

공시일	2024-06-07
기준일	2024-06-05

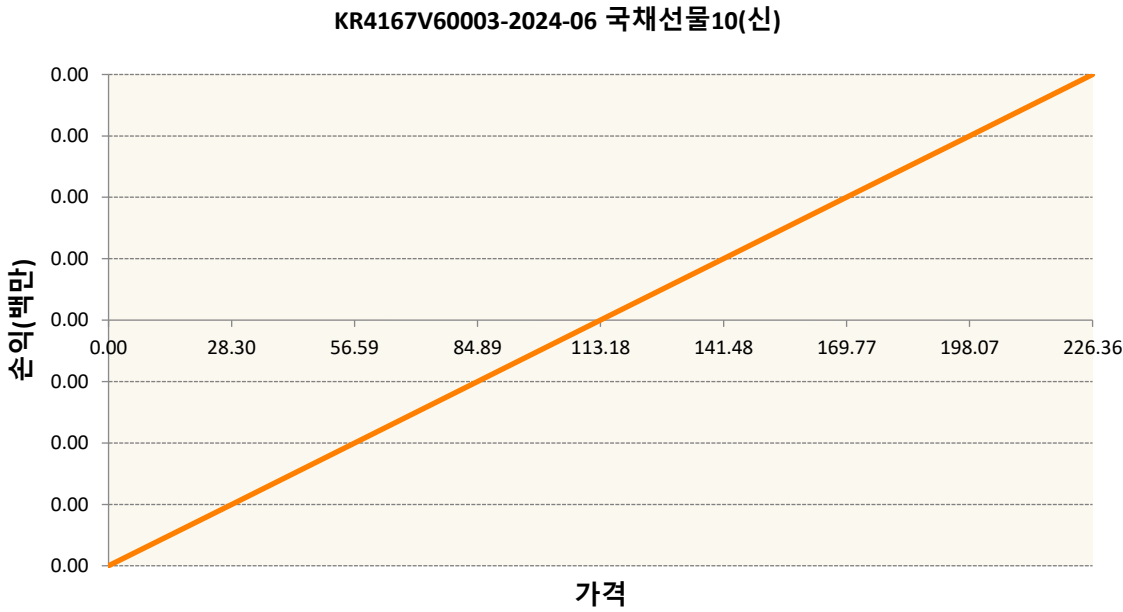
베스트장기채(채권-파생형)

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	45,272	0	45,272	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4167V600 2024-06 국채선물10(신)	3,622
------------------------------	-------

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

(단위:백만원)

1,355

공시일	2024-06-07
기준일	2024-06-05

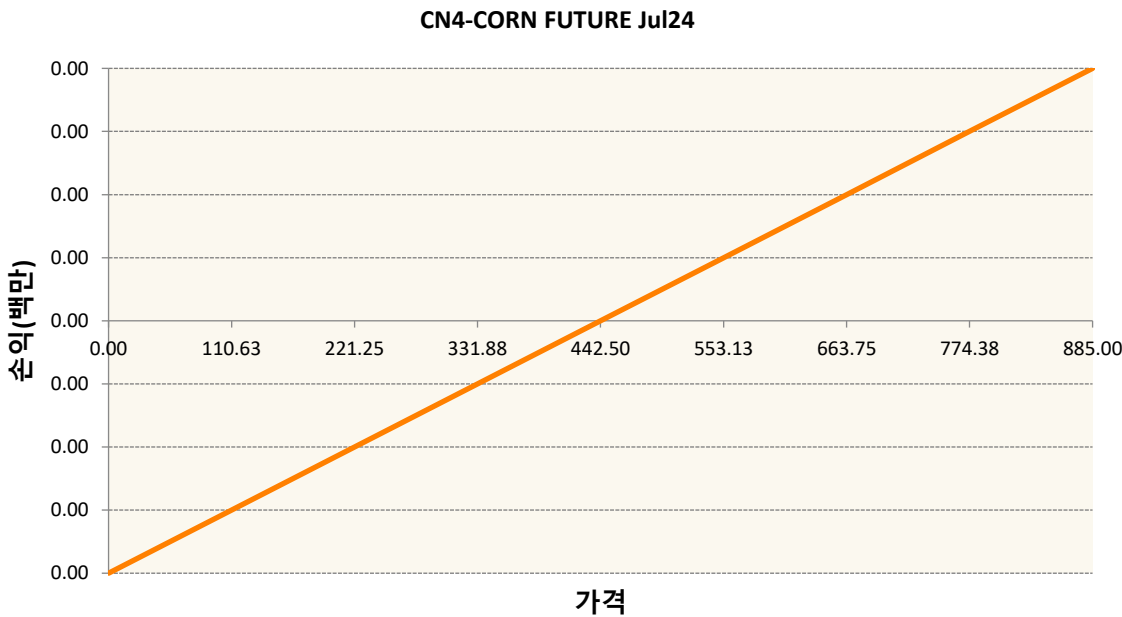
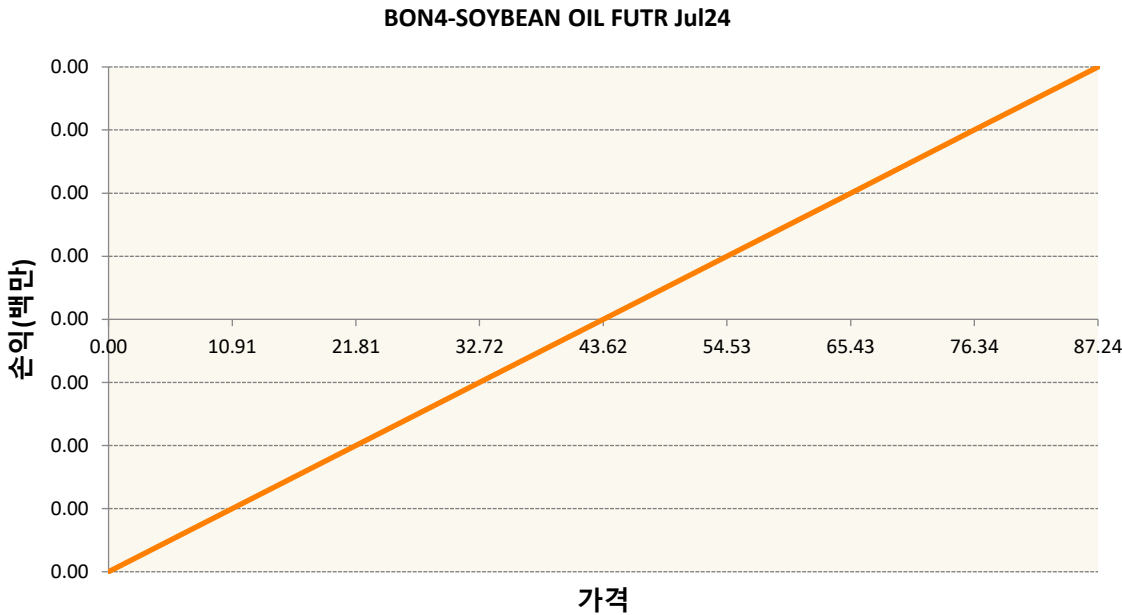
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

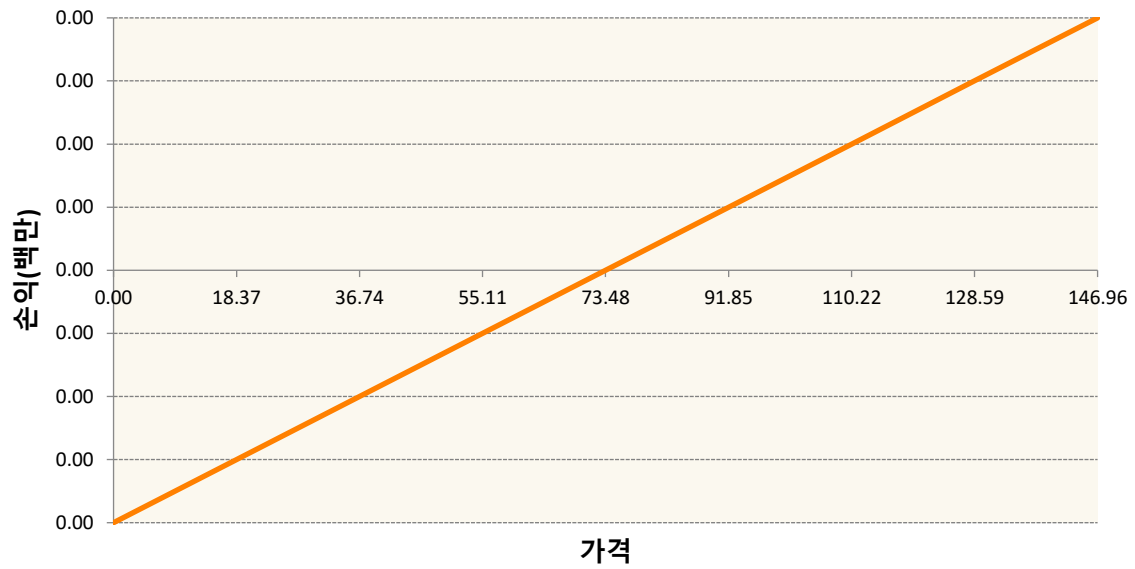
(단위:USD 백만)

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	4,235	0	4,235	
누계	통화	선물	0	494	-494	장내

