

공시일	2023-12-04
기준일	2023-12-01

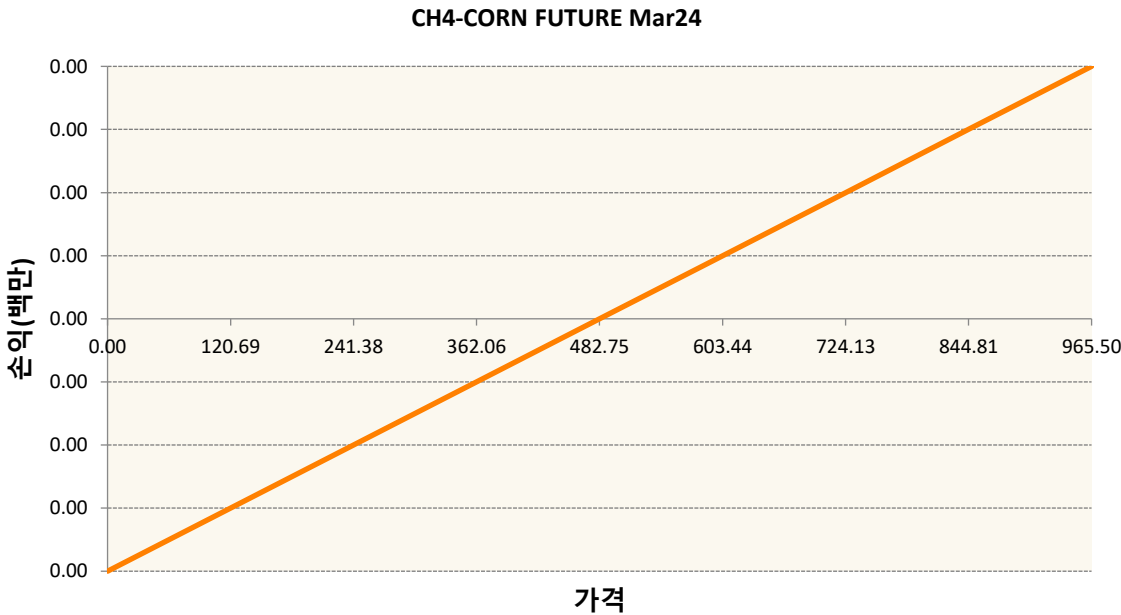
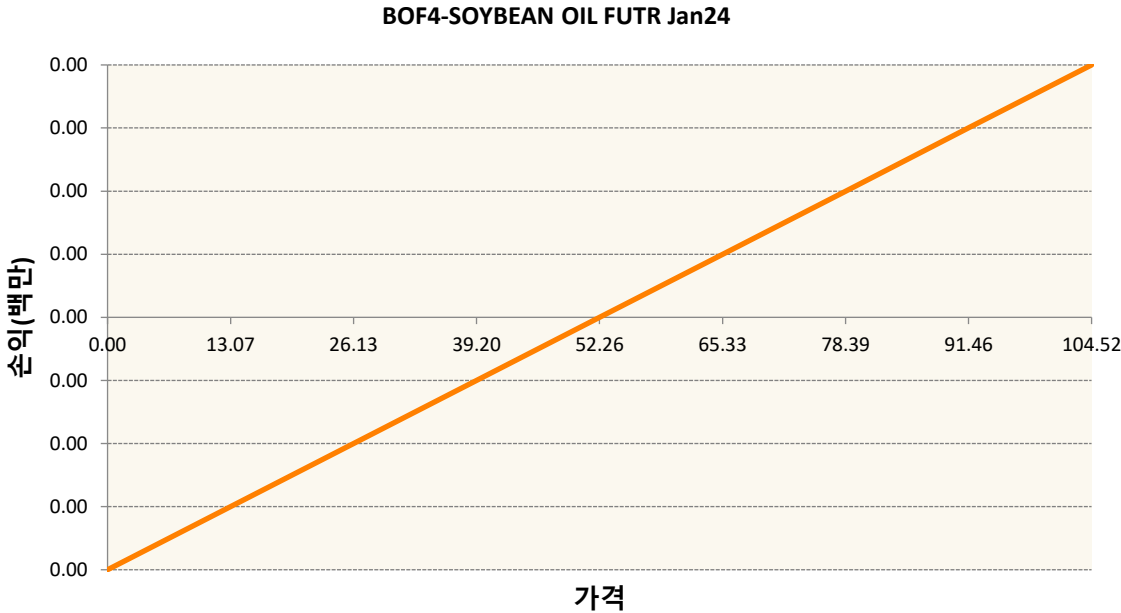
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

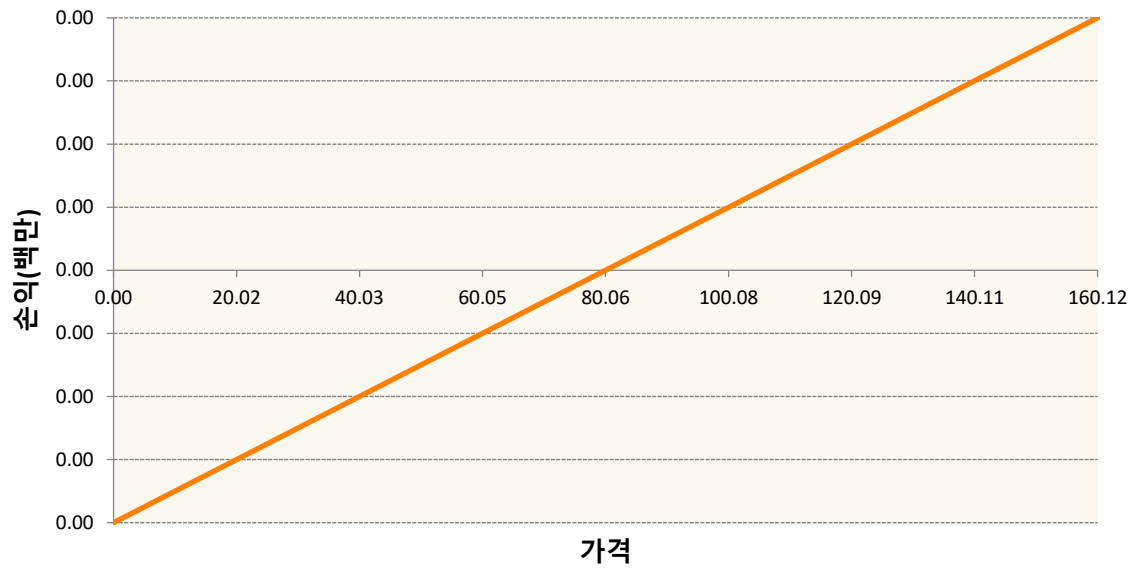
(단위:USD 백만)

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	5,021	0	5,021	
누계	통화	선물	0	548	-548	장내

