

공시일	2023-12-08
기준일	2023-12-07

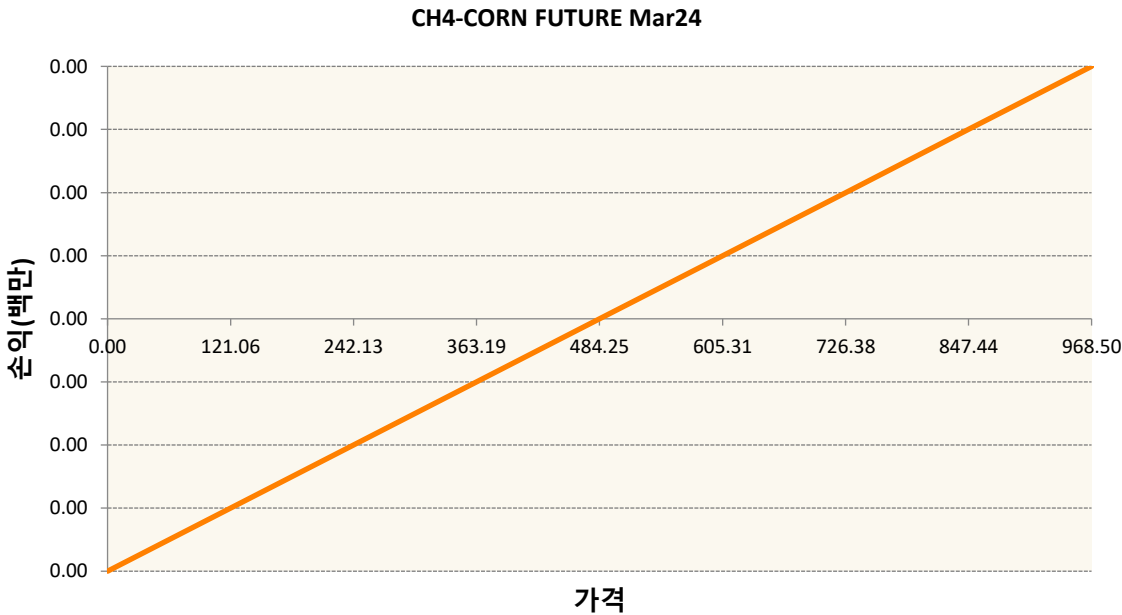
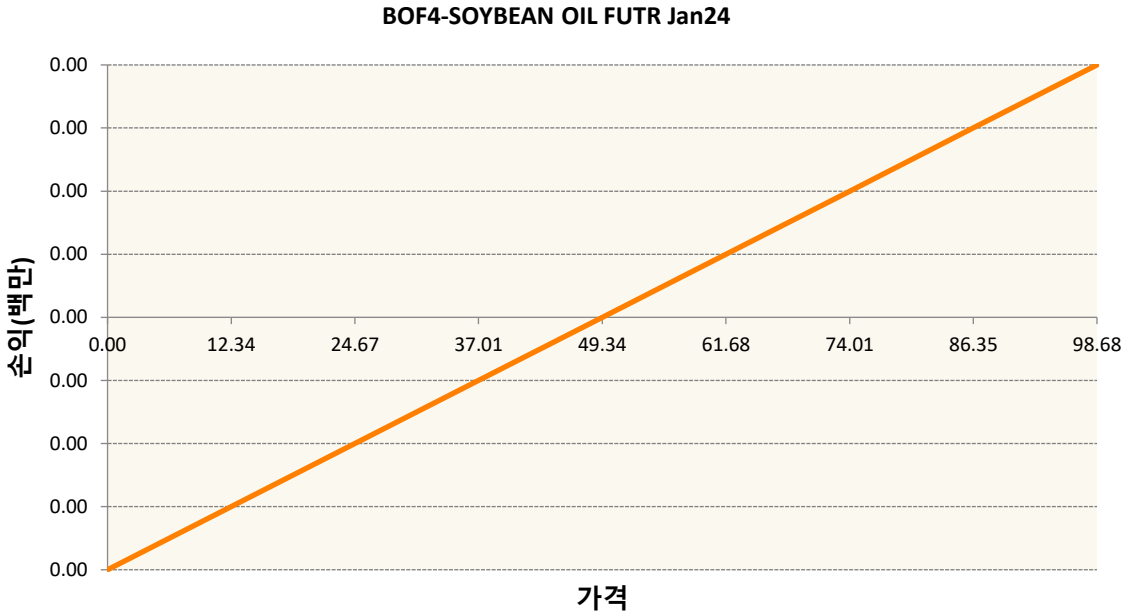
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

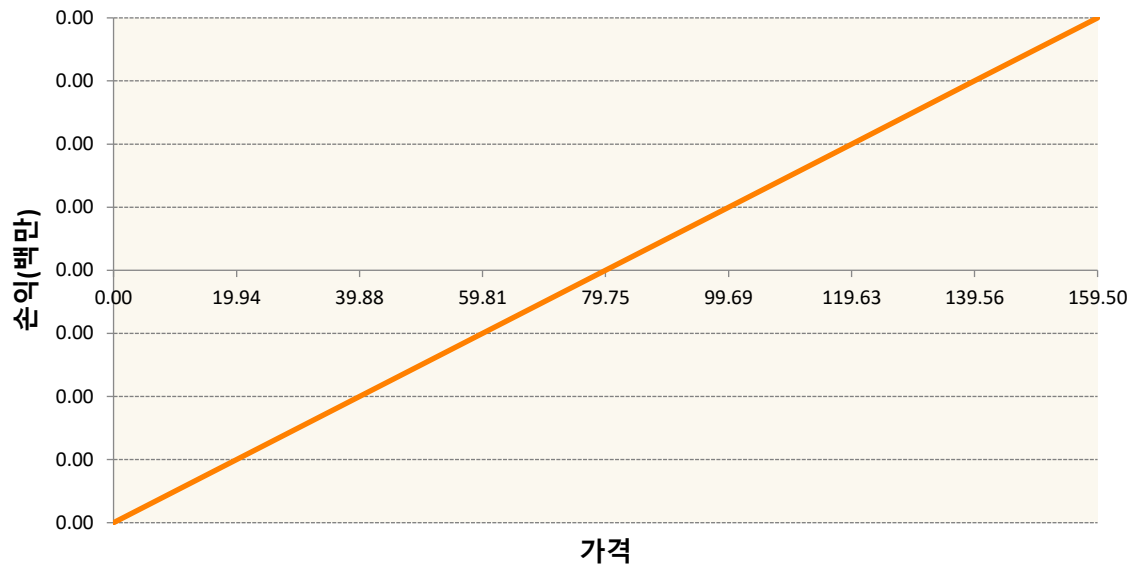
(단위:USD 백만)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	66	0	66	장내
누계	유가증권	선물	4,853	0	4,853	
누계	통화	선물	0	490	-490	장내

