

공시일	2024-06-03
기준일	2024-05-31

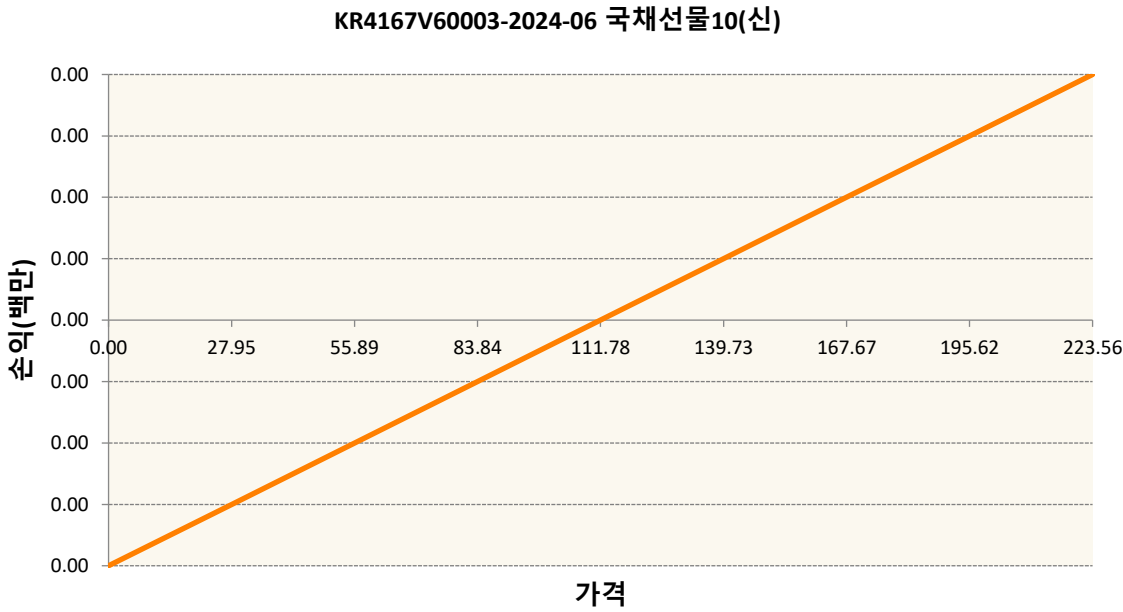
베스트장기채(채권-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	금리	선물	0	0	0	장내
누계	금리	선물	44,712	0	44,712	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4167V600 2024-06 국채선물10(신)	3,577
------------------------------	-------

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

(단위:백만원)

1,337

공시일	2024-06-03
기준일	2024-05-31

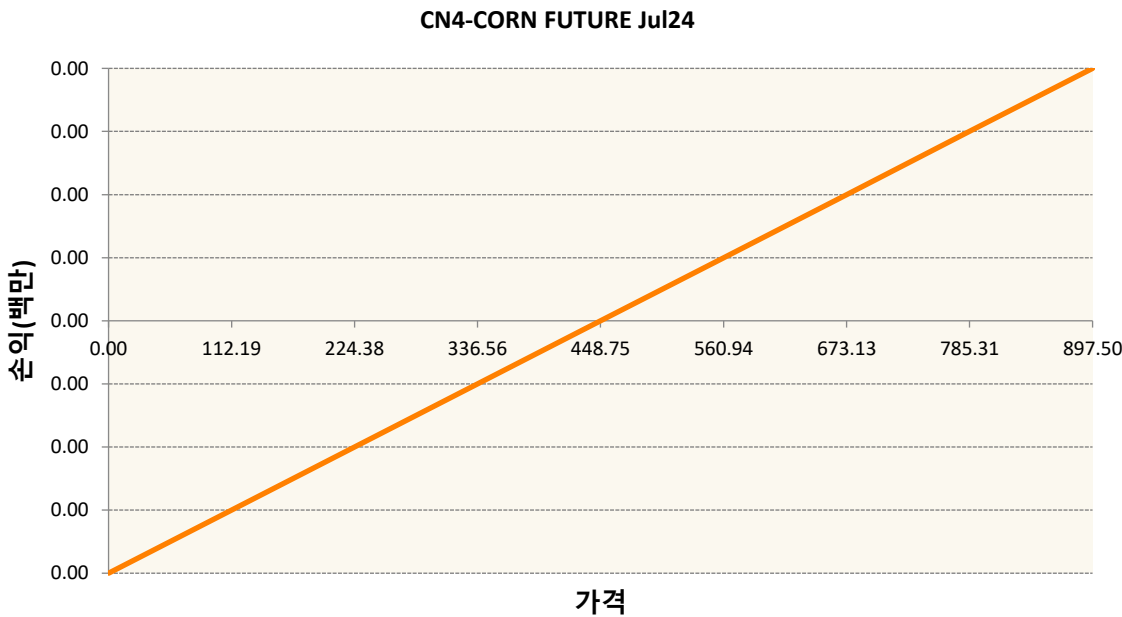
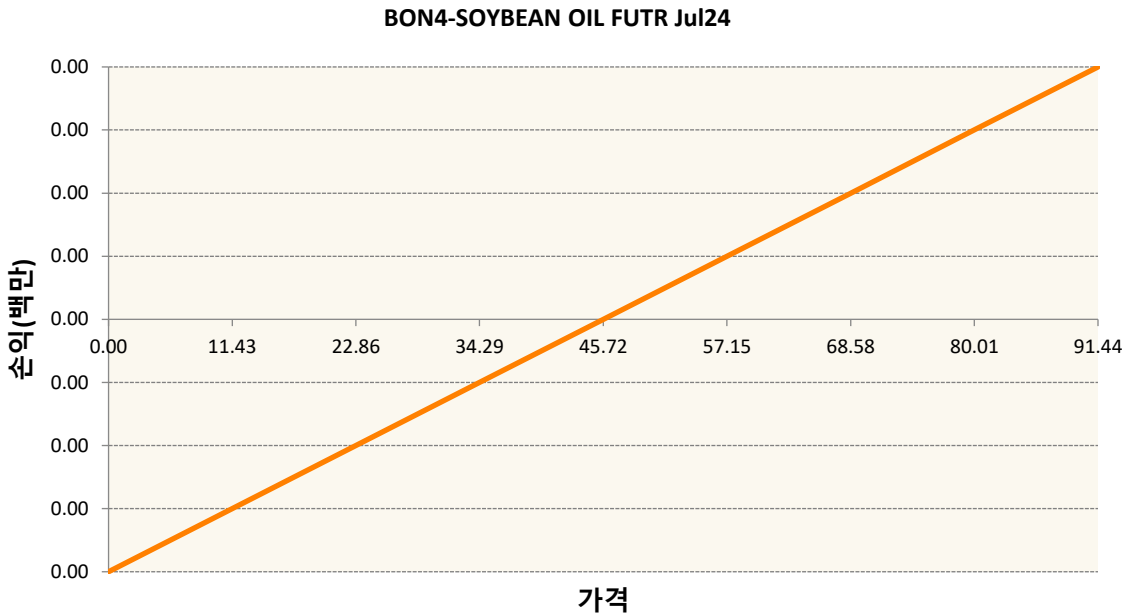
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

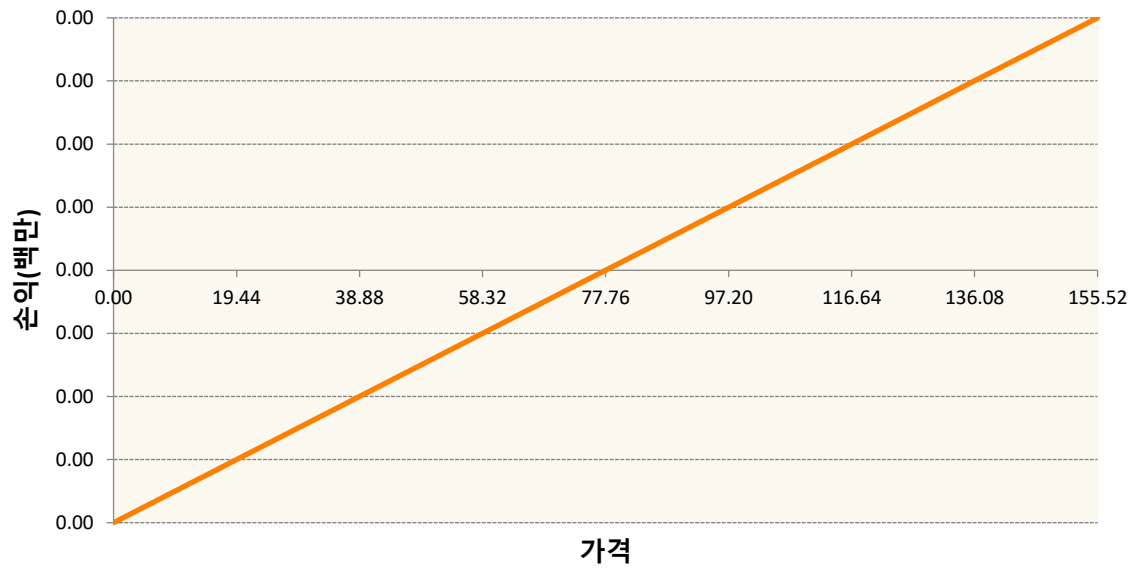
(단위:USD 백만)

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	4,356	0	4,356	
누계	통화	선물	0	554	-554	장내