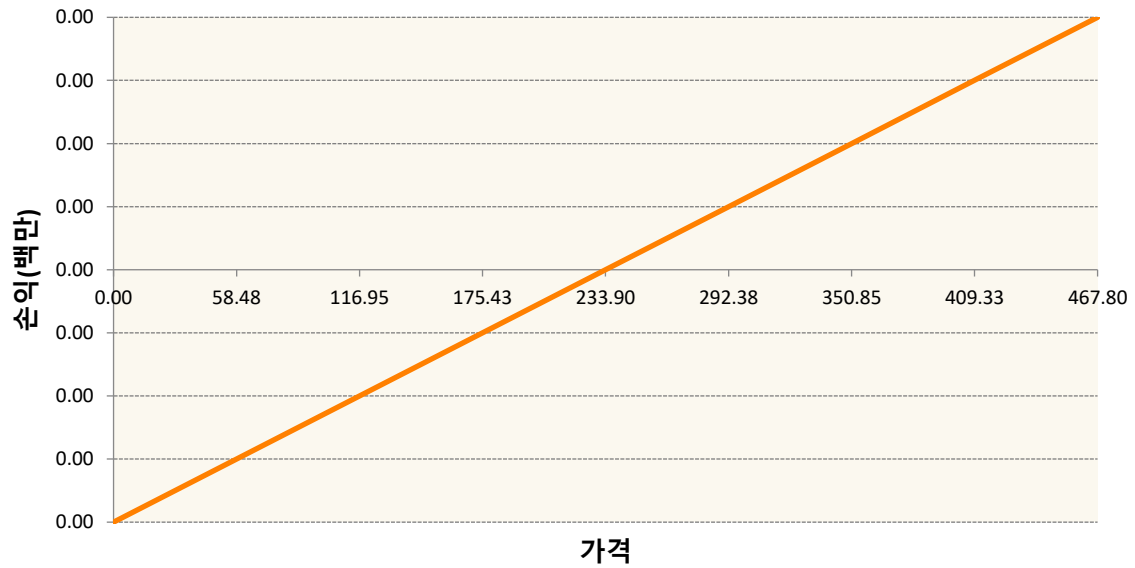
2. 만기시점의 손익구조



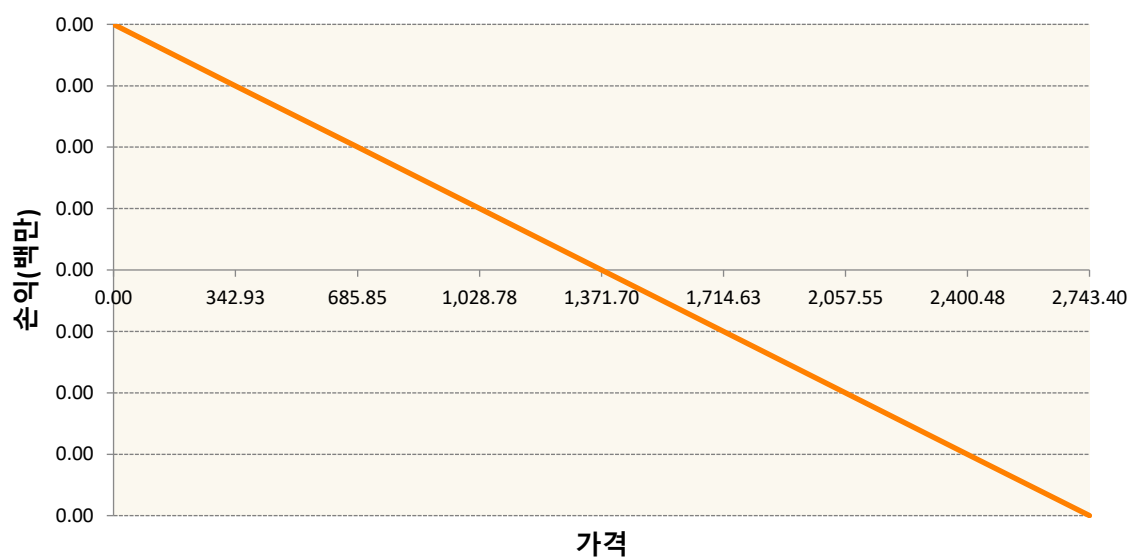
CTN4-COTTON NO.2 FUTR Jul24



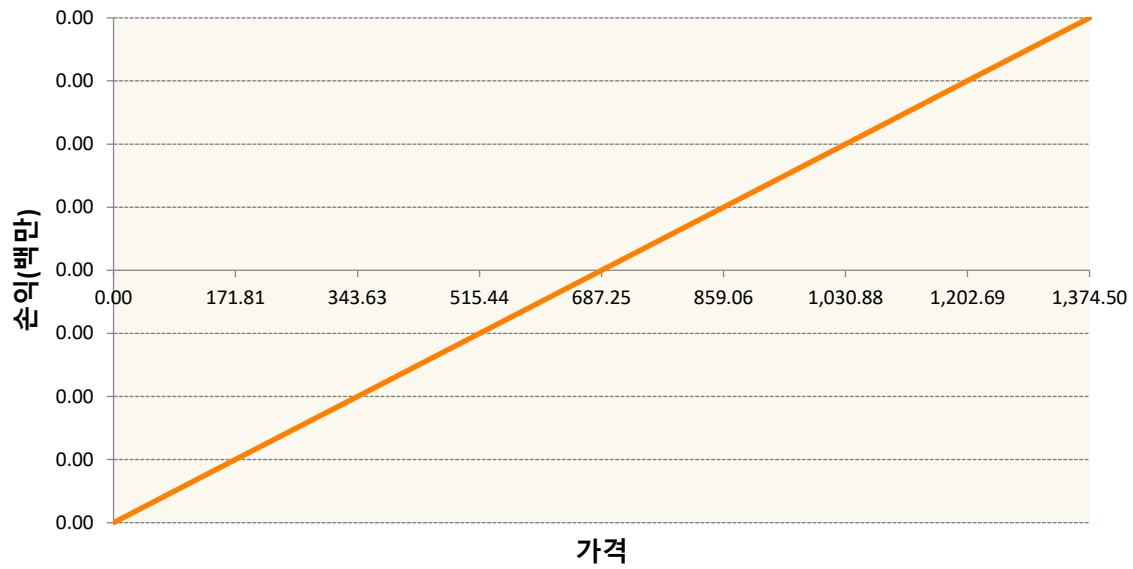
KCN4-COFFEE 'C' FUTURE Jul24



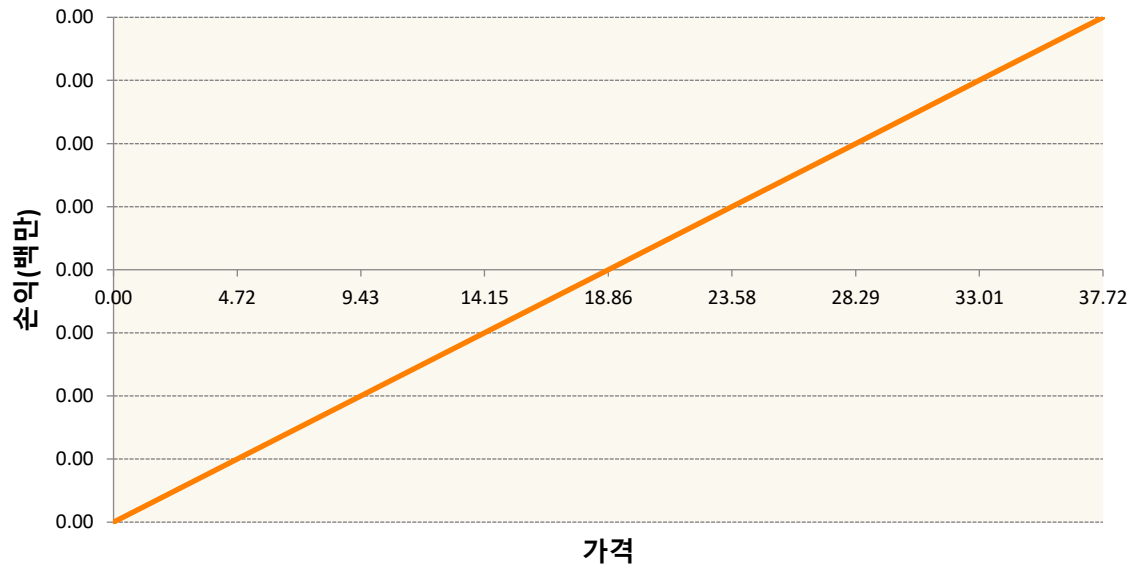
KR4175V60006-2024-06 달러선물



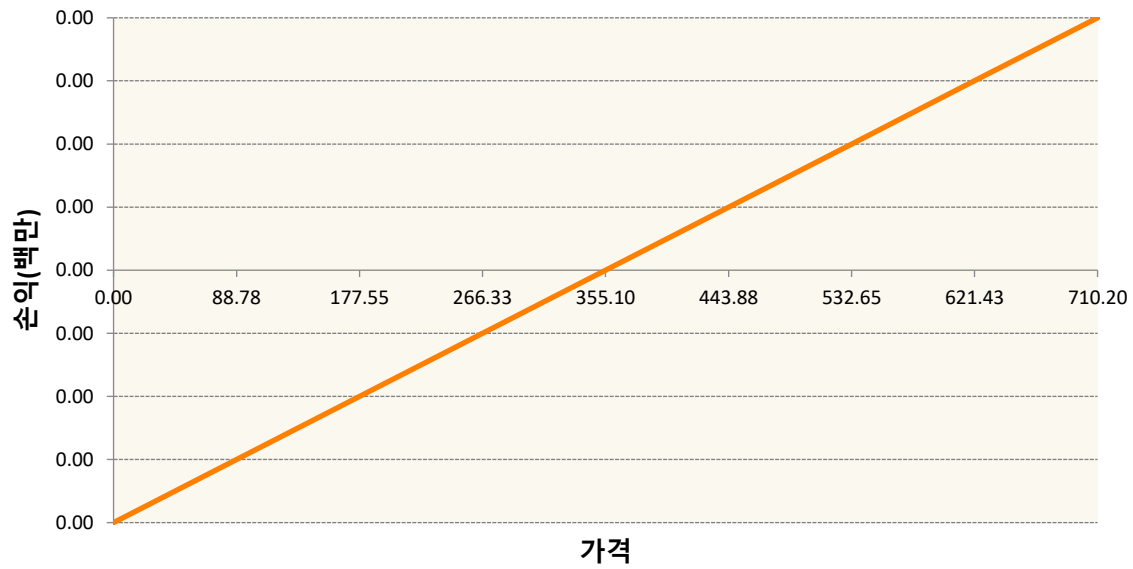
KWN4-KC HRW WHEAT FUT Jul24

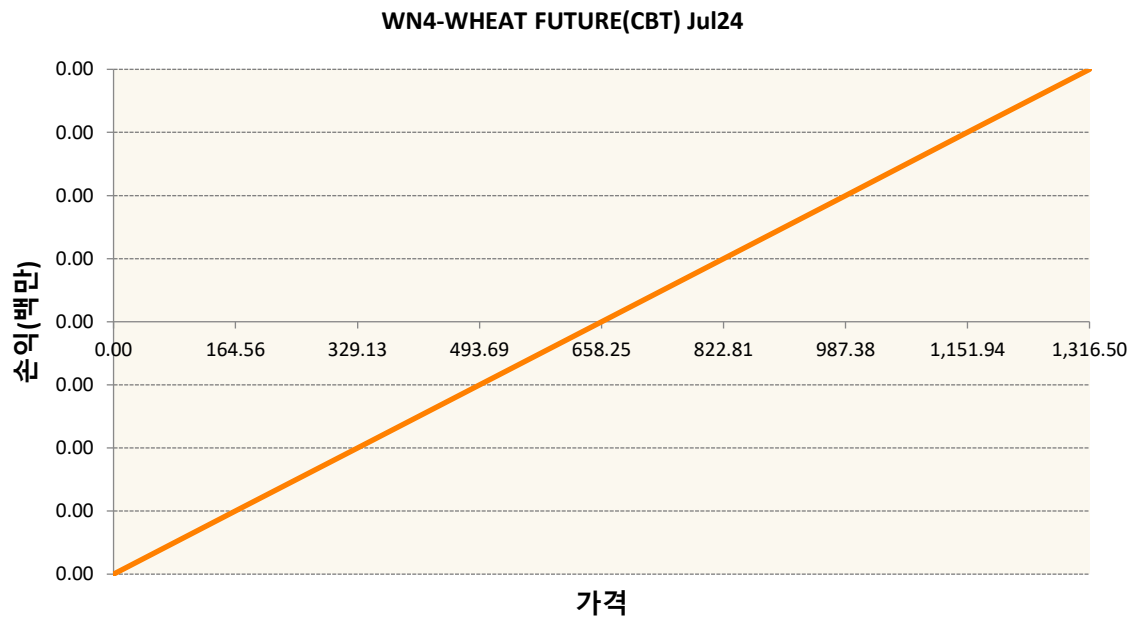
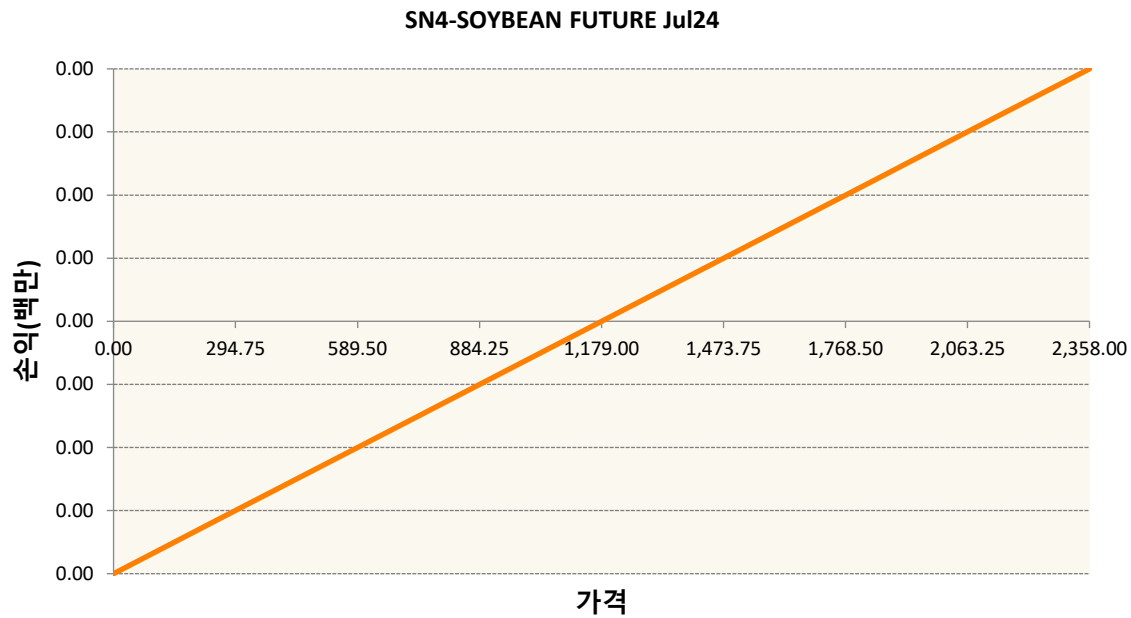


SBN4-Sugar #11 (WORLD) Jul24



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	2024-06-07
기준일	2024-06-05

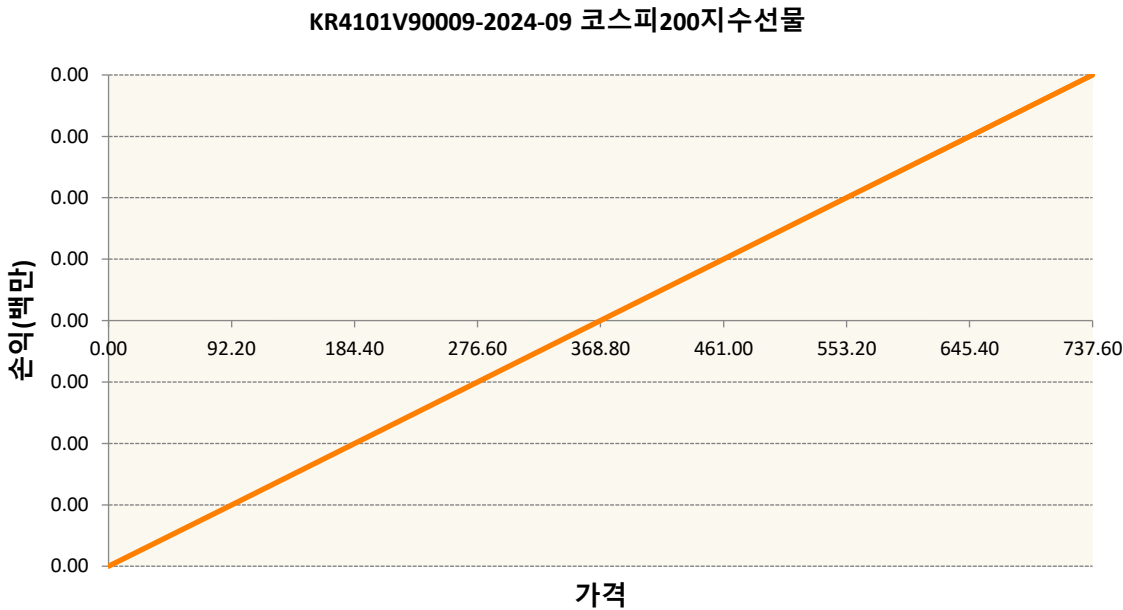
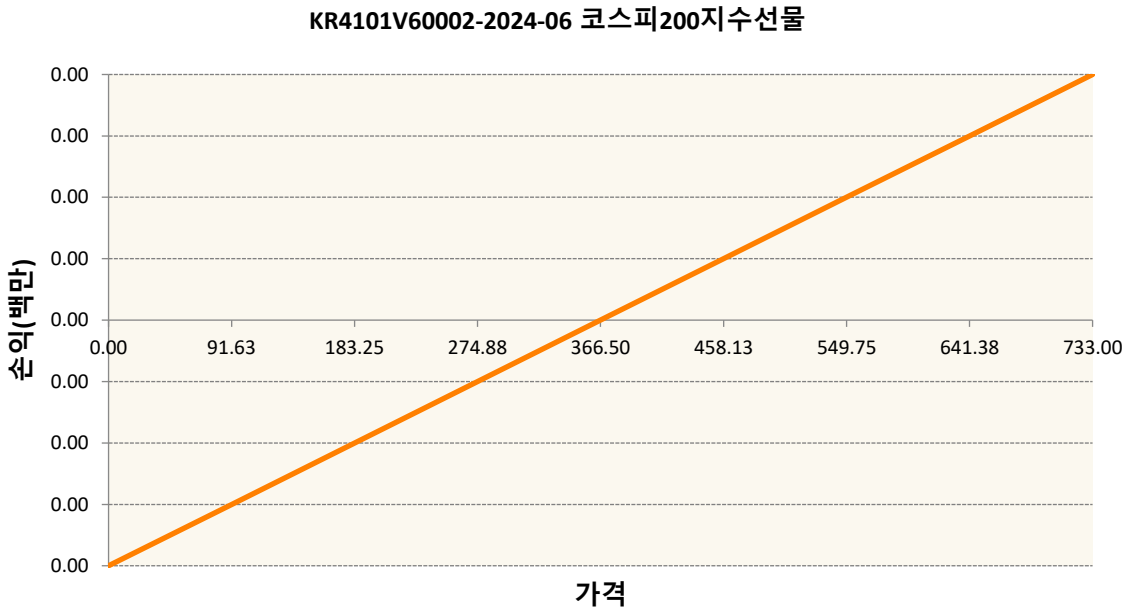
스마트인덱스모

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	458	0	458	장내
누계	유가증권	선물	2,576	0	2,576	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101V60002		2024-06 코스피200지수선물					73
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-73	-73	-73	-73	-73	-73	-73
-5.33%	-49	-49	-49	-49	-49	-49	-49
-2.67%	-24	-24	-24	-24	-24	-24	-24
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	24	24	24	24	24	24	24
5.33%	49	49	49	49	49	49	49
8.00%	73	73	73	73	73	73	73
KR4101V90009		2024-09 코스피200지수선물					132
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-132	-132	-132	-132	-132	-132	-132
-5.33%	-88	-88	-88	-88	-88	-88	-88
-2.67%	-44	-44	-44	-44	-44	-44	-44
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	44	44	44	44	44	44	44
5.33%	88	88	88	88	88	88	88
8.00%	132	132	132	132	132	132	132

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

202

공시일	2024-06-07
기준일	2024-06-05

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	267
-----------------------------	-----

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

325

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2024-06-07
기준일	2024-06-05

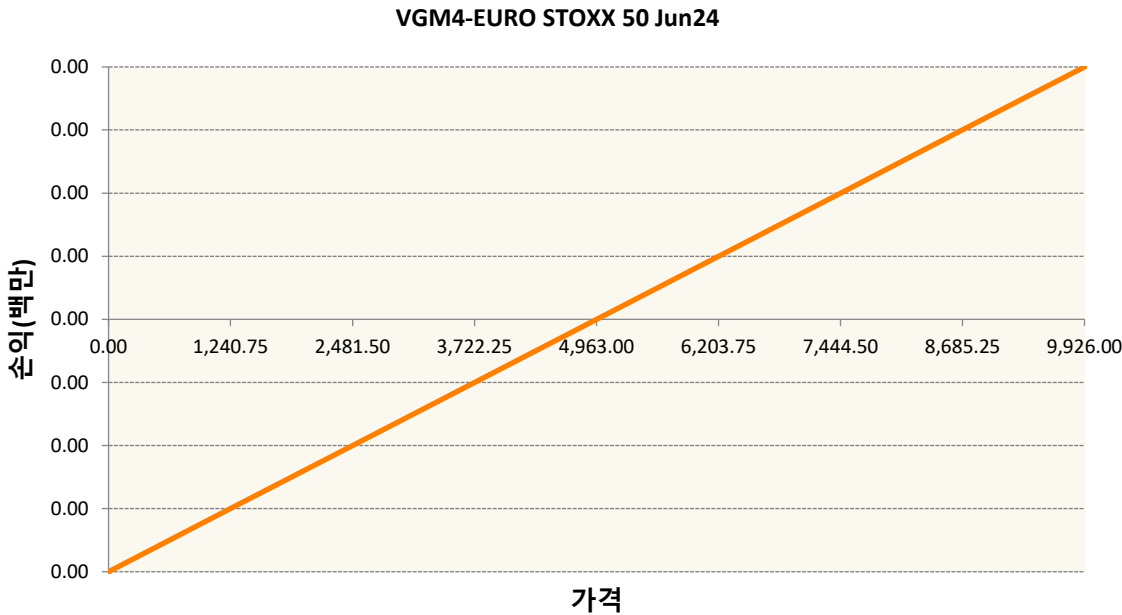
유로인덱스모(주식-파생형)

