

공시일 2022-04-12

기준일 2022-04-11

포커스농산물모(채권-파생형)

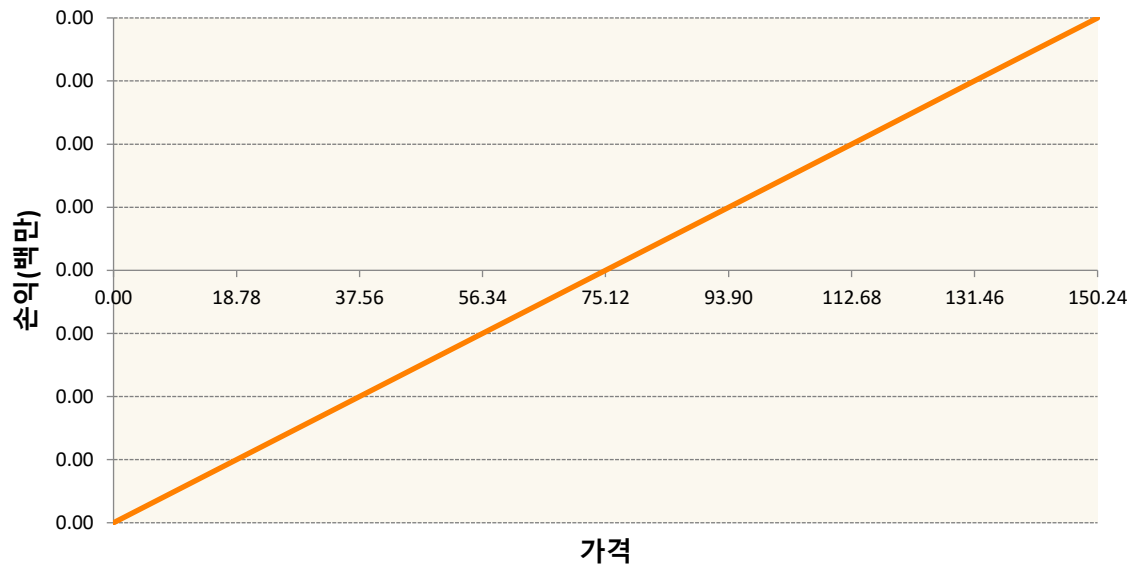
1. 계약금액

(단위:USD 백만)

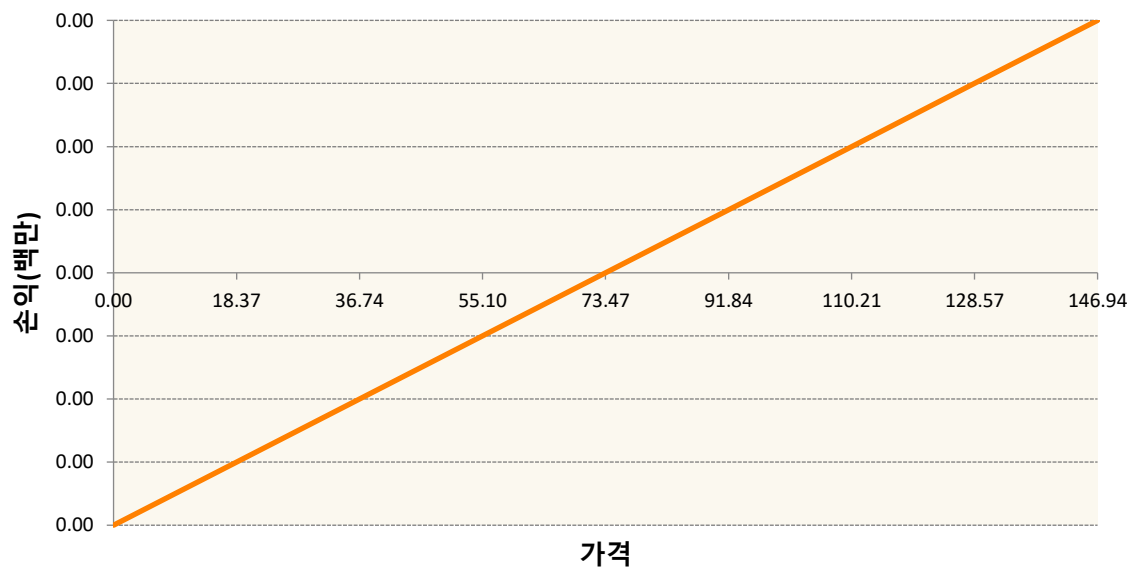
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	8,478	1,728	6,751	

