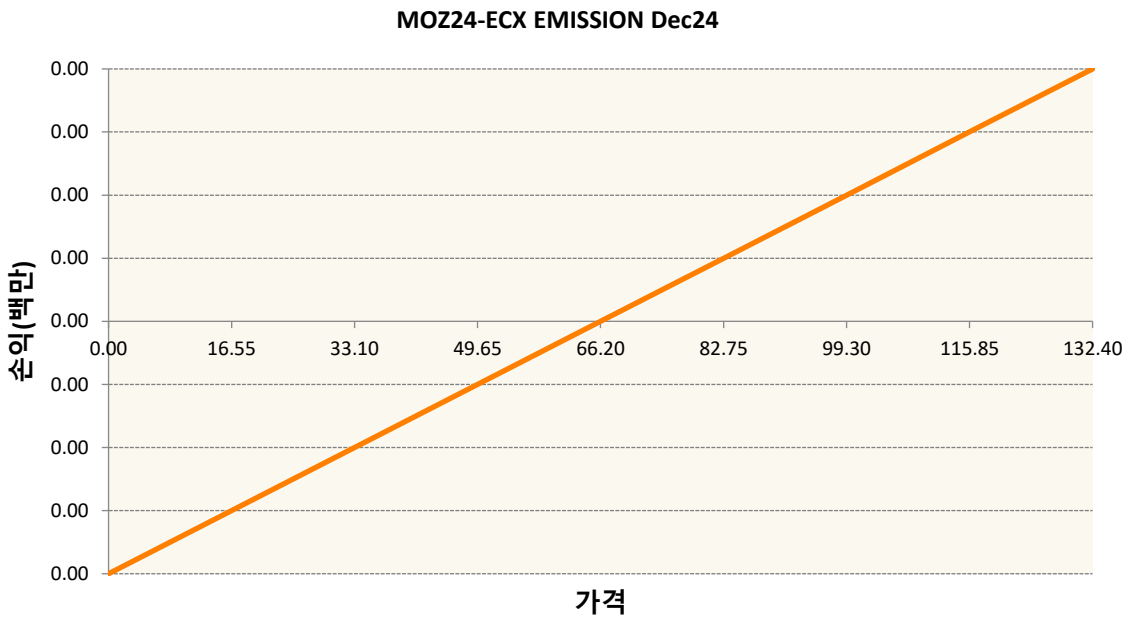
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	8,887	0	8,887	
누계	지수	스왑	373	0	373	장외
누계	통화	선도	0	1,875	-1,875	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	711
SWICEUACN ICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX	1

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

(단위:백만원)

1,280

공시일	2024-09-09
기준일	2024-09-06

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)	16
SWCSI00000 신한CSI Index 240620 (메리츠)	16
SWCSI00000 신한CSI Index 240620 (NH)	11

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

(단위:백만원)

73

공시일	2024-09-09
기준일	2024-09-06

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)	19
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(NH)	16
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(메리츠)	23
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(키움)	5

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

(단위:백만원)

72

공시일	2024-09-09
기준일	2024-09-06

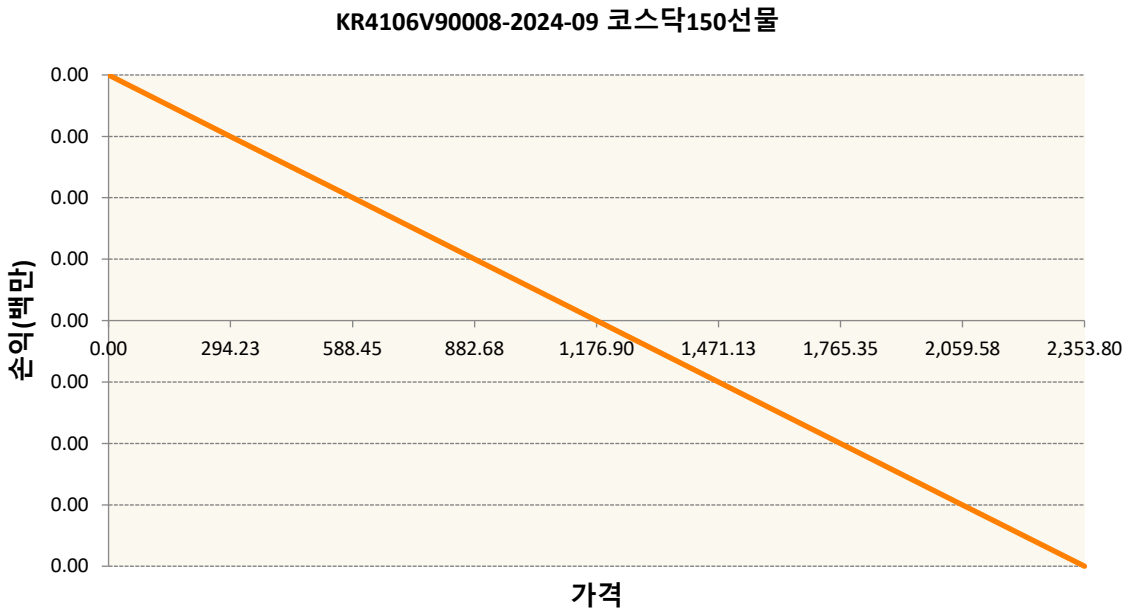
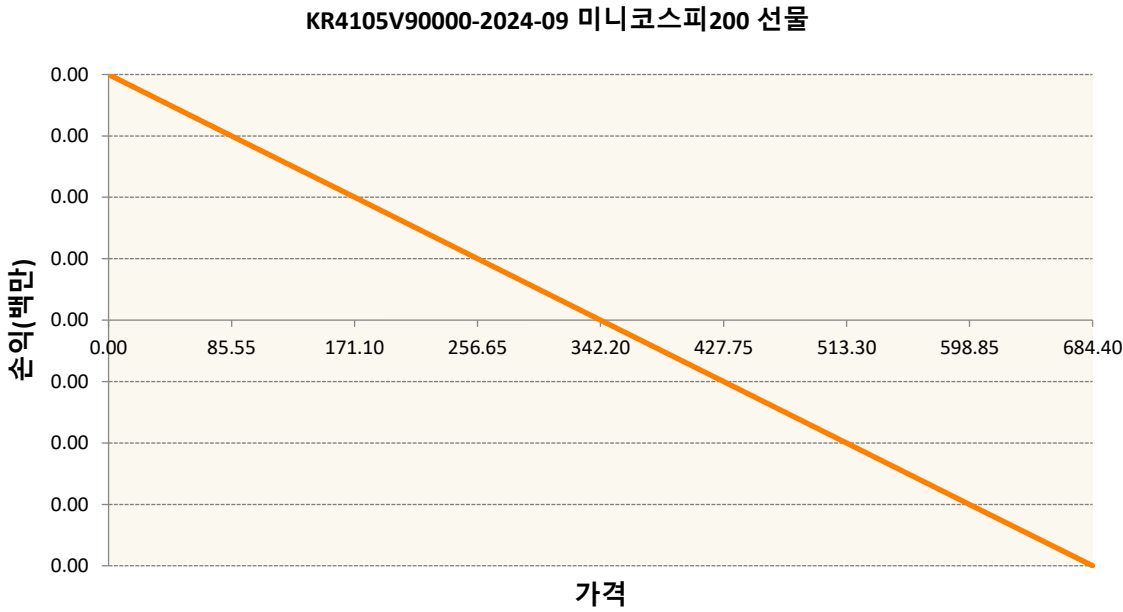
에퀴티알파일반사모혼합자산