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	926	0	926	
누계	통화	선도	224	0	224	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213E3K(EUR/KRW 21-06-24E	18
VGM4 EURO STOXX 50 Jun24	74

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

(단위:백만원)

59

공시일	2024-06-07
기준일	2024-06-05

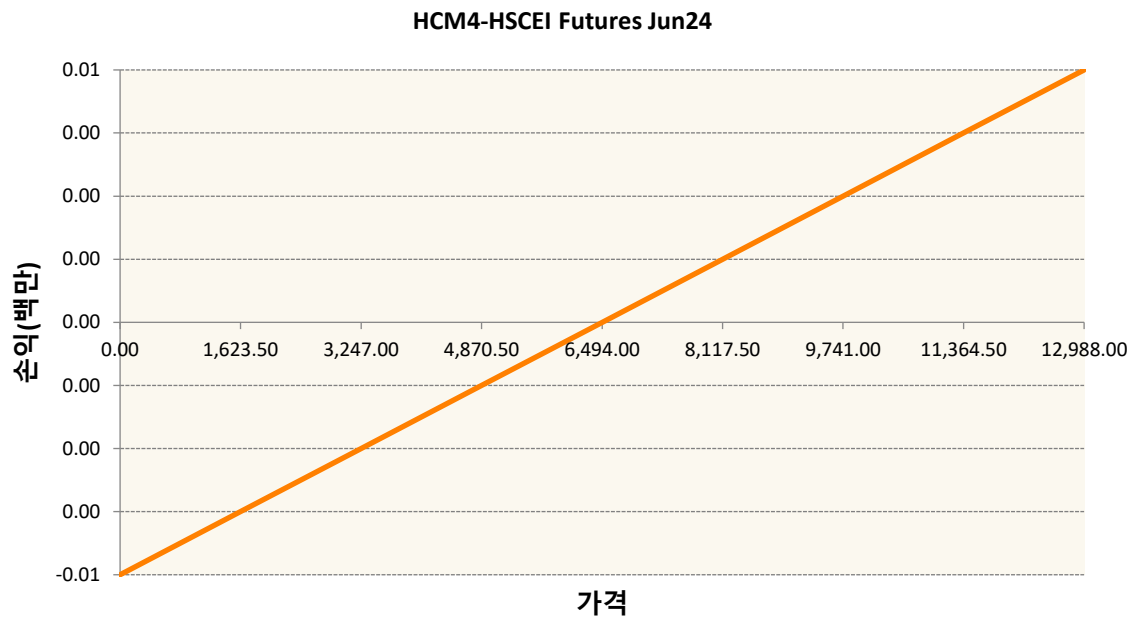
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,361	0	1,361	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCM4	HSCEI Futures Jun24	109
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

136

공시일	2024-06-07
기준일	2024-06-05

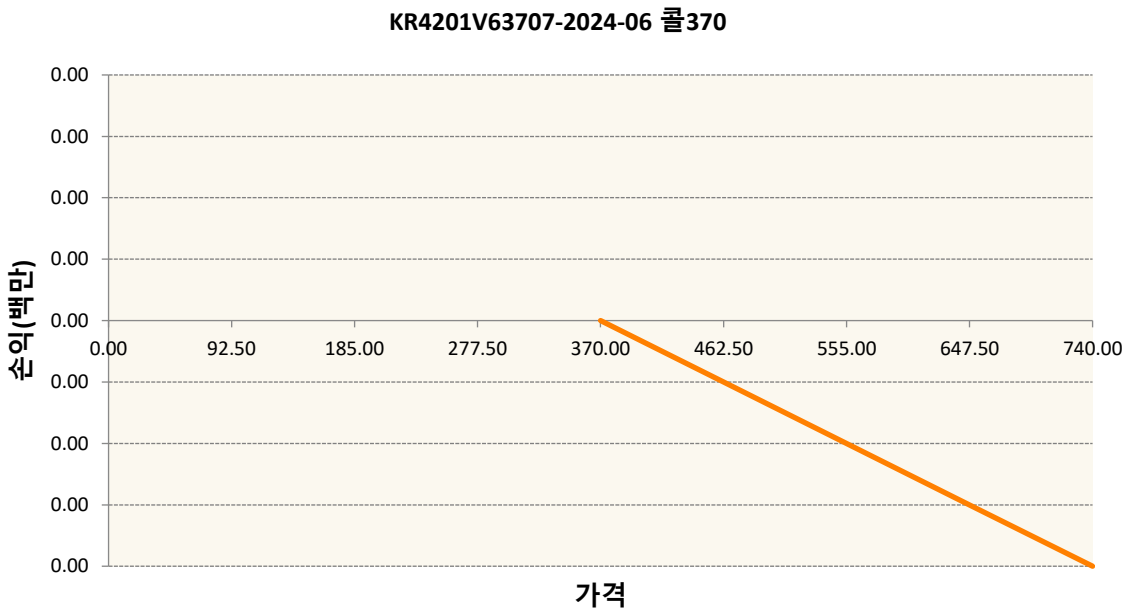
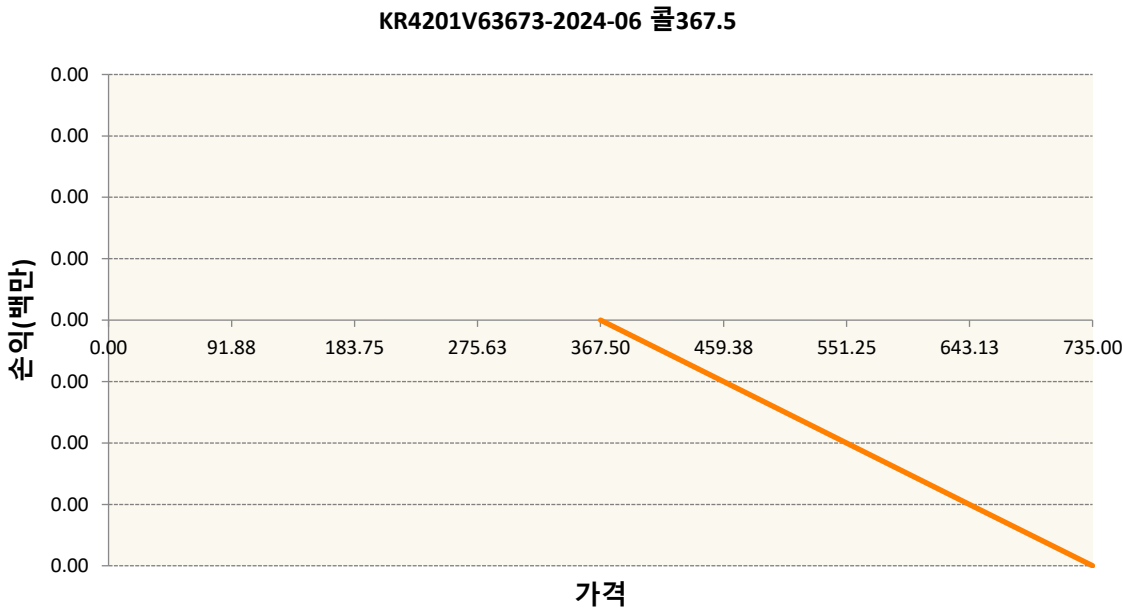
커버드콜모(주식혼합-파생형)

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 displays 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 (백만원)' (Net Income in 100 million won), ranges from 0.00 to 0.00. A single orange line starts at the origin (0, 0) and extends to the point (370, 0), indicating that net income is zero at a price of 370.00.

(단위:백만원)

KR4201V63673							2024-06 콜367.5		932	
기초자산의 변동성										
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%			
-8.00%	208	208	207	205	204	201	197			
-5.33%	204	201	196	191	184	176	167			
-2.67%	174	162	149	135	121	106	91			
0%	57	38	19	0	-19	-38	-57			
2.67%	-191	-205	-220	-236	-252	-269	-286			
5.33%	-534	-539	-546	-554	-564	-574	-585			
8.00%	-912	-913	-915	-918	-921	-926	-932			
KR4201V63707							2024-06 콜370		1,454	
기초자산의 변동성										

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	272	272	271	270	268	264	260
-5.33%	269	265	260	253	244	234	222
-2.67%	237	221	204	184	164	142	119
0%	90	60	30	0	-30	-61	-91
2.67%	-262	-290	-318	-346	-375	-405	-434
5.33%	-796	-808	-823	-840	-859	-879	-900
8.00%	-1,409	-1,412	-1,417	-1,424	-1,432	-1,442	-1,454
KR4301V63671 2024-06 풋367.5							522

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-522	-522	-522	-522	-522	-522	-522
-5.33%	-327	-327	-327	-328	-328	-329	-330
-2.67%	-135	-137	-139	-142	-145	-148	-152
0%	18	12	6	0	-6	-12	-18
2.67%	76	73	70	66	62	58	53
5.33%	83	83	82	81	80	79	77
8.00%	83	83	83	83	83	83	82
KR4301V63705 2024-06 풋370							68

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-68	-68	-68	-68	-68	-68	-68
-5.33%	-43	-43	-43	-43	-43	-43	-44
-2.67%	-19	-19	-19	-20	-20	-20	-21
0%	2	1	1	0	-1	-1	-2
2.67%	12	12	11	11	10	9	9
5.33%	14	14	14	14	14	13	13
8.00%	14	14	14	14	14	14	14

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

(단위:백만원)

3,258

공시일	2024-06-07
기준일	2024-06-05

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	1,169	0	1,169	

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	2024-06-07
기준일	2024-06-05

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	4,255	0	4,255	

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	2024-06-07
기준일	2024-06-05

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	15,019	0	15,019	
누계	통화	선도	206	15,082	-14,876	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213E3TC KRW/USD 28-06-24E	423
FXW213E4SC KRW/USD 31-07-24E	196
FXW213E5W KRW/USD 30-08-24E	588
FXW213E65C USD/KRW 28-06-24E	16
IE00BD8RGM75	

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

569

공시일	2024-06-07
기준일	2024-06-05

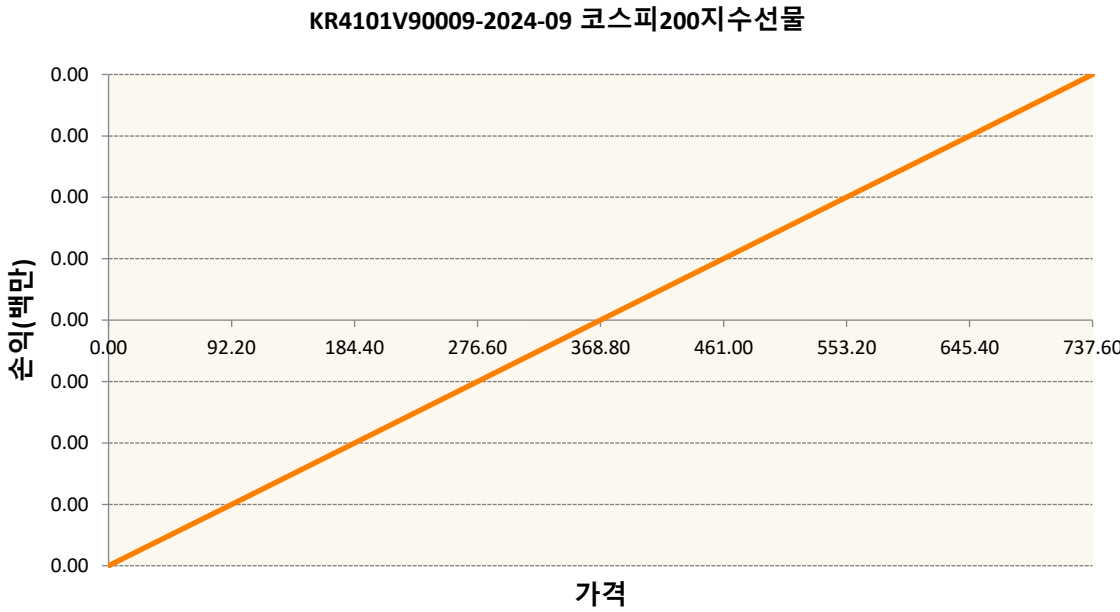
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	184	-184	장내
누계	유가증권	선물	738	0	738	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101V90009			2024-09 코스피200지수선물				59
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-59	-59	-59	-59	-59	-59	-59
-5.33%	-39	-39	-39	-39	-39	-39	-39
-2.67%	-20	-20	-20	-20	-20	-20	-20
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	20	20	20	20	20	20	20
5.33%	39	39	39	39	39	39	39
8.00%	59	59	59	59	59	59	59

공시일	2024-06-07
기준일	2024-06-05

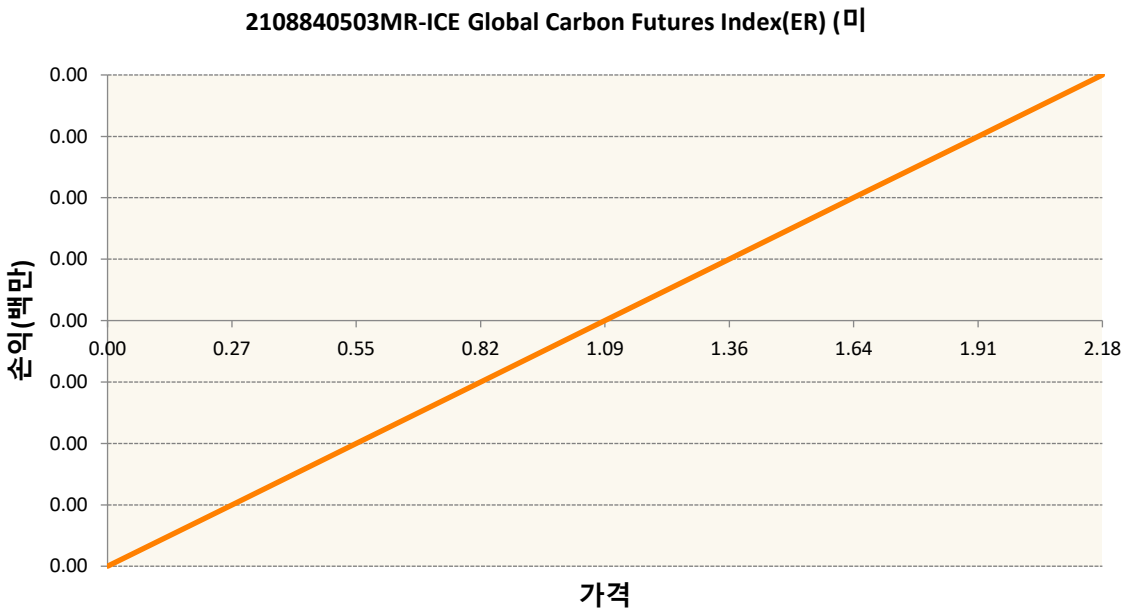
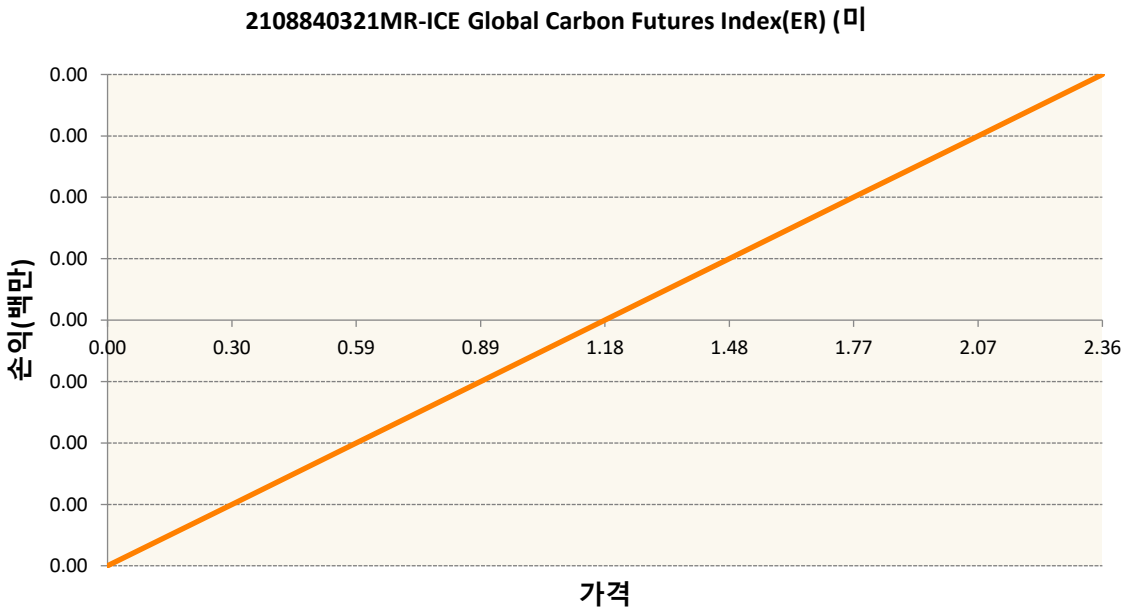
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