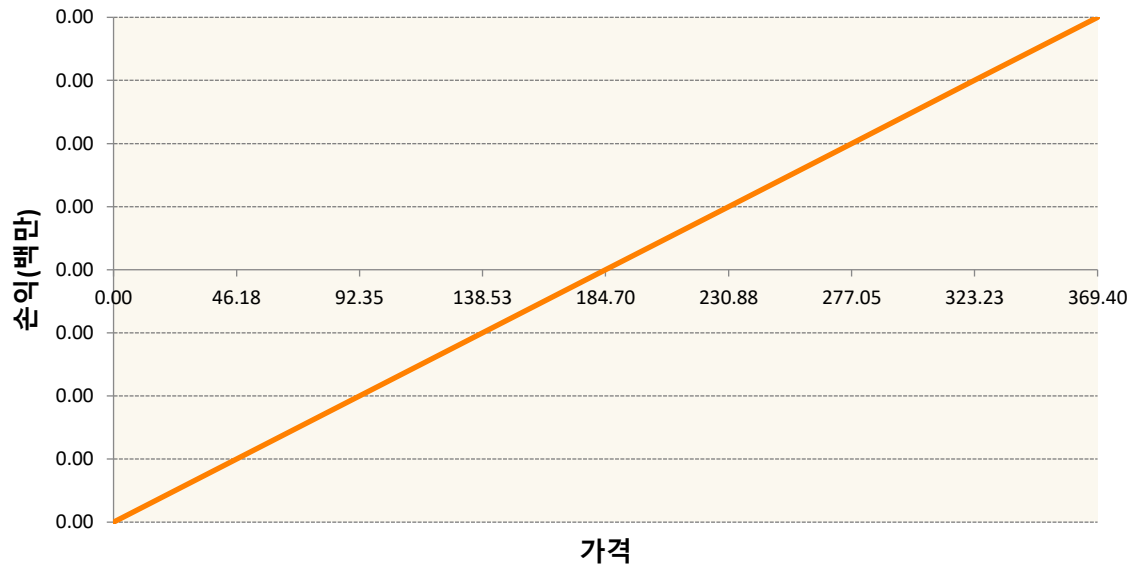
2. 만기시점의 손익구조



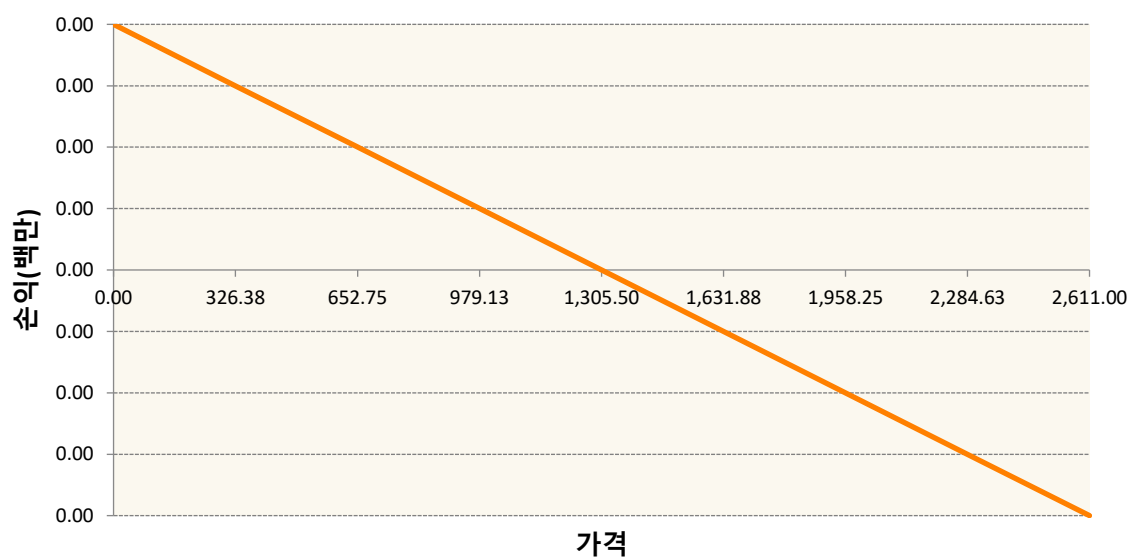
CTH4-COTTON NO.2 FUTR Mar24



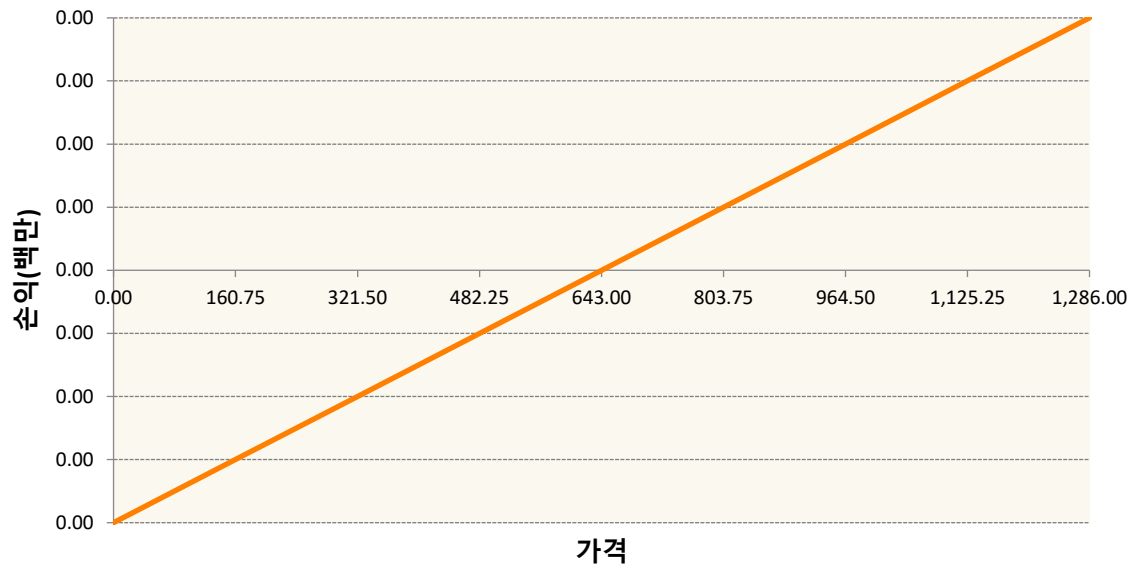
KCH4-COFFEE 'C' FUTURE Mar24



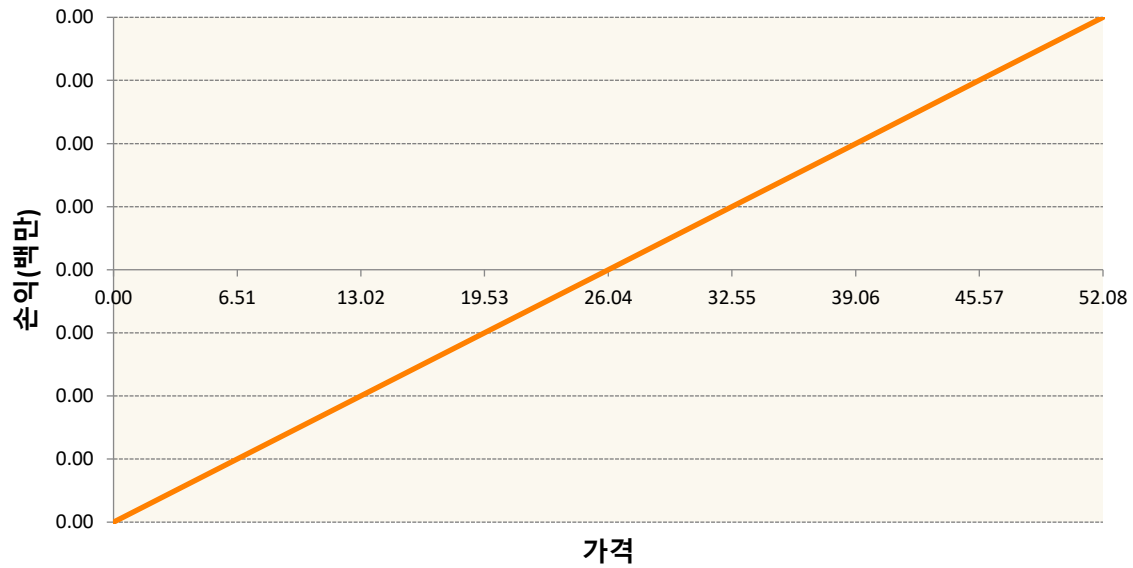
KR4175TC0009-2023-12 달러선물



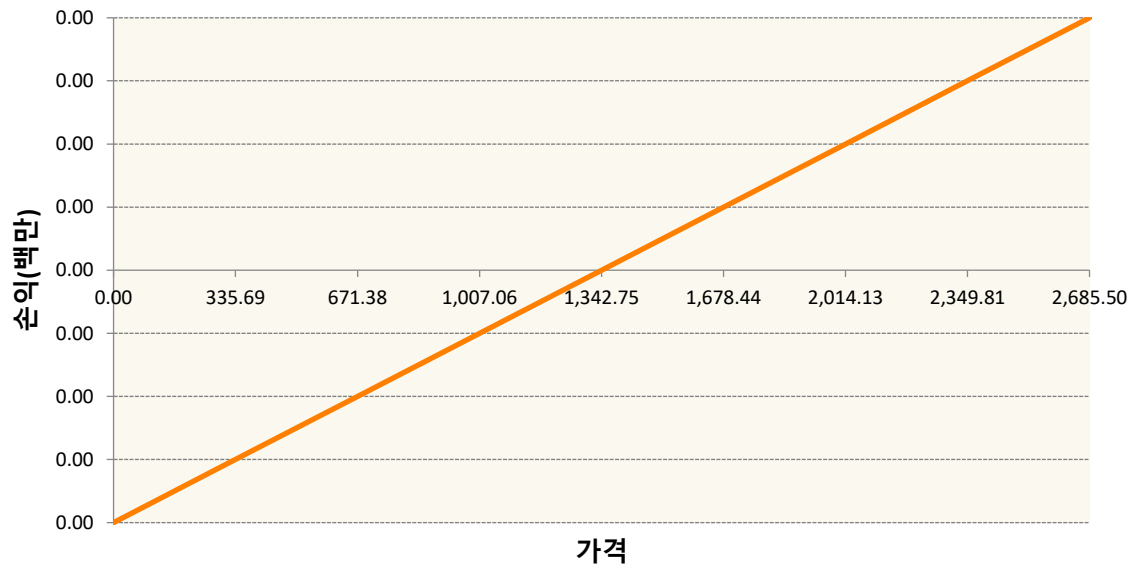
KWH4-KC HRW WHEAT FUT Mar24



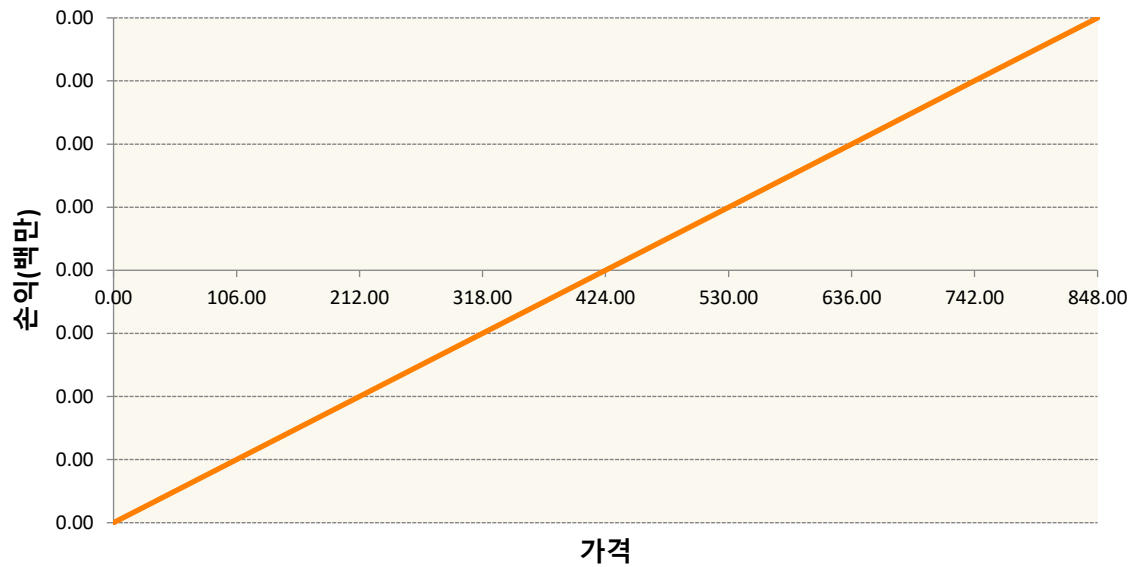
SBH4-Sugar #11 (WORLD) Mar24



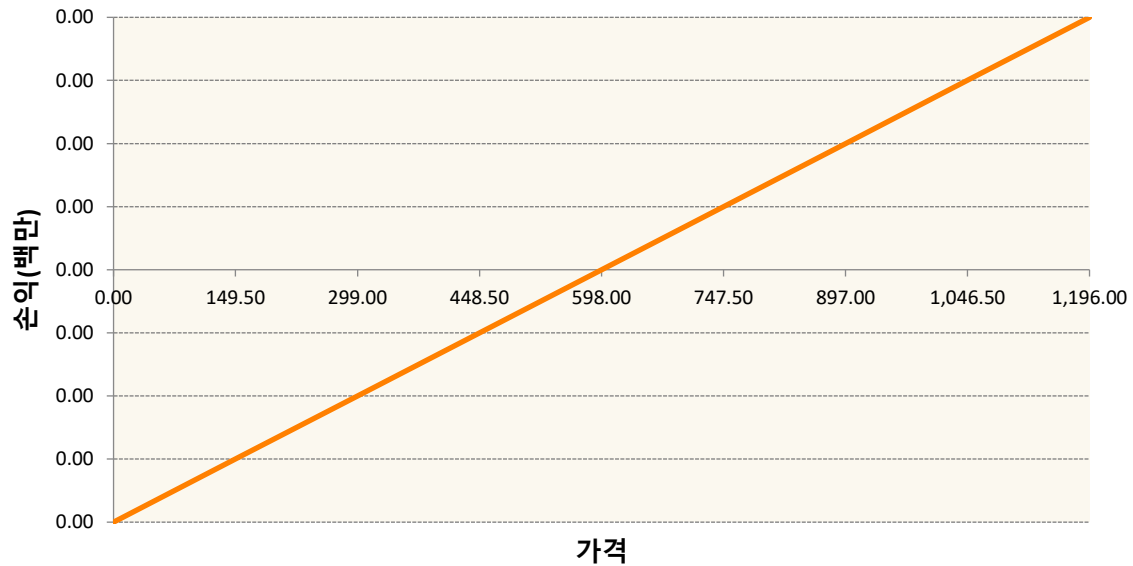
SF4-SOYBEAN FUTURE Jan24



SMF4-SOYBEAN MEAL FUTR Jan24



WH4-WHEAT FUTURE(CBT) Mar24



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

공시일	2023-12-04
기준일	2023-12-01

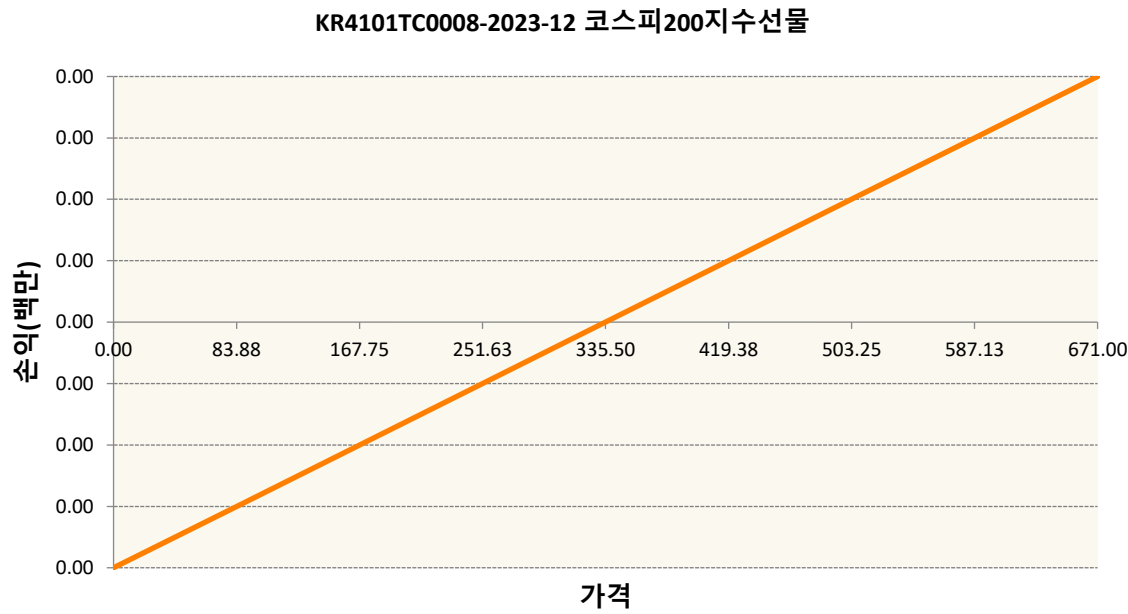
스마트인덱스모

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	1,845	0	1,845	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101TC0008			2023-12 코스피200지수선물				147
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-147	-147	-147	-147	-147	-147	-147
-5.33%	-98	-98	-98	-98	-98	-98	-98
-2.67%	-49	-49	-49	-49	-49	-49	-49
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	49	49	49	49	49	49	49
5.33%	98	98	98	98	98	98	98
8.00%	147	147	147	147	147	147	147

공시일	2023-12-04
기준일	2023-12-01

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	3,903	0	3,903	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 신한CSI500미래230314

317

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

281

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2023-12-04
기준일	2023-12-01

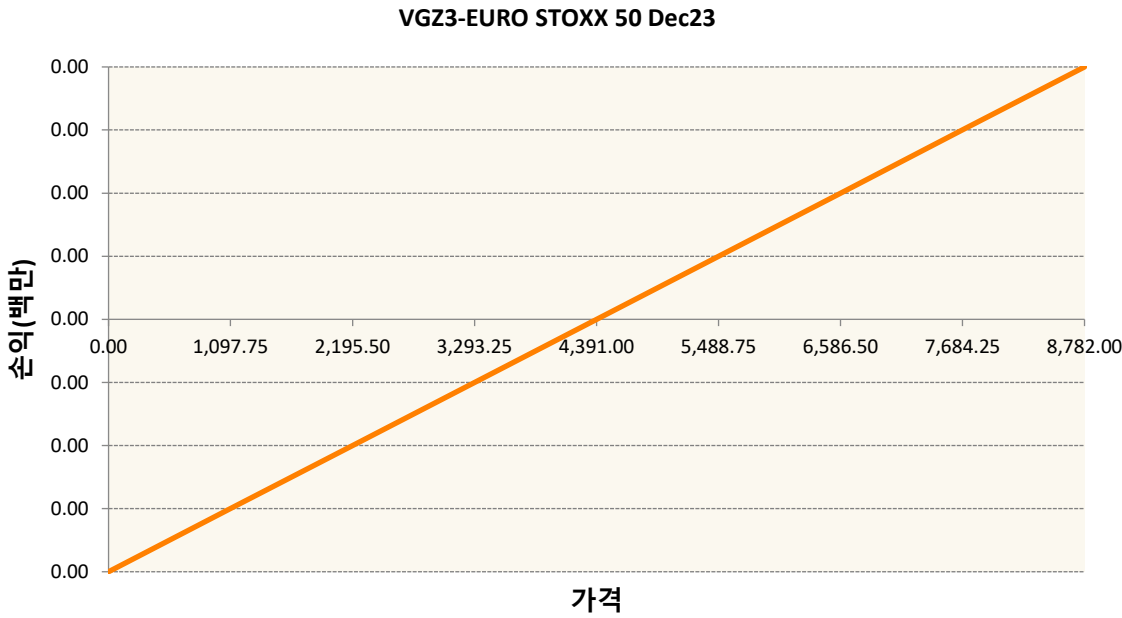
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	937	0	937	
누계	통화	선도	214	0	214	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213D9M EUR/KRW 22-12-23E	17
VGZ3 EURO STOXX 50 Dec23	75

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

(단위:백만원)

71

공시일	2023-12-04
기준일	2023-12-01

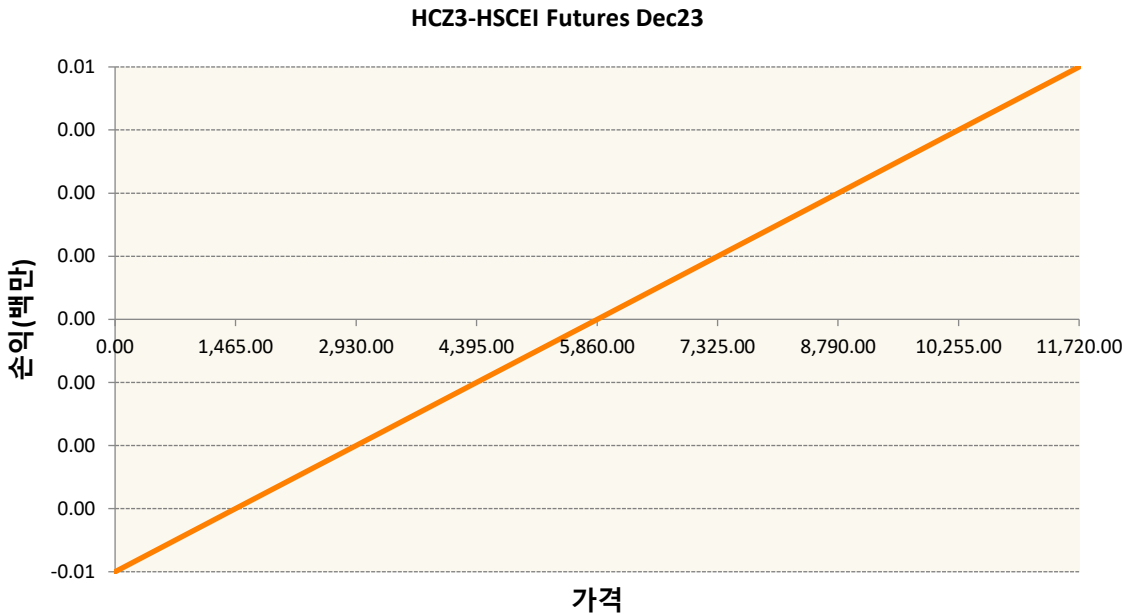
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,118	0	1,118	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCZ3	HSCEI Futures Dec23	89
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

131

공시일	2023-12-04
기준일	2023-12-01

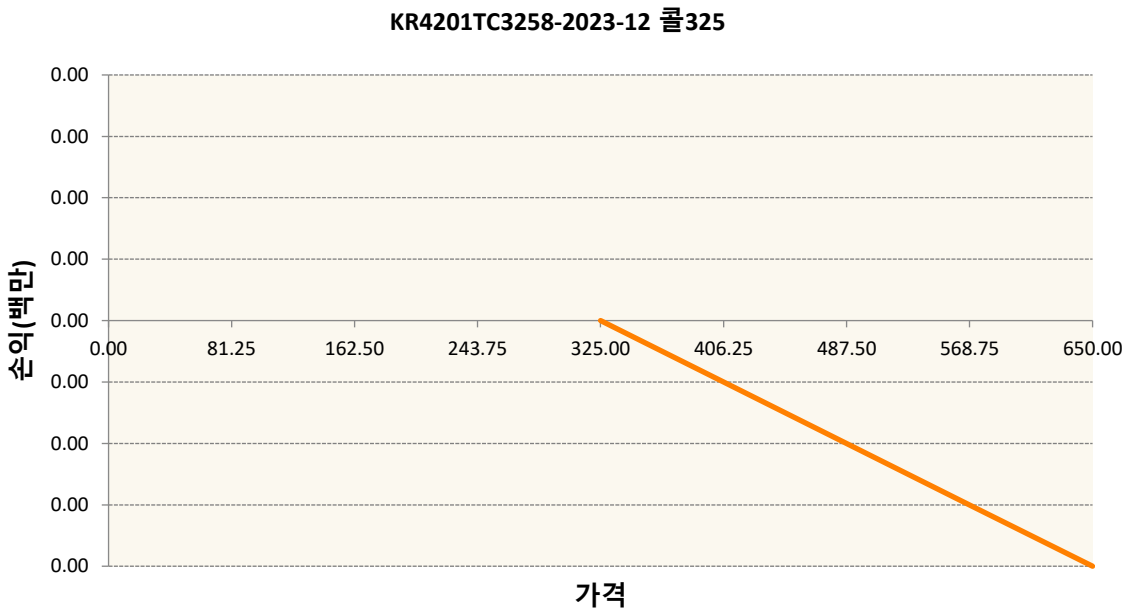
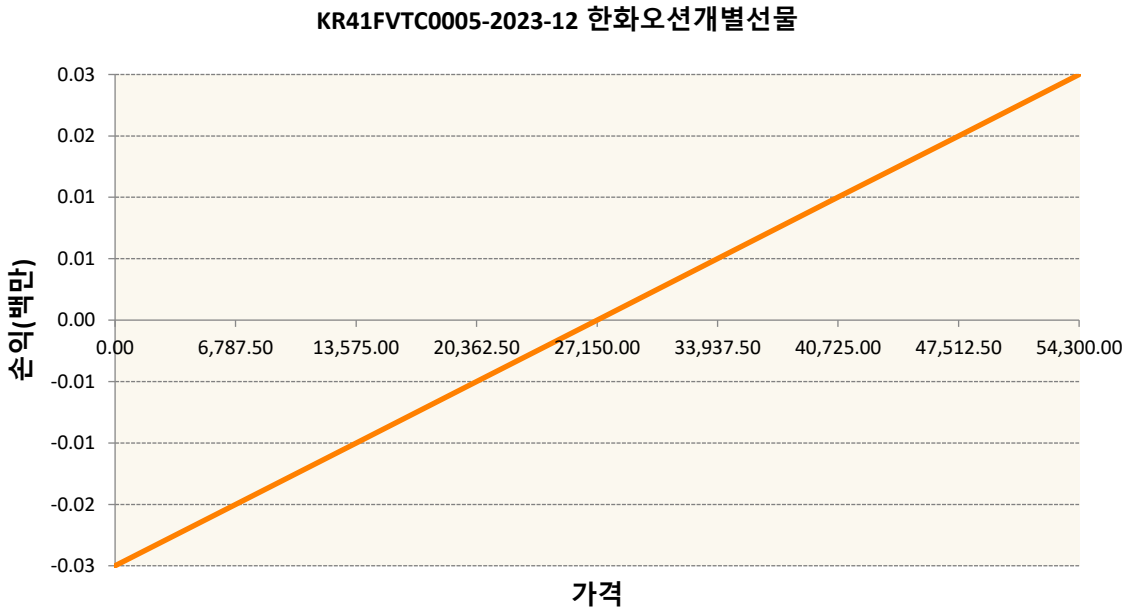
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	34	0	34	장내
누계	유가증권	옵션	0	50,663	-50,663	장내

2. 만기시점의 손익구조



The graph illustrates a linear relationship between price and profit/loss. The x-axis, labeled '가격' (Price), ranges from 0.00 to 655.00. The y-axis, labeled '손익(백만)' (Profit/Loss in millions), ranges from 0.00 to 0.00. A blue line starts at (327.50, 0.00) and ends at (655.00, 0.00).

가격	손익(백만)
327.50	0.00
655.00	0.00

The graph illustrates the relationship between price and net income. The x-axis represents '가격' (Price) and the y-axis represents '순이익 (백만)' (Net Income in millions). The blue line shows that net income is zero for prices up to 325.00.