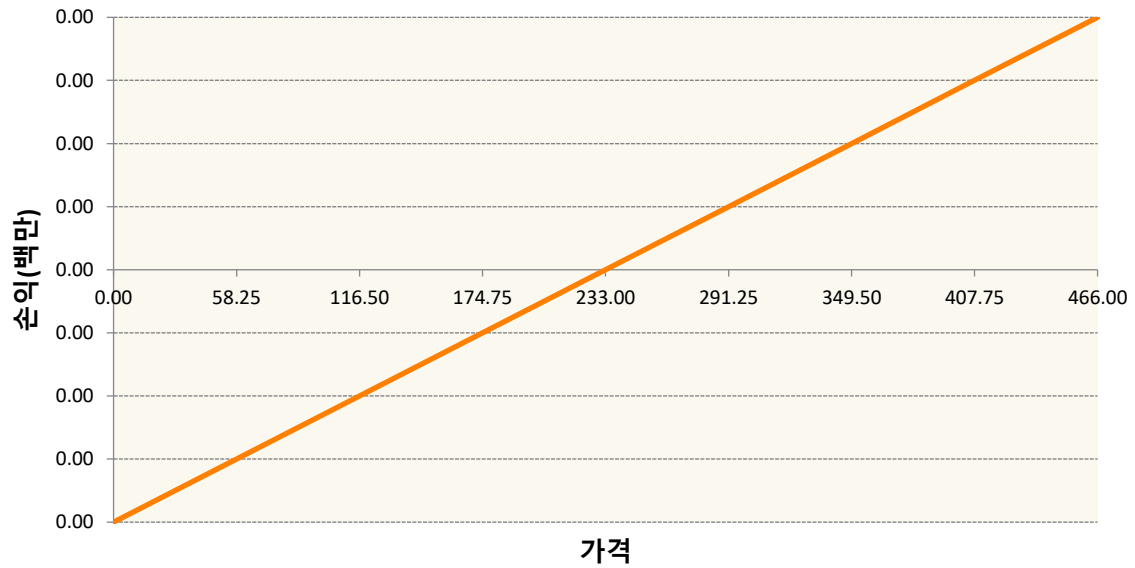
2. 만기시점의 손익구조



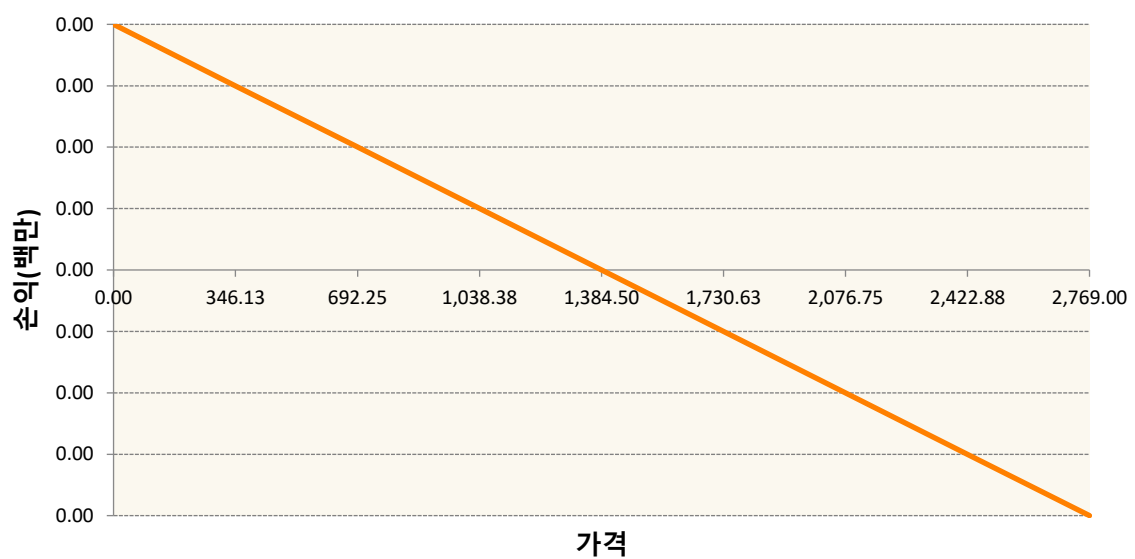
CTN4-COTTON NO.2 FUTR Jul24



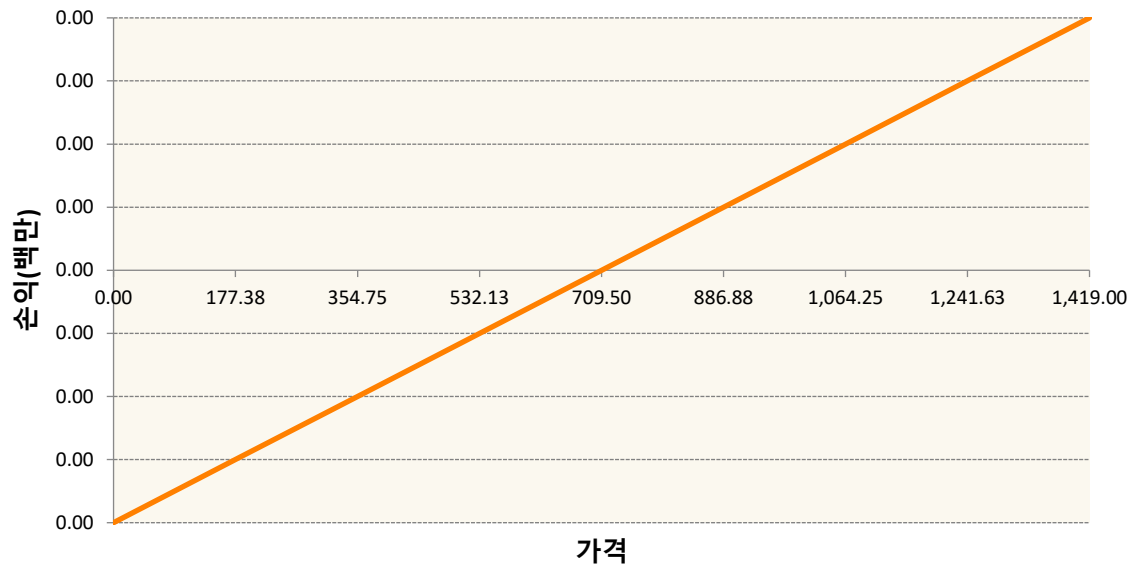
KCN4-COFFEE 'C' FUTURE Jul24



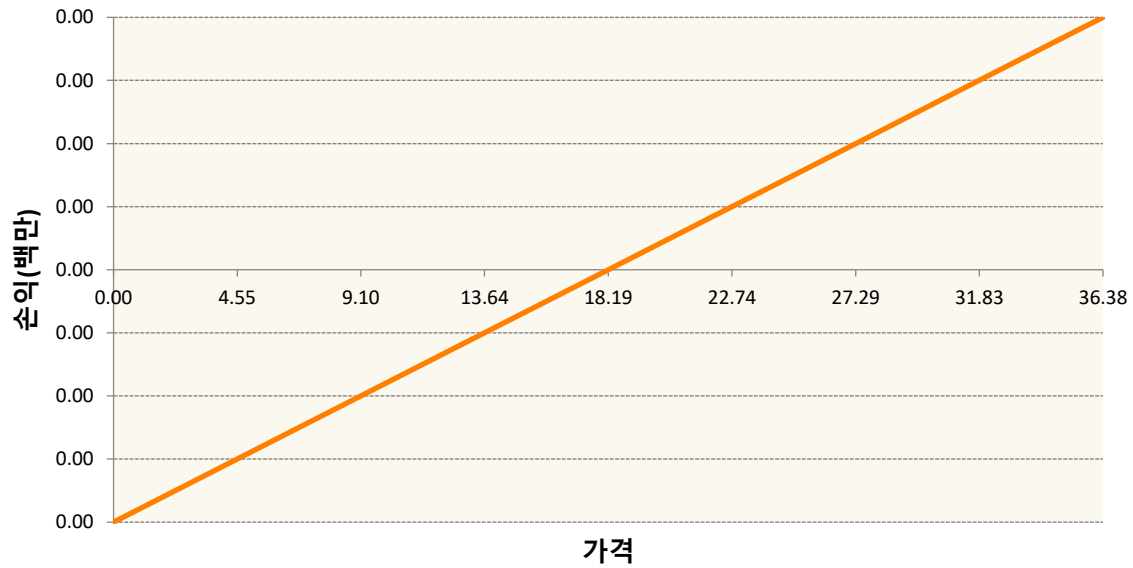
KR4175V60006-2024-06 달러선물



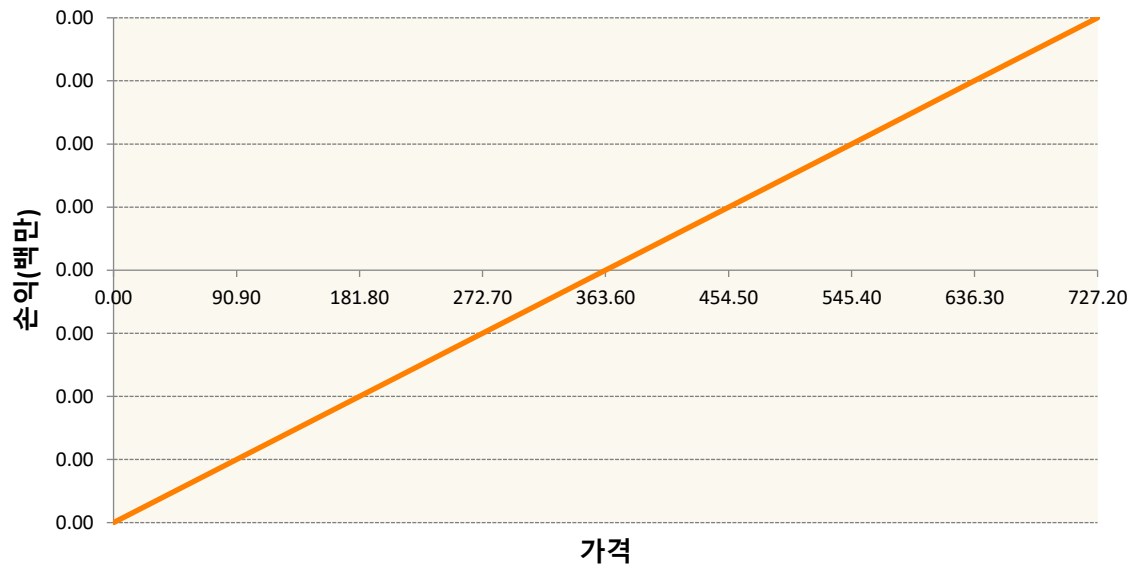
KWN4-KC HRW WHEAT FUT Jul24

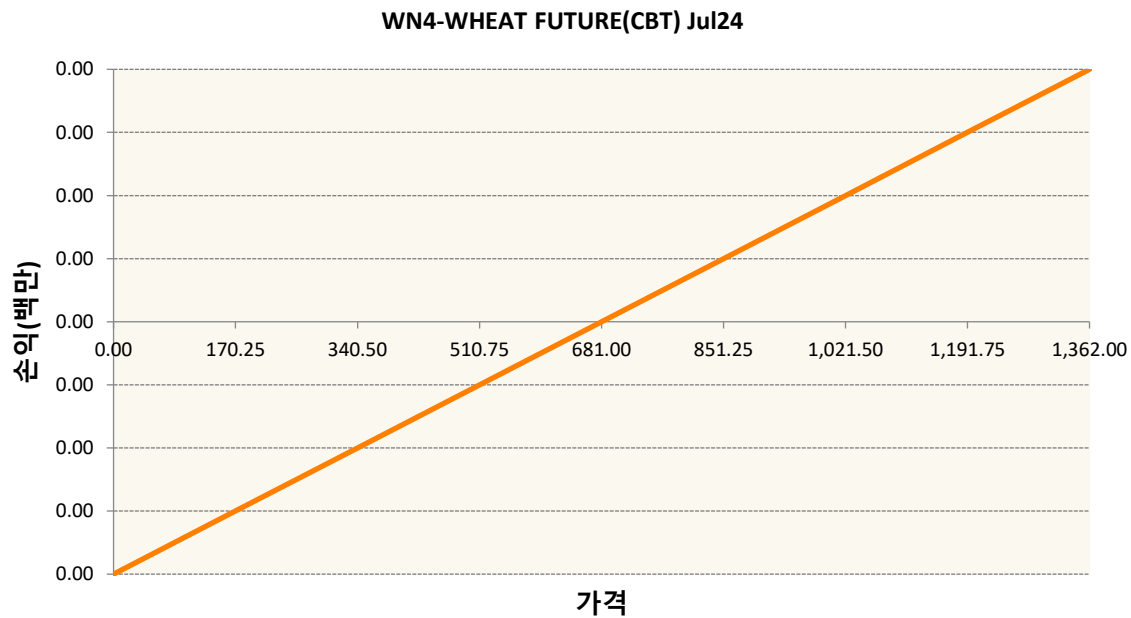
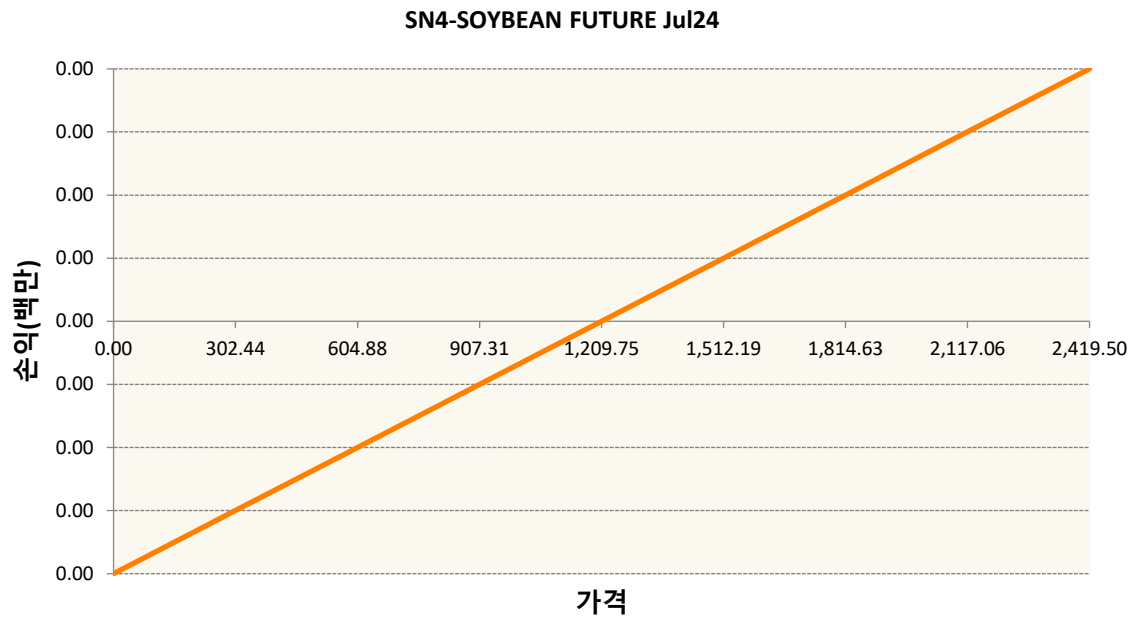


SBN4-Sugar #11 (WORLD) Jul24



SMN4-SOYBEAN MEAL FUTR Jul24





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

공시일	2024-06-03
기준일	2024-05-31

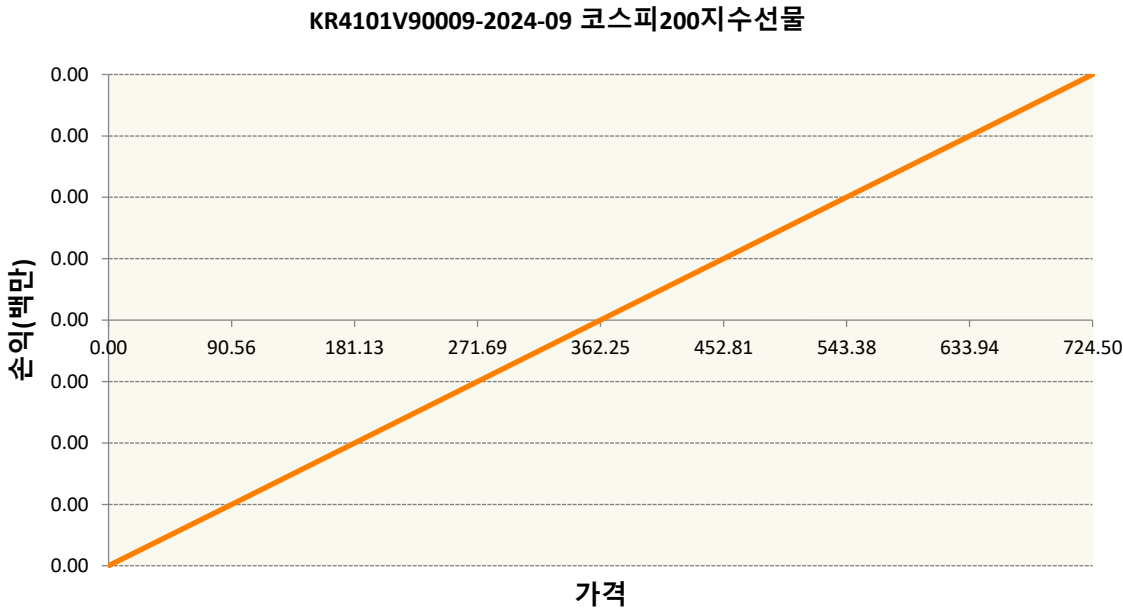
스마트인덱스모

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	362	0	362	장내
누계	유가증권	선물	1,268	0	1,268	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101V90009		2024-09 코스피200지수선물					100
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-100	-100	-100	-100	-100	-100	-100
-5.33%	-67	-67	-67	-67	-67	-67	-67
-2.67%	-33	-33	-33	-33	-33	-33	-33
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	33	33	33	33	33	33	33
5.33%	67	67	67	67	67	67	67
8.00%	100	100	100	100	100	100	100

공시일	2024-06-03
기준일	2024-05-31

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	3,420	0	3,420	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 신한CSI500미래231226	265
-----------------------------	-----

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

322

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2024-06-03
기준일	2024-05-31

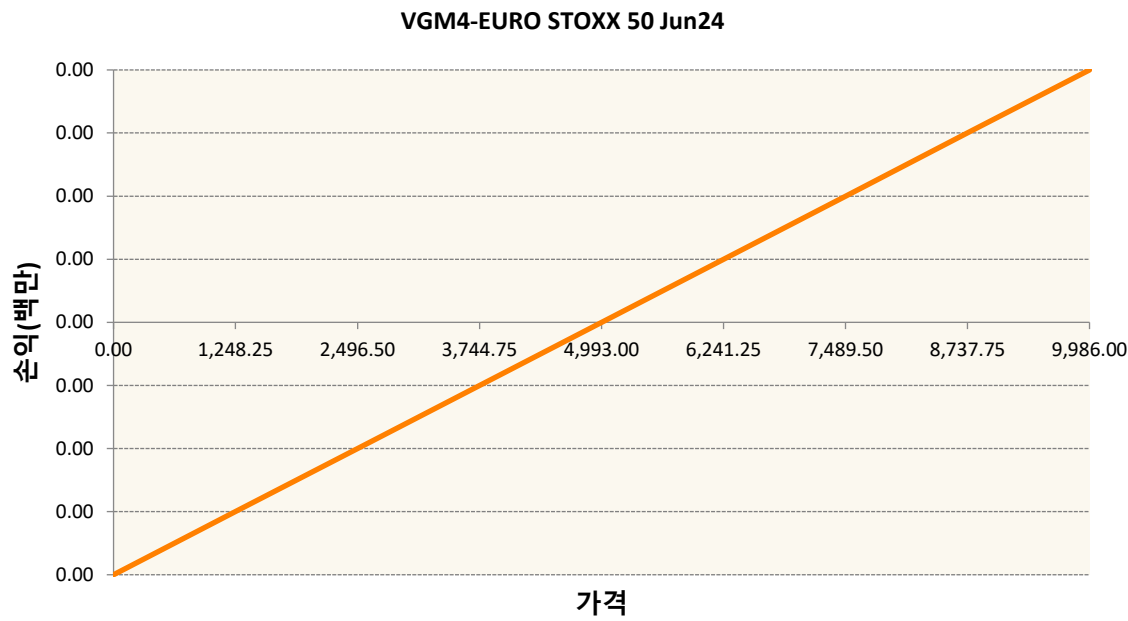
유로인덱스모(주식-파생형)

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	932	0	932	
누계	통화	선도	225	0	225	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213E3K(EUR/KRW 21-06-24E	18
VGM4 EURO STOXX 50 Jun24	75

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

(단위:백만원)