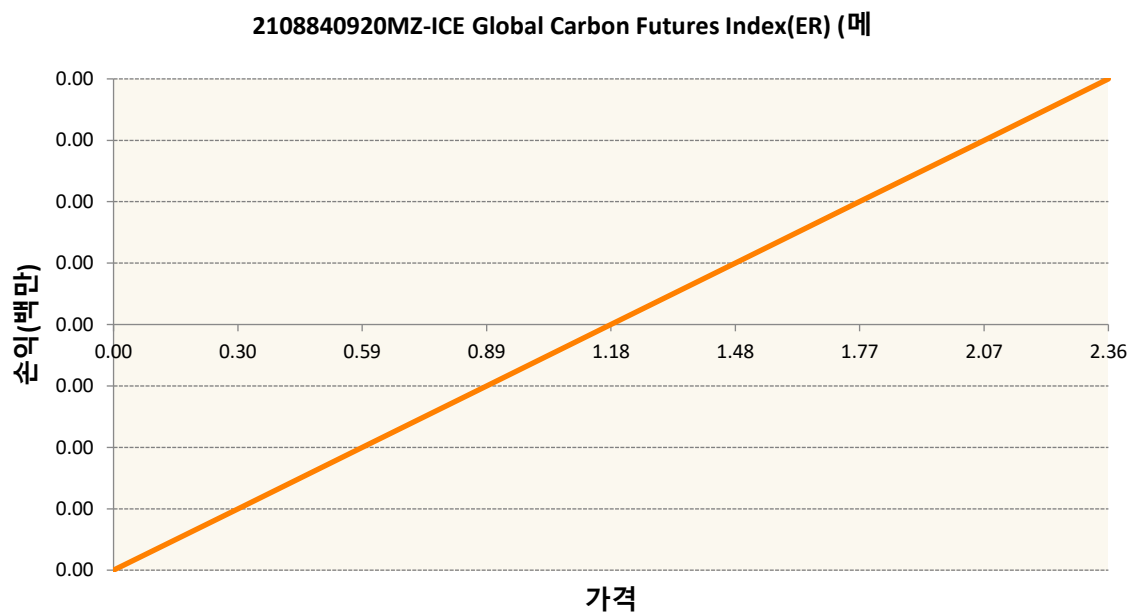
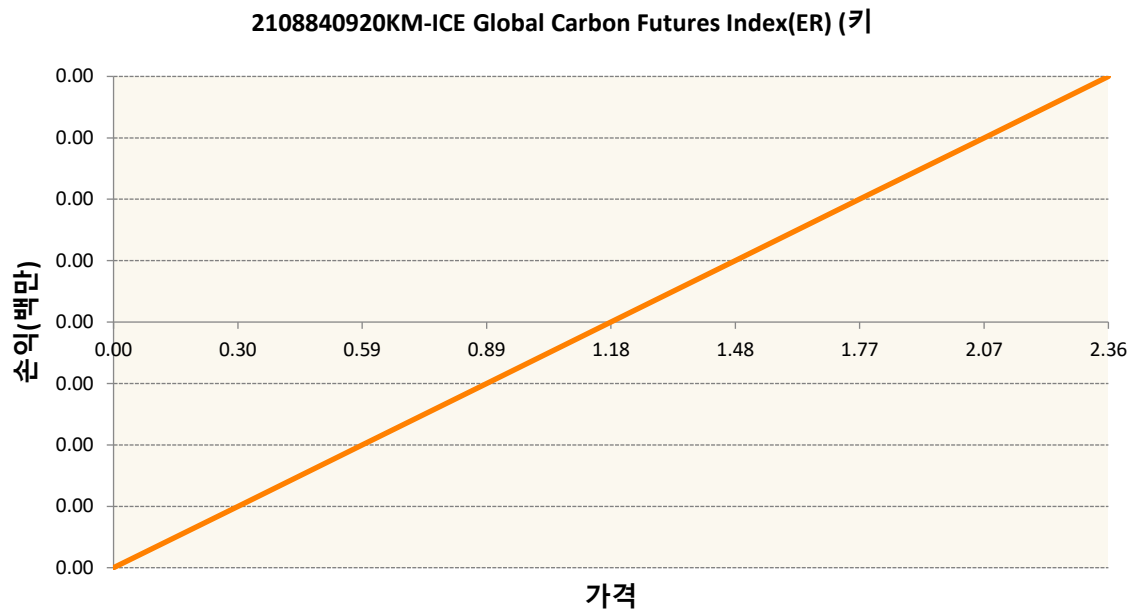
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	24,310	0	24,310	

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108840321ICE Global Carbon Futures Index(ER) (미)		511
2108840503ICE Global Carbon Futures Index(ER) (미)		204
2108840920ICE Global Carbon Futures Index(ER) (키)		1,022
2108840920ICE Global Carbon Futures Index(ER) (메)		204

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	2,285

공시일	2024-06-07
기준일	2024-06-05

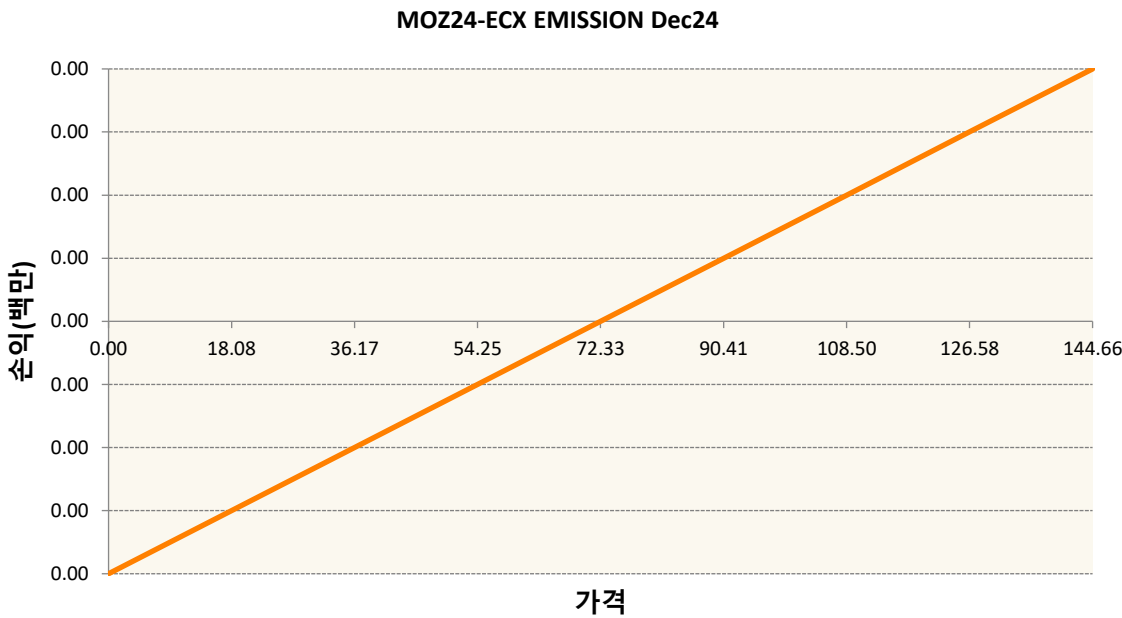
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	9,734	0	9,734	
누계	지수	스왑	331	0	331	장외
누계	통화	선도	0	2,300	-2,300	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213E5W KRW/EUR 28-06-24E	86
FXW213E5W KRW/EUR 28-06-24E	98
MOZ24 ECX EMISSION Dec24	779
SWICEUACN ICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX	5

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

(단위:백만원)

1,508

공시일	2024-06-07
기준일	2024-06-05

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)	11
SWCSI00000 신한CSI Index 230622 (메리츠)	11
SWCSI00000 신한CSI Index 230922 (키움)	8
SWCSI00000 신한CSI Index 231013 (NH)	8

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

(단위:백만원)

54

공시일	2024-06-07
기준일	2024-06-05

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	6,101	0	6,101	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(미래)	9
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(NH)	8
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(메리츠)	11
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(키움)	2

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

(단위:백만원)

34

공시일	2024-06-07
기준일	2024-06-05

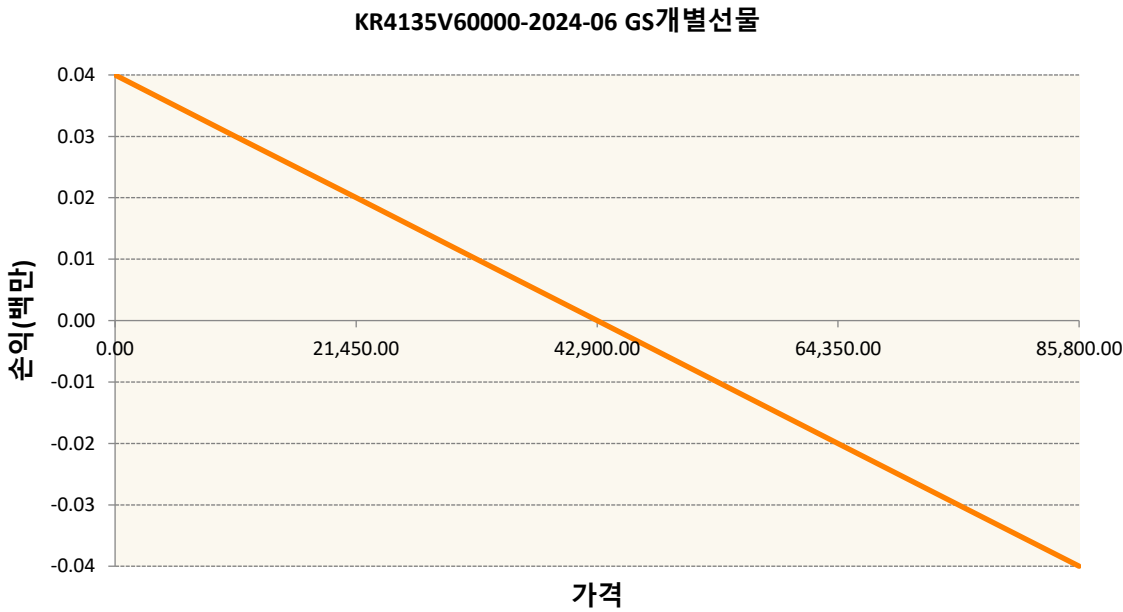
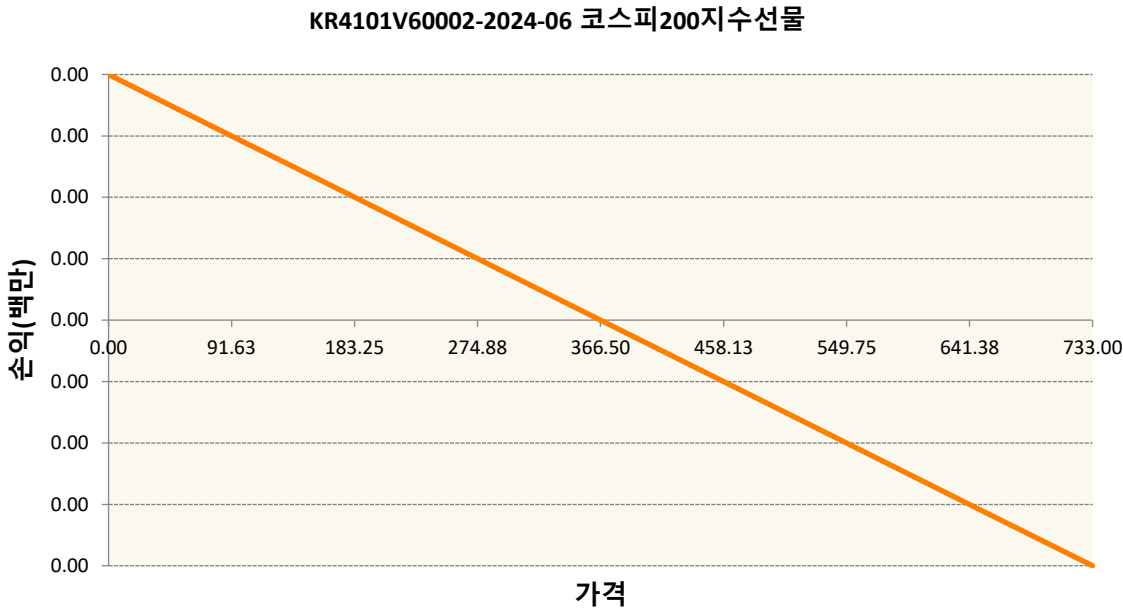
에쿼티알파일반사모혼합자산

1. 계약금액

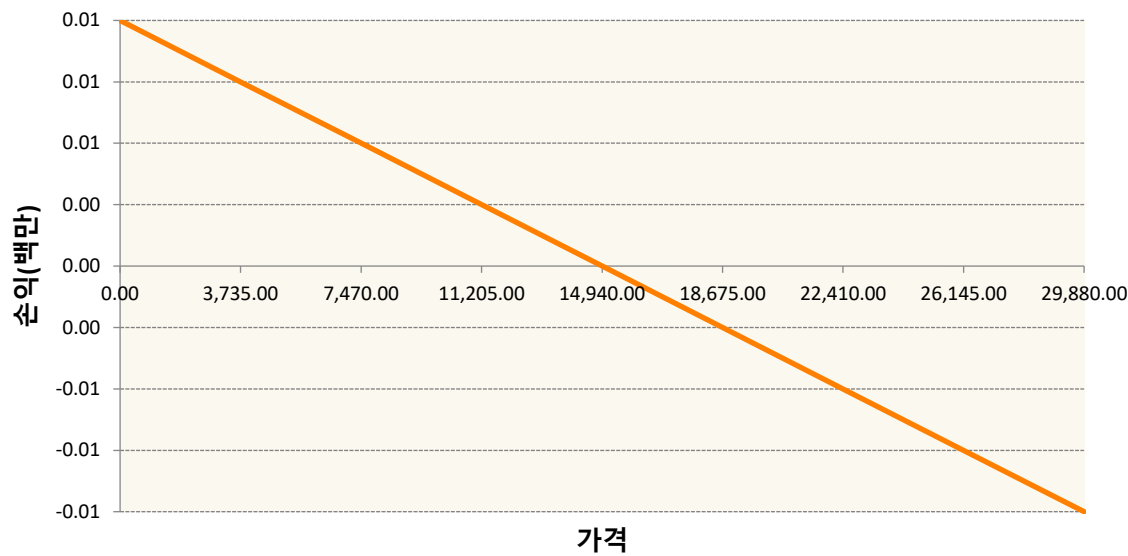
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	18	44	-26	장내
누계	유가증권	선물	23	470	-447	장내

