

공시일 2024-06-20

기준일 2024-06-19

베스트장기채(채권-파생형)

1. 계약금액

* 해당 펀드는 파생상품을 포함하지 않음

2. 만기시점의 손익구조

* 해당 펀드는 파생상품을 포함하지 않음

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

* 해당 펀드는 파생상품을 포함하지 않음

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

* 해당 펀드는 파생상품을 포함하지 않음

공시일	2024-06-20
기준일	2024-06-19

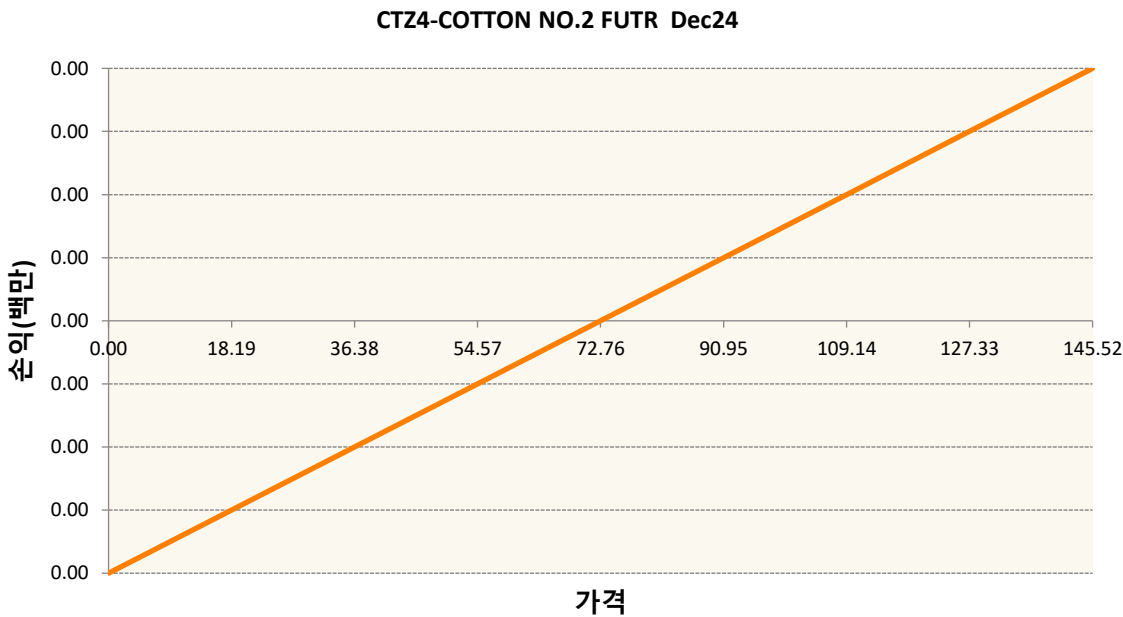
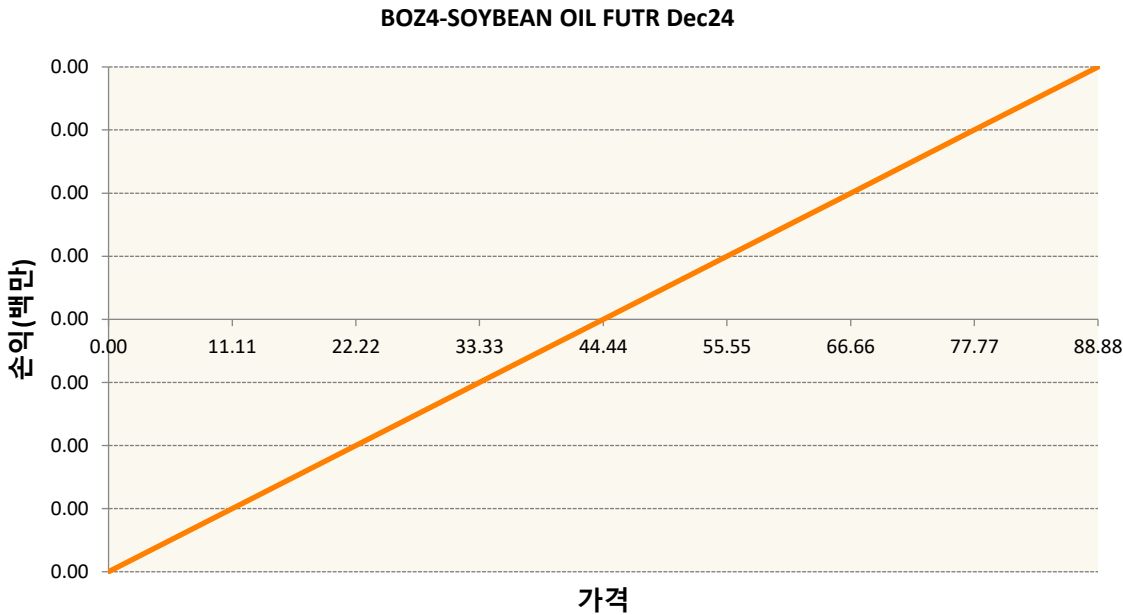
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

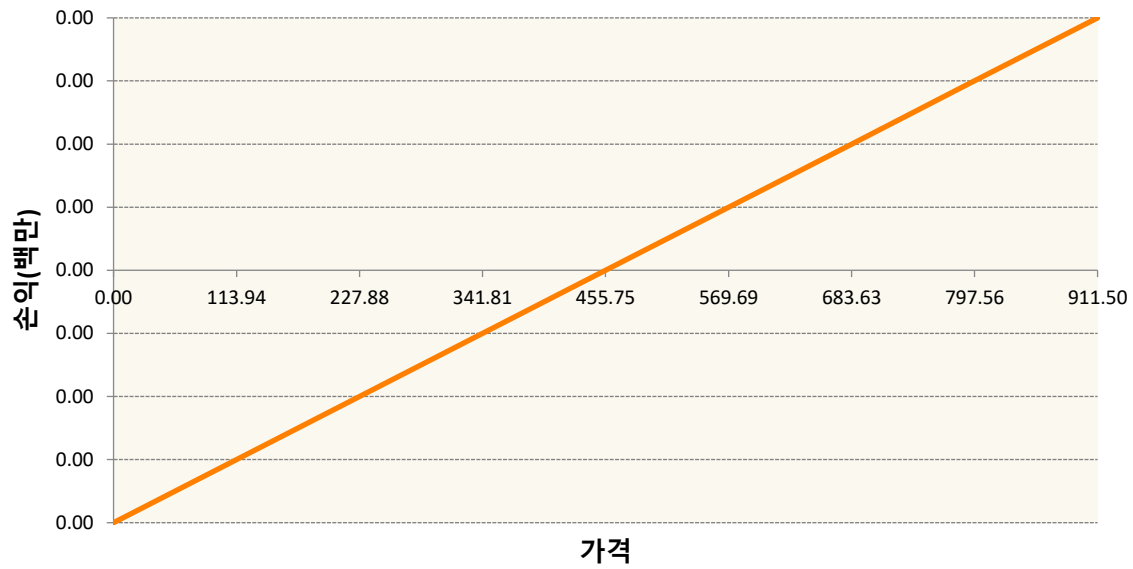
(단위:USD 백만)

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	4,180	0	4,180	
누계	통화	선물	0	400	-400	장내

