

공시일	2024-01-16
기준일	2024-01-15

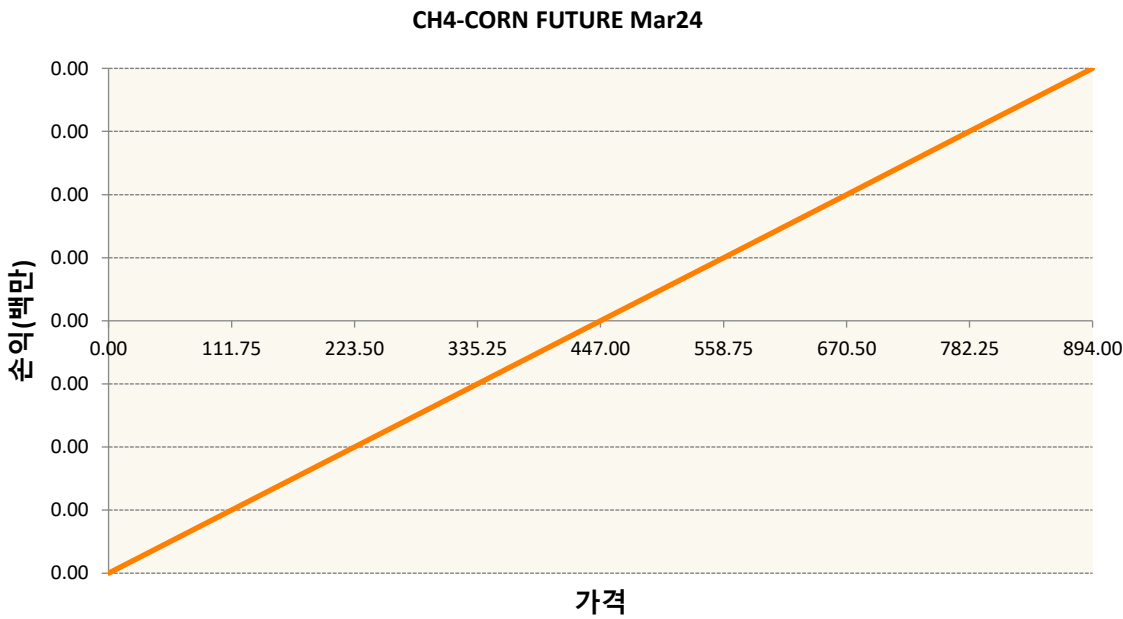
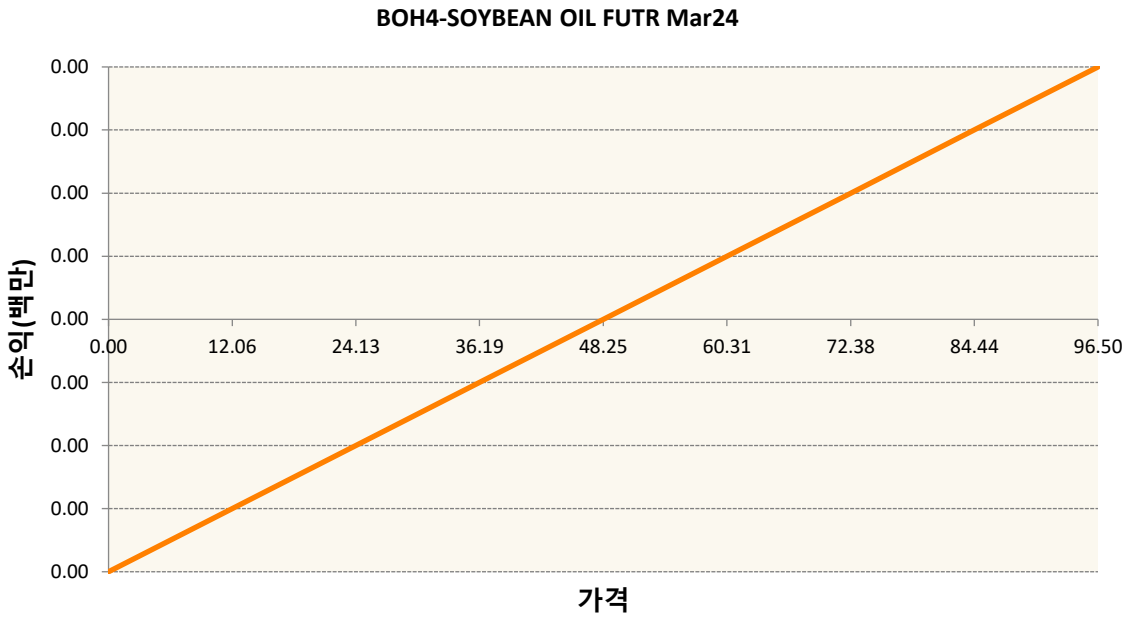
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

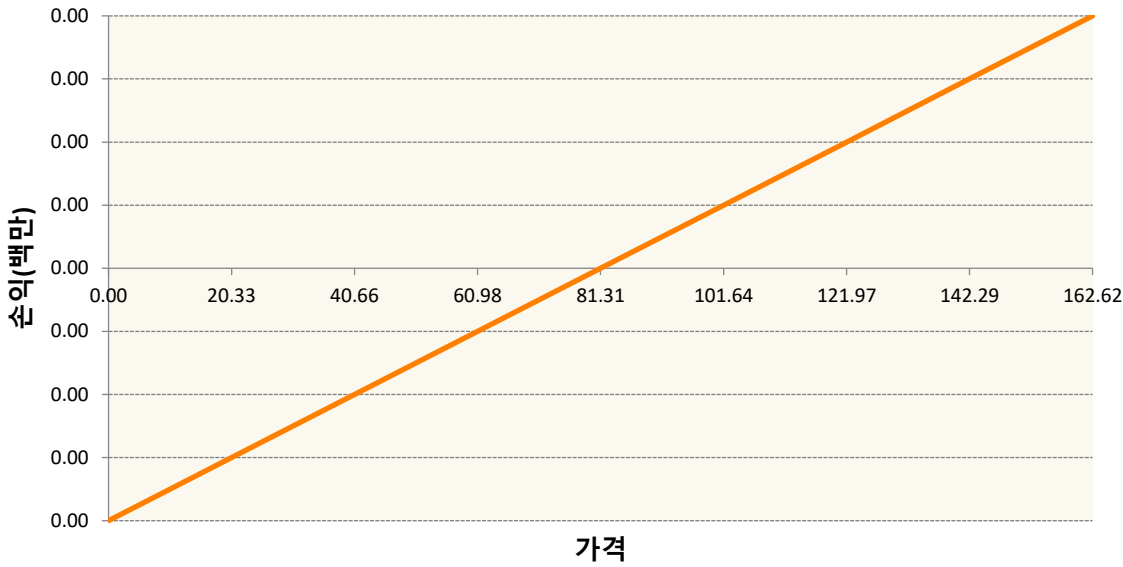
(단위:USD 백만)

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	4,519	0	4,519	
누계	통화	선물	0	448	-448	장내