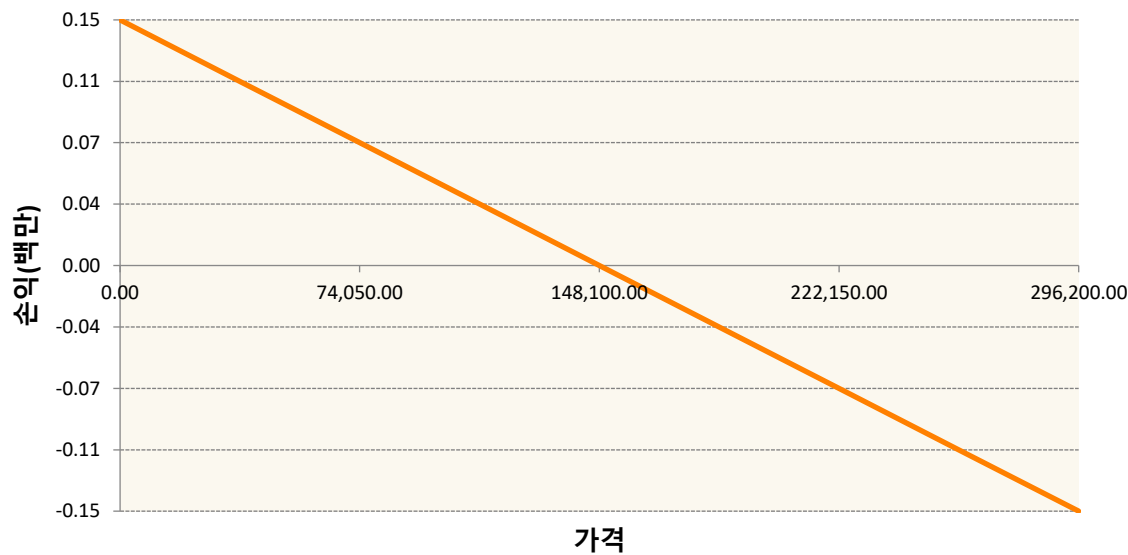
2. 만기시점의 손익구조



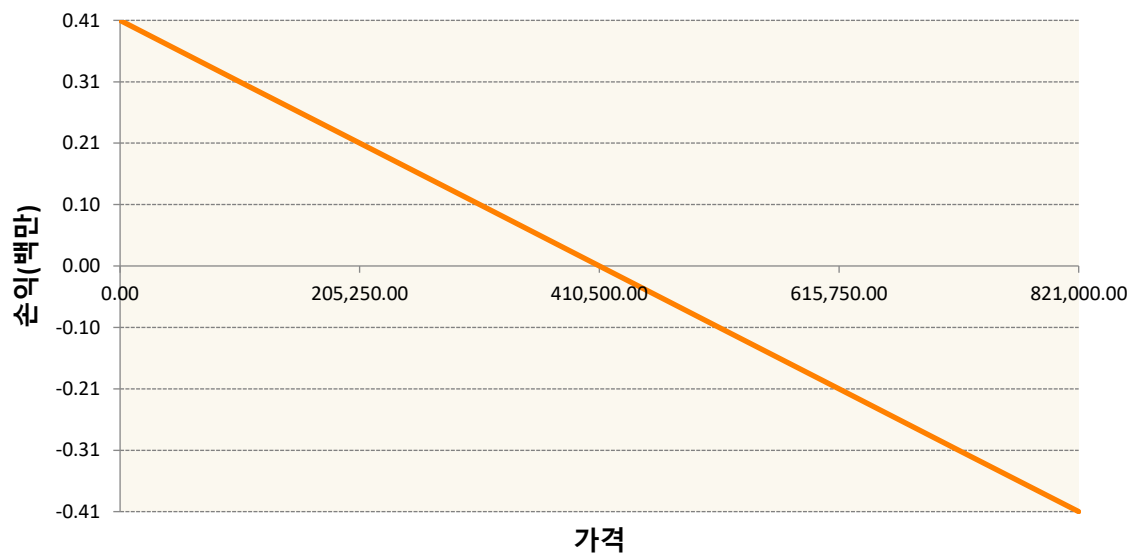
KR41BSV60002-2024-06 강원랜드개별선물



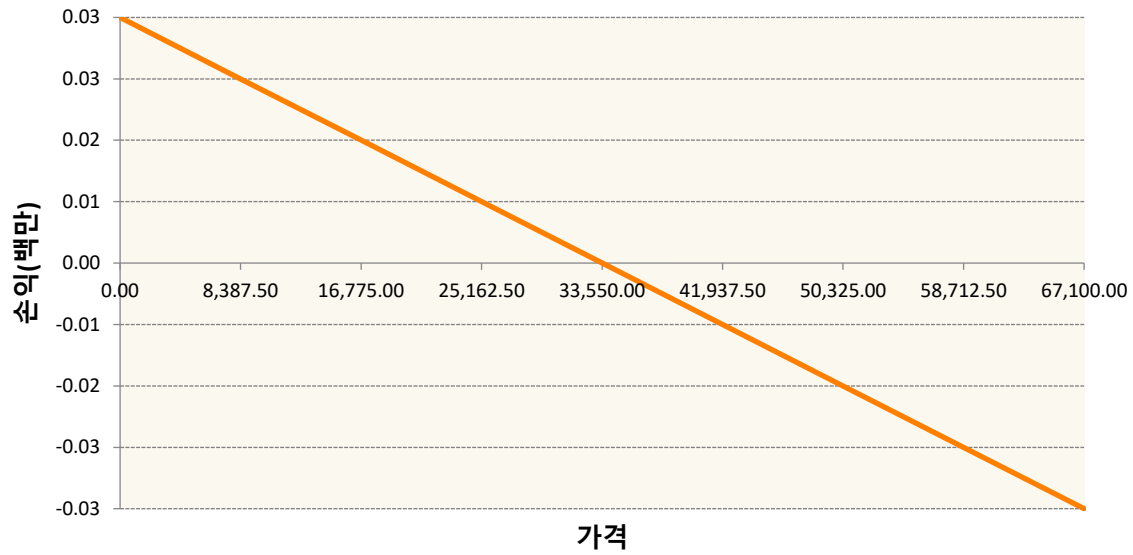
KR41C3V60005-2024-06 금호석유개별선물



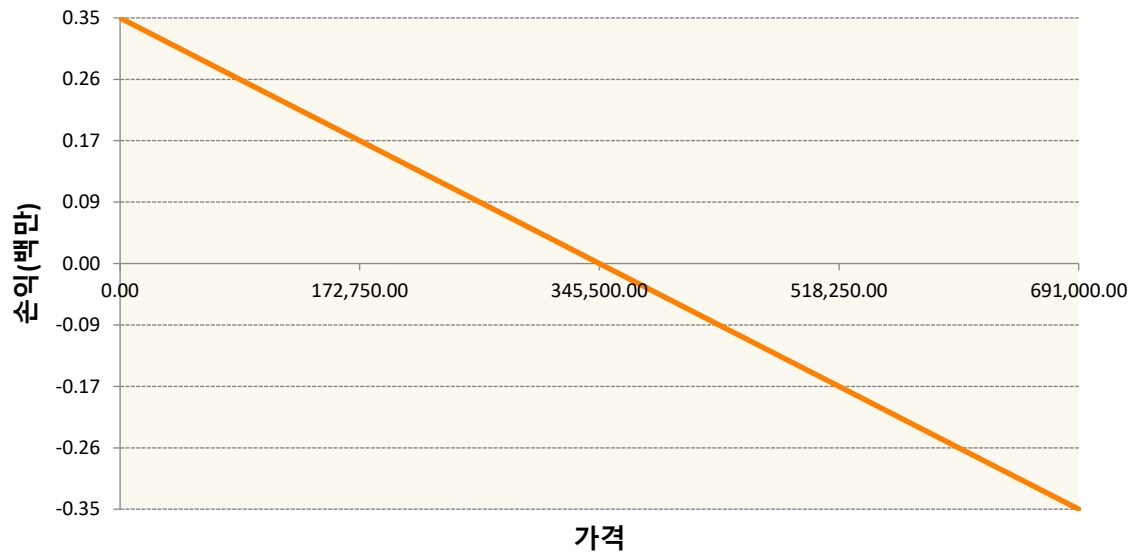
KR41CRV60002-2024-06 LG생활건강개별선물



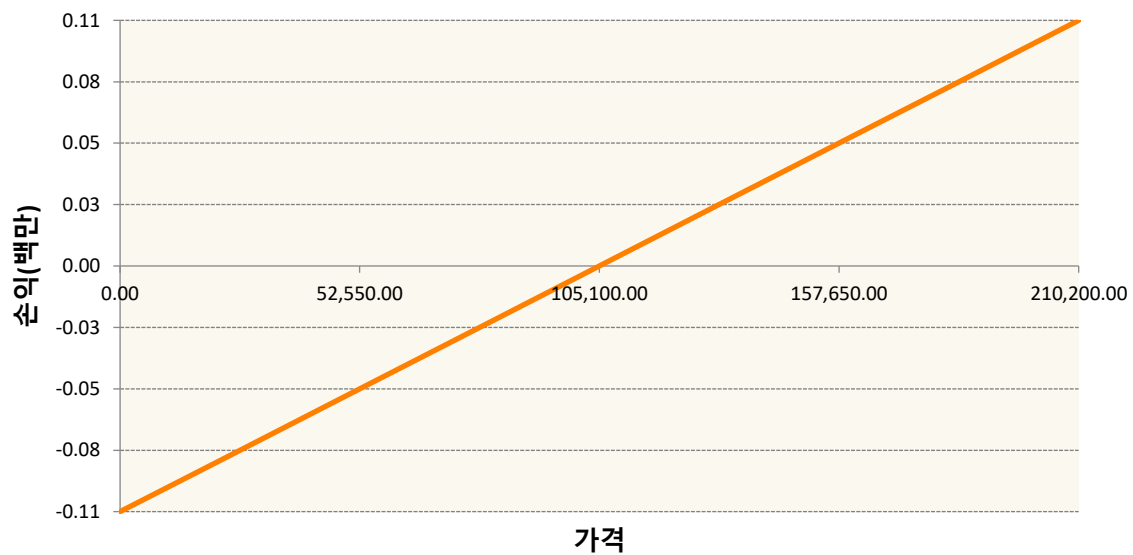
KR41CSV60000-2024-06 아모레G개별선물



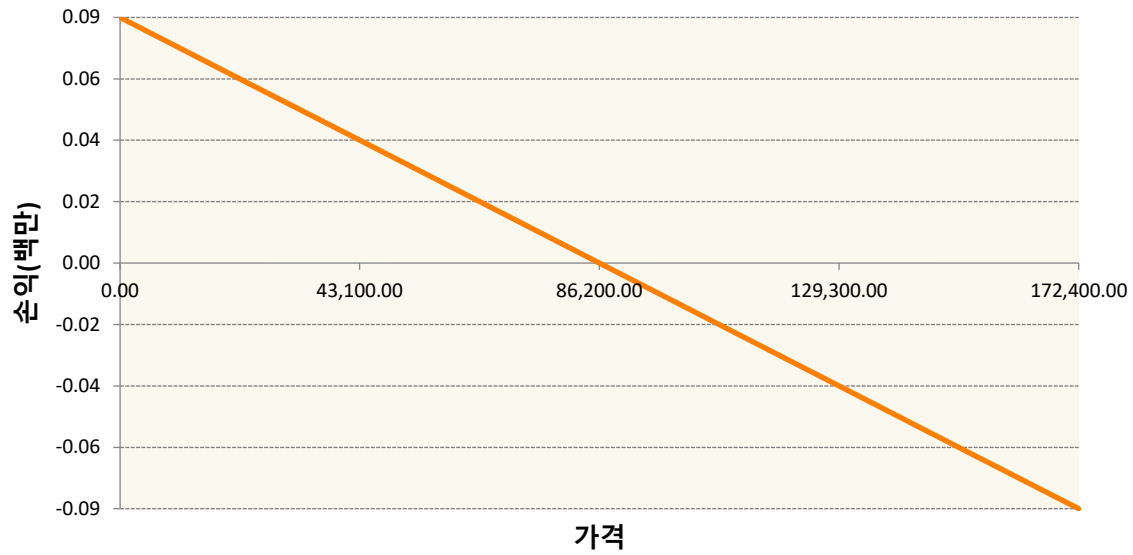
KR41CTV60008-2024-06 삼성화재개별선물



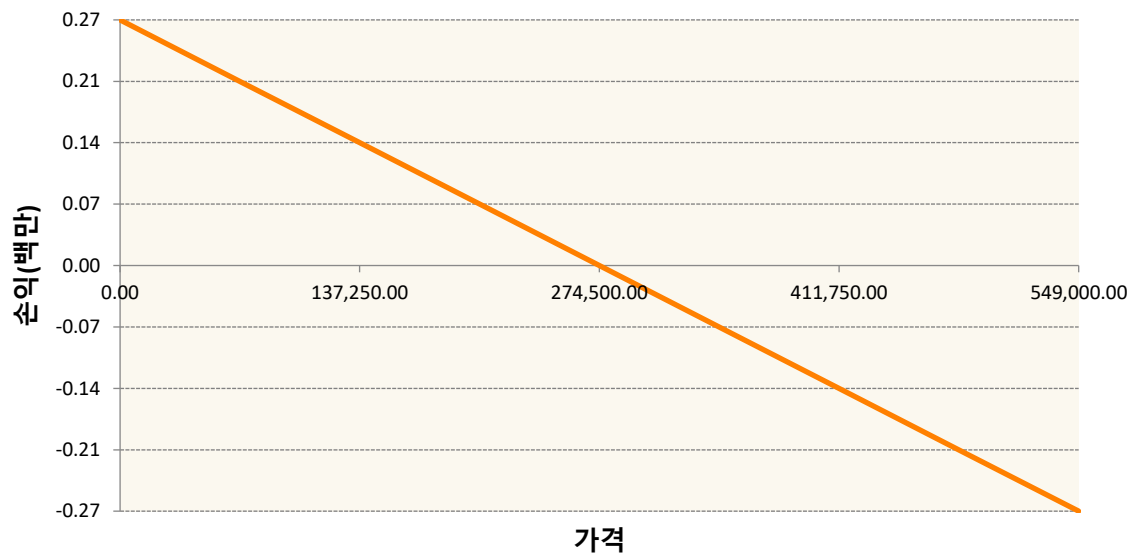
KR41D0V60000-2024-06 DB손해보험개별선물



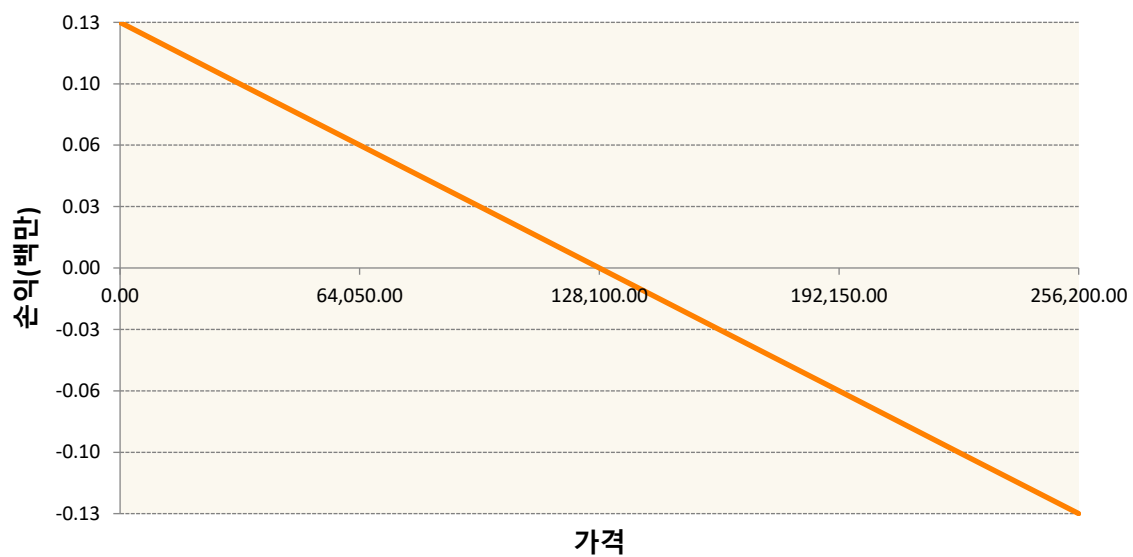
KR41DTV60006-2024-06 CJ ENM개별선물



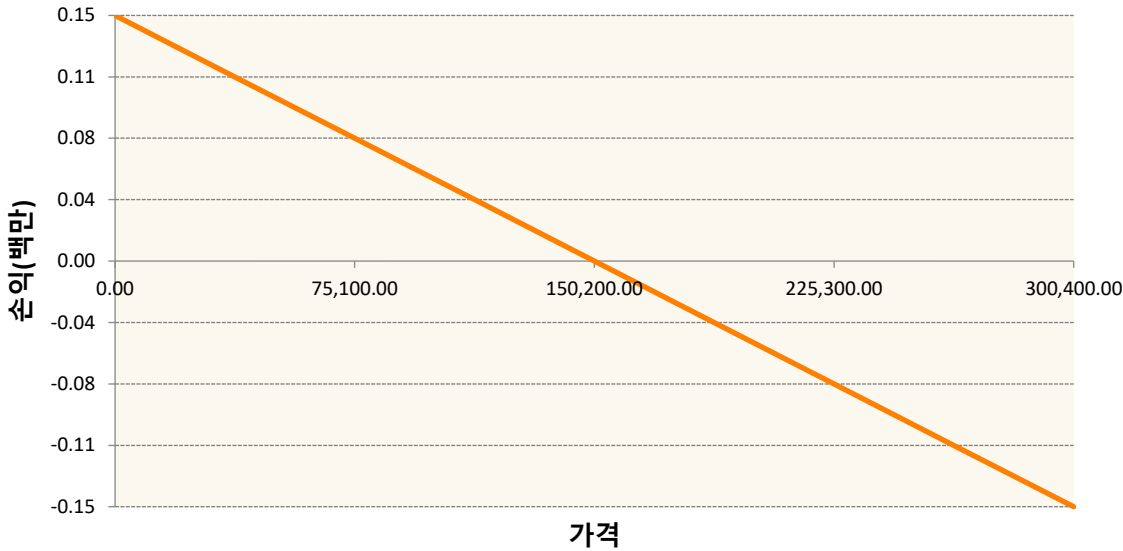
KR41E8V60002-2024-06 포스코케미칼개별선물



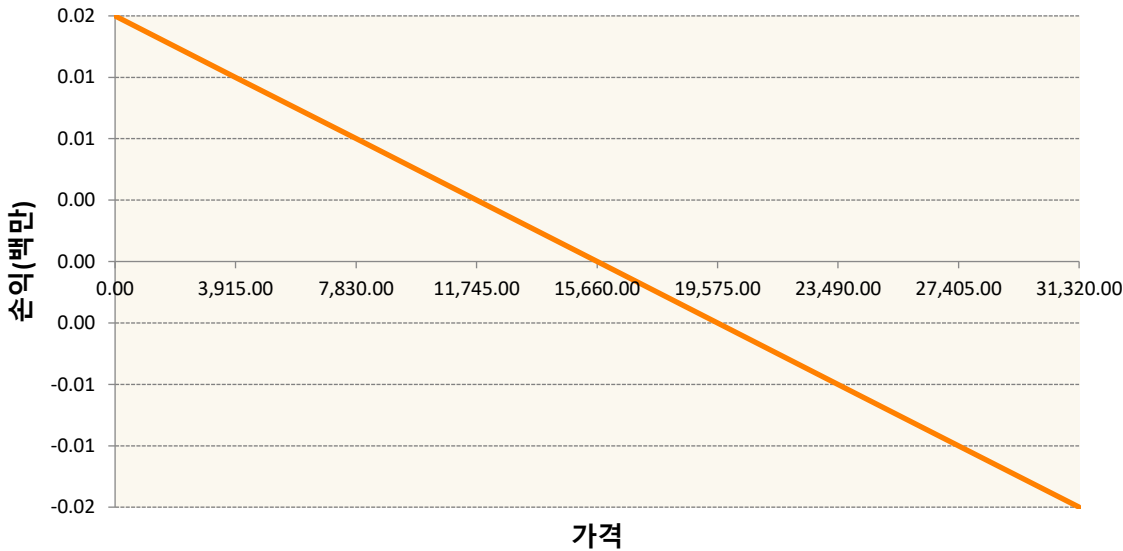
KR41FDV60005-2024-06 현대중공업개별선물



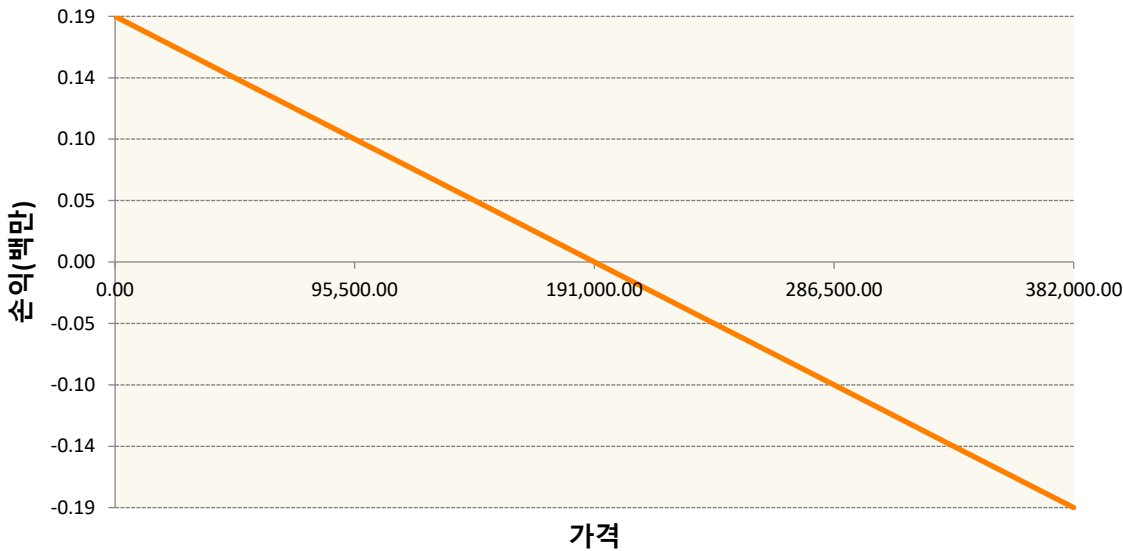
KR41FSV60003-2024-06 LS개별선물



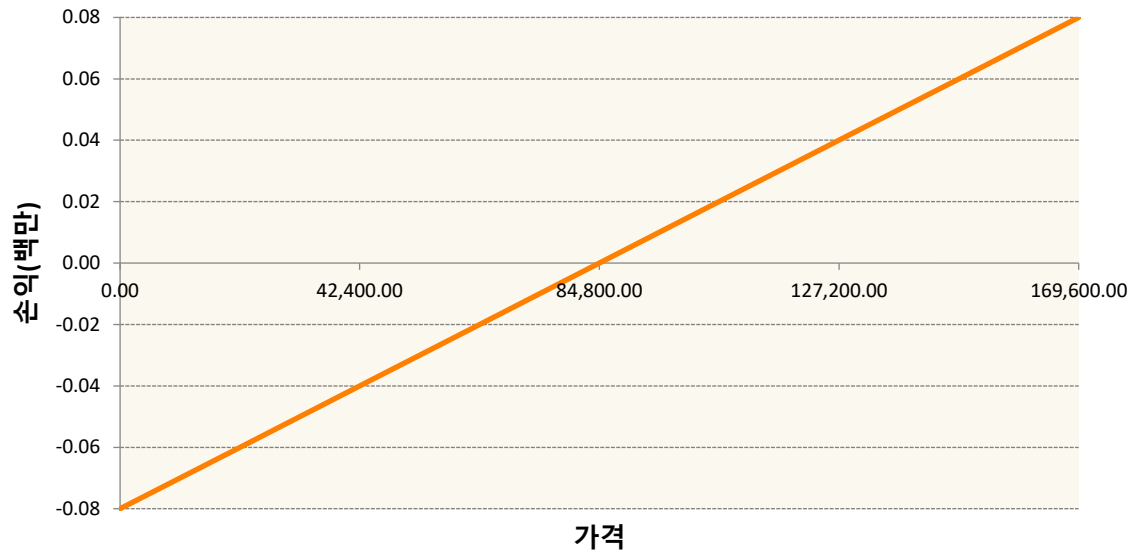
KR41FWV60005-2024-06 대한전선개별선물



KR41GLV60006-2024-06 LS ELECTRIC개별선물



KR41GNV60002-2024-06 금양개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101V600 2024-06 코스피200지수선물	29
KR4135V600 2024-06 GS개별선물	1
KR41BSV600 2024-06 강원랜드개별선물	0.48
KR41C3V600 2024-06 금호석유개별선물	1
KR41CRV600 2024-06 LG생활건강개별선물	1
KR41CSV600 2024-06 아모레G개별선물	1
KR41CTV600 2024-06 삼성화재개별선물	1
KR41D0V600 2024-06 DB손해보험개별선물	1
KR41DTV600 2024-06 CJ ENM개별선물	1