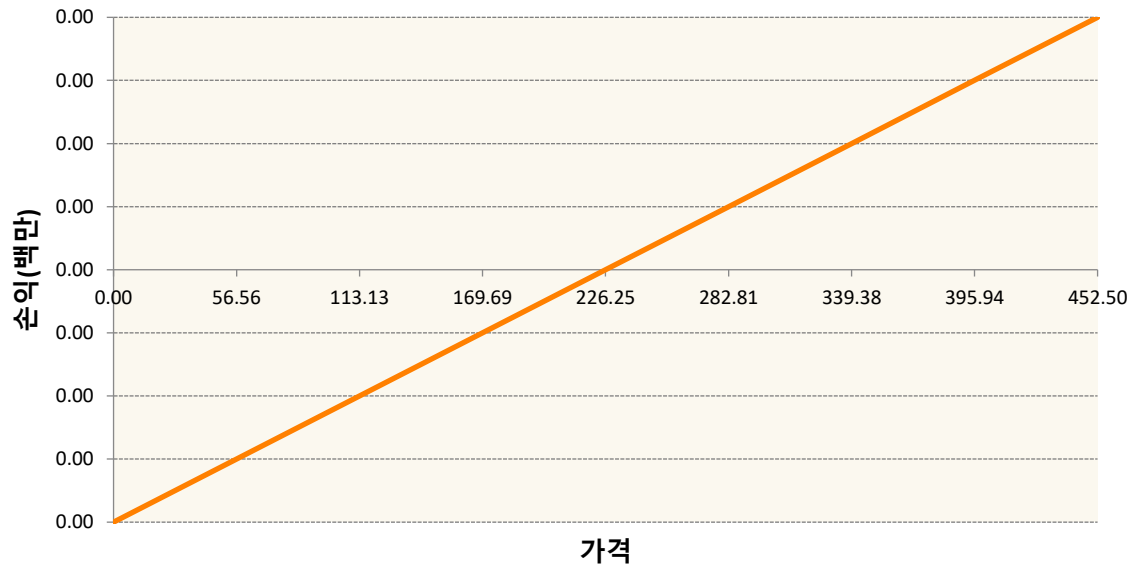
2. 만기시점의 손익구조



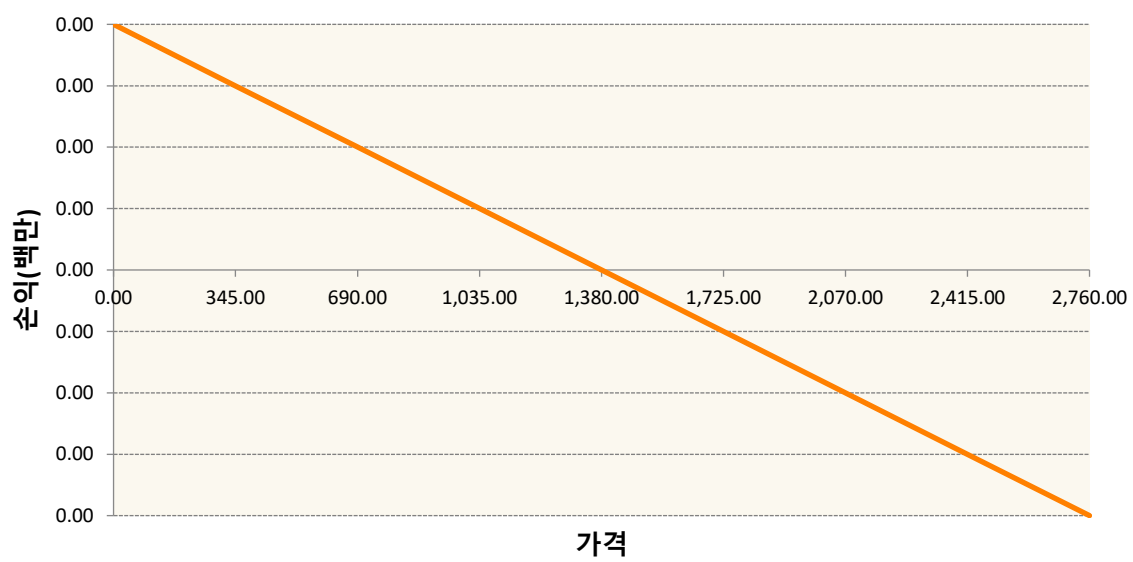
CU4-CORN FUTURE Sep24



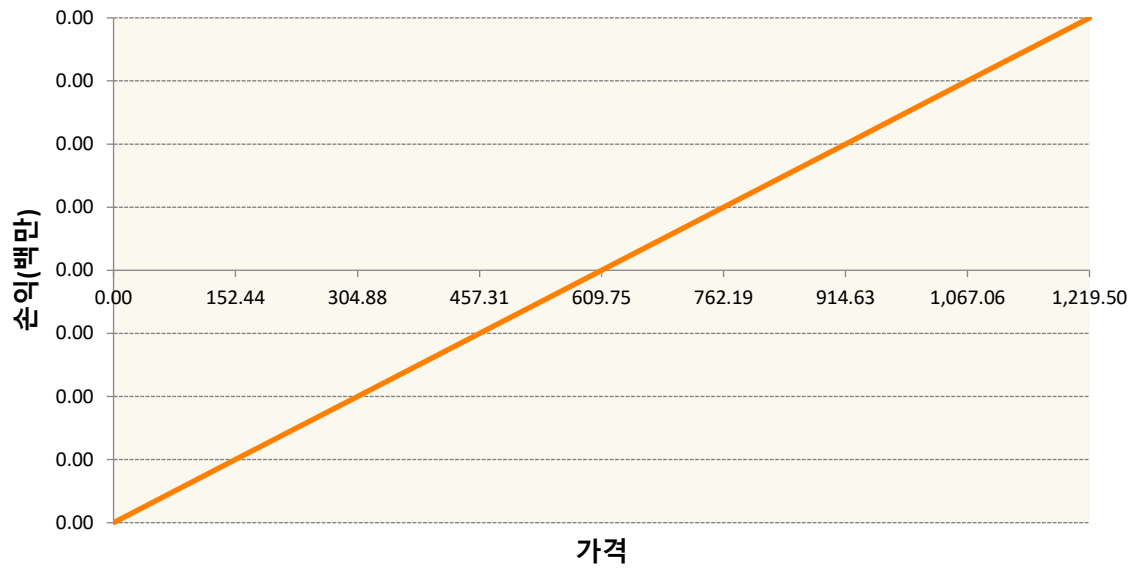
KCU4-COFFEE 'C' FUTURE Sep24



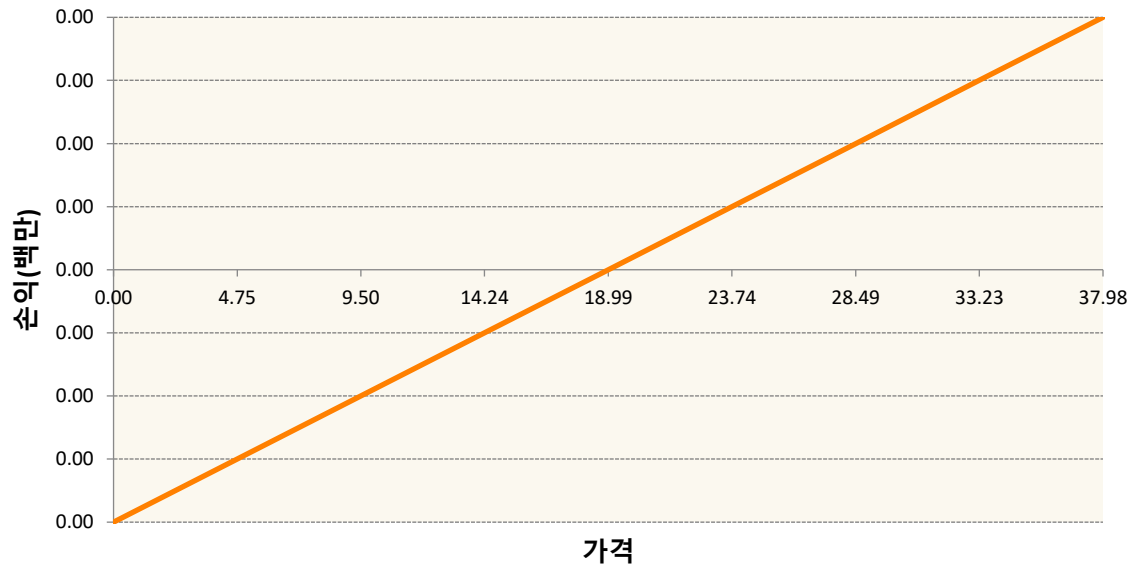
KR4175V70005-2024-07 달러선물



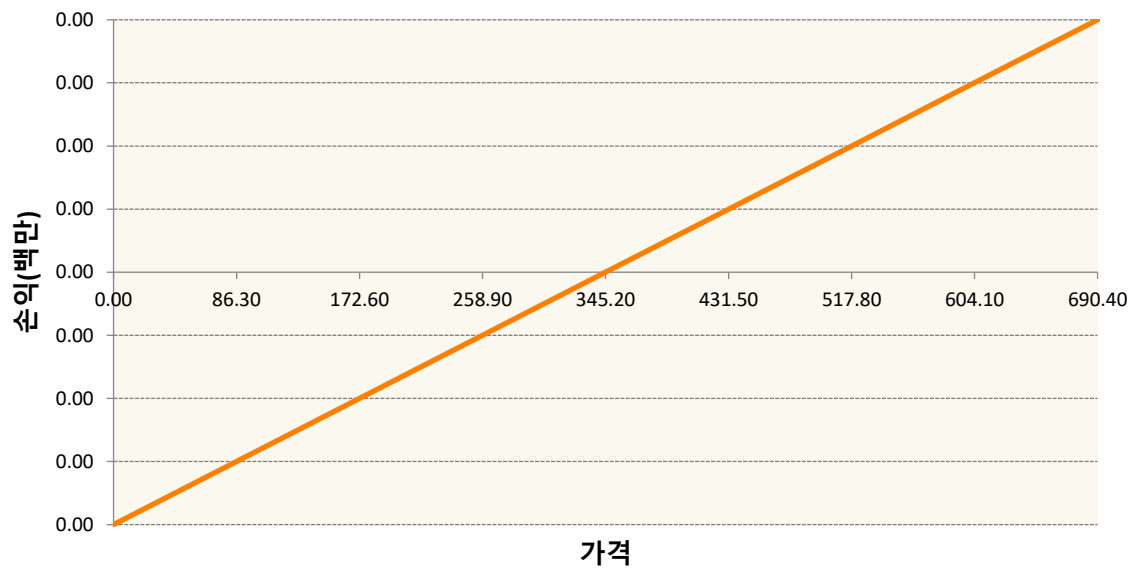
KWU4-KC HRW WHEAT FUT Sep24

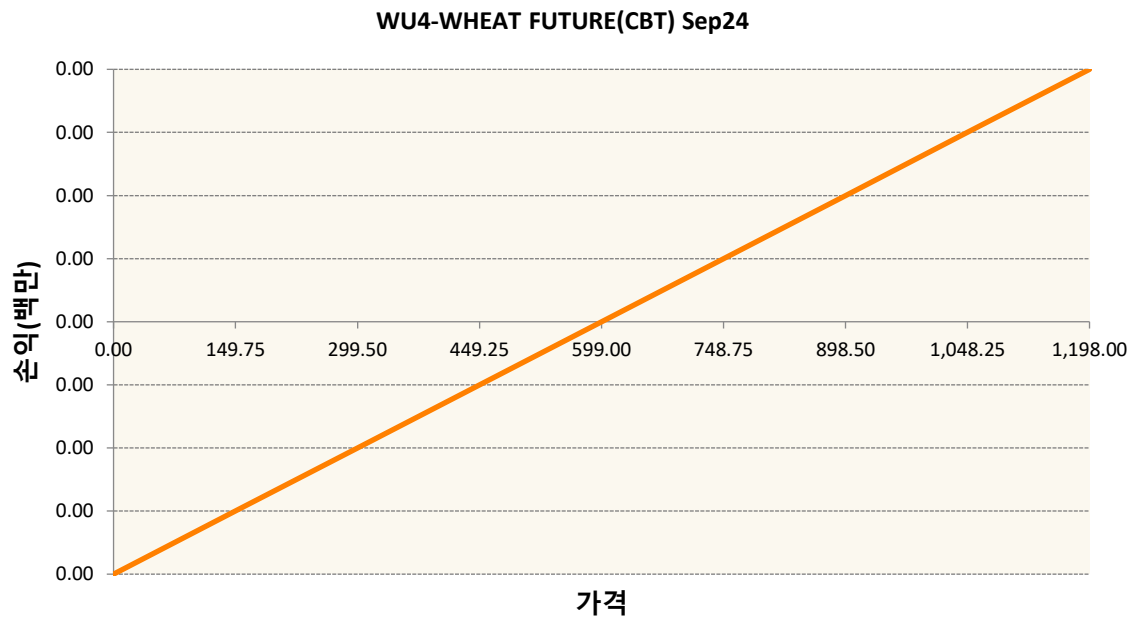
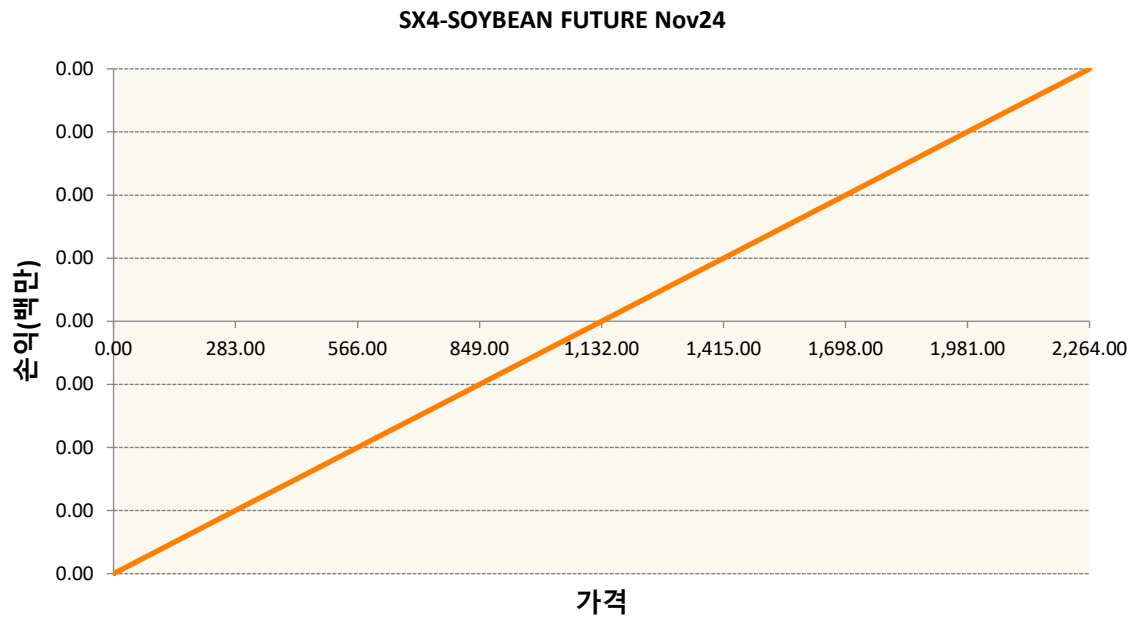


SBV4-Sugar #11 (WORLD) Oct24



SMZ4-SOYBEAN MEAL FUTR Dec24





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

공시일	2024-06-20
기준일	2024-06-19

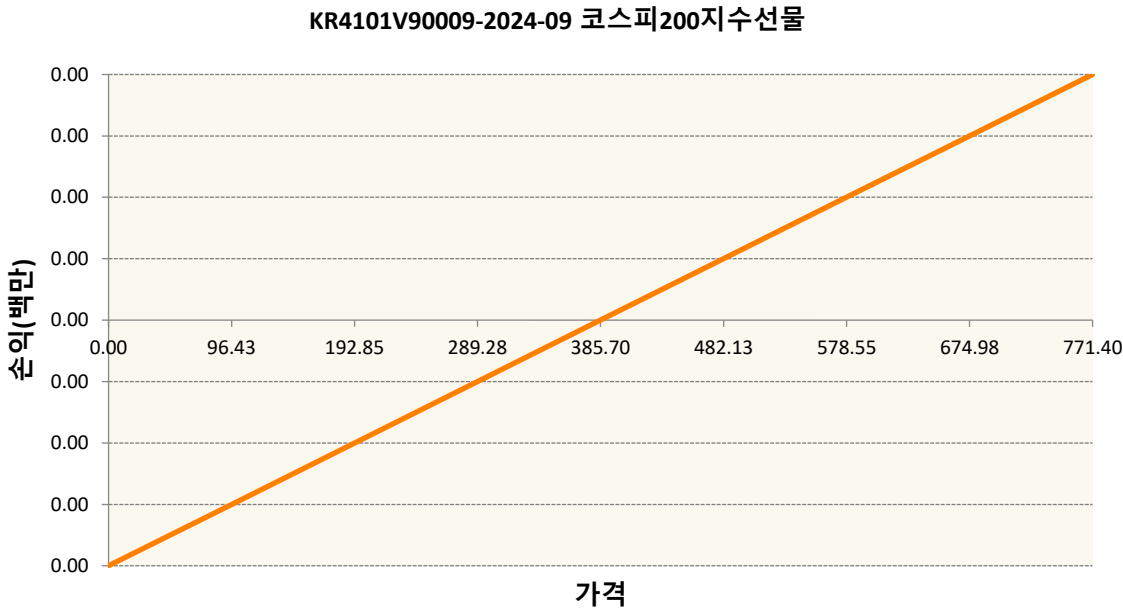
스마트인덱스모

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	96	-96	장내
누계	유가증권	선물	1,254	0	1,254	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%	-66	-66	-66	-66	-66	-66	-66
-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%	66	66	66	66	66	66	66
8.00%	100	100	100	100	100	100	100

공시일	2024-06-20
기준일	2024-06-19

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	262
-----------------------------	-----

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

317

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2024-06-20
기준일	2024-06-19

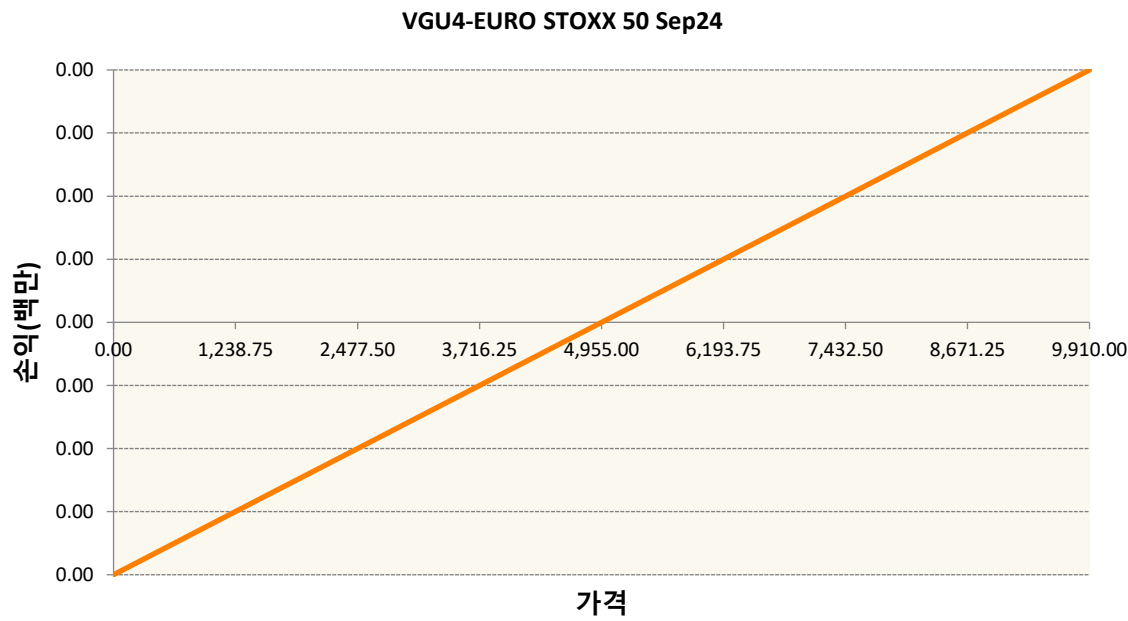
유로인덱스모(주식-파생형)

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	955	0	955	
누계	통화	선도	222	0	222	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213E3K(EUR/KRW 21-06-24E	18
VGU4 EURO STOXX 50 Sep24	76

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

(단위:백만원)

61

공시일	2024-06-20
기준일	2024-06-19

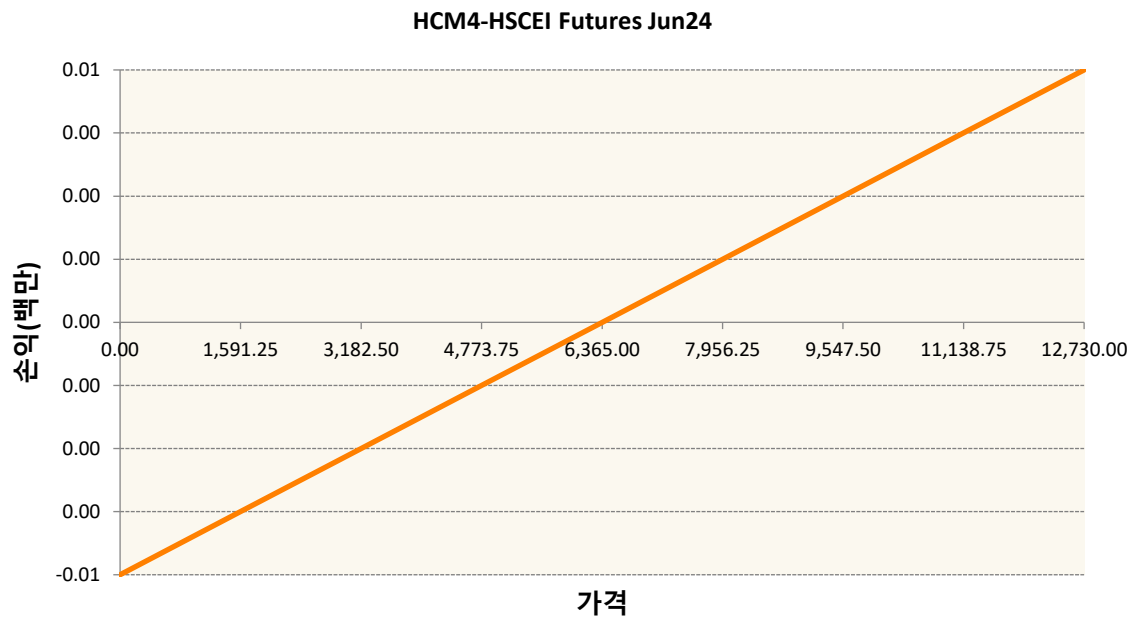
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,334	0	1,334	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCM4	HSCEI Futures Jun24	107
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