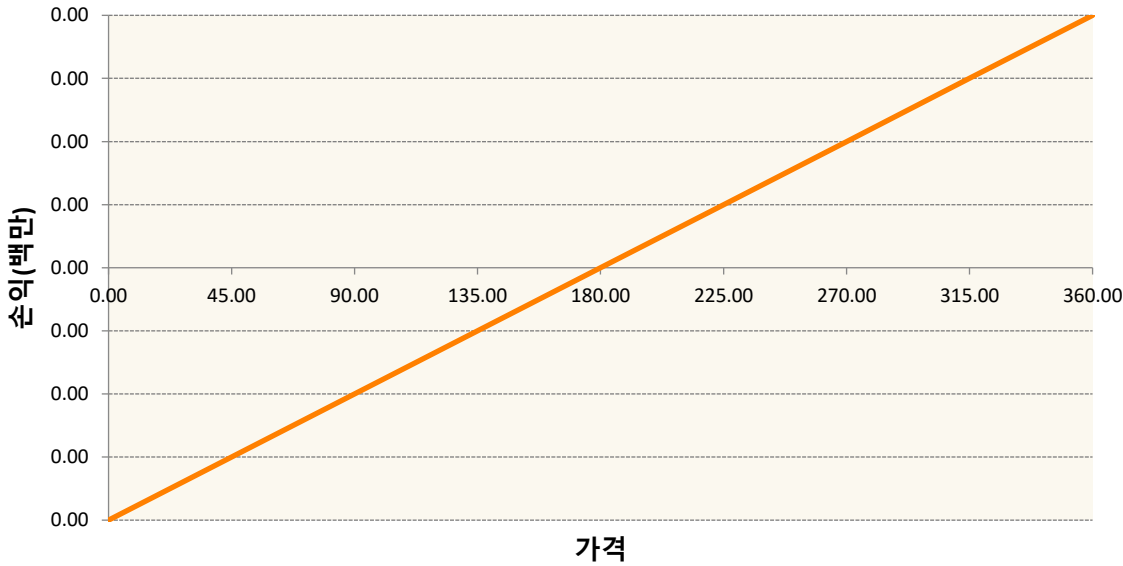
2. 만기시점의 손익구조



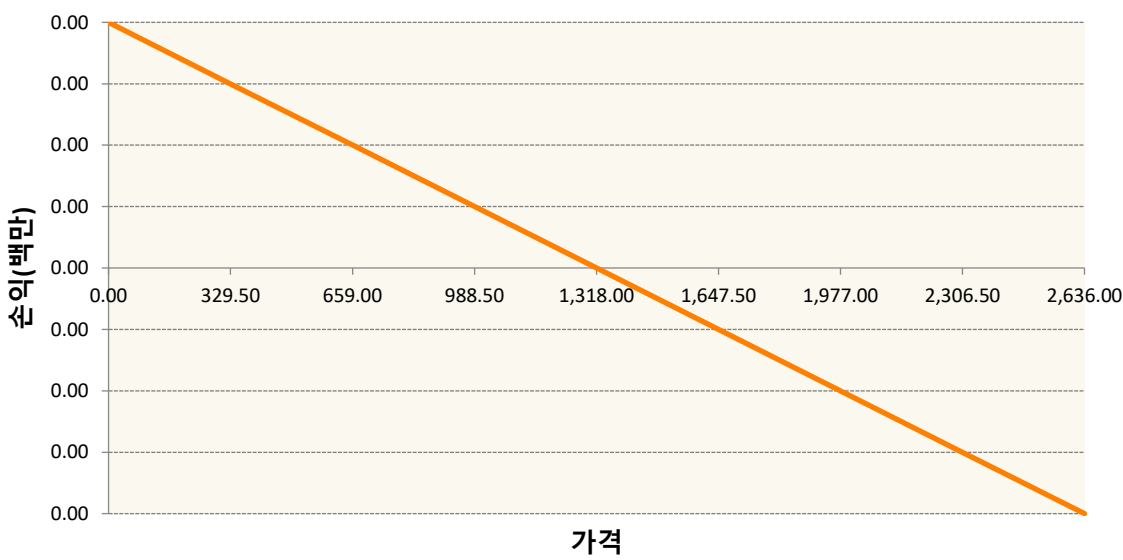
CTH4-COTTON NO.2 FUTR Mar24



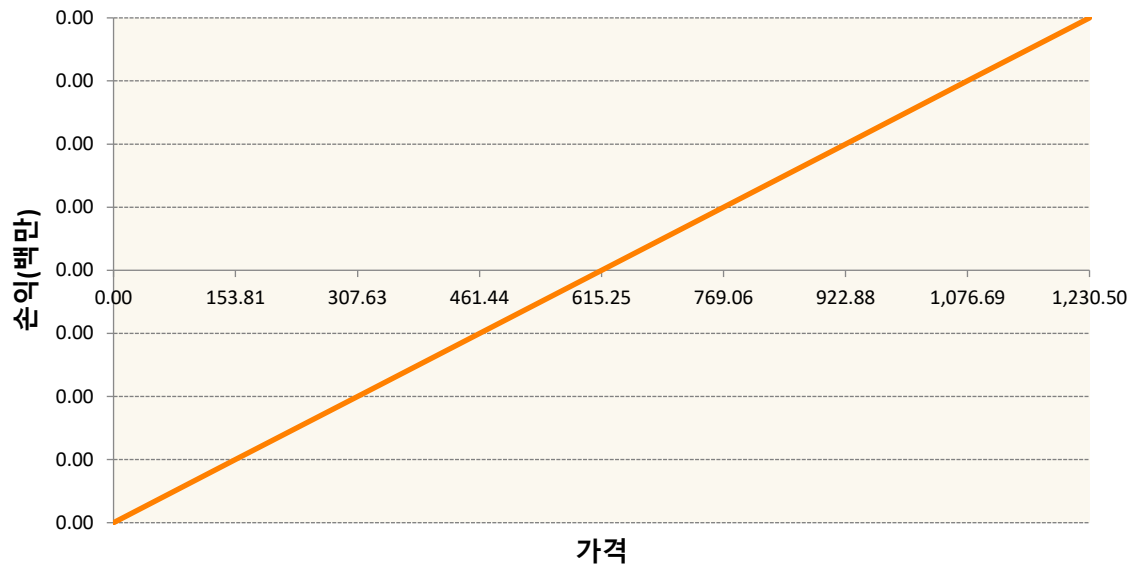
KCH4-COFFEE 'C' FUTURE Mar24



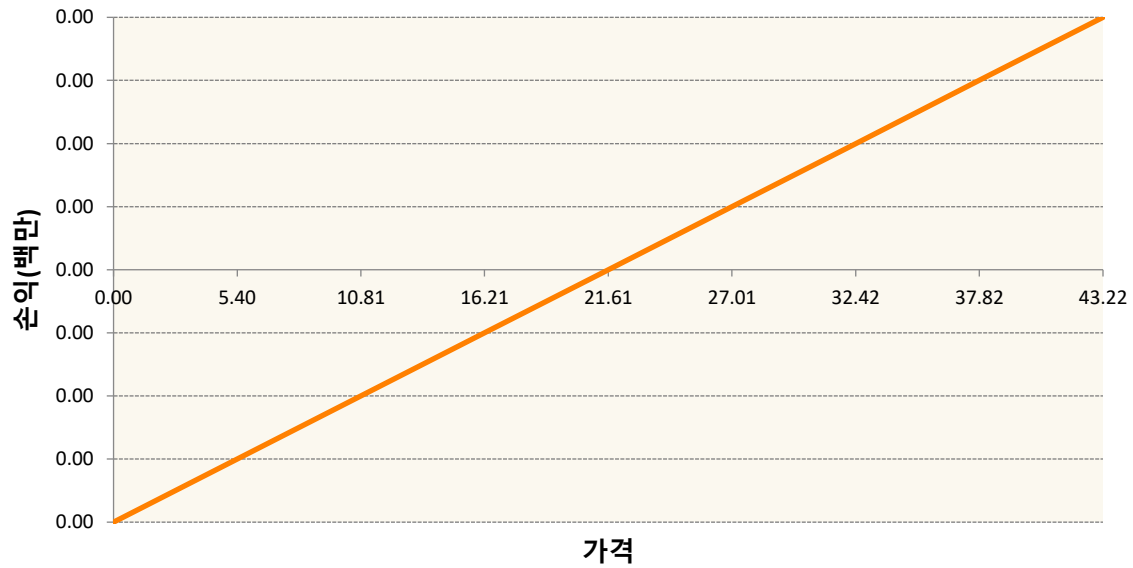
KR4175V20000-2024-02 달러선물



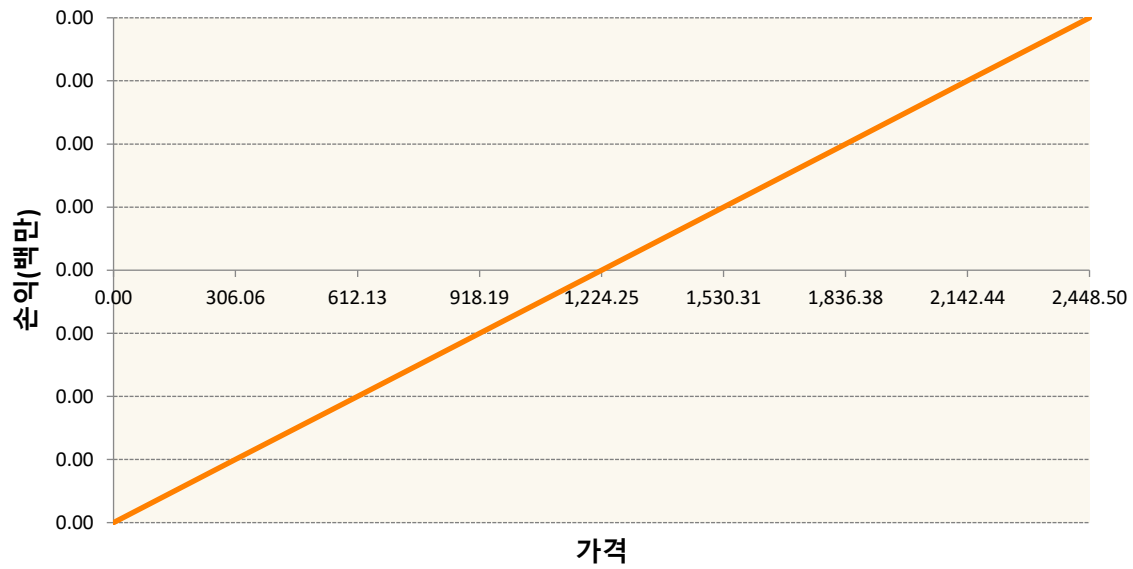
KWH4-KC HRW WHEAT FUT Mar24



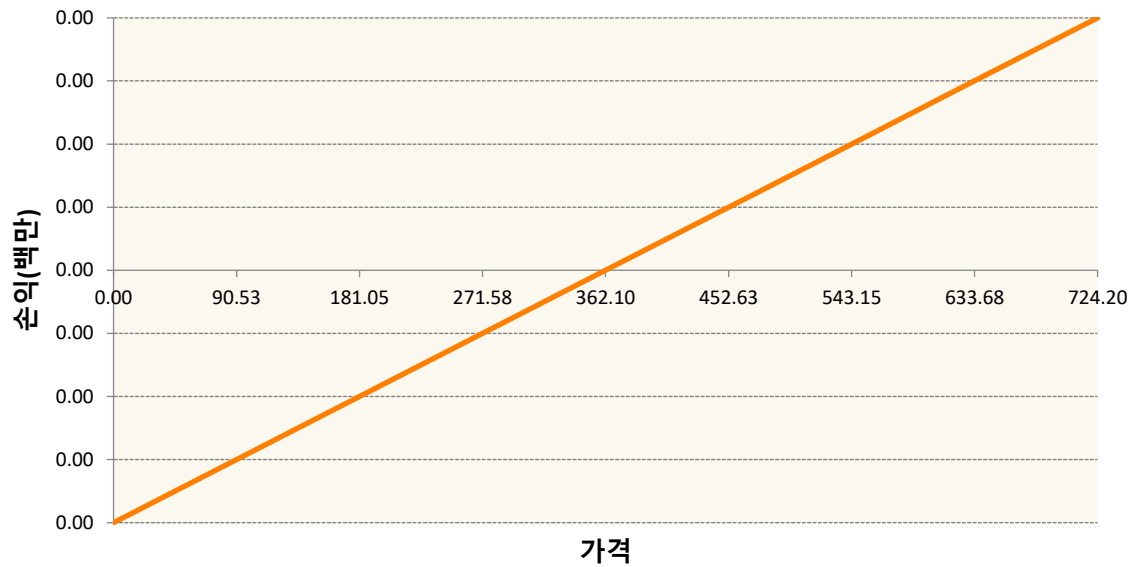
SBH4-Sugar #11 (WORLD) Mar24



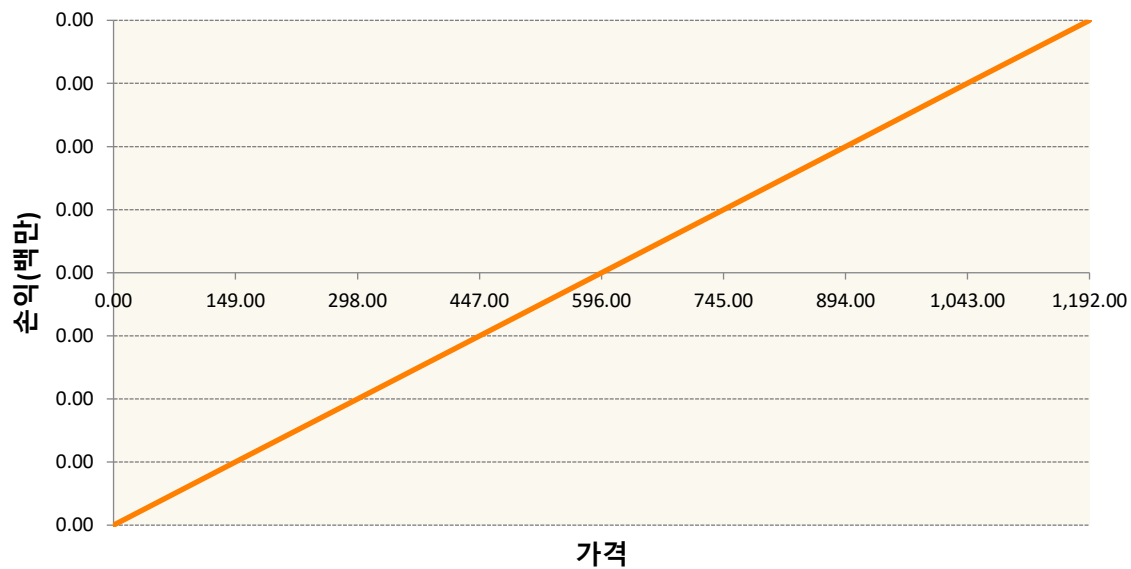
SH4-SOYBEAN FUTURE Mar24



SMH4-SOYBEAN MEAL FUTR Mar24



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	2024-01-16
기준일	2024-01-15

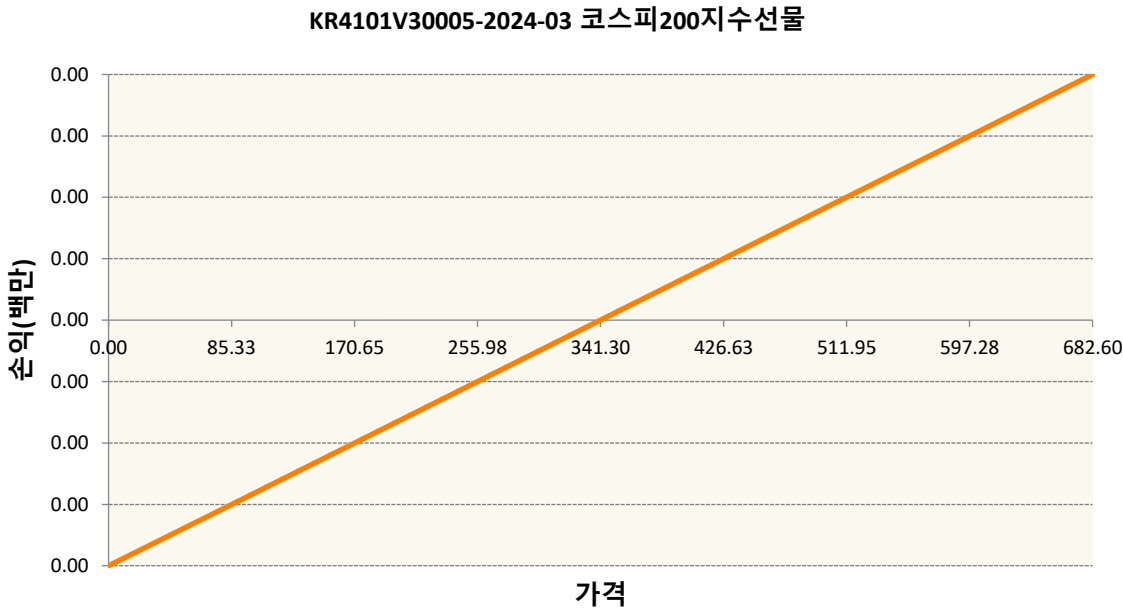
스마트인덱스모

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	85	-85	장내
누계	유가증권	선물	1,280	0	1,280	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101V30005			2024-03 코스피200지수선물				102
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-102	-102	-102	-102	-102	-102	-102
-5.33%	-68	-68	-68	-68	-68	-68	-68
-2.67%	-34	-34	-34	-34	-34	-34	-34
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	34	34	34	34	34	34	34
5.33%	68	68	68	68	68	68	68
8.00%	102	102	102	102	102	102	102

공시일	2024-01-16
기준일	2024-01-15

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	3,779	0	3,779	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 신한CSI500미래231226	294
-----------------------------	-----

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

258

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2024-01-16
기준일	2024-01-15

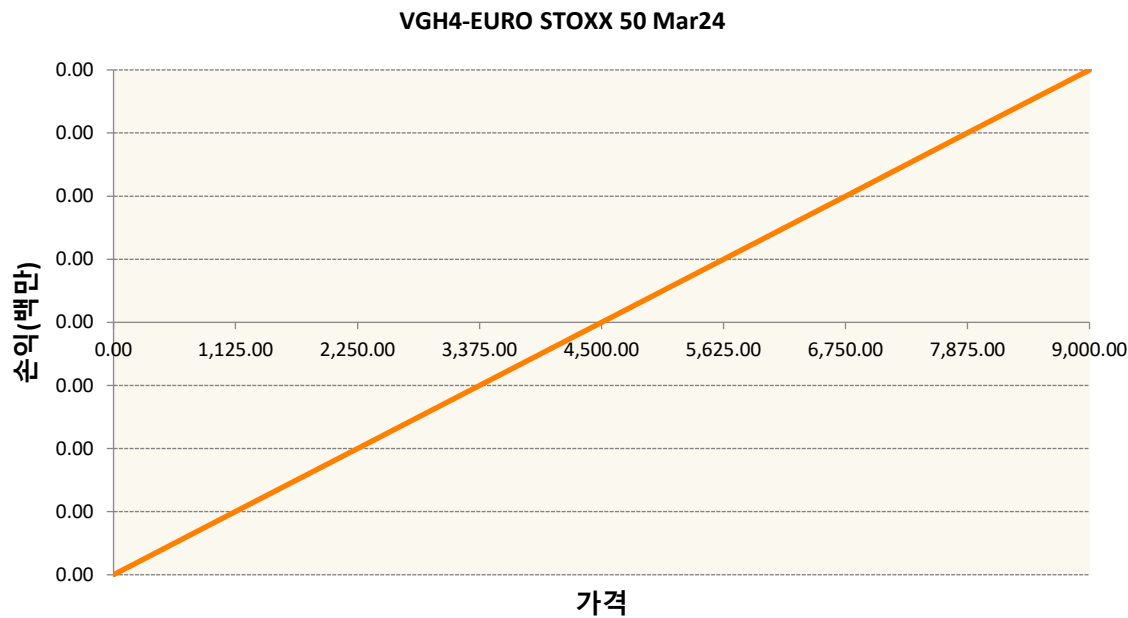
유로인덱스모(주식-파생형)

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	960	0	960	
누계	통화	선도	217	0	217	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213DCL	EUR/KRW 22-03-24E	17
VGH4	EURO STOXX 50 Mar24	77

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

(단위:백만원)

71

공시일	2024-01-16
기준일	2024-01-15

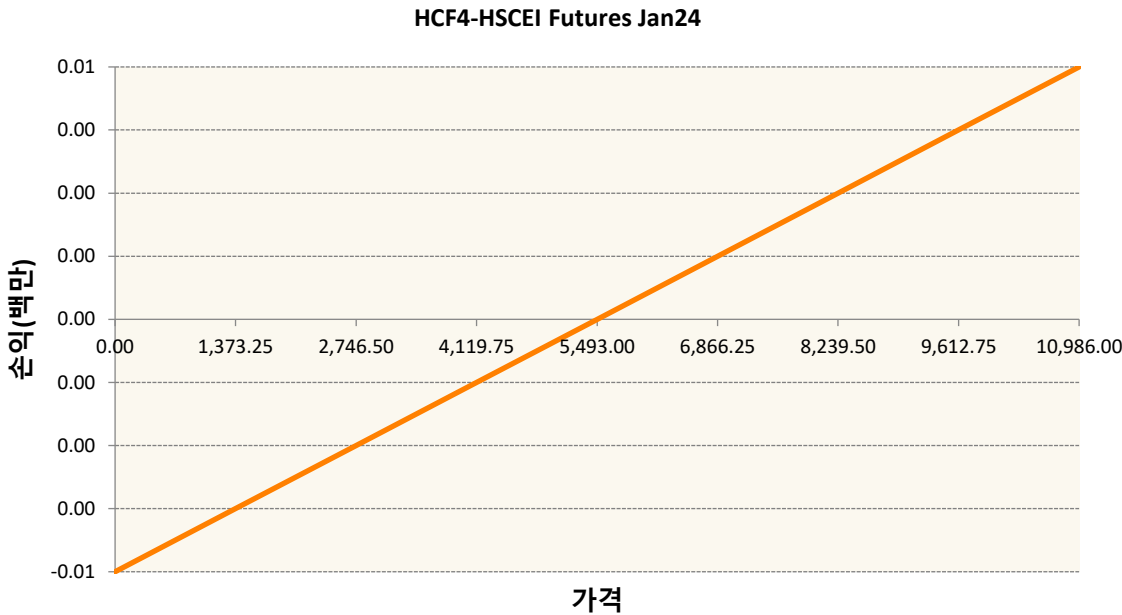
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,001	0	1,001	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCF4	HSCEI Futures Jan24	80
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

116

공시일	2024-01-16
기준일	2024-01-15

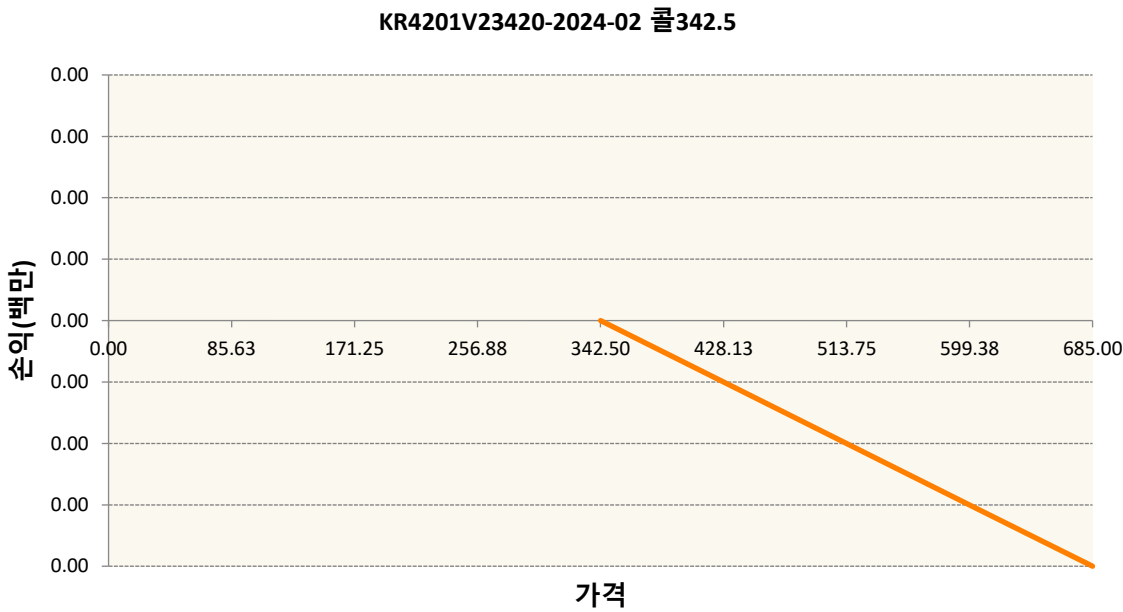
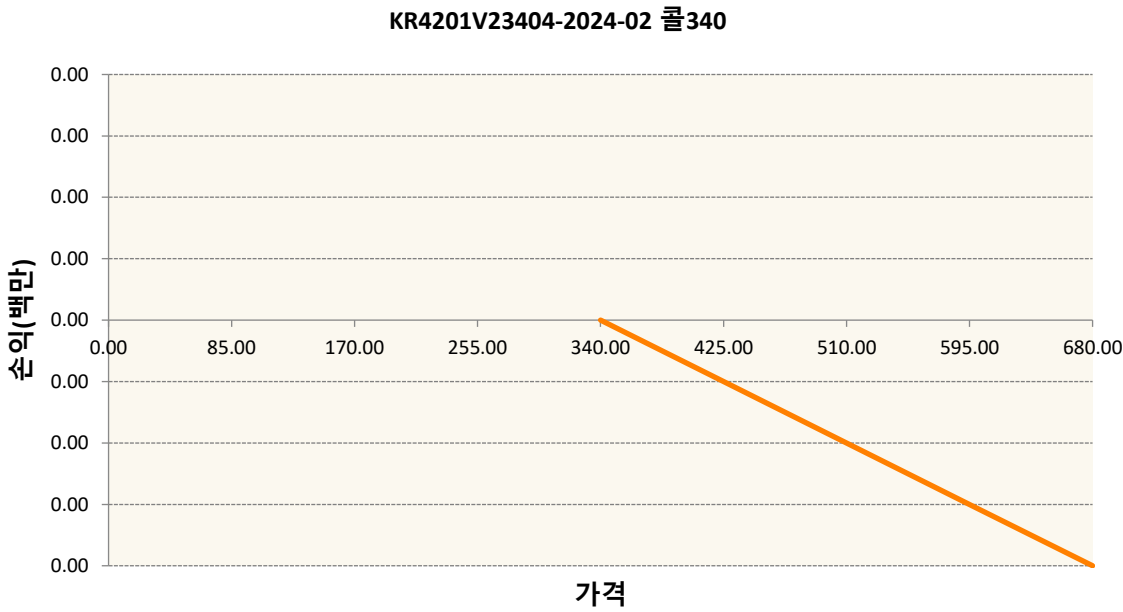
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

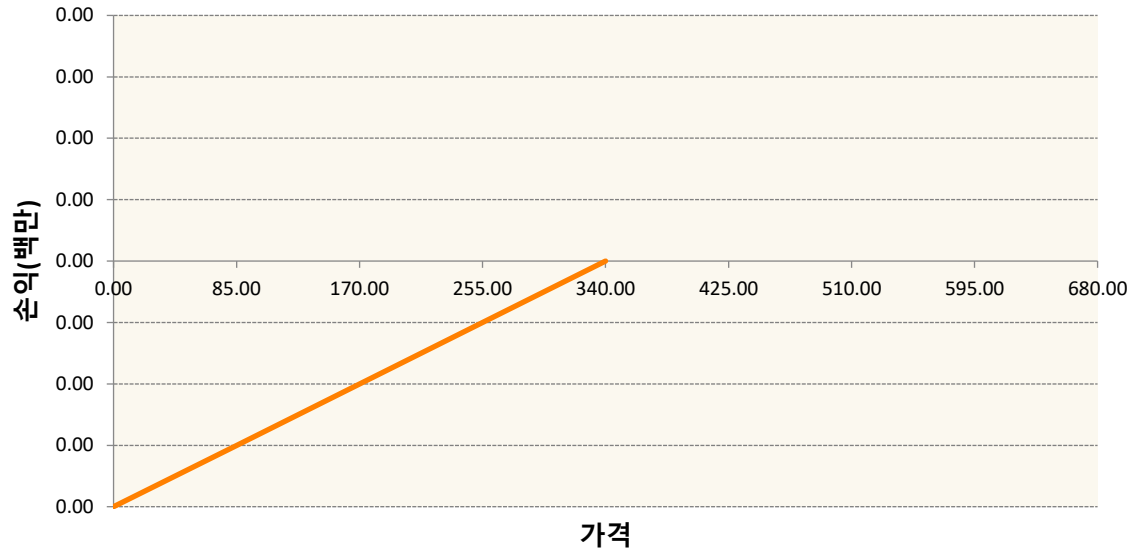
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	51,213	-51,213	장내

2. 만기시점의 손익구조



KR4301V23402-2024-02 풋340



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201V23404		2024-02 콜340						2,125
		기초자산의 변동성						
가격		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	886	864	837	804	767	727	682	
-5.33%	802	758	709	656	600	541	481	
-2.67%	604	536	467	396	324	252	179	
0%	236	157	79	0	-79	-157	-236	
2.67%	-320	-392	-465	-539	-614	-689	-765	
5.33%	-1,038	-1,090	-1,146	-1,206	-1,269	-1,334	-1,401	
8.00%	-1,866	-1,897	-1,933	-1,975	-2,021	-2,072	-2,125	
KR4201V23420		2024-02 콜342.5						338
		기초자산의 변동성						
가격		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	129	126	123	118	113	106	100	
-5.33%	119	112	105	97	89	79	70	
-2.67%	92	81	70	59	48	36	25	
0%	39	26	13	0	-13	-26	-39	
2.67%	-45	-57	-70	-83	-96	-109	-122	
5.33%	-157	-167	-177	-188	-199	-211	-222	
8.00%	-290	-296	-303	-311	-320	-329	-338	
KR4301V23402		2024-02 풋340						681
		기초자산의 변동성						
가격		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-668	-668	-670	-671	-674	-677	-681	
-5.33%	-393	-396	-401	-407	-414	-421	-429	
-2.67%	-142	-152	-163	-175	-187	-200	-212	
0%	45	30	15	0	-15	-30	-45	