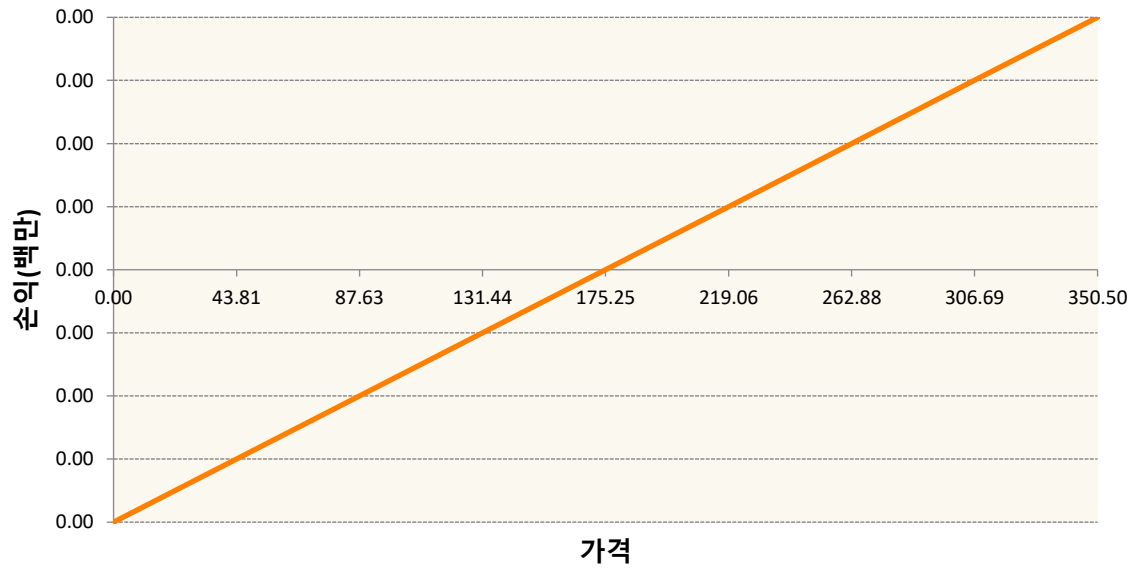
2. 만기시점의 손익구조



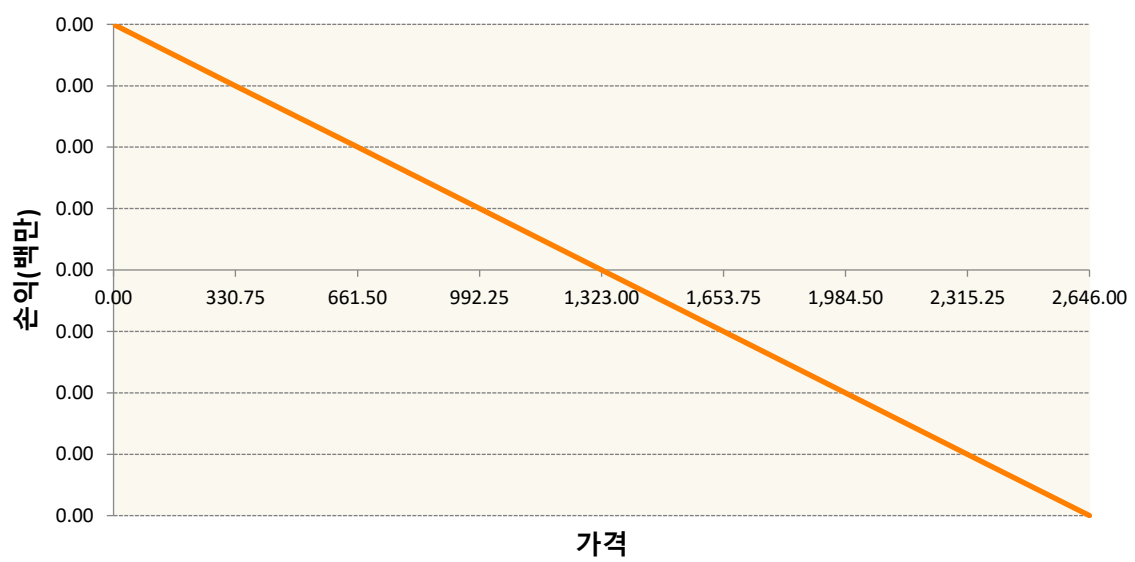
CTH4-COTTON NO.2 FUTR Mar24



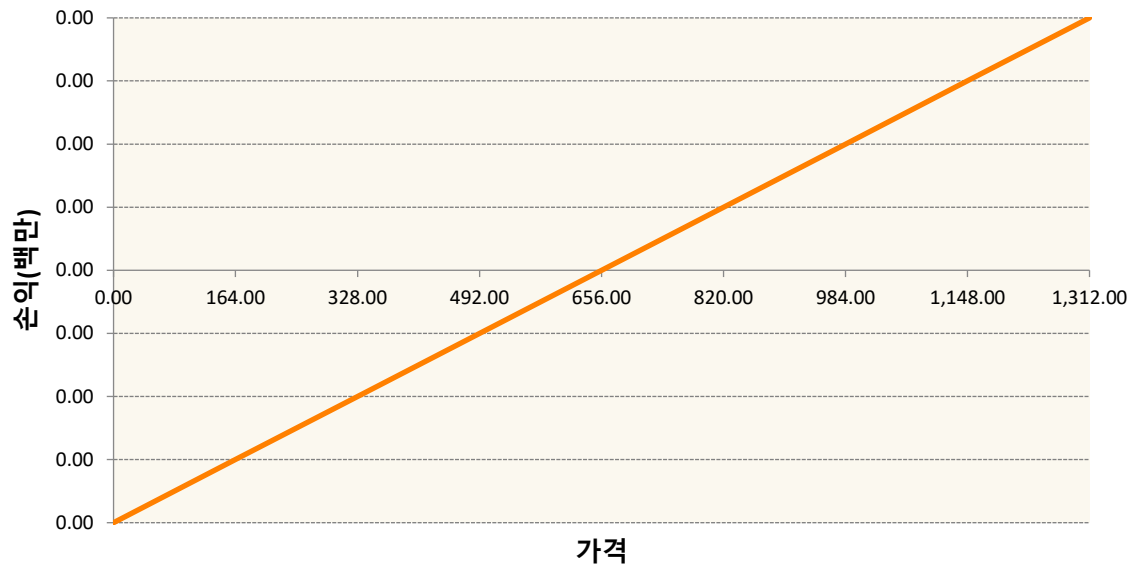
KCH4-COFFEE 'C' FUTURE Mar24



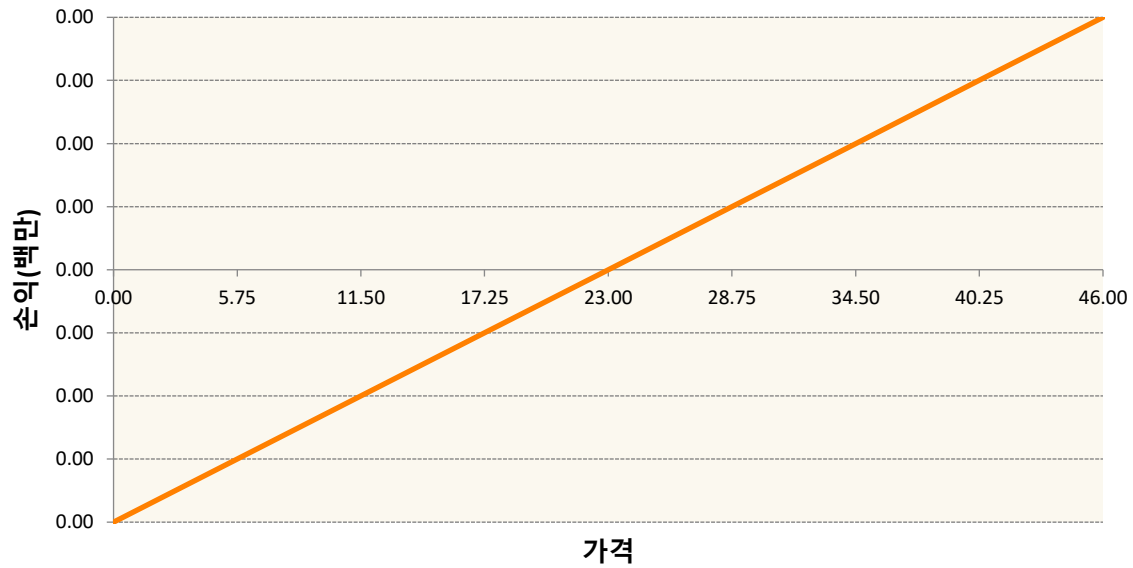
KR4175TC0009-2023-12 달러선물



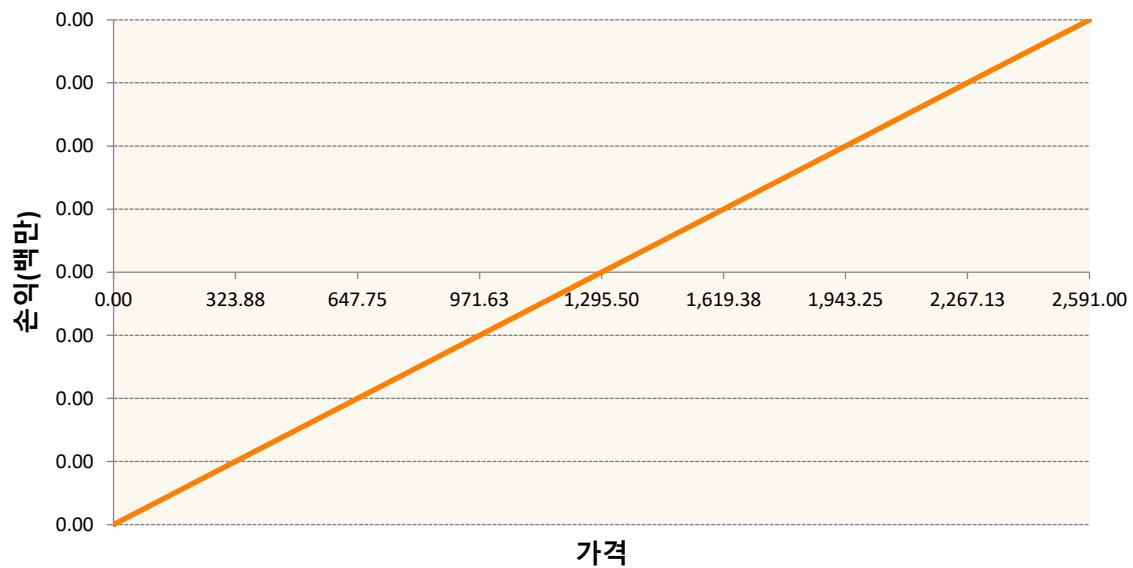
KWH4-KC HRW WHEAT FUT Mar24



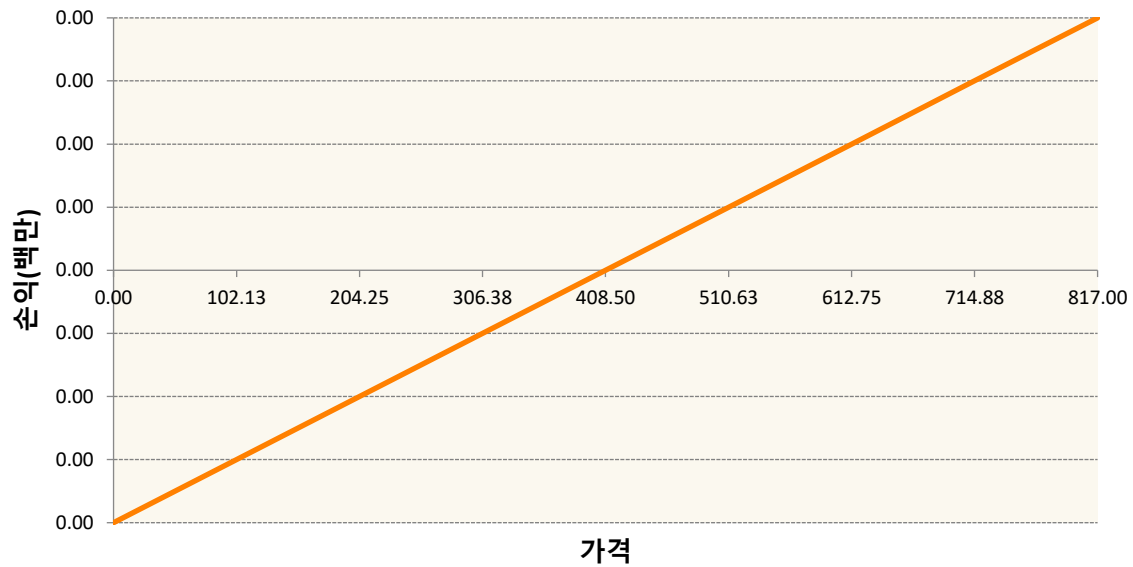
SBH4-Sugar #11 (WORLD) Mar24



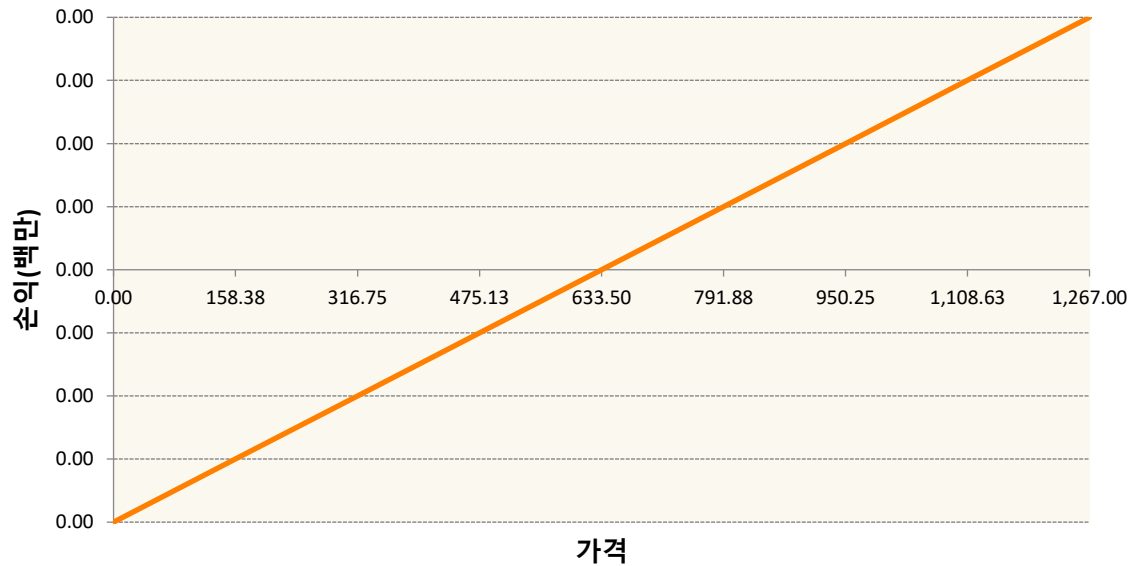
SF4-SOYBEAN FUTURE Jan24



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	2023-12-08
기준일	2023-12-07

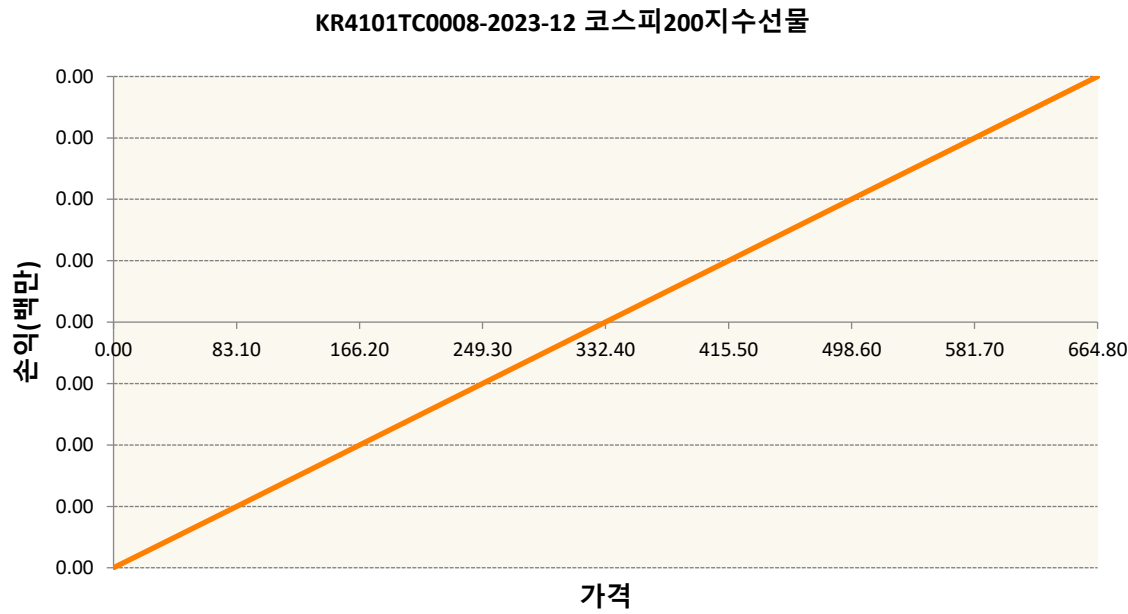
스마트인덱스모

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	1,745	0	1,745	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101TC0008			2023-12 코스피200지수선물				140
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-140	-140	-140	-140	-140	-140	-140
-5.33%	-93	-93	-93	-93	-93	-93	-93
-2.67%	-47	-47	-47	-47	-47	-47	-47
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	47	47	47	47	47	47	47
5.33%	93	93	93	93	93	93	93
8.00%	140	140	140	140	140	140	140

공시일	2023-12-08
기준일	2023-12-07

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	312
-----------------------------	-----

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

274

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2023-12-08
기준일	2023-12-07

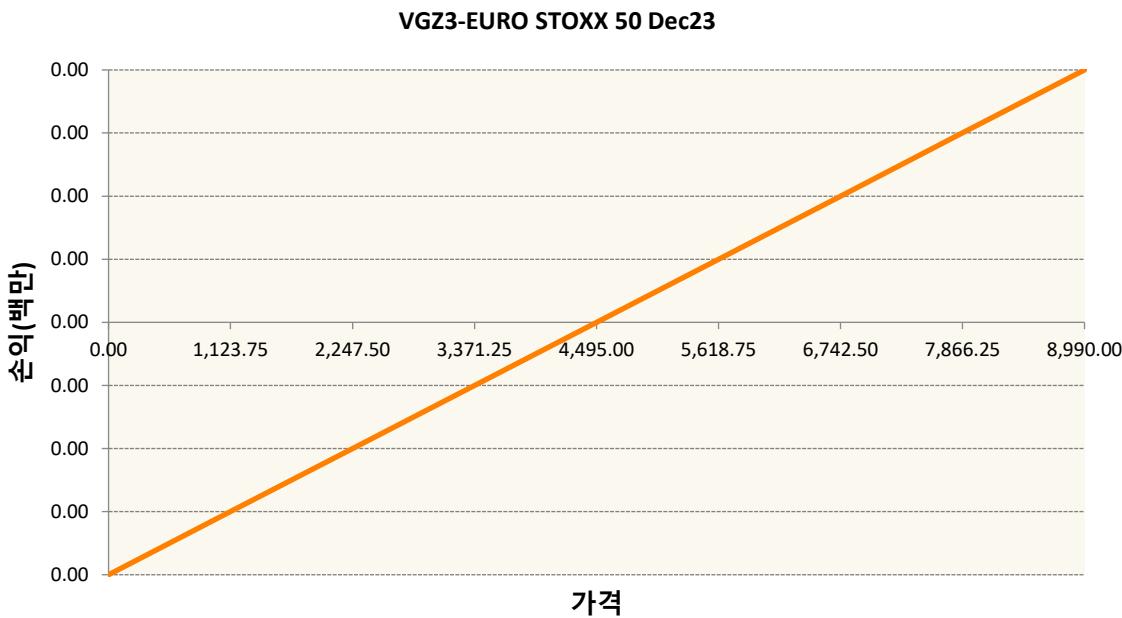
유로인덱스모(주식-파생형)

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	959	0	959	
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	77

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

(단위:백만원)

72

공시일	2023-12-08
기준일	2023-12-07

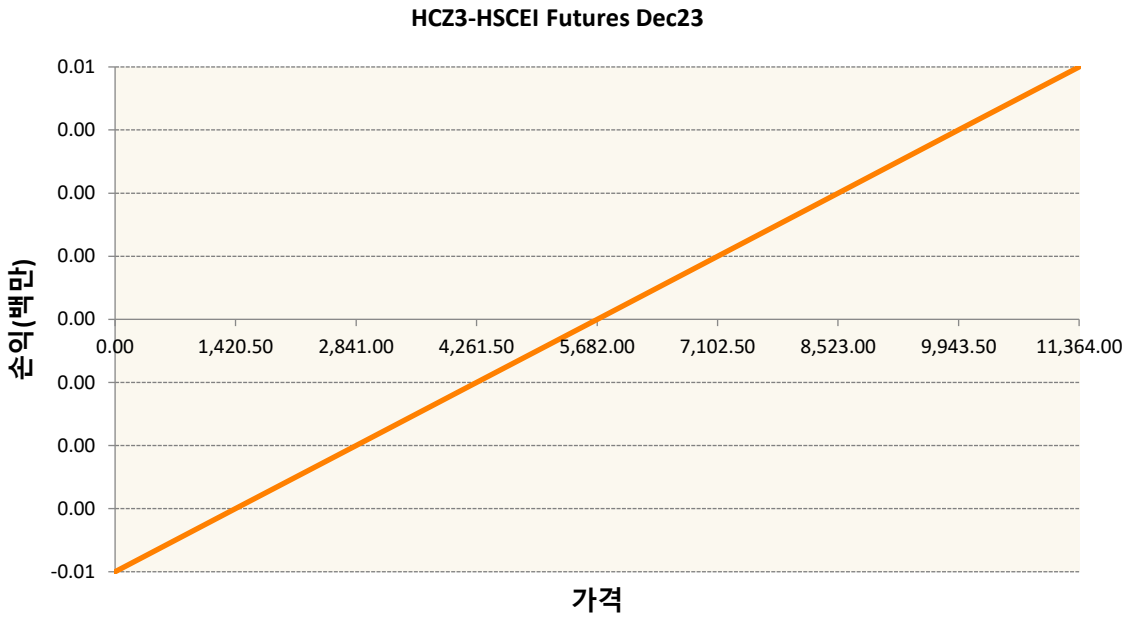
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,083	0	1,083	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCZ3	HSCEI Futures Dec23	87
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

126

공시일	2023-12-08
기준일	2023-12-07

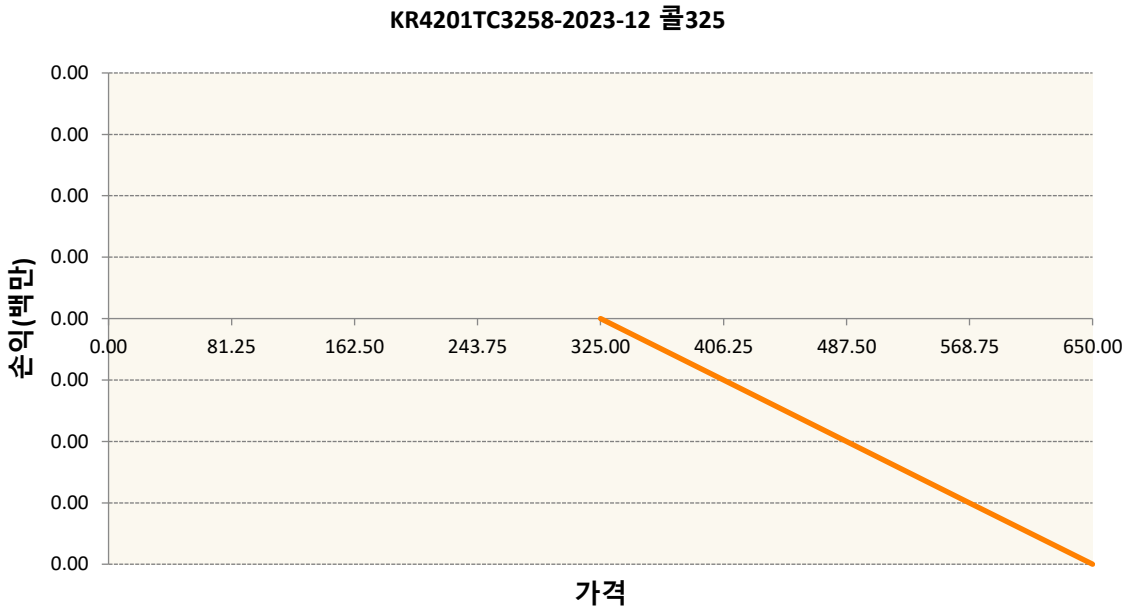
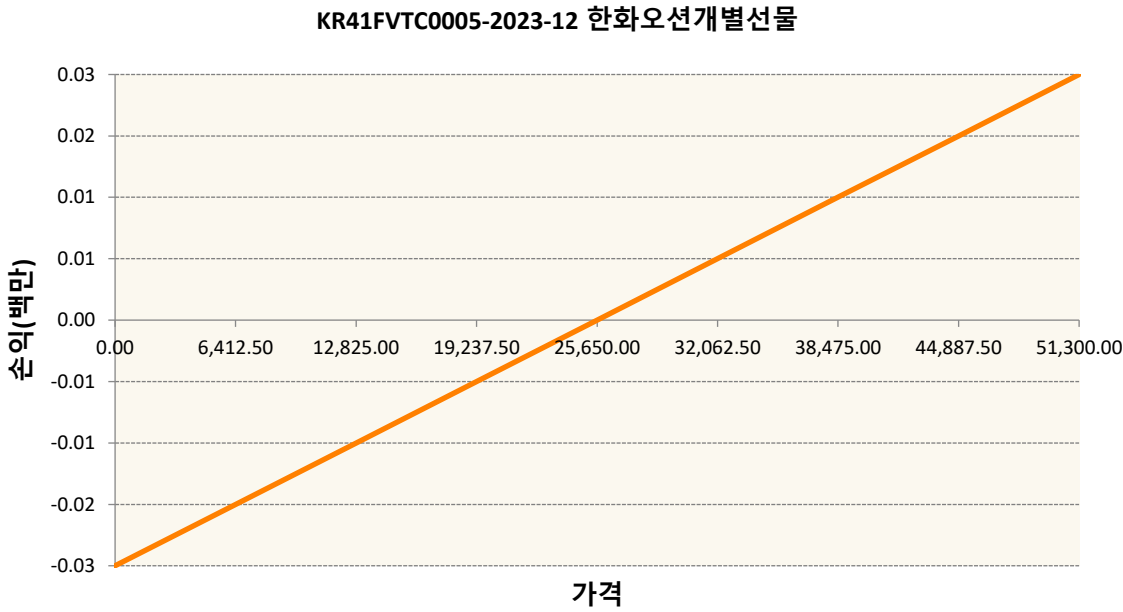
커버드콜모(주식혼합-파생형)

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	33	0	33	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 with major ticks every 81.88 units. The y-axis, labeled '손익(백만)' (Profit/Loss in millions), ranges from 0.00 to 0.00 with major ticks every 0.00 units. A blue line starts at the point (327.50, 0.00) and ends at the point (655.00, 0.00), indicating that the profit/loss is zero at these price points.

가격	손익(백만)
327.50	0.00
655.00	0.00

The graph displays a linear relationship between price and net income. The x-axis, labeled '가격' (Price), has major ticks at 0.00, 81.25, 162.50, 243.75, 325.00, 406.25, 487.50, 568.75, and 650.00. The y-axis, labeled '순이익 (백만)' (Net Income in millions), has major ticks at 0.00, 0.00, 0.00, 0.00, 0.00, 0.00, 0.00, 0.00, 0.00, and 0.00. A single orange line starts at (0, 0) and ends at (325, 0), indicating zero net income across the entire price range.