132

공시일	2024-06-20
기준일	2024-06-19

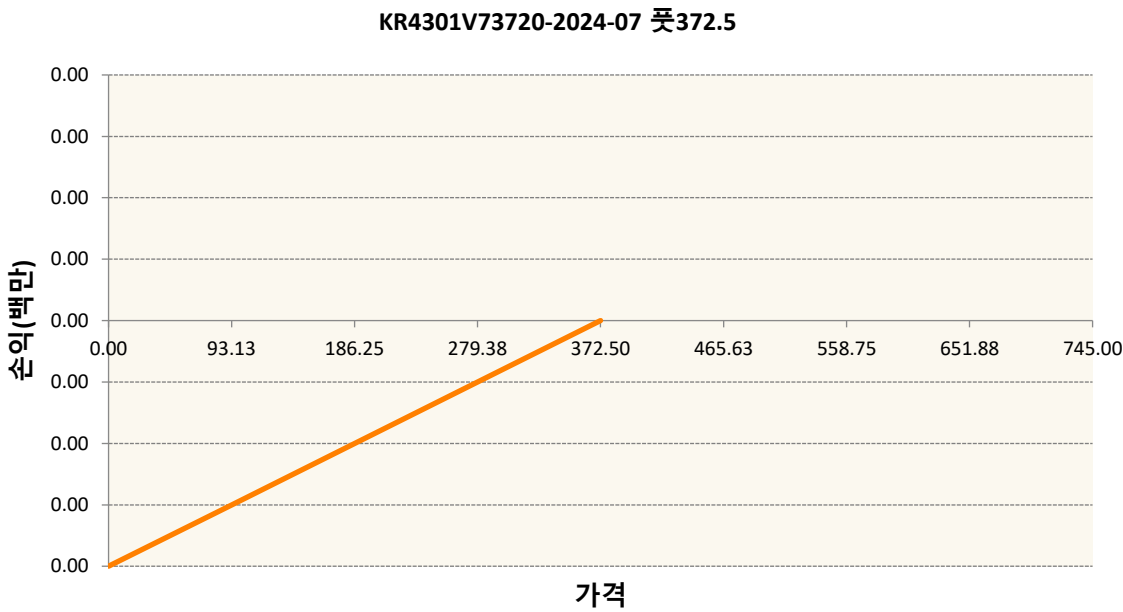
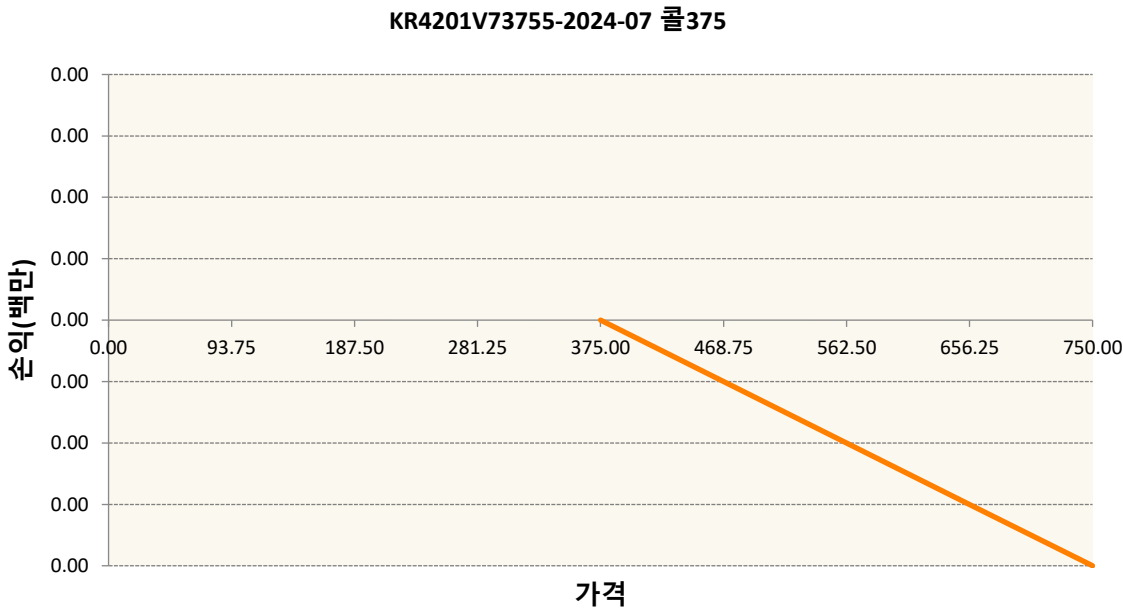
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

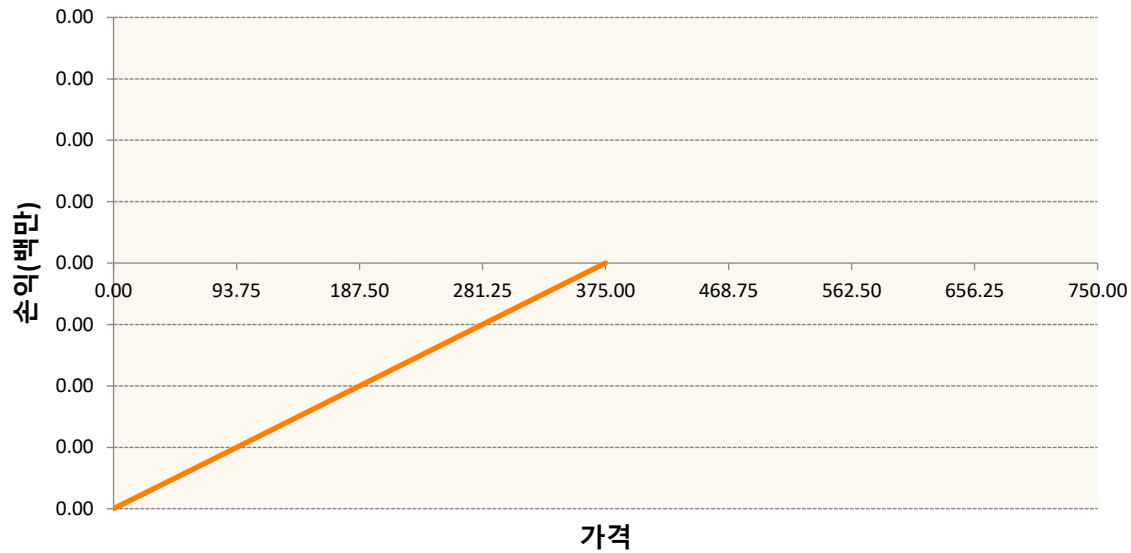
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	638	0	638	장내
누계	유가증권	옵션	0	45,438	-45,438	장내

2. 만기시점의 손익구조



KR4301V73753-2024-07 풋375



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201V73755		2024-07 콜375					2,637
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,393	1,352	1,306	1,255	1,200	1,143	1,082
-5.33%	1,205	1,138	1,068	996	922	848	772
-2.67%	831	748	665	582	499	415	332
0%	236	158	80	0	-80	-161	-243
2.67%	-554	-610	-671	-735	-802	-872	-943
5.33%	-1,475	-1,508	-1,546	-1,590	-1,639	-1,693	-1,749
8.00%	-2,466	-2,481	-2,502	-2,528	-2,560	-2,596	-2,637
KR4301V73720		2024-07 풋372.5					237
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-222	-224	-226	-228	-231	-234	-237
-5.33%	-108	-113	-117	-122	-127	-133	-138
-2.67%	-26	-32	-38	-45	-51	-57	-64
0%	14	10	5	0	-5	-10	-16
2.67%	25	24	22	20	17	13	10
5.33%	27	27	27	26	25	23	22
8.00%	28	28	28	27	27	27	26
KR4301V73753		2024-07 풋375					153
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-146	-147	-148	-149	-150	-152	-153
-5.33%	-75	-78	-80	-83	-85	-88	-91
-2.67%	-20	-24	-28	-32	-35	-39	-43
0%	10	7	3	0	-3	-7	-10

2.67%	20	18	17	15	13	11	8
5.33%	22	21	21	20	19	18	17
8.00%	22	22	22	21	21	21	20

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

(단위:백만원)

3,018

공시일	2024-06-20
기준일	2024-06-19

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	1,160	0	1,160	

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	2024-06-20
기준일	2024-06-19

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	4,169	0	4,169	

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	2024-06-20
기준일	2024-06-19

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	14,907	0	14,907	
누계	통화	선도	207	15,179	-14,972	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213E3TC KRW/USD 28-06-24E	426
FXW213E4SC KRW/USD 31-07-24E	197
FXW213E5W KRW/USD 30-08-24E	591
FXW213E65C USD/KRW 28-06-24E	17
IE00BD8RGM75	

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

568

공시일	2024-06-20
기준일	2024-06-19

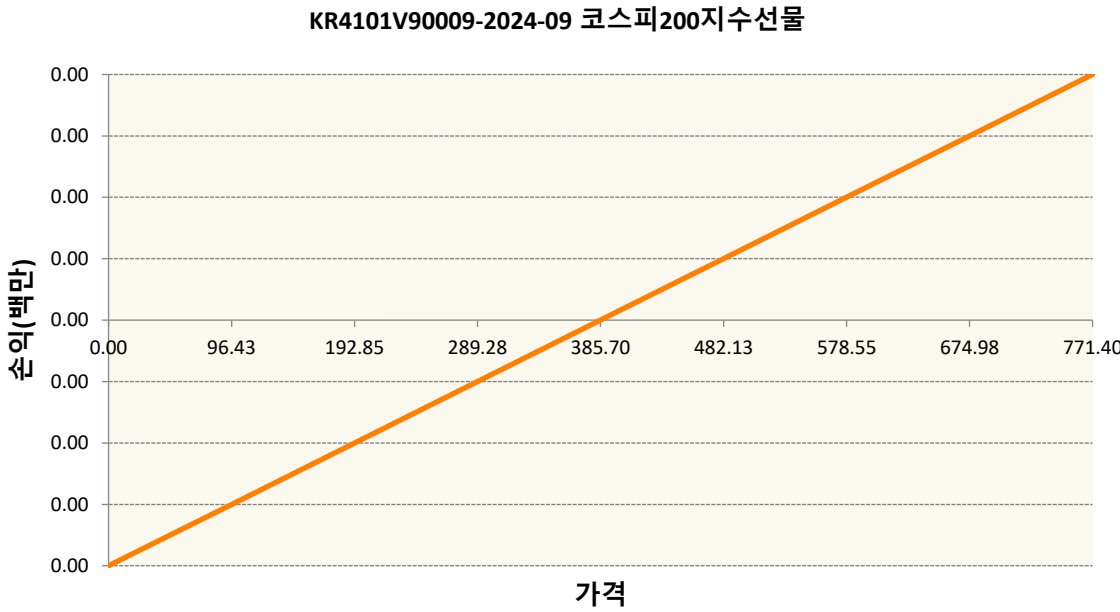
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

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	1,061	0	1,061	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101V90009			2024-09 코스피200지수선물				84
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-84	-84	-84	-84	-84	-84	-84
-5.33%	-56	-56	-56	-56	-56	-56	-56
-2.67%	-28	-28	-28	-28	-28	-28	-28
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	28	28	28	28	28	28	28
5.33%	56	56	56	56	56	56	56
8.00%	84	84	84	84	84	84	84

공시일	2024-06-20
기준일	2024-06-19

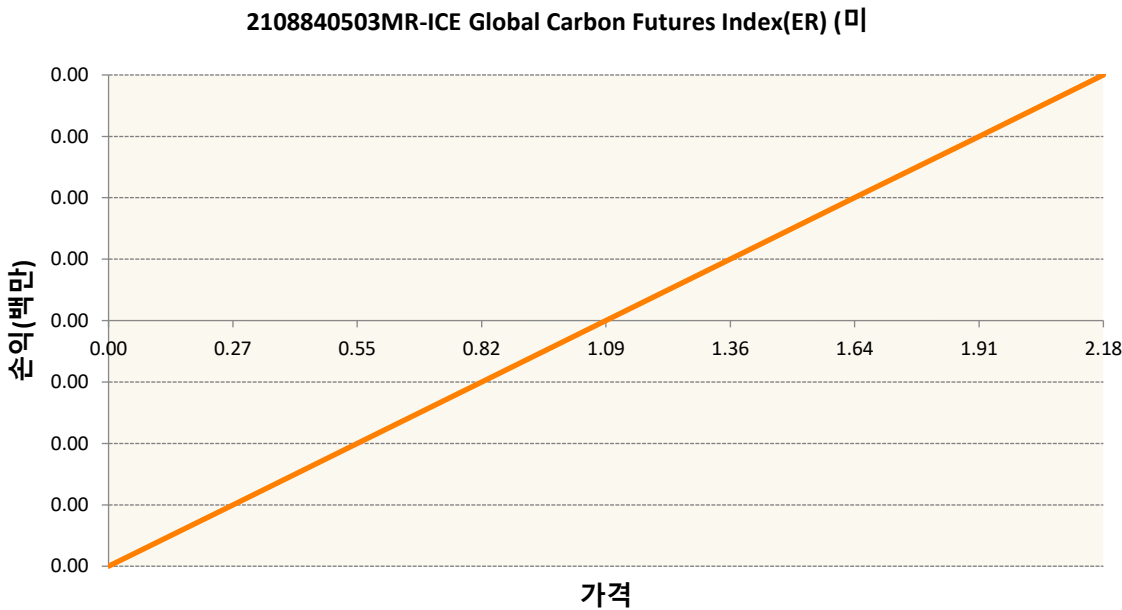
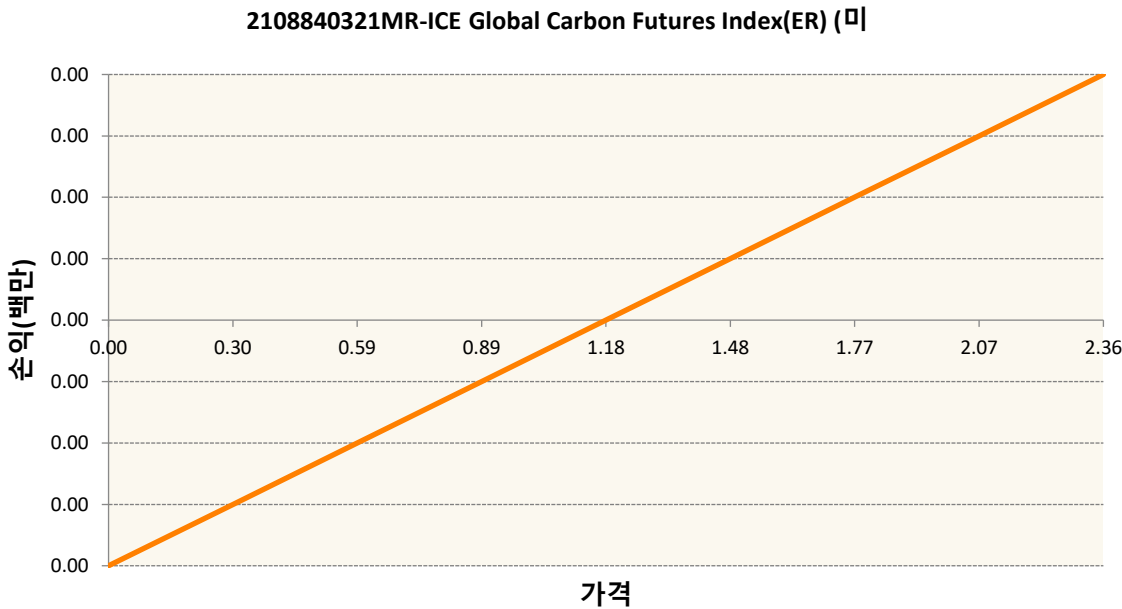
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

1. 계약금액

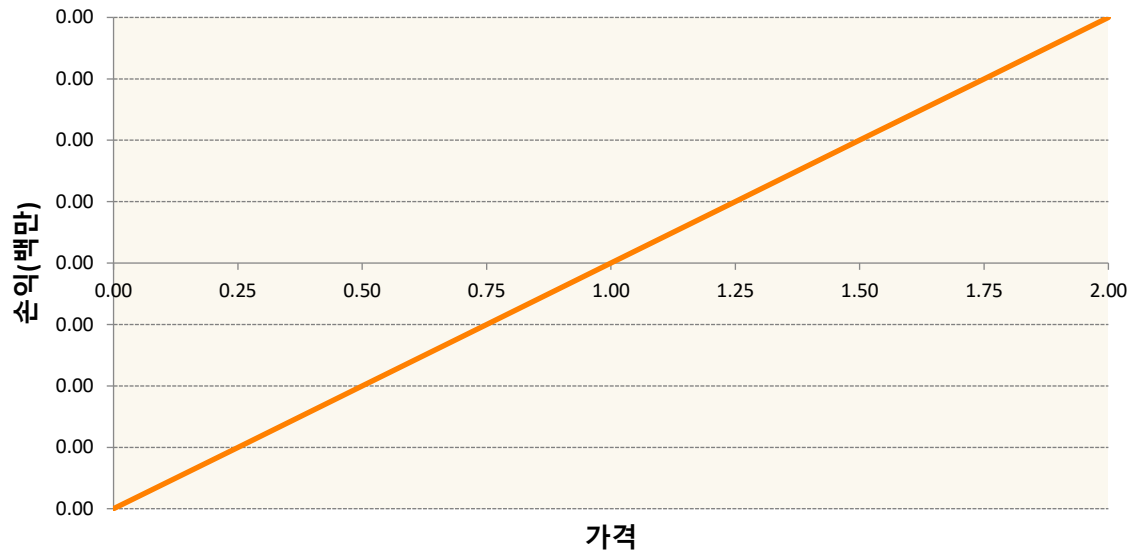
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	16,601	0	16,601	