1. 계약금액

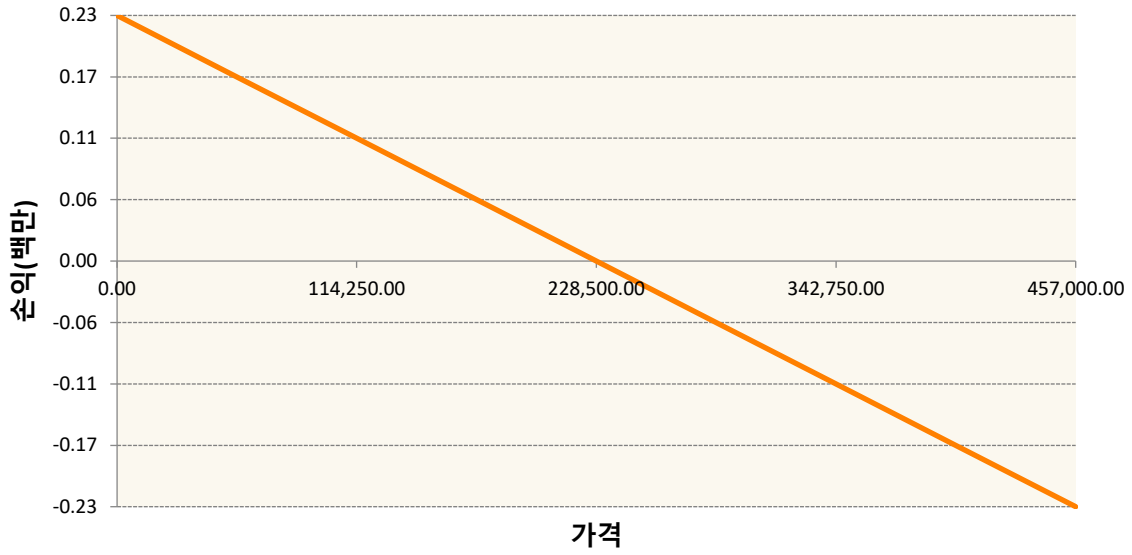
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	86	-86	장내
누계	유가증권	선물	9	1,319	-1,310	장내