(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
-5.33%	-2	-2	-2	-2	-2	-2	-2
-2.67%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	1	1	1	1	1	1	1
5.33%	2	2	2	2	2	2	2
8.00%	3	3	3	3	3	3	3
KR4201TC3258		2023-12 콜325					2,916
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	907	907	907	907	907	906	905
-5.33%	904	900	895	888	881	871	861
-2.67%	746	722	698	674	651	627	603
0%	30	22	12	0	-13	-27	-43
2.67%	-943	-943	-943	-944	-946	-948	-951
5.33%	-1,929	-1,929	-1,929	-1,929	-1,929	-1,929	-1,930
8.00%	-2,916	-2,916	-2,916	-2,916	-2,916	-2,916	-2,916
KR4201TC3274 2023-12 콜327.5							451

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	106	106	106	106	106	106	106
-5.33%	106	106	106	105	104	104	103
-2.67%	95	92	89	85	82	79	75
0%	8	5	3	0	-3	-6	-9
2.67%	-141	-141	-141	-142	-142	-143	-144
5.33%	-296	-296	-296	-296	-296	-296	-296
8.00%	-451	-451	-451	-451	-451	-451	-451

KR4301TC3257 2023-12 풋325							499
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-498	-498	-498	-498	-498	-498	-499
-5.33%	-260	-260	-262	-263	-265	-267	-270
-2.67%	-58	-64	-70	-76	-82	-87	-93
0%	7	5	3	0	-3	-7	-10
2.67%	11	11	10	10	10	9	9
5.33%	11	11	11	11	11	11	11
8.00%	11	11	11	11	11	11	11

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

(단위:백만원)

4,630

공시일	2023-12-08
기준일	2023-12-07

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	1,939	0	1,939	

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	2023-12-08
기준일	2023-12-07

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	4,588	0	4,588	

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	2023-12-08
기준일	2023-12-07

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	17,765	0	17,765	
누계	통화	선도	0	16,931	-16,931	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
FXW213D9R\KRW/USD 29-12-23E		514
FXW213DAT\KRW/USD 31-01-24E		189
FXW213DBV\KRW/USD 29-02-24E		651
IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	

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

공시일	2023-12-08
기준일	2023-12-07

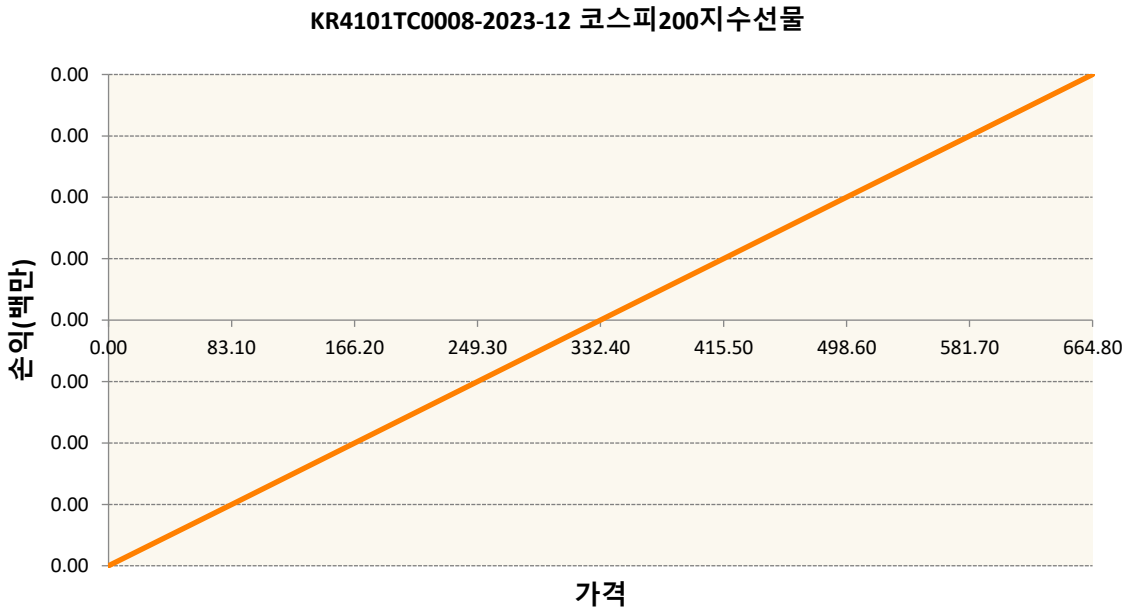
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

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	665	0	665	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101TC0008			2023-12 코스피200지수선물				53
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-53	-53	-53	-53	-53	-53	-53
-5.33%	-35	-35	-35	-35	-35	-35	-35
-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%	35	35	35	35	35	35	35
8.00%	53	53	53	53	53	53	53

공시일	2023-12-08
기준일	2023-12-07

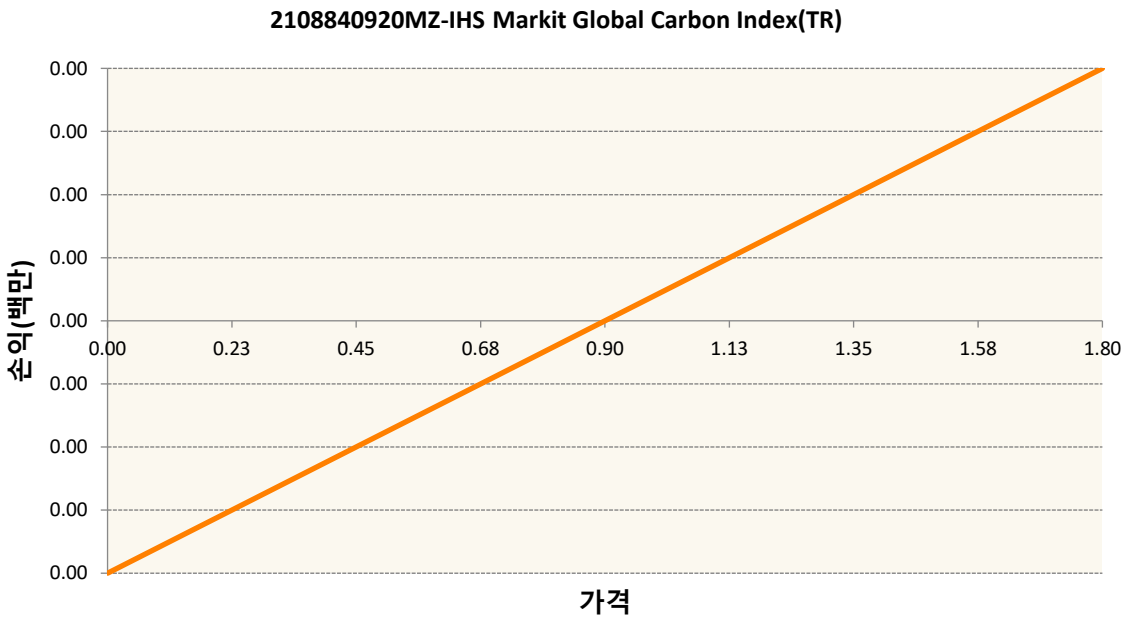
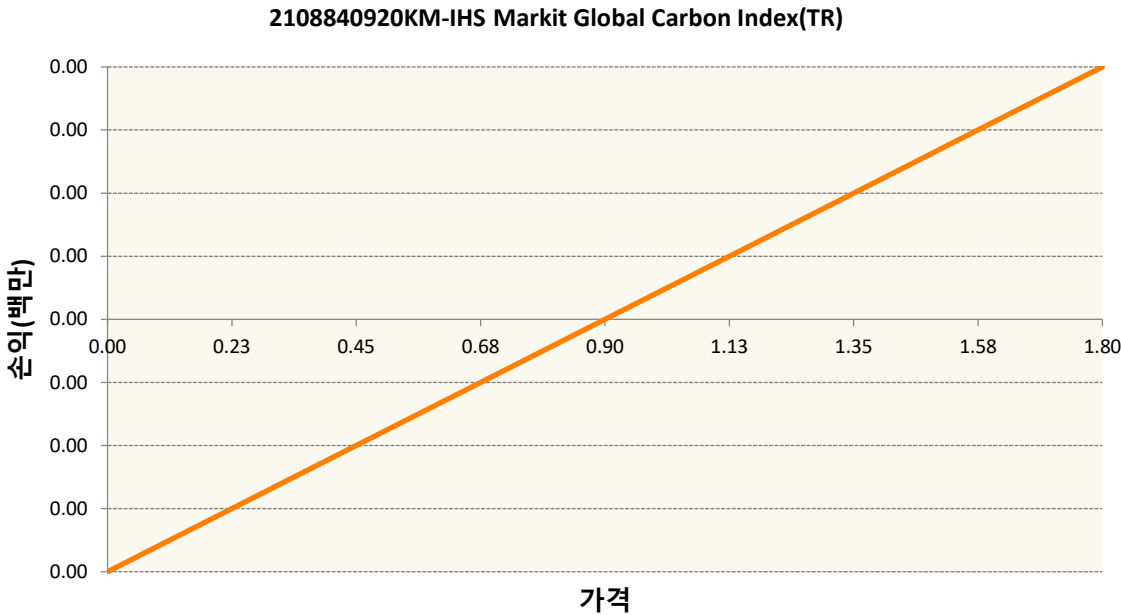
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

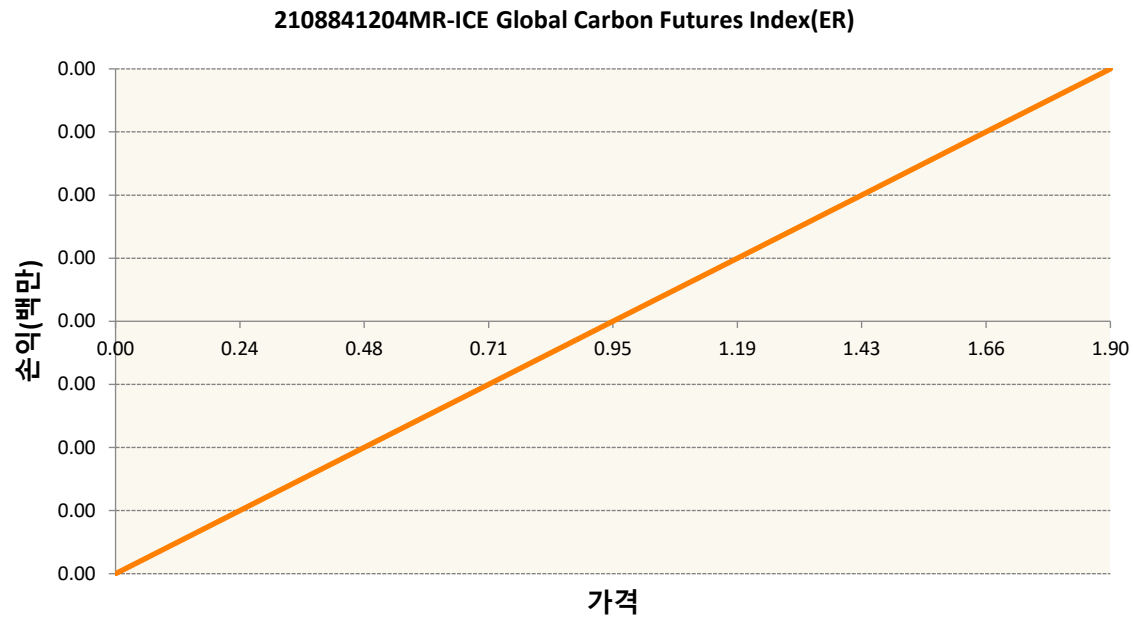
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	18,249	0	18,249	

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108840920IIHS Markit Global Carbon Index(TR)		915
2108840920IIHS Markit Global Carbon Index(TR)		183
2108841204IIICE Global Carbon Futures Index(ER)		366

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)		(단위:백만원)
		1,850

공시일	2023-12-08
기준일	2023-12-07

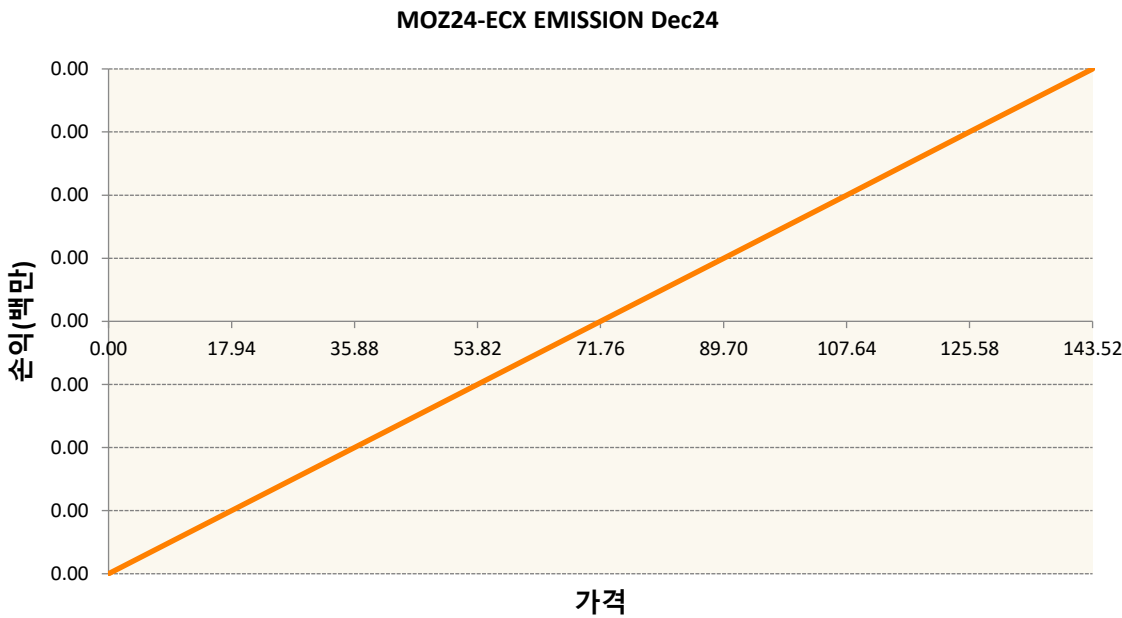
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	7,775	0	7,775	
누계	지수	스왑	479	0	479	장외
누계	통화	선도	0	1,439	-1,439	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213DBV KRW/EUR 28-12-23E	115
MOZ24 ECX EMISSION Dec24	622
SWICEUACN ICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX	7

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

(단위:백만원)

1,207

공시일	2023-12-08
기준일	2023-12-07

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)	18
SWCSI00000 신한CSI Index 230622 (메리츠)	18
SWCSI00000 신한CSI Index 230922 (키움)	11
SWCSI00000 신한CSI Index 231013 (NH)	13

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

(단위:백만원)

87

공시일	2023-12-08
기준일	2023-12-07

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)	1
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 230116(메리츠)	2
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 230116(미래)	2
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 230427(키움)	0.38

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

(단위:백만원)

5

공시일	2023-12-08
기준일	2023-12-07

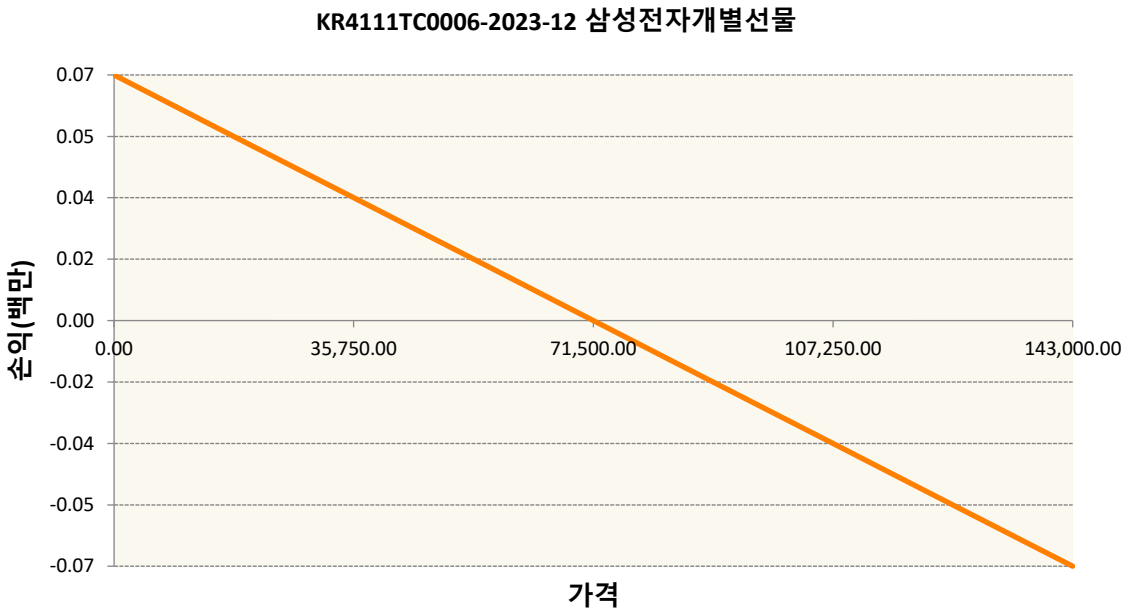
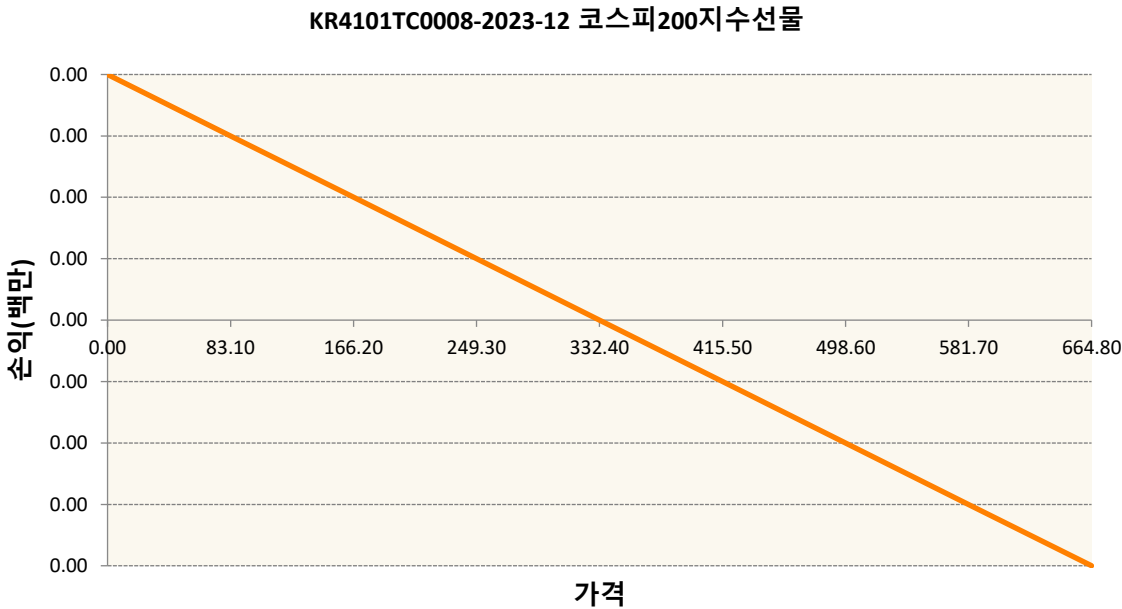
에퀴티알파일반사모혼합자산