가격	순이익 (백만)
0.00	0.00
81.25	0.00
162.50	0.00
243.75	0.00
325.00	0.00

(단위:백만원)

KR41FVTC0005		2023-12 한화오션개별선물						3
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-3
-5.33%	-2	-2	-2	-2	-2	-2	-2	-2
-2.67%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1
0%	0	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	1	1	1	1	1	1	1	1
5.33%	2	2	2	2	2	2	2	2
8.00%	3	3	3	3	3	3	3	3
KR4201TC3258		2023-12 콜325						2,725
	기초자산의 변동성							

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,357	1,335	1,309	1,280	1,247	1,212	1,174
-5.33%	1,204	1,157	1,109	1,059	1,008	956	903
-2.67%	812	754	696	638	580	522	463
0%	137	94	48	0	-49	-100	-152
2.67%	-739	-759	-784	-812	-844	-879	-917
5.33%	-1,702	-1,708	-1,718	-1,730	-1,747	-1,766	-1,789
8.00%	-2,690	-2,691	-2,694	-2,698	-2,704	-2,713	-2,725
KR4201TC3274 2023-12 콜327.5							418

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	185	183	180	176	171	167	161
-5.33%	168	162	155	148	140	133	125
-2.67%	119	109	100	91	82	73	64
0%	24	16	8	0	-8	-17	-26
2.67%	-106	-111	-115	-121	-127	-133	-140
5.33%	-255	-257	-259	-261	-265	-268	-273
8.00%	-410	-410	-411	-412	-413	-415	-418

KR4301TC3257 2023-12 풋325							438
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-393	-399	-405	-412	-420	-429	-438
-5.33%	-189	-201	-213	-225	-237	-250	-263
-2.67%	-44	-58	-72	-86	-100	-114	-128
0%	33	23	12	0	-12	-24	-37
2.67%	62	57	51	44	36	27	18
5.33%	69	67	65	62	58	53	48
8.00%	70	70	69	68	66	64	61

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

(단위:백만원)

3,792

공시일	2023-12-04
기준일	2023-12-01

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	1,912	0	1,912	

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	2023-12-04
기준일	2023-12-01

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	4,589	0	4,589	

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	2023-12-04
기준일	2023-12-01

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	17,519	0	17,519	
누계	통화	선도	0	16,682	-16,682	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
FXW213D9R\KRW/USD 29-12-23E		507
FXW213DAT\KRW/USD 31-01-24E		186
FXW213DBV\KRW/USD 29-02-24E		641
IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	699

공시일	2023-12-04
기준일	2023-12-01

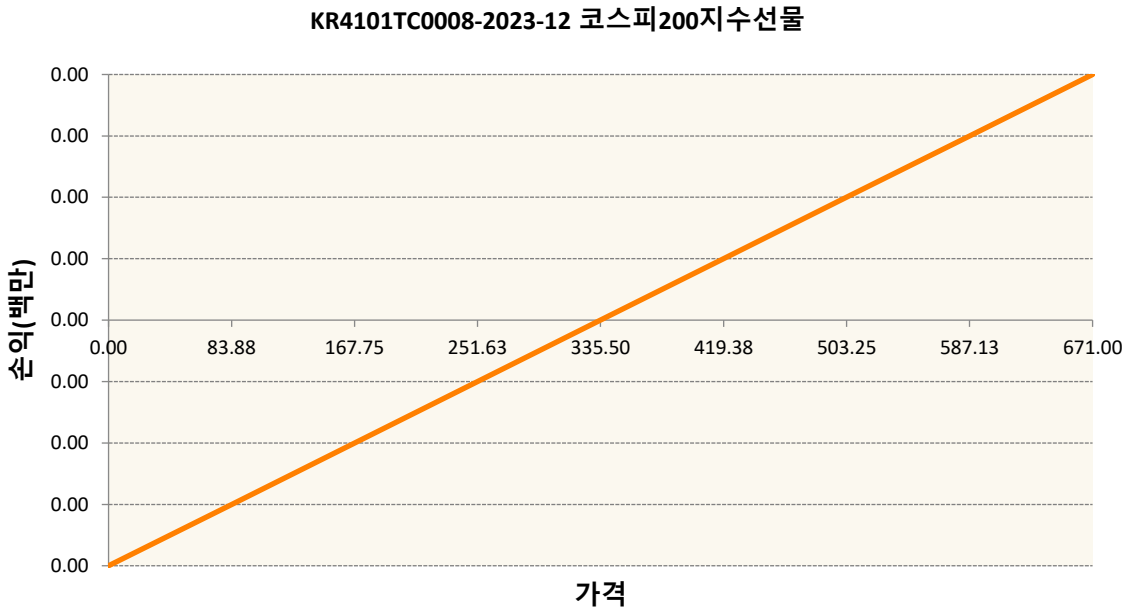
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

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	671	0	671	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101TC0008			2023-12 코스피200지수선물				54
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-54	-54	-54	-54	-54	-54	-54
-5.33%	-36	-36	-36	-36	-36	-36	-36
-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%	36	36	36	36	36	36	36
8.00%	54	54	54	54	54	54	54

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

(단위:백만원)

50

공시일	2023-12-04
기준일	2023-12-01

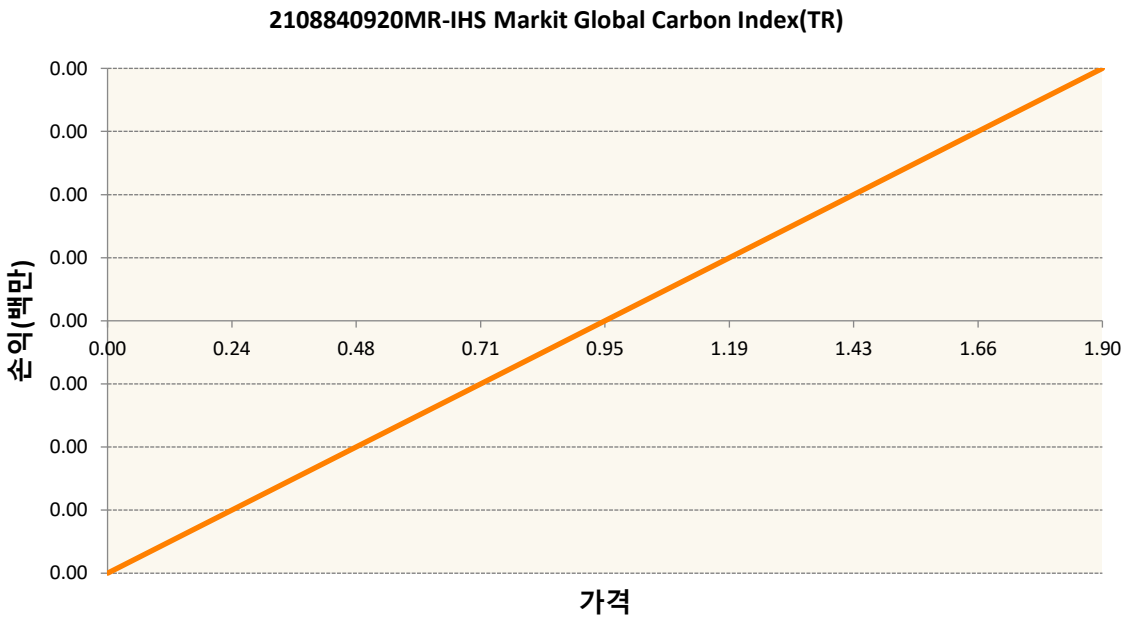
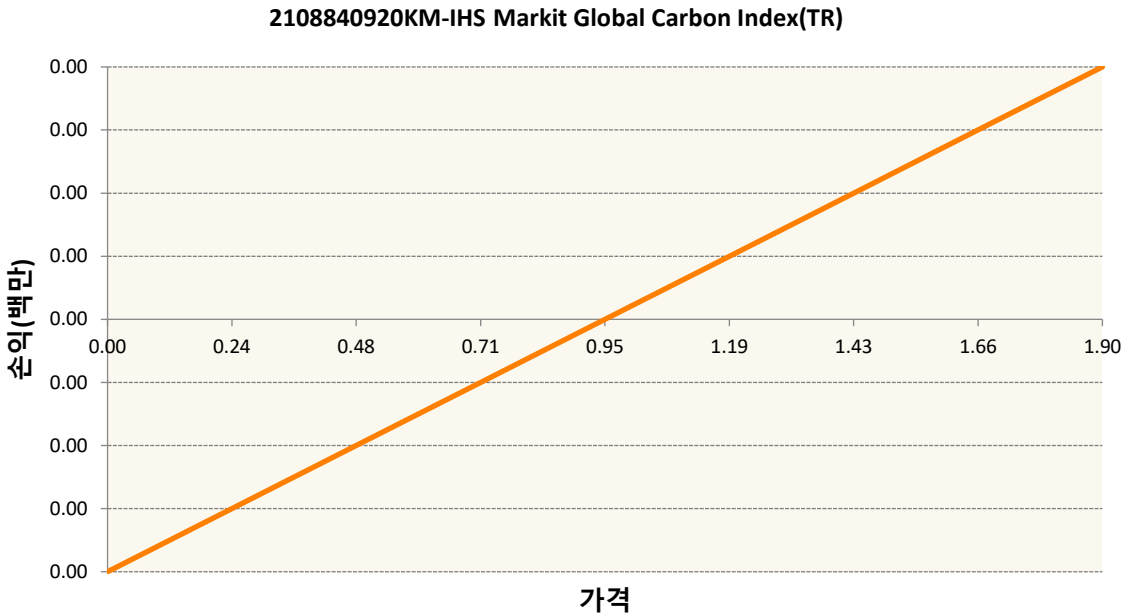
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

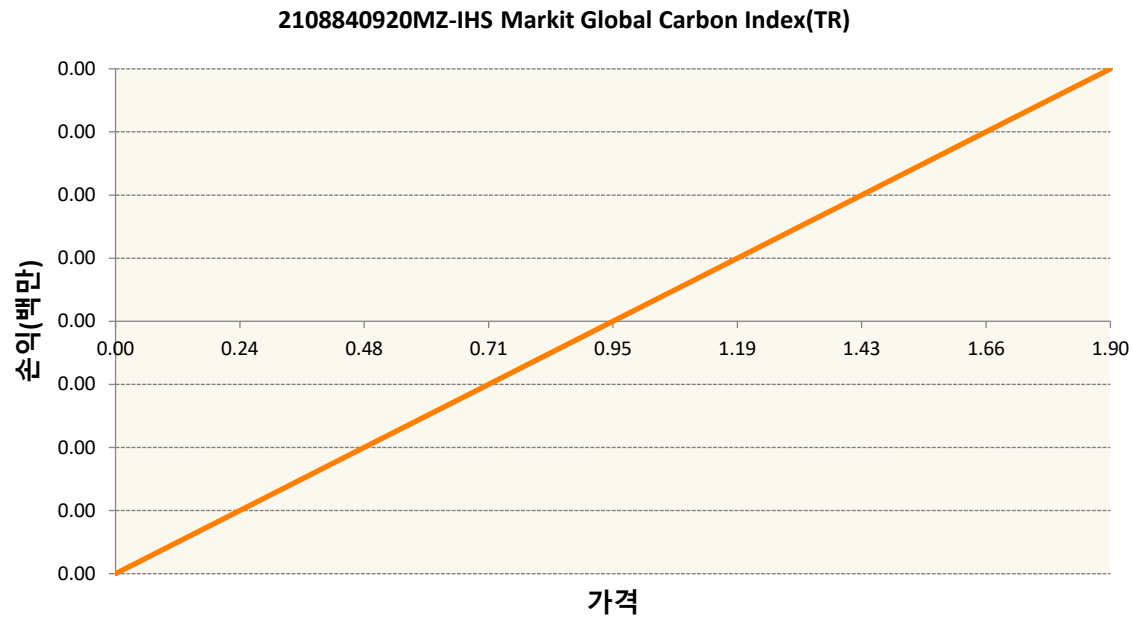
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	16,825	0	16,825	

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108840920IHS Markit Global Carbon Index(TR)		966
2108840920IHS Markit Global Carbon Index(TR)		193
2108840920IHS Markit Global Carbon Index(TR)		193

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,724

공시일	2023-12-04
기준일	2023-12-01

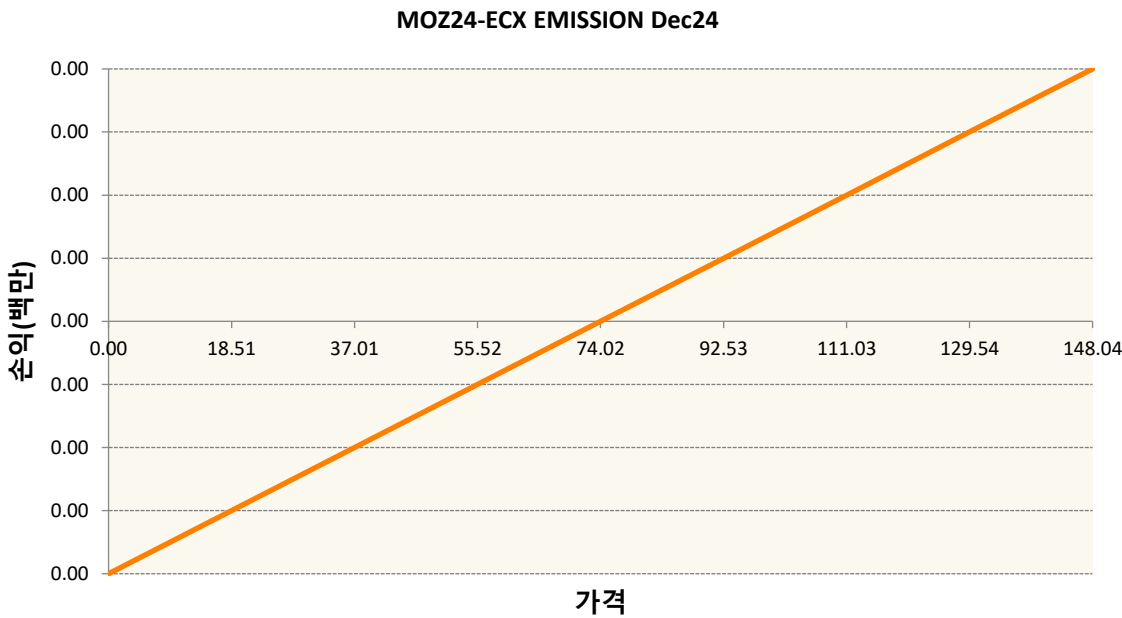
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	8,024	0	8,024	
누계	지수	스왑	479	0	479	장외
누계	통화	선도	0	1,437	-1,437	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213DBV KRW/EUR 28-12-23E	115
MOZ24 ECX EMISSION Dec24	642
SWICEUACN ICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX	6

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

(단위:백만원)

1,236

공시일	2023-12-04
기준일	2023-12-01

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	5,380	0	5,380	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI00000 신한CSI Index 230622 (미래)	16
SWCSI00000 신한CSI Index 230622 (메리츠)	16
SWCSI00000 신한CSI Index 230922 (키움)	10
SWCSI00000 신한CSI Index 231013 (NH)	12

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

(단위:백만원)

80

공시일	2023-12-04
기준일	2023-12-01

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	6,424	0	6,424	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 230116(NH)	0.27
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 230116(메리츠)	0.38
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 230116(미래)	0.32
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 230427(키움)	0.08

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

(단위:백만원)

1

공시일	2023-12-04
기준일	2023-12-01

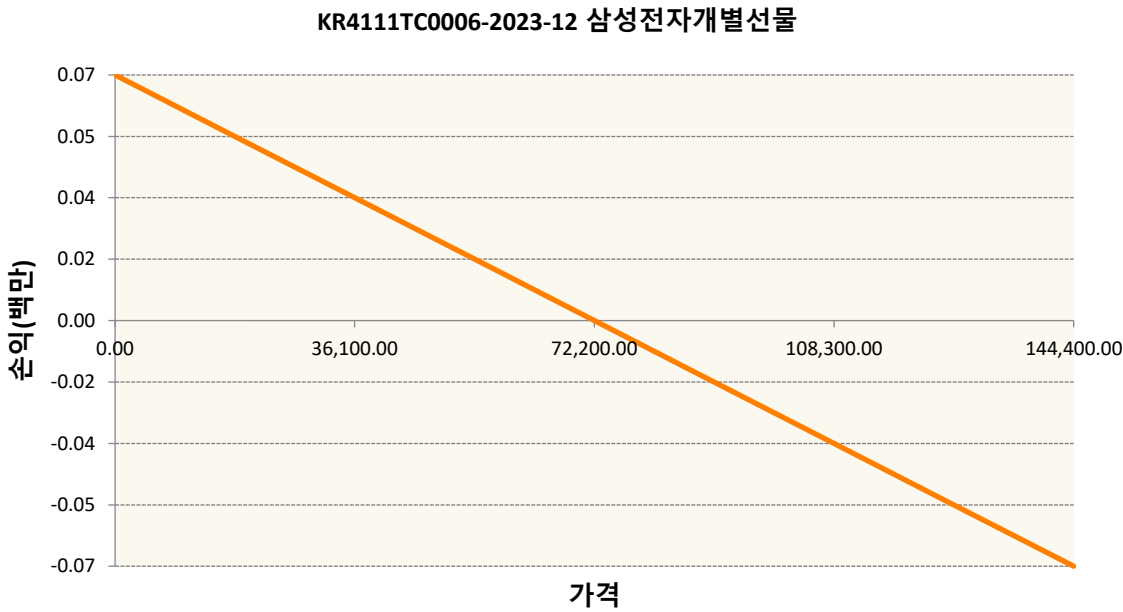
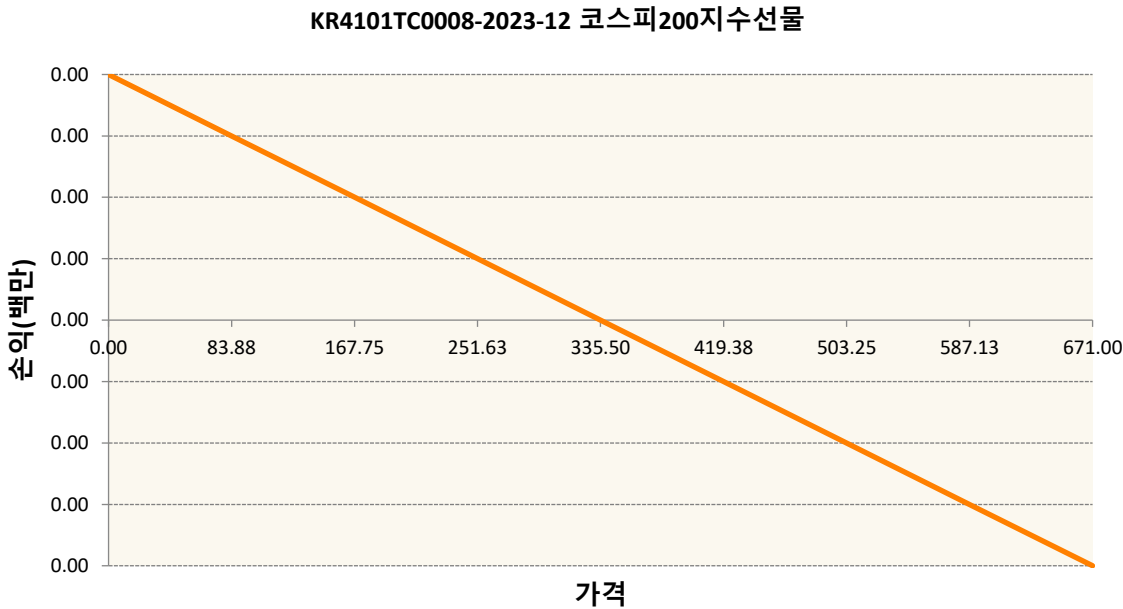
에퀴티알파일반사모혼합자산