59

공시일	2024-06-03
기준일	2024-05-31

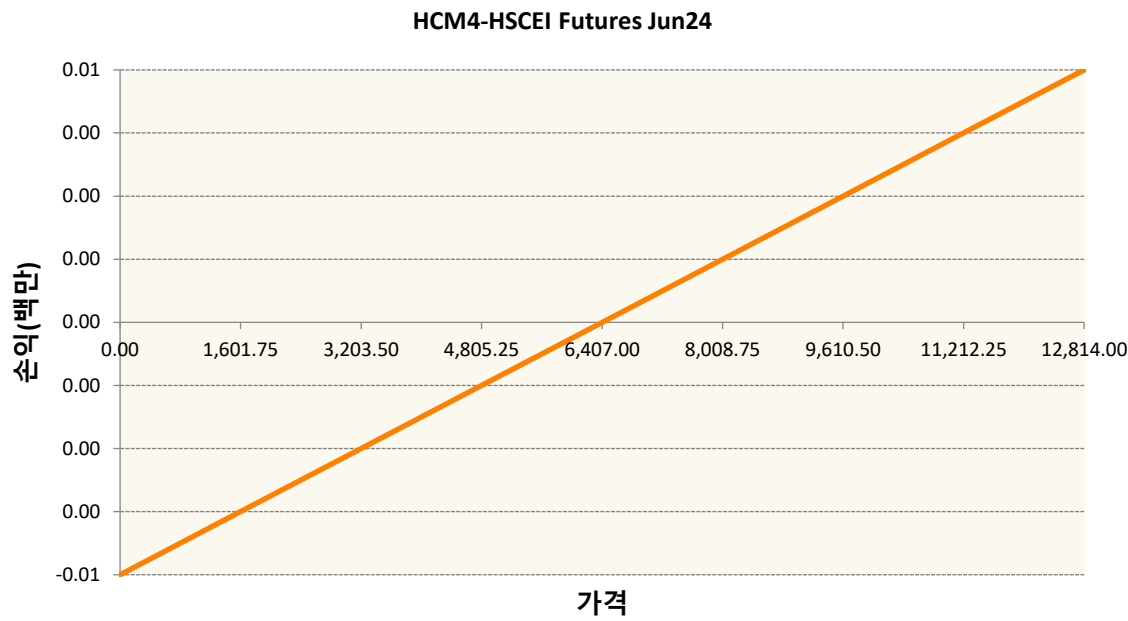
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,398	0	1,398	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCM4	HSCEI Futures Jun24	112
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

139

공시일	2024-06-03
기준일	2024-05-31

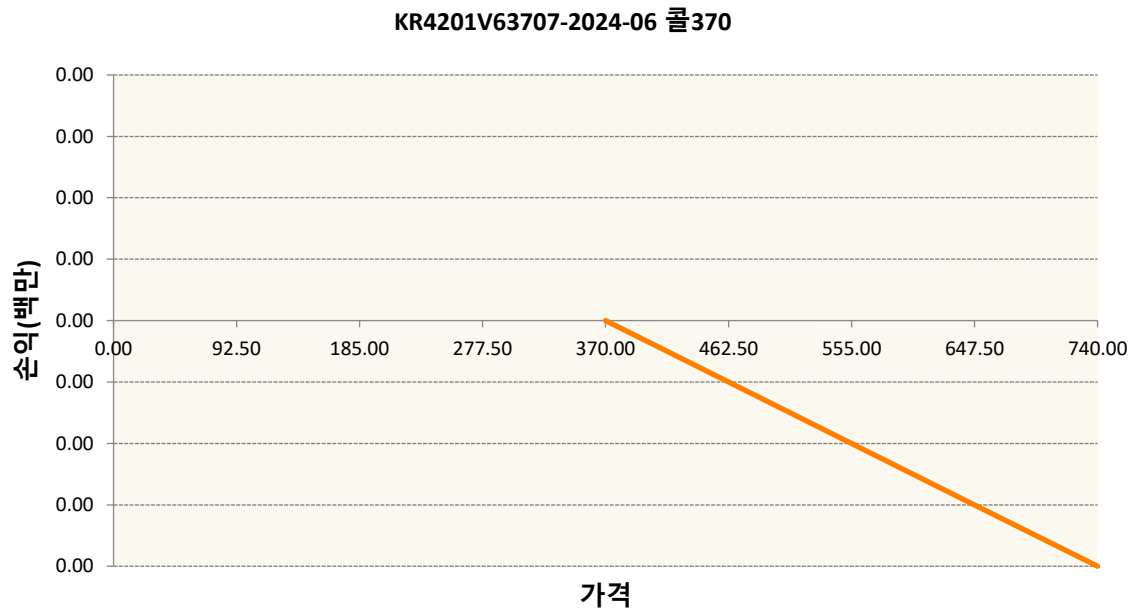
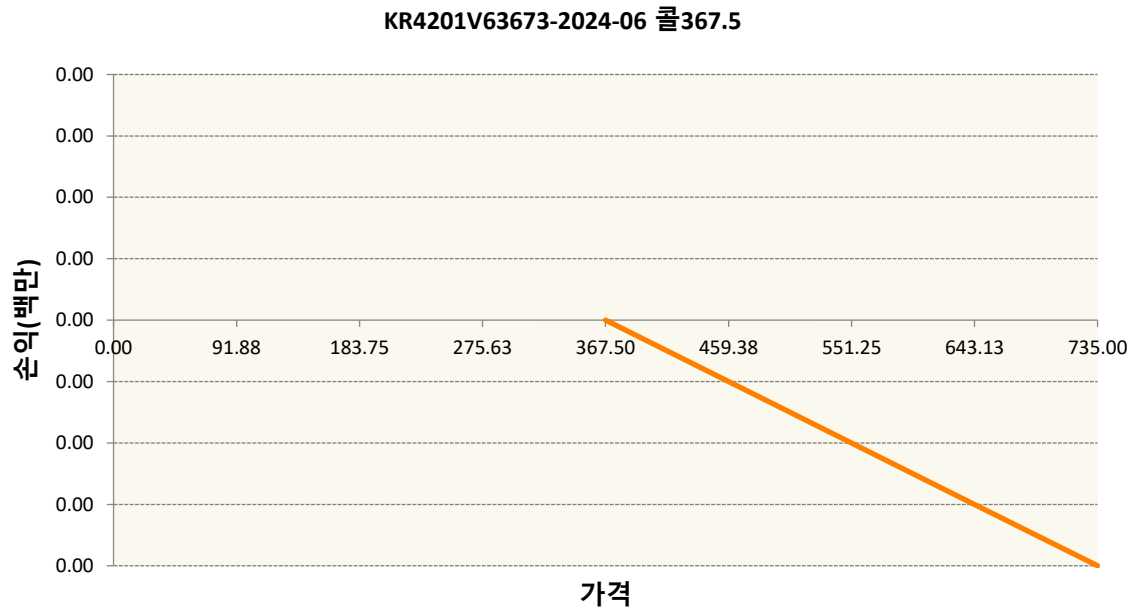
커버드콜모(주식혼합-파생형)

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	46,841	-46,841	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 735.00. The y-axis, labeled '손익(백만)' (Profit/Loss in millions), ranges from 0.00 to 0.00. An orange line starts at the origin (0, 0) and extends to the point (367.50, 0.00).

가격	손익(백만)
0.00	0.00
91.88	0.00
183.75	0.00
275.63	0.00
367.50	0.00
459.38	0.00
551.25	0.00
643.13	0.00
735.00	0.00

The graph illustrates a linear relationship between price and net income. The x-axis, labeled '가격' (Price), ranges from 0.00 to 740.00. The y-axis, labeled '순이익(백만)' (Net Income in millions), ranges from 0.00 to 0.00. An orange line starts at the origin (0, 0) and extends to the point (370, 0). The line is labeled with '0.00' at the origin and '0.00' at the point (370, 0).

(단위:백만원)

KR4201V63673				2024-06 콜367.5			736	
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	141	140	139	137	135	131	127	
-5.33%	138	135	131	125	118	109	99	
-2.67%	121	111	100	87	73	57	41	
0%	60	41	21	0	-21	-43	-65	
2.67%	-84	-109	-133	-157	-181	-205	-229	
5.33%	-329	-349	-369	-390	-411	-433	-455	
8.00%	-651	-661	-674	-687	-703	-719	-736	
KR4201V63707				2024-06 콜370			1,131	
	기초자산의 변동성							

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	187	186	185	183	180	175	169
-5.33%	184	181	175	168	158	147	133
-2.67%	166	153	137	119	98	76	52
0%	90	62	31	0	-33	-66	-100
2.67%	-108	-147	-187	-226	-266	-306	-345
5.33%	-469	-504	-541	-578	-615	-653	-691
8.00%	-970	-991	-1,015	-1,042	-1,070	-1,100	-1,131
KR4301V63671 2024-06 풋367.5							545

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-545	-545	-545	-545	-545	-545	-545
-5.33%	-354	-354	-354	-354	-355	-355	-356
-2.67%	-164	-165	-166	-168	-170	-172	-175
0%	15	10	5	0	-6	-12	-18
2.67%	145	137	129	122	114	106	99
5.33%	199	195	190	184	179	173	167
8.00%	210	209	207	205	203	200	197

KR4301V63705 2024-06 풋370							69
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-69	-69	-69	-69	-69	-69	-69
-5.33%	-45	-45	-45	-45	-45	-45	-46
-2.67%	-22	-22	-22	-22	-22	-22	-23
0%	1	1	1	0	-1	-1	-2
2.67%	20	19	18	17	16	15	14
5.33%	29	28	27	27	26	25	24
8.00%	31	31	31	30	30	30	29

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

(단위:백만원)

2,402

공시일	2024-06-03
기준일	2024-05-31

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	1,180	0	1,180	

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	2024-06-03
기준일	2024-05-31

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	4,336	0	4,336	

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	2024-06-03
기준일	2024-05-31

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	15,160	0	15,160	
누계	통화	선도	0	15,209	-15,209	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213E3TC KRW/USD 28-06-24E	426
FXW213E4SC KRW/USD 31-07-24E	198
FXW213E5W KRW/USD 30-08-24E	593
IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

567

공시일	2024-06-03
기준일	2024-05-31

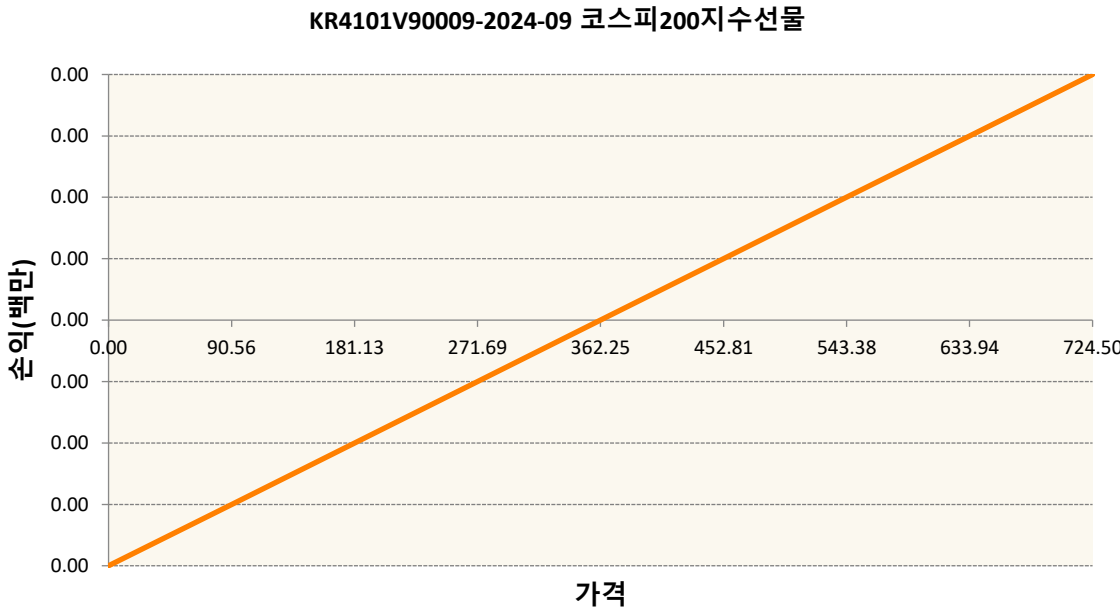
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

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	996	0	996	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101V90009			2024-09 코스피200지수선물				79
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-79	-79	-79	-79	-79	-79	-79
-5.33%	-53	-53	-53	-53	-53	-53	-53
-2.67%	-26	-26	-26	-26	-26	-26	-26
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	26	26	26	26	26	26	26
5.33%	53	53	53	53	53	53	53
8.00%	79	79	79	79	79	79	79

공시일	2024-06-03
기준일	2024-05-31

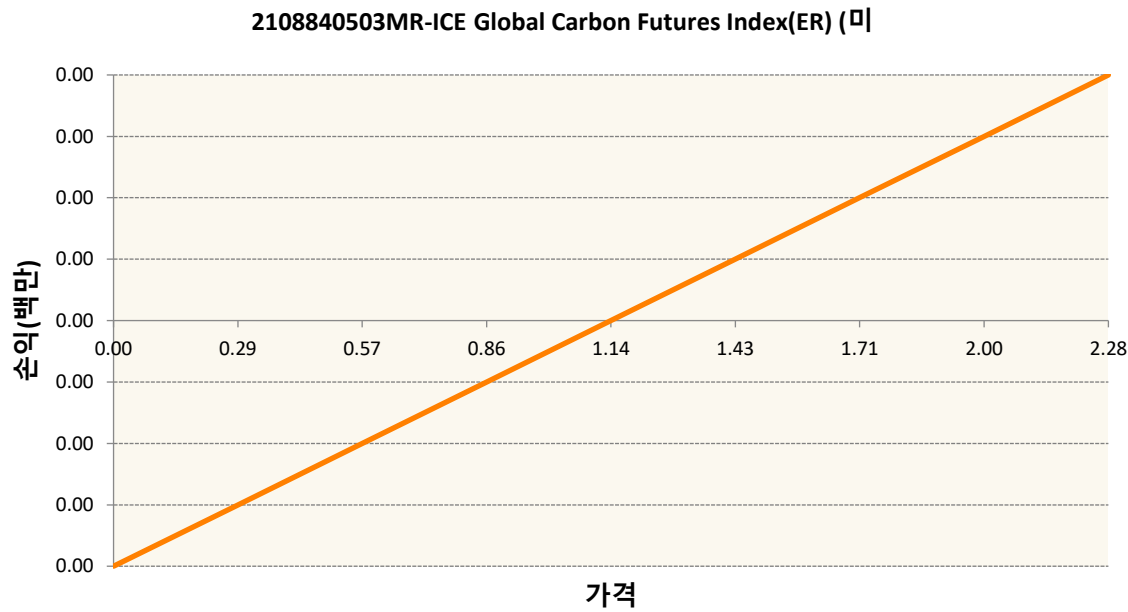
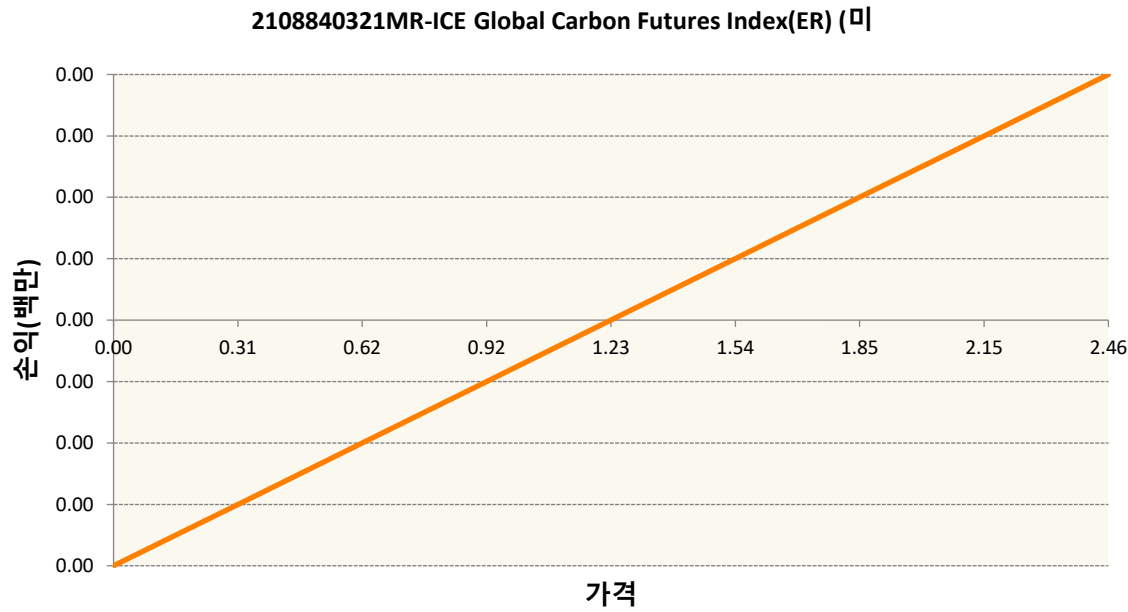
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