1. 계약금액

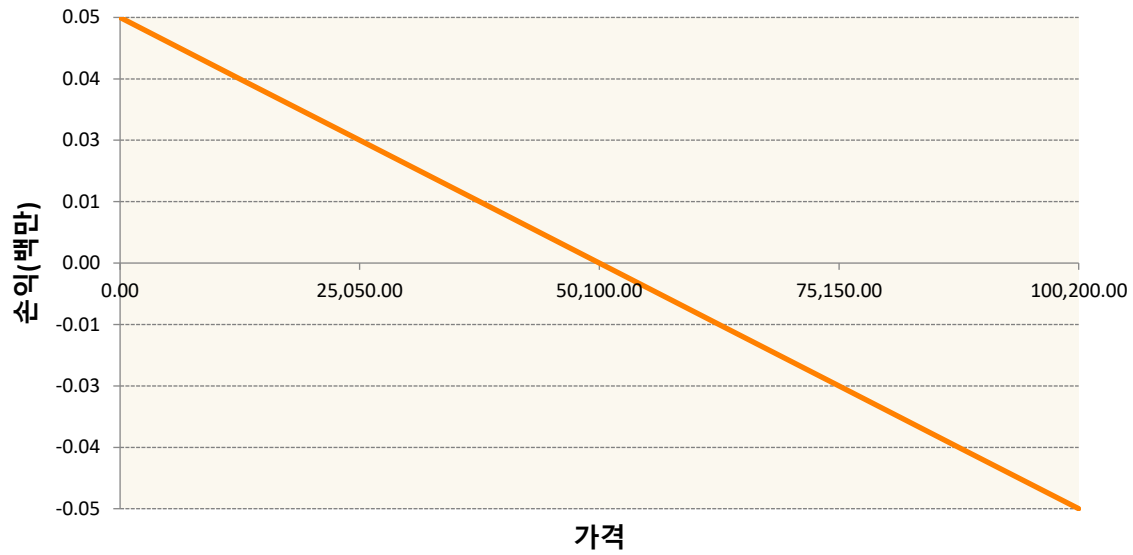
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	458	448	10	장내
누계	유가증권	선물	14	3,081	-3,068	장내