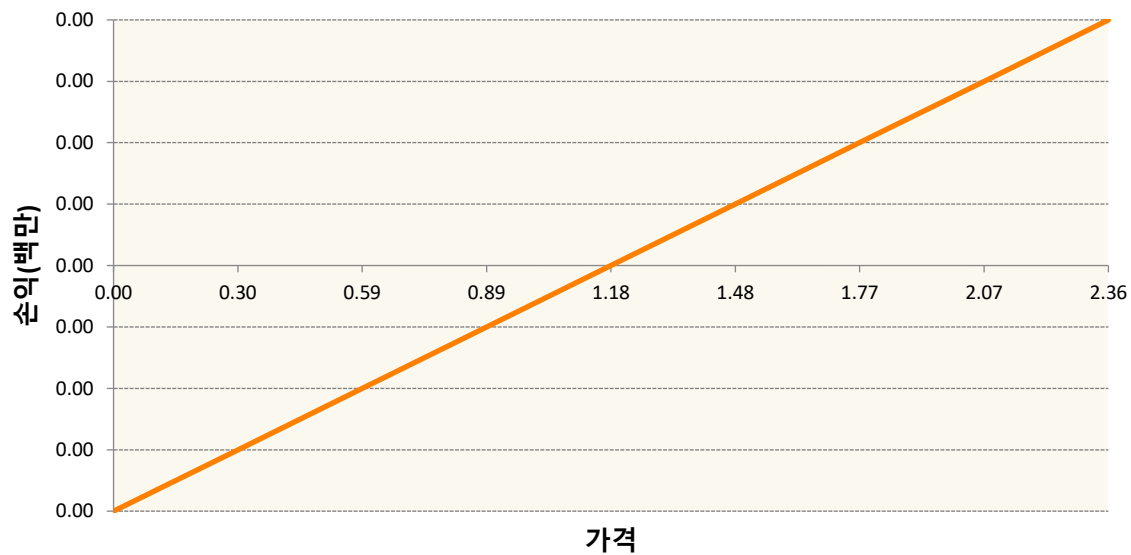
2. 만기시점의 손익구조



2108840610KM-ICE Global Carbon Futures Index(ER) (키



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



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2108840321IICE Global Carbon Futures Index(ER) (미
2108840503IICE Global Carbon Futures Index(ER) (미
2108840610IICE Global Carbon Futures Index(ER) (키
2108840920IICE Global Carbon Futures Index(ER) (메

510
204
408
204

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

(단위:백만원)

1,530

공시일	2024-06-20
기준일	2024-06-19

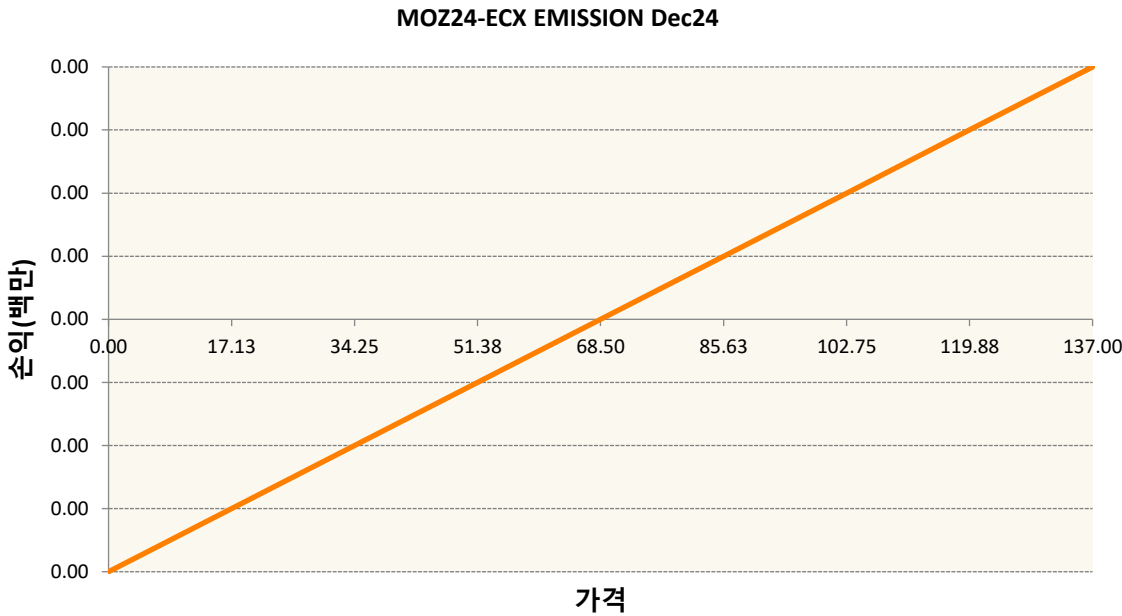
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	9,198	0	9,198	
누계	지수	스왑	331	0	331	장외
누계	통화	선도	0	2,284	-2,284	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213E5W KRW/EUR 28-06-24E	85
FXW213E5W KRW/EUR 28-06-24E	98
MOZ24 ECX EMISSION Dec24	736
SWICEUACN ICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX	3

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

(단위:백만원)

1,408

공시일	2024-06-20
기준일	2024-06-19

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)	17
SWCSI00000 신한CSI Index 230622 (메리츠)	17
SWCSI00000 신한CSI Index 230922 (키움)	12
SWCSI00000 신한CSI Index 231013 (NH)	12

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

(단위:백만원)

81

공시일	2024-06-20
기준일	2024-06-19

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)	8
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(NH)	7
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(메리츠)	9
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(키움)	2

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

(단위:백만원)

29

공시일	2024-06-20
기준일	2024-06-19

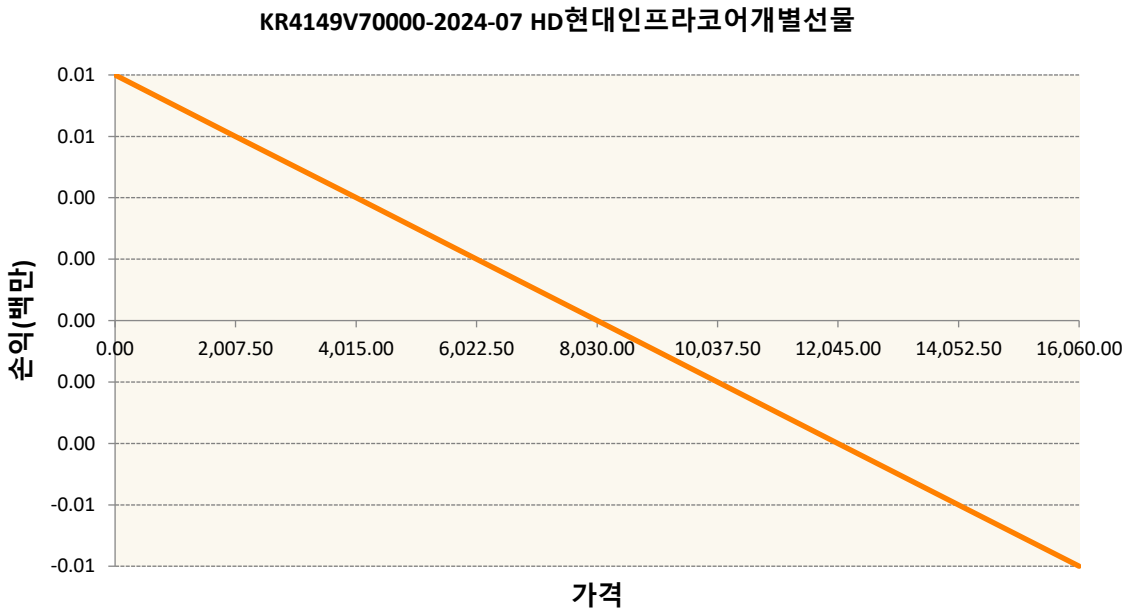
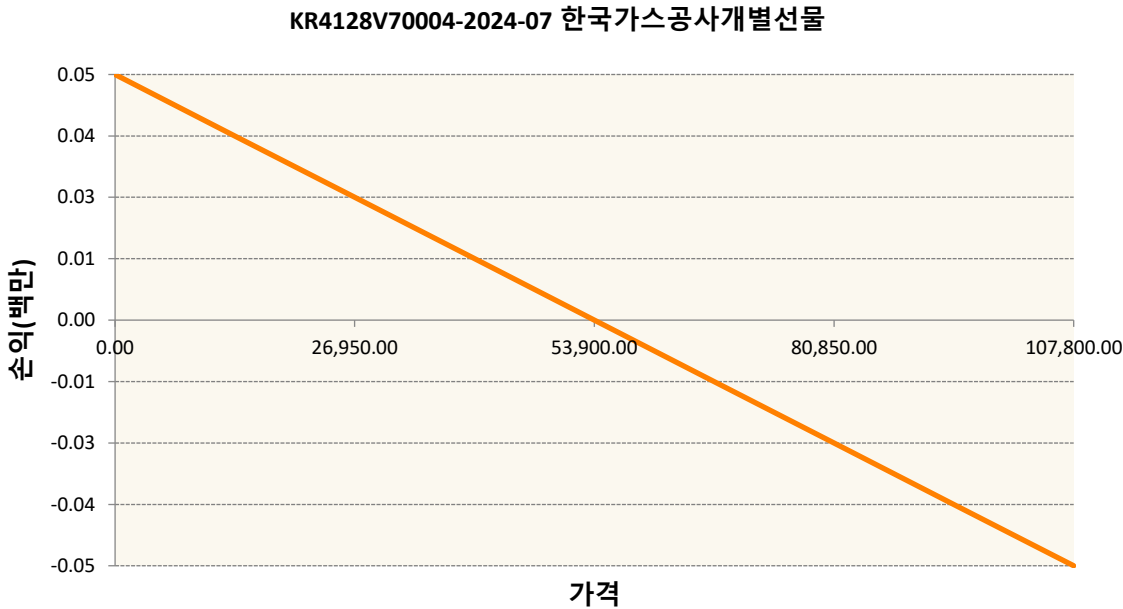
에쿼티알파일반사모혼합자산

1. 계약금액

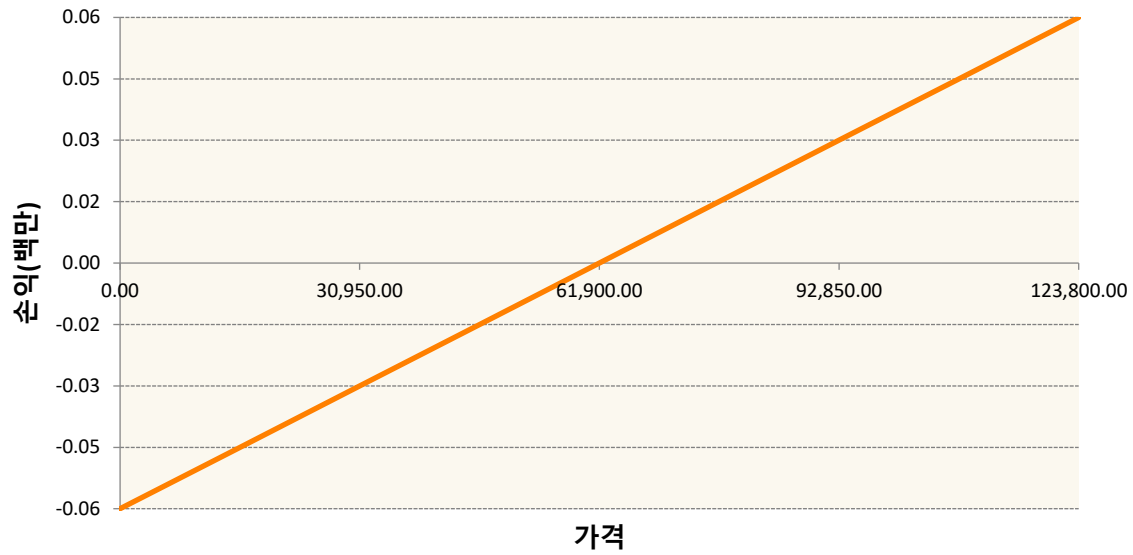
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	2	25	-23	장내
누계	유가증권	선물	65	87	-22	장내