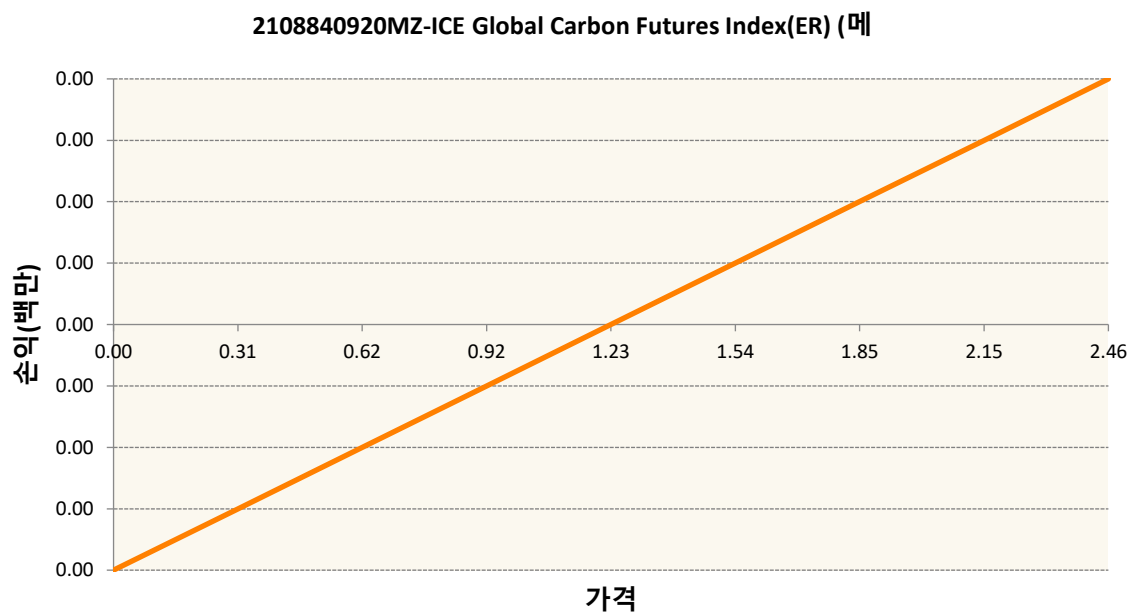
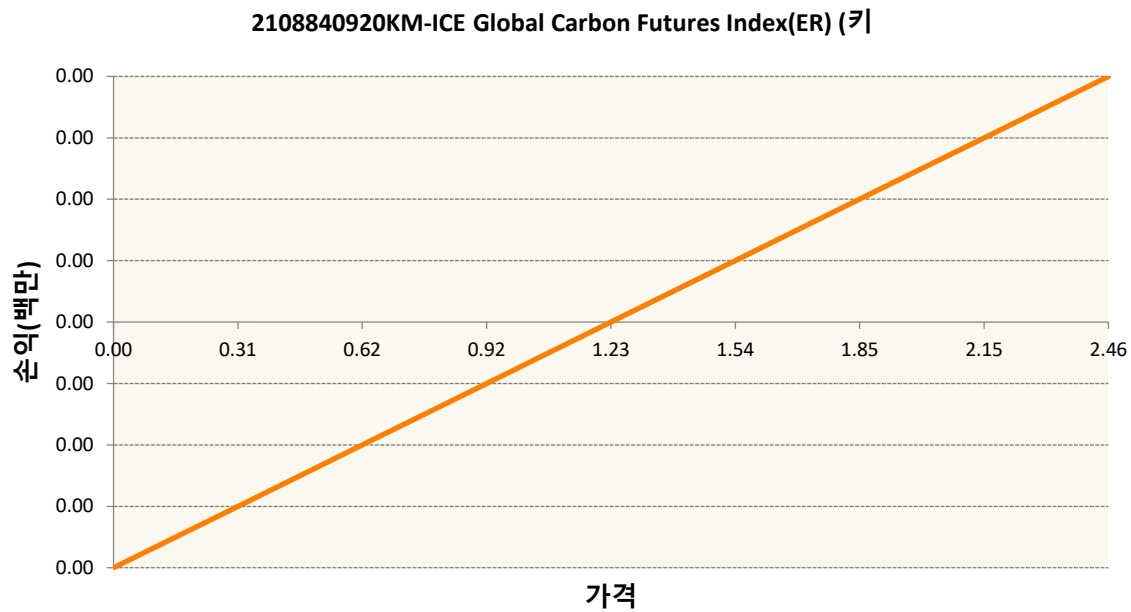
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	25,350	0	25,350	

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108840321IICE Global Carbon Futures Index(ER) (미)		532
2108840503IICE Global Carbon Futures Index(ER) (미)		213
2108840920IICE Global Carbon Futures Index(ER) (키)		1,063
2108840920IICE Global Carbon Futures Index(ER) (메)		213

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	2,369

공시일	2024-06-03
기준일	2024-05-31

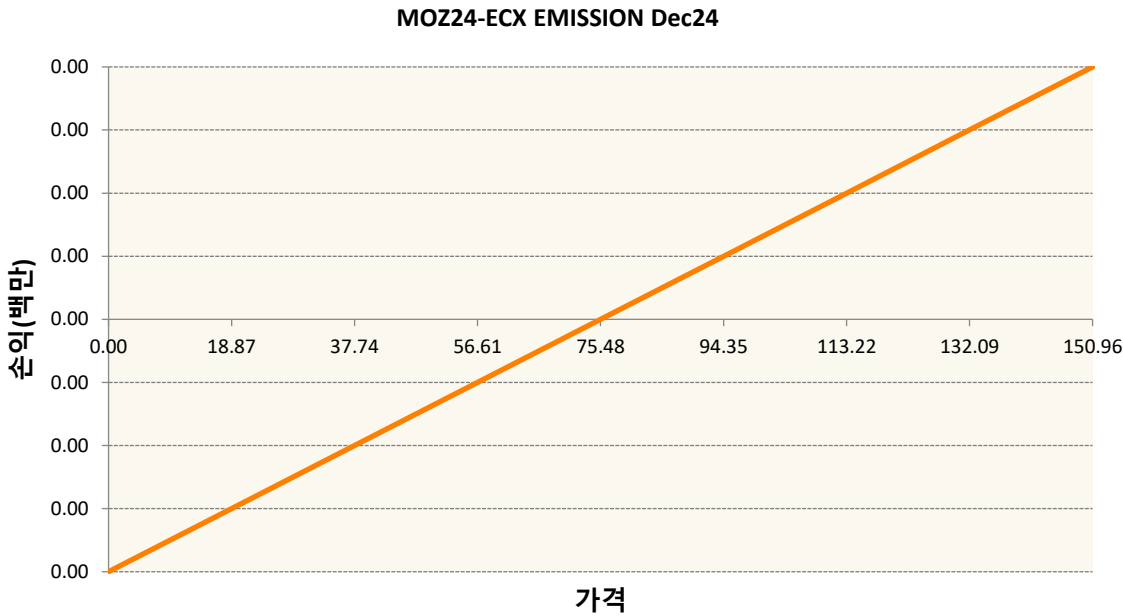
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	10,181	0	10,181	
누계	지수	스왑	331	0	331	장외
누계	통화	선도	0	2,307	-2,307	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213E5W KRW/EUR 28-06-24E	86
FXW213E5W KRW/EUR 28-06-24E	99
MOZ24 ECX EMISSION Dec24	814
SWICEUACN ICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX	6

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

(단위:백만원)

1,581

공시일	2024-06-03
기준일	2024-05-31

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	4,948	0	4,948	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI00000 신한CSI Index 230622 (미래)	10
SWCSI00000 신한CSI Index 230622 (메리츠)	10
SWCSI00000 신한CSI Index 230922 (키움)	6
SWCSI00000 신한CSI Index 231013 (NH)	6

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

(단위:백만원)

45

공시일	2024-06-03
기준일	2024-05-31

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	6,101	0	6,101	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(미래)	10
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(NH)	9
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(메리츠)	12
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(키움)	3

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

(단위:백만원)

37

공시일	2024-06-03
기준일	2024-05-31

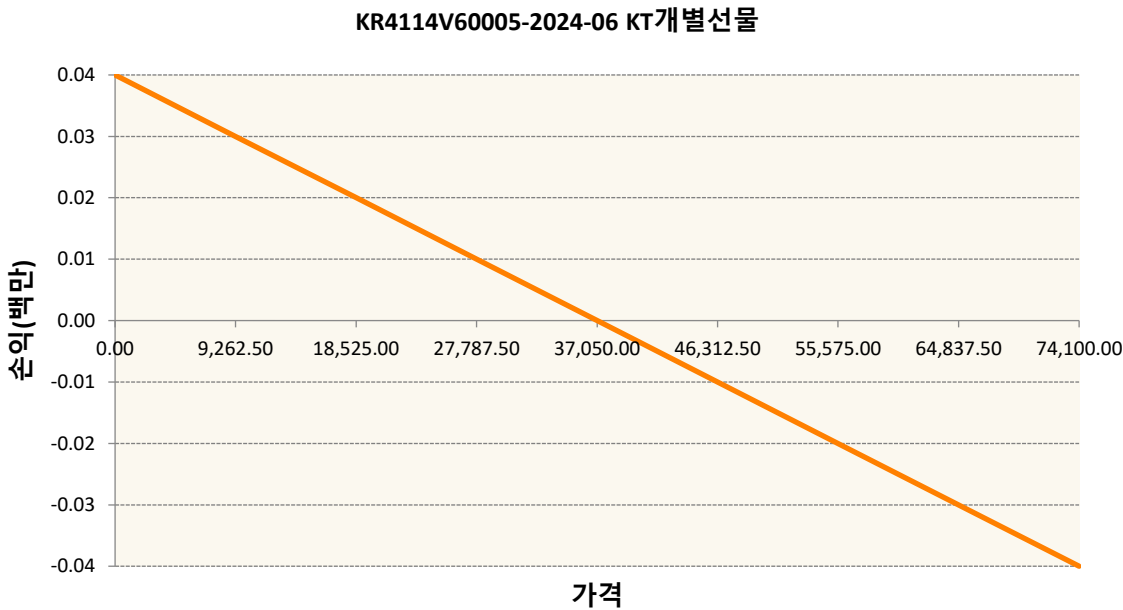
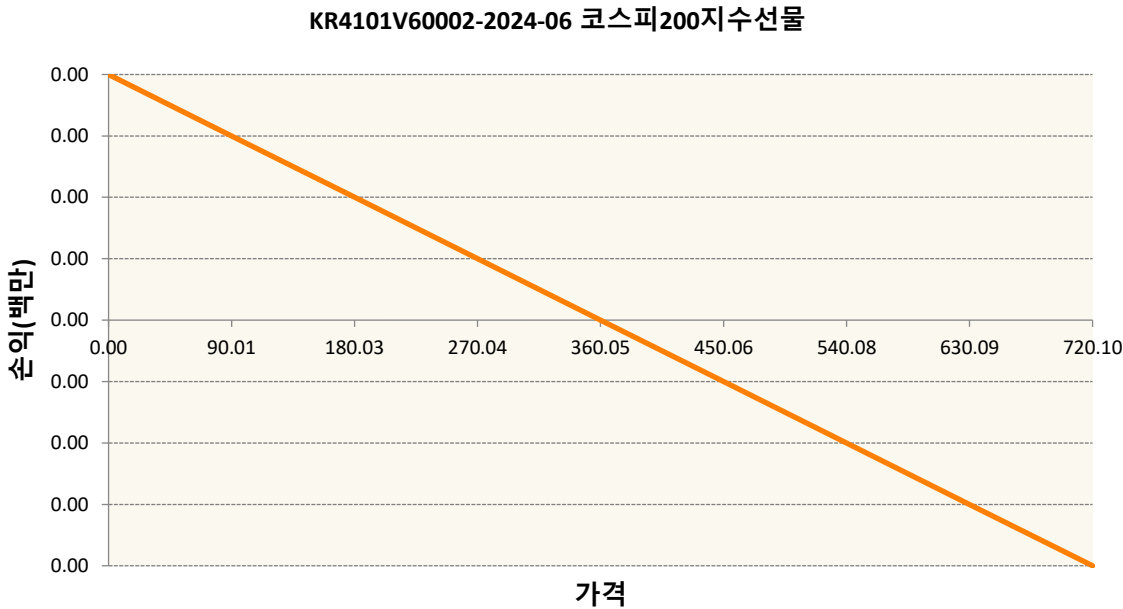
에퀴티알파일반사모혼합자산