1. 계약금액

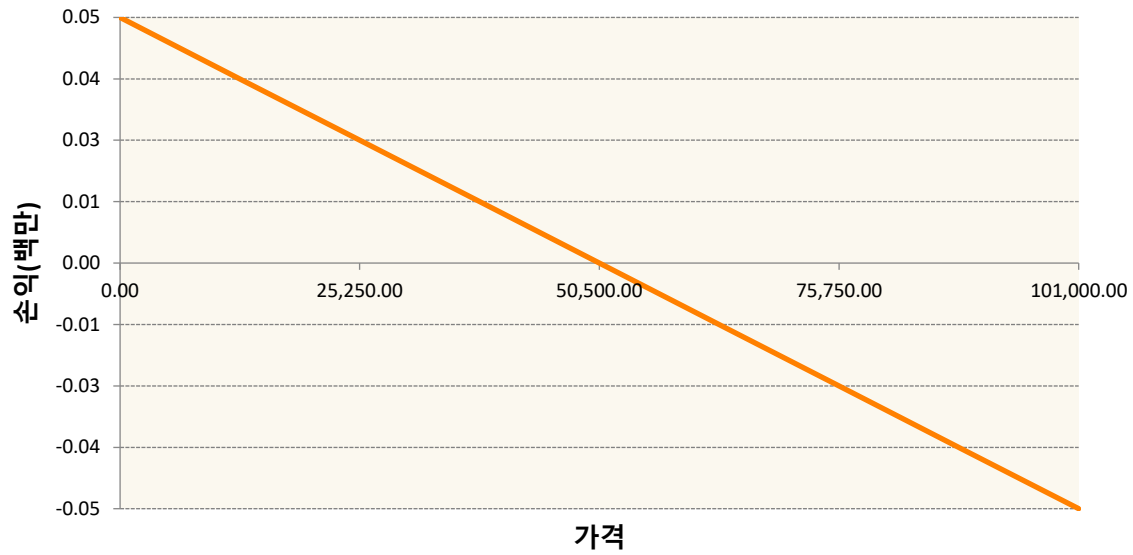
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	122	108	14	장내
누계	유가증권	선물	0	3,052	-3,052	장내