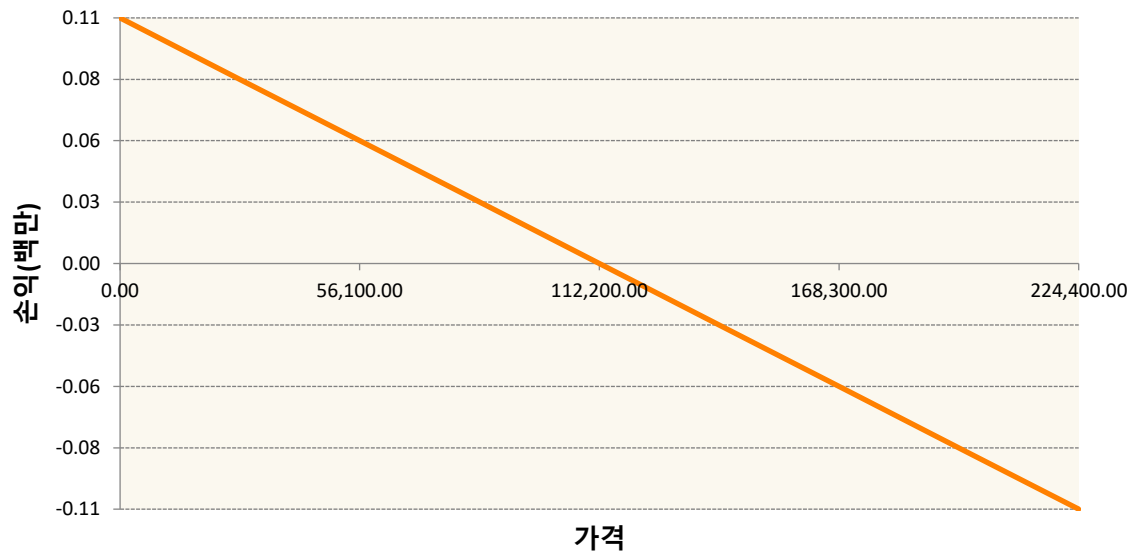
2. 만기시점의 손익구조



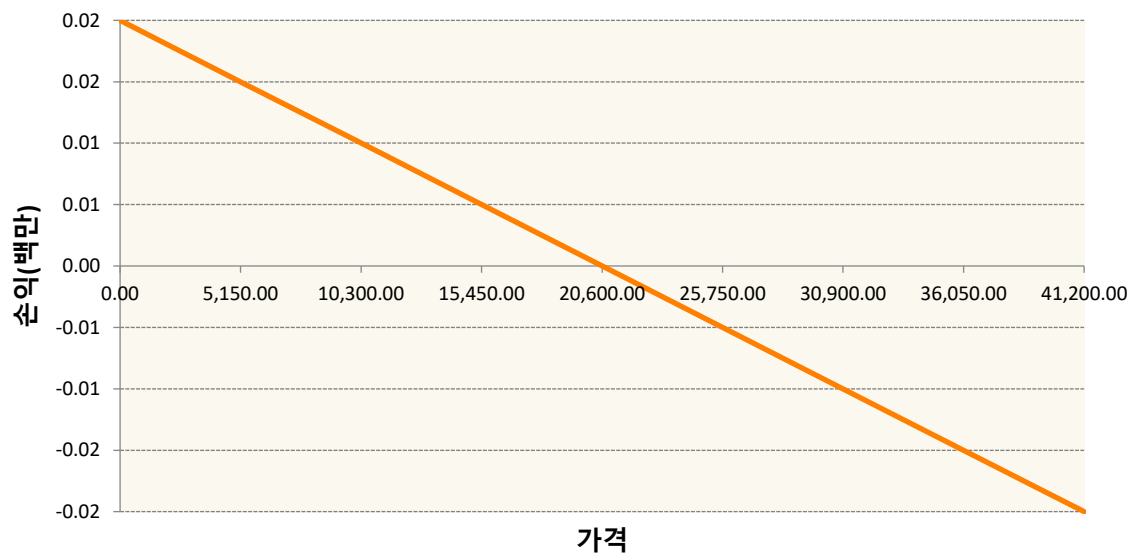
KR41B7V70006-2024-07 포스코인터내셔널개별선물



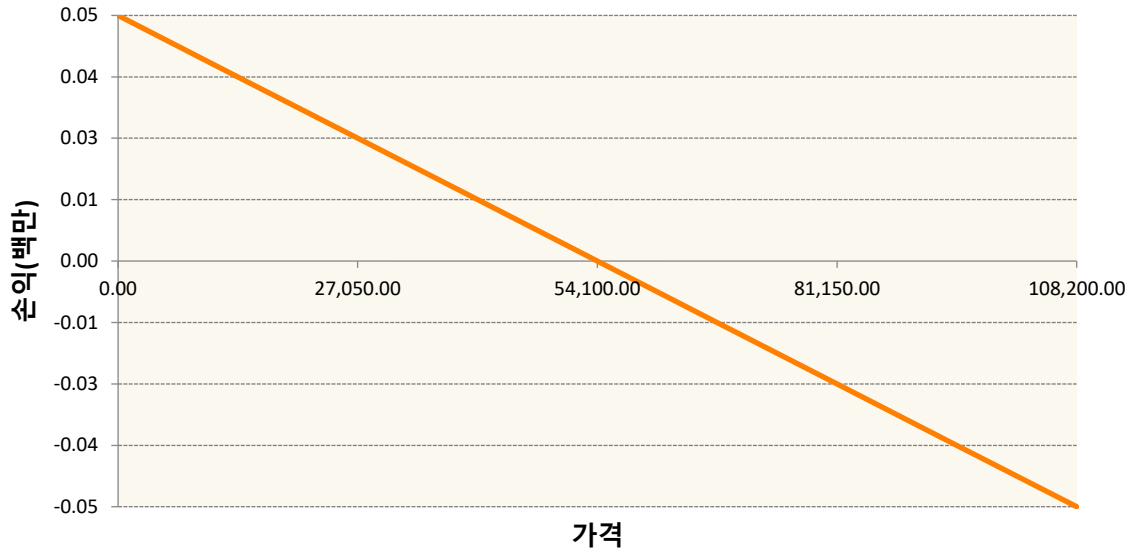
KR41BBV70007-2024-07 롯데케미칼개별선물



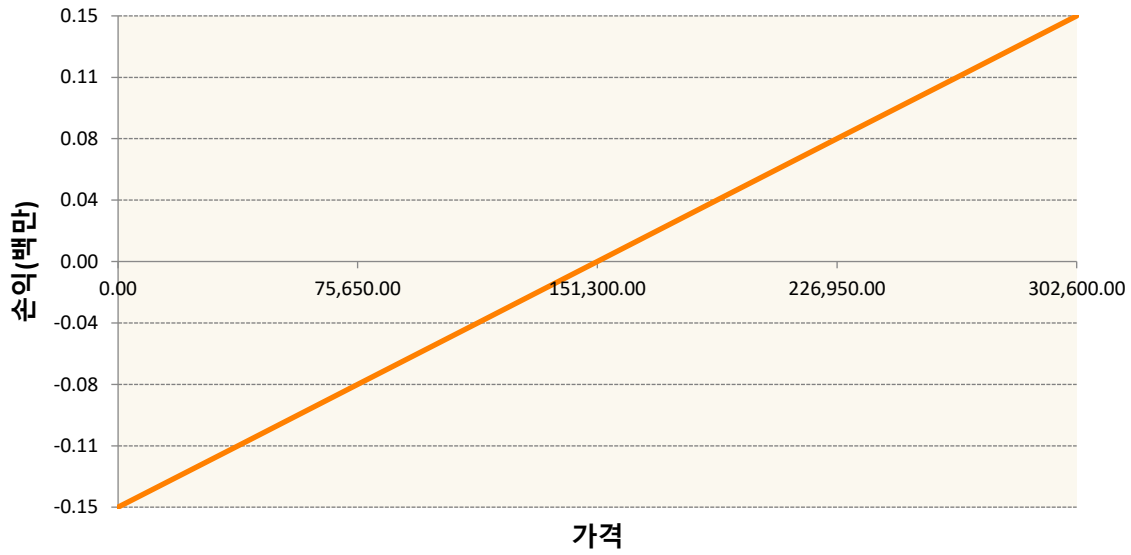
KR41BKV70008-2024-07 하이트진로개별선물



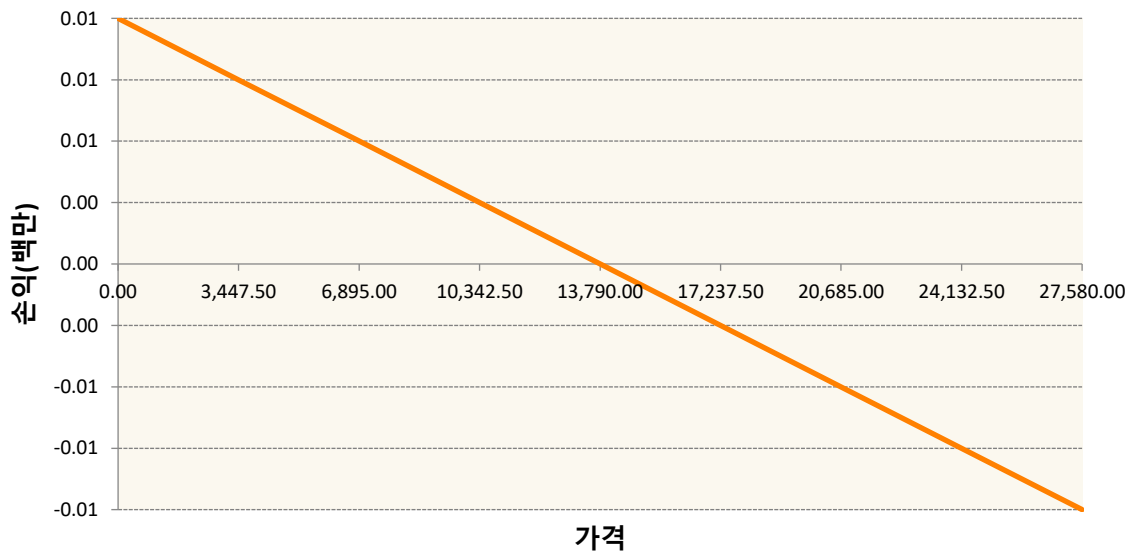
KR41BMV70004-2024-07 한국항공우주개별선물



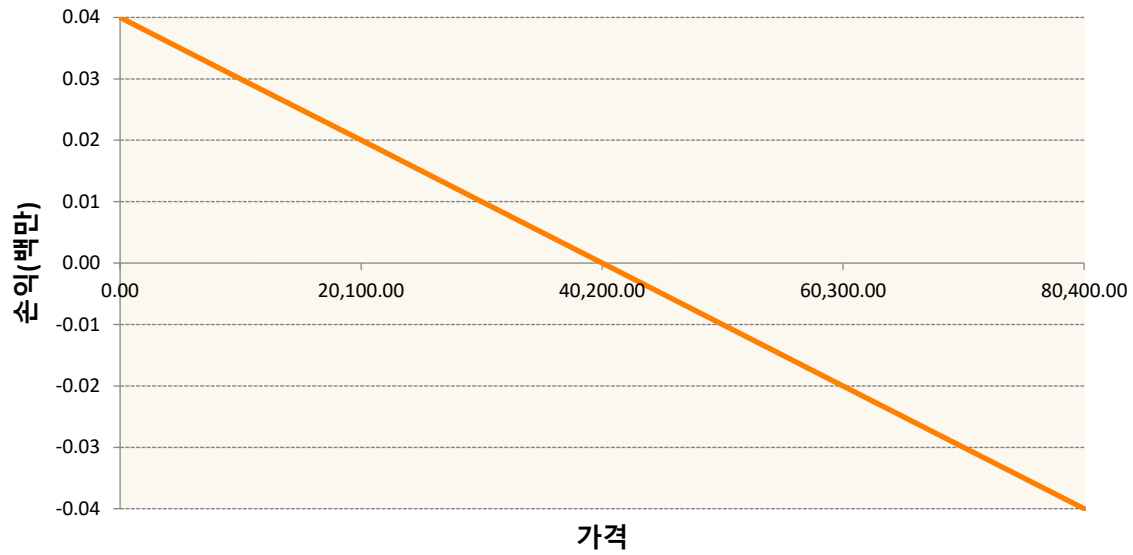
KR41C3V70004-2024-07 금호석유개별선물



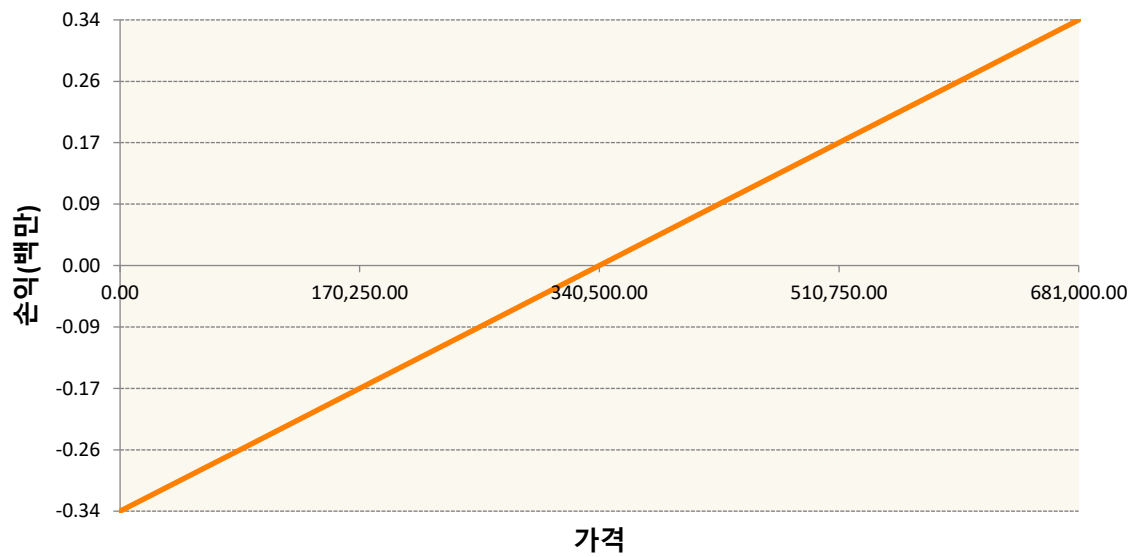
KR41CGV70004-2024-07 파라다이스개별선물



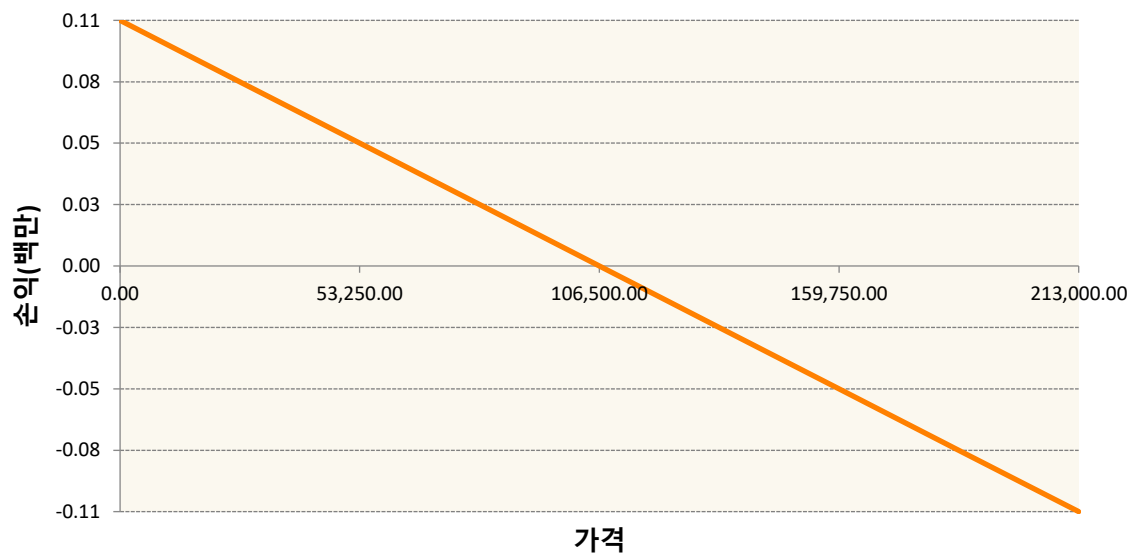
KR41CNV70000-2024-07 포스코DX개별선물



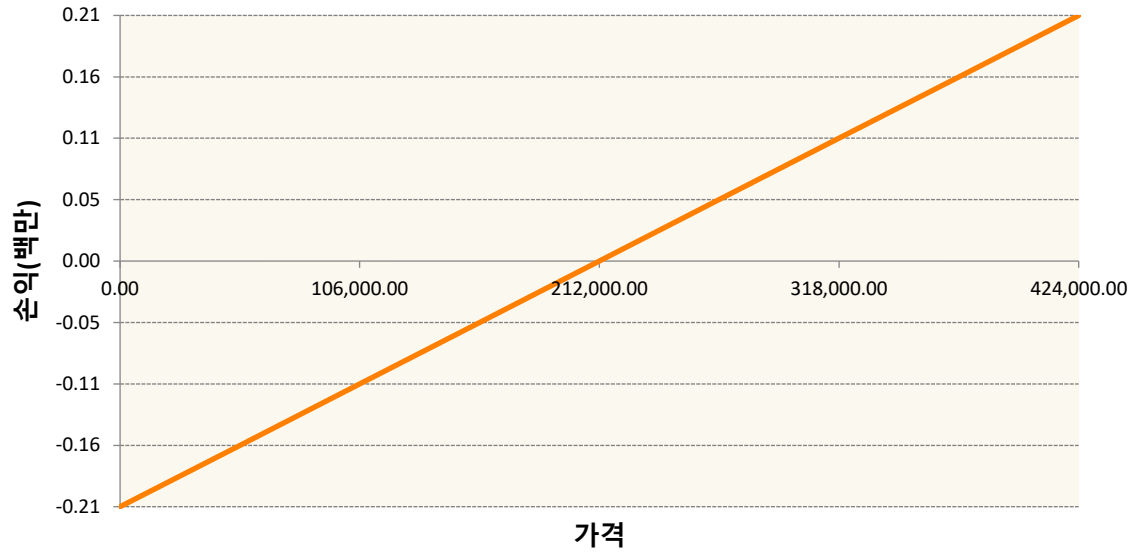
KR41CTV70007-2024-07 삼성화재개별선물



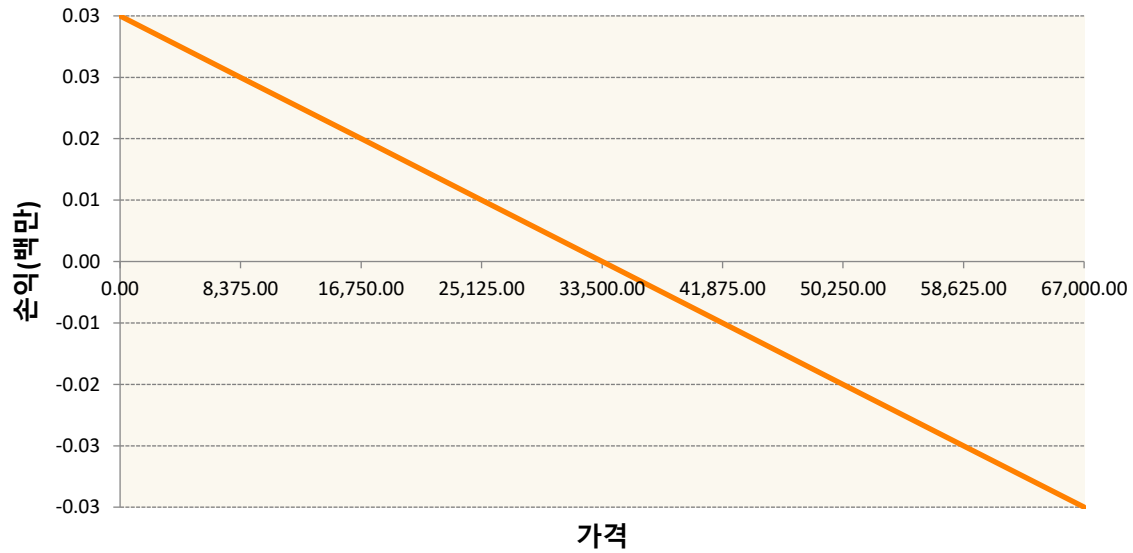
KR41D0V70009-2024-07 DB손해보험개별선물



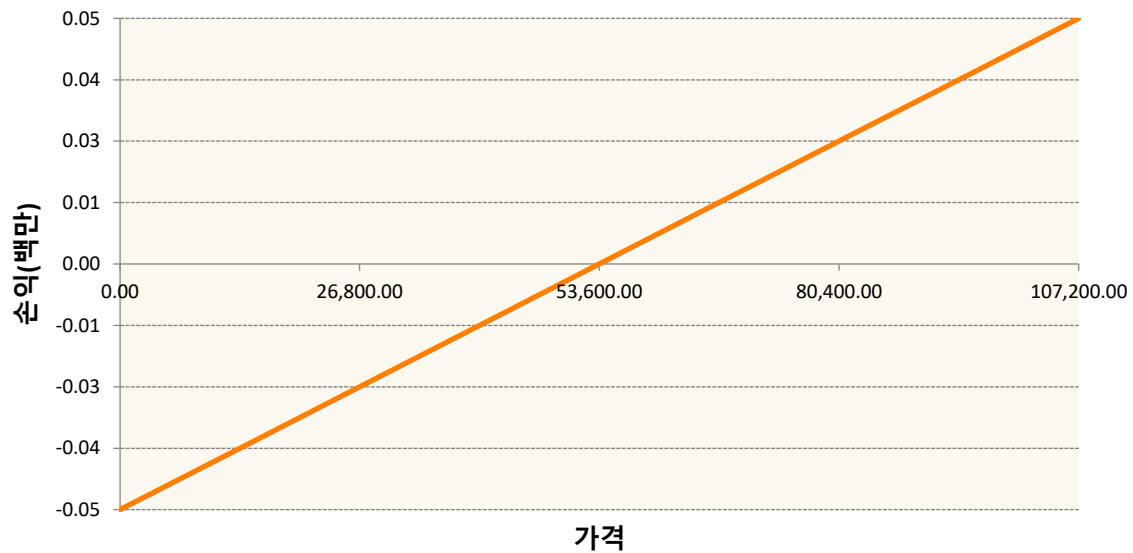
KR41DBV70003-2024-07 LIG넥스원개별선물



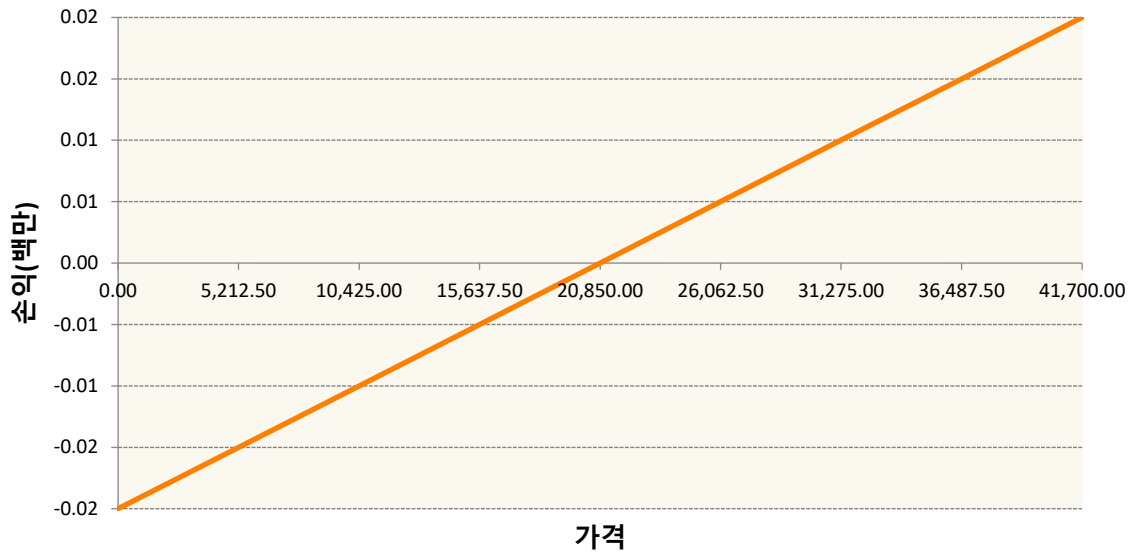
KR41DGV70002-2024-07 영원무역개별선물



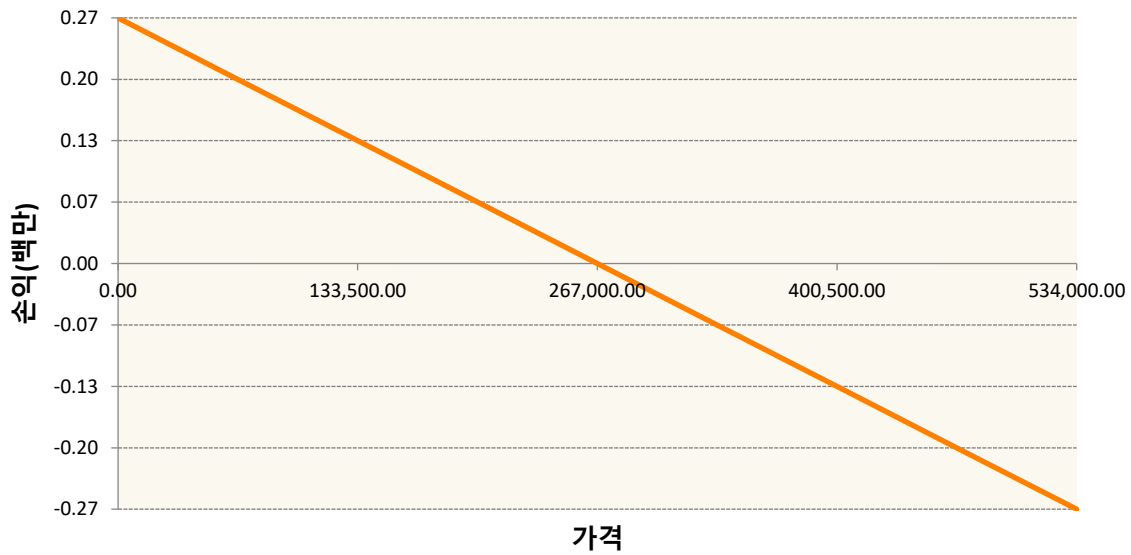
KR41DWV70009-2024-07 두산밥캣개별선물



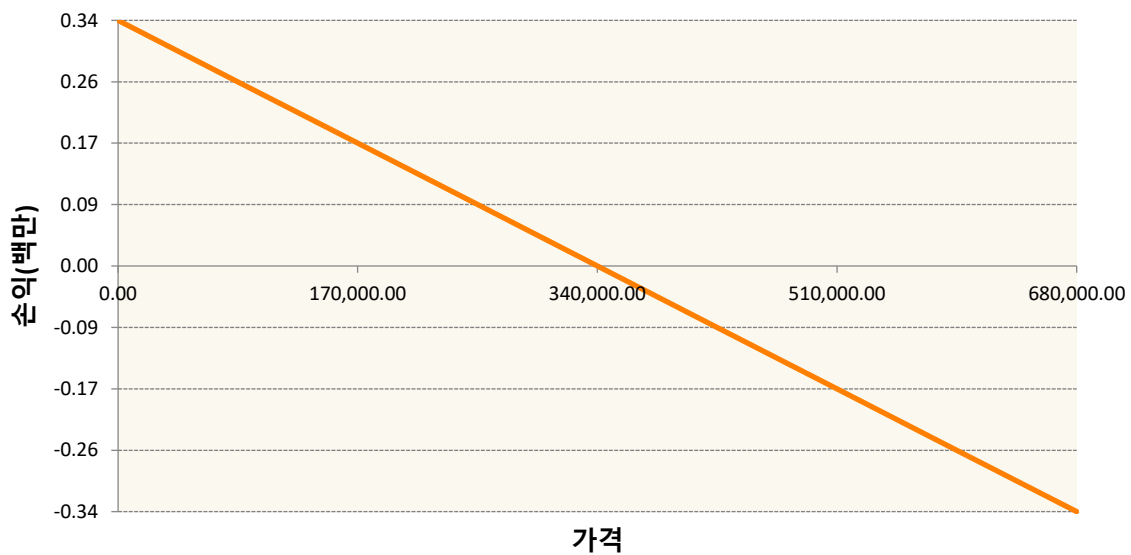
KR41DZV70002-2024-07 한세실업개별선물



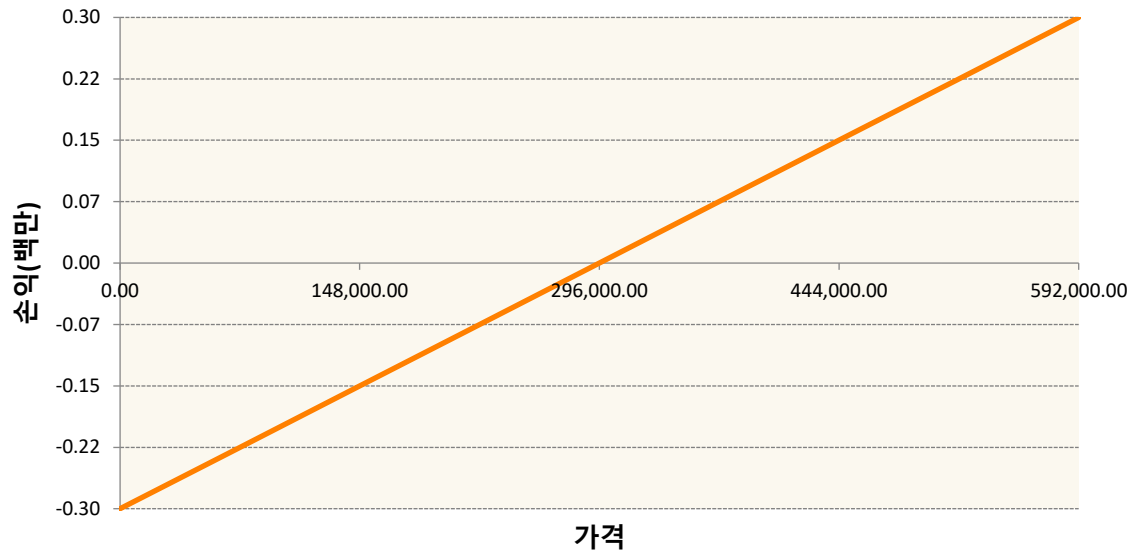
KR41E8V70001-2024-07 포스코퓨처엠개별선물



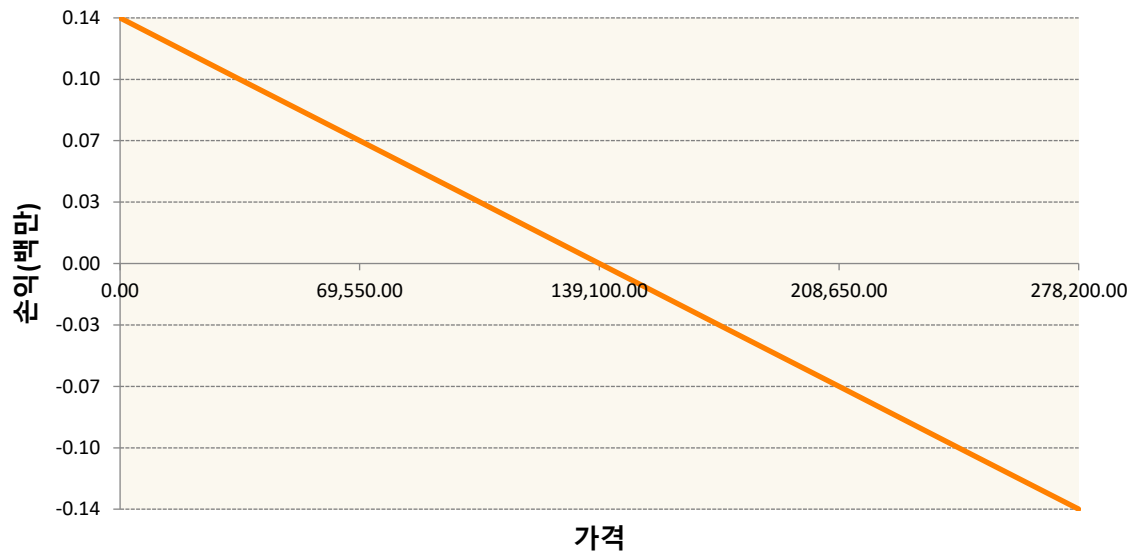
KR41F5V70006-2024-07 LG에너지솔루션개별선물



KR41GHV70003-2024-07 HD현대일렉트릭개별선물



KR41GWV70002-2024-07 롯데칠성개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4128V700 2024-07 한국가스공사개별선물	0.43