2.67%	144	133	120	108	95	82	68
5.33%	179	174	167	160	152	143	134
8.00%	186	185	183	180	176	172	166

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

(단위:백만원)

3,089

공시일	2024-01-16
기준일	2024-01-15

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	1,971	0	1,971	

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	2024-01-16
기준일	2024-01-15

H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	53	-53	
누계	유가증권	수익증권	4,518	0	4,518	

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	2024-01-16
기준일	2024-01-15

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	17,836	0	17,836	
누계	통화	선도	0	17,592	-17,592	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213DAT KRW/USD 31-01-24E	189
FXW213DBV KRW/USD 29-02-24E	648
FXW213DCB KRW/USD 31-01-24E	26
FXW213DCS KRW/USD 31-01-24E	32
FXW213DCT KRW/USD 29-03-24E	512
IE00BD8RGM75	

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

720

공시일	2024-01-16
기준일	2024-01-15

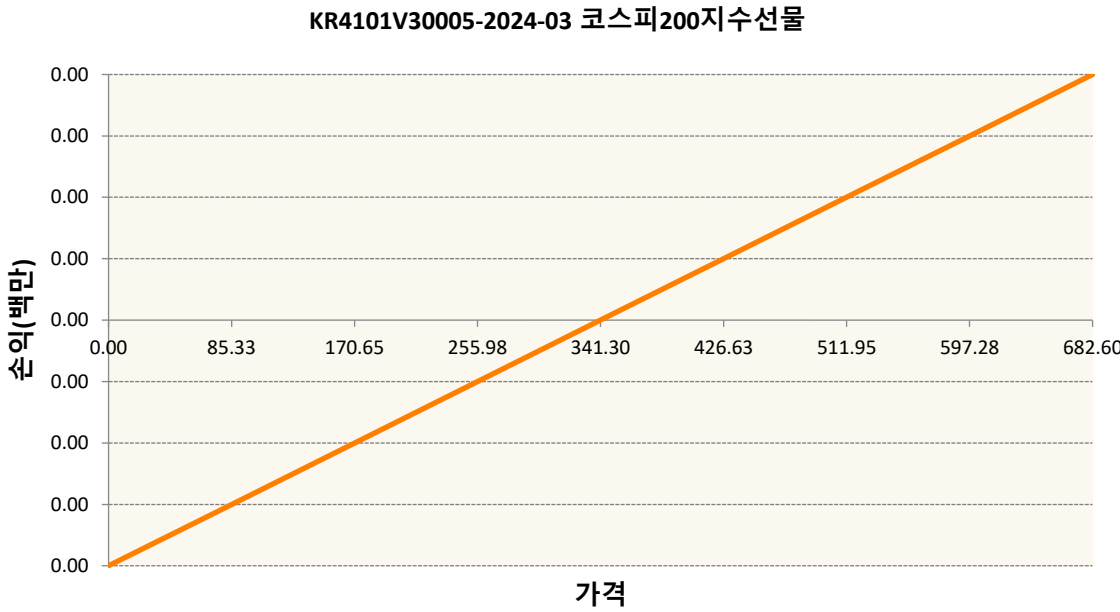
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

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	427	0	427	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101V30005		2024-03 코스피200지수선물					34
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-34	-34	-34	-34	-34	-34	-34
-5.33%	-23	-23	-23	-23	-23	-23	-23
-2.67%	-11	-11	-11	-11	-11	-11	-11
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	11	11	11	11	11	11	11
5.33%	23	23	23	23	23	23	23
8.00%	34	34	34	34	34	34	34

공시일	2024-01-16
기준일	2024-01-15

SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

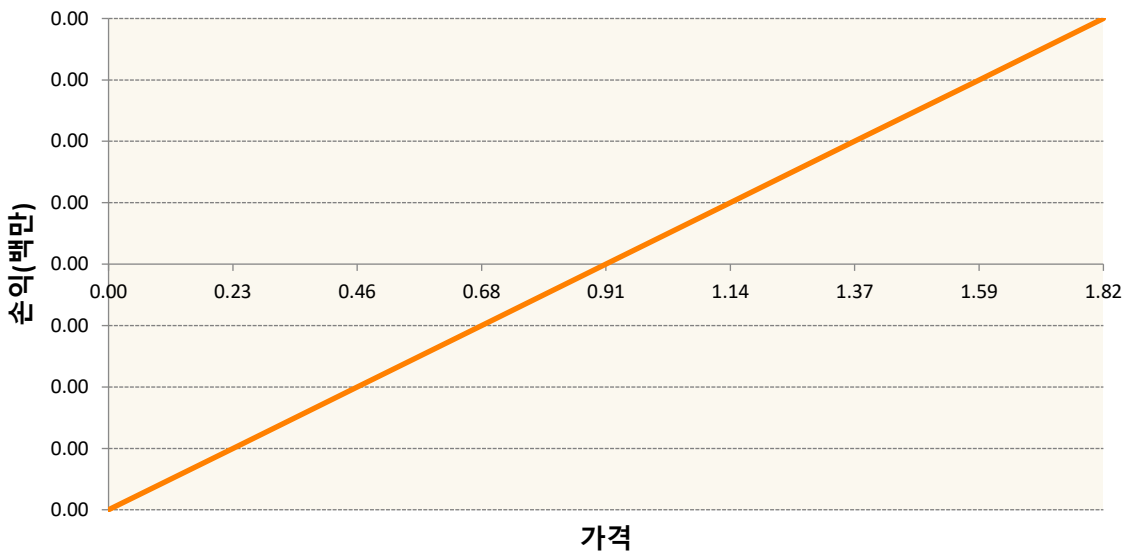
1. 계약금액

(단위:백만원)

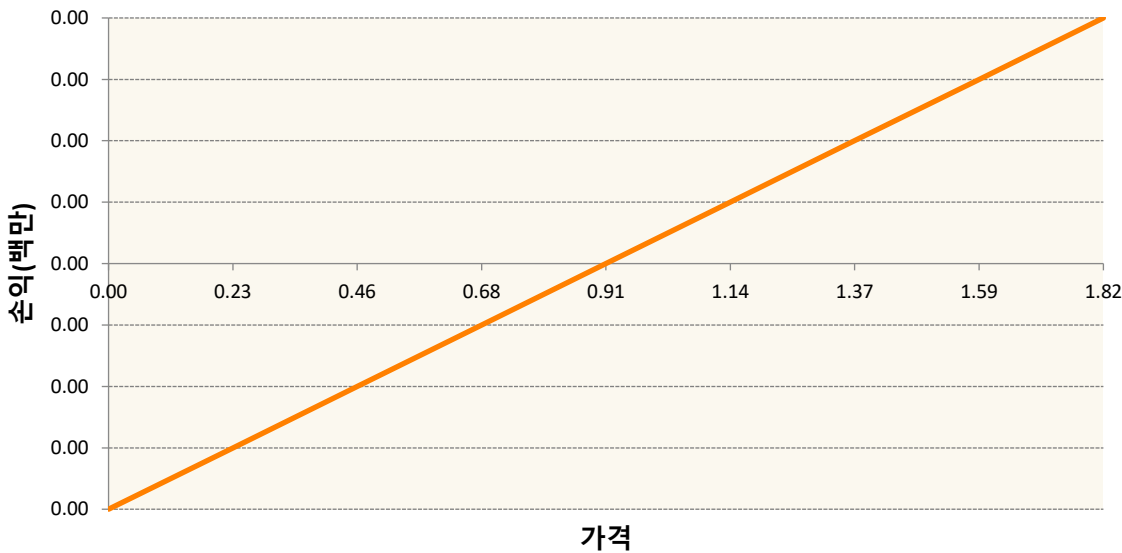
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	18,082	0	18,082	

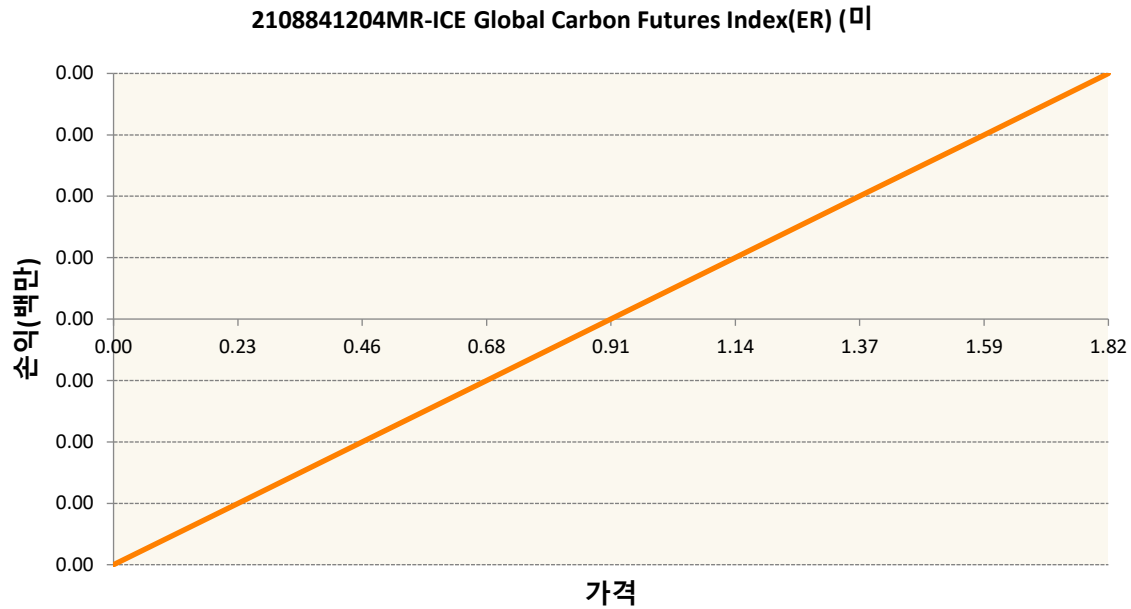
2. 만기시점의 손익구조

2108840920KM-ICE Global Carbon Futures Index(ER) (키



2108840920MZ-ICE Global Carbon Futures Index(ER) (메





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108840920ICE Global Carbon Futures Index(ER) (키		900
2108840920ICE Global Carbon Futures Index(ER) (메		180
2108841204ICE Global Carbon Futures Index(ER) (미		360

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,842

공시일	2024-01-16
기준일	2024-01-15

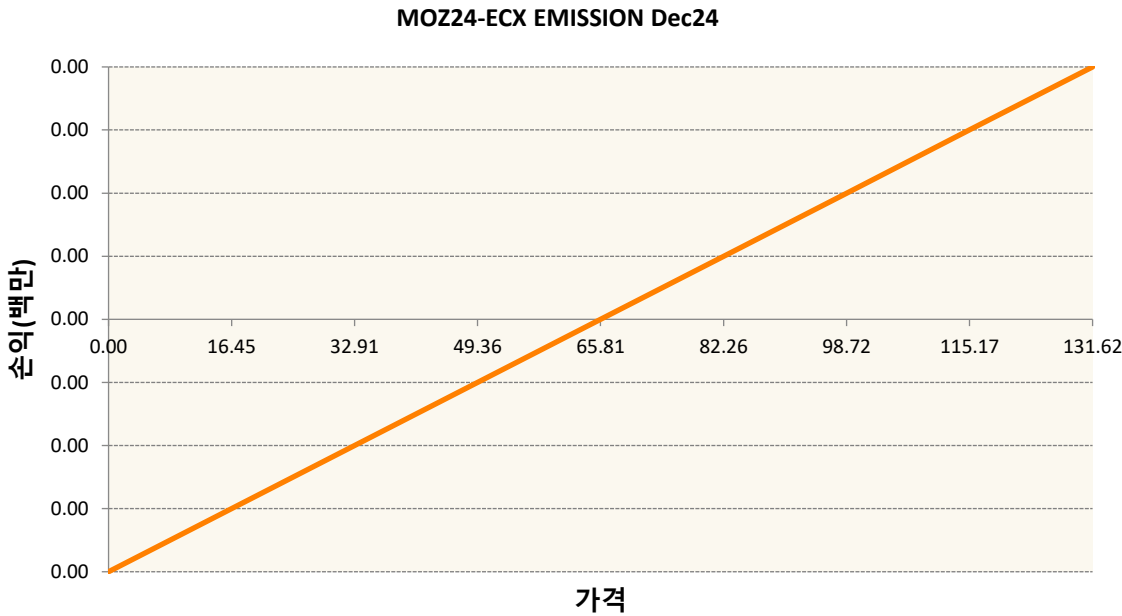
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	8,032	0	8,032	
누계	지수	스왑	424	0	424	장외
누계	통화	선도	869	2,434	-1,566	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213DCS KRW/EUR 31-01-24E	15
FXW213DCS KRW/EUR 31-01-24E	63
FXW213DCS KRW/EUR 31-01-24E	117
FXW213E1FC EUR/KRW 31-01-24E	69
MOZ24 ECX EMISSION Dec24	643
SWICEUACN ICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX	5

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

(단위:백만원)

공시일	2024-01-16
기준일	2024-01-15

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	4,370	0	4,370	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI00000 신한CSI Index 230622 (미래)	12
SWCSI00000 신한CSI Index 230622 (메리츠)	12
SWCSI00000 신한CSI Index 230922 (키움)	8
SWCSI00000 신한CSI Index 231013 (NH)	8

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

(단위:백만원)

55

공시일	2024-01-16
기준일	2024-01-15

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	6,244	0	6,244	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(미래)	11
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(NH)	10
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(메리츠)	14
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(키움)	3

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

(단위:백만원)

40

공시일	2024-01-16
기준일	2024-01-15

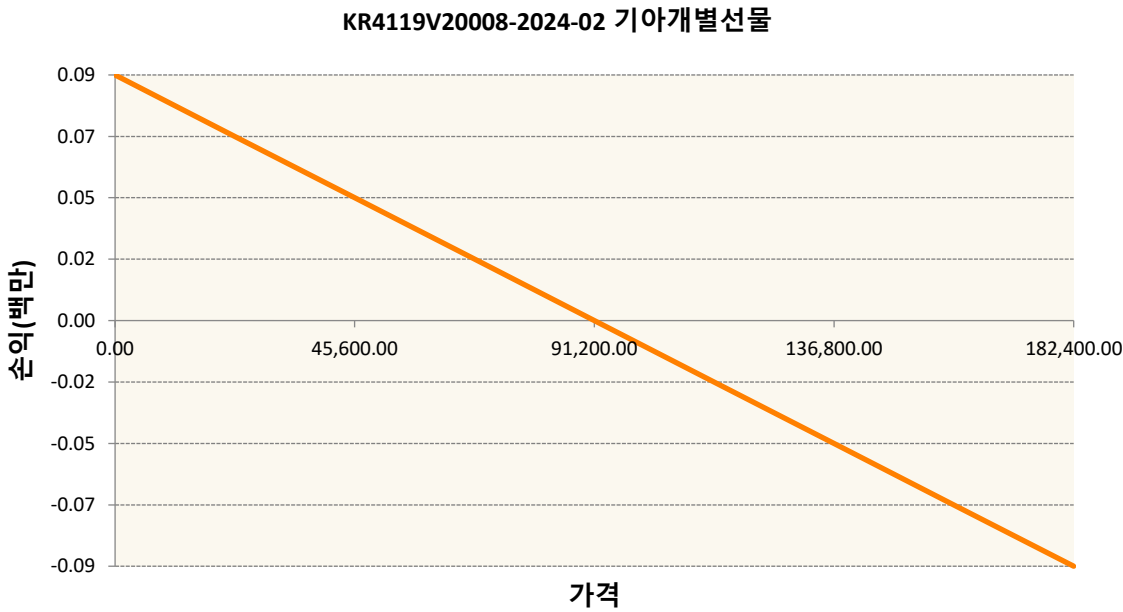
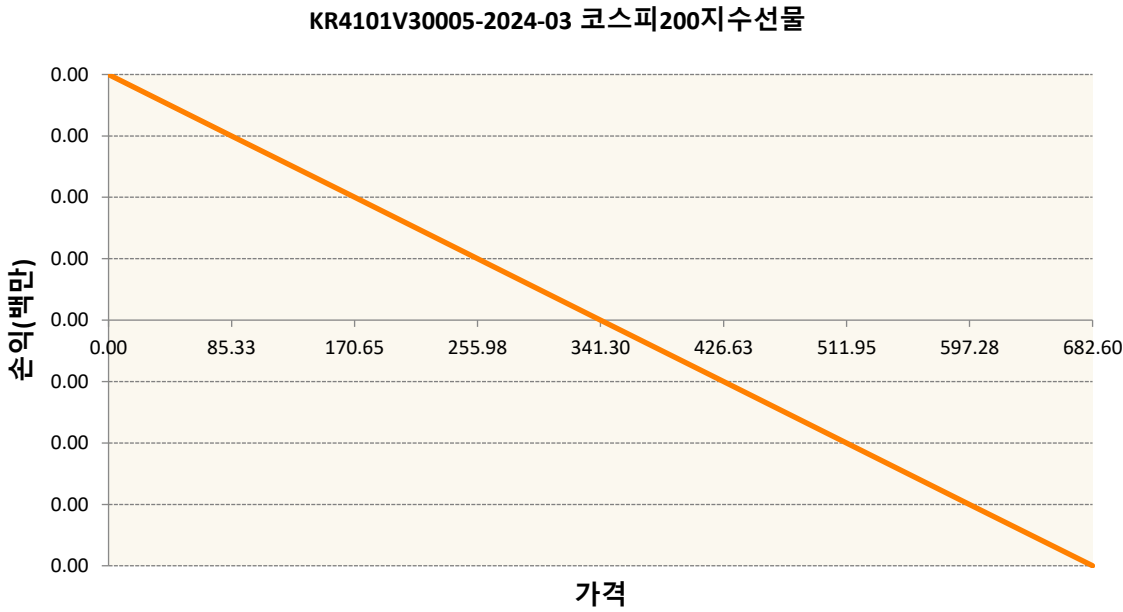
에쿼티알파일반사모혼합자산