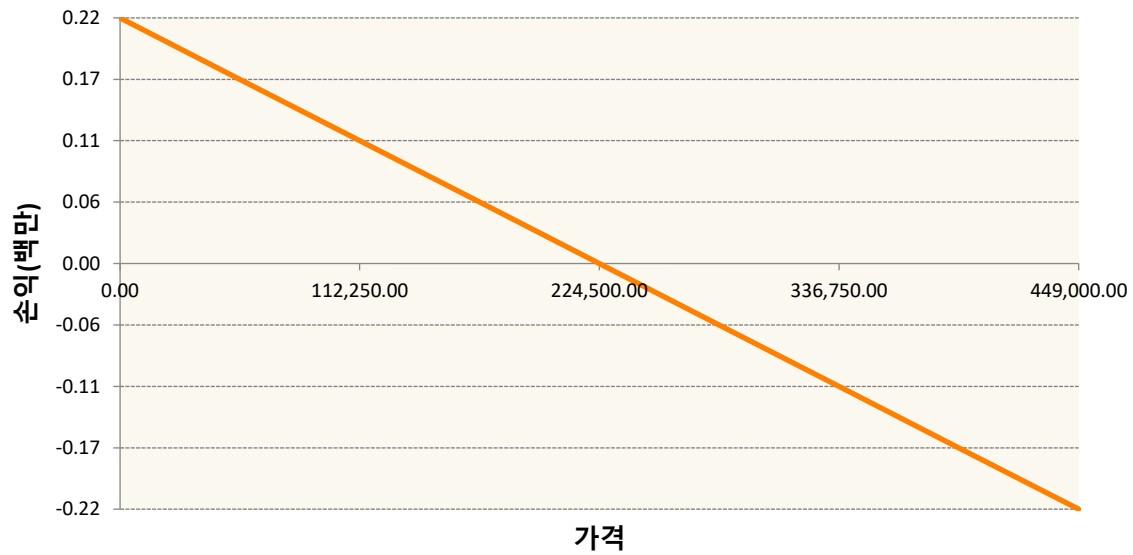
2. 만기시점의 손익구조



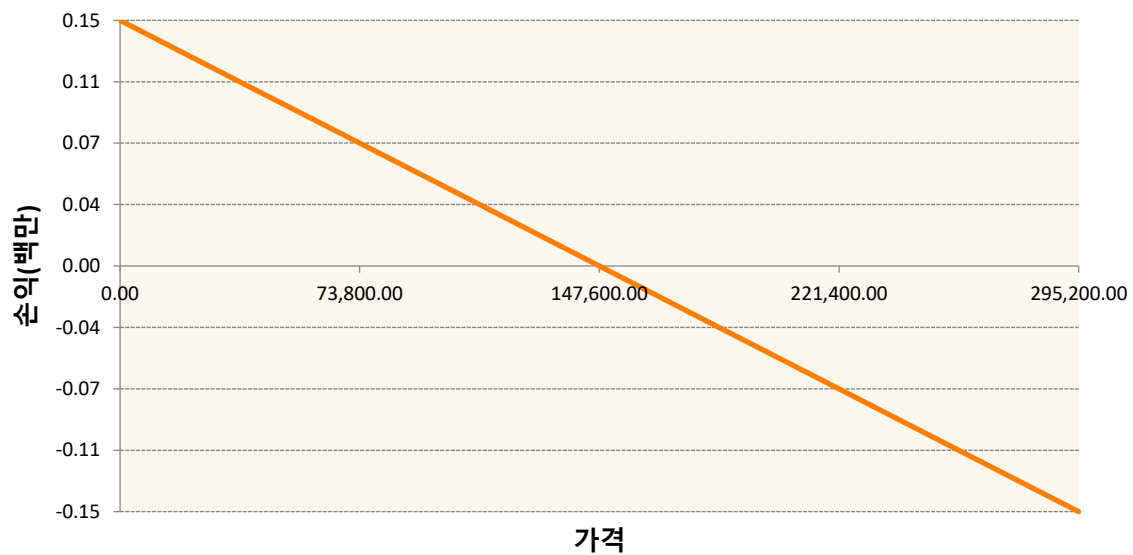
KR4112TC0005-2023-12 SK텔레콤개별선물



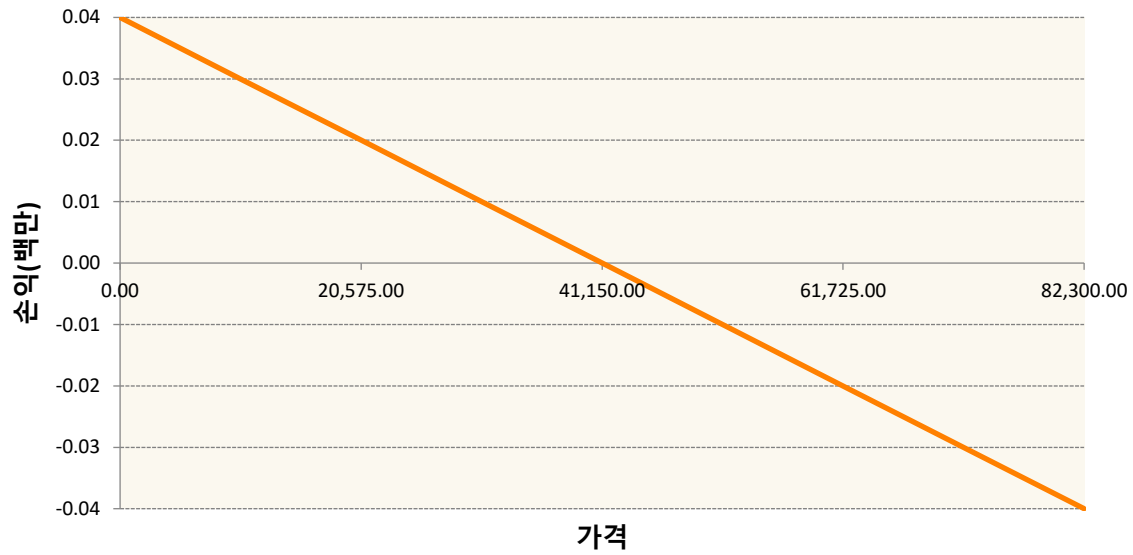
KR4120TC0005-2023-12 현대모비스개별선물



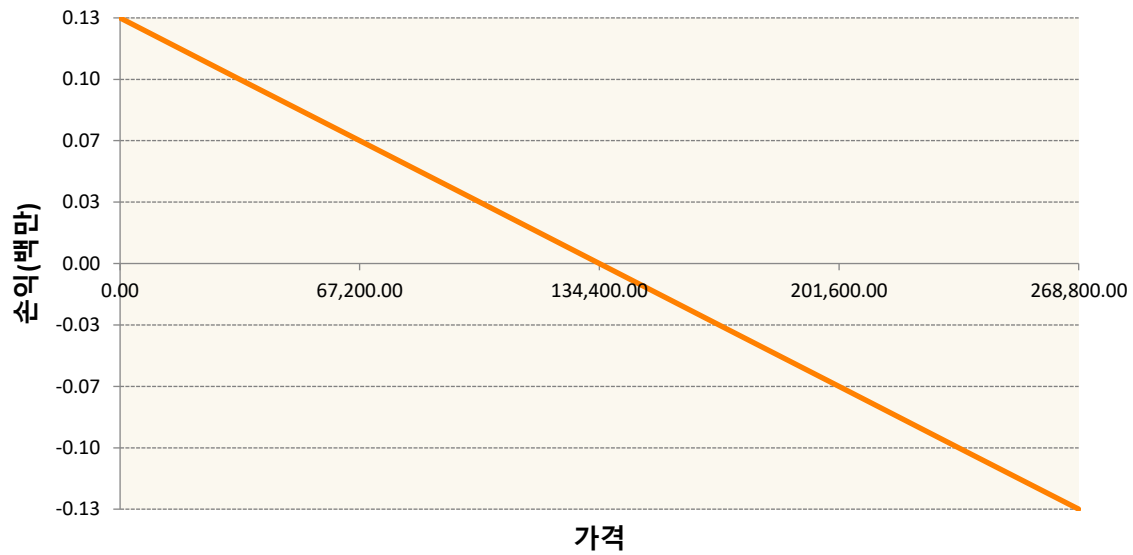
KR4123TC0002-2023-12 삼성전기개별선물



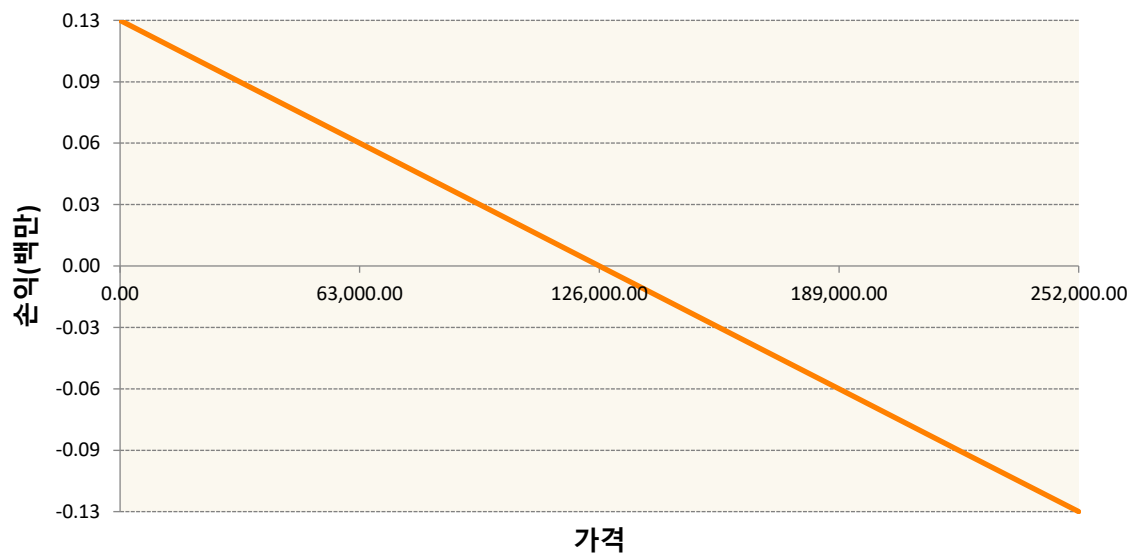
KR4140TC0001-2023-12 하나금융지주개별선물



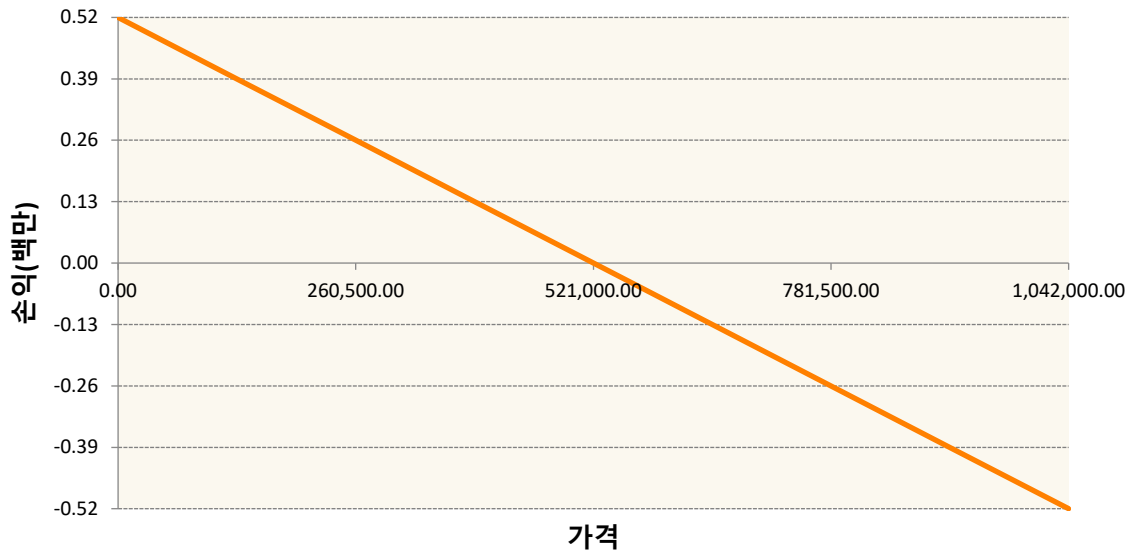
KR4141TC0000-2023-12 SK이노베이션개별선물



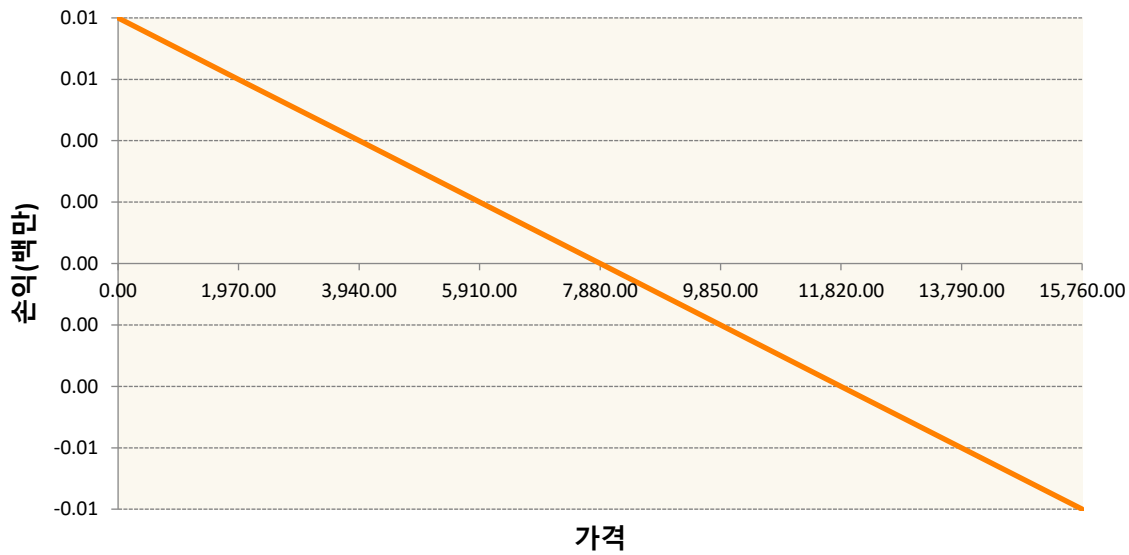
KR4150TC0008-2023-12 SK하이닉스개별선물



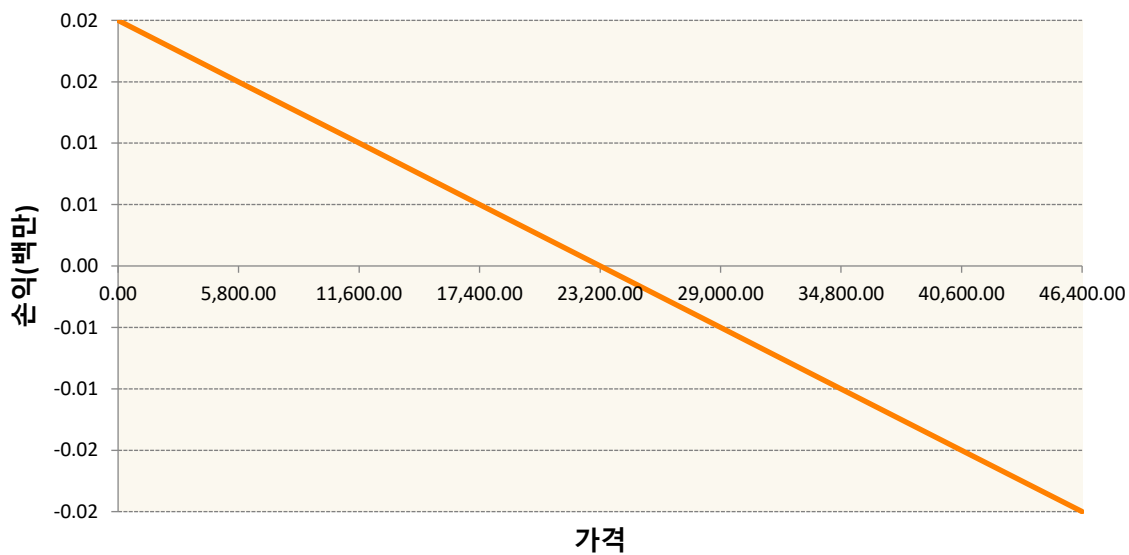
KR41B3TC0002-2023-12 고려아연개별선물



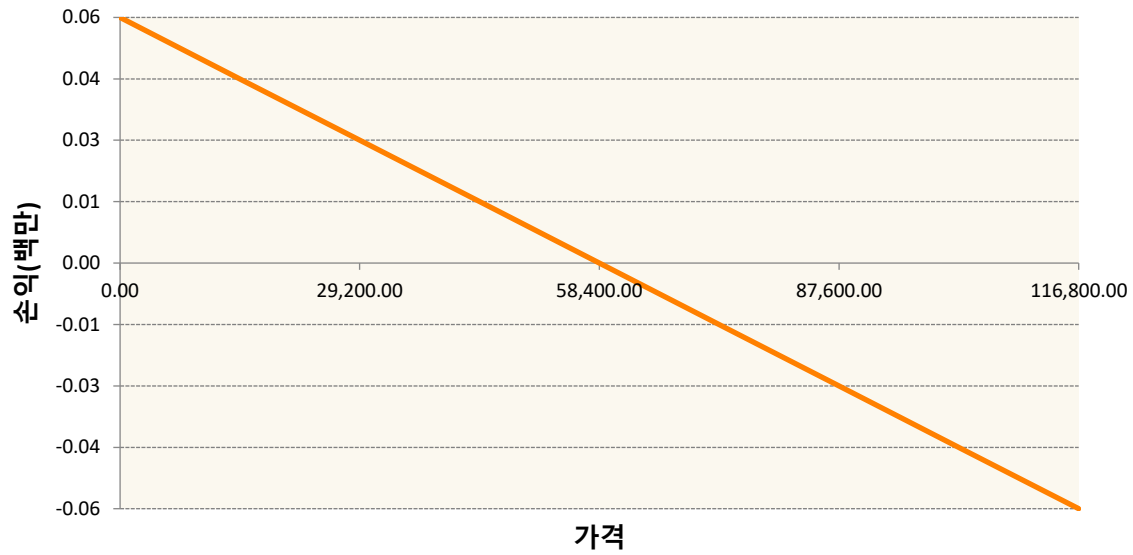
KR41BFTC0009-2023-12 삼성중공업개별선물



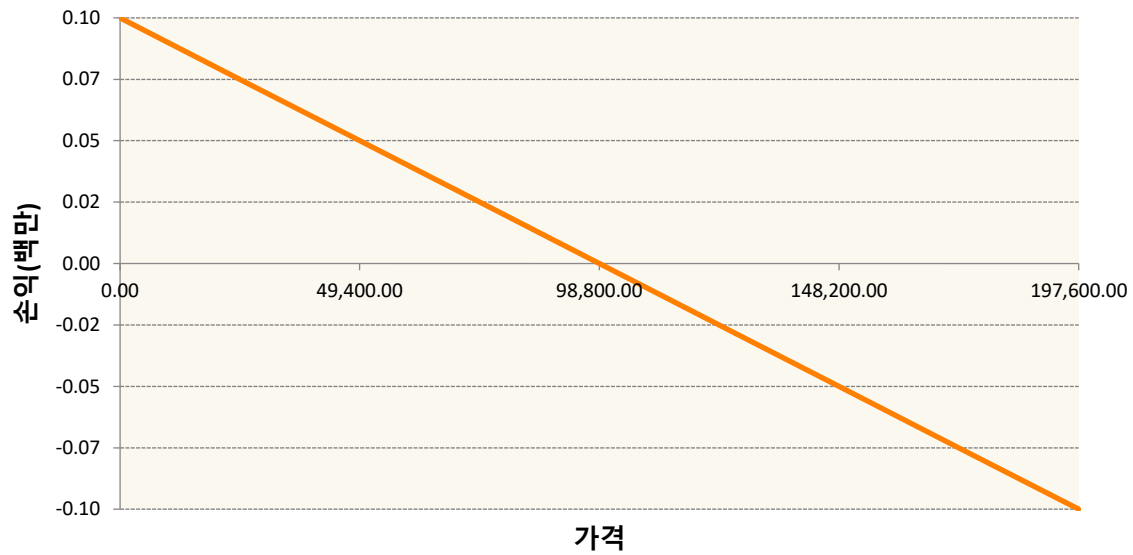
KR41BKTC0002-2023-12 하이트진로개별선물



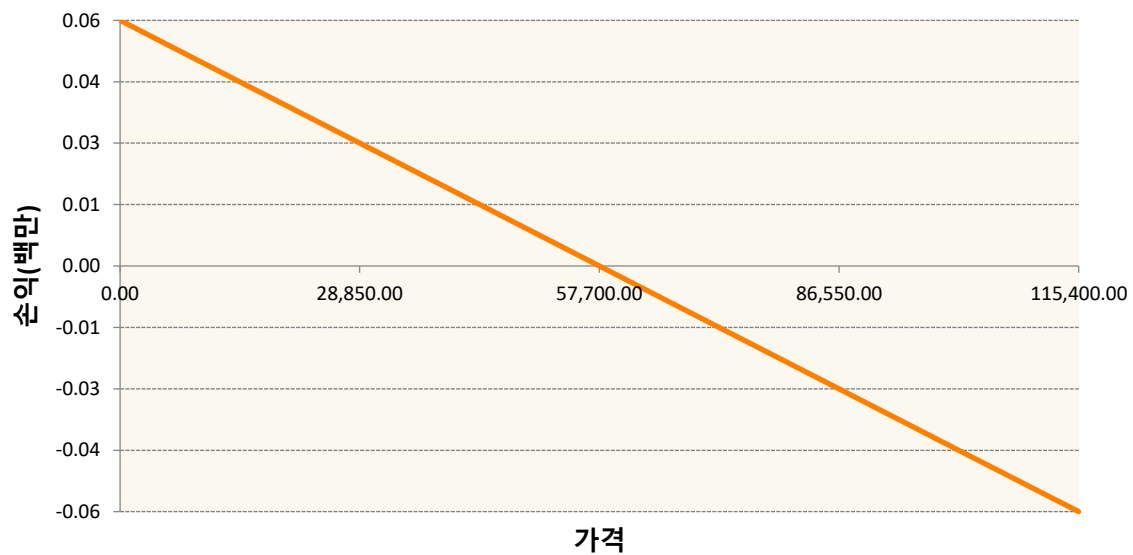
KR41CQTC0005-2023-12 와이지엔터테인먼트개별선물



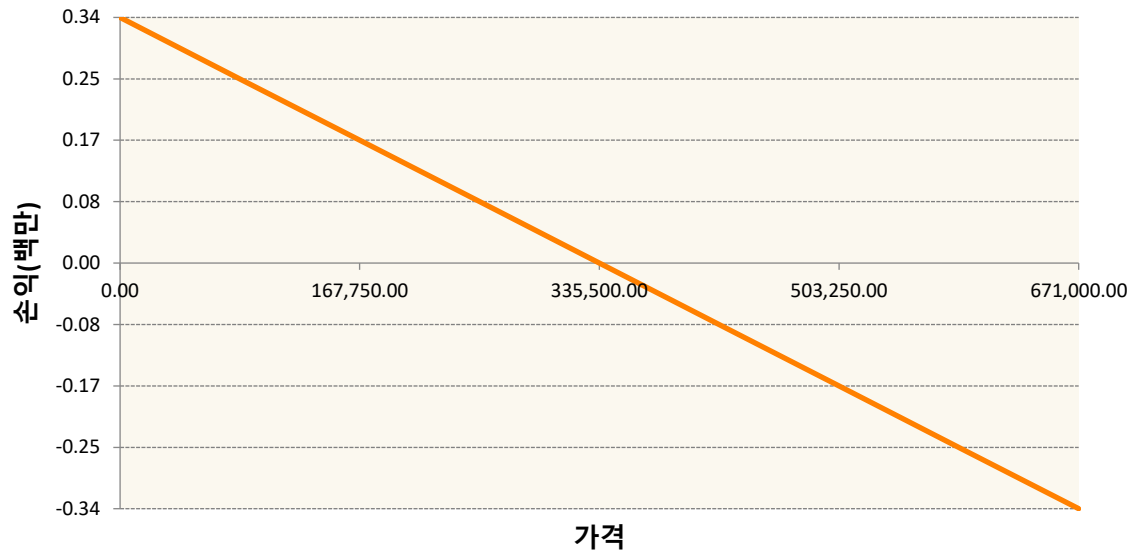
KR41DBTC0001-2023-12 LIG넥스원개별선물



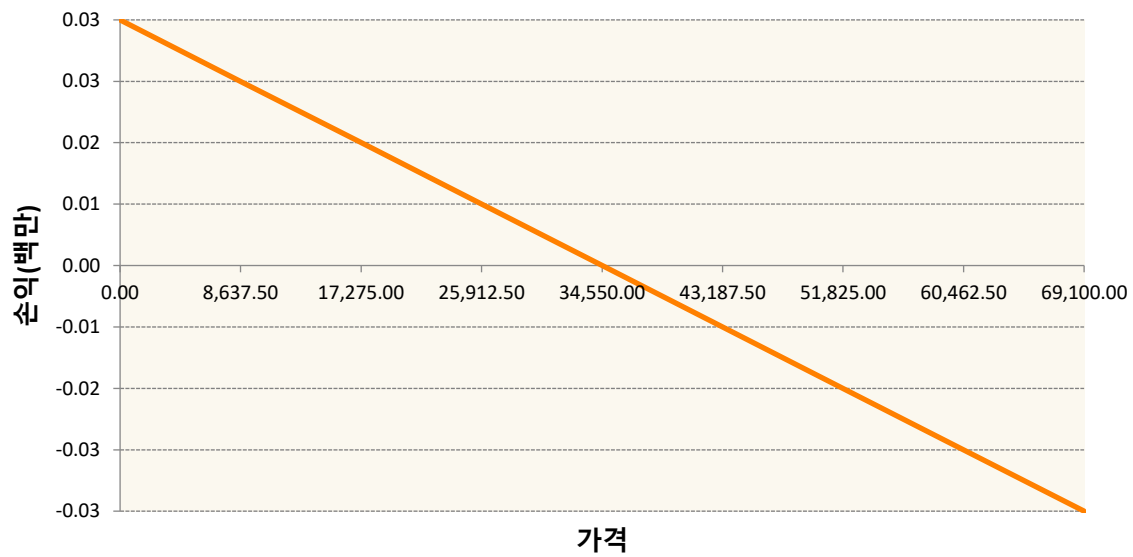
KR41E5TC0004-2023-12 넷마블개별선물



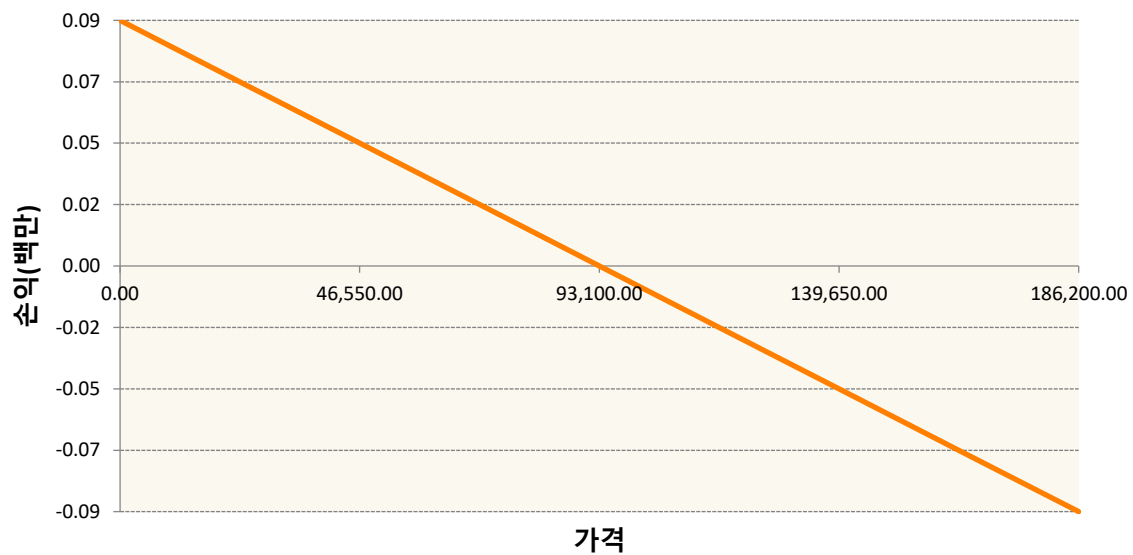
KR41E8TC0001-2023-12 포스코케미칼개별선물



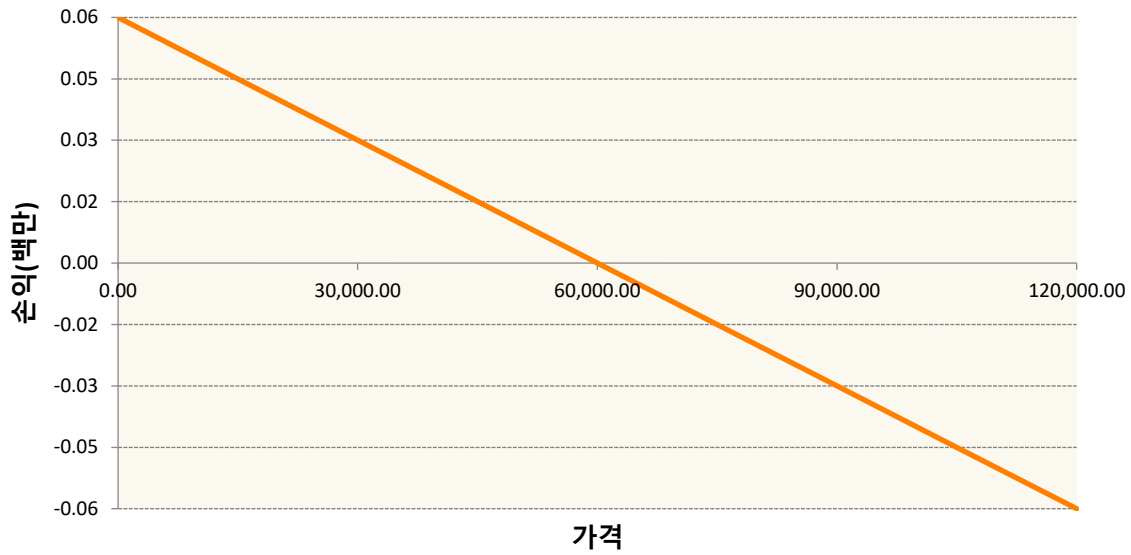
KR41EETC0007-2023-12 한올바이오파마개별선물



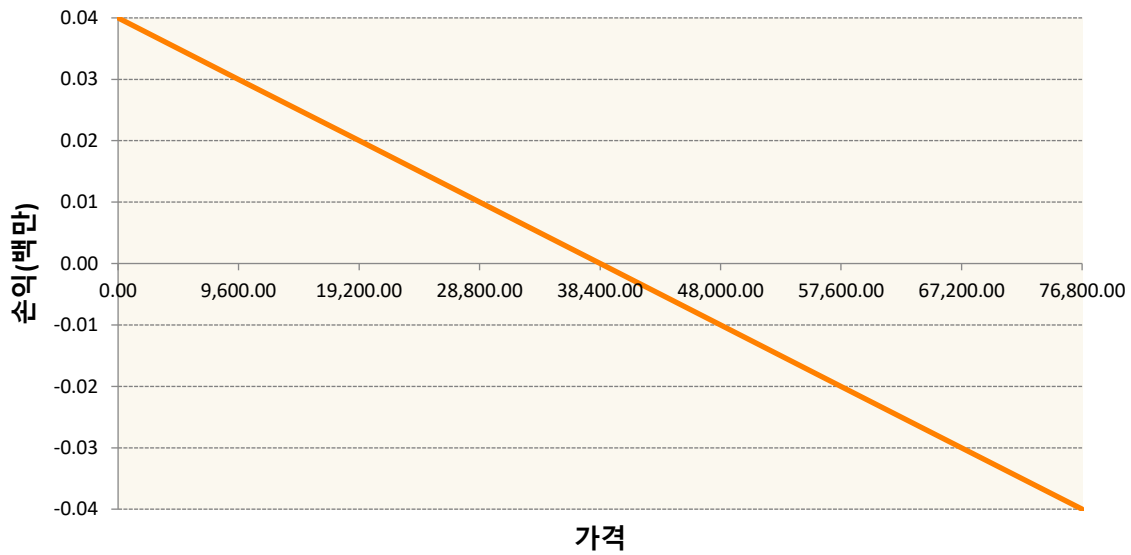
KR41EFTC0006-2023-12 JYP Ent.개별선물