KR4149V700 2024-07 HD현대인프라코어개별선물	2
KR41B7V700 2024-07 포스코인터내셔널개별선물	0.35
KR41BBV700 2024-07 롯데케미칼개별선물	1
KR41BKV700 2024-07 하이트진로개별선물	0.38
KR41BMV700 2024-07 한국항공우주개별선물	1
KR41C3V700 2024-07 금호석유개별선물	0.48
KR41CGV700 2024-07 파라다이스개별선물	0.4
KR41CNV700 2024-07 포스코DX개별선물	1
KR41CTV700 2024-07 삼성화재개별선물	1
KR41D0V700 2024-07 DB손해보험개별선물	1
KR41DBV700 2024-07 LIG넥스원개별선물	1

KR41DGV70(2024-07 영원무역개별선물	1
KR41DWV70 2024-07 두산밥캣개별선물	2
KR41DZV70(2024-07 한세실업개별선물	1
KR41E8V700 2024-07 포스코퓨처엠개별선물	0.21
KR41F5V700 2024-07 LG에너지솔루션개별선물	0.27
KR41GHV70(2024-07 HD현대일렉트릭개별선물	1
KR41GWV70 2024-07 롯데칠성개별선물	0.45

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

(단위:백만원)

28

공시일	2024-06-20
기준일	2024-06-19

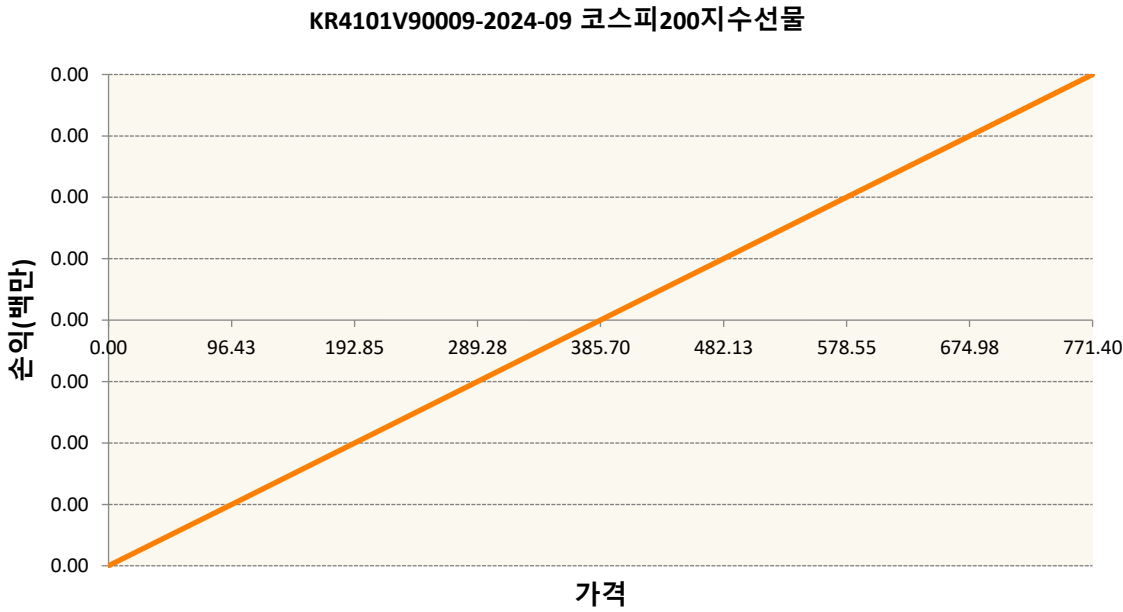
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	672	-672	장내
누계	유가증권	선물	10,125	0	10,125	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101V90009		2024-09 코스피200지수선물					804
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-804	-804	-804	-804	-804	-804	-804
-5.33%	-536	-536	-536	-536	-536	-536	-536
-2.67%	-268	-268	-268	-268	-268	-268	-268
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	268	268	268	268	268	268	268
5.33%	536	536	536	536	536	536	536
8.00%	804	804	804	804	804	804	804