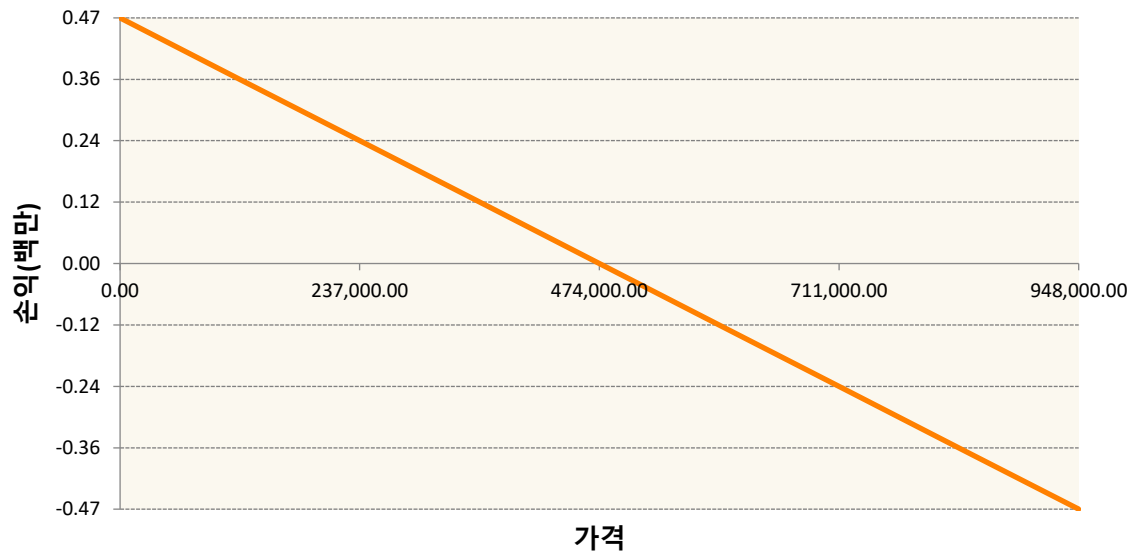
2. 만기시점의 손익구조



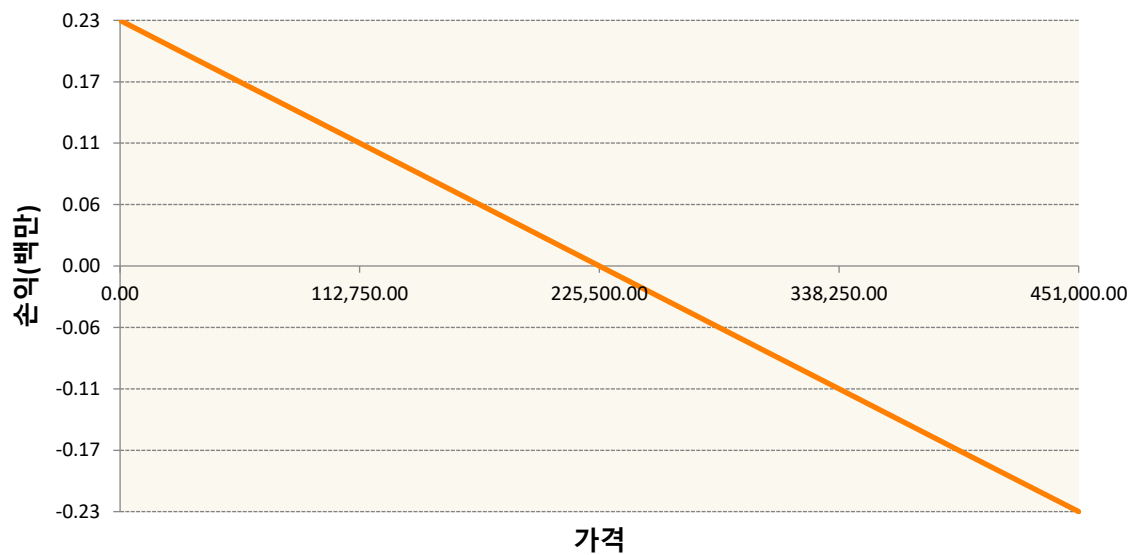
KR4112TC0005-2023-12 SK텔레콤개별선물



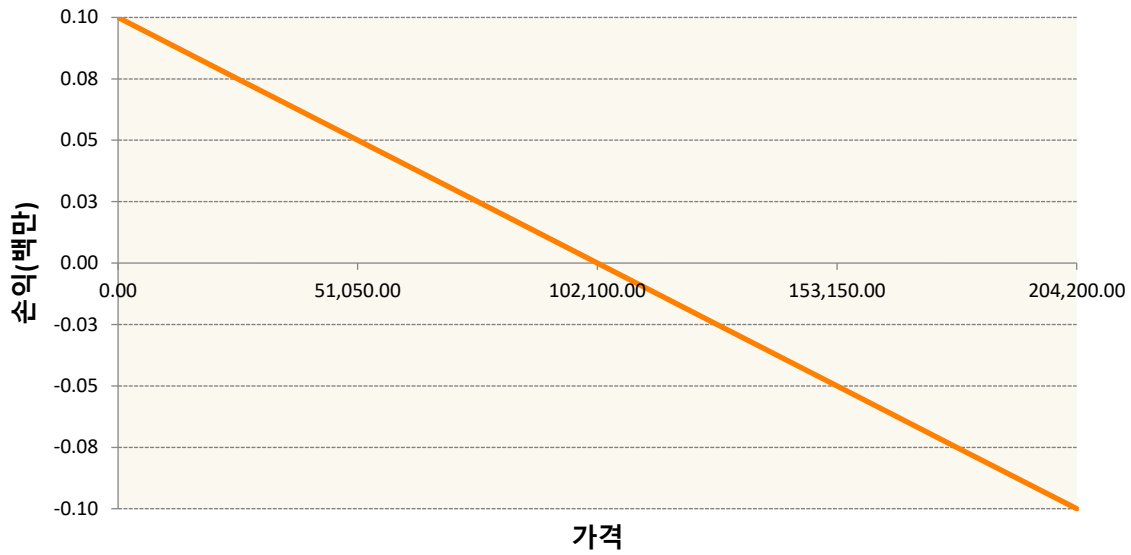
KR4113TC0004-2023-12 POSCO개별선물



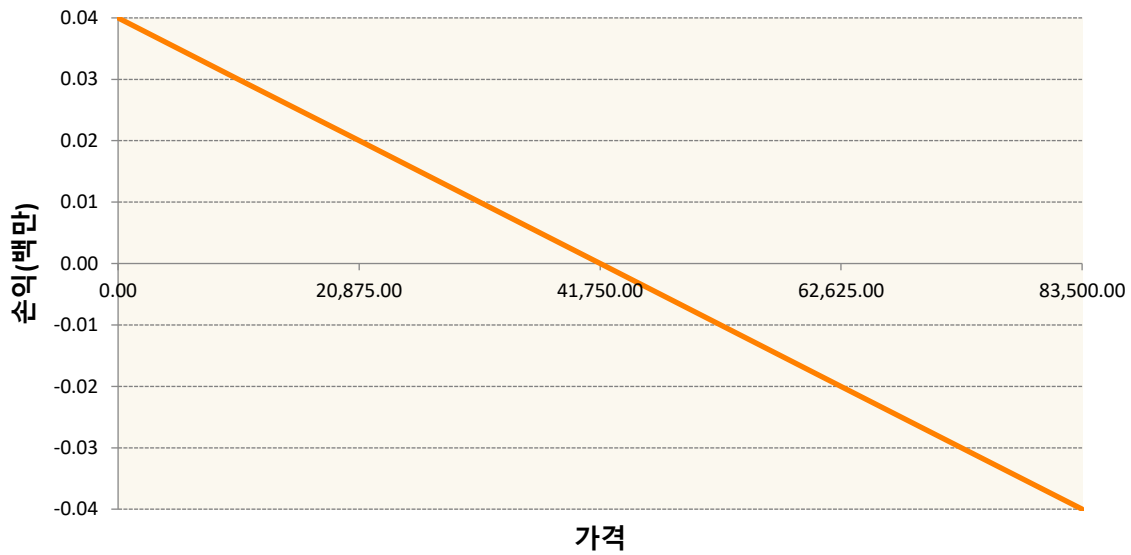
KR4120TC0005-2023-12 현대모비스개별선물



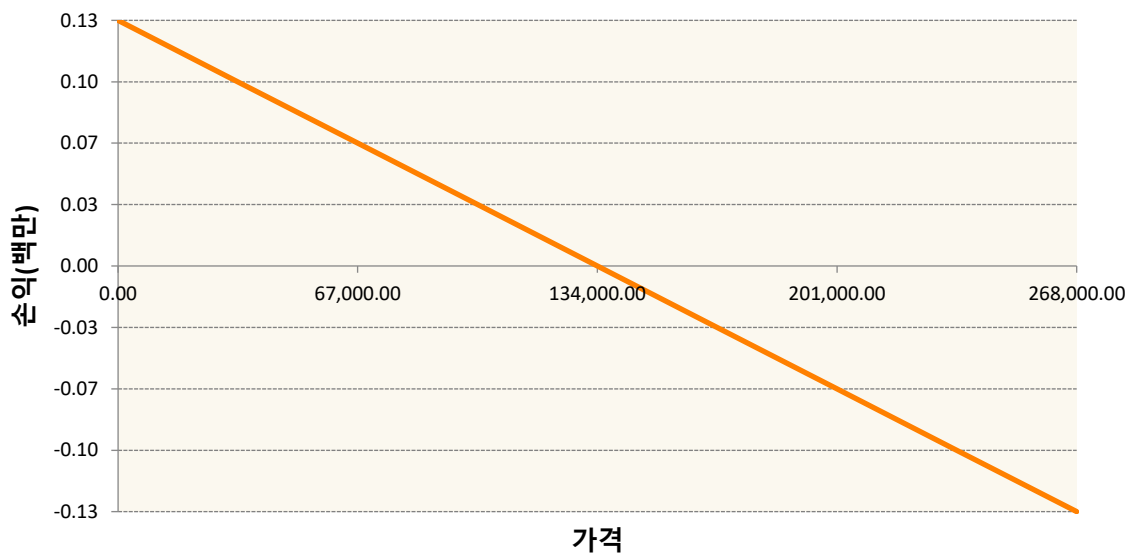
KR4124TC0001-2023-12 LG전자개별선물



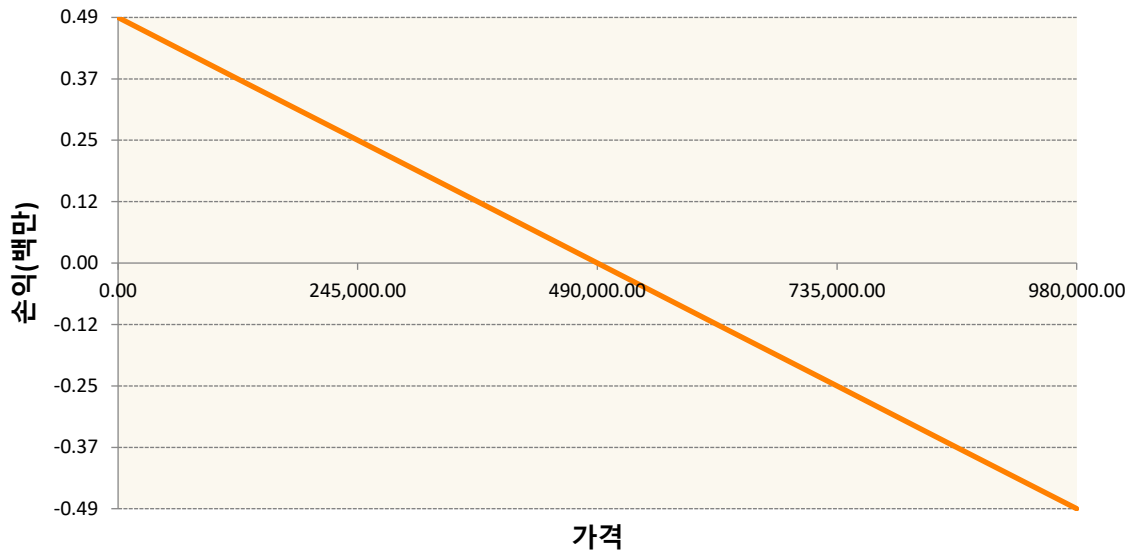
KR4140TC0001-2023-12 하나금융지주개별선물



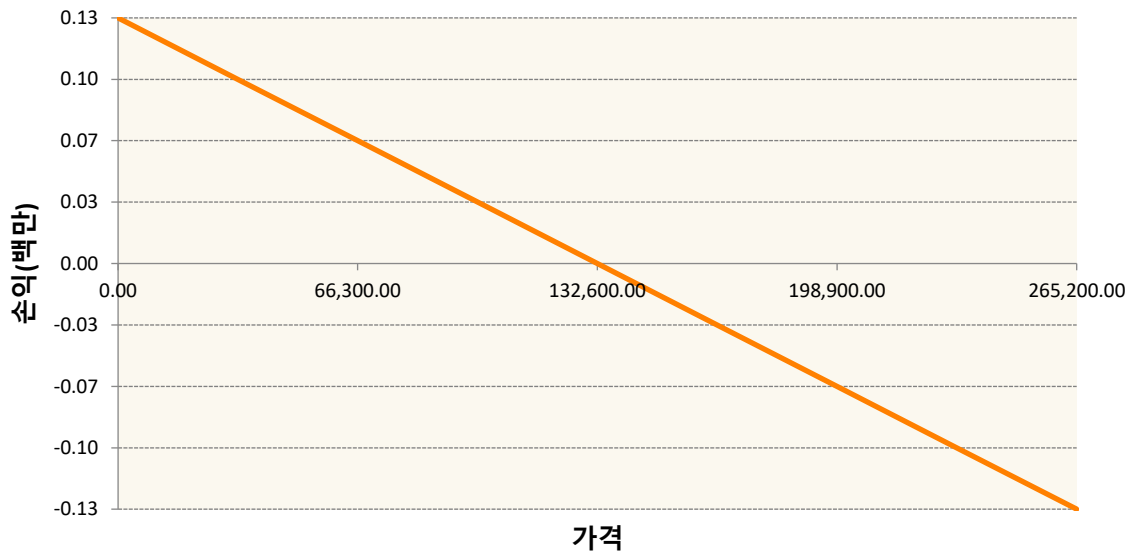
KR4141TC0000-2023-12 SK이노베이션개별선물



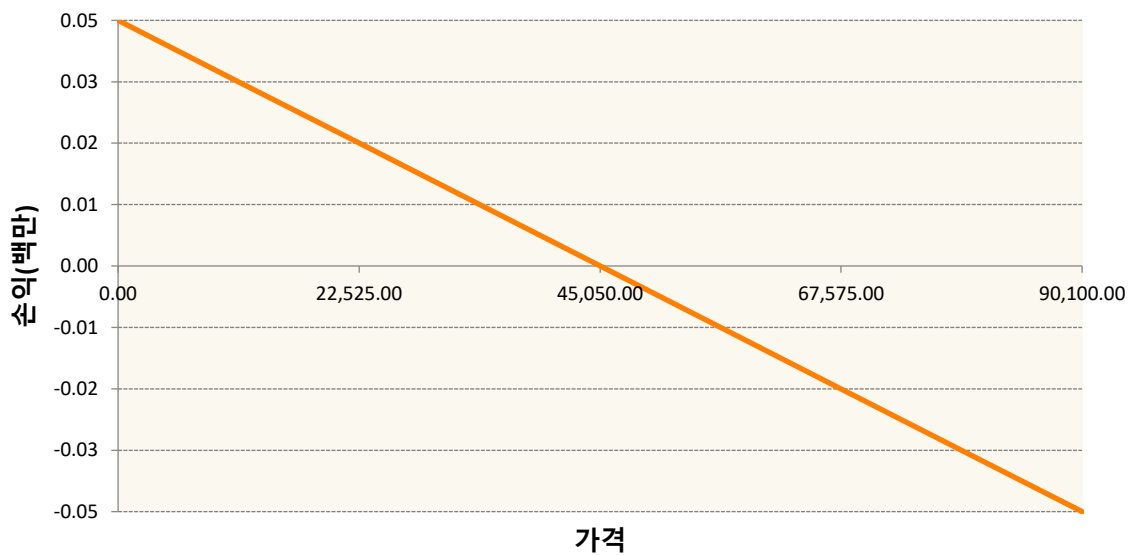
KR4147TC0004-2023-12 LG화학개별선물



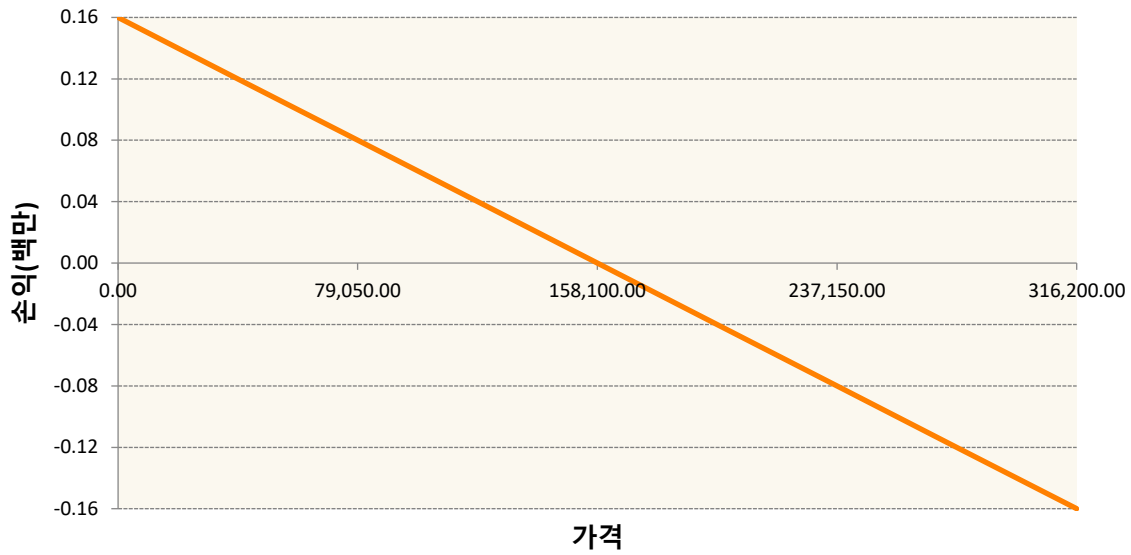
KR4150TC0008-2023-12 SK하이닉스개별선물



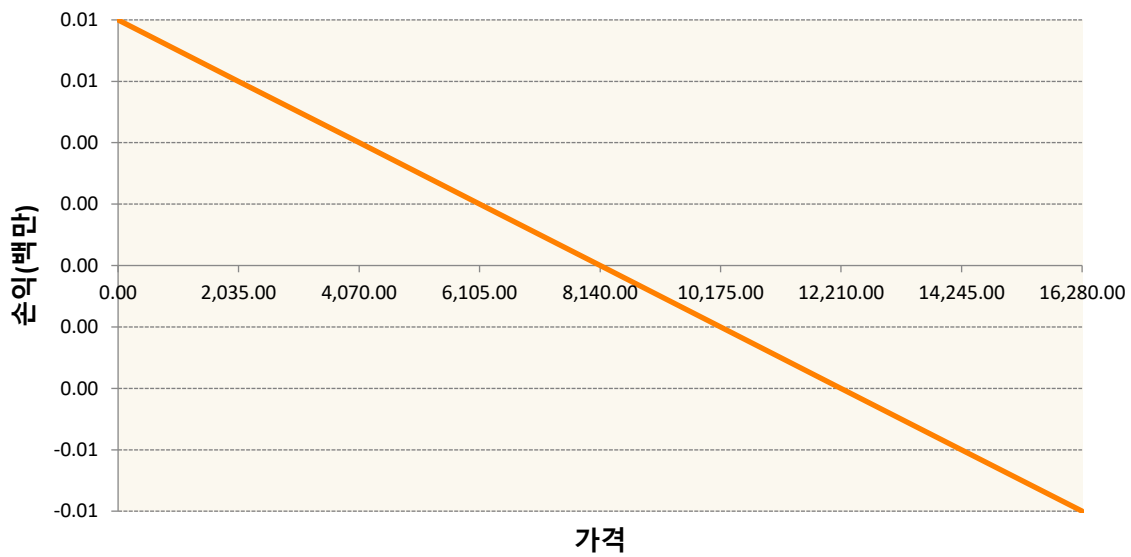
KR4155TC0003-2023-12 한국타이어앤테크놀로지개별선물



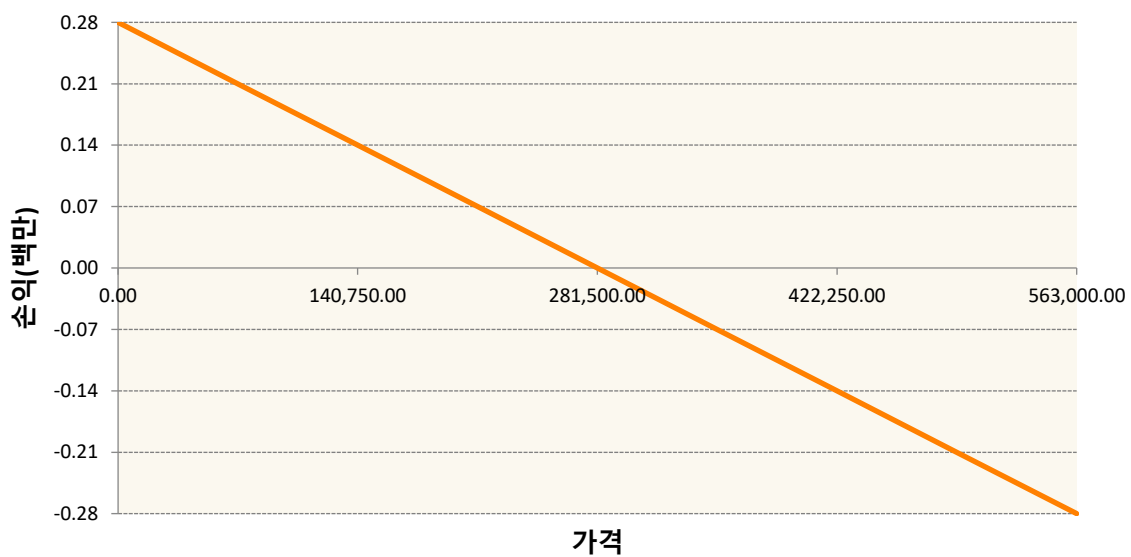
KR41BBTC0003-2023-12 롯데케미칼개별선물



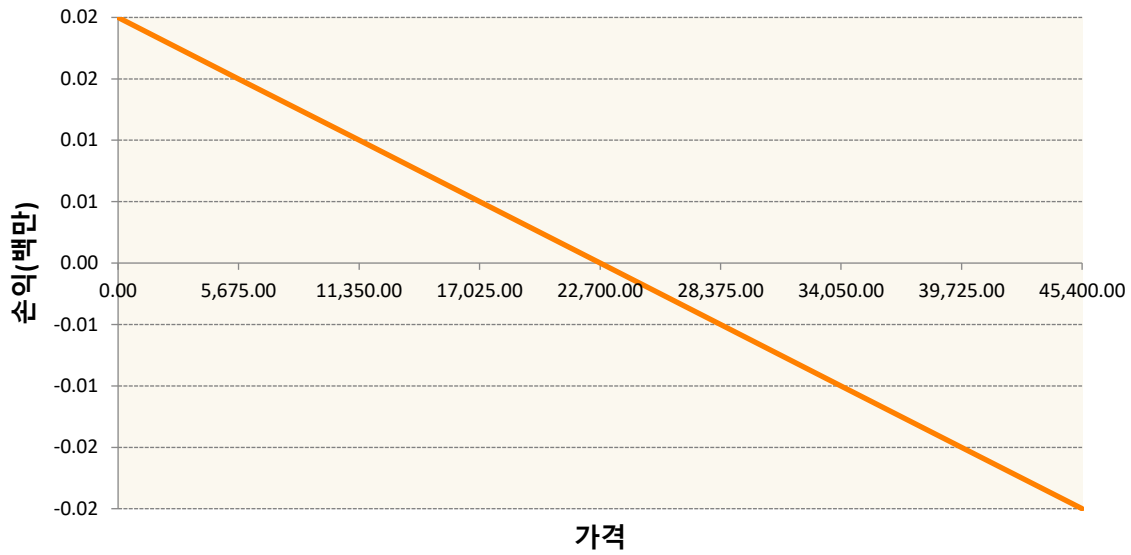
KR41BFTC0009-2023-12 삼성중공업개별선물



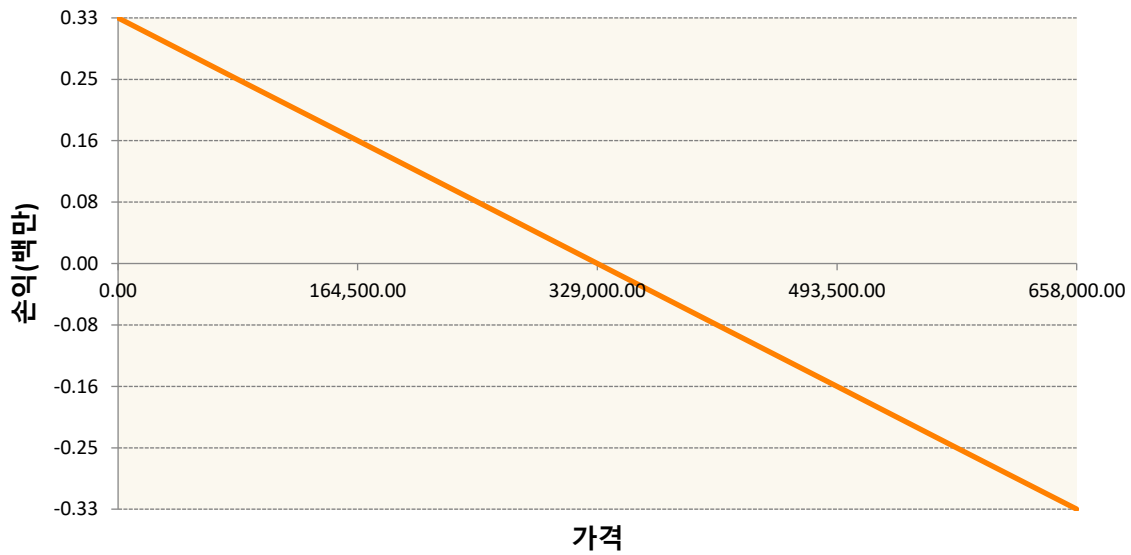
KR41BJTC0005-2023-12 엔씨소프트개별선물



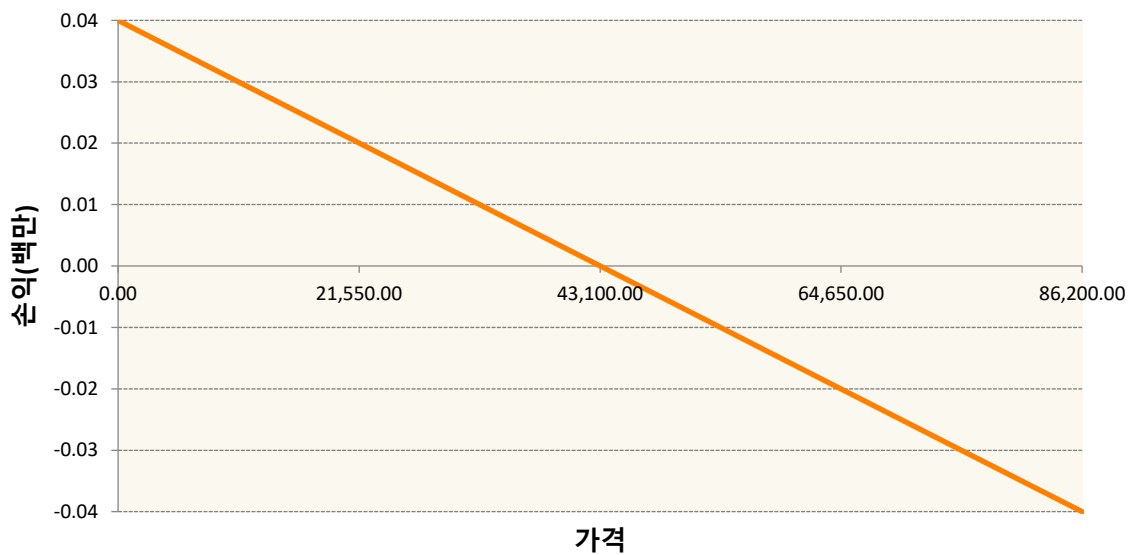
KR41BKTC0002-2023-12 하이트진로개별선물



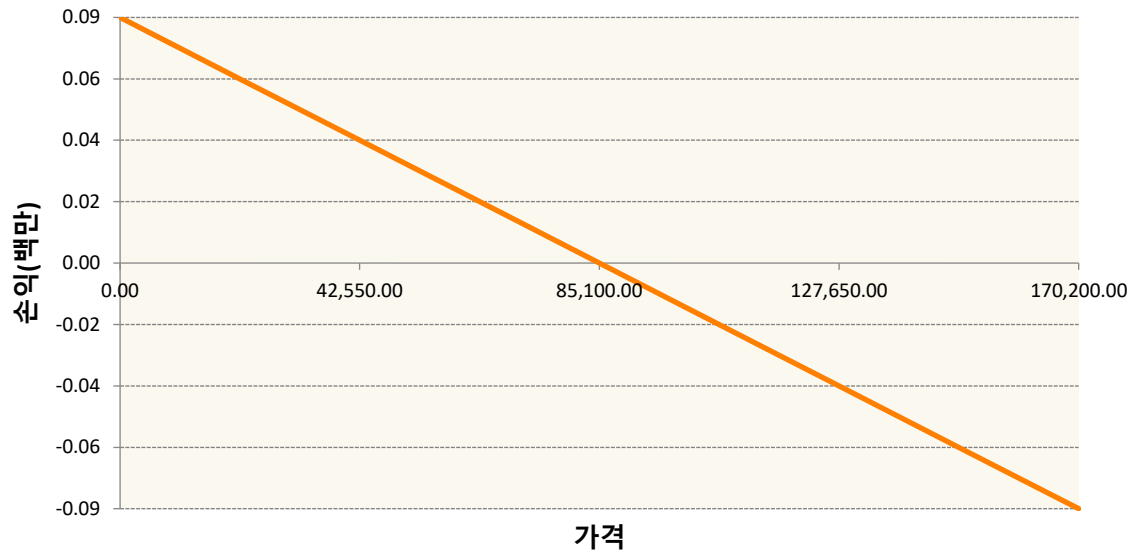
KR41CRTC0004-2023-12 LG생활건강개별선물



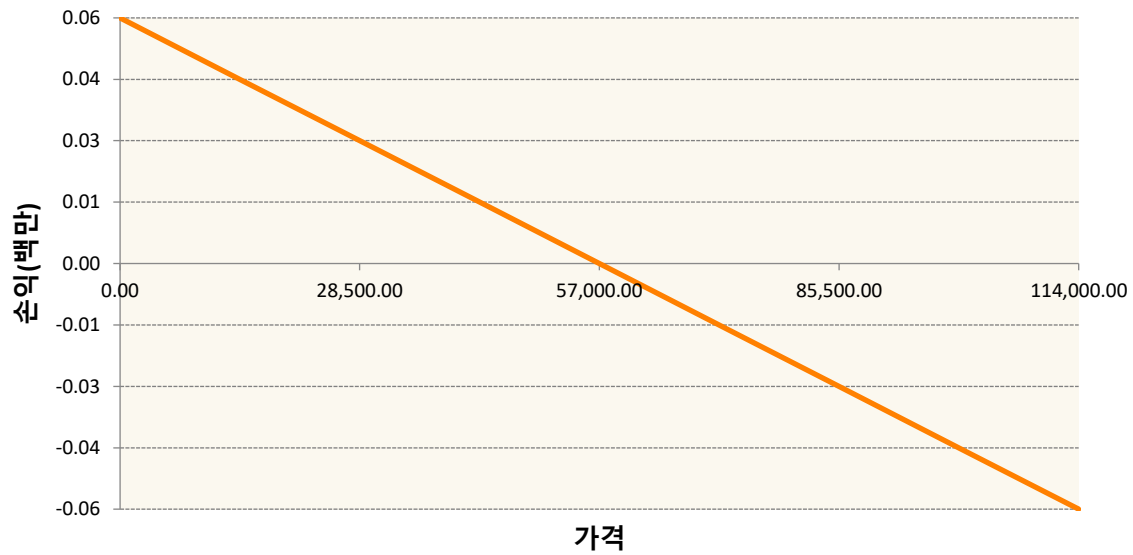
KR41DWTC0006-2023-12 두산밥캣개별선물