1. 계약금액

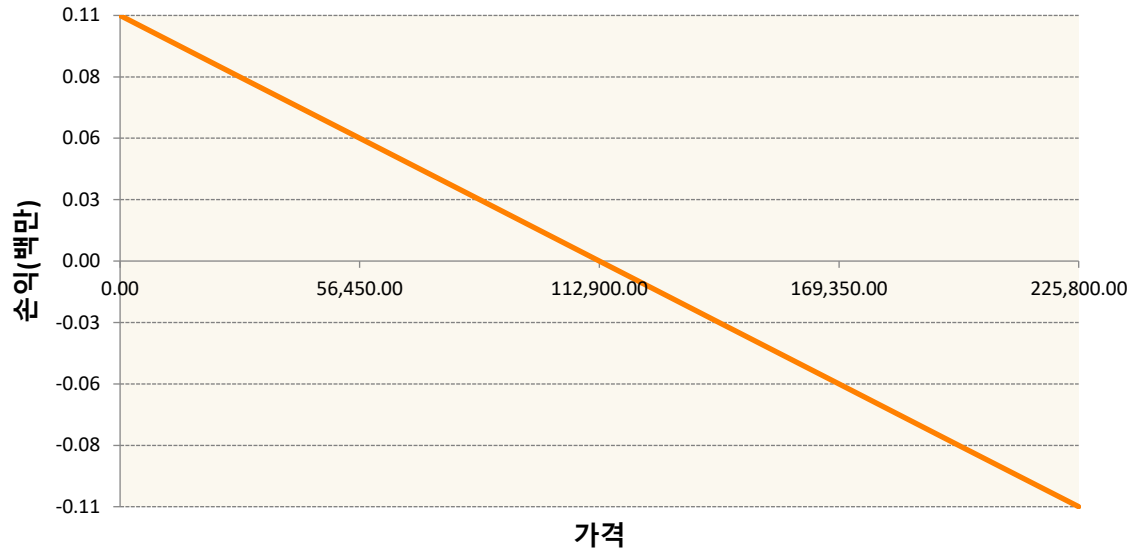
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	7	76	-69	장내
누계	유가증권	선물	0	1,169	-1,169	장내