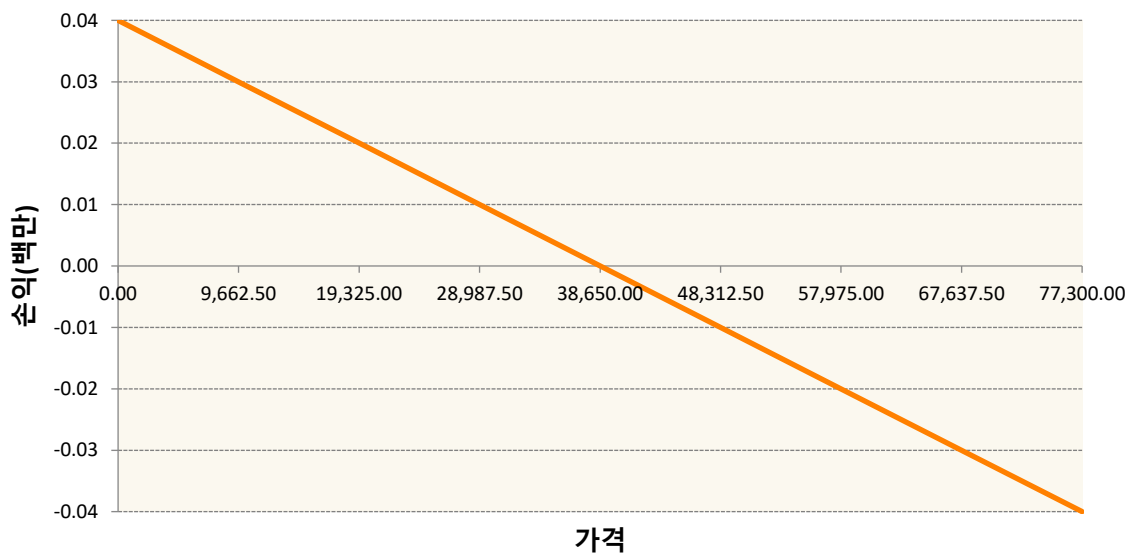
KR41EKTC0009-2023-12 DB하이텍개별선물



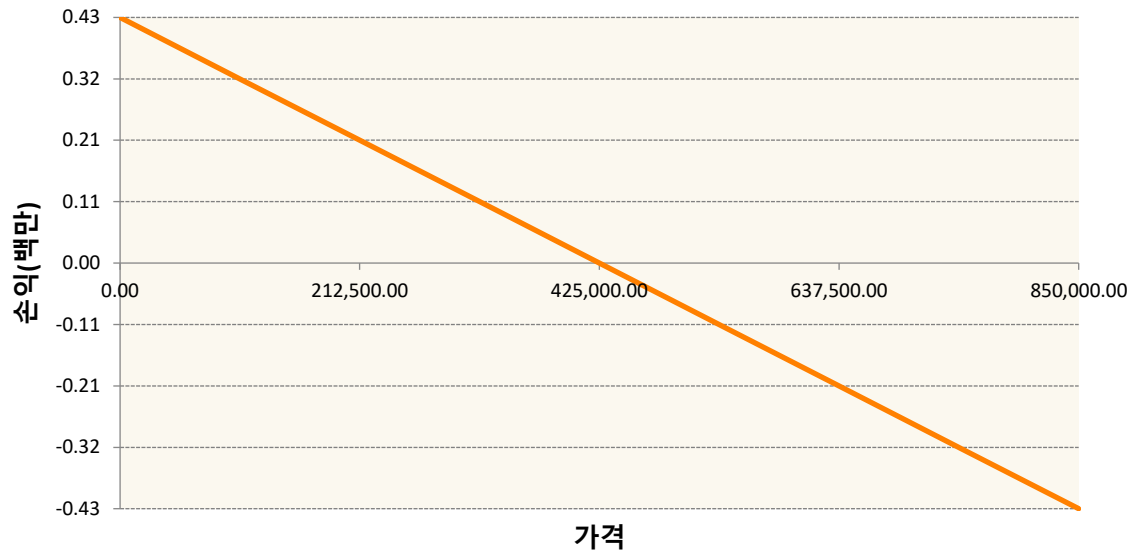
KR41ENTC0006-2023-12 동진세미캠개별선물



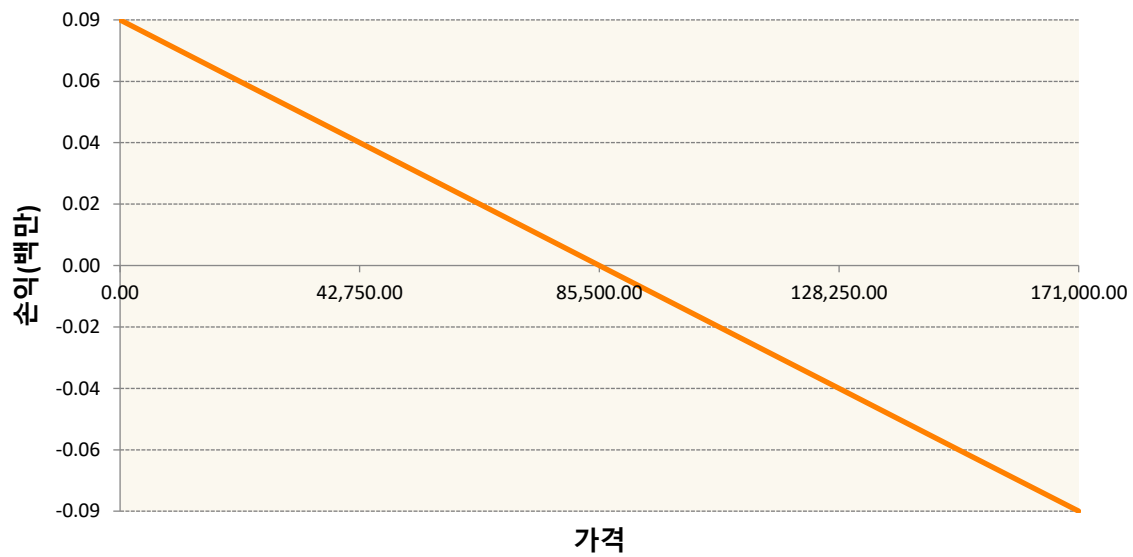
KR41ERTC0002-2023-12 DL이앤씨개별선물



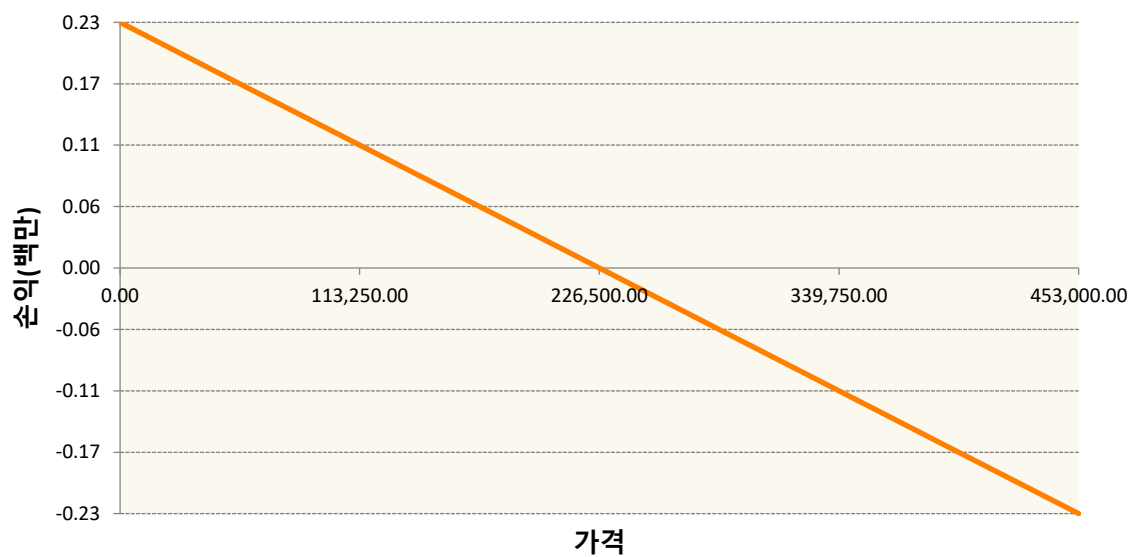
KR41F5TC0001-2023-12 LG에너지솔루션개별선물



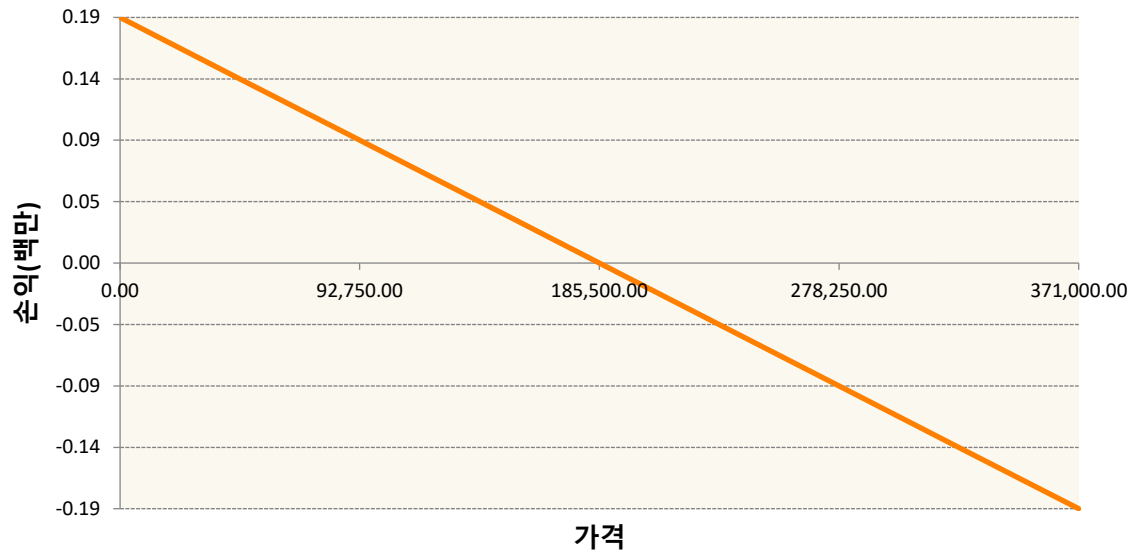
KR41FBTC0009-2023-12 SK아이이테크놀로지개별선물



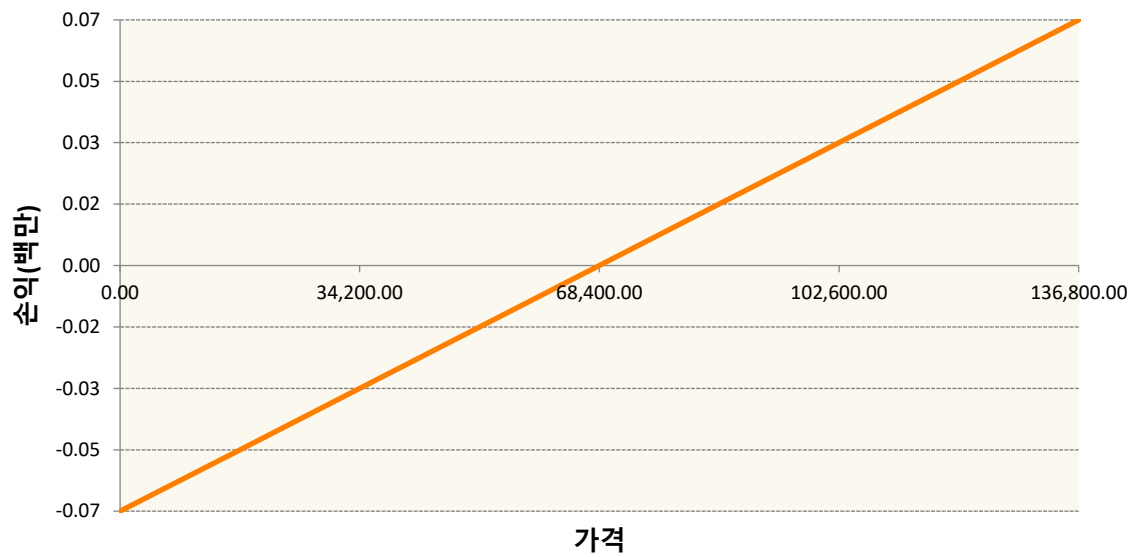
KR41FCTC0008-2023-12 하이브개별선물



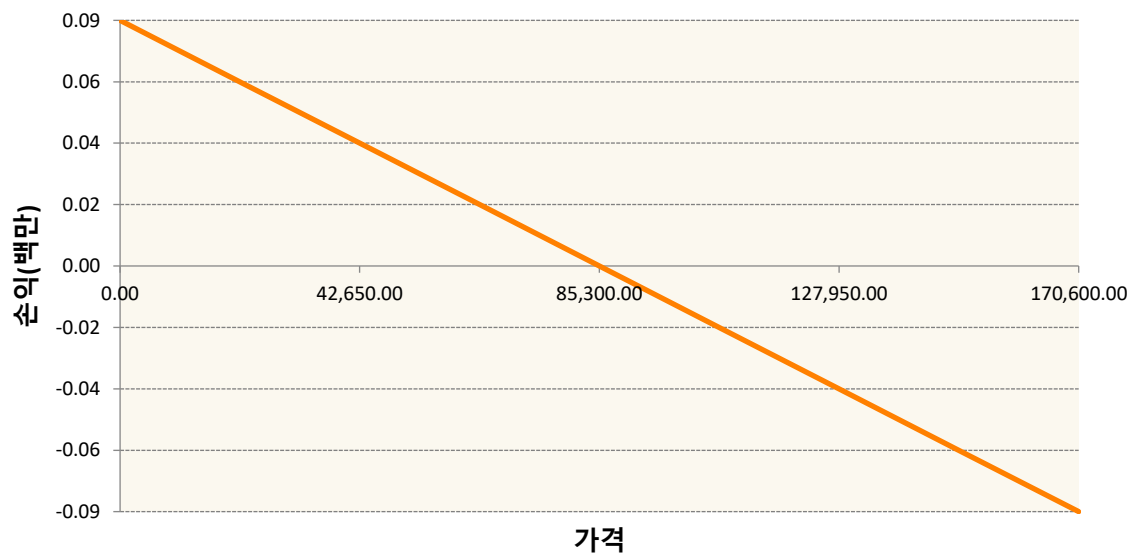
KR41FMTC0006-2023-12 엘애프개별선물



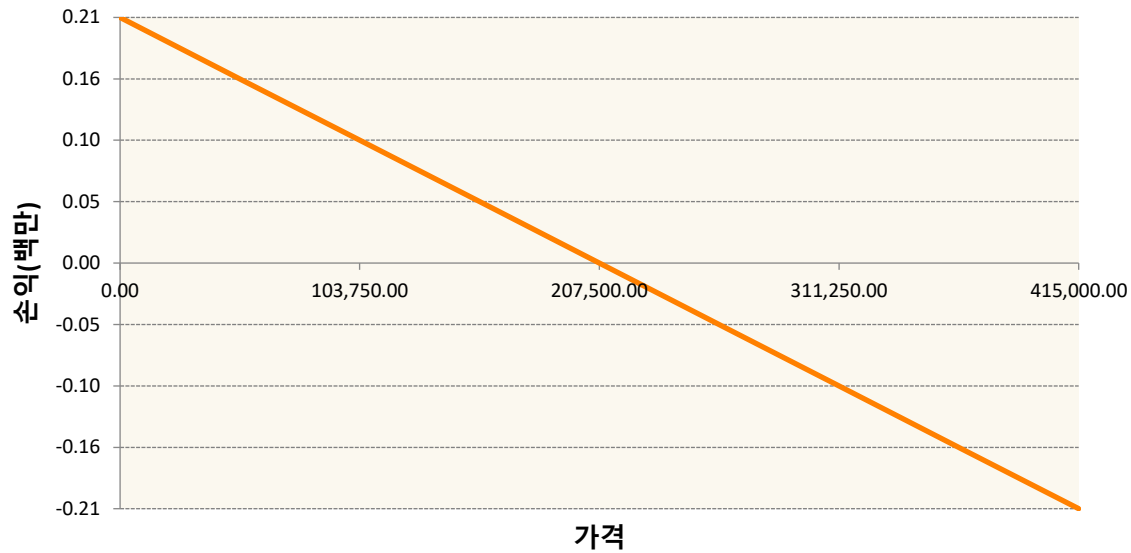
KR41FNTC0005-2023-12 위메이드개별선물



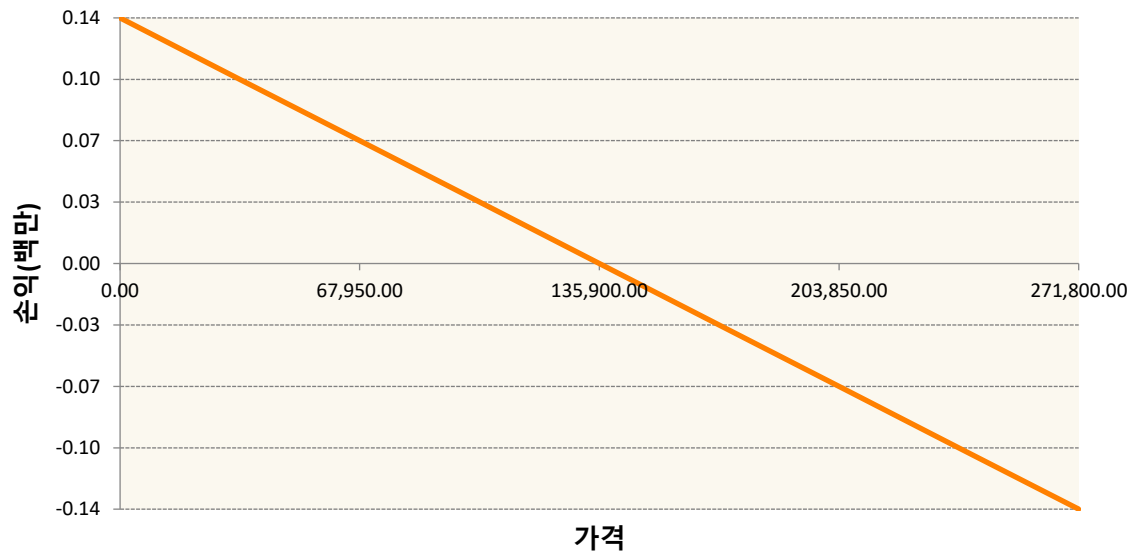
KR41FSTC0000-2023-12 LS개별선물



KR41G4TC0000-2023-12 한솔케미칼개별선물



KR41GCTC0007-2023-12 이오테크닉스개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101TC00 2023-12 코스피200지수선물	173
KR4111TC00 2023-12 삼성전자개별선물	19
KR4112TC00 2023-12 SK텔레콤개별선물	2
KR4120TC00 2023-12 현대모비스개별선물	3
KR4123TC00 2023-12 삼성전기개별선물	1
KR4140TC00 2023-12 하나금융지주개별선물	2
KR4141TC00 2023-12 SK이노베이션개별선물	1
KR4150TC00 2023-12 SK하이닉스개별선물	3
KR41B3TC00 2023-12 고려아연개별선물	0.42
KR41BFTC00 2023-12 삼성중공업개별선물	2
KR41BKTC00 2023-12 하이트진로개별선물	5
KR41CQTC00 2023-12 와이즈엔터테인먼트개별선물	1