2. 만기시점의 손익구조

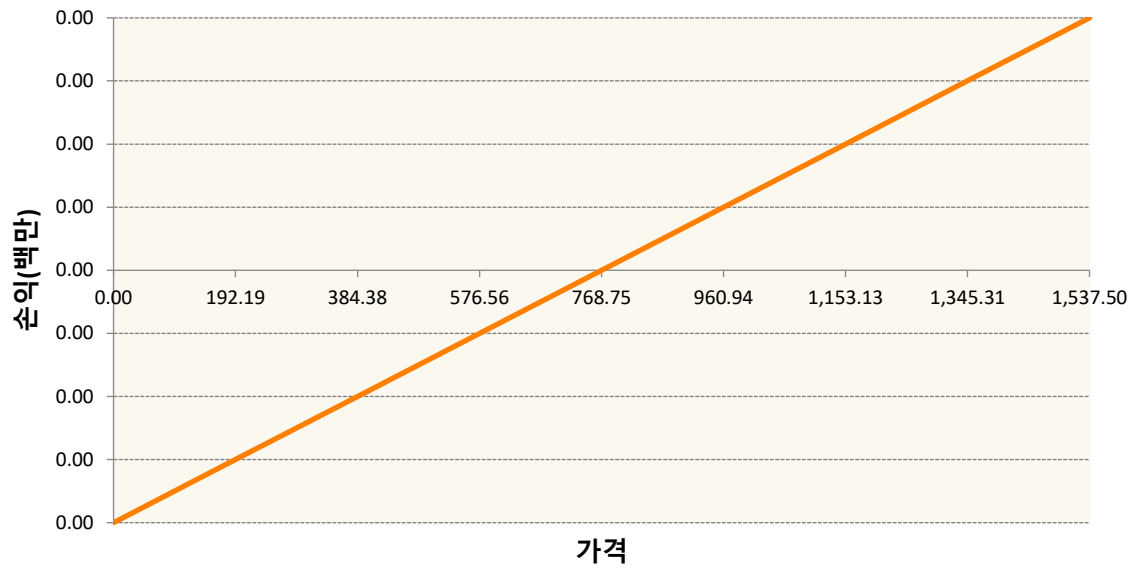
BOK2-SOYBEAN OIL FUTR May22



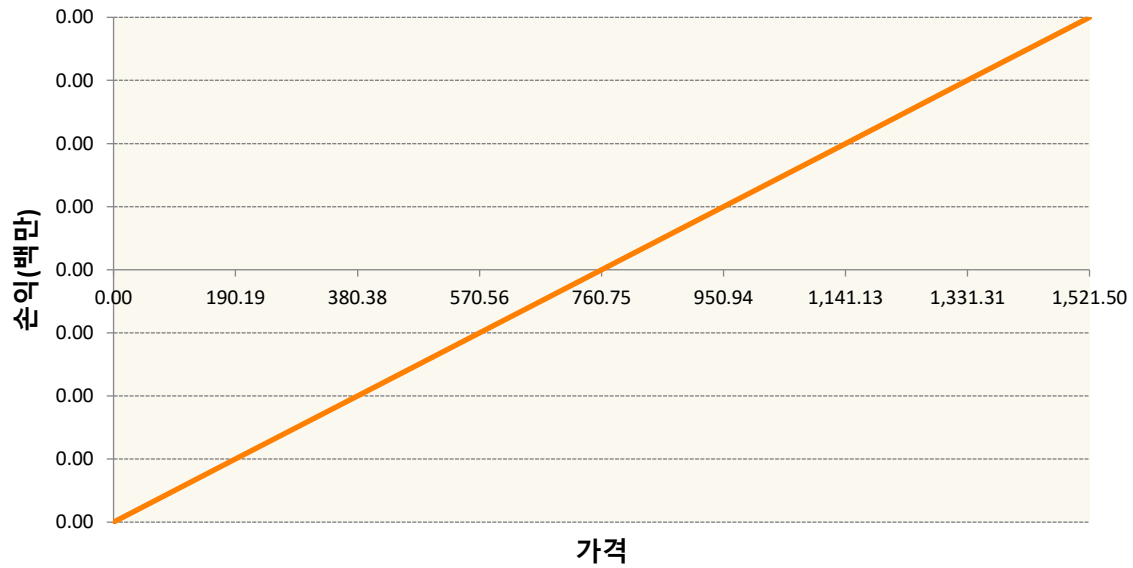
BON2-SOYBEAN OIL FUTR Jul22