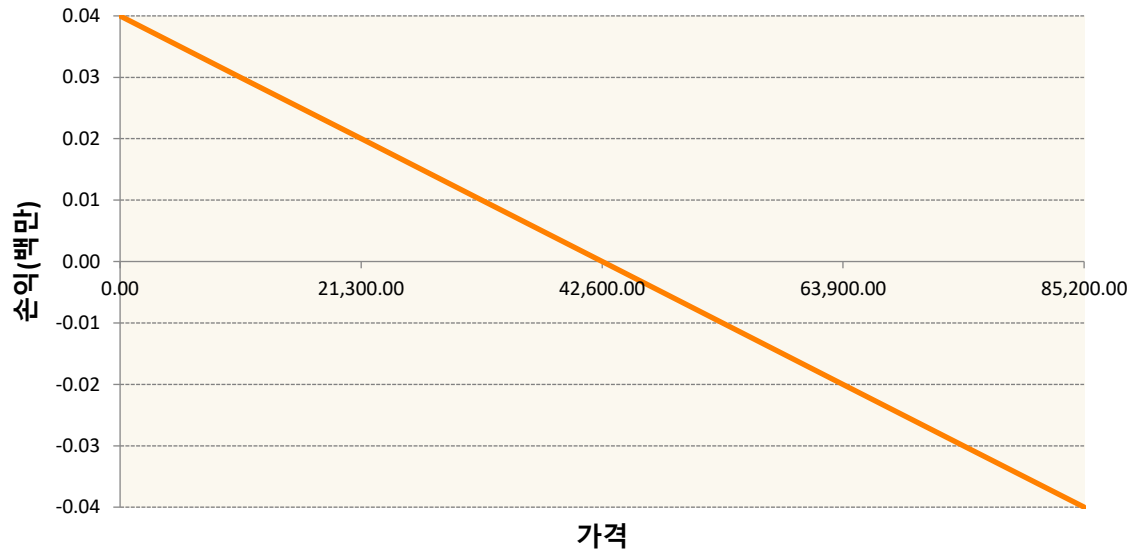
2. 만기시점의 손익구조



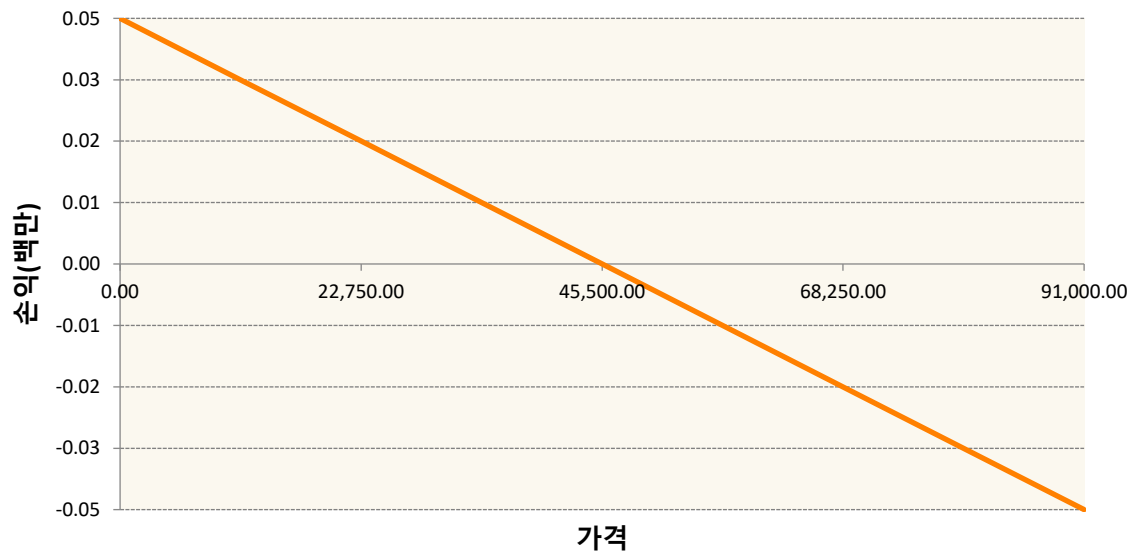
KR4139V20006-2024-02 HD한국조선해양개별선물



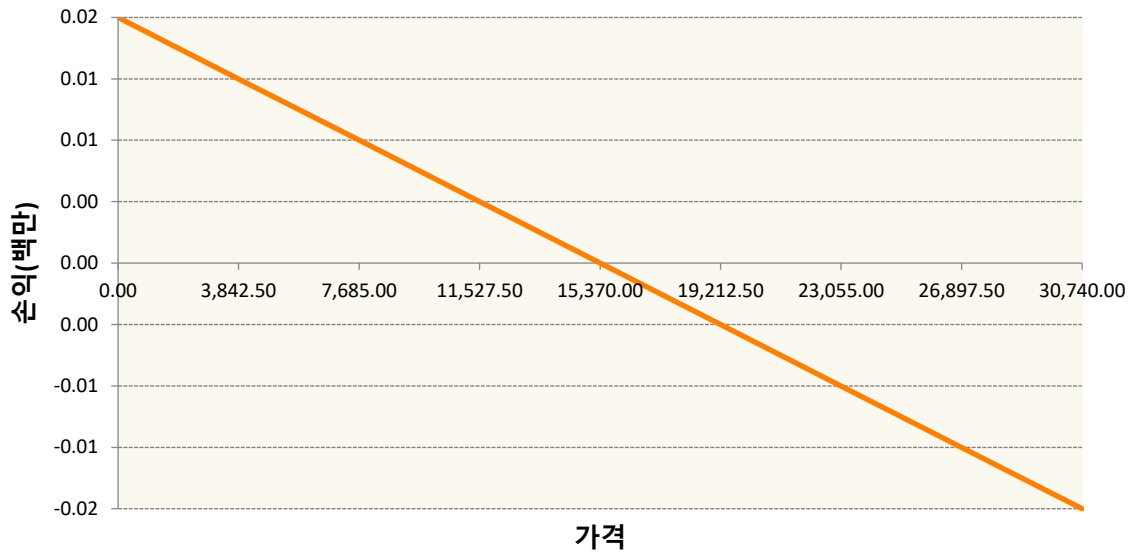
KR4140V20004-2024-02 하나금융지주개별선물



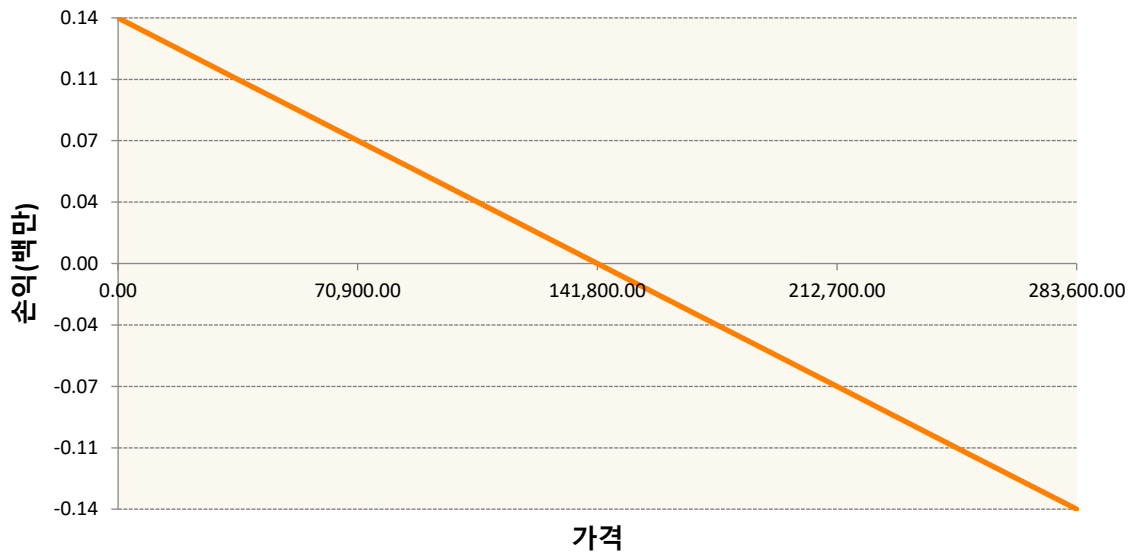
KR4155V20002-2024-02 한국타이어앤테크놀로지개별선물



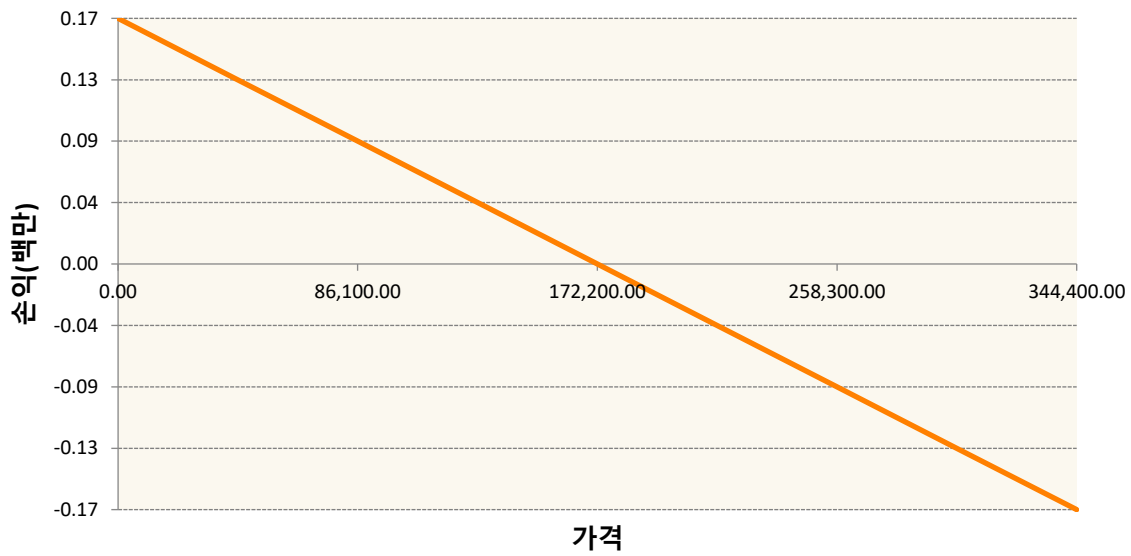
KR41B9V20007-2024-02 두산에너지빌리티개별선물



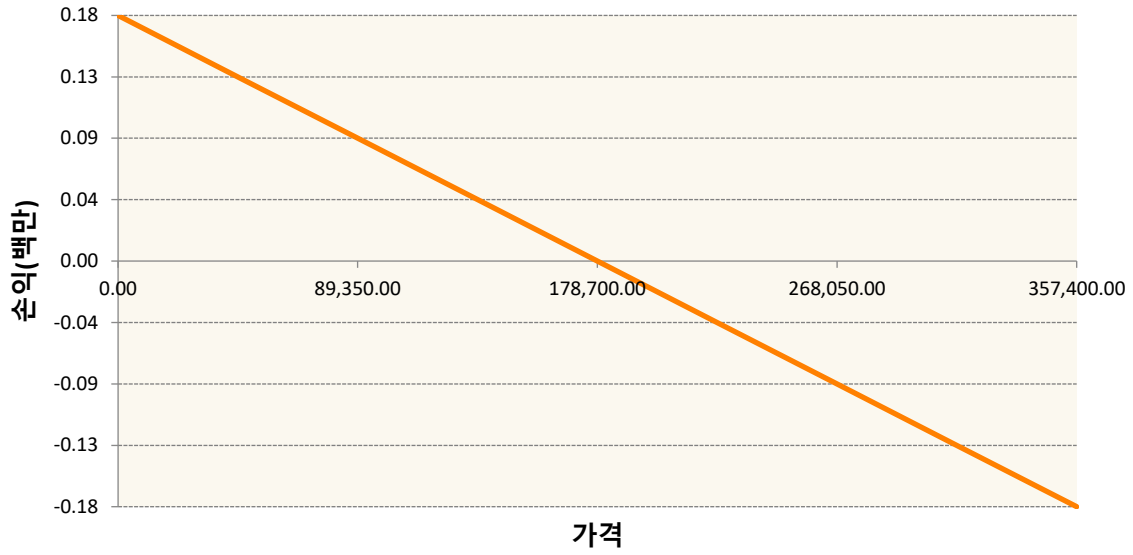
KR41BHV20009-2024-02 한화에어로스페이스개별선물



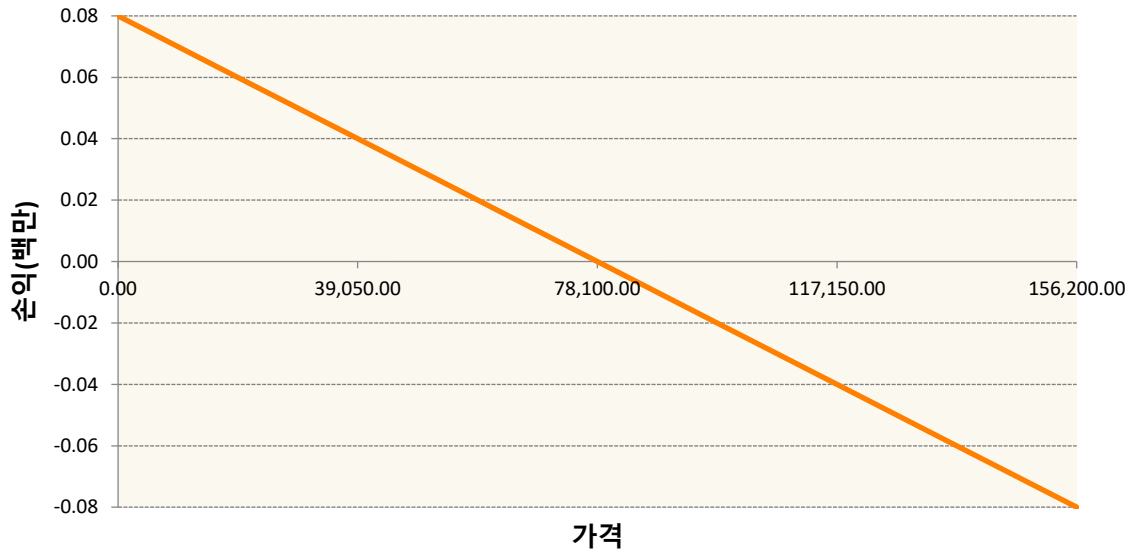
KR41C5V20004-2024-02 삼성에스디에스개별선물



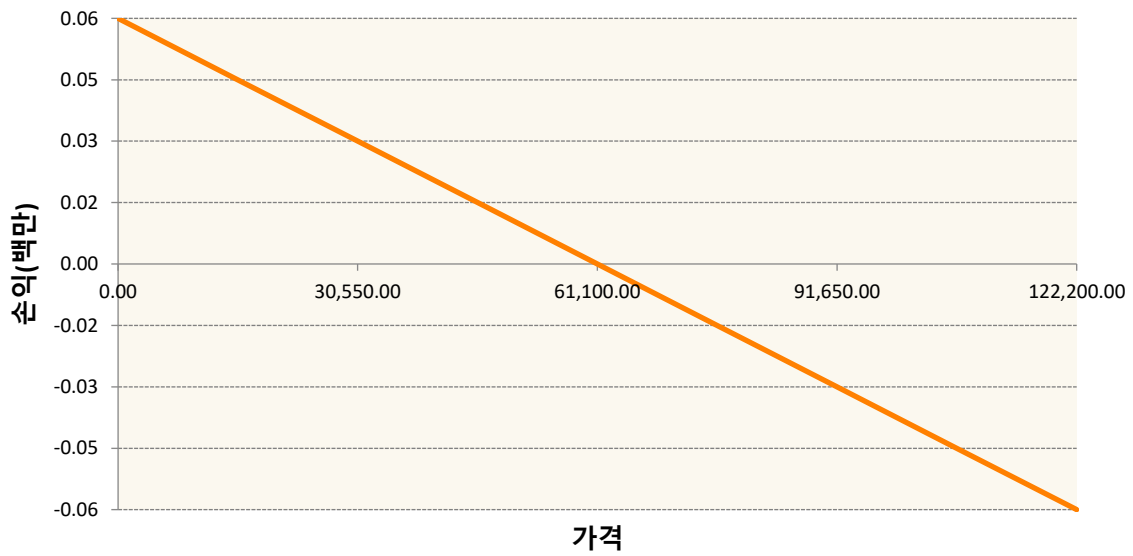
KR41CCV20008-2024-02 현대글로비스개별선물



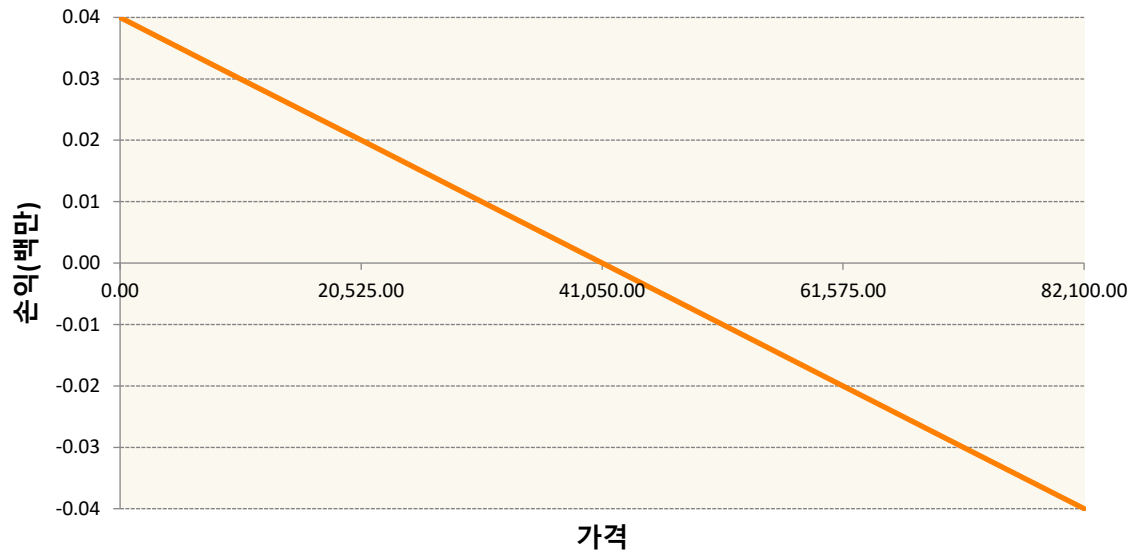
KR41CDV20006-2024-02 현대미포조선개별선물



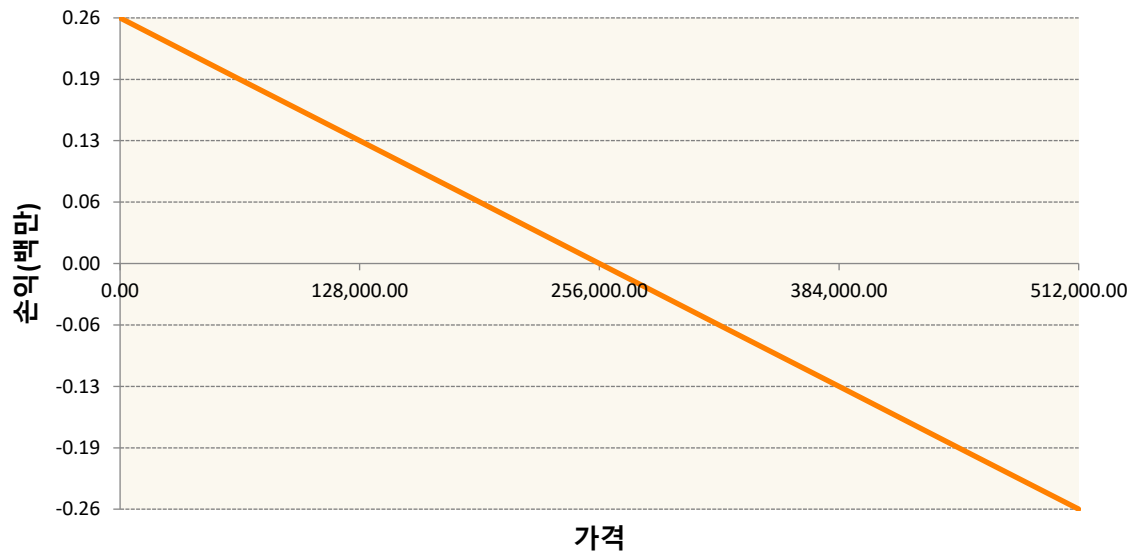
KR41CFV20001-2024-02 카카오개별선물



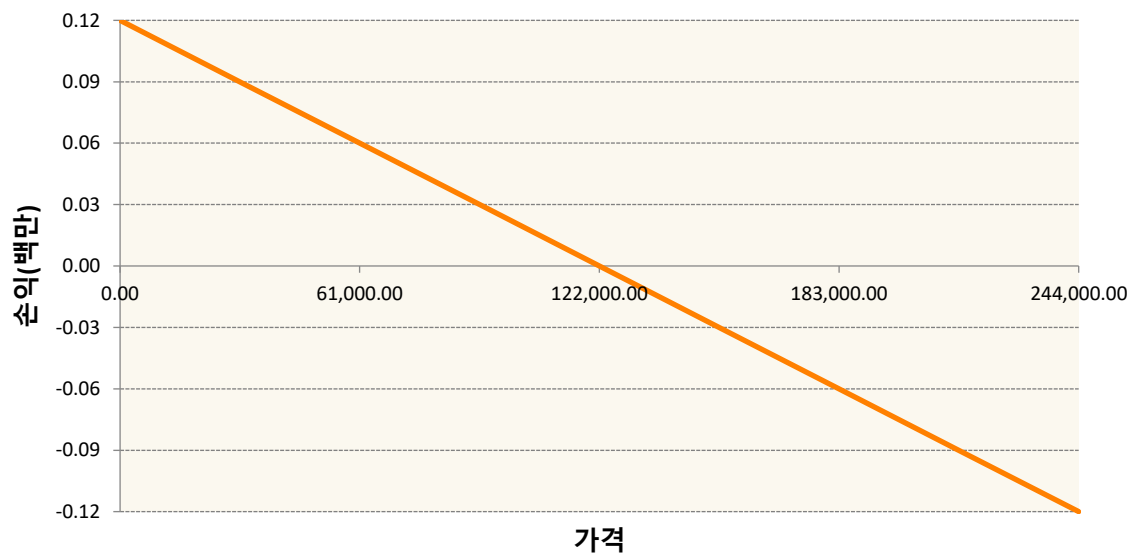
KR41CQV20008-2024-02 와이지엔터테인먼트개별선물



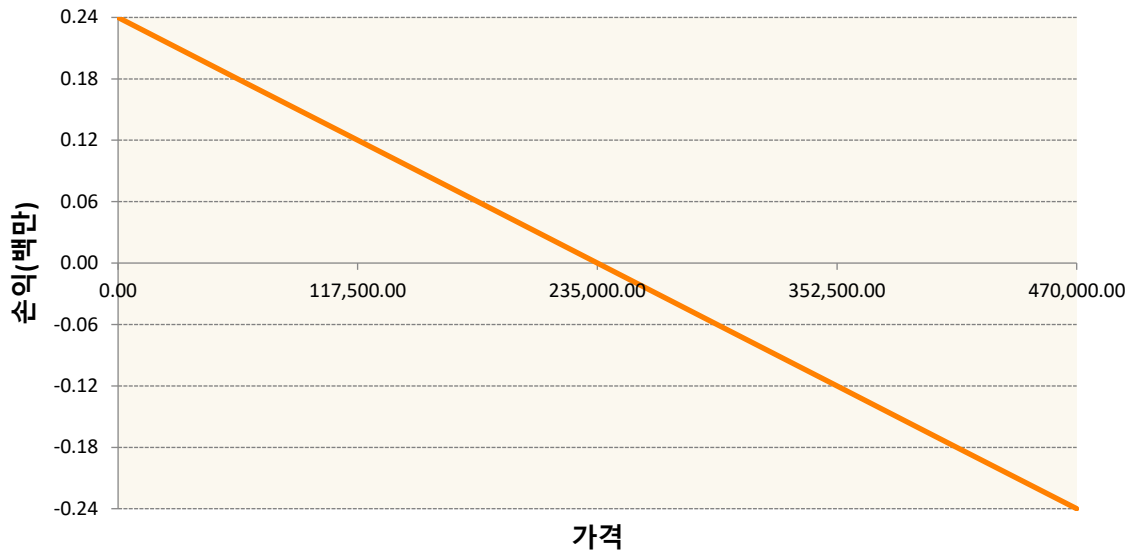
KR41CTV20002-2024-02 삼성화재개별선물



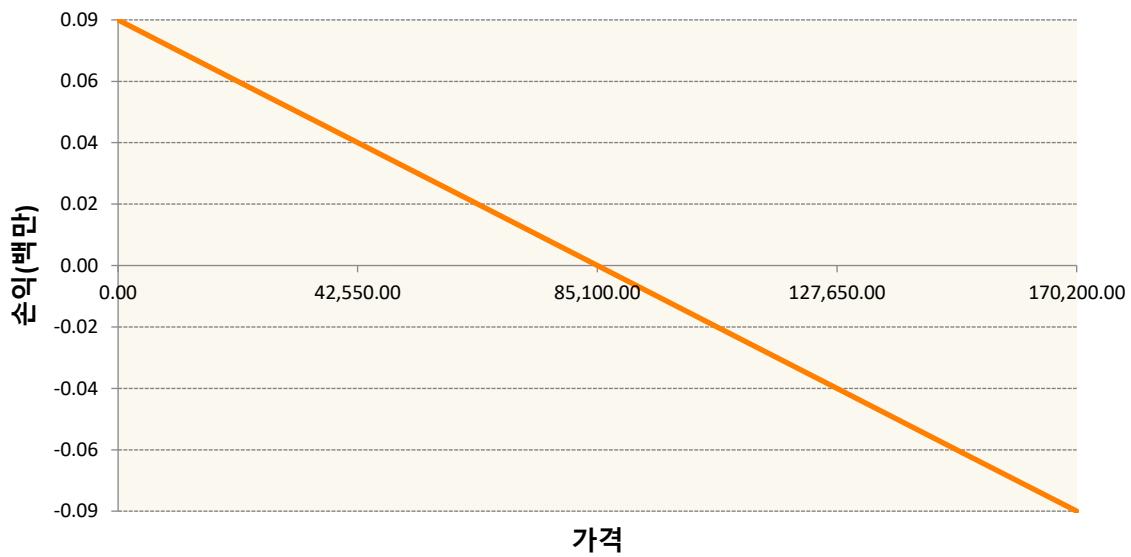
KR41DBV20008-2024-02 LIG넥스원개별선물



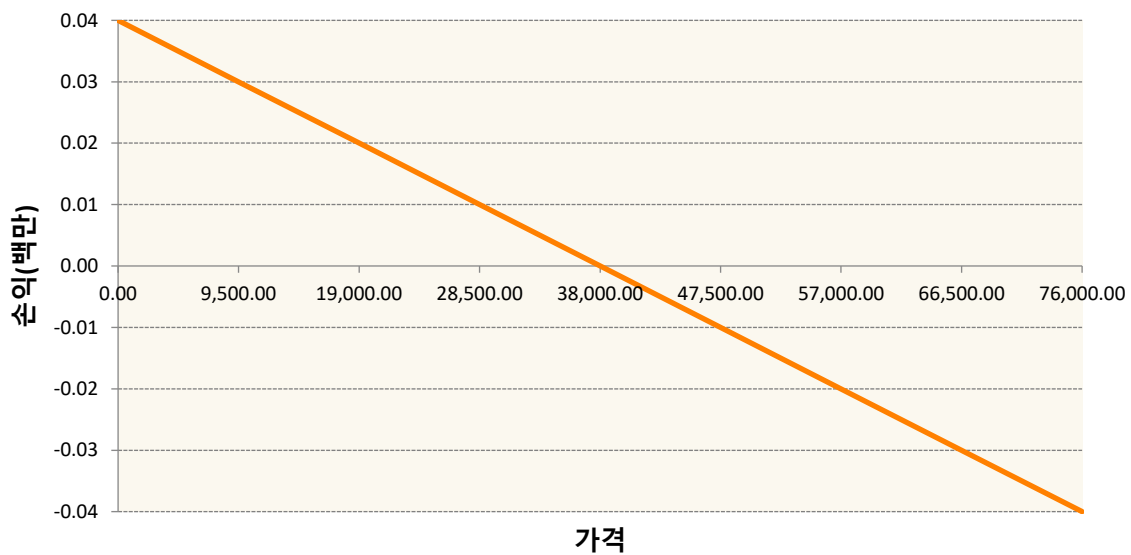
KR41DPV20008-2024-02 메디톡스개별선물



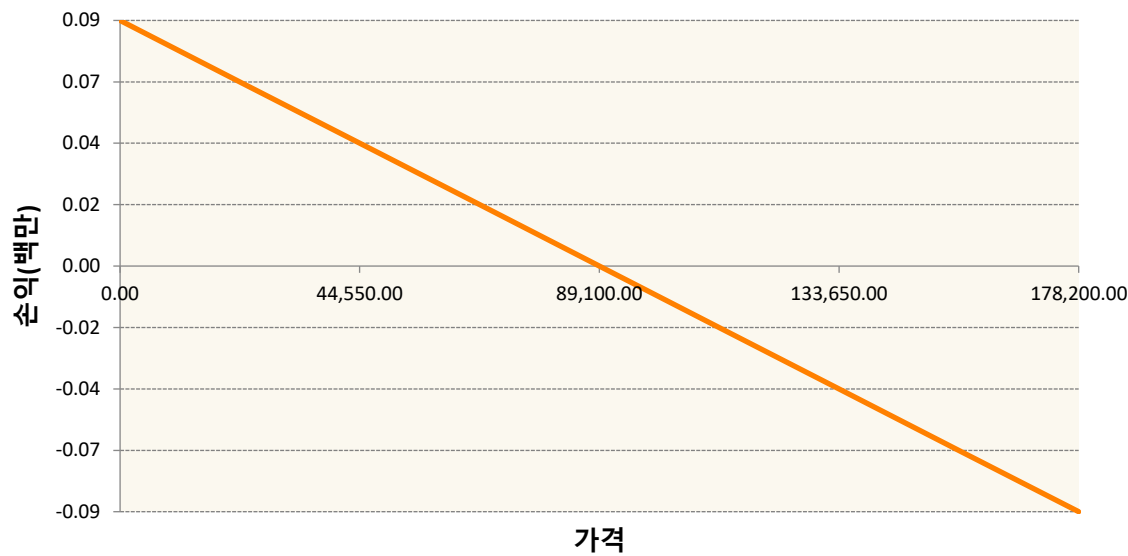
KR41E4V20005-2024-02 에스엠개별선물



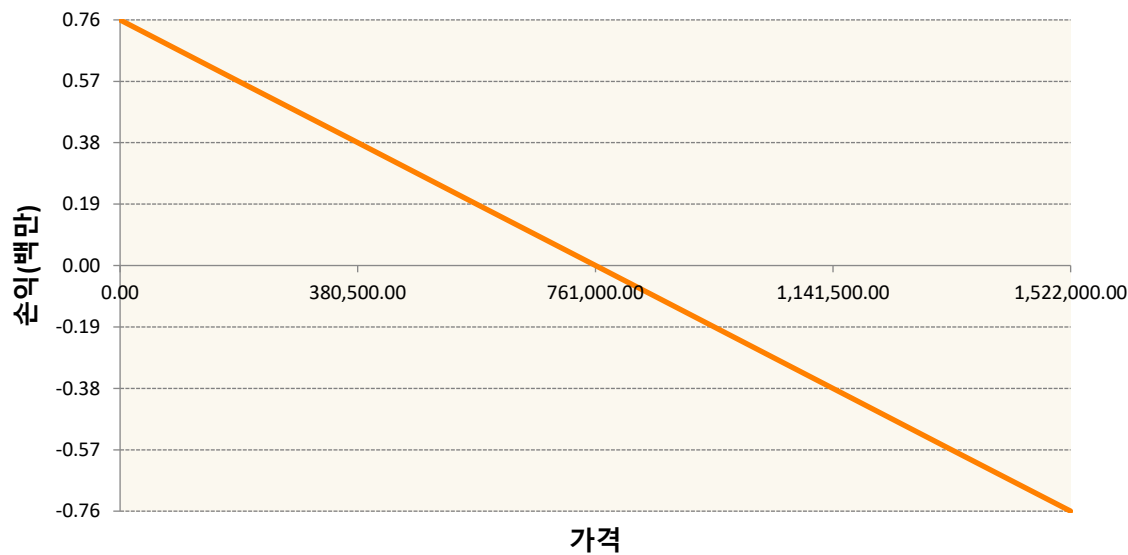
KR41EEV20000-2024-02 한올바이오파마개별선물



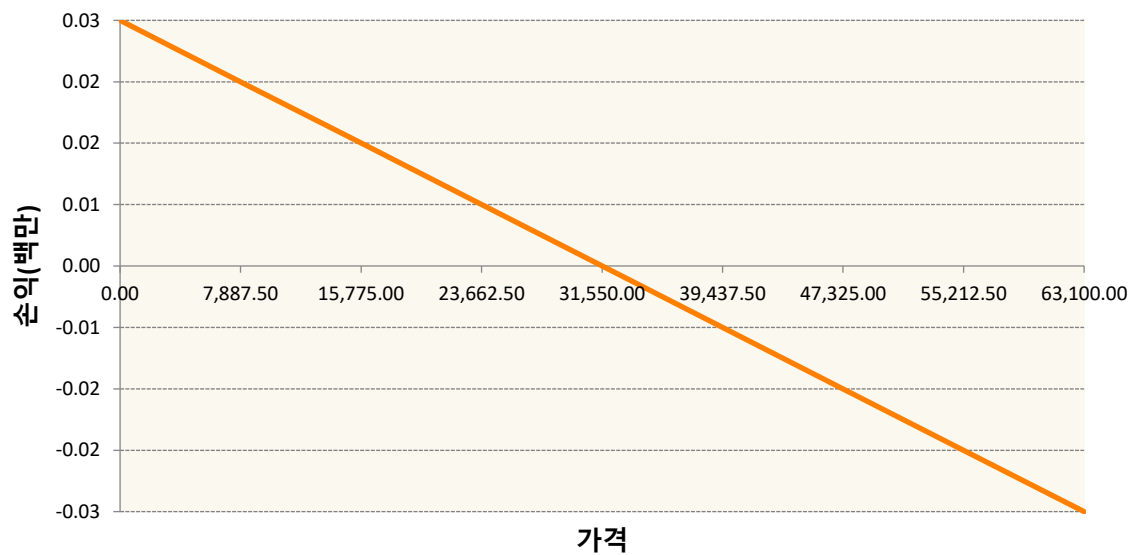
KR41EFV20007-2024-02 JYP Ent.개별선물



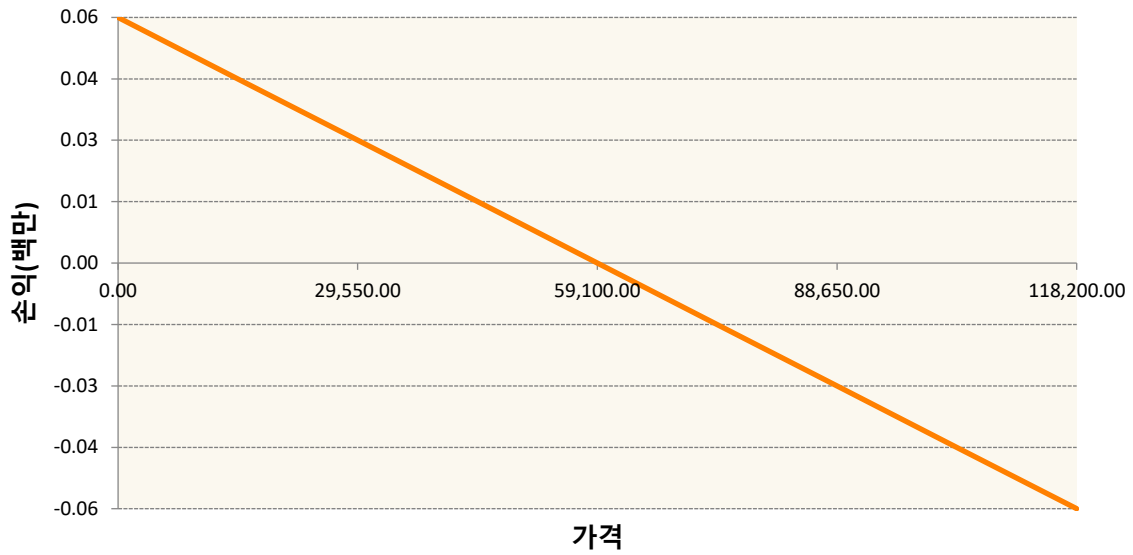
KR41ESV20000-2024-02 삼성바이오로직스개별선물



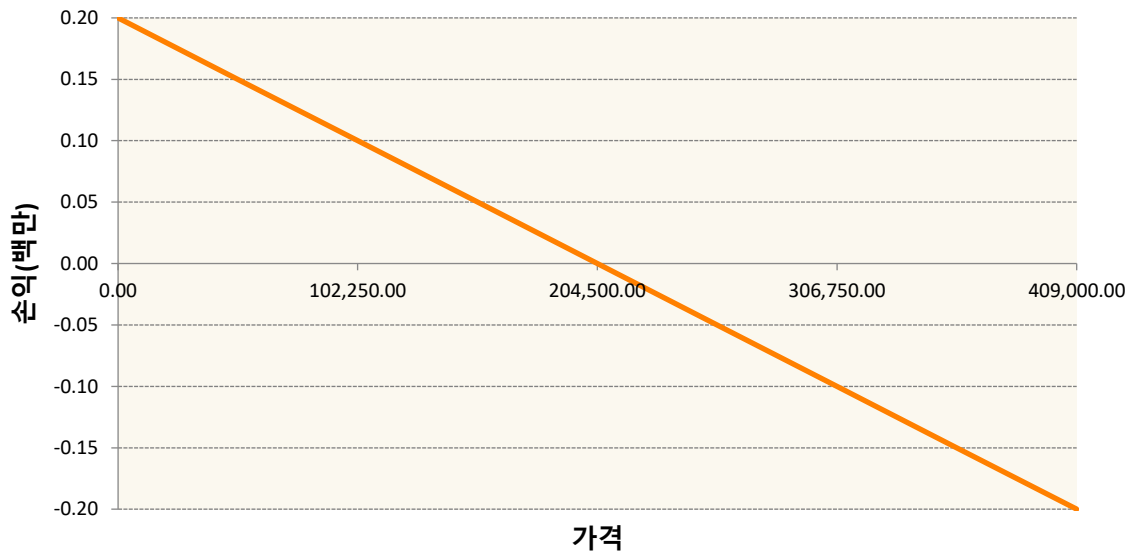
KR41F6V20009-2024-02 카카오뱅크개별선물



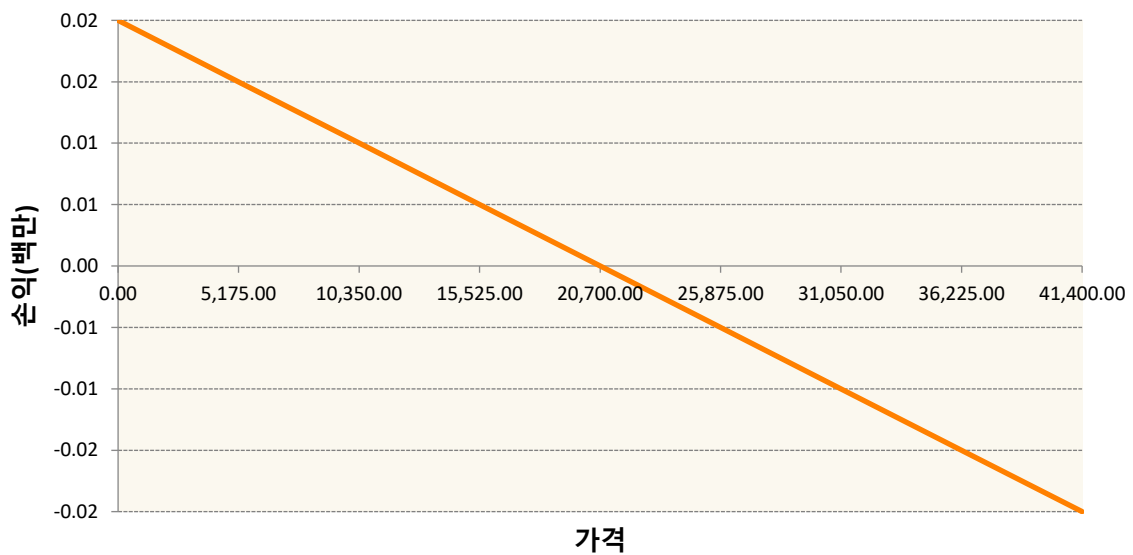