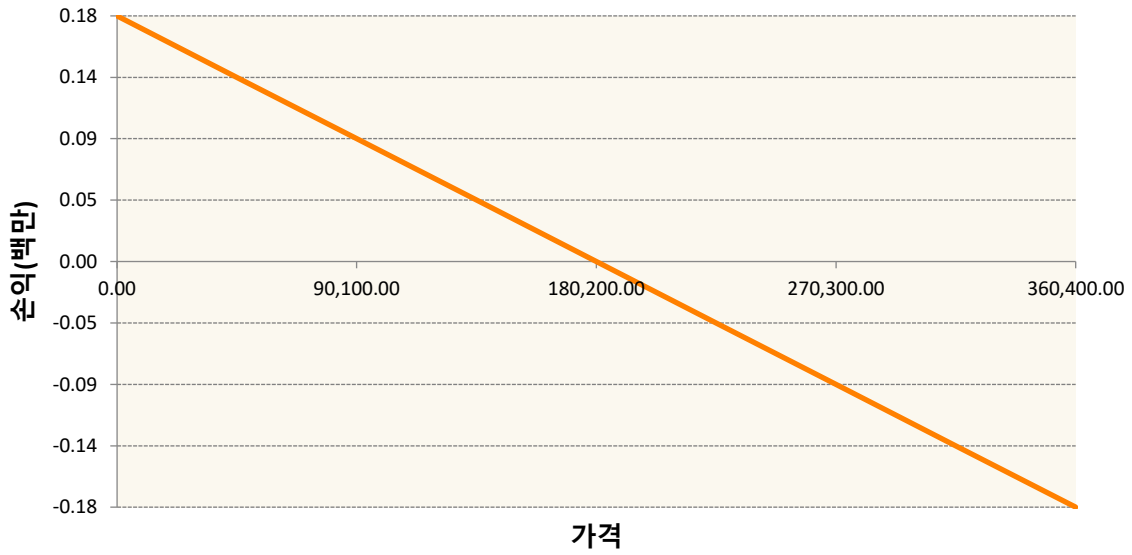
2. 만기시점의 손익구조



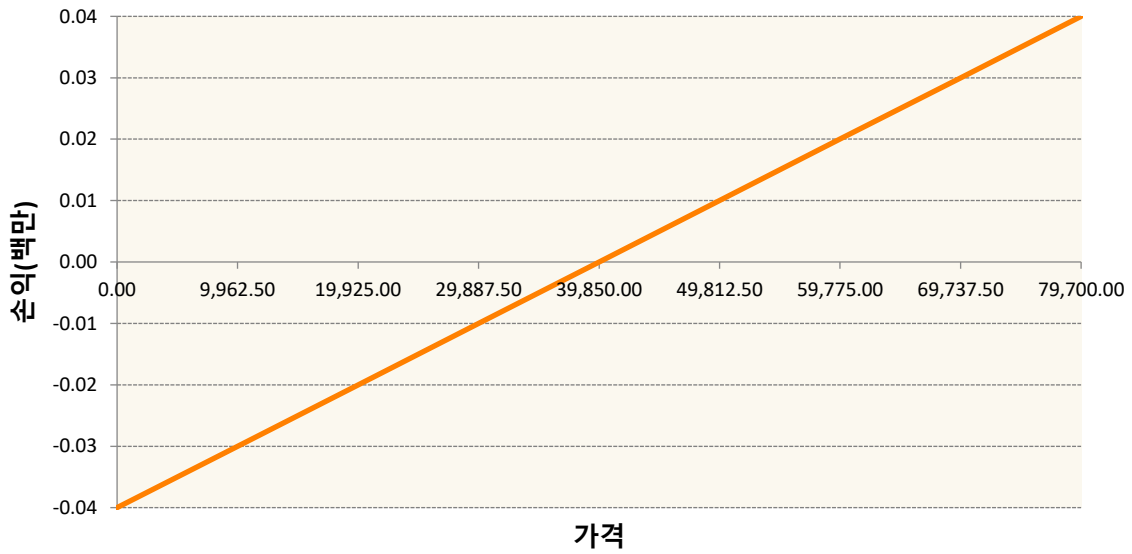
KR4116V90007-2024-09 현대차개별선물



KR41BJV90008-2024-09 엔씨소프트개별선물



KR41GNV90009-2024-09 금양개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
KR4105V900 2024-09 미니코스피200 선물		19
KR4106V900 2024-09 코스닥150선물		5
KR4116V900 2024-09 현대차개별선물		4
KR41BJV900 2024-09 엔씨소프트개별선물		1
KR41GNV900 2024-09 금양개별선물		1

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	43

공시일	2024-09-09
기준일	2024-09-06

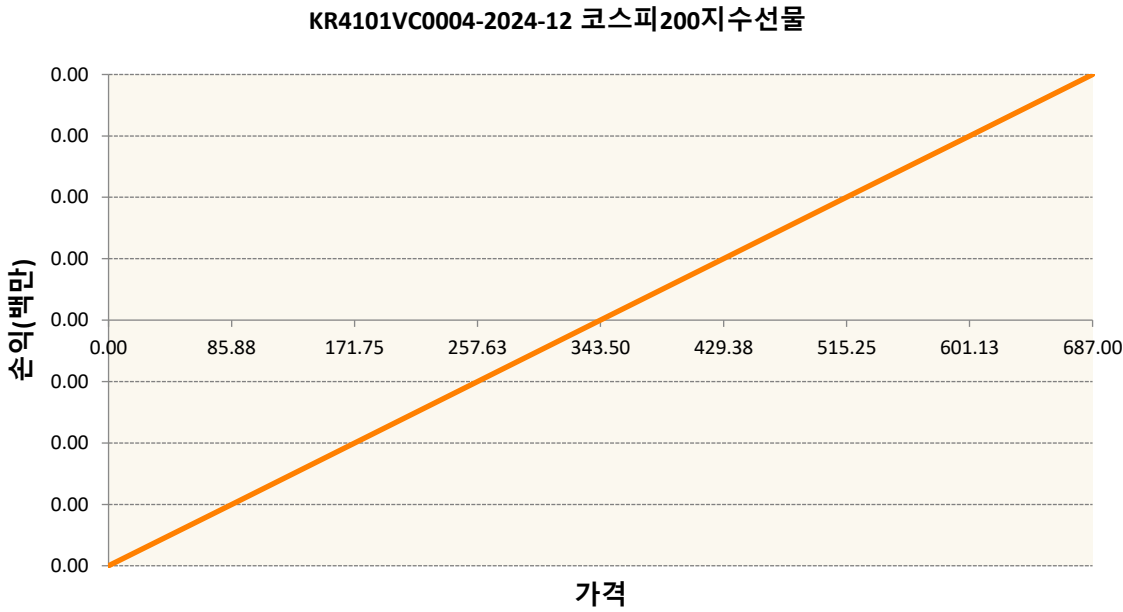
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

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	6,269	0	6,269	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101VC0004		2024-12 코스피200지수선물					500
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-500	-500	-500	-500	-500	-500	-500
-5.33%	-333	-333	-333	-333	-333	-333	-333
-2.67%	-167	-167	-167	-167	-167	-167	-167
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	167	167	167	167	167	167	167
5.33%	333	333	333	333	333	333	333
8.00%	500	500	500	500	500	500	500