KR41DBTC00 2023-12 LIG넥스원개별선물	1
KR41E5TC00 2023-12 넷마블개별선물	7
KR41E8TC00 2023-12 포스코케미칼개별선물	6
KR41EETC00 2023-12 한올바이오파마개별선물	0.22
KR41EFTC00 2023-12 JYP Ent.개별선물	1
KR41EKTC00 2023-12 DB하이텍개별선물	1
KR41ENTC00 2023-12 동진썬미켄개별선물	1
KR41ERTC00 2023-12 DL이앤씨개별선물	4
KR41F5TC00 2023-12 LG에너지솔루션개별선물	2
KR41FBTC00 2023-12 SK아이이테크놀로지개별선물	3
KR41FCTC00 2023-12 하이브개별선물	4
KR41FMTC00 2023-12 엘앤에프개별선물	0.3
KR41FNTC00 2023-12 위메이드개별선물	1
KR41FSTC00 2023-12 LS개별선물	1
KR41G4TC00 2023-12 한솔케미칼개별선물	1
KR41GCTC00 2023-12 이오테크닉스개별선물	1

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

(단위:백만원)

315

공시일	2023-12-08
기준일	2023-12-07

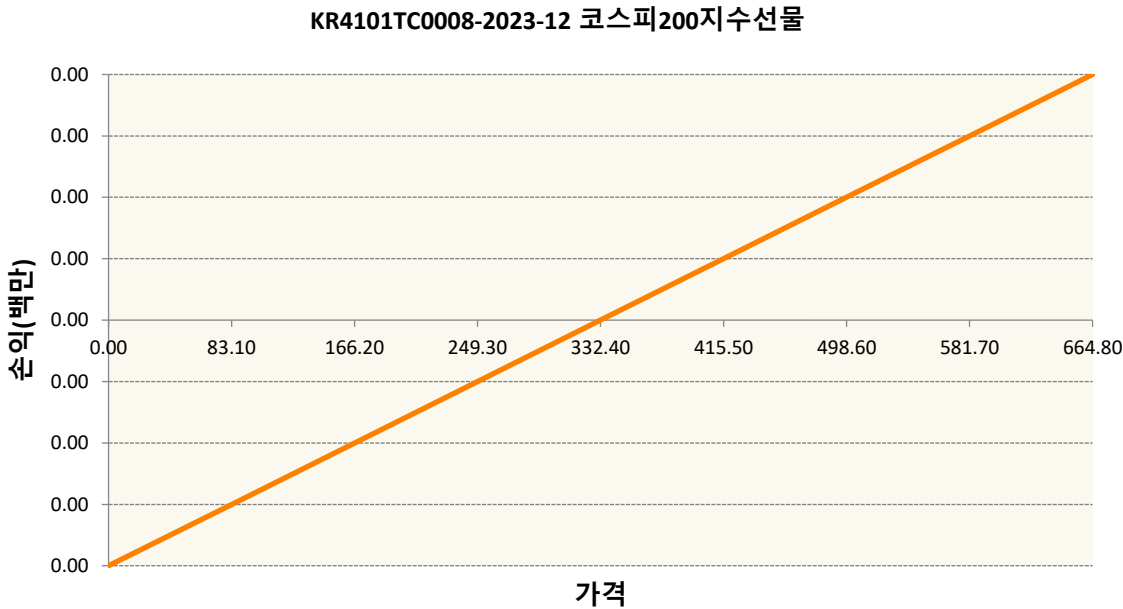
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

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	4,321	0	4,321	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101TC0008			2023-12 코스피200지수선물				346
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-346	-346	-346	-346	-346	-346	-346
-5.33%	-231	-231	-231	-231	-231	-231	-231
-2.67%	-115	-115	-115	-115	-115	-115	-115
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	115	115	115	115	115	115	115
5.33%	231	231	231	231	231	231	231
8.00%	346	346	346	346	346	346	346

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

(단위:백만원)

320

공시일	2023-12-08
기준일	2023-12-07

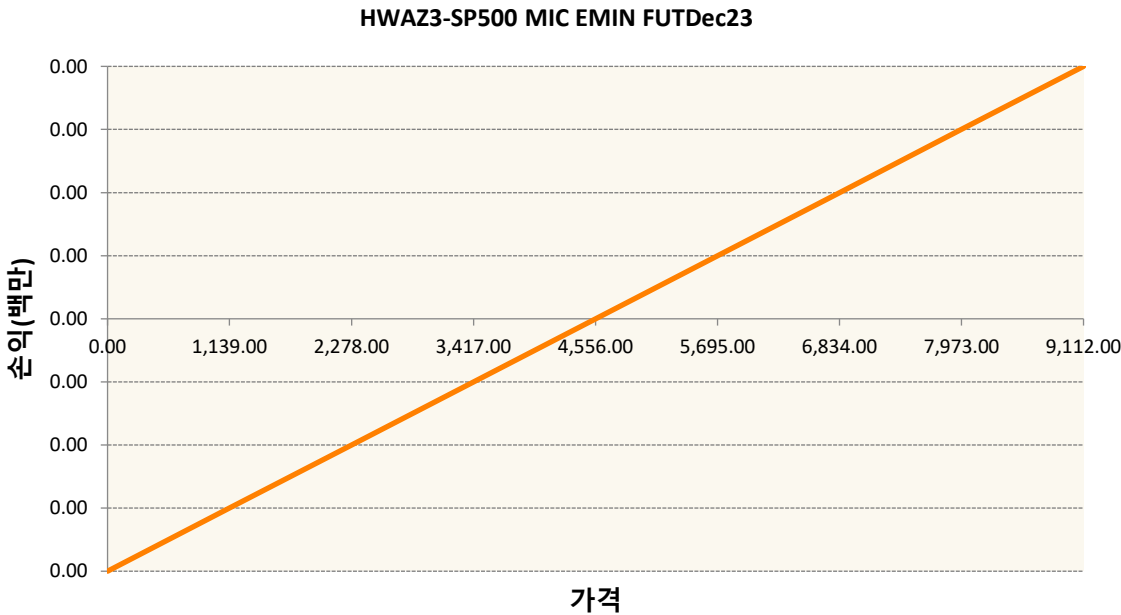
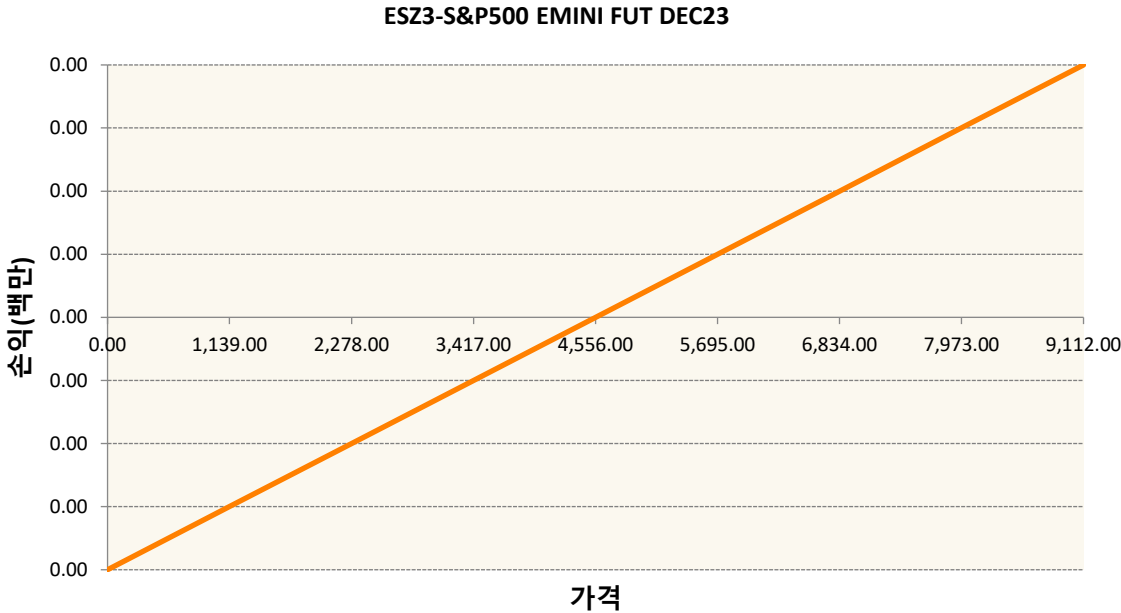
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

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	308	0	308	
누계	유가증권	선물	1,863	0	1,863	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESZ3	S&P500 EMINI FUT DEC23	25
HWAZ3	SP500 MIC EMIN FUTDec23	149

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	148

공시일	2023-12-08
기준일	2023-12-07

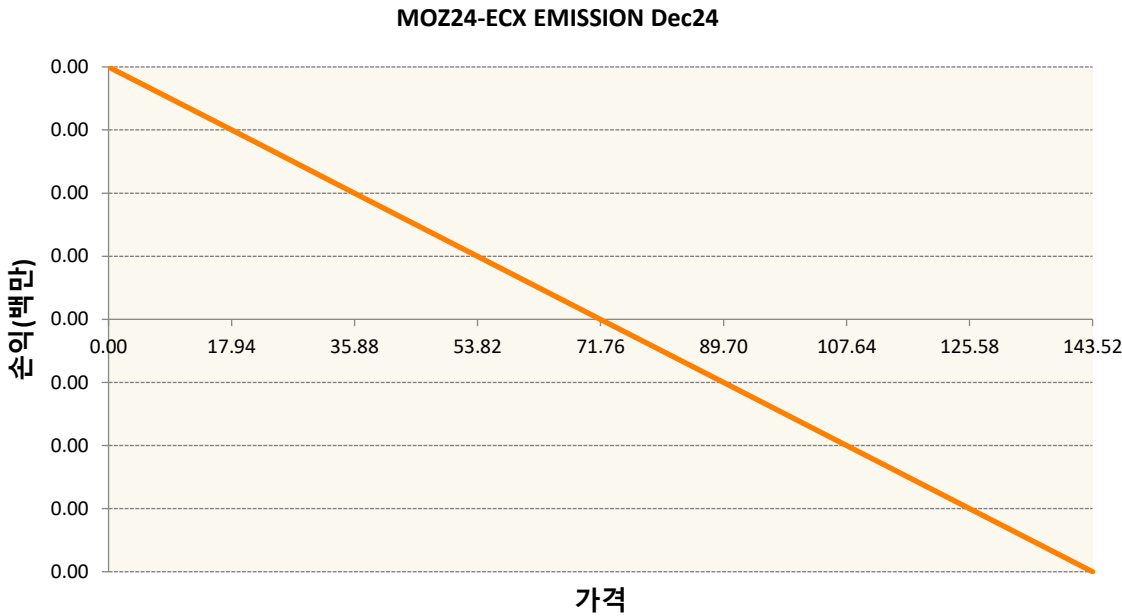
SOL유럽탄소배출권선물인버스ICE특별자산상

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	7,203	-7,203	
누계	지수	스왑	479	0	479	장외
누계	통화	선도	0	1,728	-1,728	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	576
SWICEUACN ICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX	7

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

(단위:백만원)

1,140

공시일	2023-12-08
기준일	2023-12-07

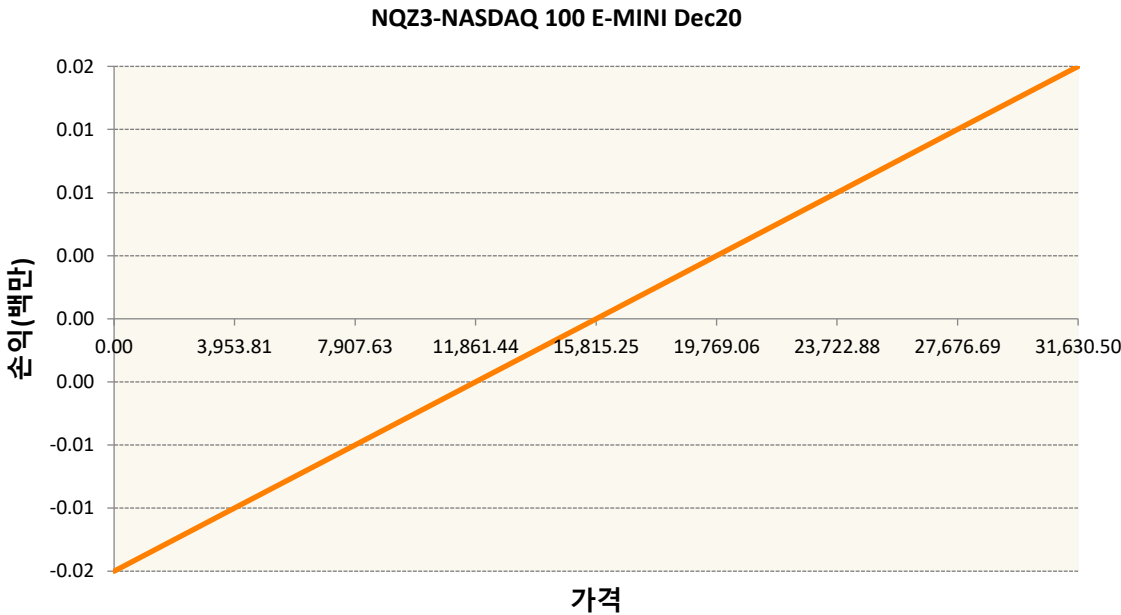
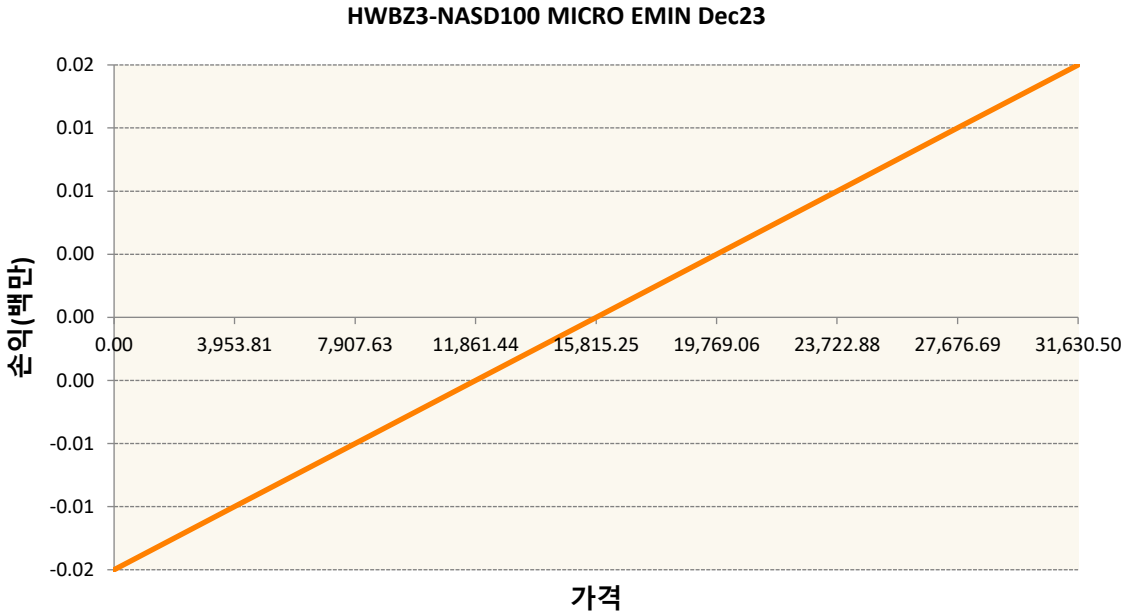
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

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	428	0	428	
누계	유가증권	선물	1,657	0	1,657	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HWBZ3	NASD100 MICRO EMIN Dec23	133
NQZ3	NASDAQ 100 E-MINI Dec20	34