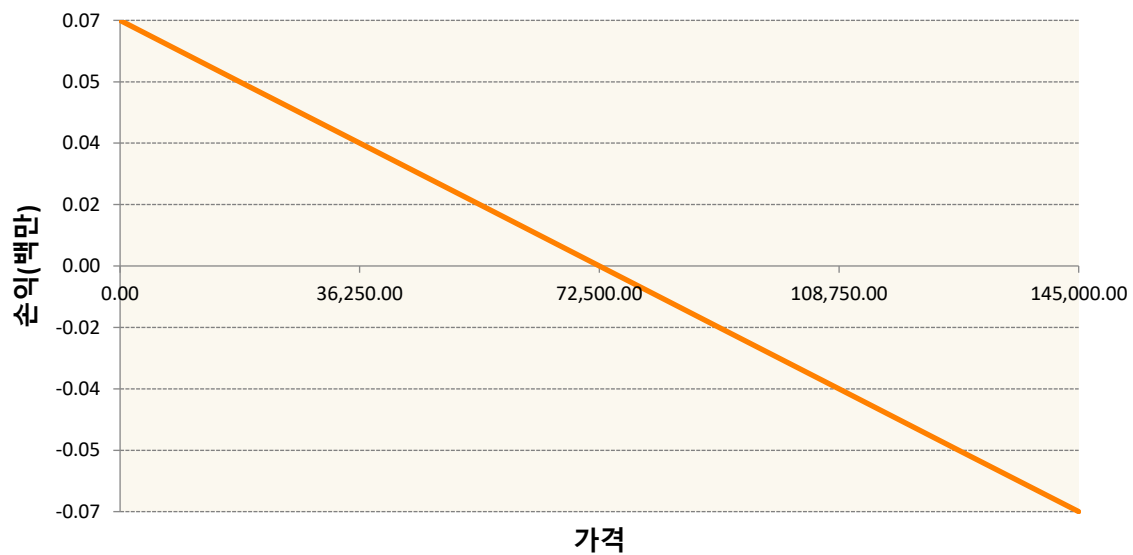
KR41E4TC0005-2023-12 에스엠개별선물



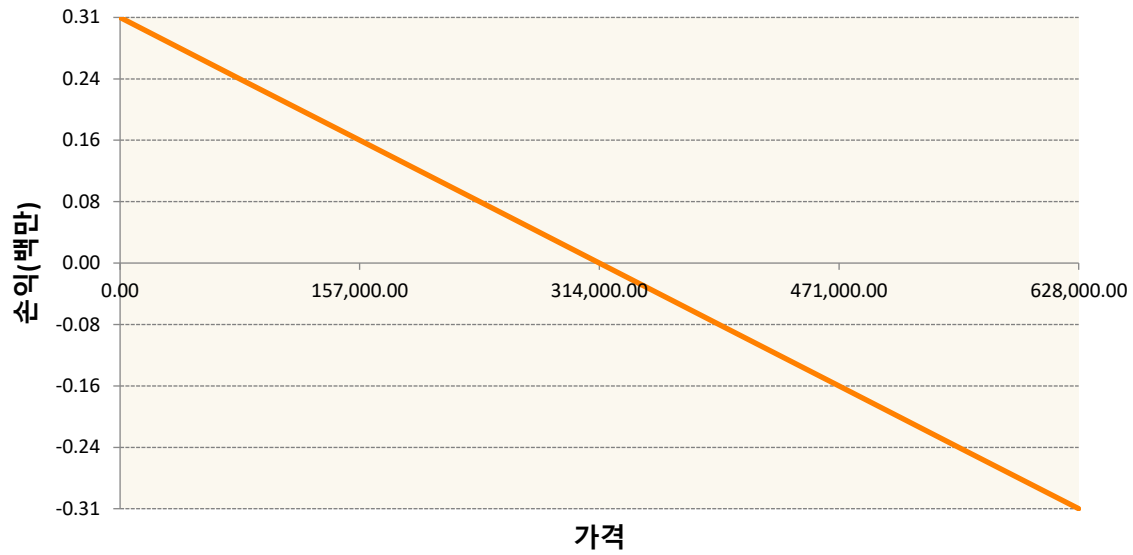
KR41E5TC0004-2023-12 넷마블개별선물



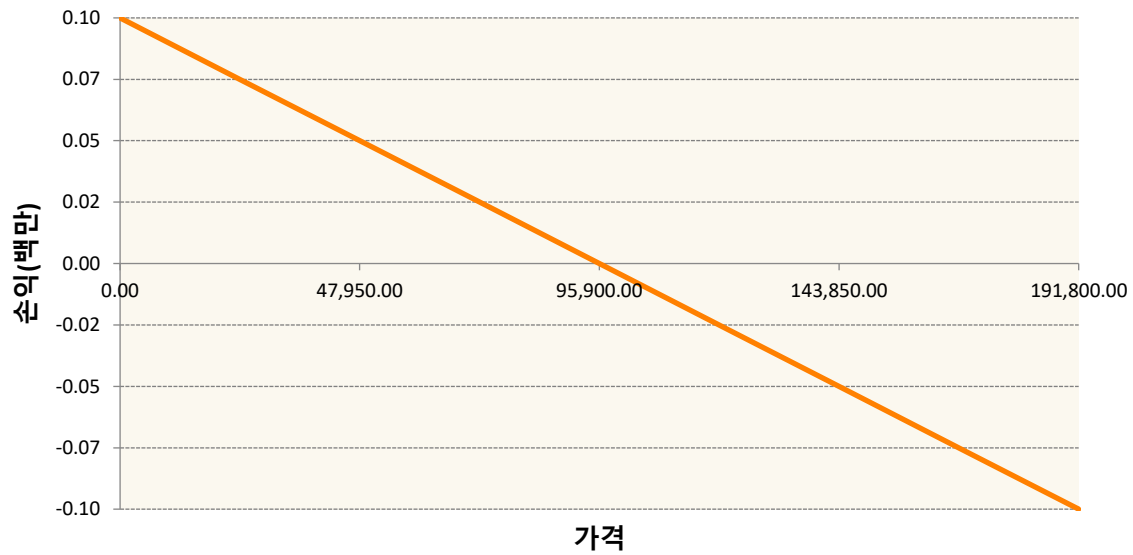
KR41E6TC0003-2023-12 셀트리온헬스케어개별선물



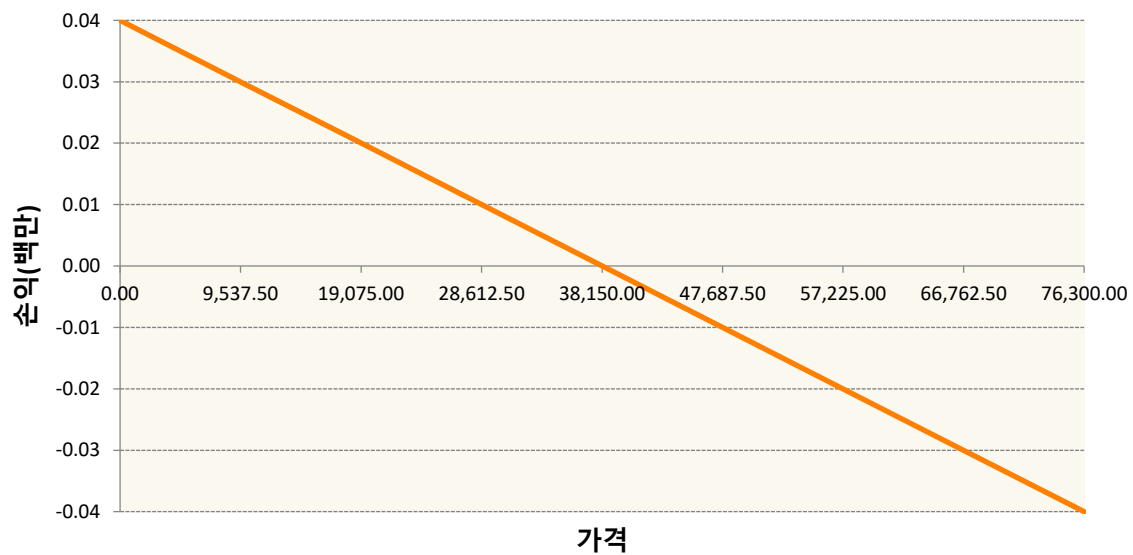
KR41E8TC0001-2023-12 포스코케미칼개별선물



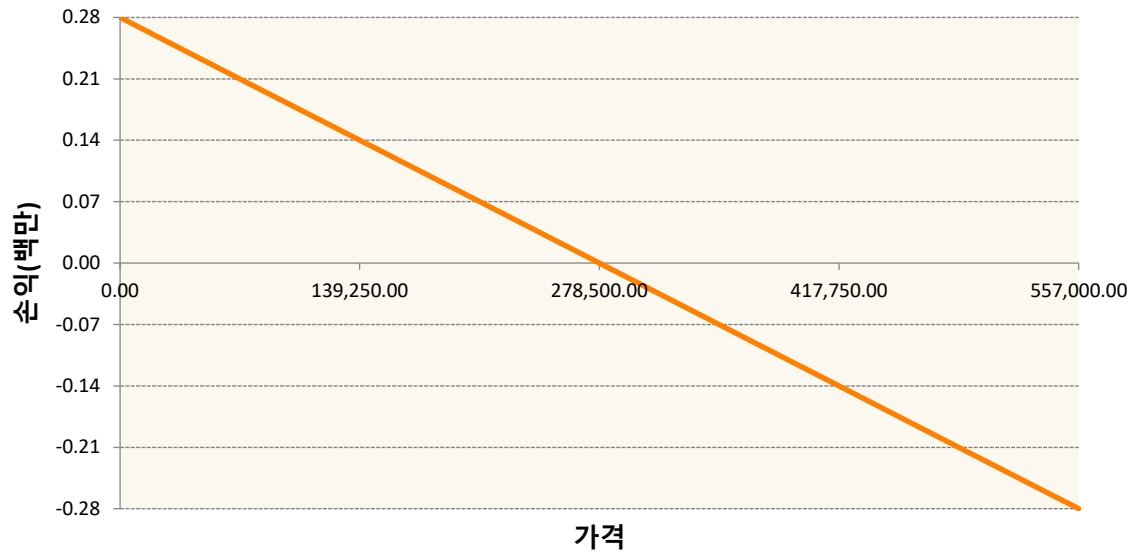
KR41EFTC0006-2023-12 JYP Ent.개별선물



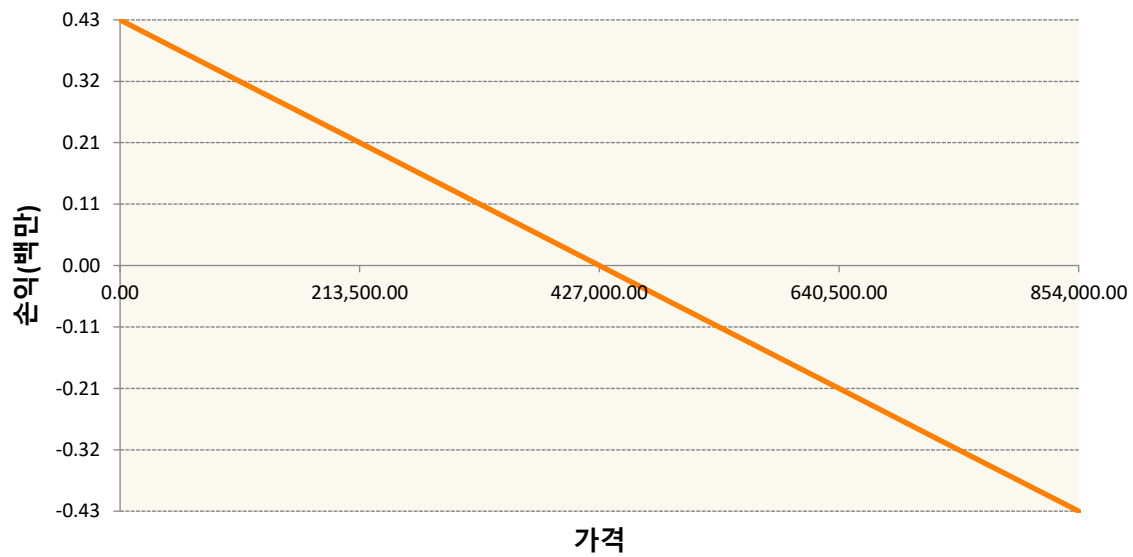
KR41ERTC0002-2023-12 DL이앤씨개별선물



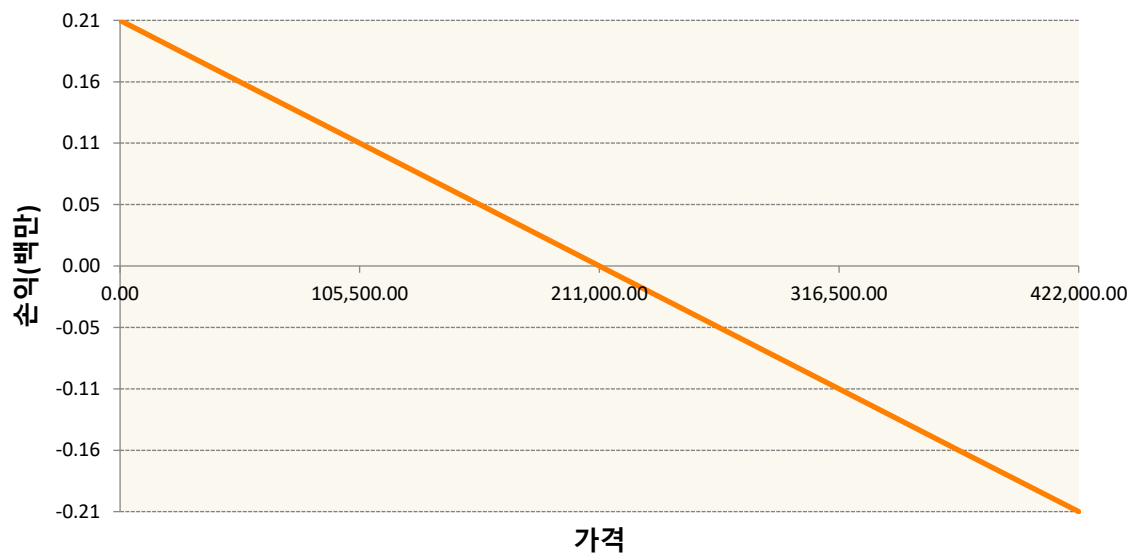
KR41EYTC0003-2023-12 에코프로비엠개별선물



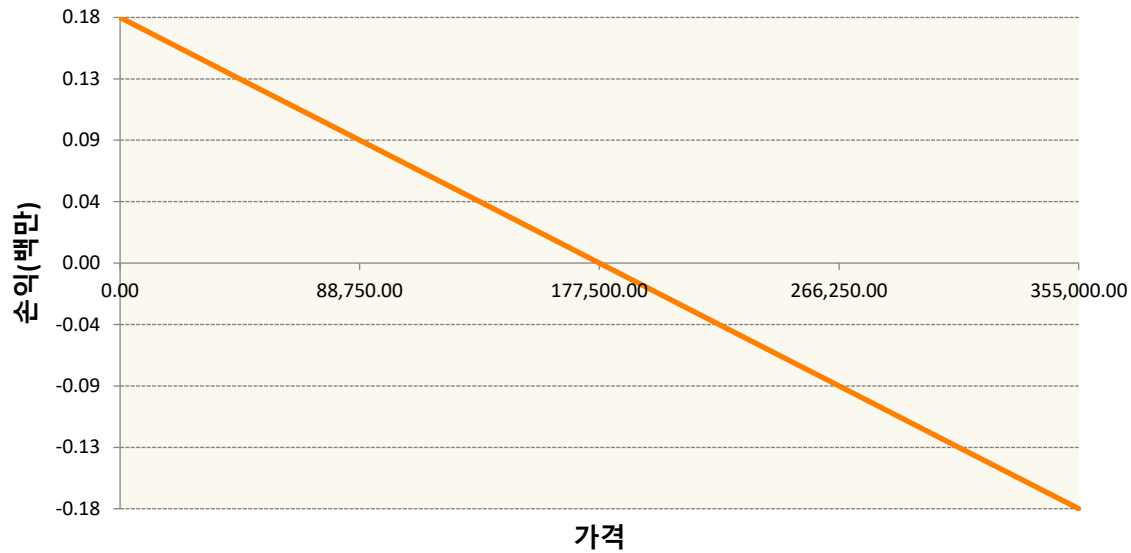
KR41F5TC0001-2023-12 LG에너지솔루션개별선물



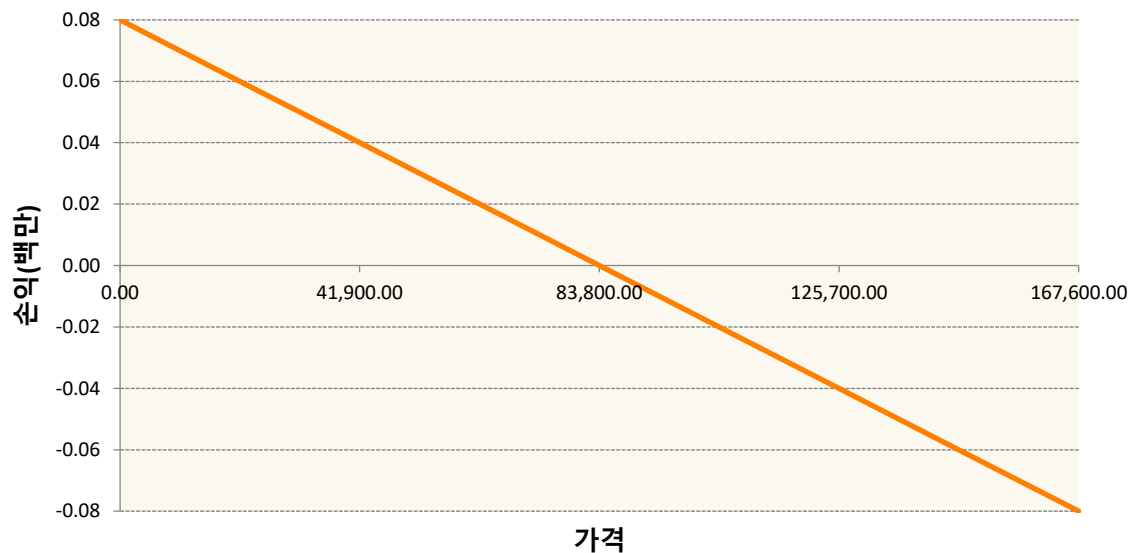
KR41FCTC0008-2023-12 하이브개별선물



KR41FMTC0006-2023-12 엘앤에프개별선물



KR41FSTC0000-2023-12 LS개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101TC00 2023-12 코스피200지수선물	127
KR4111TC00 2023-12 삼성전자개별선물	19
KR4112TC00 2023-12 SK텔레콤개별선물	4
KR4113TC00 2023-12 POSCO개별선물	1
KR4120TC00 2023-12 현대모비스개별선물	3
KR4124TC00 2023-12 LG전자개별선물	2
KR4140TC00 2023-12 하나금융지주개별선물	2
KR4141TC00 2023-12 SK이노베이션개별선물	1
KR4147TC00 2023-12 LG화학개별선물	3
KR4150TC00 2023-12 SK하이닉스개별선물	19
KR4155TC00 2023-12 한국타이어엔테크놀로지개별선물	2
KR41BBTC00 2023-12 롯데케미칼개별선물	4