공시일	2024-09-09
기준일	2024-09-06

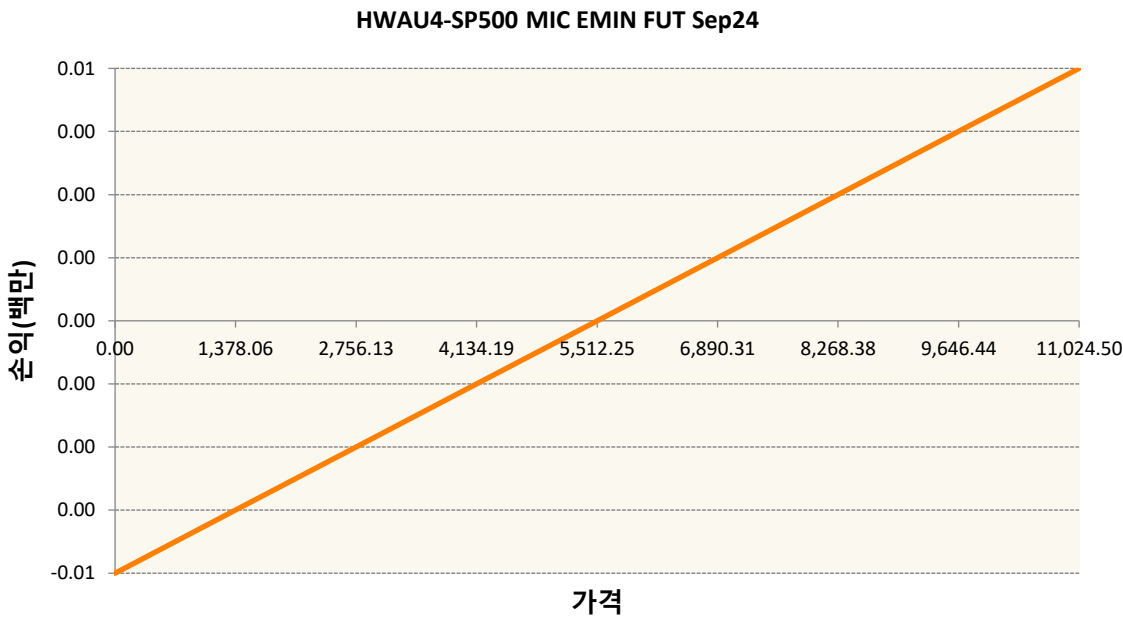
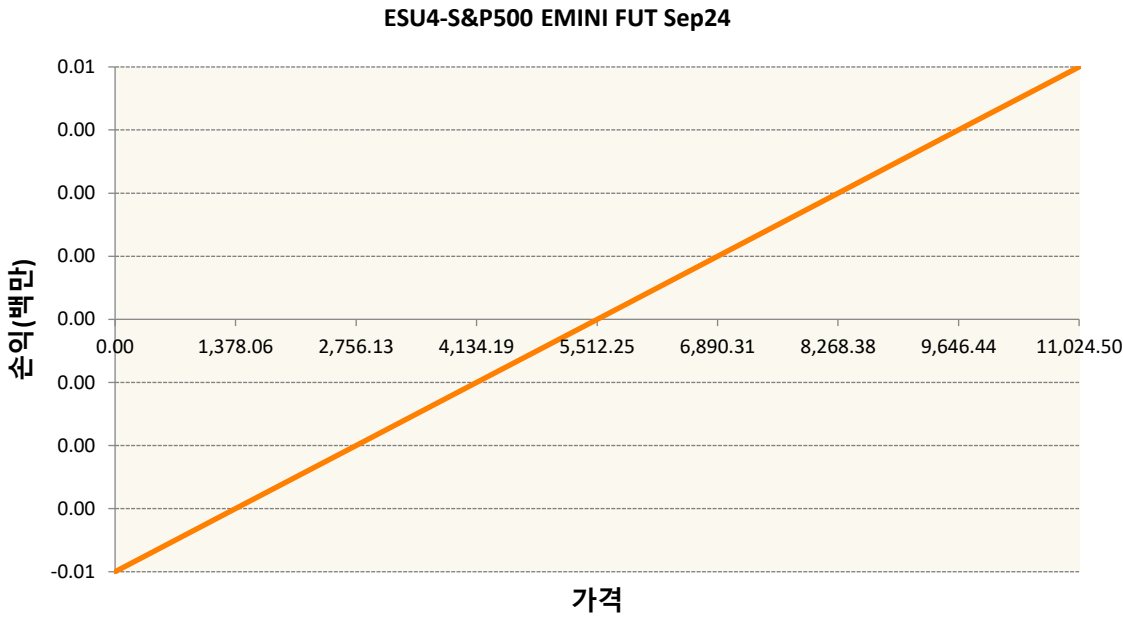
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

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	10,985	0	10,985	
누계	유가증권	선물	1,711	0	1,711	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESU4	S&P500 EMINI FUT Sep24	879
HWAU4	SP500 MIC EMIN FUT Sep24	137

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	619

공시일	2024-09-09
기준일	2024-09-06

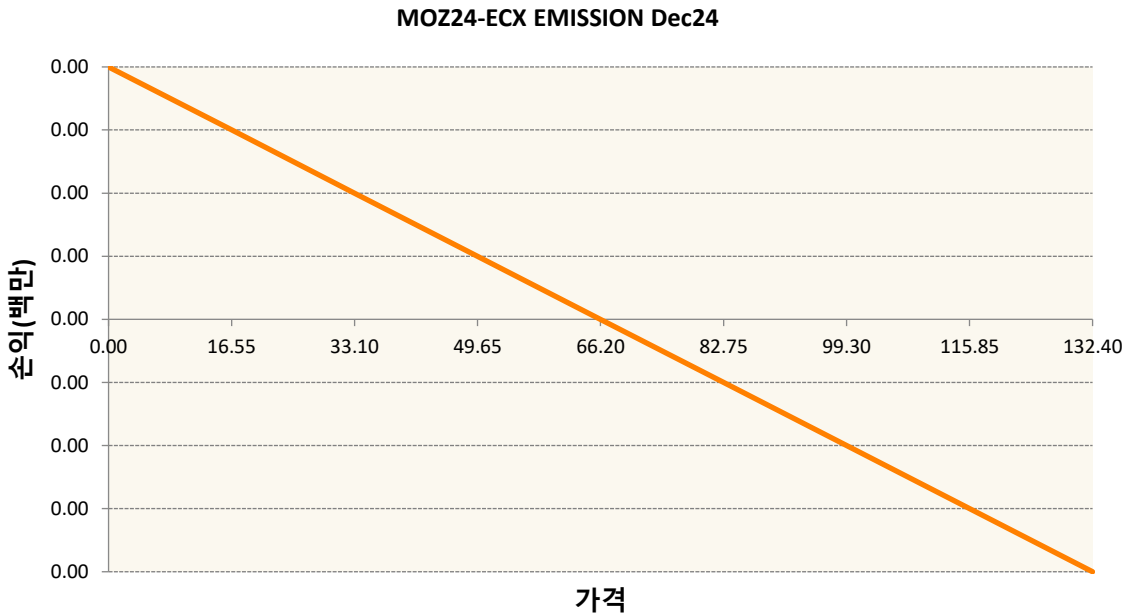
SOL유럽탄소배출권선물인버스ICE특별자산상

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	6,489	-6,489	
누계	지수	스왑	373	0	373	장외
누계	통화	선도	0	1,093	-1,093	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213E8V(KRW/EUR 30-09-24E	87
MOZ24 ECX EMISSION Dec24	519
SWICEUACN ICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX	1