KR41F7V20007-2024-02 카카오페이개별선물



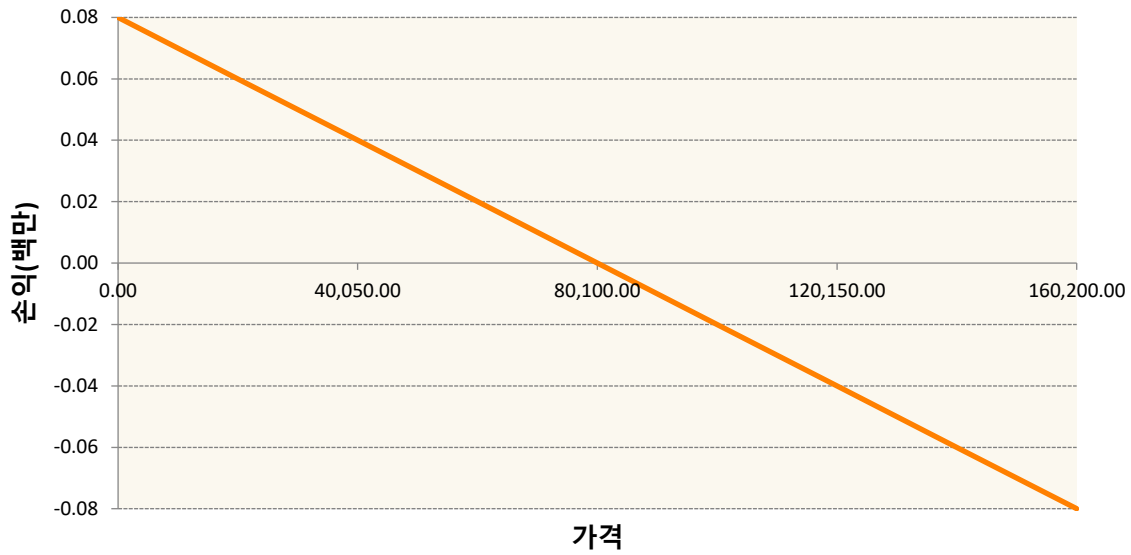
KR41F8V20005-2024-02 크래프톤개별선물



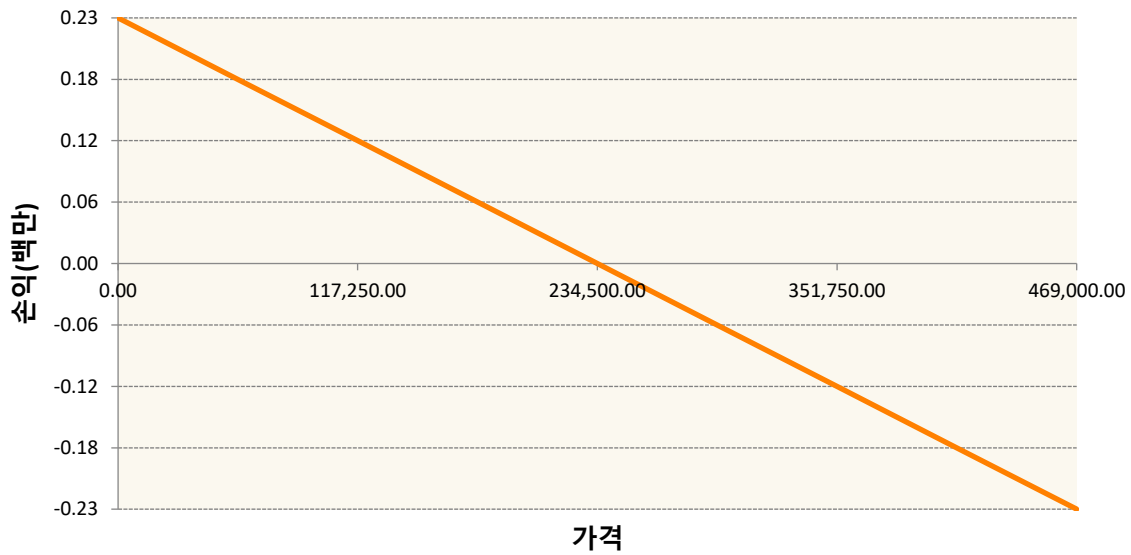
KR41FAV20005-2024-02 HMM개별선물



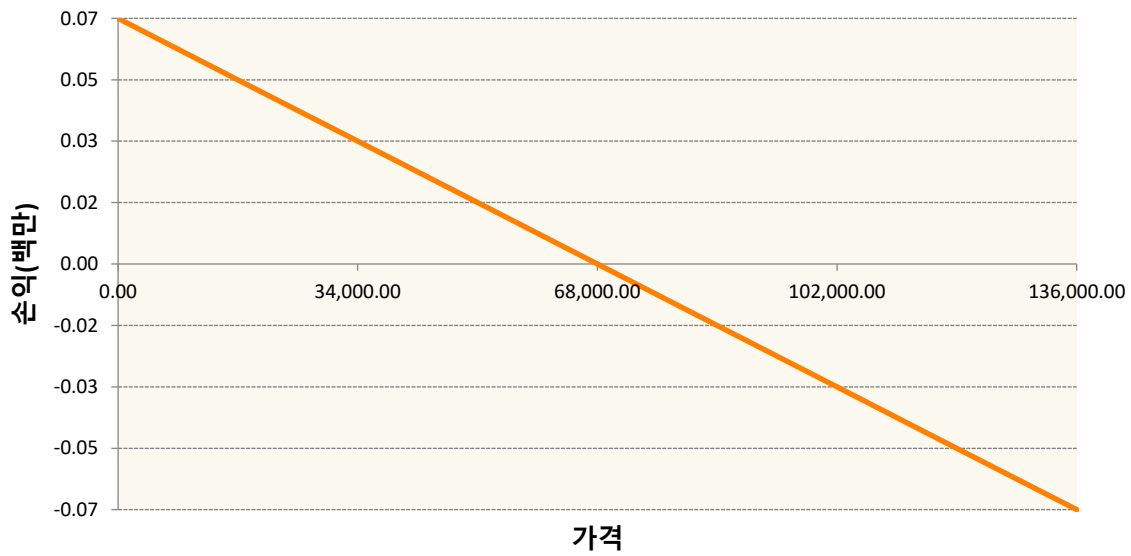
KR41FBV20003-2024-02 SK아이이테크놀로지개별선물



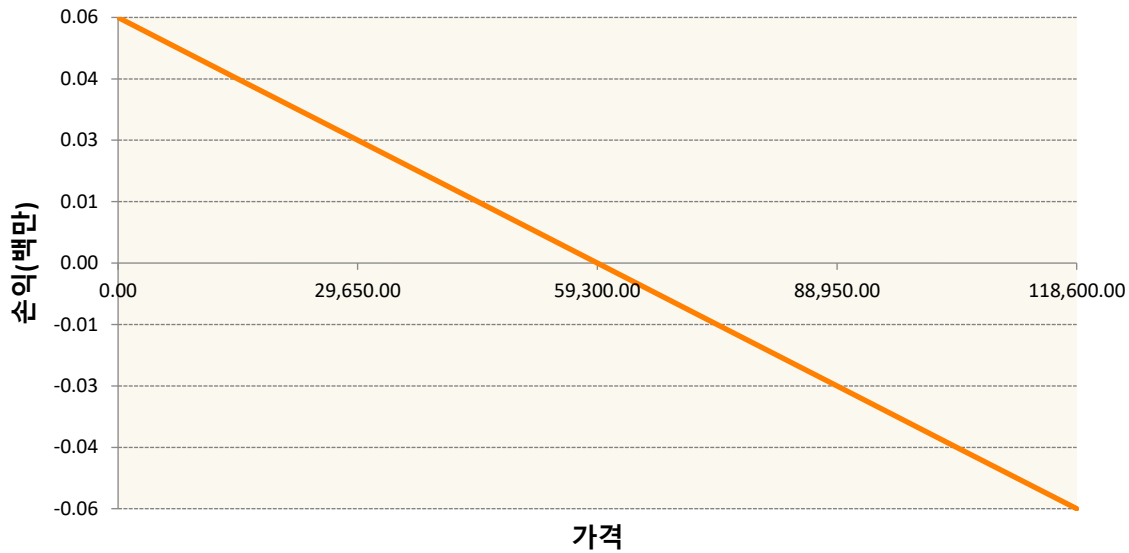
KR41FCV20001-2024-02 하이브개별선물



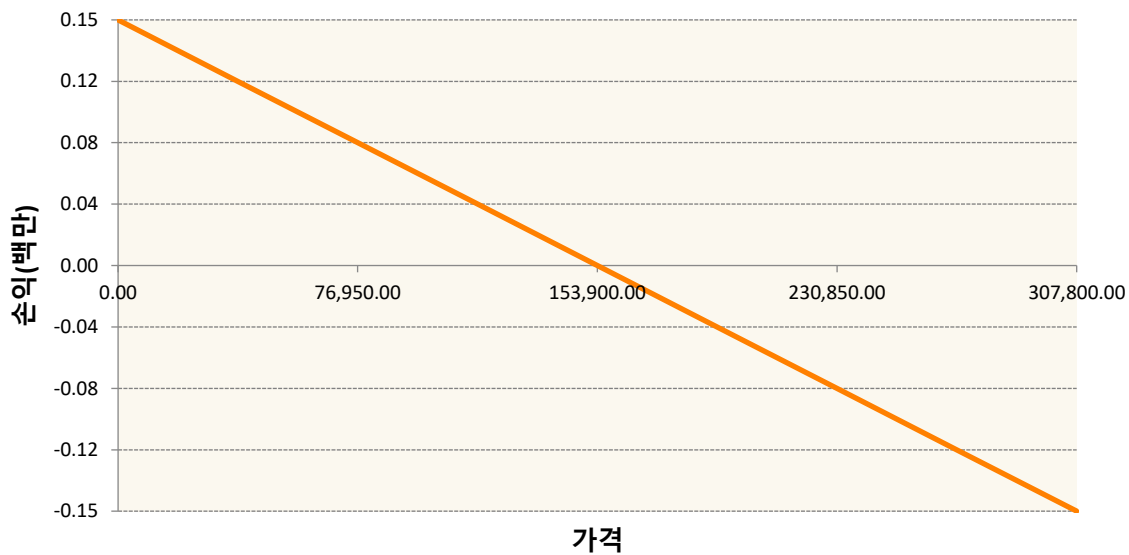
KR41FHV20000-2024-02 HD현대개별선물



KR41FKV20004-2024-02 메리츠금융지주개별선물



KR41GCV20009-2024-02 이오테크닉스개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101V300 2024-03 코스피200지수선물	82
KR4119V200 2024-02 기아개별선물	0.36
KR4139V200 2024-02 HD한국조선해양개별선물	1
KR4140V200 2024-02 하나금융지주개별선물	0.34
KR4155V200 2024-02 한국타이어엔테크놀로지개별선물	0.36
KR41B9V200 2024-02 두산에너빌리티개별선물	0.37
KR41BHV200 2024-02 한화에어로스페이스개별선물	1
KR41C5V200 2024-02 삼성에스디에스개별선물	0.41
KR41CCV200 2024-02 현대글로벌비스개별선물	0.14
KR41CDV200 2024-02 현대미포조선개별선물	0.5
KR41CFV200 2024-02 카카오개별선물	1
KR41CQV200 2024-02 와이지엔터테인먼트개별선물	1

KR41CTV200 2024-02 삼성화재개별선물	0.41
KR41DBV200 2024-02 LIG넥스원개별선물	0.29
KR41DPV200 2024-02 메디톡스개별선물	0.38
KR41E4V200 2024-02 에스엠개별선물	0.34
KR41EEV200 2024-02 한올바이오파마개별선물	0.3
KR41EFV200 2024-02 JYP Ent.개별선물	0.29
KR41ESV200 2024-02 삼성바이오로직스개별선물	1
KR41F6V200 2024-02 카카오뱅크개별선물	1
KR41F7V200 2024-02 카카오페이개별선물	1
KR41F8V200 2024-02 크래프톤개별선물	0.33
KR41FAV200 2024-02 HMM개별선물	0.36
KR41FBV200 2024-02 SK아이이테크놀로지개별선물	0.38
KR41FCV200 2024-02 하이브개별선물	0.19
KR41FHV200 2024-02 HD현대개별선물	0.38
KR41FKV200 2024-02 메리츠금융지주개별선물	0.33
KR41GCV200 2024-02 이오테크닉스개별선물	0.12