1. 계약금액

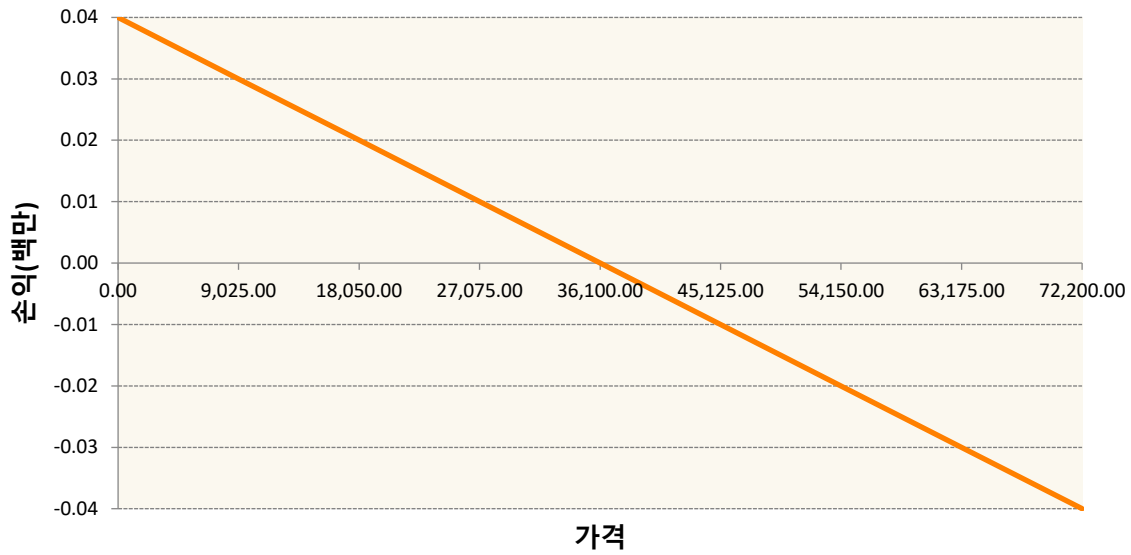
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	15	45	-31	장내
누계	유가증권	선물	20	445	-426	장내