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

(단위:백만원)

923

공시일	2024-09-09
기준일	2024-09-06

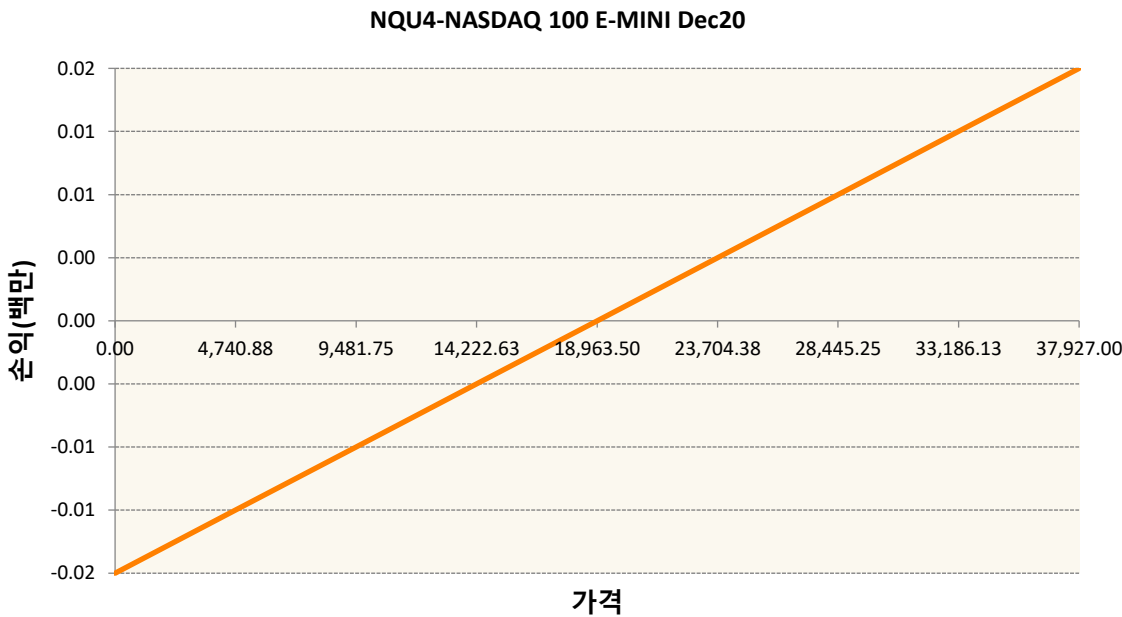
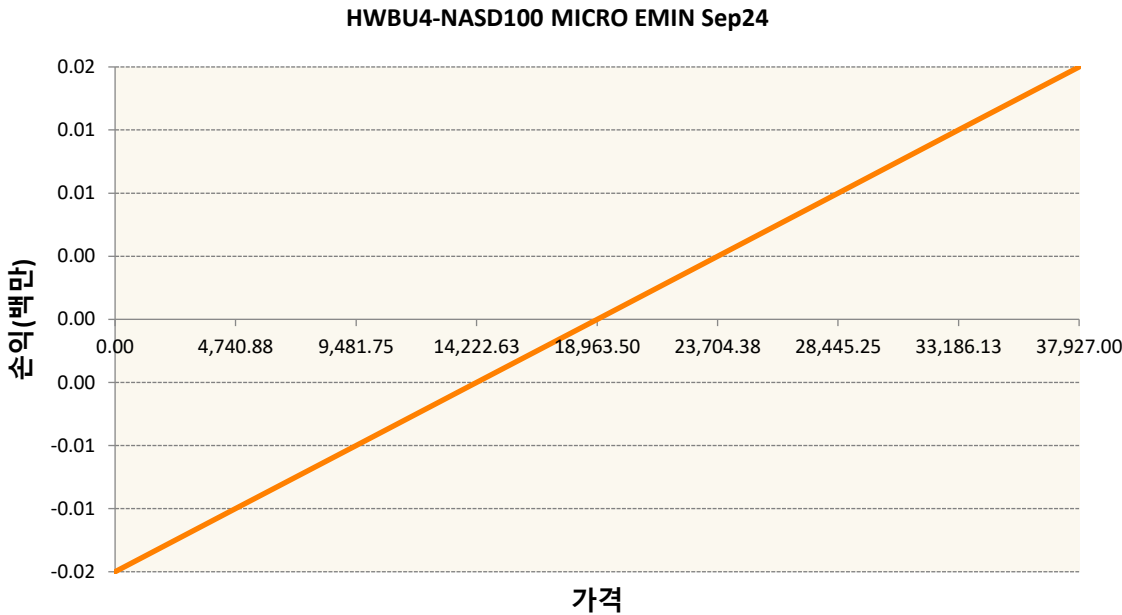
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

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	5,753	0	5,753	
누계	유가증권	선물	1,523	0	1,523	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HWBU4	NASD100 MICRO EMIN Sep24	122
NQU4	NASDAQ 100 E-MINI Dec20	460

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	467

공시일	2024-09-09
기준일	2024-09-06

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	4,887
SWKEDI0000 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	6,383
SWKEDI0000 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	713
SWKEDI0000 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	3,329

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

(단위:백만원)

9,052

공시일	2024-09-09
기준일	2024-09-06

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	7
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	7
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	7
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	7

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

(단위:백만원)