KR41E8V600 2024-06 포스코케미칼개별선물	0.44
KR41FDV600 2024-06 현대중공업개별선물	1
KR41FSV600 2024-06 LS개별선물	1
KR41FWV600 2024-06 대한전선개별선물	1
KR41GLV600 2024-06 LS ELECTRIC개별선물	0.31
KR41GNV600 2024-06 금양개별선물	1

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

(단위:백만원)

51

공시일	2024-06-07
기준일	2024-06-05

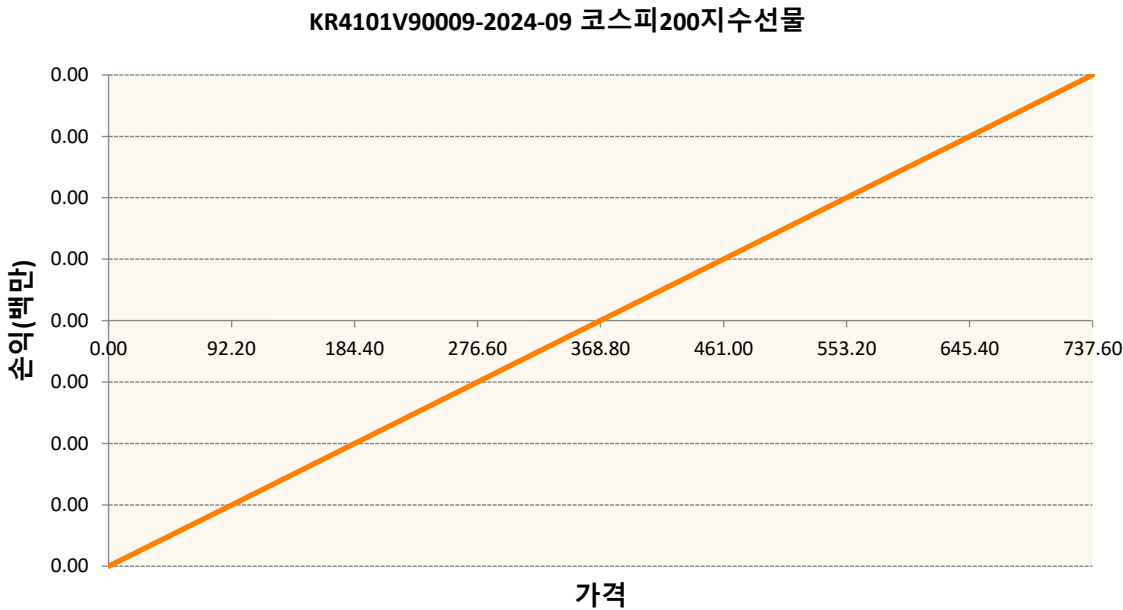
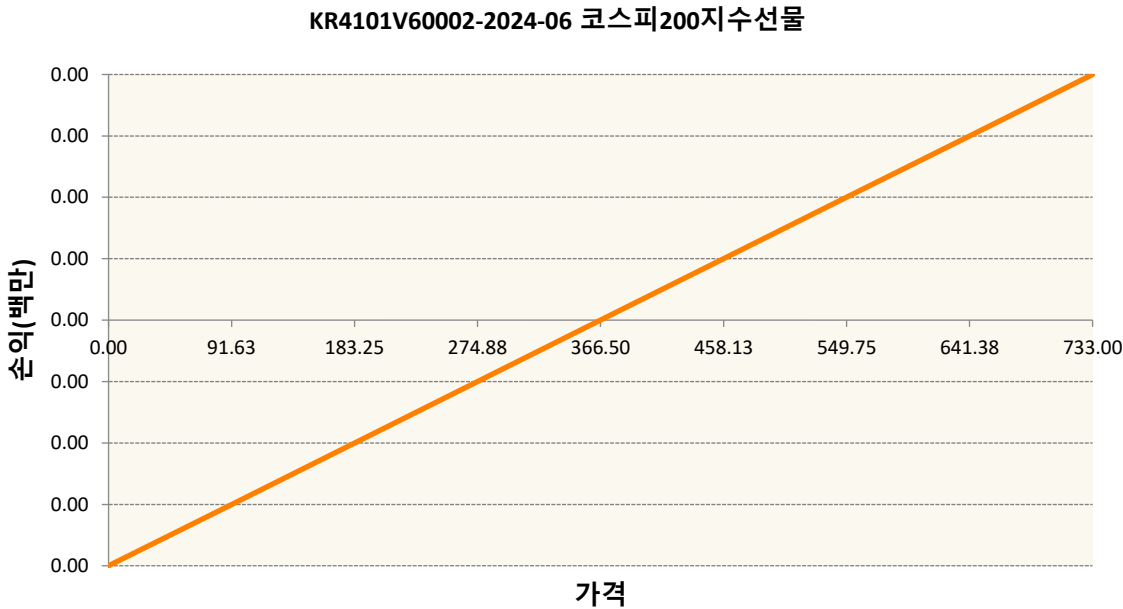
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	2,745	0	2,745	장내
누계	유가증권	선물	17,023	0	17,023	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101V60002		2024-06 코스피200지수선물					440
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-440	-440	-440	-440	-440	-440	-440
-5.33%	-293	-293	-293	-293	-293	-293	-293
-2.67%	-147	-147	-147	-147	-147	-147	-147
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	147	147	147	147	147	147	147
5.33%	293	293	293	293	293	293	293
8.00%	440	440	440	440	440	440	440
KR4101V90009		2024-09 코스피200지수선물					916
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-916	-916	-916	-916	-916	-916	-916
-5.33%	-611	-611	-611	-611	-611	-611	-611
-2.67%	-305	-305	-305	-305	-305	-305	-305
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	305	305	305	305	305	305	305
5.33%	611	611	611	611	611	611	611
8.00%	916	916	916	916	916	916	916