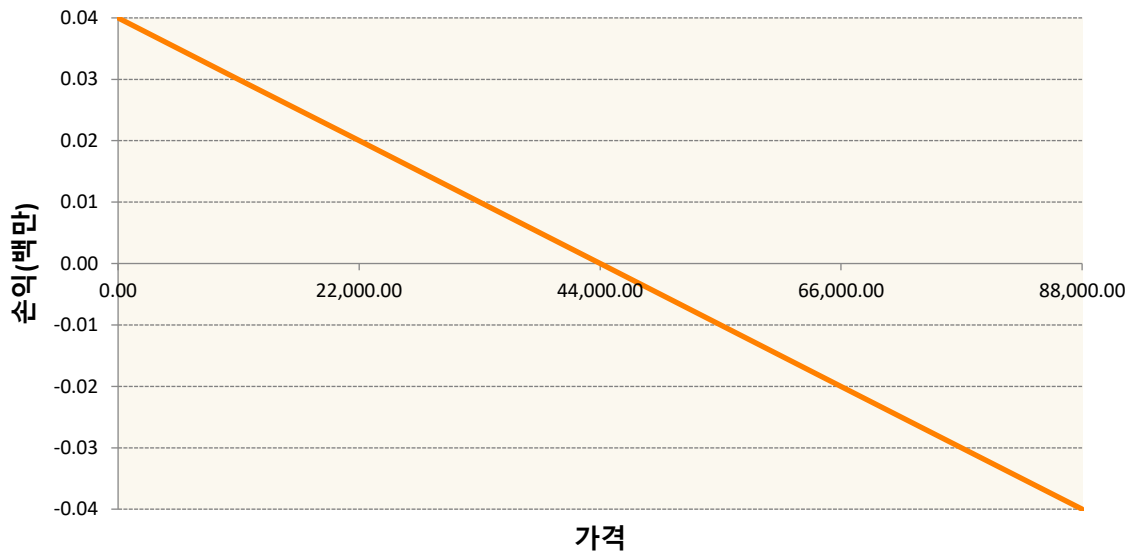
2. 만기시점의 손익구조



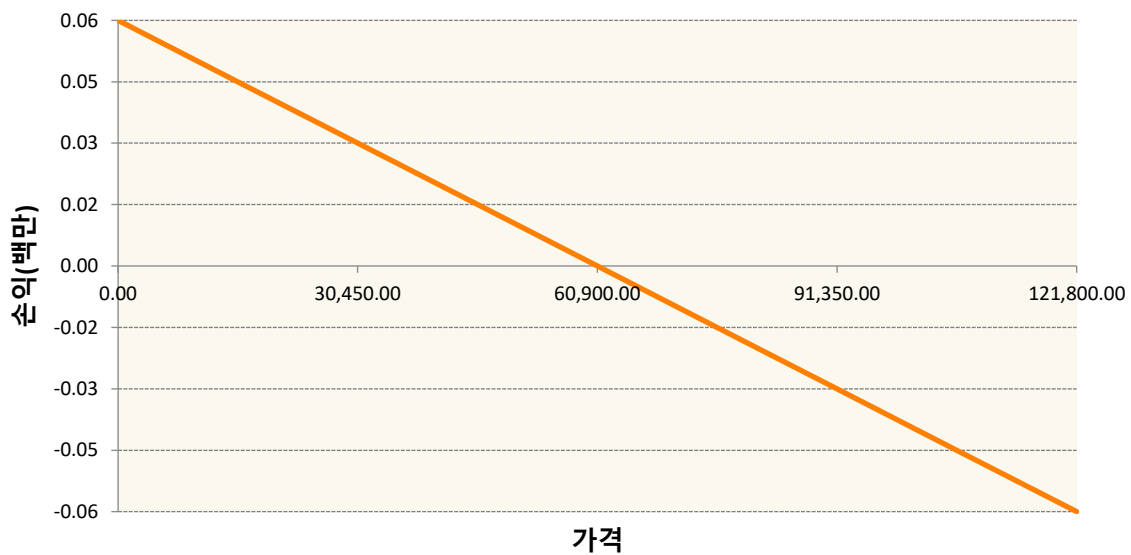
KR4117V60008-2024-06 삼성증권개별선물



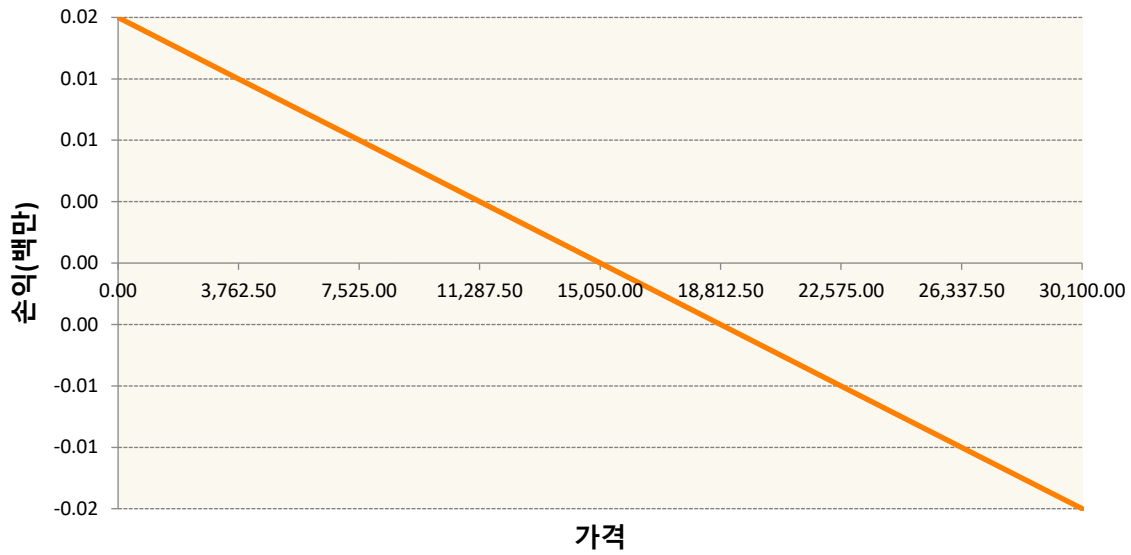
KR4135V60000-2024-06 GS개별선물



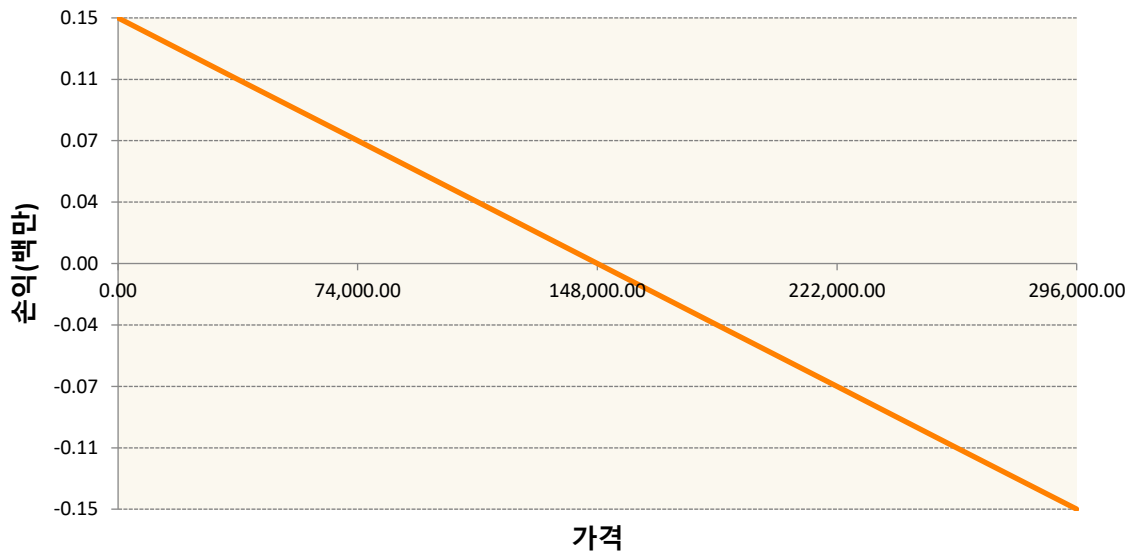
KR4154V60001-2024-06 이마트개별선물



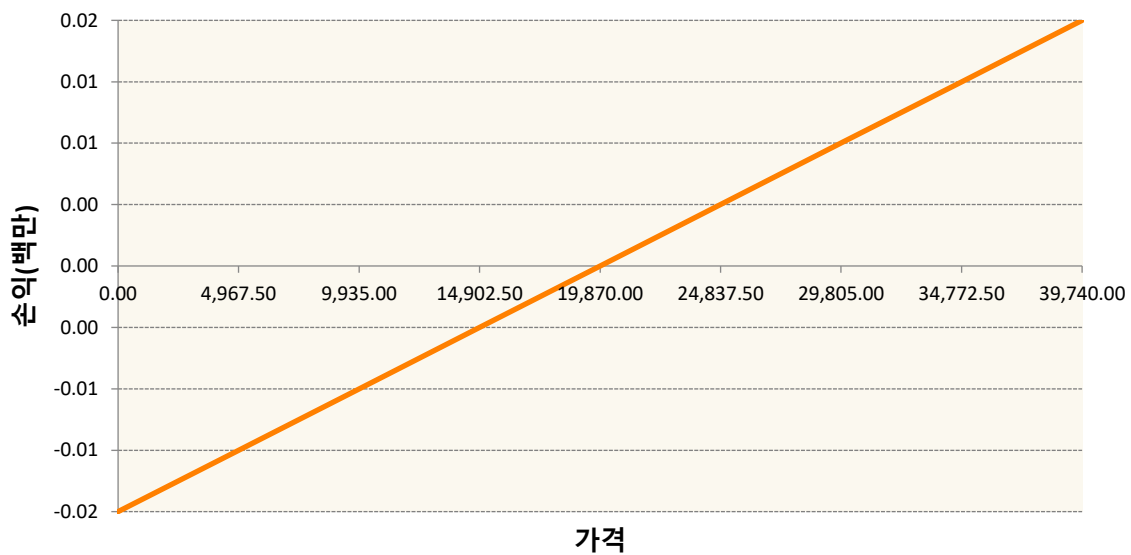
KR41BSV60002-2024-06 강원랜드개별선물



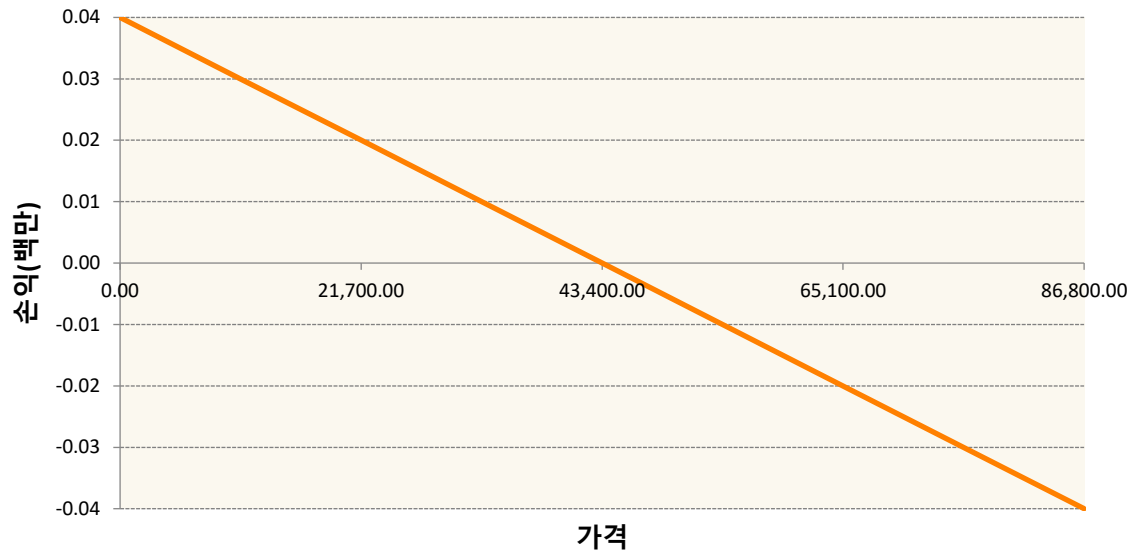
KR41C3V60005-2024-06 금호석유개별선물



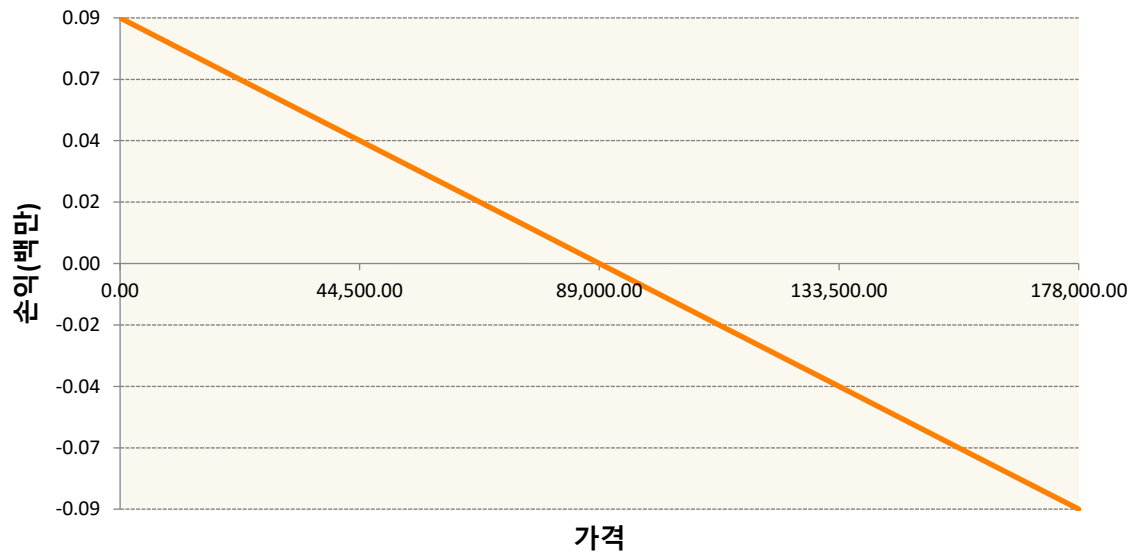
KR41D4V60002-2024-06 GS리테일개별선물



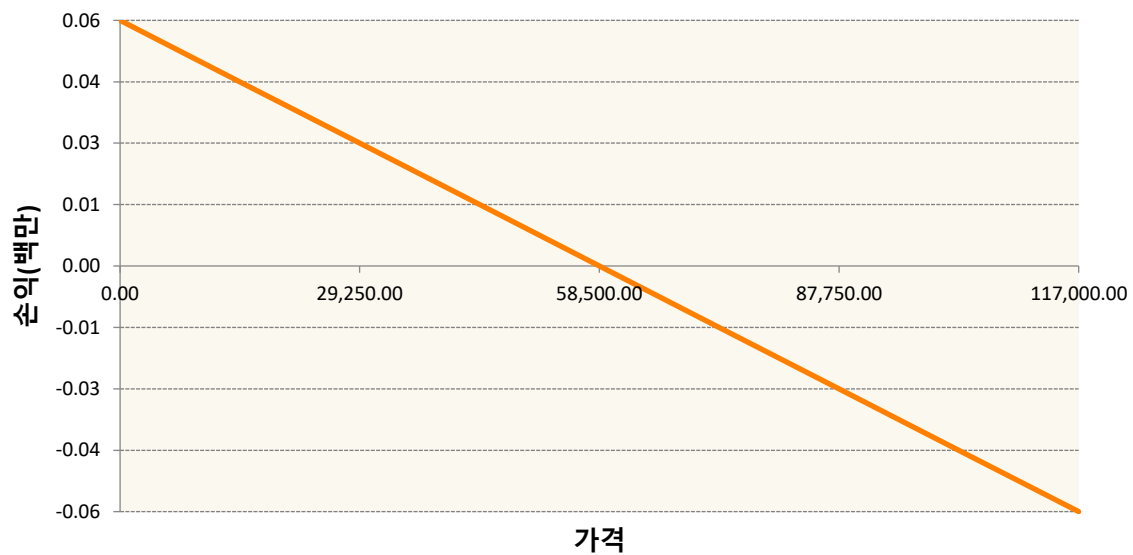
KR41DCV60002-2024-06 만도개별선물



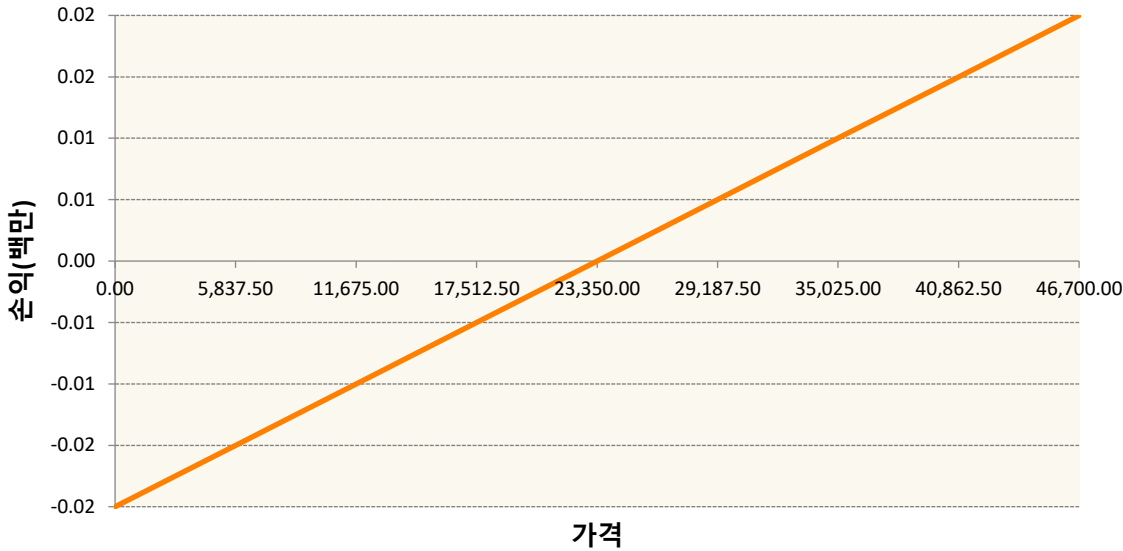
KR41DTV60006-2024-06 CJ ENM개별선물



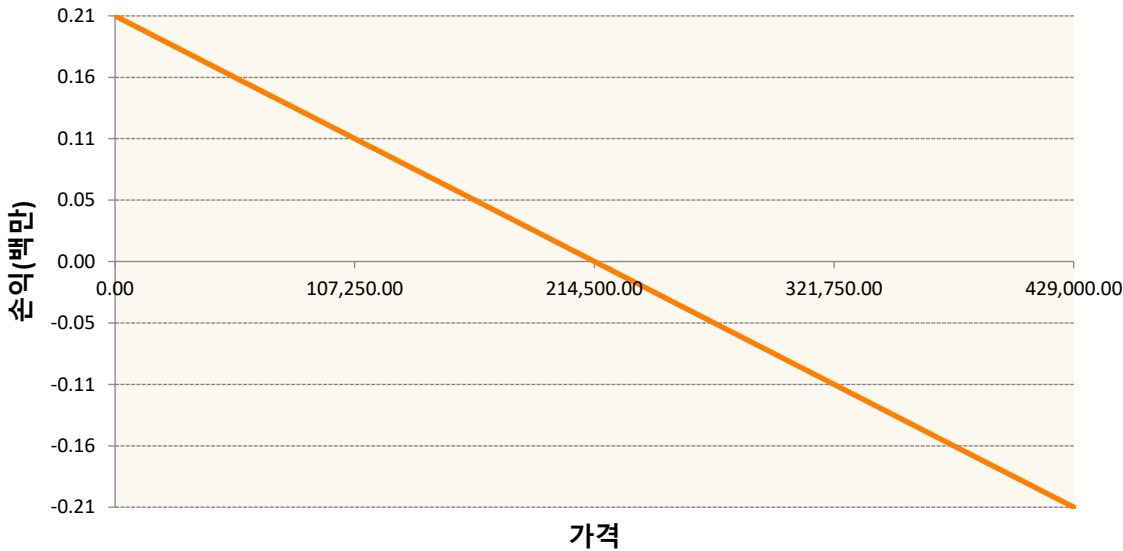
KR41DWV60000-2024-06 두산밥캣개별선물



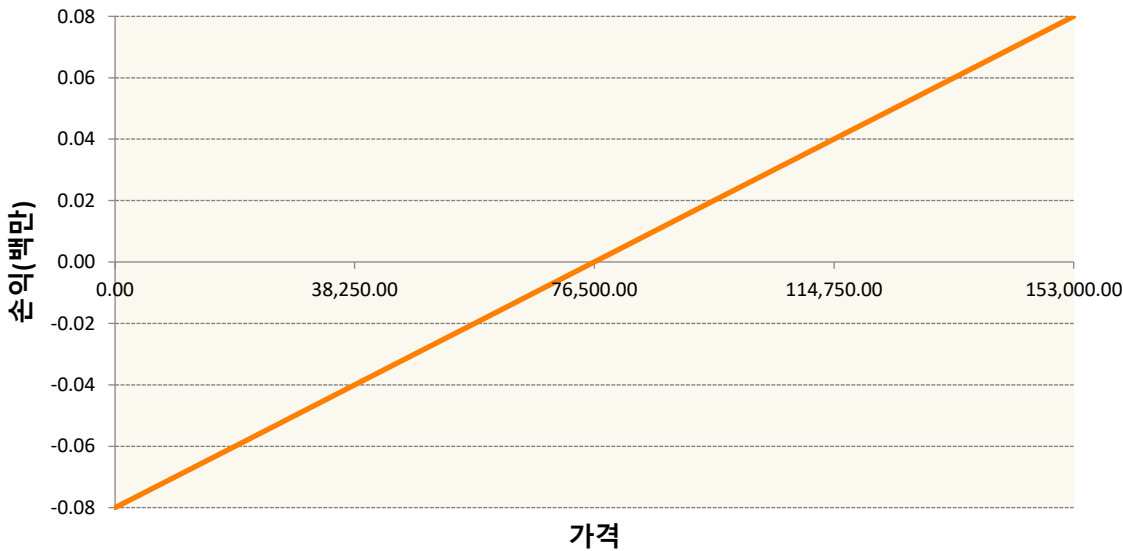
KR41DZV60003-2024-06 한세실업개별선물



KR41GLV60006-2024-06 LS ELECTRIC개별선물



KR41GNV60002-2024-06 금양개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
KR4101V600 2024-06 코스피200지수선물	29
KR4114V600 2024-06 KT개별선물	0.47
KR4117V600 2024-06 삼성증권개별선물	0.49
KR4135V600 2024-06 GS개별선물	1
KR4154V600 2024-06 이마트개별선물	1
KR41BSV600 2024-06 강원랜드개별선물	0.48
KR41C3V600 2024-06 금호석유개별선물	1
KR41D4V600 2024-06 GS리테일개별선물	1
KR41DCV600 2024-06 만도개별선물	1
KR41DTV600 2024-06 CJ ENM개별선물	1
KR41DWV600 2024-06 두산밥캣개별선물	1
KR41DZV600 2024-06 한세실업개별선물	1
KR41GLV600 2024-06 LS ELECTRIC개별선물	0.34
KR41GNV600 2024-06 금양개별선물	0.37

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

공시일	2024-06-03
기준일	2024-05-31

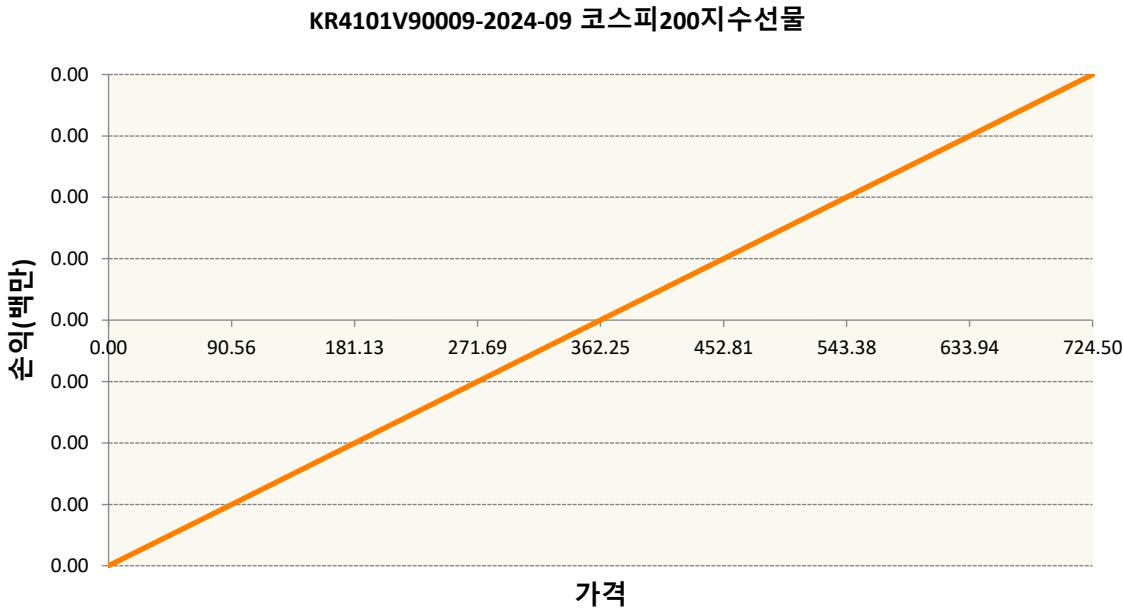
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	2,713	0	2,713	장내
누계	유가증권	선물	9,056	0	9,056	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101V90009		2024-09 코스피200지수선물					716
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-716	-716	-716	-716	-716	-716	-716
-5.33%	-478	-478	-478	-478	-478	-478	-478
-2.67%	-239	-239	-239	-239	-239	-239	-239
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	239	239	239	239	239	239	239
5.33%	478	478	478	478	478	478	478
8.00%	716	716	716	716	716	716	716

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

(단위:백만원)

699

공시일	2024-06-03
기준일	2024-05-31

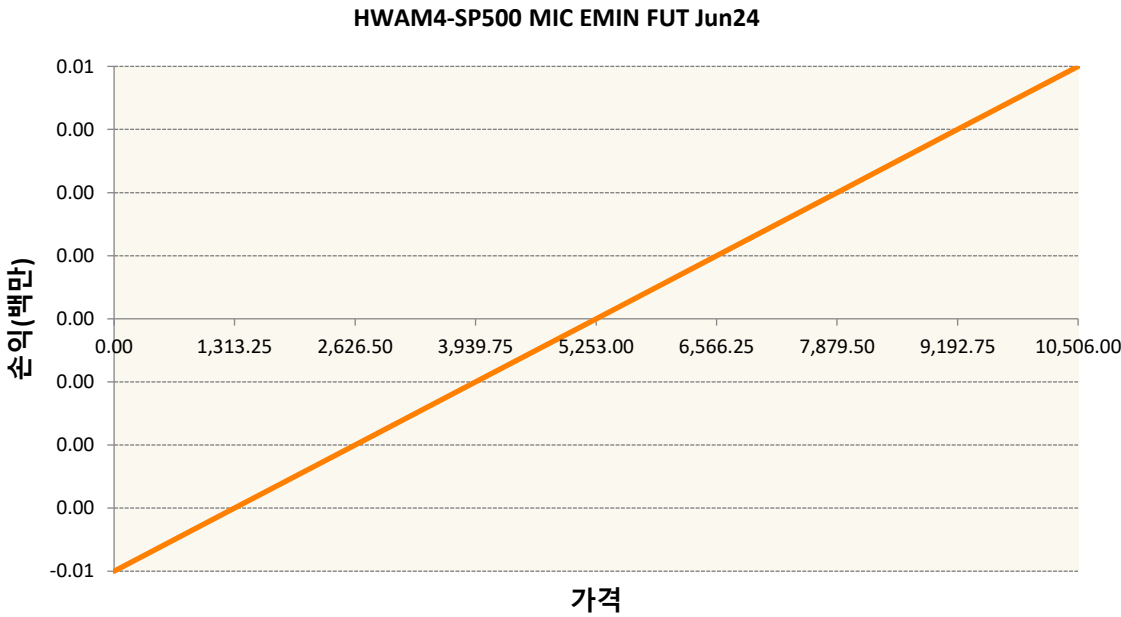
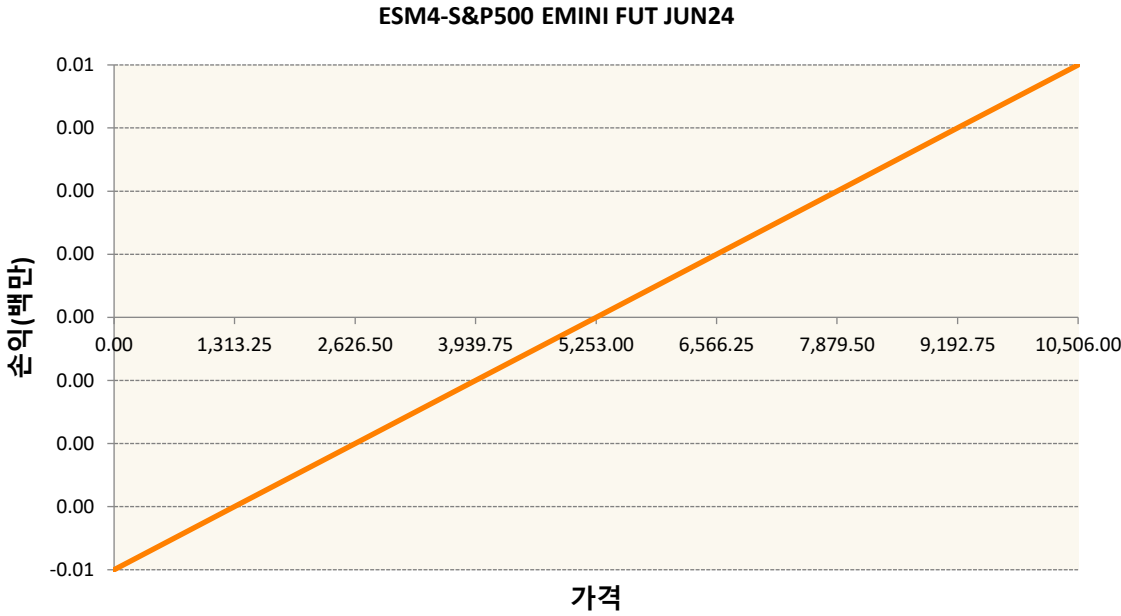
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