31

공시일	2024-09-09
기준일	2024-09-06

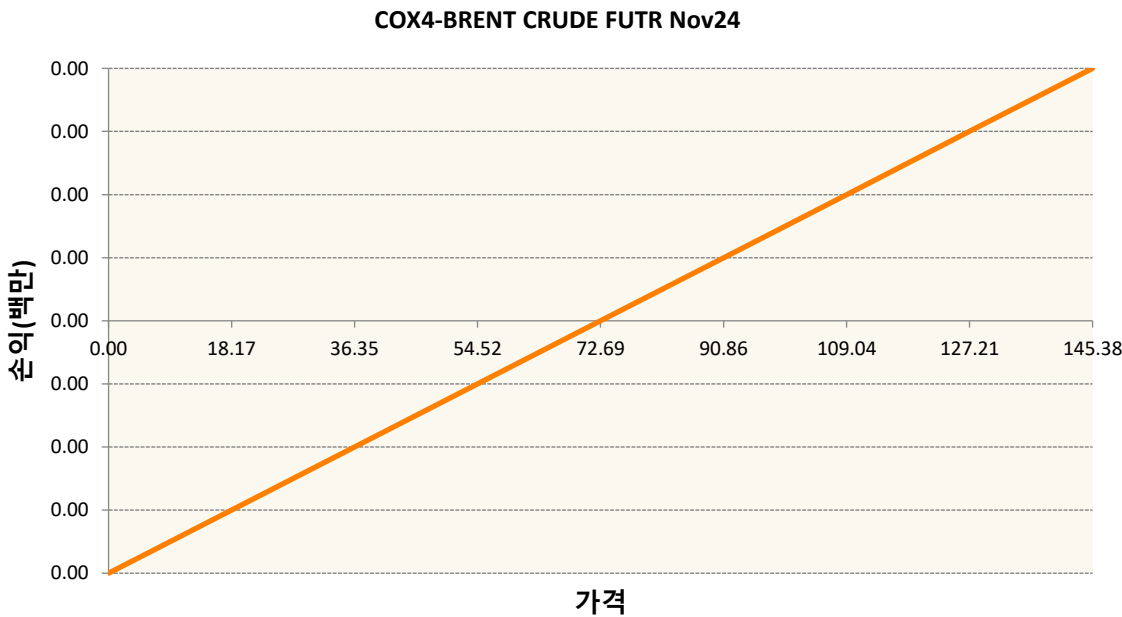
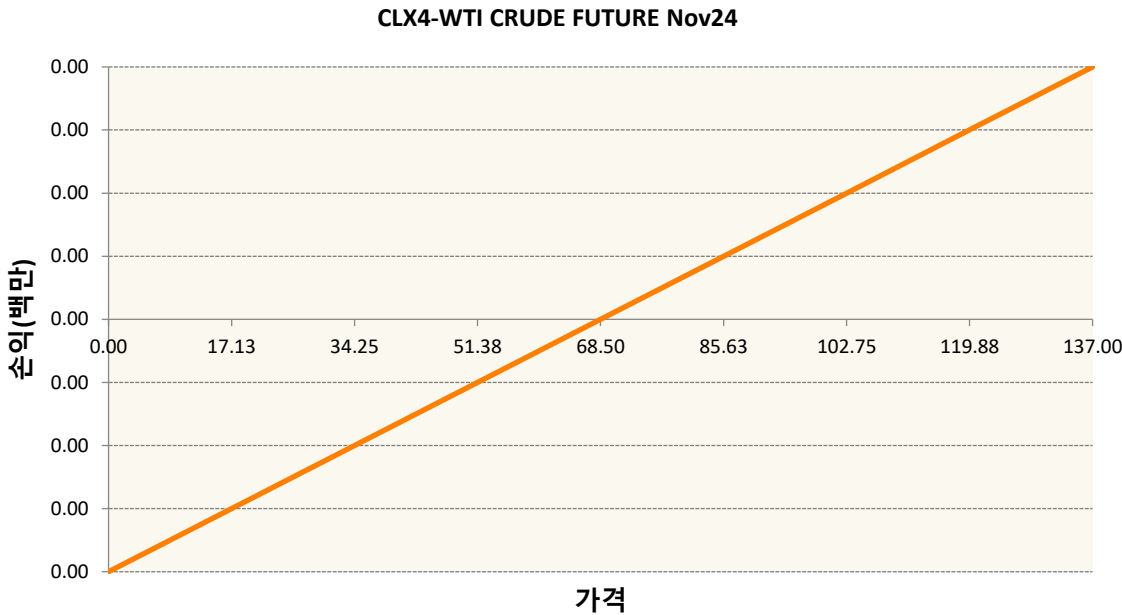
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

1. 계약금액

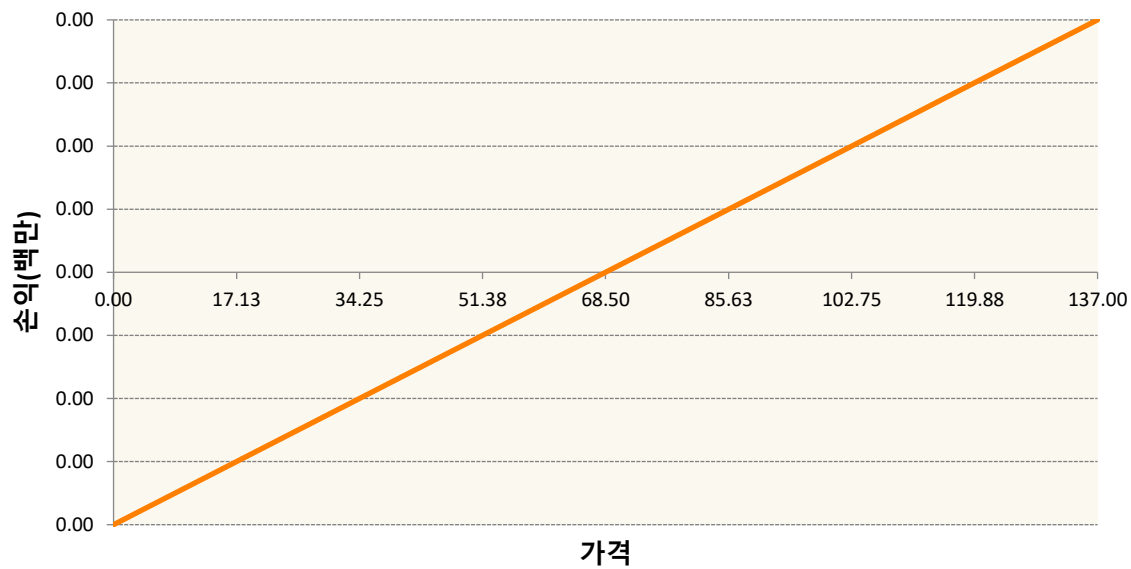
(단위:백만원)