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	151

공시일	2023-12-08
기준일	2023-12-07

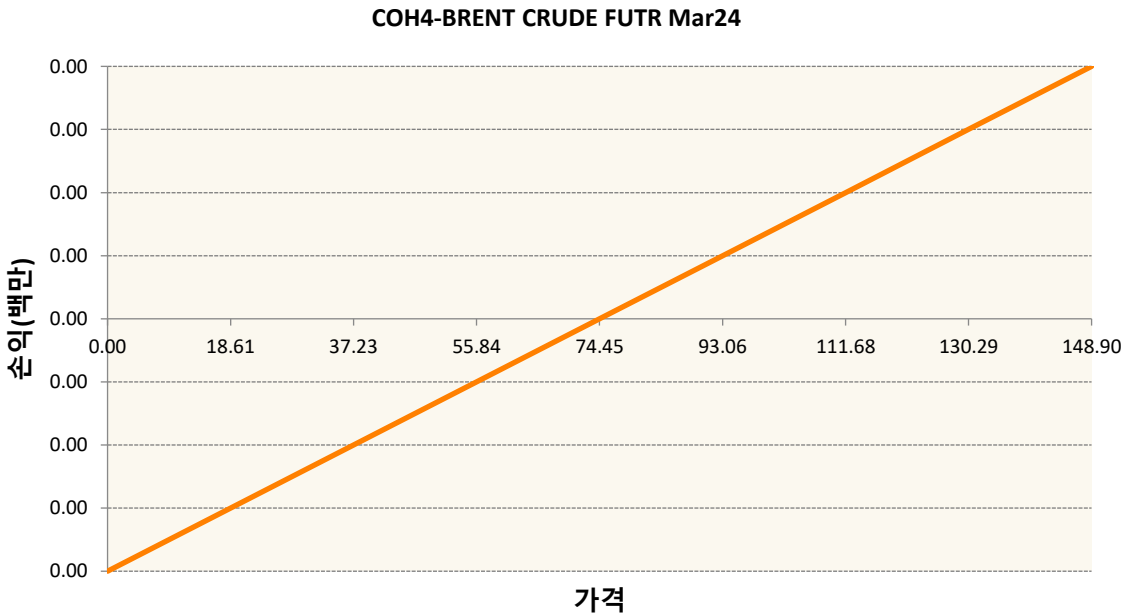
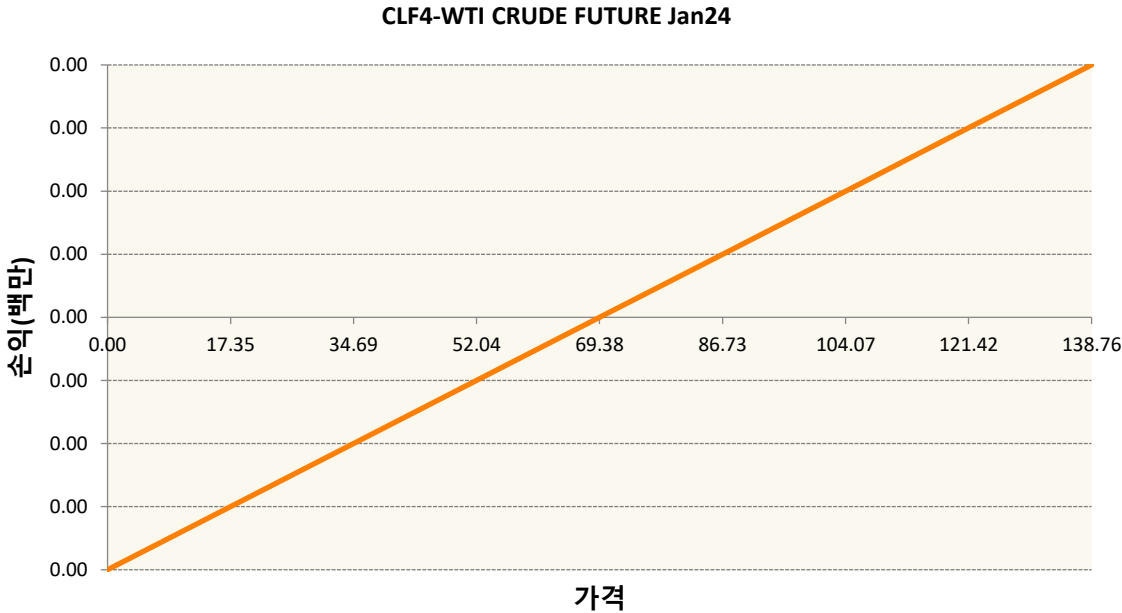
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

1. 계약금액

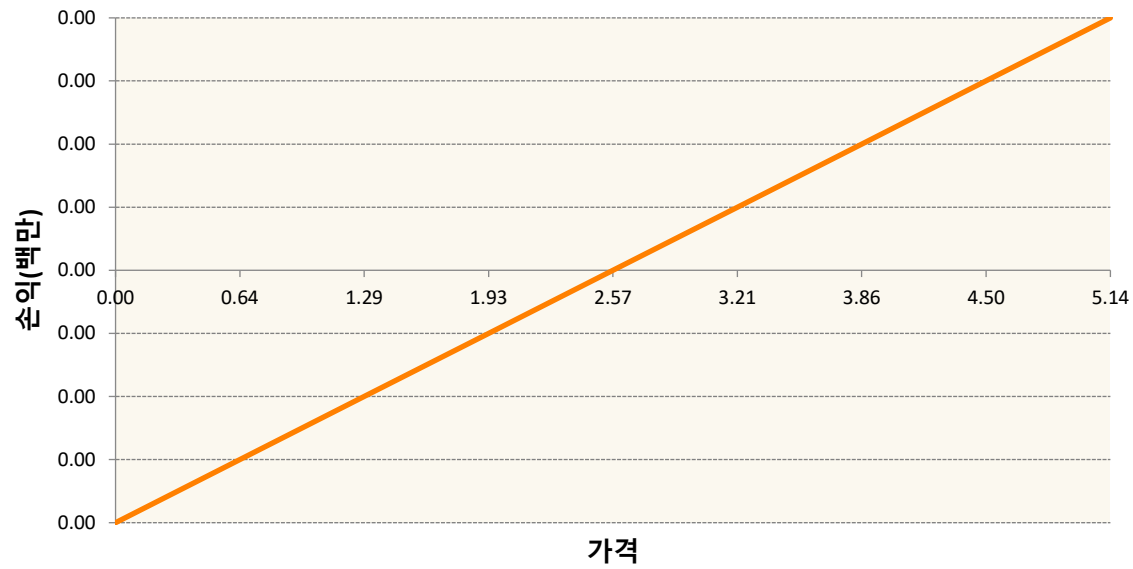
(단위:백만원)

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	1,164	0	1,164	
누계	통화	선물	0	119	-119	장내

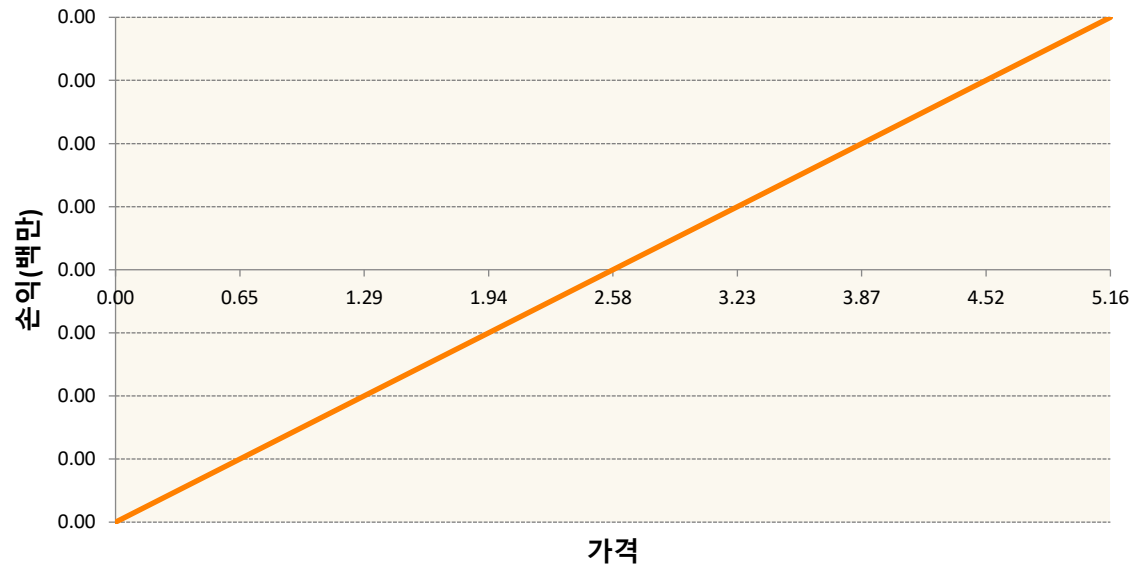
2. 만기시점의 손익구조



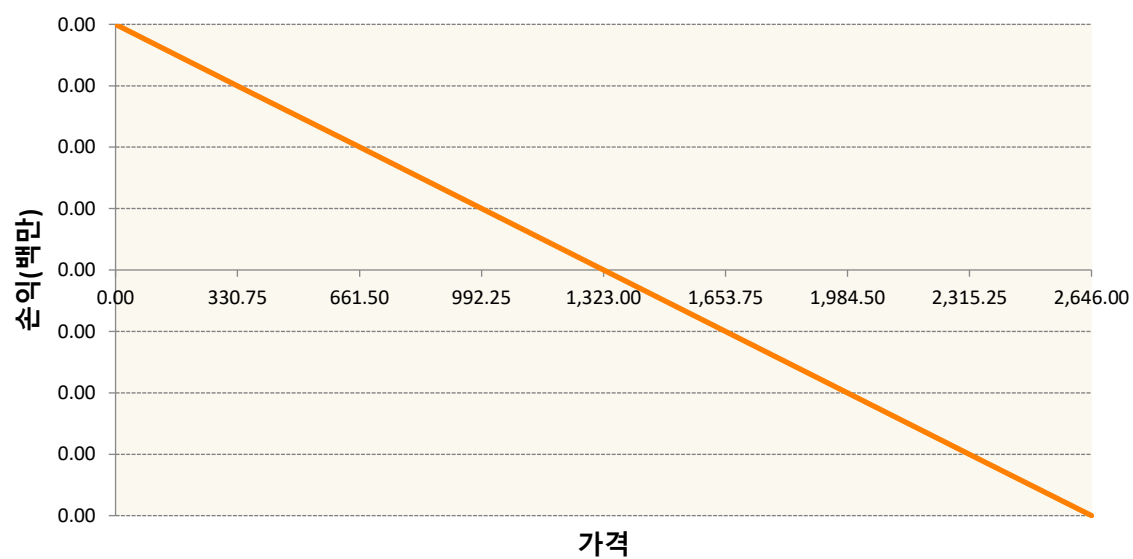
EOF4-E-MINI NATURAL GAS Jan24



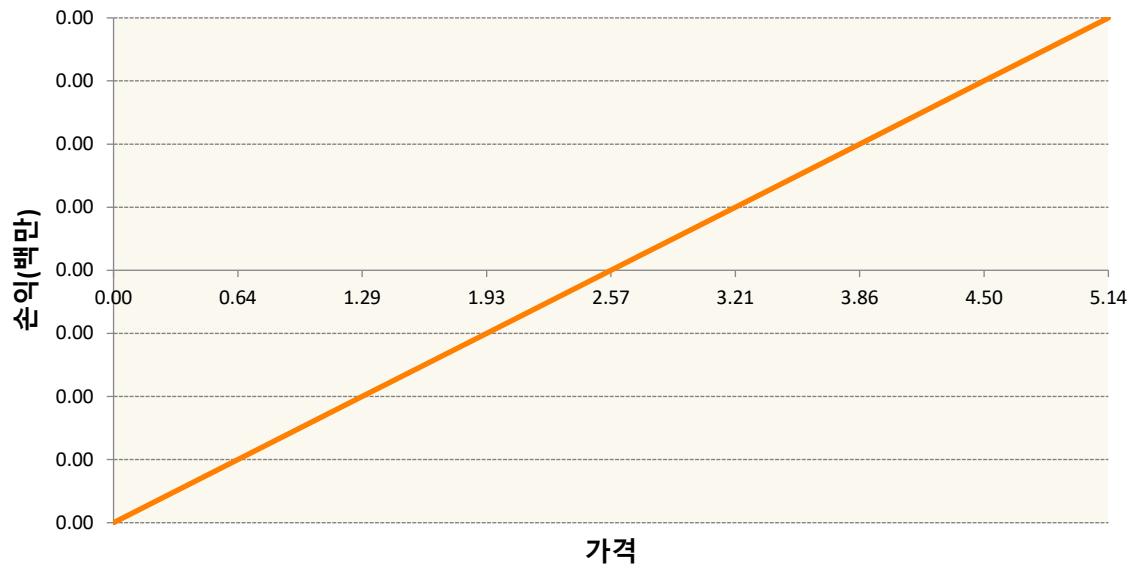
HOF4-NY Harb ULSD Fut Jan24



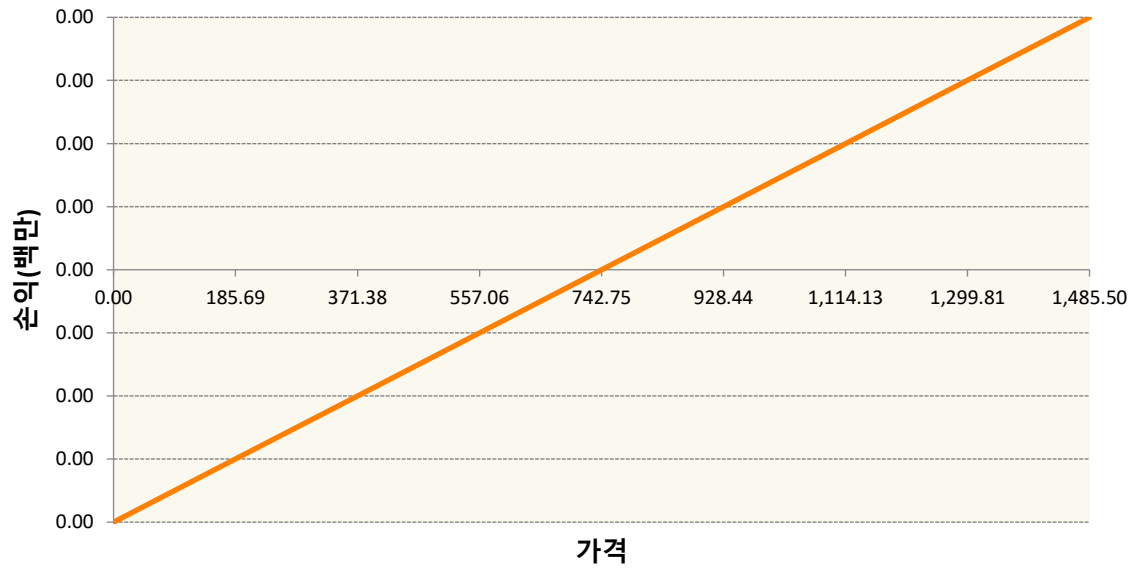
KR4175TC0009-2023-12 달러선물



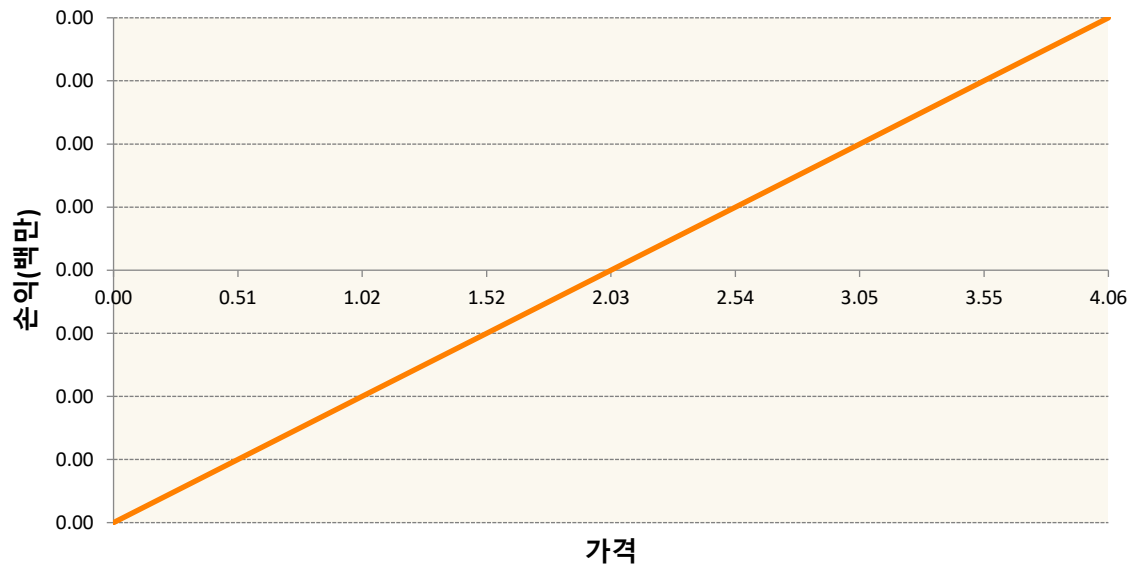
NGF24-NATURAL GAS FUTR Jan24



QSF4-Low Su Gasoil G Jan24



XBF4-GASOLINE RBOB FUT Jan24



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
CLF4	WTI CRUDE FUTURE Jan24		22
COH4	BRENT CRUDE FUTR Mar24		24
EOF4	E-MINI NATURAL GAS Jan24		2
HOF4	NY Harb ULSD Fut Jan24		12
KR4175TC00 2023-12 달러선물			10
NGF24	NATURAL GAS FUTR Jan24		17
QSF4	Low Su Gasoil G Jan24		8
XBF4	GASOLINE RBOB FUT Jan24		9

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	228