KR41BFTC00 2023-12 삼성중공업개별선물	2
KR41BJTC00(2023-12 엔씨소프트개별선물	8
KR41BKTC00 2023-12 하이트진로개별선물	5
KR41CRTC00 2023-12 LG생활건강개별선물	3
KR41DWTC0 2023-12 두산밥캣개별선물	3
KR41E4TC00 2023-12 에스엠개별선물	1
KR41E5TC00 2023-12 넷마블개별선물	7
KR41E6TC00 2023-12 셀트리온헬스케어개별선물	2
KR41E8TC00 2023-12 포스코케미칼개별선물	4
KR41EFTC00(2023-12 JYP Ent.개별선물	1
KR41ERTC00 2023-12 DL이앤씨개별선물	3
KR41EYTC00 2023-12 에코프로비엠개별선물	4
KR41F5TC00 2023-12 LG에너지솔루션개별선물	2
KR41FCTC00 2023-12 하이브개별선물	5
KR41FMTC0(2023-12 엘앤에프개별선물	6
KR41FSTC00(2023-12 LS개별선물	1

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

(단위:백만원)

365

공시일	2023-12-04
기준일	2023-12-01

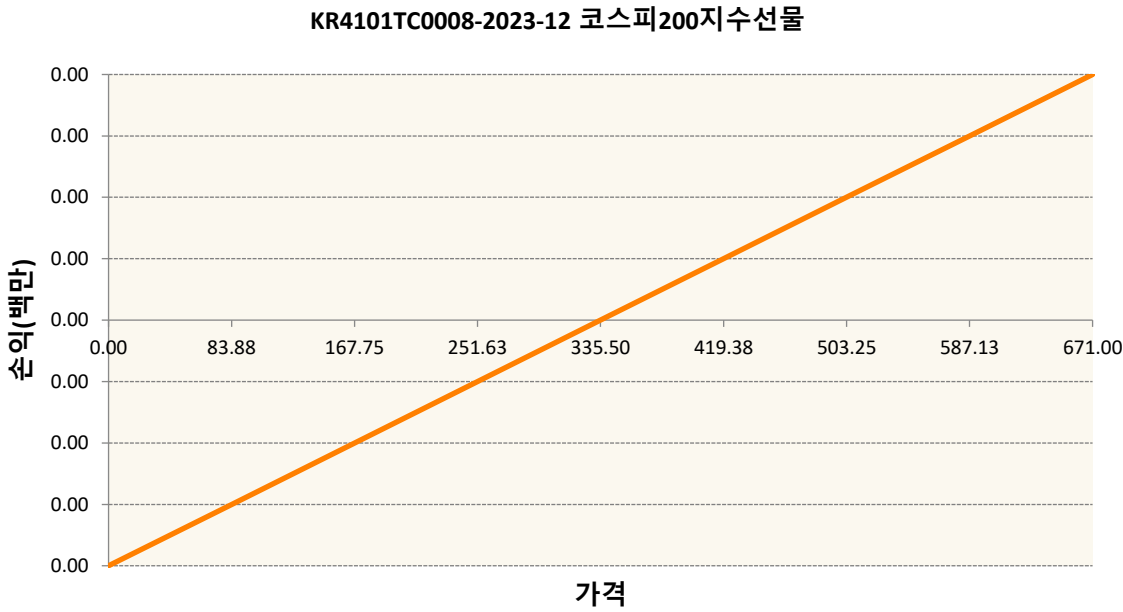
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

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	4,362	0	4,362	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101TC0008		2023-12 코스피200지수선물					348
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-348	-348	-348	-348	-348	-348	-348
-5.33%	-232	-232	-232	-232	-232	-232	-232
-2.67%	-116	-116	-116	-116	-116	-116	-116
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	116	116	116	116	116	116	116
5.33%	232	232	232	232	232	232	232
8.00%	348	348	348	348	348	348	348

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

(단위:백만원)

326

공시일	2023-12-04
기준일	2023-12-01

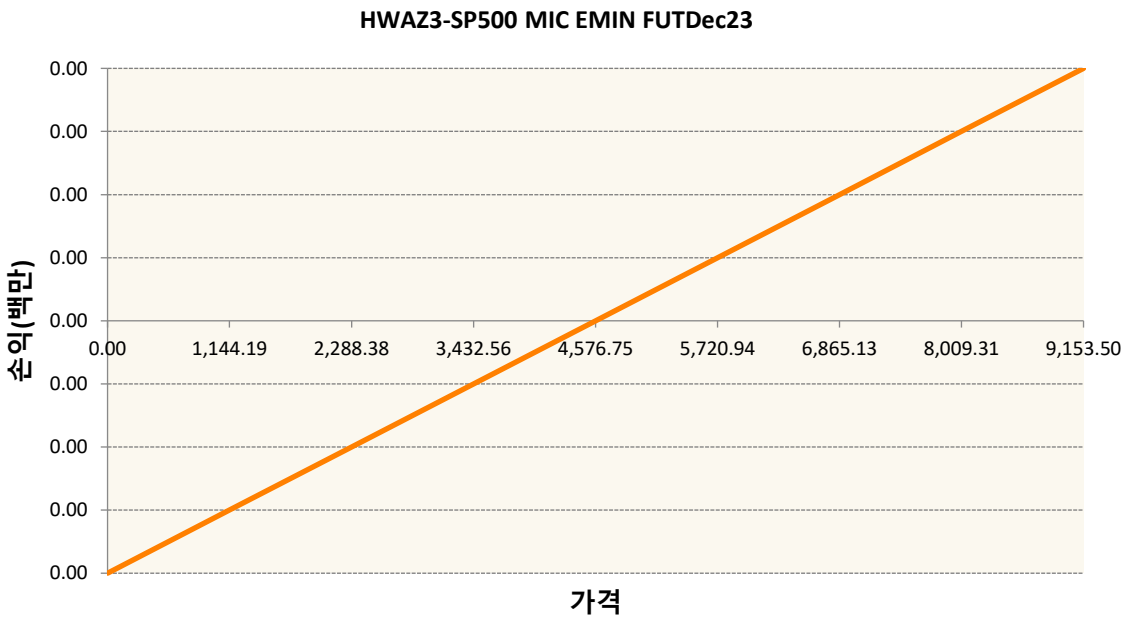
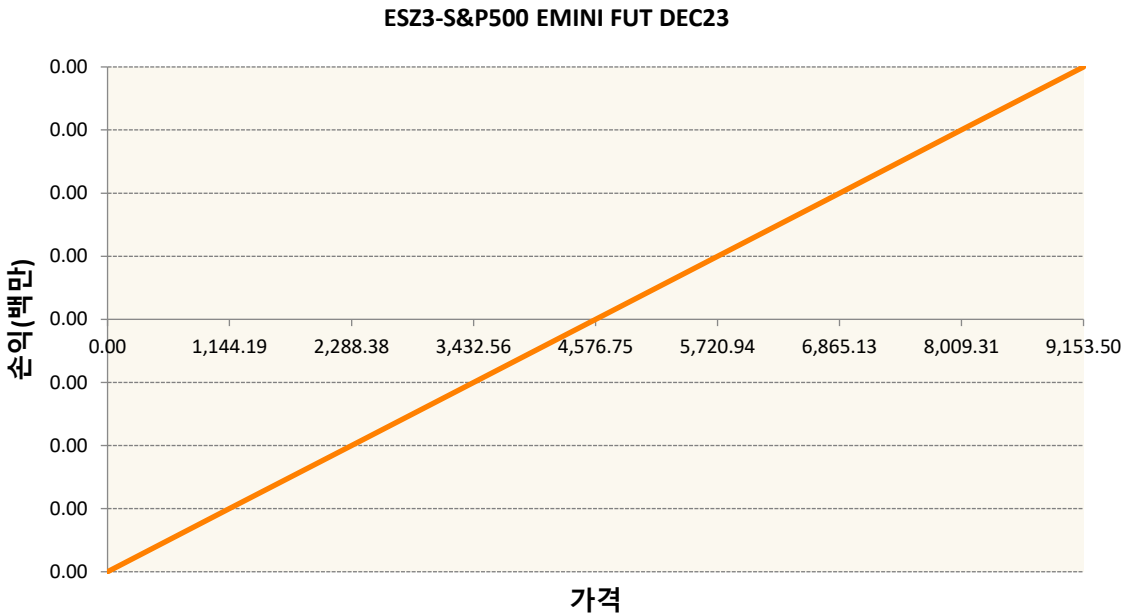
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

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	309	0	309	
누계	유가증권	선물	1,871	0	1,871	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESZ3	S&P500 EMINI FUT DEC23	25
HWAZ3	SP500 MIC EMIN FUTDec23	150

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	149

공시일	2023-12-04
기준일	2023-12-01

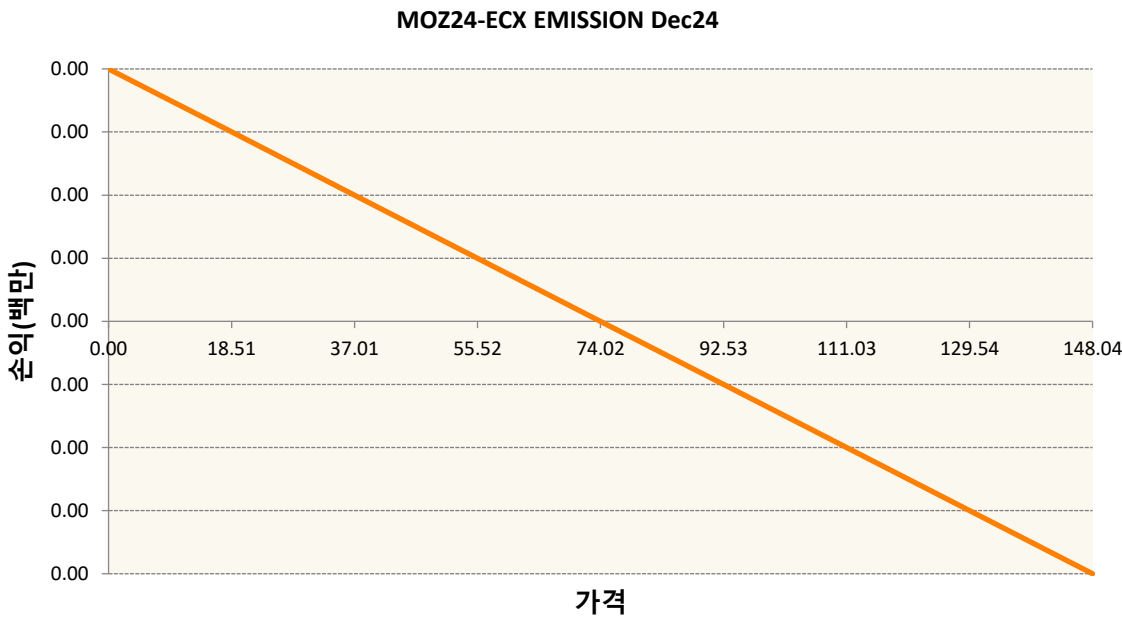
SOL유럽탄소배출권선물인버스ICE특별자산상

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	6,657	-6,657	
누계	지수	스왑	479	0	479	장외
누계	통화	선도	0	1,726	-1,726	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213DBV KRW/EUR 28-12-23E	7
FXW213DBV KRW/EUR 28-12-23E	131
MOZ24 ECX EMISSION Dec24	533
SWICEUACN ICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX	6

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

(단위:백만원)

1,056

공시일	2023-12-04
기준일	2023-12-01

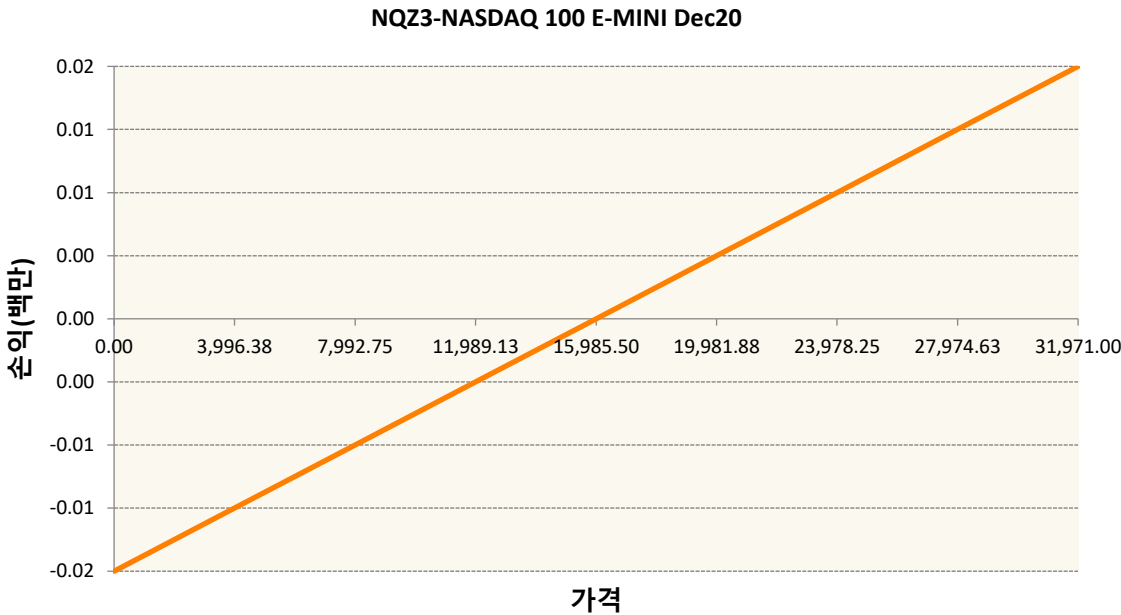
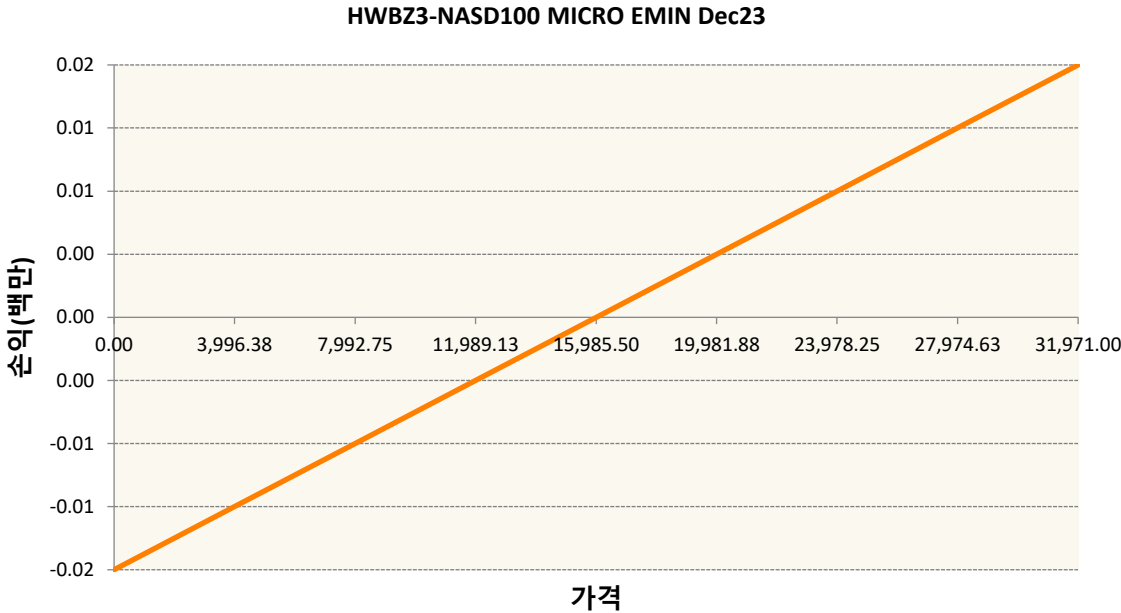
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

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	432	0	432	
누계	유가증권	선물	1,549	0	1,549	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HWBZ3	NASD100 MICRO EMIN Dec23	124
NQZ3	NASDAQ 100 E-MINI Dec20	35