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	814	0	814	
누계	통화	선물	0	93	-93	장내

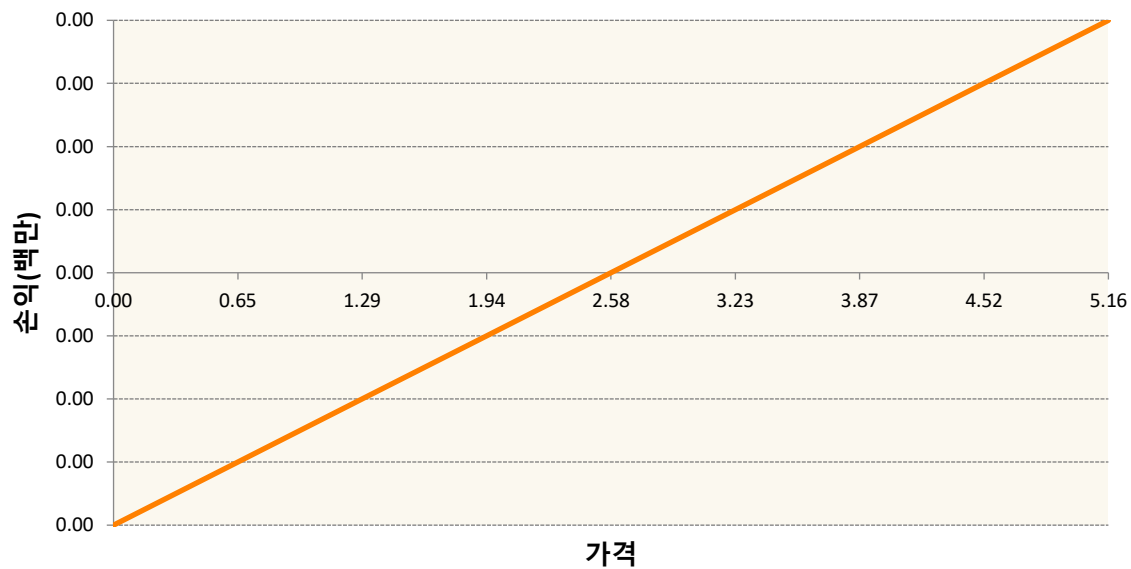
2. 만기시점의 손익구조



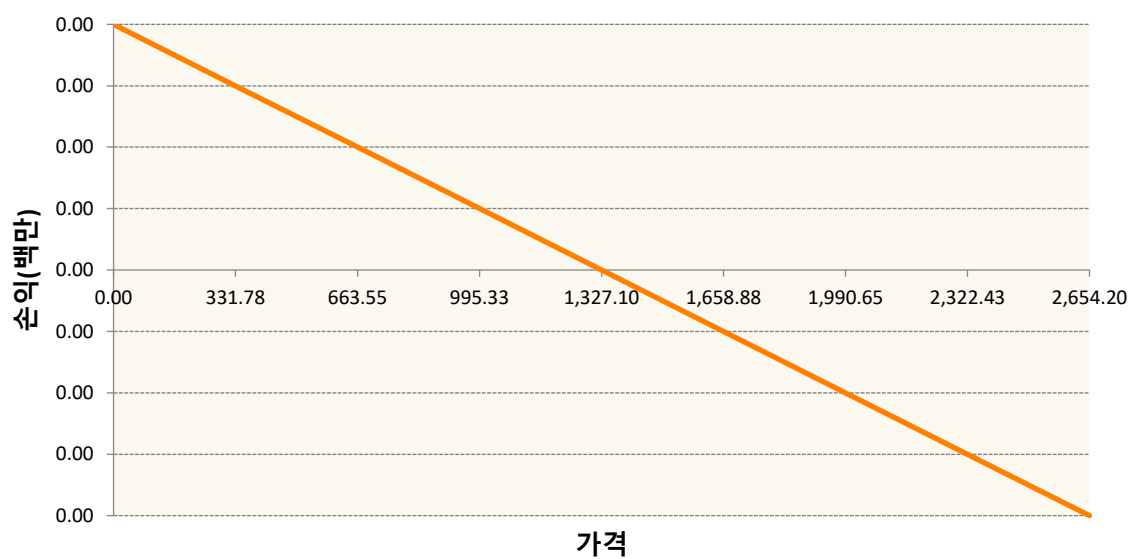
ECX4-E-mini Crude Oil Nov24



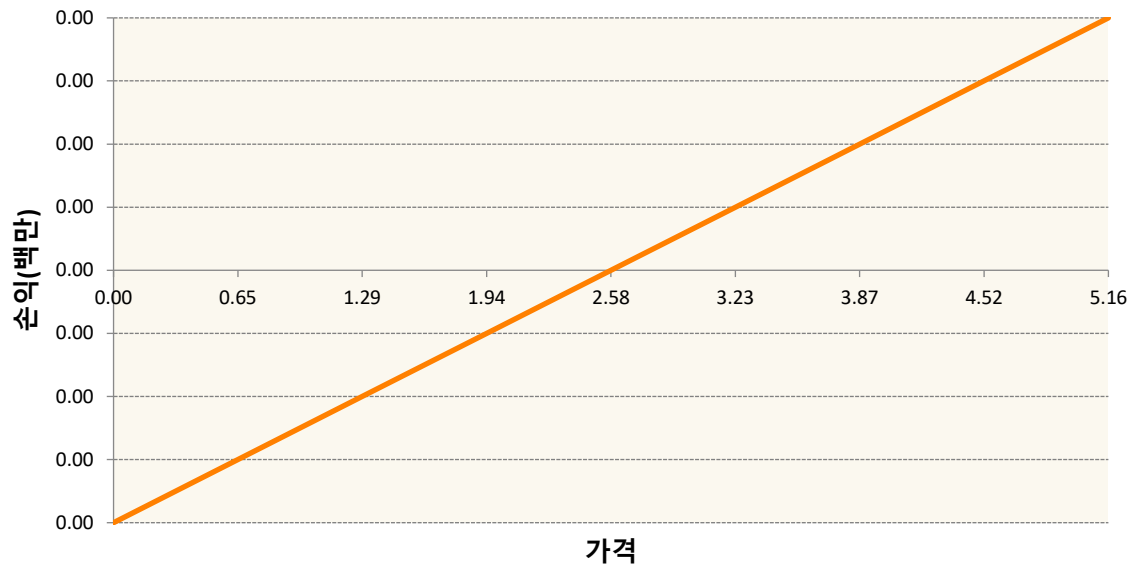
EOX4-E-MINI NATURAL GA Nov24



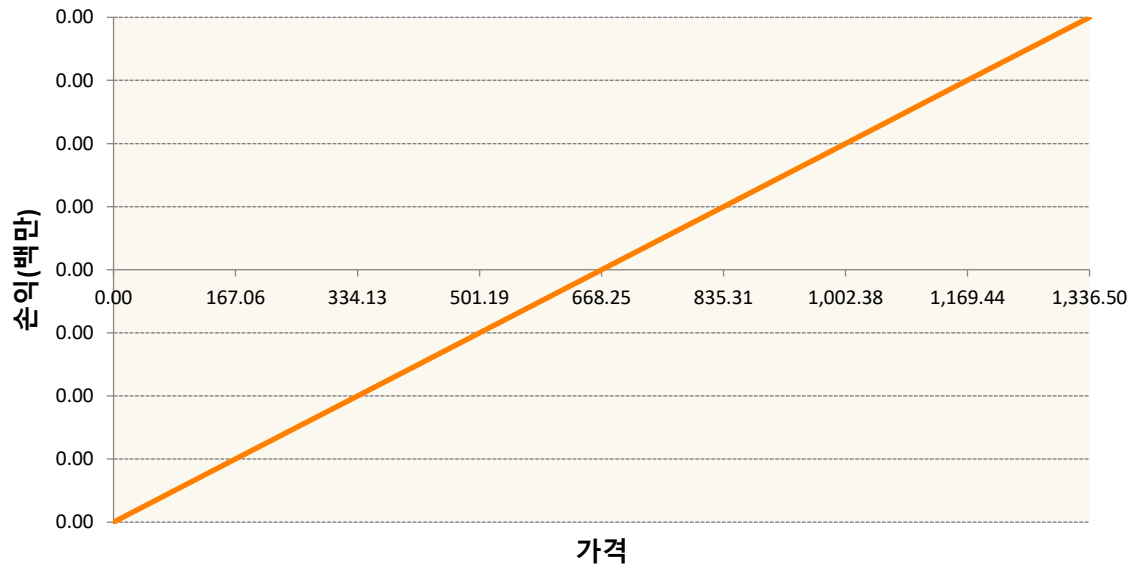
KR4175V90003-2024-09 달러선물