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

(단위:백만원)

795

공시일	2024-06-20
기준일	2024-06-19

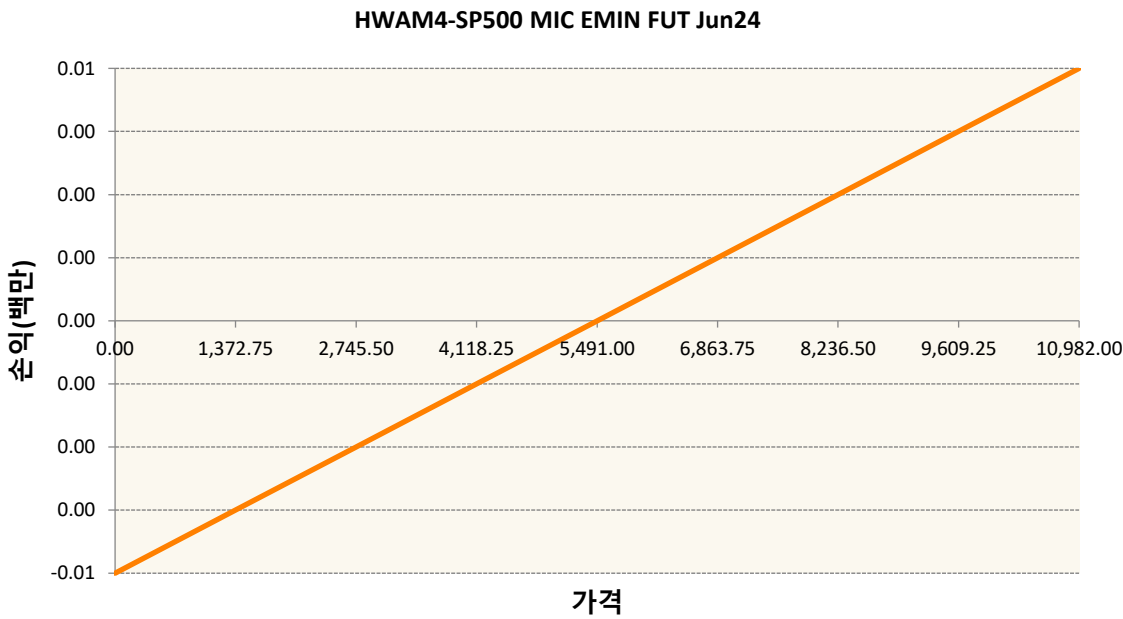
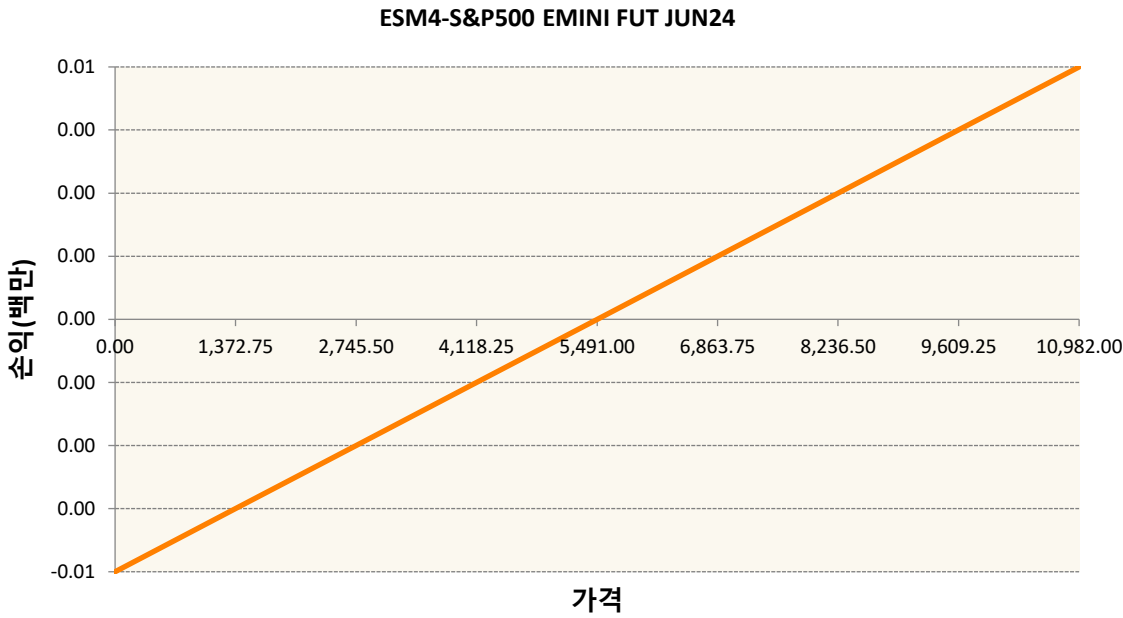
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

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	6,985	0	6,985	
누계	유가증권	선물	2,463	0	2,463	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESM4	S&P500 EMINI FUT JUN24	559
HWAM4	SP500 MIC EMIN FUT Jun24	197

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	464

공시일	2024-06-20
기준일	2024-06-19

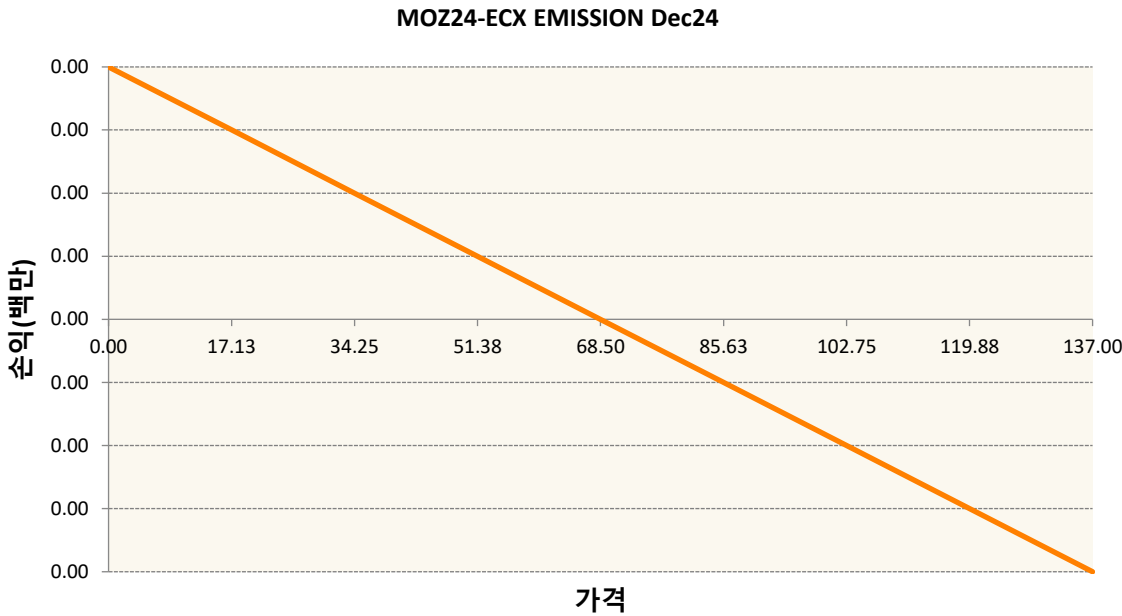
SOL유럽탄소배출권선물인버스ICE특별자산상

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	5,653	-5,653	
누계	지수	스왑	331	0	331	장외
누계	통화	선도	0	1,055	-1,055	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213E5W KRW/EUR 28-06-24E	84
MOZ24 ECX EMISSION Dec24	452
SWICEUACN ICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX	3

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

(단위:백만원)

852

공시일	2024-06-20
기준일	2024-06-19

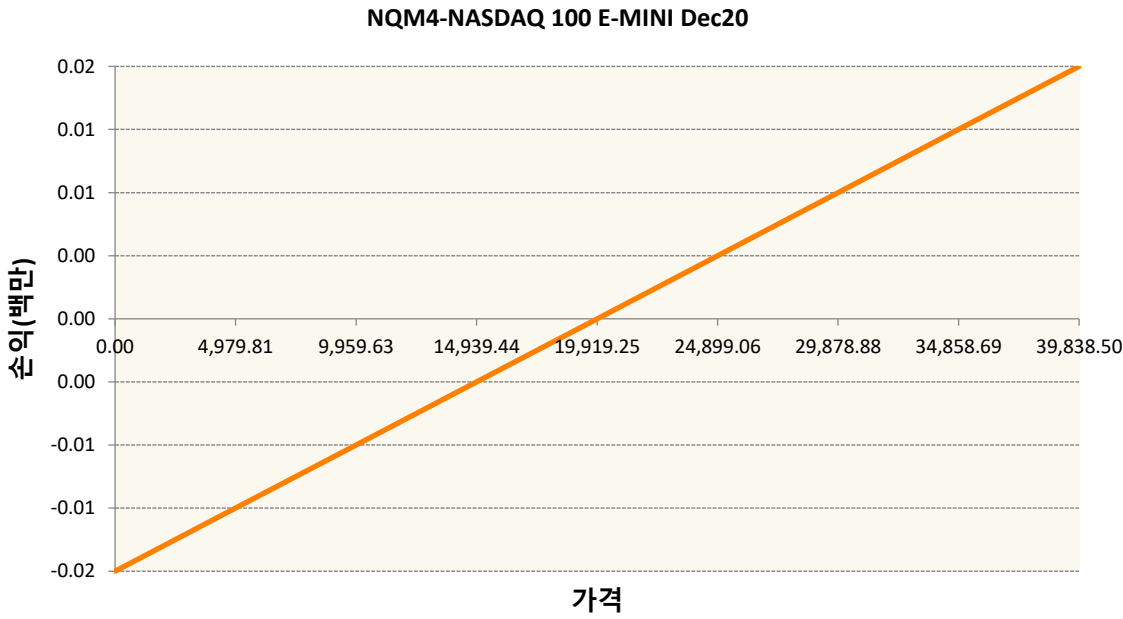
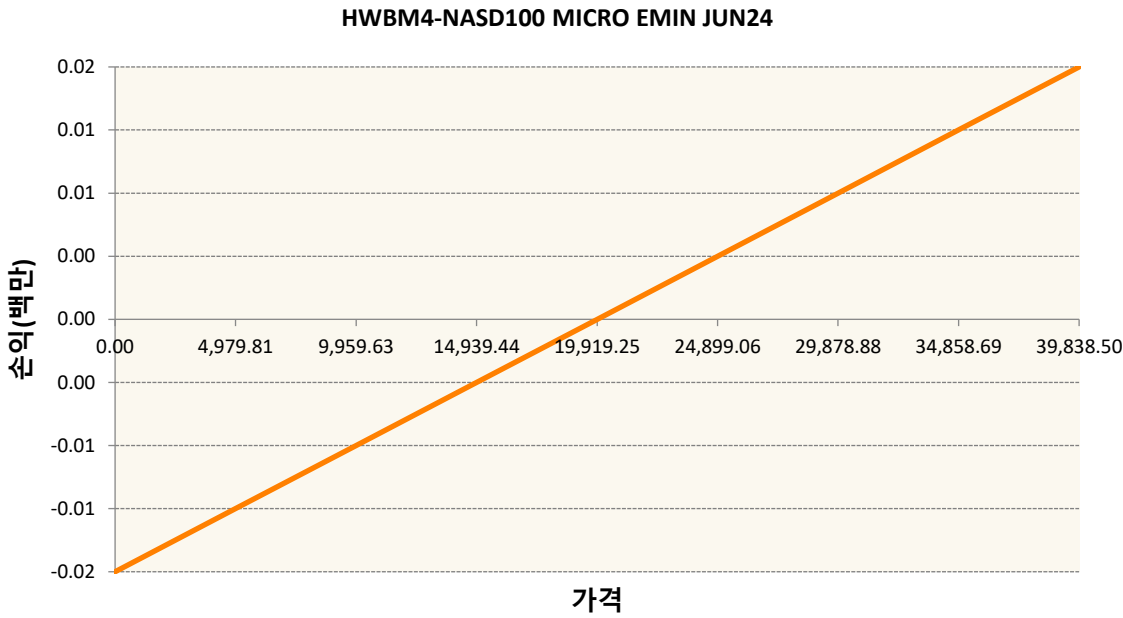
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

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	2,641	0	2,641	
누계	유가증권	선물	2,831	0	2,831	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
HWBM4	NASD100 MICRO EMIN JUN24		227
NQM4	NASDAQ 100 E-MINI Dec20		211

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)			(단위:백만원)
			318

공시일	2024-06-20
기준일	2024-06-19

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	166,710	0	166,710	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWKEDI0000 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	3,688
SWKEDI0000 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	7,425
SWKEDI0000 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	706
SWKEDI0000 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	1,646

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

(단위:백만원)

8,127

공시일	2024-06-20
기준일	2024-06-19

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	21
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	21
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	21
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	21

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

(단위:백만원)