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	145

공시일	2023-12-04
기준일	2023-12-01

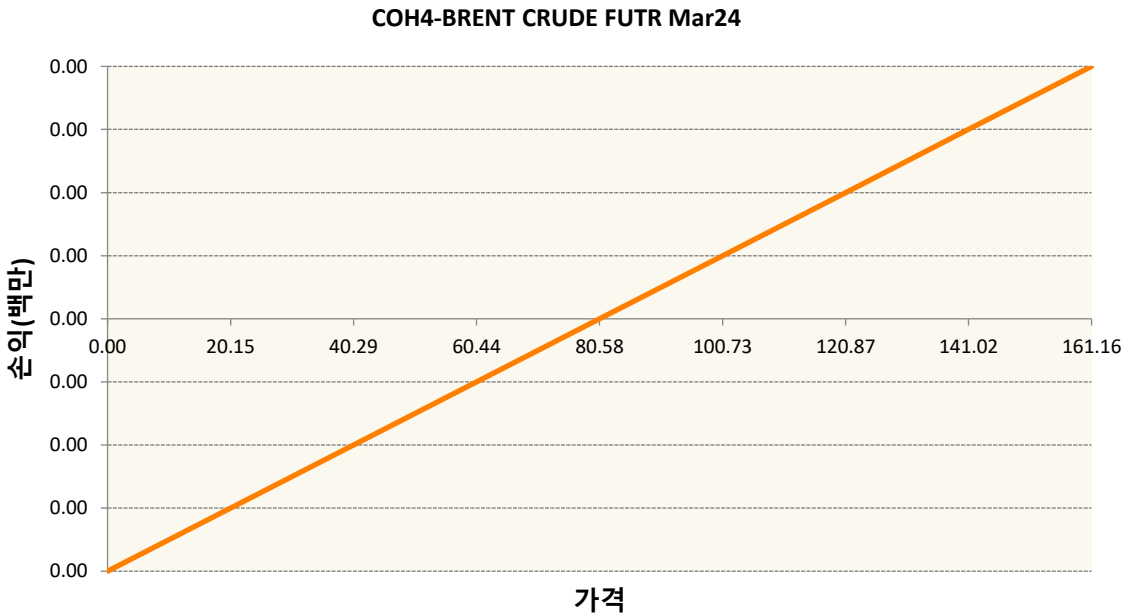
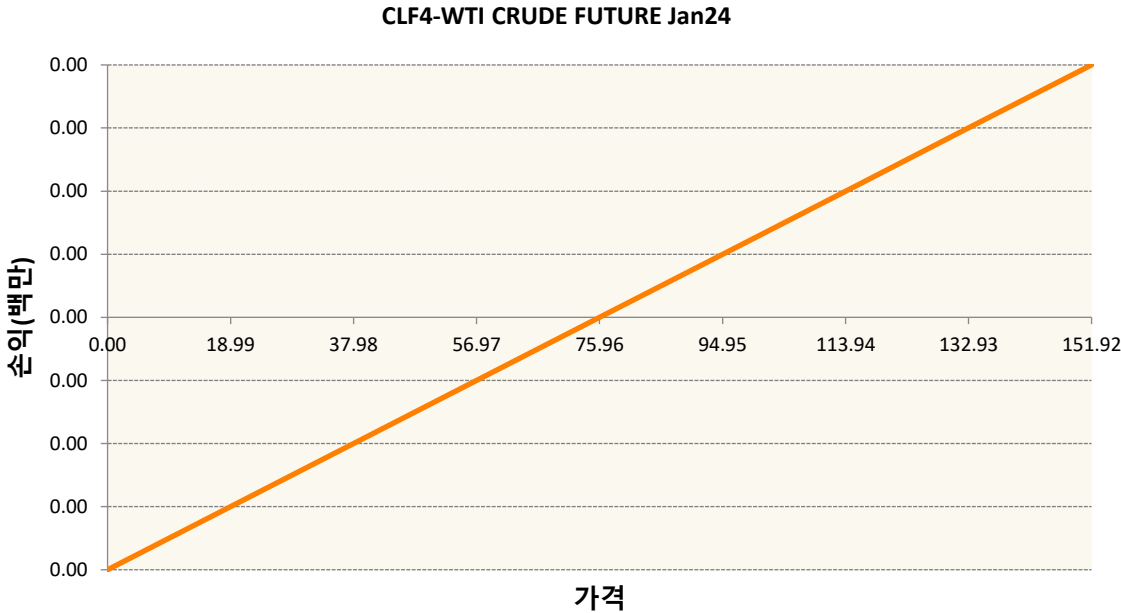
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

1. 계약금액

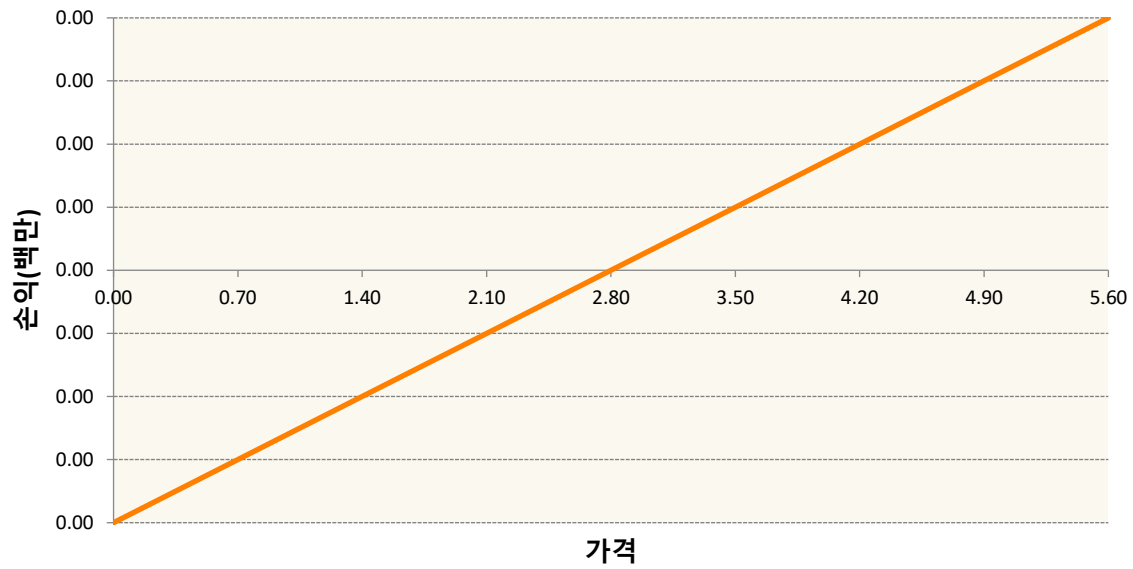
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,261	0	1,261	
누계	통화	선물	0	144	-144	장내

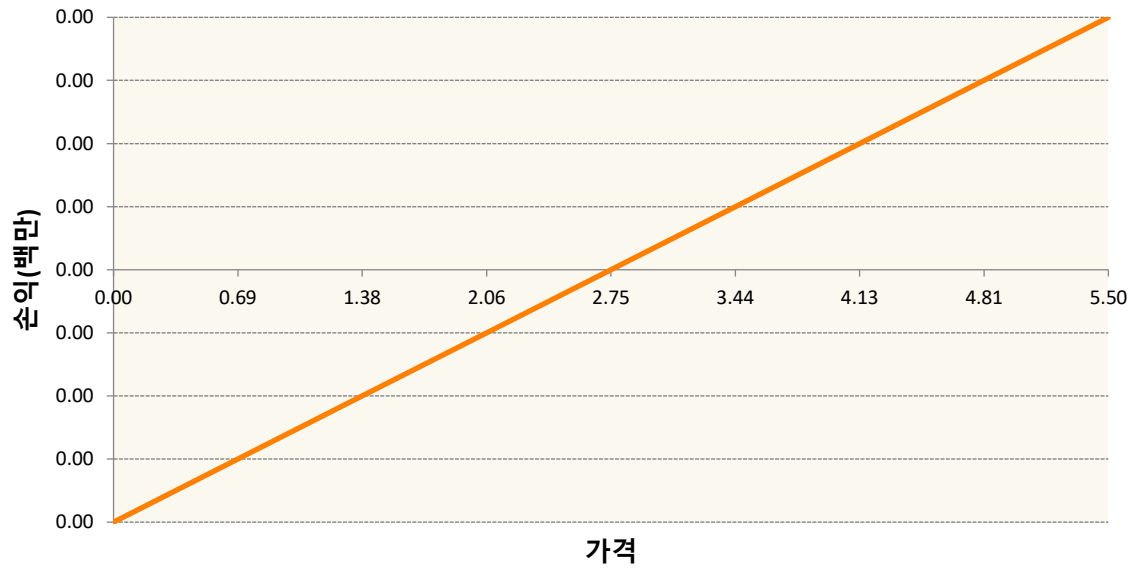
2. 만기시점의 손익구조



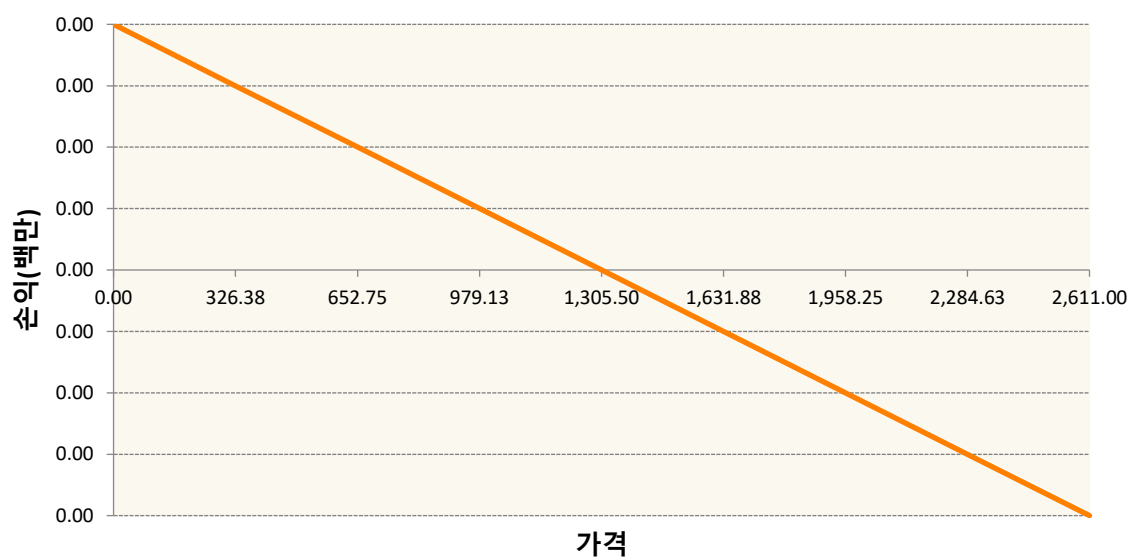
EOF4-E-MINI NATURAL GAS Jan24



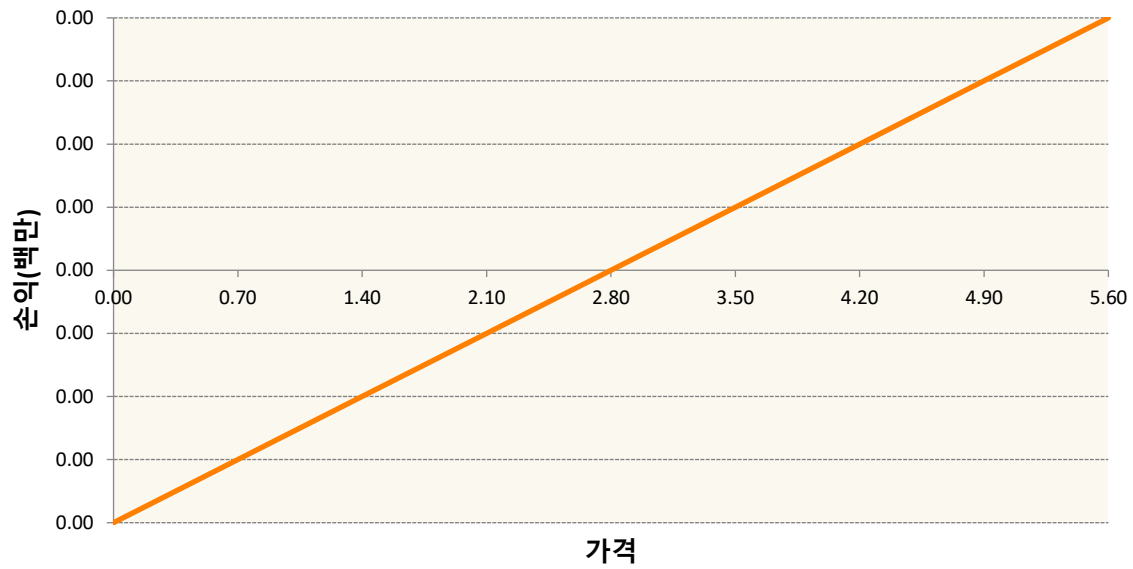
HOF4-NY Harb ULSD Fut Jan24



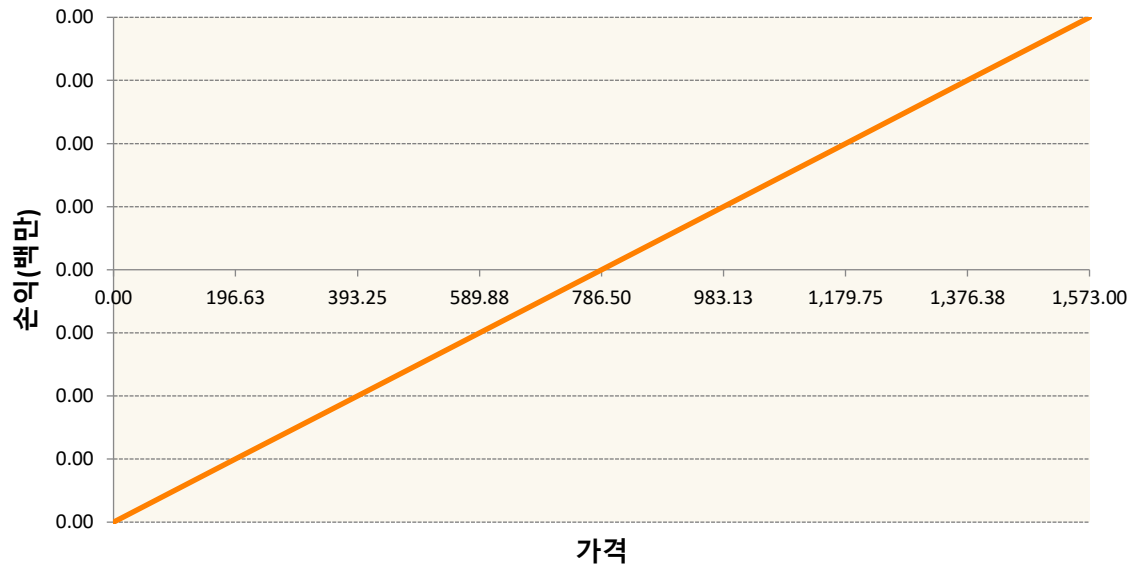
KR4175TC0009-2023-12 달러선물



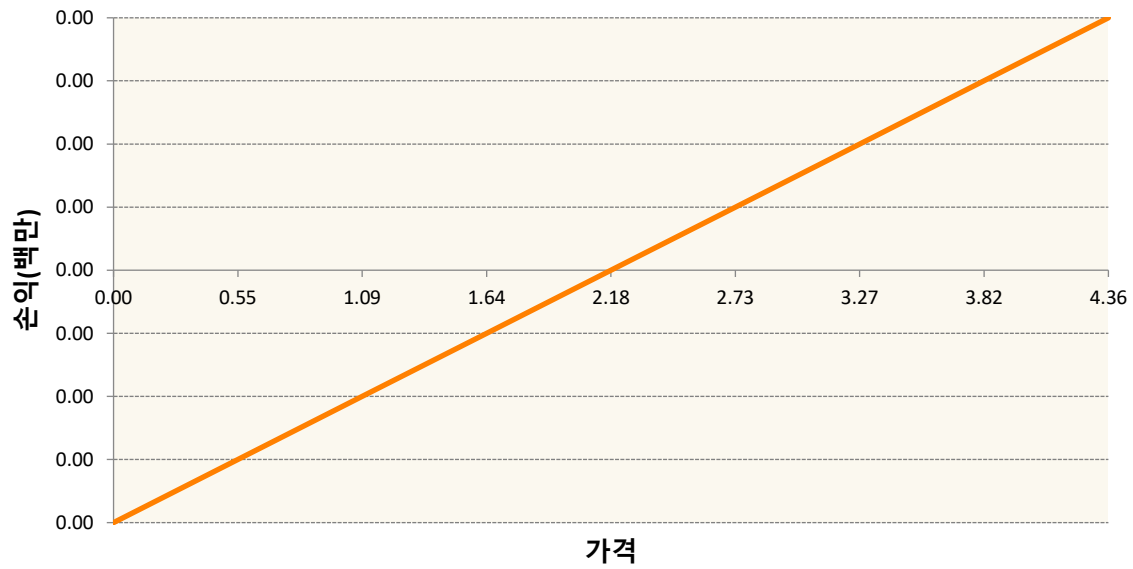
NGF24-NATURAL GAS FUTR Jan24



QSF4-Low Su Gasoil G Jan24



XBF4-GASOLINE RBOB FUT Jan24



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLF4	WTI CRUDE FUTURE Jan24	24
COH4	BRENT CRUDE FUTR Mar24	25
EOF4	E-MINI NATURAL GAS Jan24	2
HOF4	NY Harb ULSD Fut Jan24	12
KR4175TC00	2023-12 달러선물	11
NGF24	NATURAL GAS FUTR Jan24	18
QSF4	Low Su Gasoil G Jan24	8
XBF4	GASOLINE RBOB FUT Jan24	10

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

250