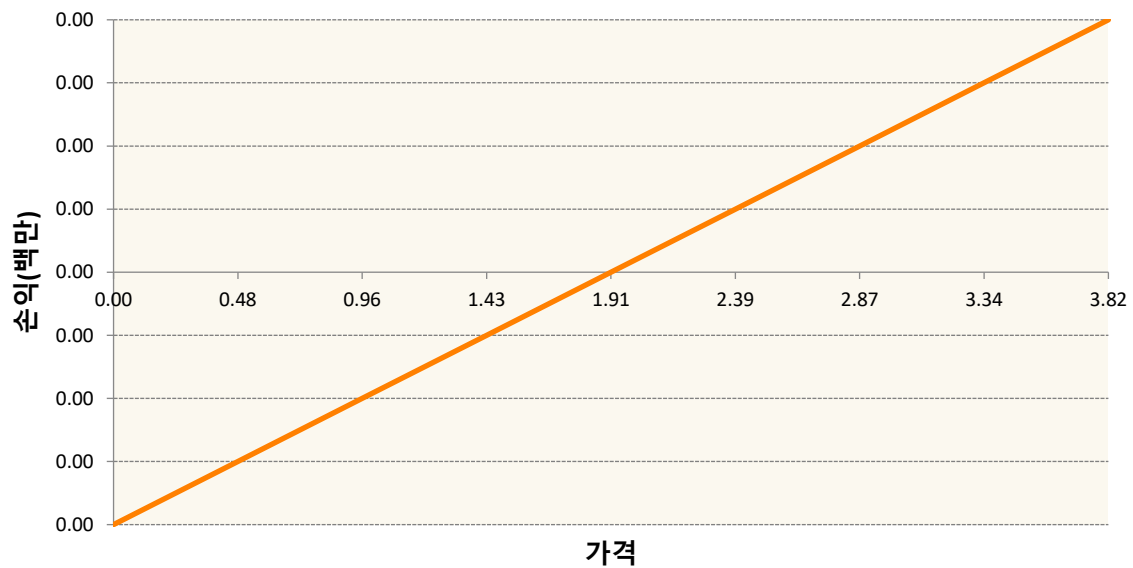
NGX24-NATURAL GAS FUTR Nov24



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	16
ECX4	E-mini Crude Oil Nov24	8
EOX4	E-MINI NATURAL GA Nov24	3
KR4175V900 2024-09 달러선물		7
NGX24	NATURAL GAS FUTR Nov24	14
QSX4	Low Su Gasoil G Nov24	7
XBX4	GASOLINE RBOB FUT Nov24	9

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

137