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

1,332

공시일	2024-06-07
기준일	2024-06-05

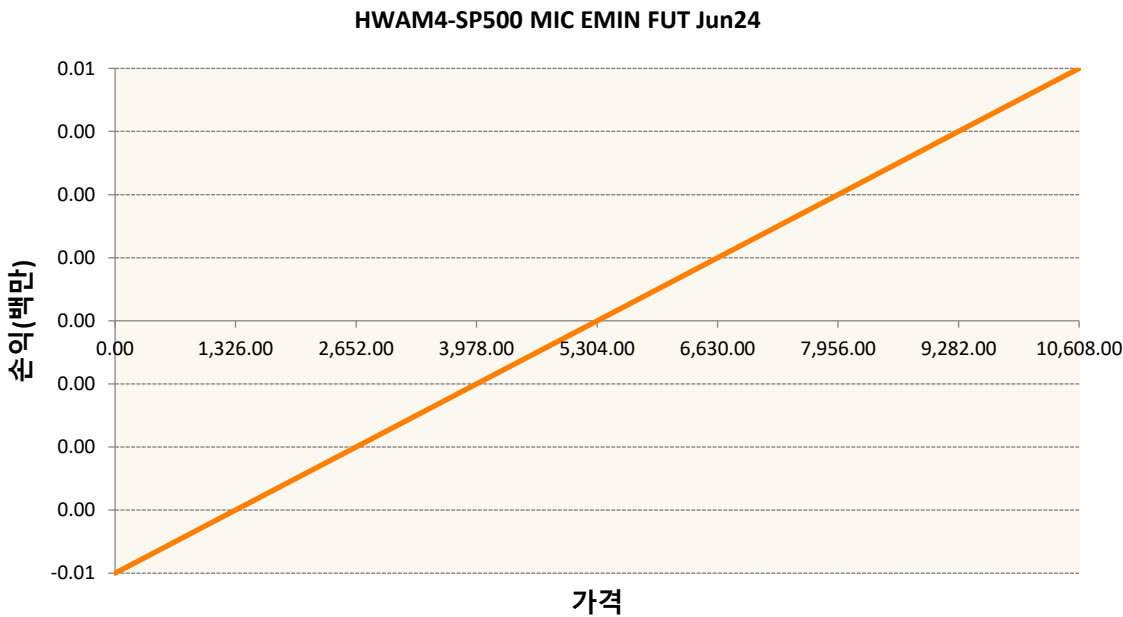
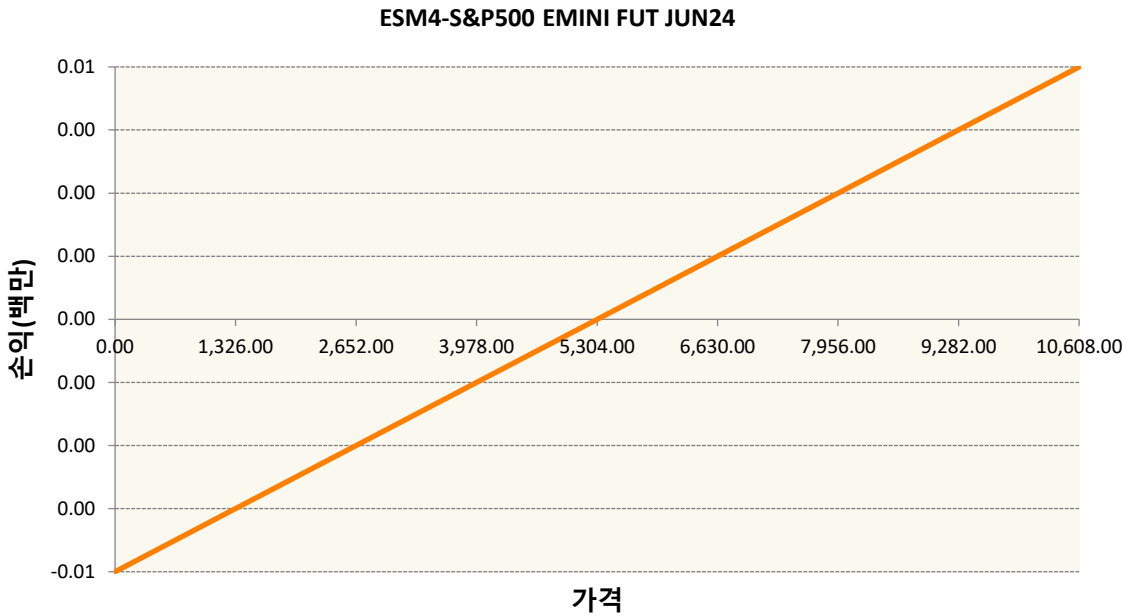
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

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	6,373	0	6,373	
누계	유가증권	선물	2,303	0	2,303	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESM4	S&P500 EMINI FUT JUN24	510
HWAM4	SP500 MIC EMIN FUT Jun24	184

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	433

공시일	2024-06-07
기준일	2024-06-05

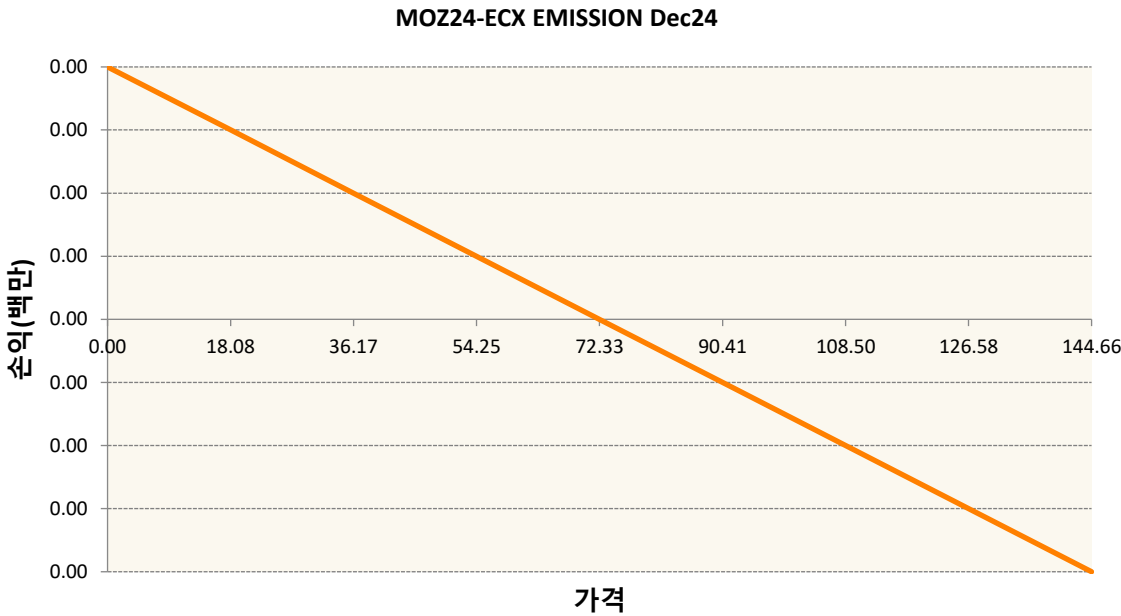
SOL유럽탄소배출권선물인버스ICE특별자산상

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	4,667	-4,667	
누계	지수	스왑	331	0	331	장외
누계	통화	선도	0	1,063	-1,063	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213E5W KRW/EUR 28-06-24E	85
MOZ24 ECX EMISSION Dec24	373
SWICEUACN ICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX	5

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

(단위:백만원)

726

공시일	2024-06-07
기준일	2024-06-05

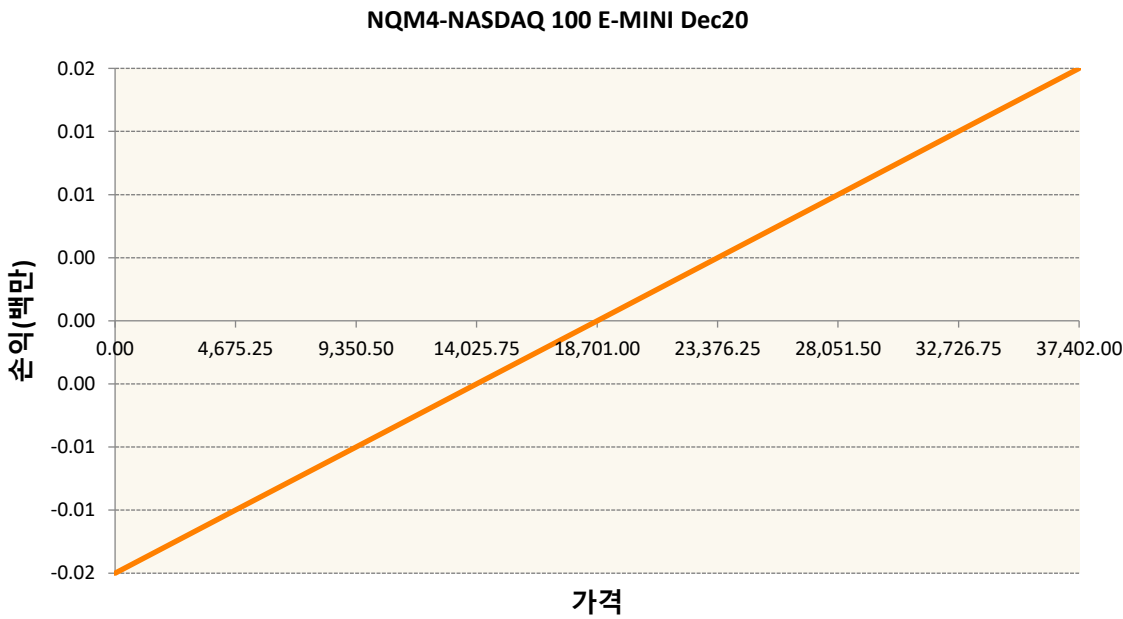
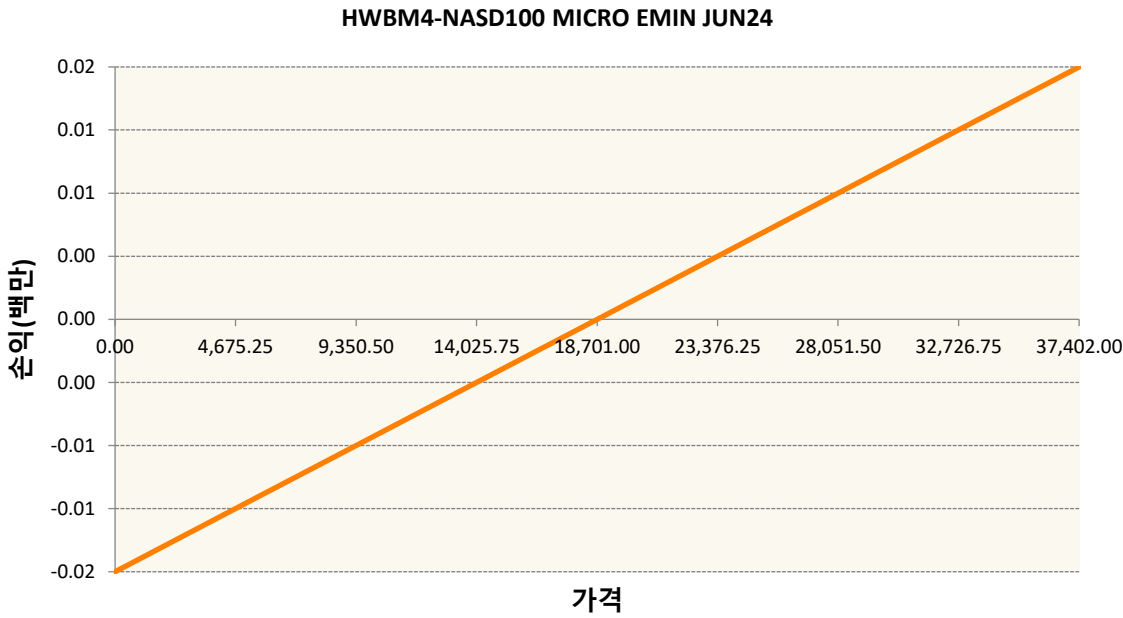
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

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	2,473	0	2,473	
누계	유가증권	선물	2,394	0	2,394	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
HWBM4	NASD100 MICRO EMIN JUN24		192
NQM4	NASDAQ 100 E-MINI Dec20		198

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)			(단위:백만원)
			289

공시일	2024-06-07
기준일	2024-06-05

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	451
SWKEDI0000 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	971
SWKEDI0000 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	9,214
SWKEDI0000 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	2,802

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

(단위:백만원)

8,182

공시일	2024-06-07
기준일	2024-06-05

SOL미국테크TOP10인버스상장지수(주식혼합)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	7,960	0	7,960	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

31

공시일	2024-06-07
기준일	2024-06-05

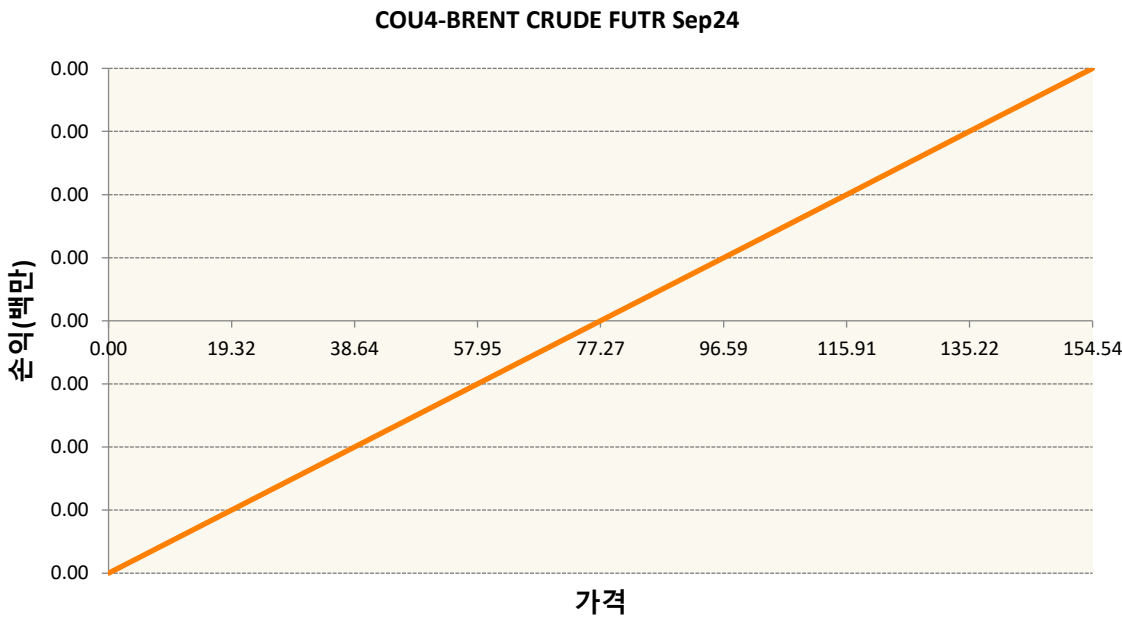
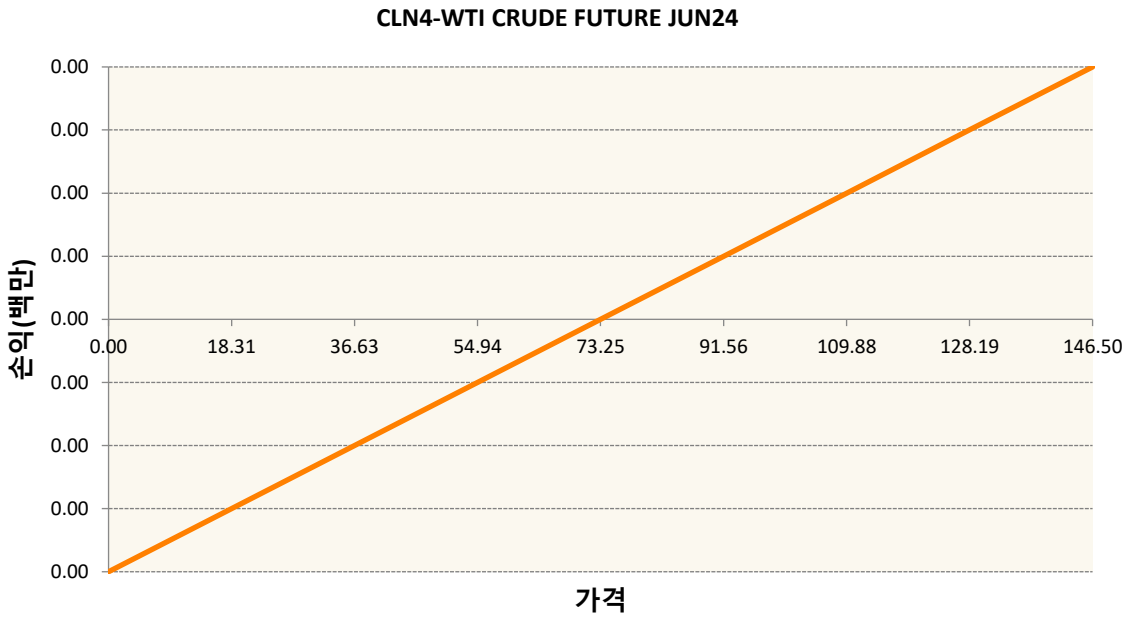
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