88

공시일	2024-06-20
기준일	2024-06-19

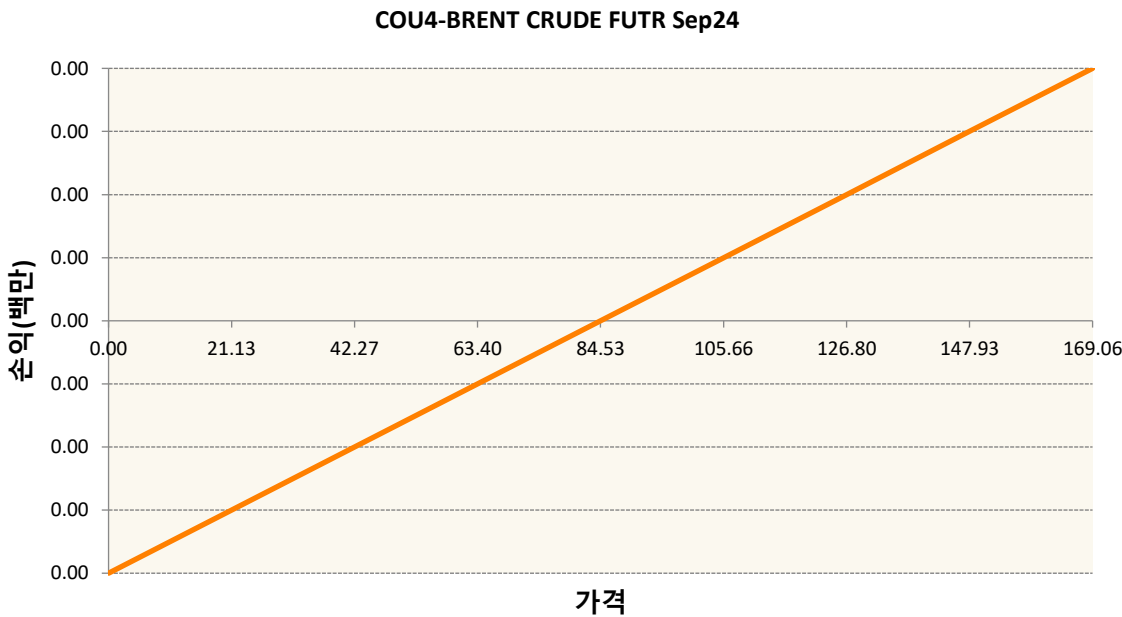
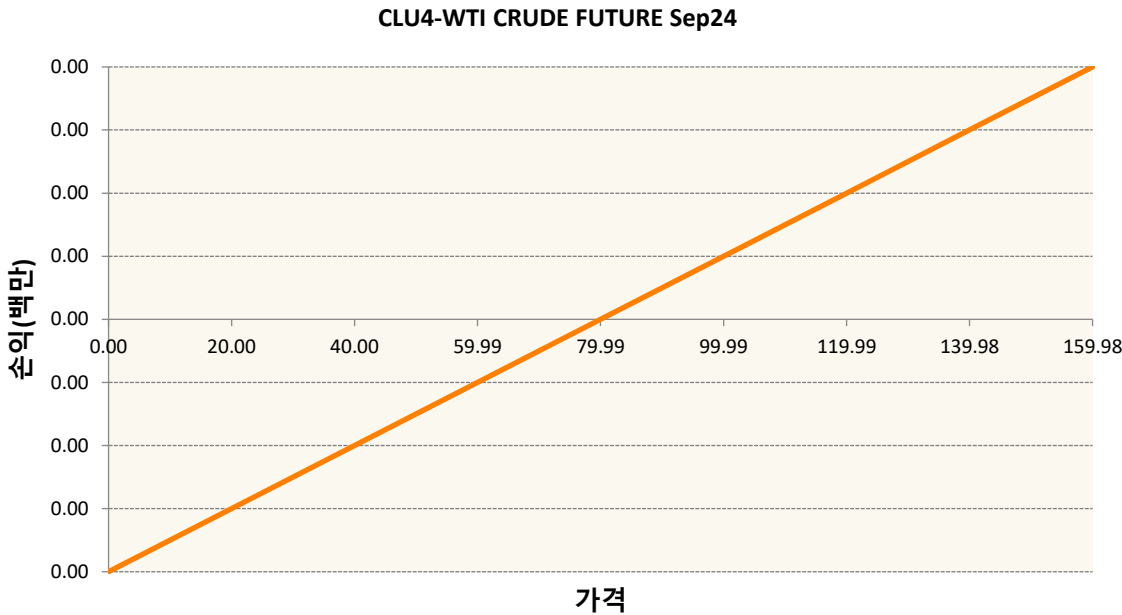
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

1. 계약금액

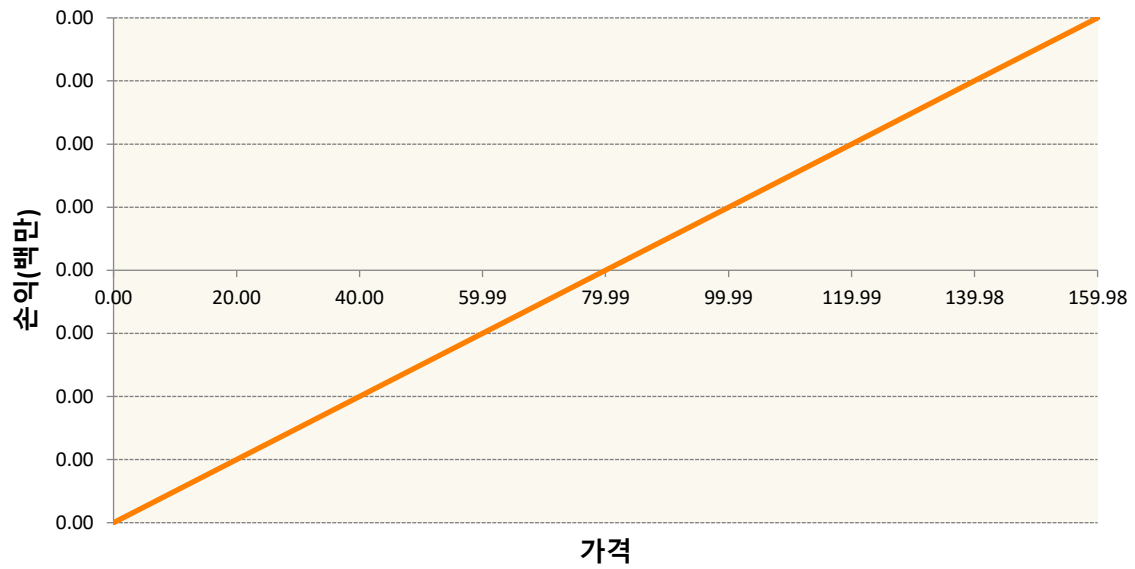
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	28	-28	장내
누계	유가증권	선물	985	0	985	
누계	통화	선물	0	179	-179	장내

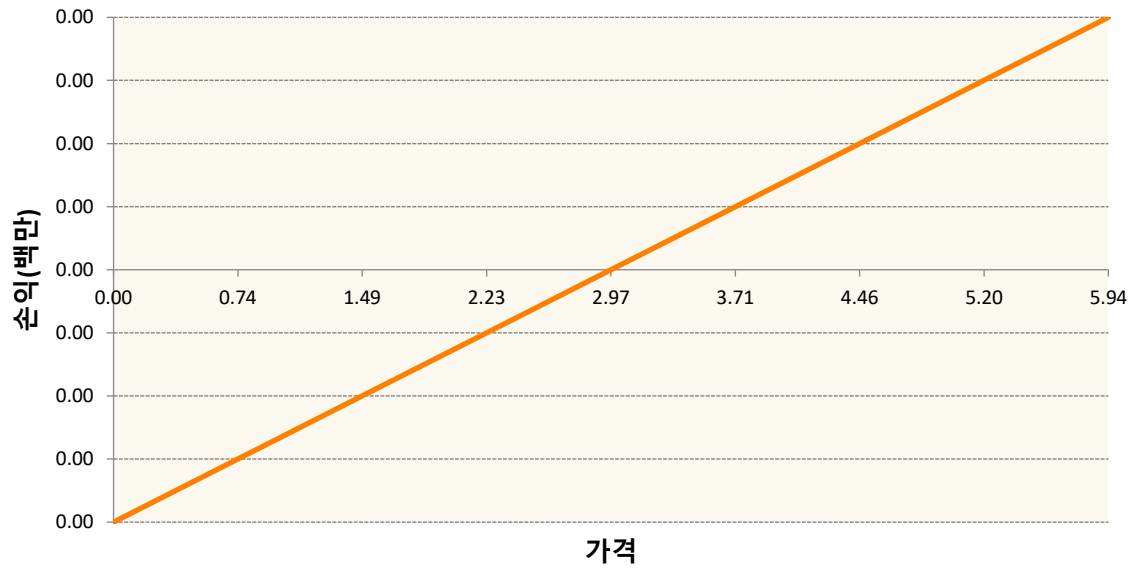
2. 만기시점의 손익구조



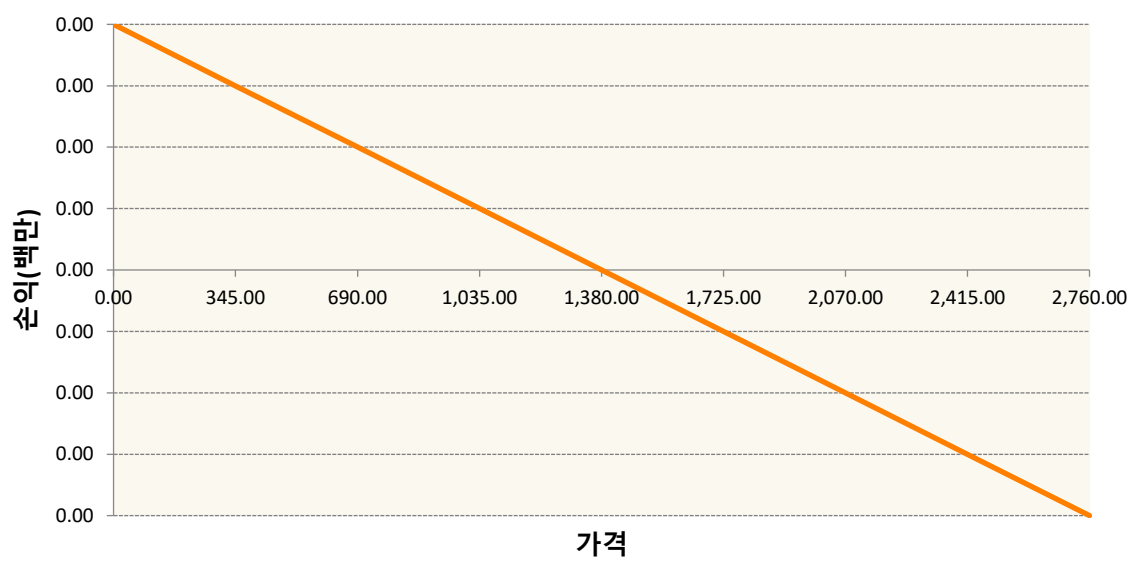
ECU4-E-mini Crude Oil Sep24



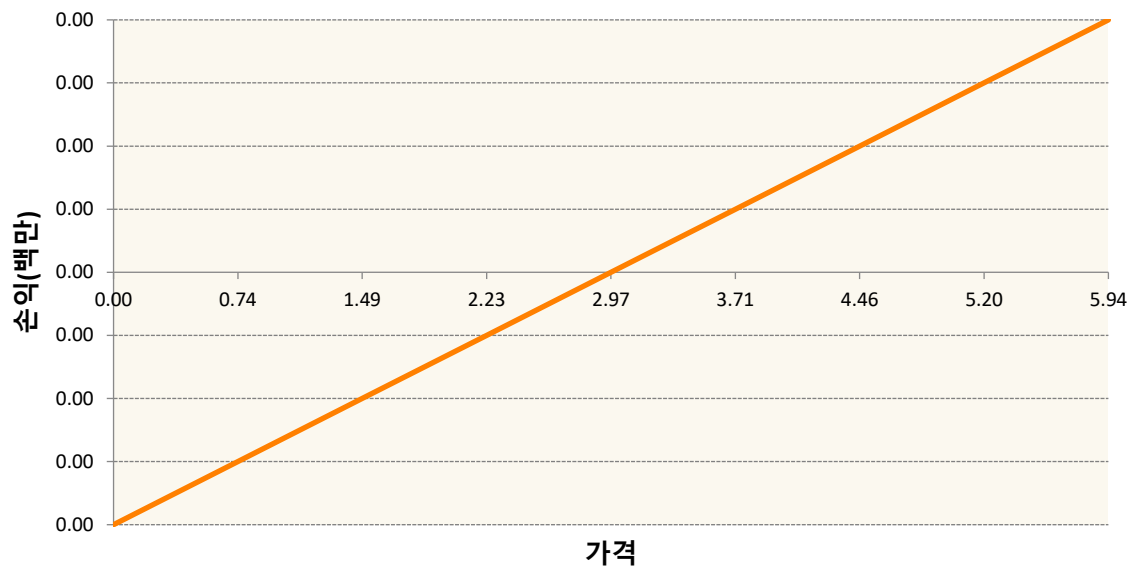
EOU4-E-MINI NATURAL GAS Sep24



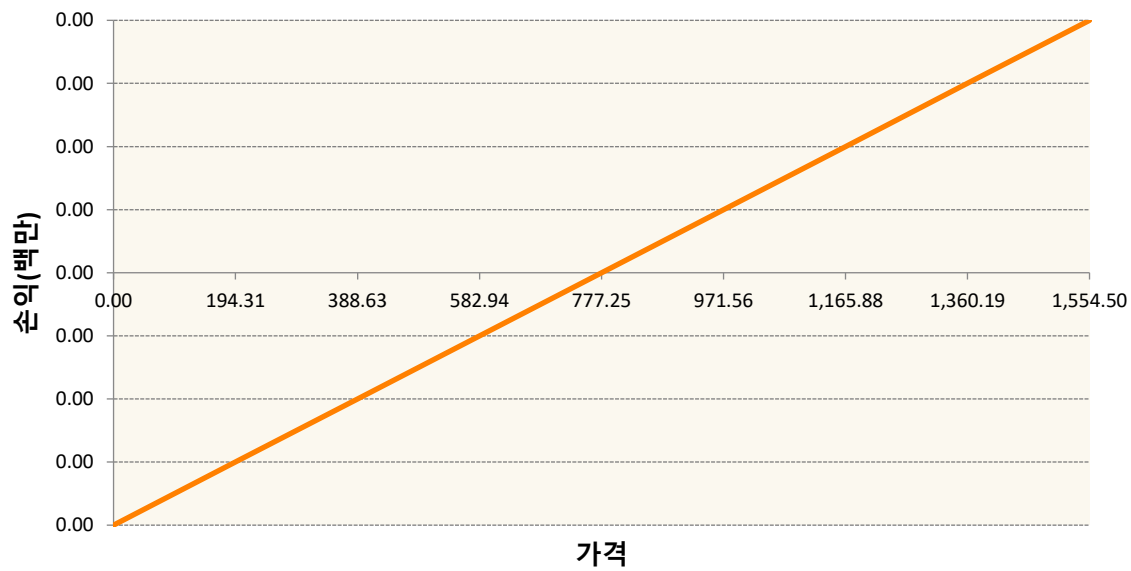
KR4175V70005-2024-07 달러선물



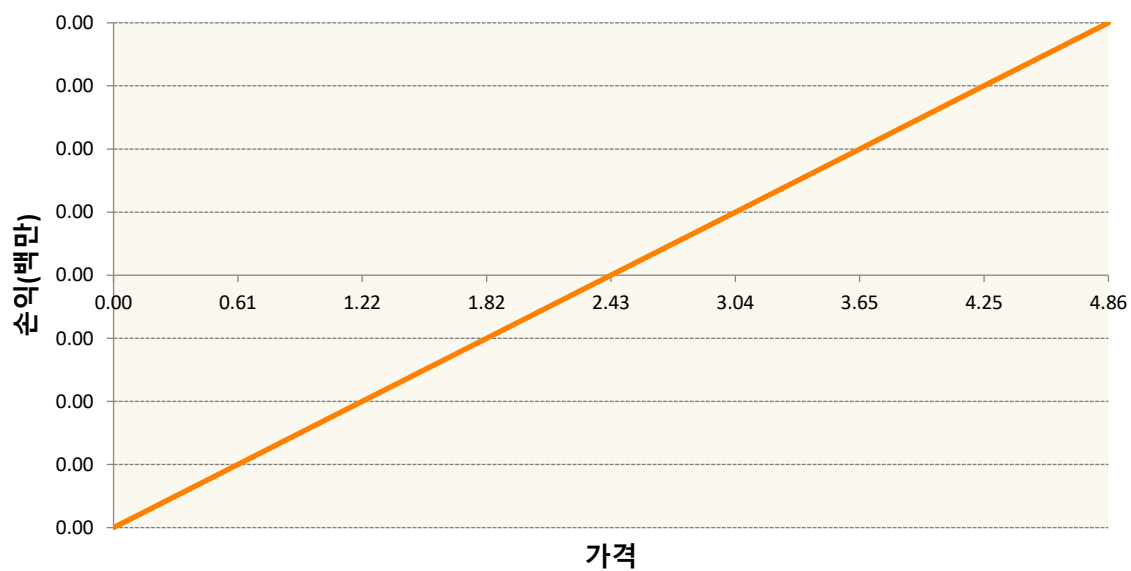
NGU24-NATURAL GAS FUTR Sep24



QSU4-Low Su Gasoil G Sep24



XBU4-GASOLINE RBOB FUT Sep24



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLU4	WTI CRUDE FUTURE Sep24	9
COU4	BRENT CRUDE FUTR Sep24	19
ECU4	E-mini Crude Oil Sep24	9
EOU4	E-MINI NATURAL GAS Sep24	3
KR4175V700 2024-07 달러선물		14
NGU24	NATURAL GAS FUTR Sep24	20
QSU4	Low Su Gasoil G Sep24	9
XBU4	GASOLINE RBOB FUT Sep24	11

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

178