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

(단위:백만원)

98

공시일	2024-01-16
기준일	2024-01-15

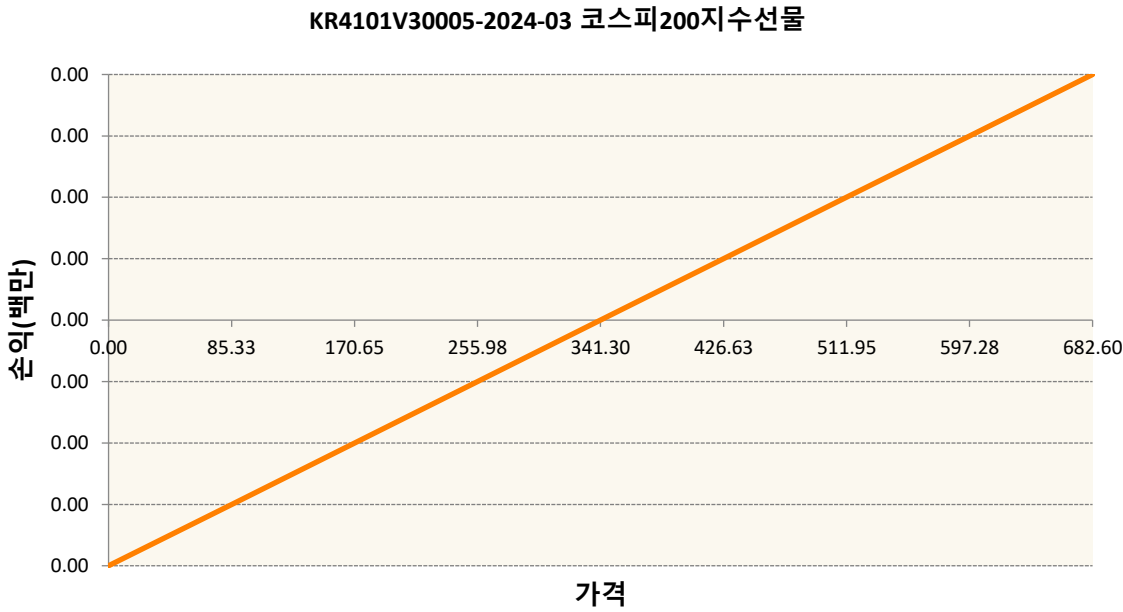
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	255	-255	장내
누계	유가증권	선물	3,072	0	3,072	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101V30005			2024-03 코스피200지수선물				244
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-244	-244	-244	-244	-244	-244	-244
-5.33%	-163	-163	-163	-163	-163	-163	-163
-2.67%	-81	-81	-81	-81	-81	-81	-81
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	81	81	81	81	81	81	81
5.33%	163	163	163	163	163	163	163
8.00%	244	244	244	244	244	244	244

공시일	2024-01-16
기준일	2024-01-15

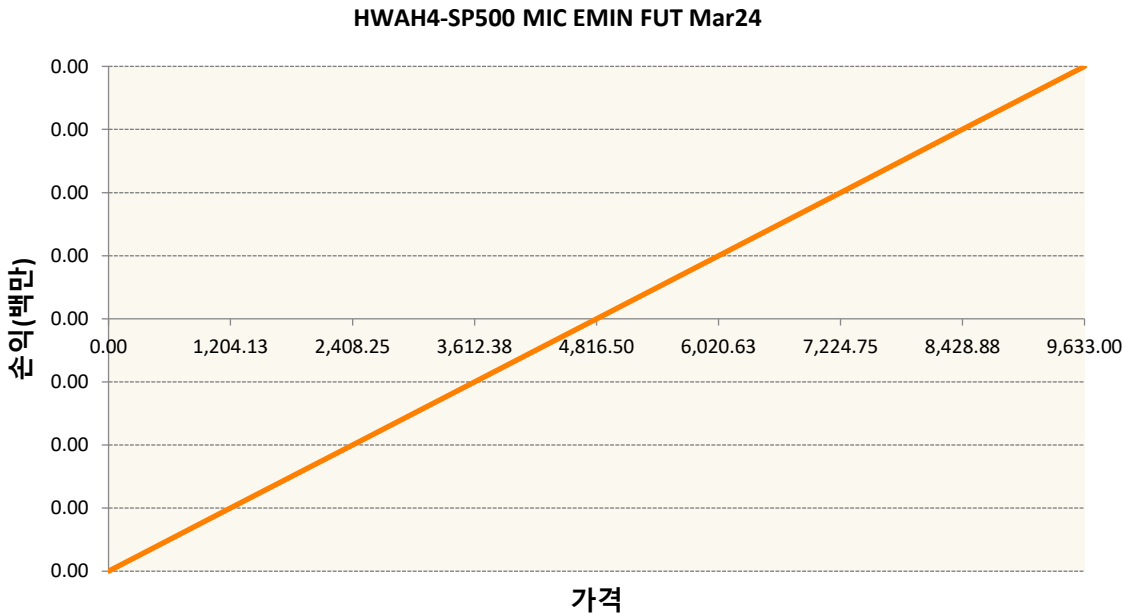
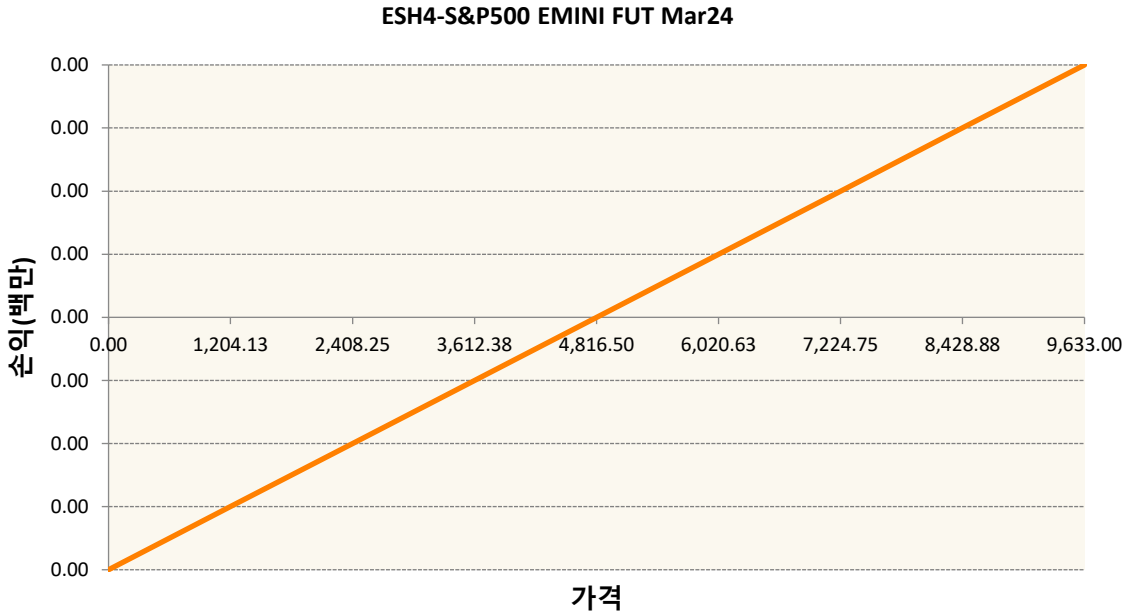
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

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	1,255	0	1,255	
누계	유가증권	선물	3,318	0	3,318	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESH4	S&P500 EMINI FUT Mar24	100
HWAH4	SP500 MIC EMIN FUT Mar24	265

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	303

공시일	2024-01-16
기준일	2024-01-15

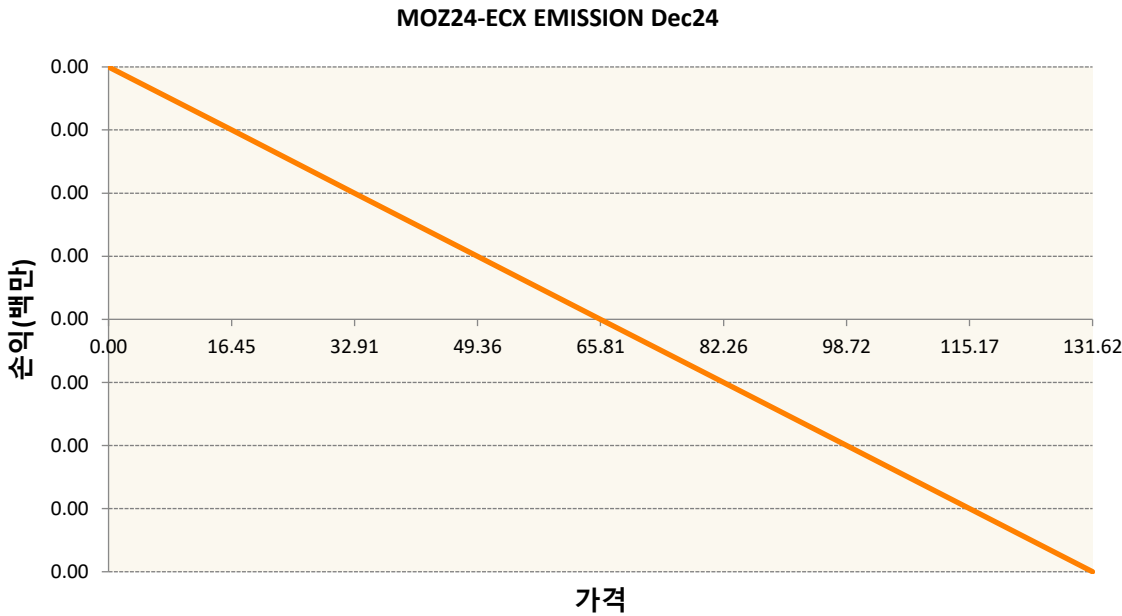
SOL유럽탄소배출권선물인버스ICE특별자산상

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	8,231	-8,231	
누계	지수	스왑	424	0	424	장외
누계	통화	선도	0	2,217	-2,217	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213DCS KRW/EUR 31-01-24E	108
FXW213E1FC KRW/EUR 31-01-24E	69
MOZ24 ECX EMISSION Dec24	659
SWICEUACN ICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX	5

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

(단위:백만원)

1,313

공시일	2024-01-16
기준일	2024-01-15

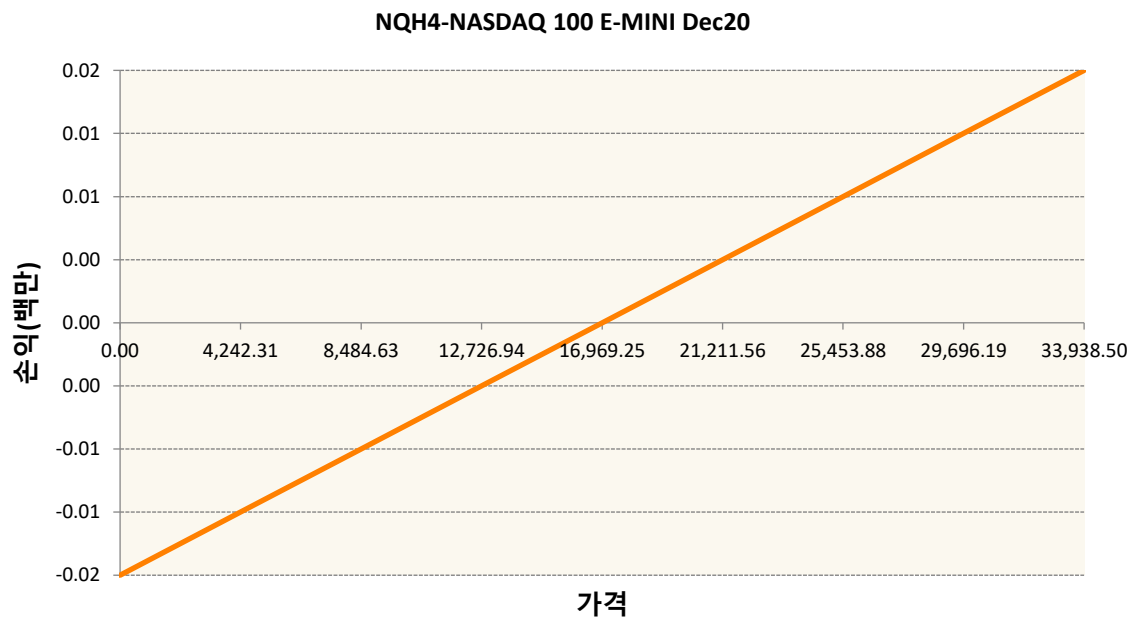
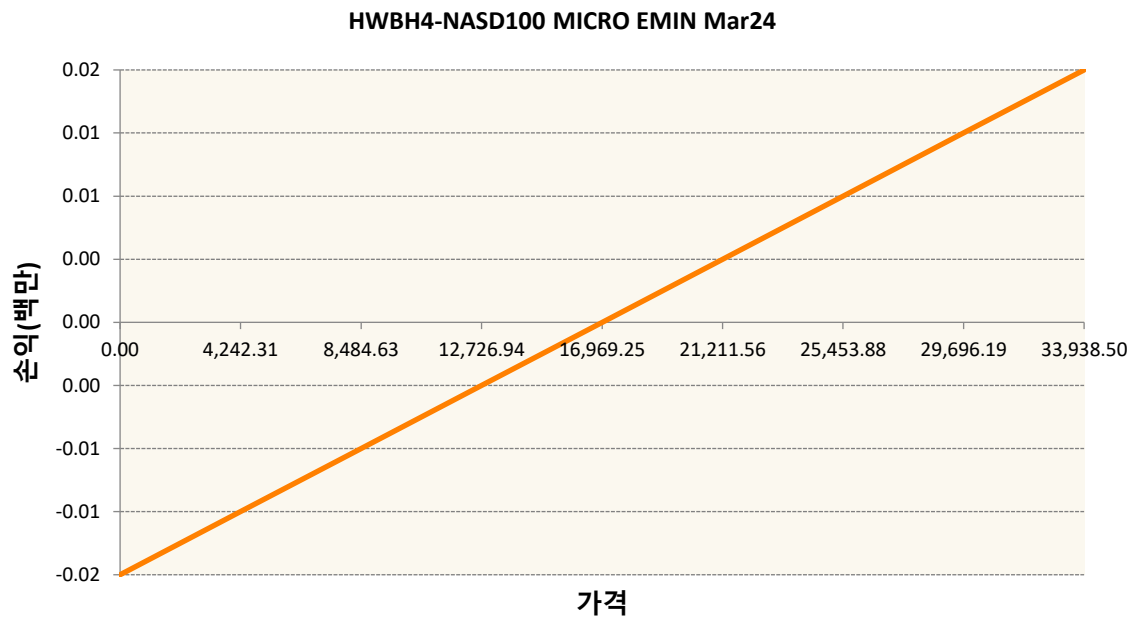
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

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	1,321	0	1,321	
누계	유가증권	선물	2,763	0	2,763	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
HWBH4	NASD100 MICRO EMIN Mar24		221
NQH4	NASDAQ 100 E-MINI Dec20		106

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)			(단위:백만원)
			299

공시일	2024-01-16
기준일	2024-01-15

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	19,592	0	19,592	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWKEDI0000 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	163
SWKEDI0000 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	163
SWKEDI0000 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	81
SWKEDI0000 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	244
SWKEDI0000 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	936

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

(단위:백만원)

1,096

공시일	2024-01-16
기준일	2024-01-15

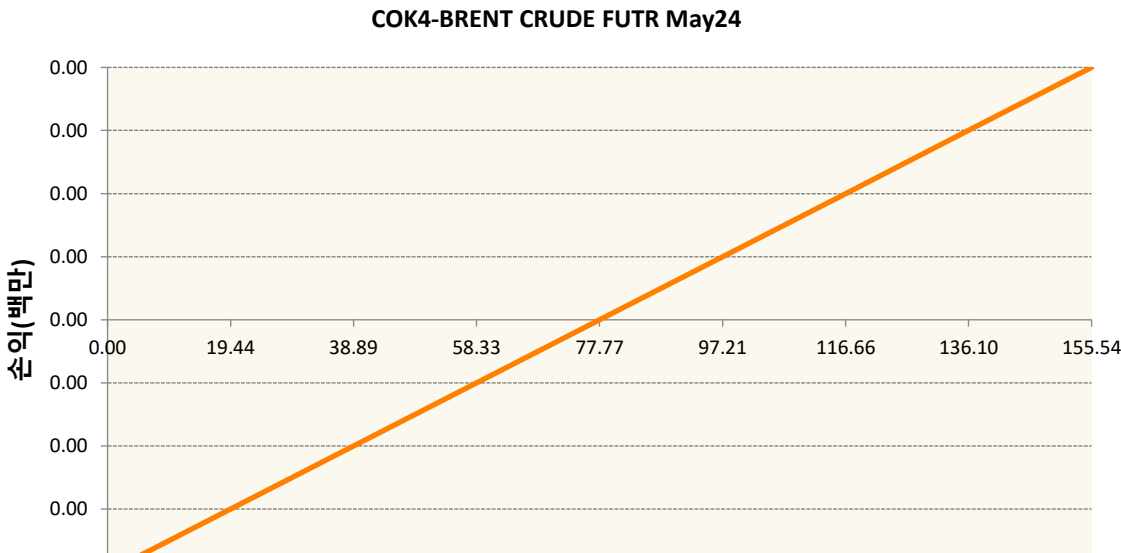
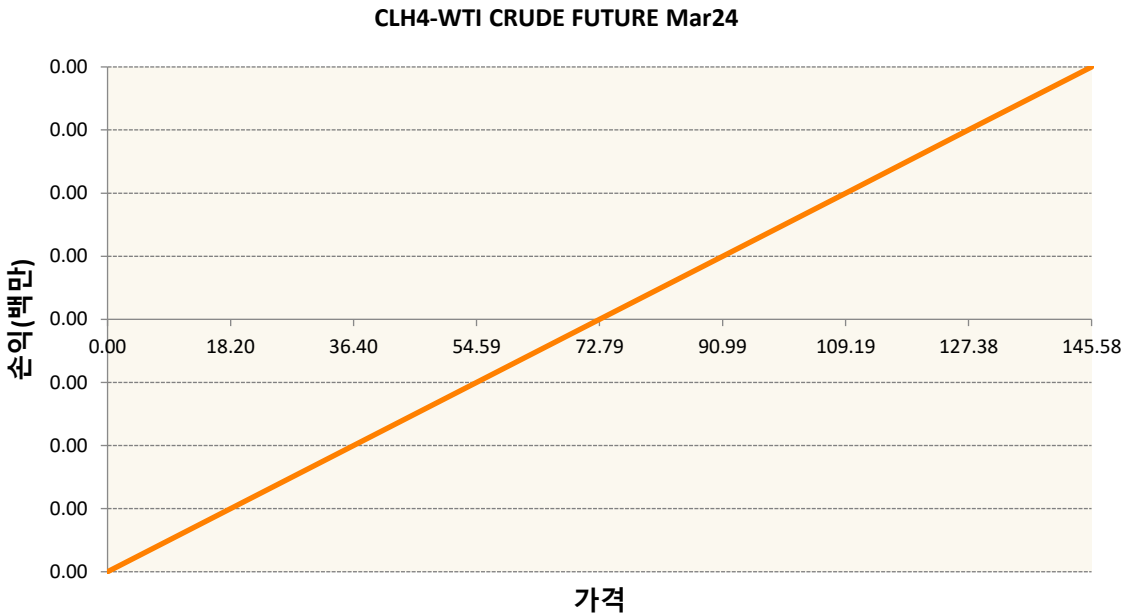
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