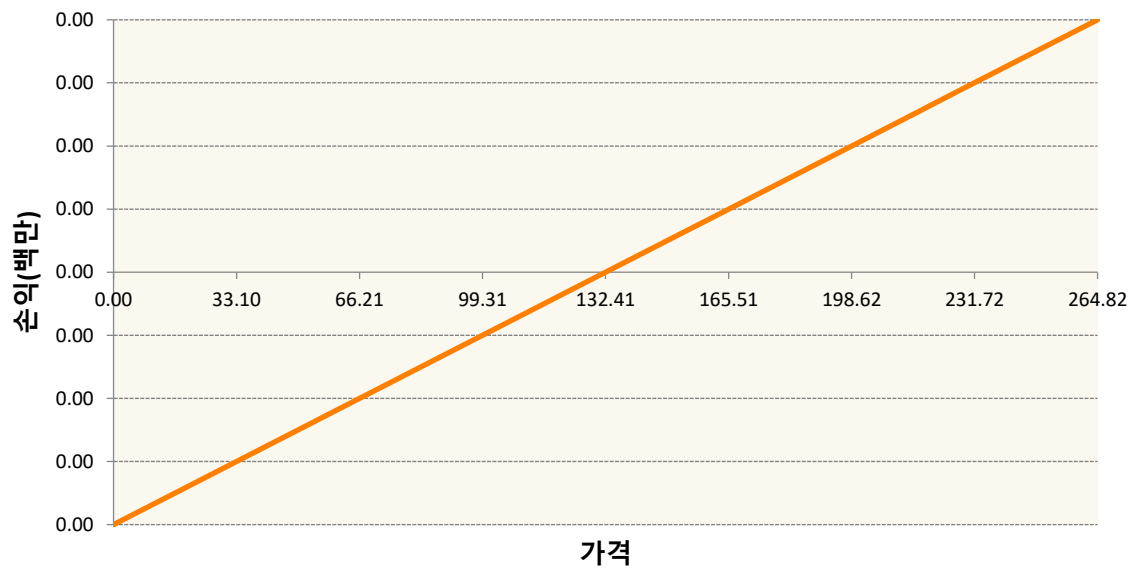
CK2-CORN FUTURE May22



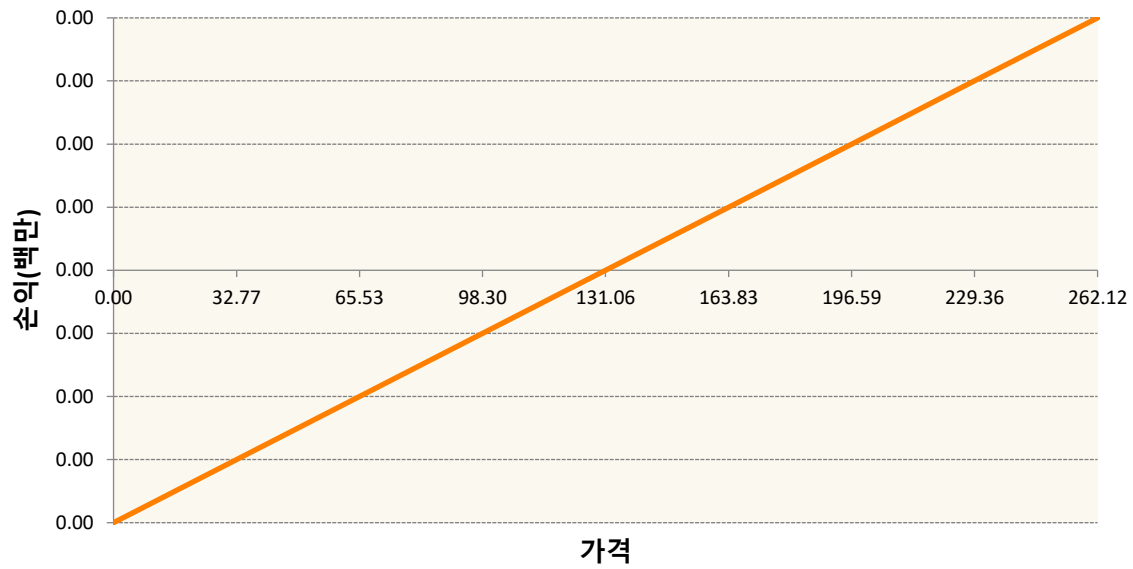
CN2-CORN FUTURE Jul22