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	6,310	0	6,310	
누계	유가증권	선물	2,419	0	2,419	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESM4	S&P500 EMINI FUT JUN24	505
HWAM4	SP500 MIC EMIN FUT Jun24	194

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	439

공시일	2024-06-03
기준일	2024-05-31

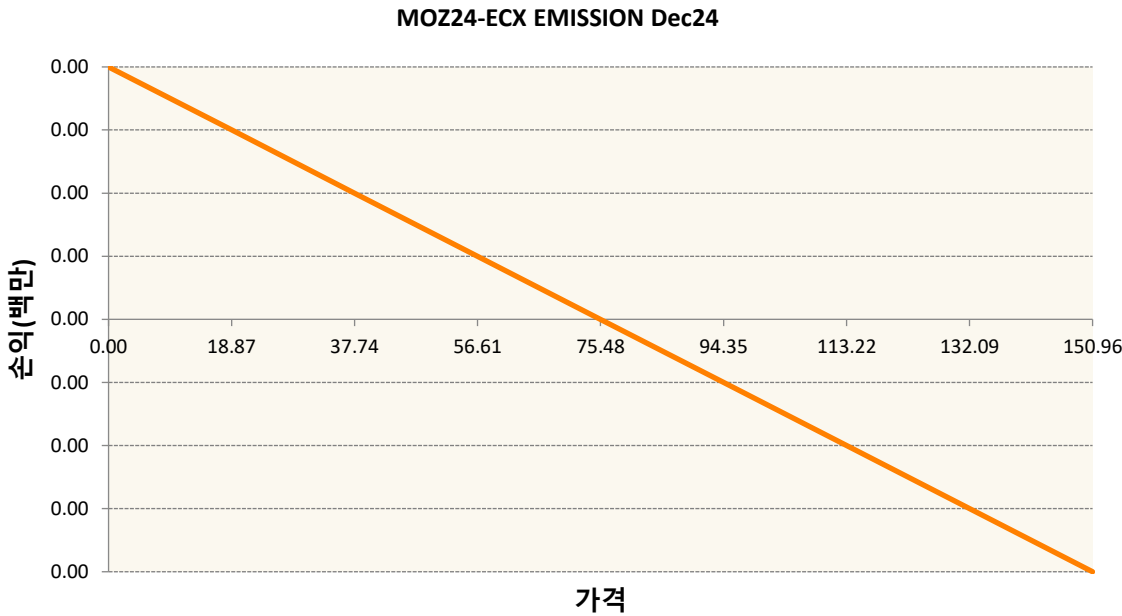
SOL유럽탄소배출권선물인버스ICE특별자산상

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	4,012	-4,012	
누계	지수	스왑	331	0	331	장외
누계	통화	선도	0	1,066	-1,066	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213E5W KRW/EUR 28-06-24E	85
MOZ24 ECX EMISSION Dec24	321
SWICEUACN ICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX	6

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

(단위:백만원)

637

공시일	2024-06-03
기준일	2024-05-31

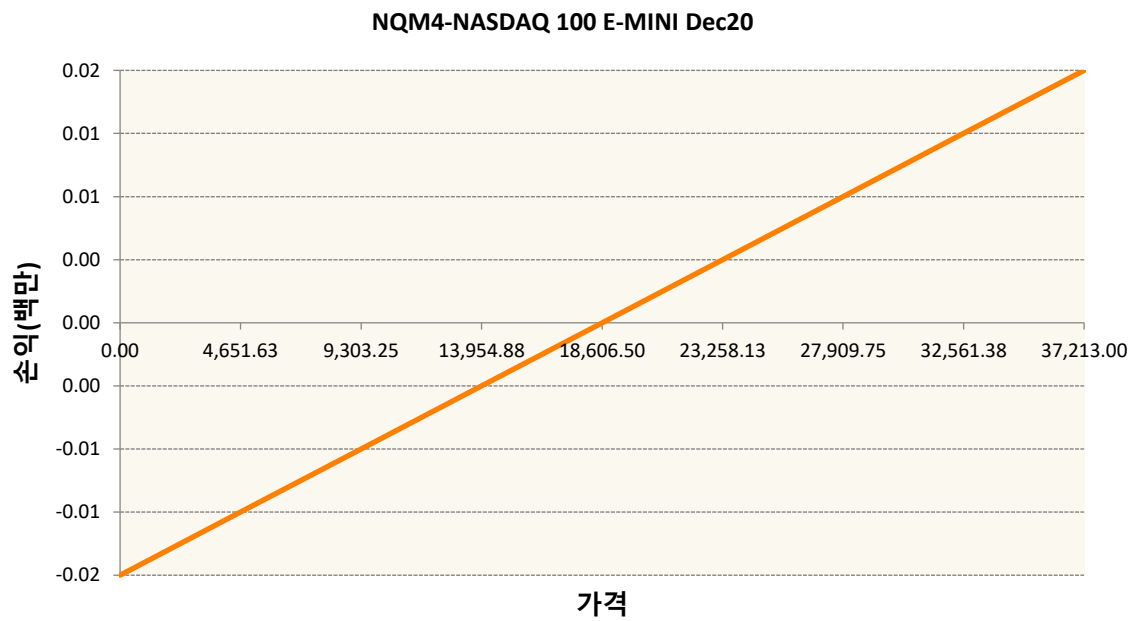
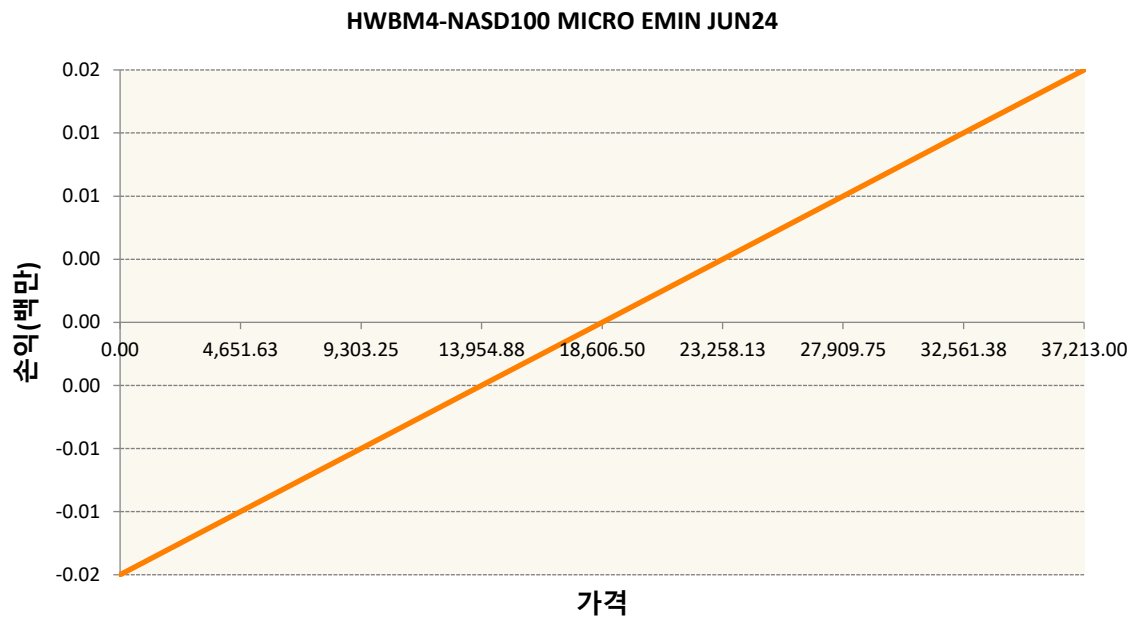
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

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	2,460	0	2,460	
누계	유가증권	선물	2,382	0	2,382	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
HWBM4	NASD100 MICRO EMIN JUN24		191
NQM4	NASDAQ 100 E-MINI Dec20		197

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)			(단위:백만원)
			290

공시일	2024-06-03
기준일	2024-05-31

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	165,244	0	165,244	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWKEDI0000 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	442
SWKEDI0000 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	953
SWKEDI0000 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	9,046
SWKEDI0000 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	2,751

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

(단위:백만원)

7,997

공시일	2024-06-03
기준일	2024-05-31

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	6
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	6
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	6
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	6

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

(단위:백만원)

27

공시일	2024-06-03
기준일	2024-05-31

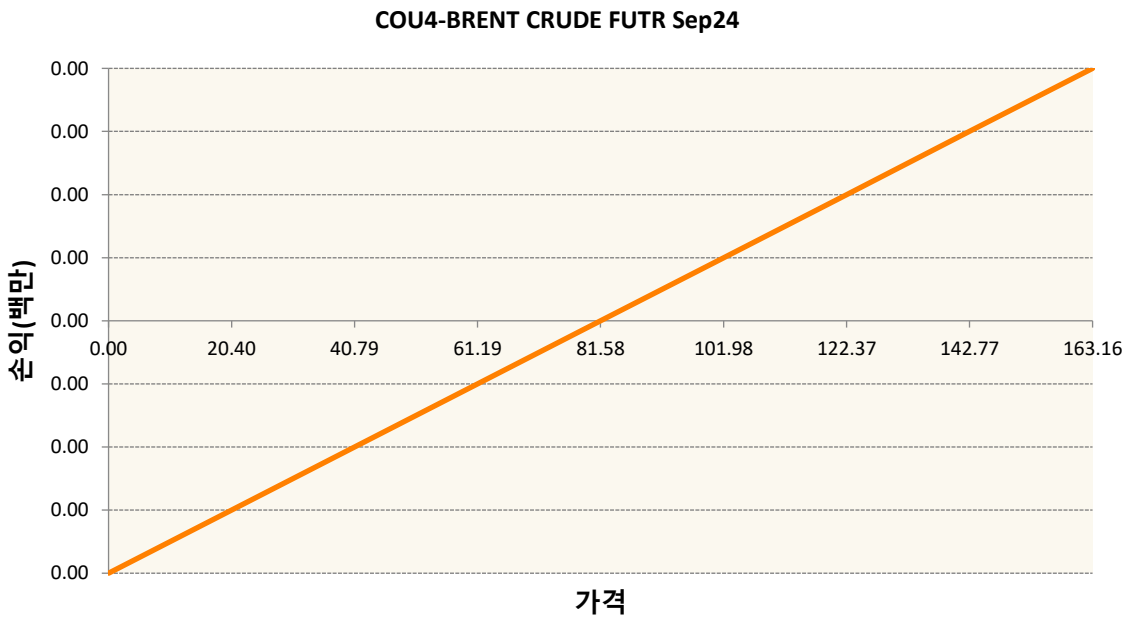
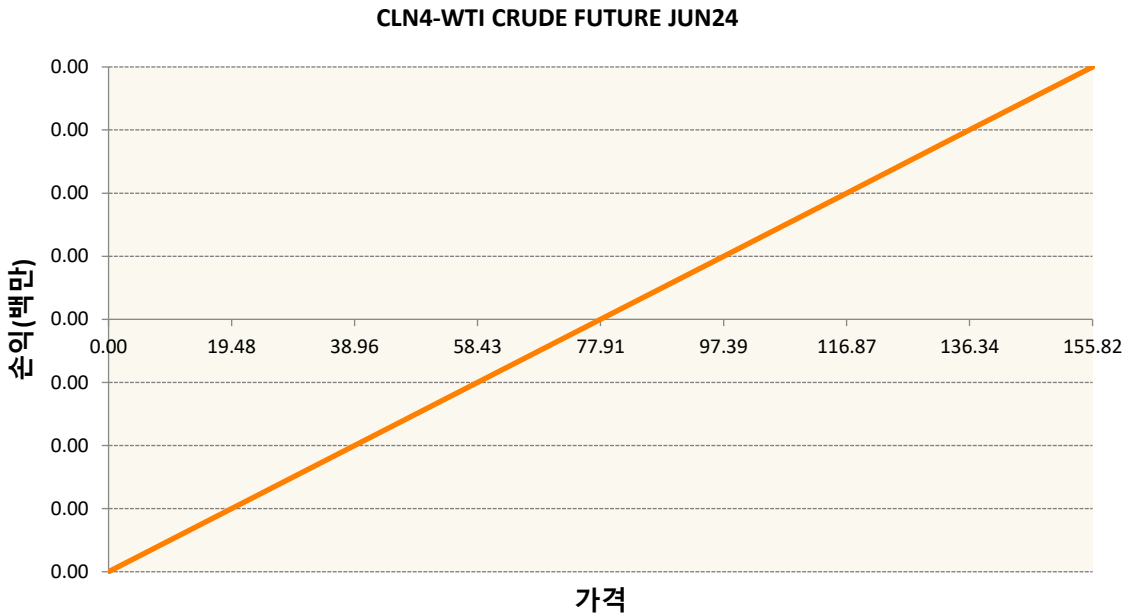
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