1. 계약금액

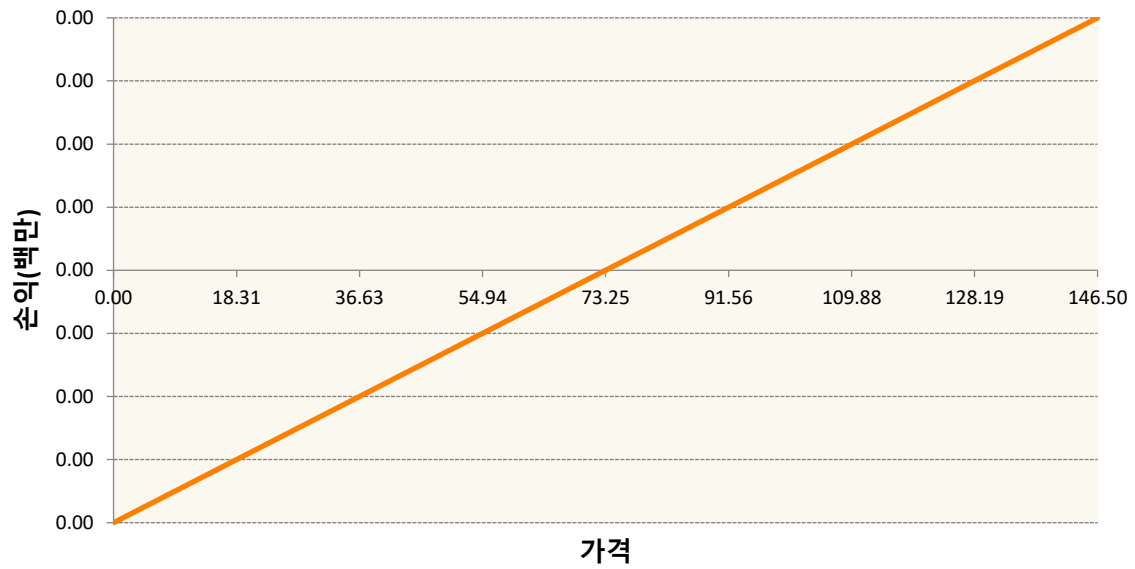
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	14	0	14	장내
누계	유가증권	선물	904	0	904	
누계	통화	선물	0	96	-96	장내

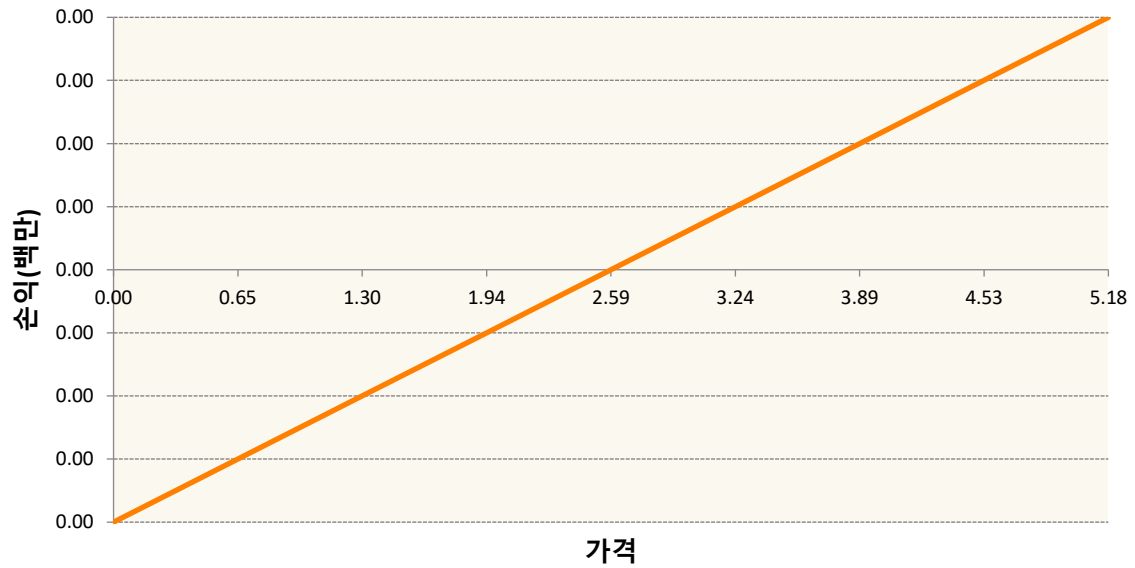
2. 만기시점의 손익구조



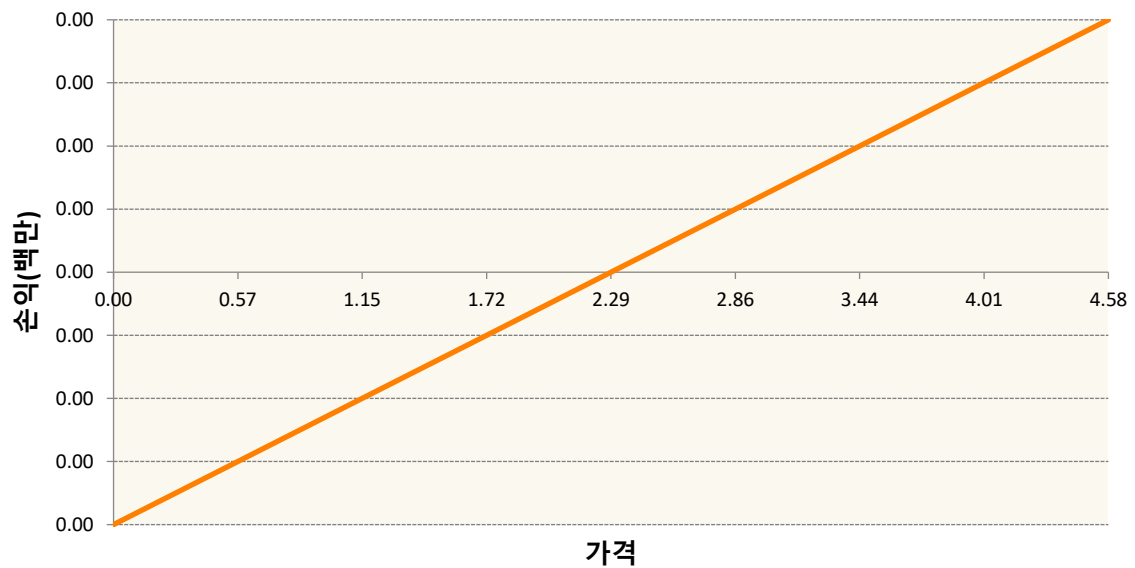
ECN4-E-mini Crude Oil Jul24



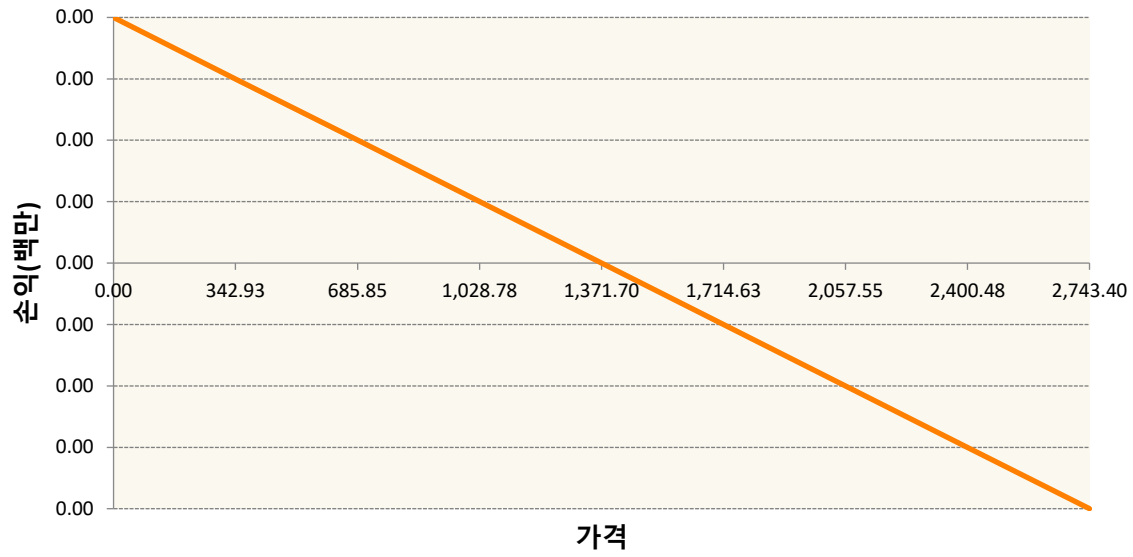
EON4-E-MINI NATURAL GAS Jul24



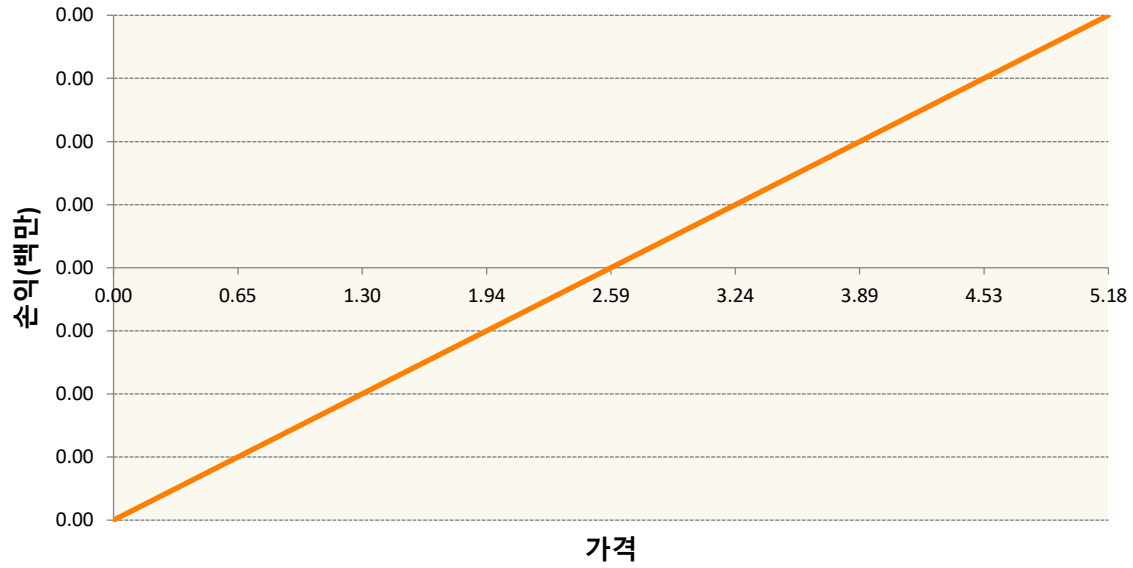
HON4-NY Harb ULSD Fut Jul24



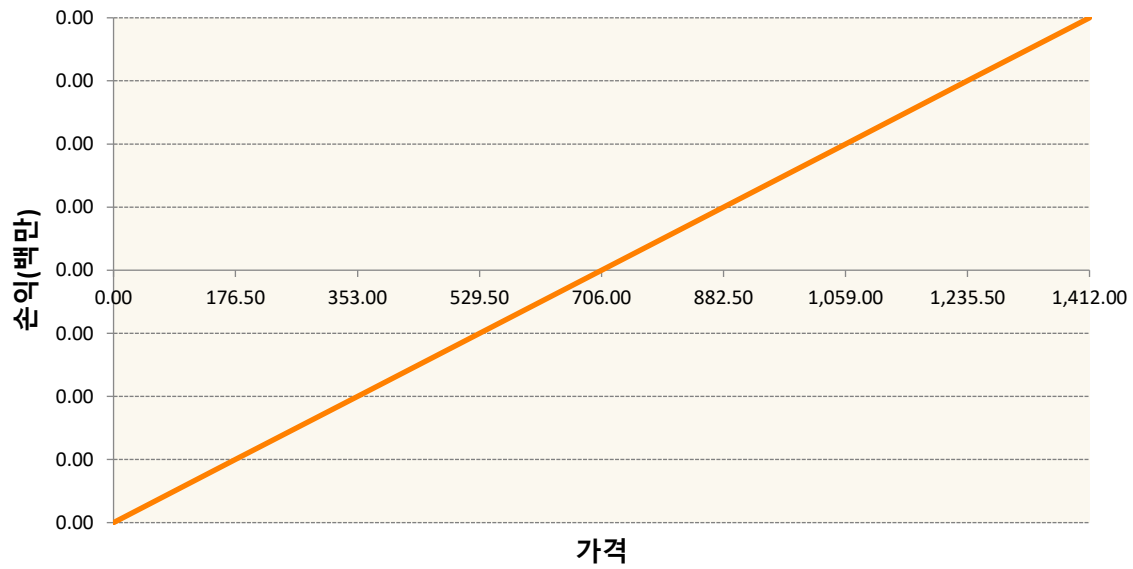
KR4175V60006-2024-06 달러선물

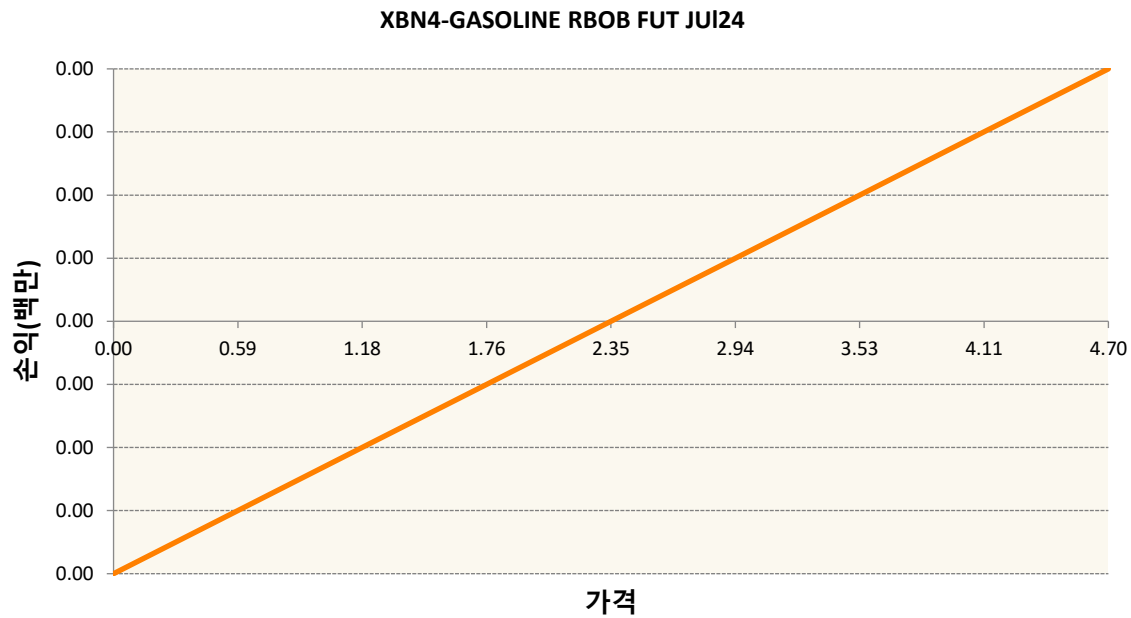


NGN24-NATURAL GAS FUTR JUL24



QSN4-Low Su Gasoil G JUL24





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
CLN4	WTI CRUDE FUTURE JUN24	8
COU4	BRENT CRUDE FUTR Sep24	17
ECN4	E-mini Crude Oil JUL24	4
EON4	E-MINI NATURAL GAS JUL24	1
HON4	NY Harb ULSD Fut Jul24	10
KR4175V600 2024-06 달러선물		8
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)
	153