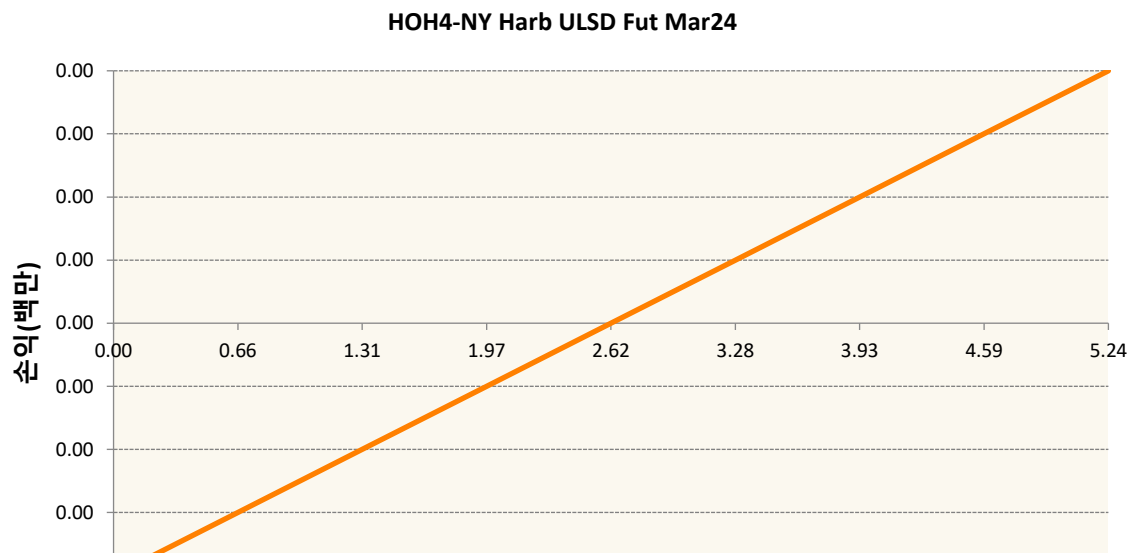
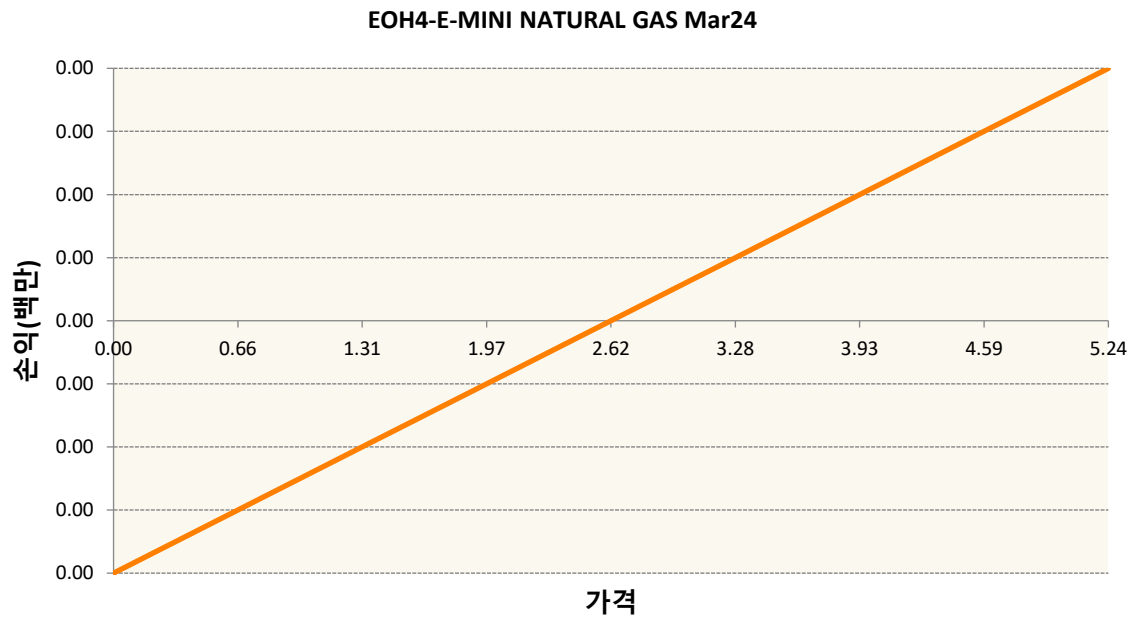
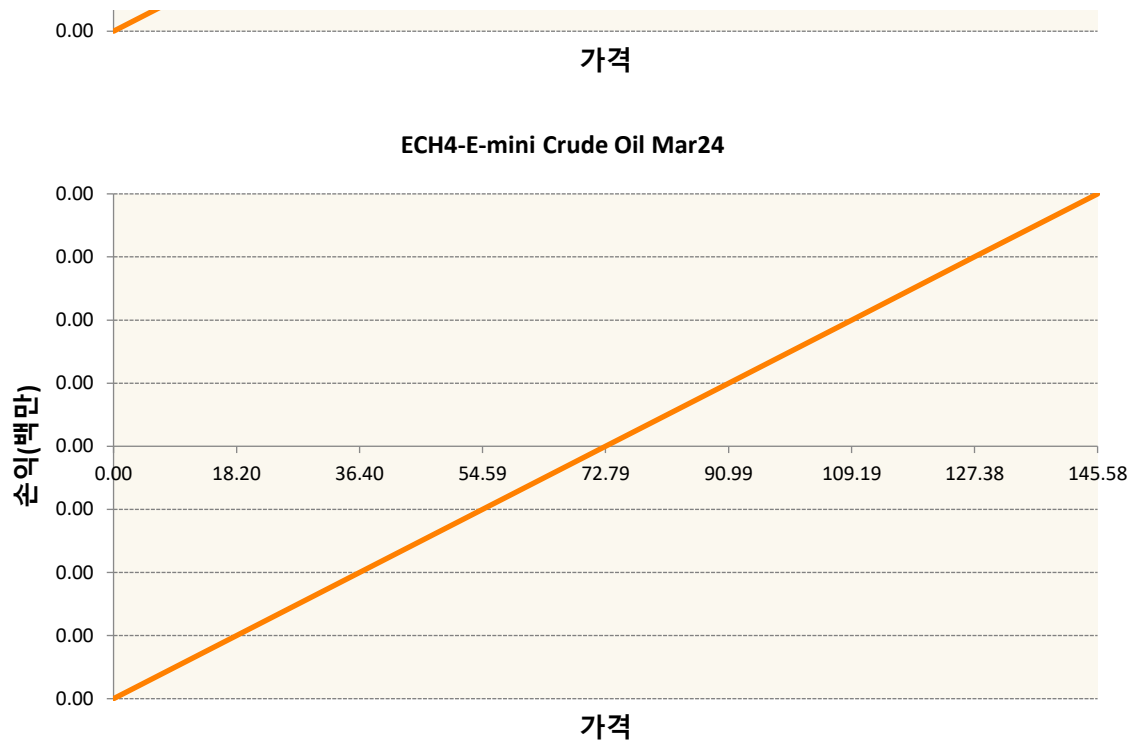
1. 계약금액

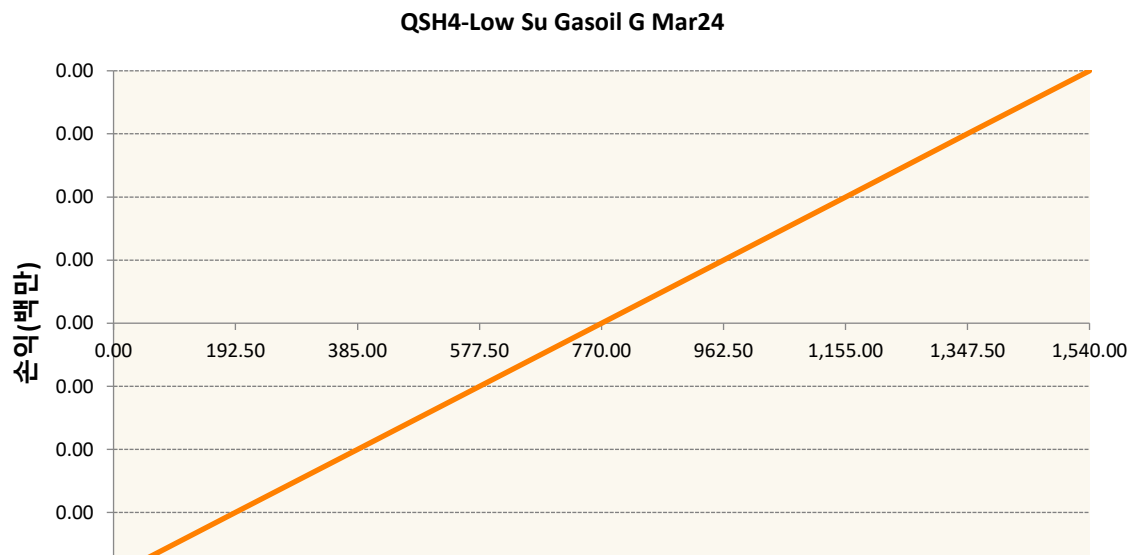
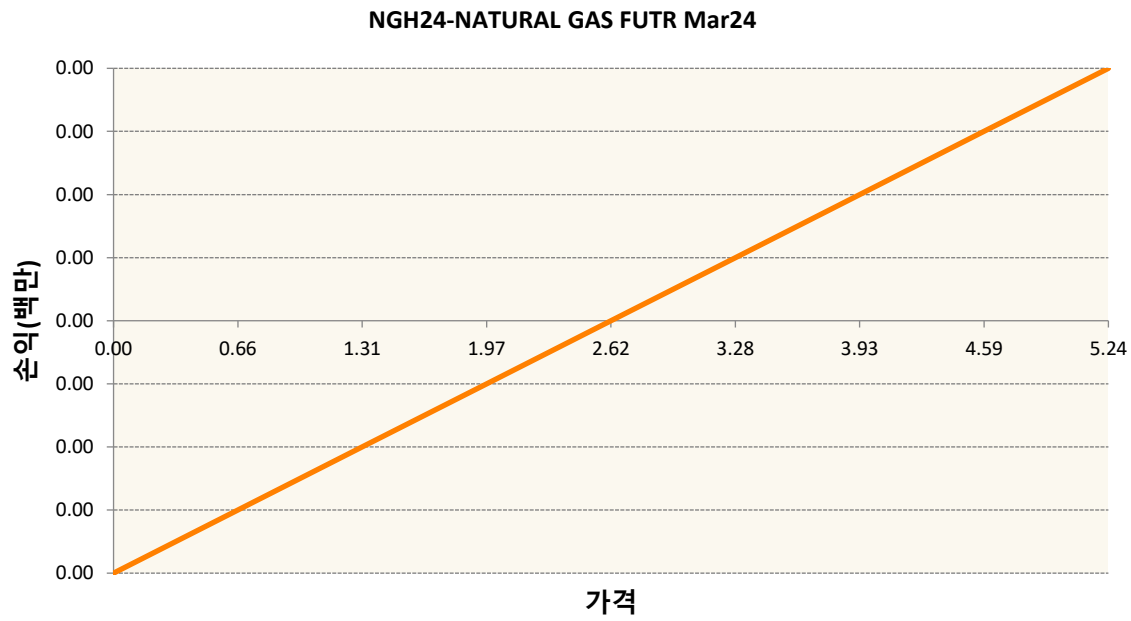
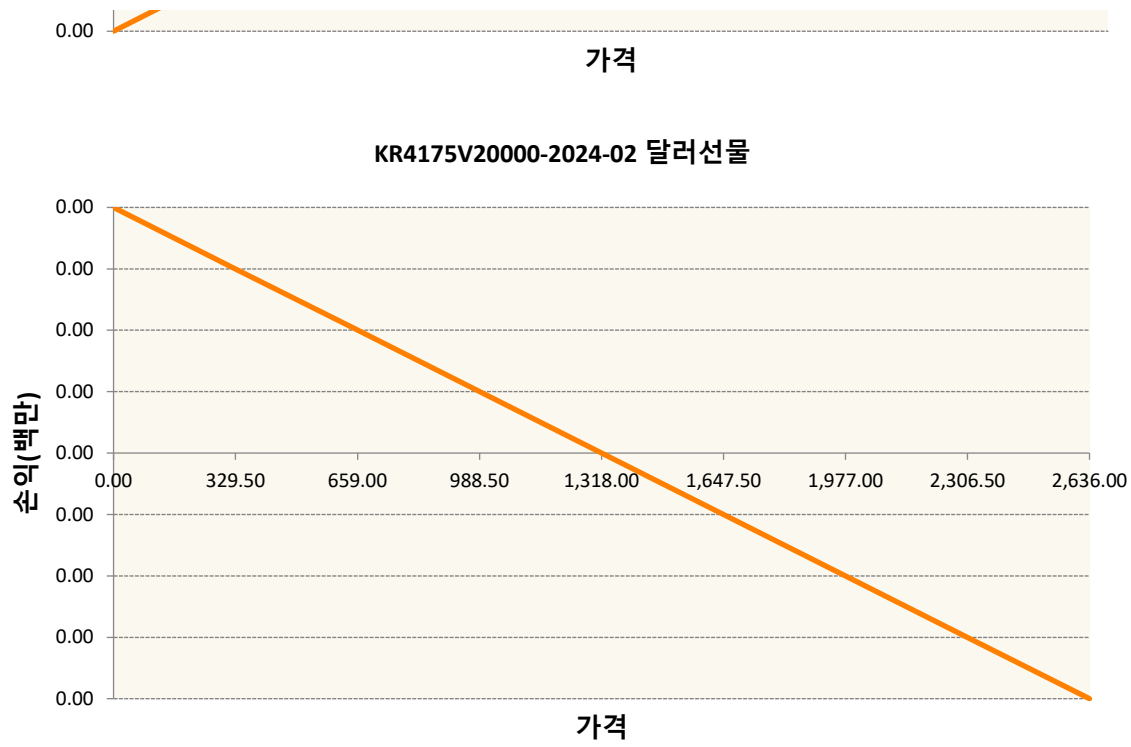
(단위:백만원)

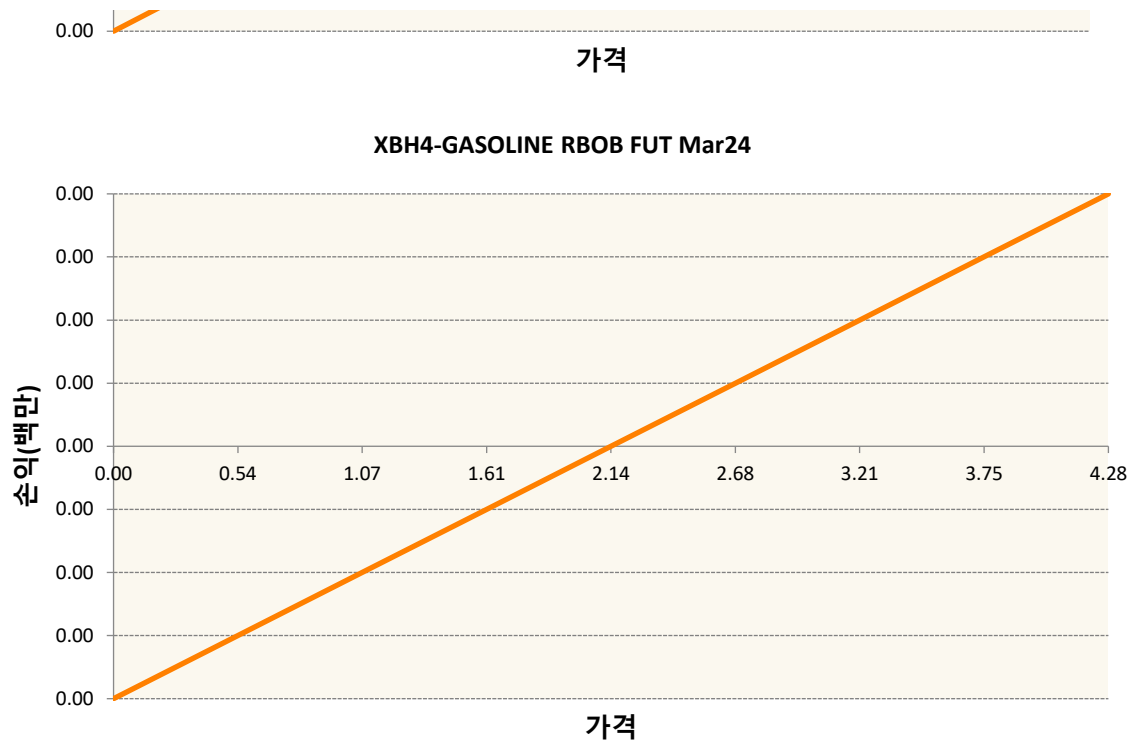
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	선물	유가증권	191	0	191	
누계	유가증권	선물	1,002	0	1,002	
누계	통화	선물	0	198	-198	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

CLH4	WTI CRUDE FUTURE Mar24	15
COK4	BRENT CRUDE FUTR May24	25
ECH4	E-mini Crude Oil Mar24	4
EOH4	E-MINI NATURAL GAS Mar24	1
HOH4	NY Harb ULSD Fut Mar24	12
KR4175V200	2024-02 달러선물	16
NGH24	NATURAL GAS FUTR Mar24	22
QSH4	Low Su Gasoil G Mar24	8
XBH4	GASOLINE RBOB FUT Mar24	9

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

(단위:백만원)

236