1. 계약금액

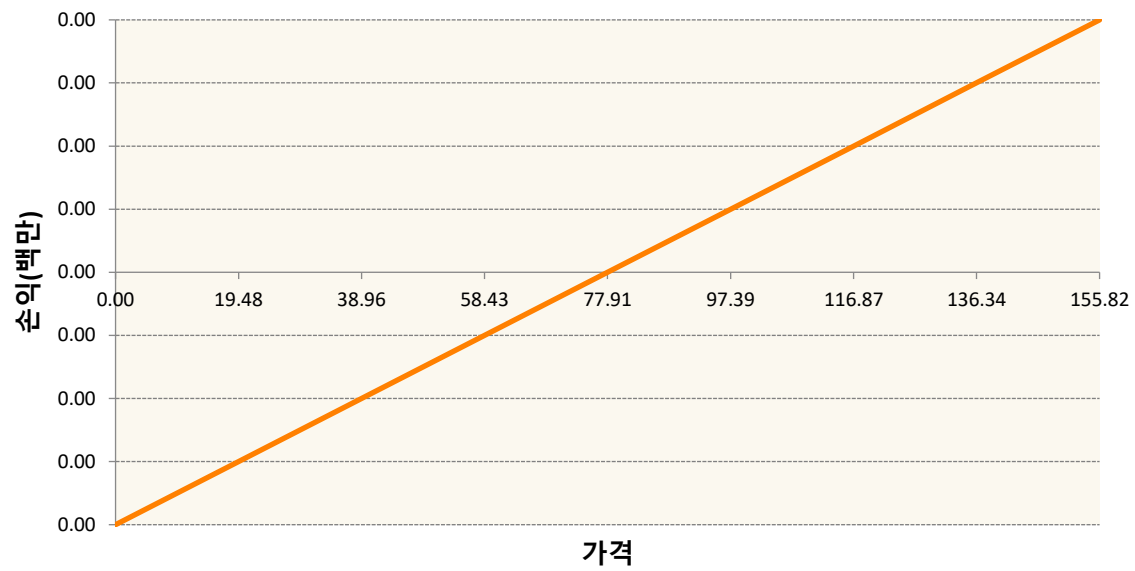
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	28	0	28	장내
누계	유가증권	선물	1,059	0	1,059	
누계	통화	선물	0	125	-125	장내

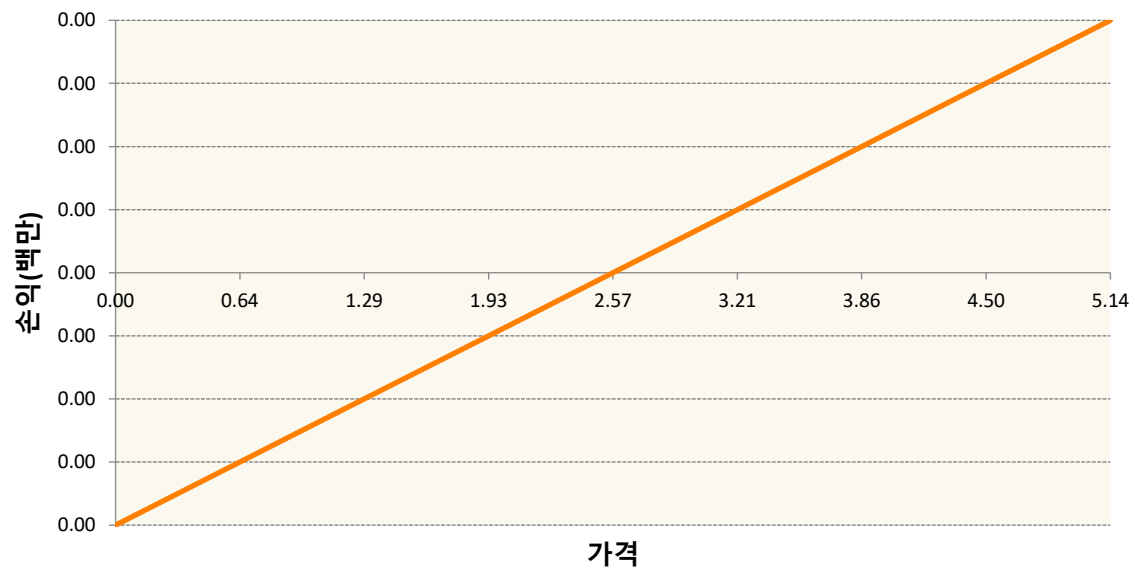
2. 만기시점의 손익구조



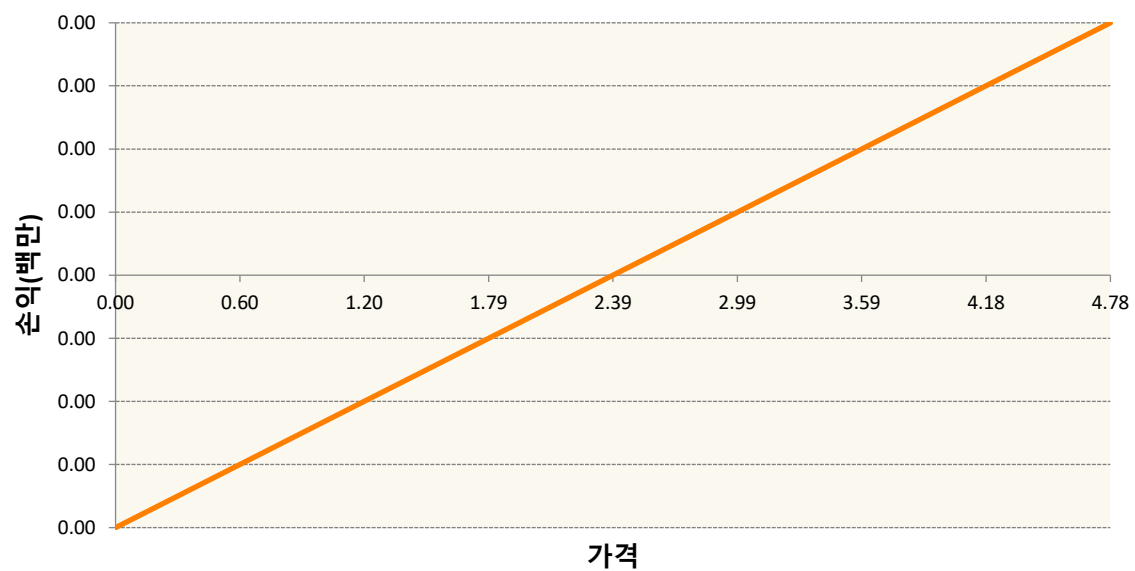
ECN4-E-mini Crude Oil Jul24



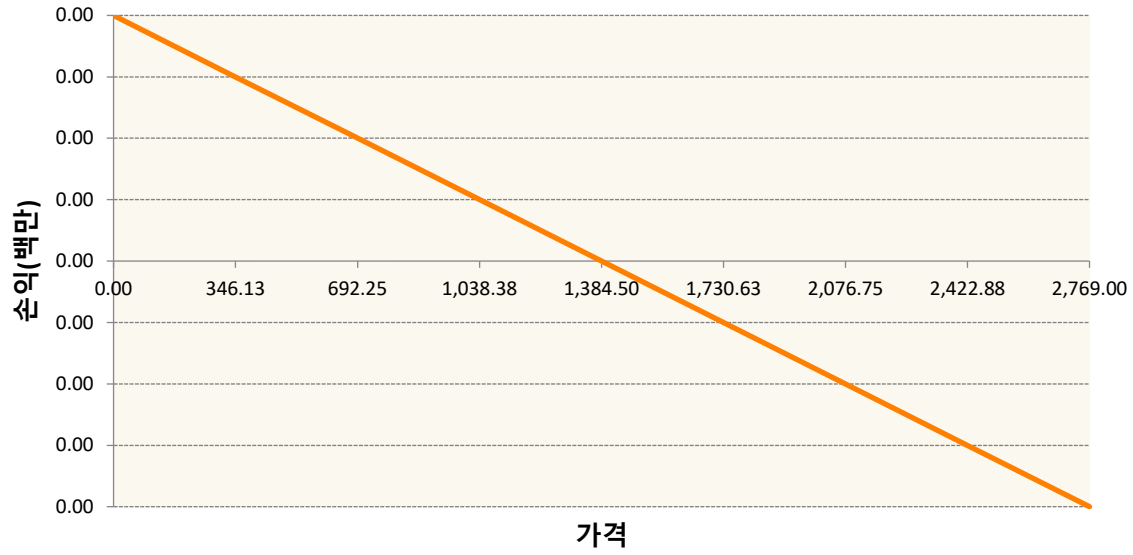
EON4-E-MINI NATURAL GAS Jul24



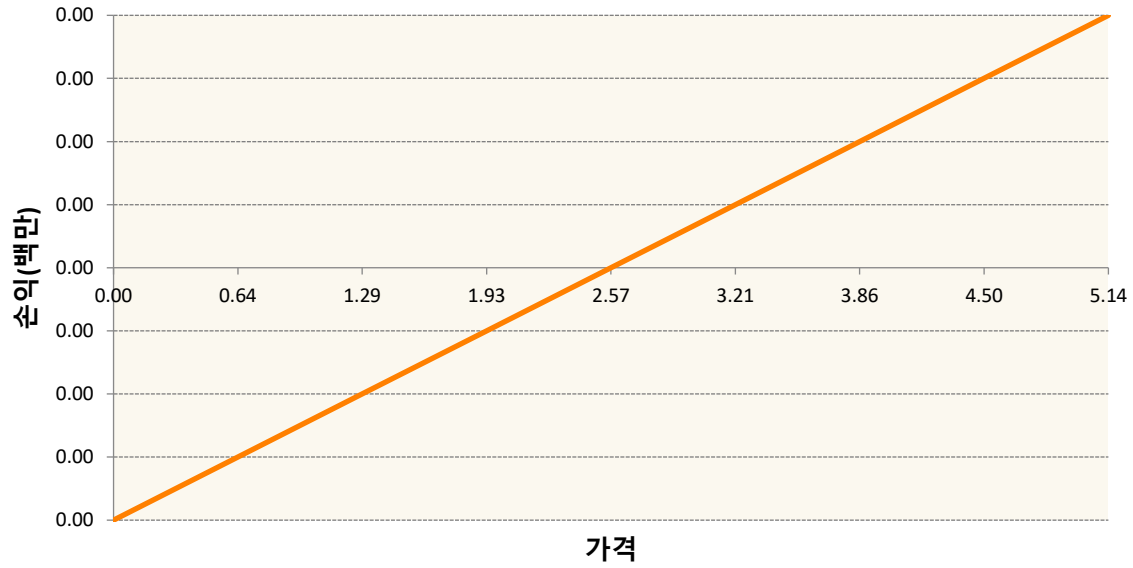
HON4-NY Harb ULSD Fut Jul24



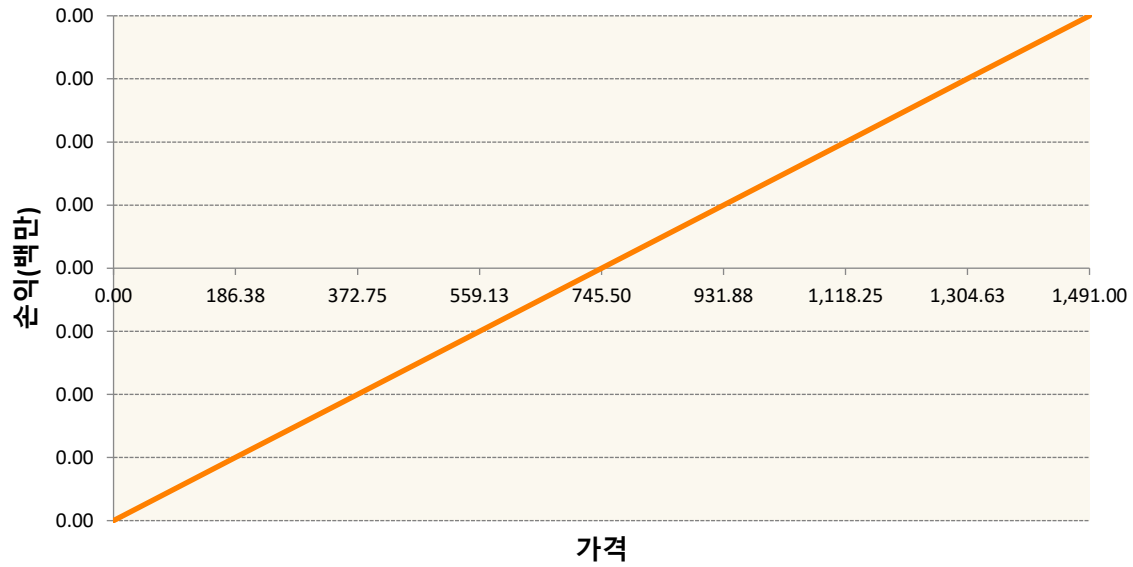
KR4175V60006-2024-06 달러선물

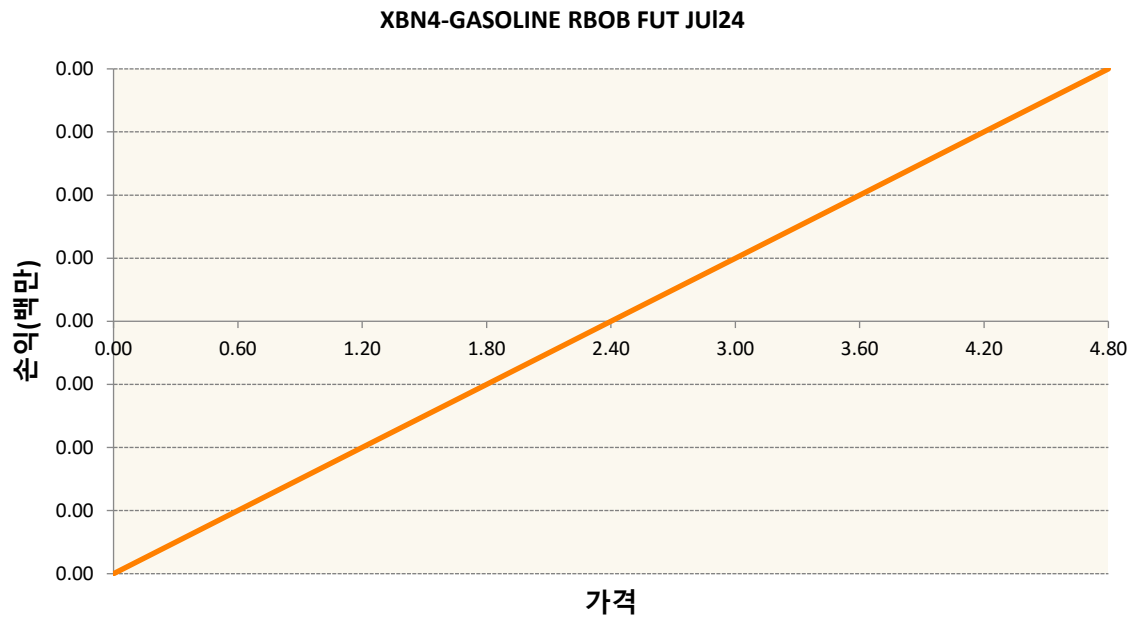


NGN24-NATURAL GAS FUTR JUL24



QSN4-Low Su Gasoil G JUL24





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
CLN4	WTI CRUDE FUTURE JUN24	8
COU4	BRENT CRUDE FUTR Sep24	27
ECN4	E-mini Crude Oil JUL24	4
EON4	E-MINI NATURAL GAS JUL24	1
HON4	NY Harb ULSD Fut Jul24	11
KR4175V600 2024-06 달러선물		10
NGN24	NATURAL GAS FUTR JUL24	14
QSN4	Low Su Gasoil G JUL24	8
XBN4	GASOLINE RBOB FUT JUL24	11

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	177