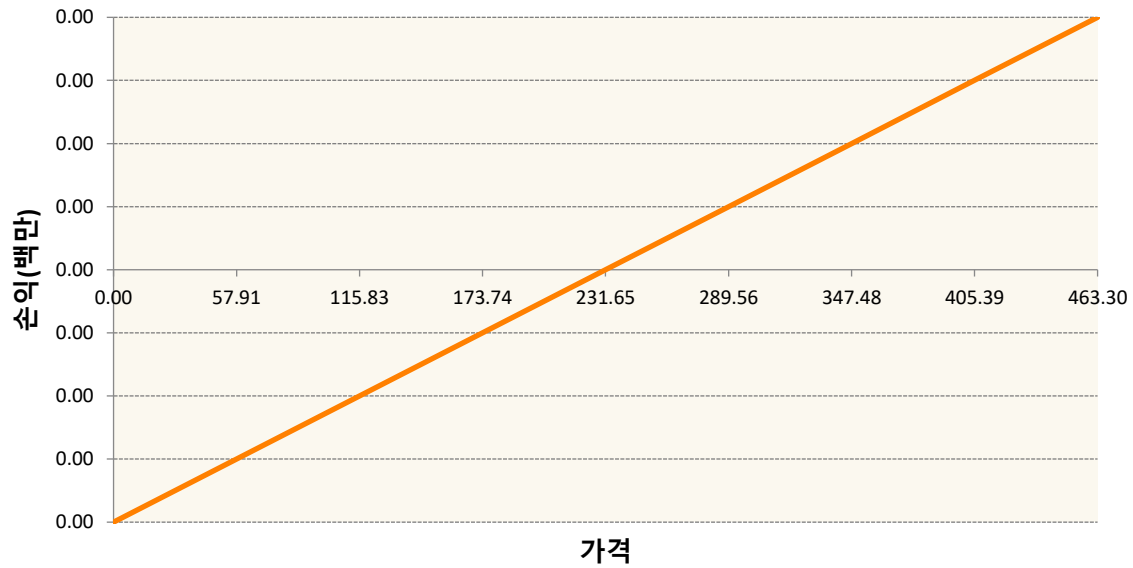
CTK2-COTTON NO.2 FUTR May22



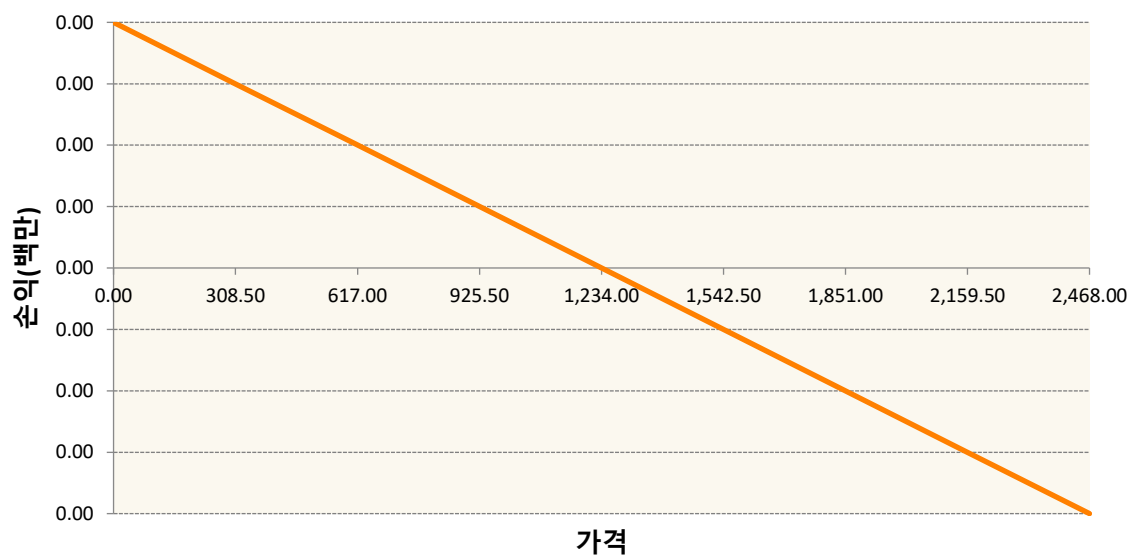
CTN2-COTTON NO.2 FUTR Jul22



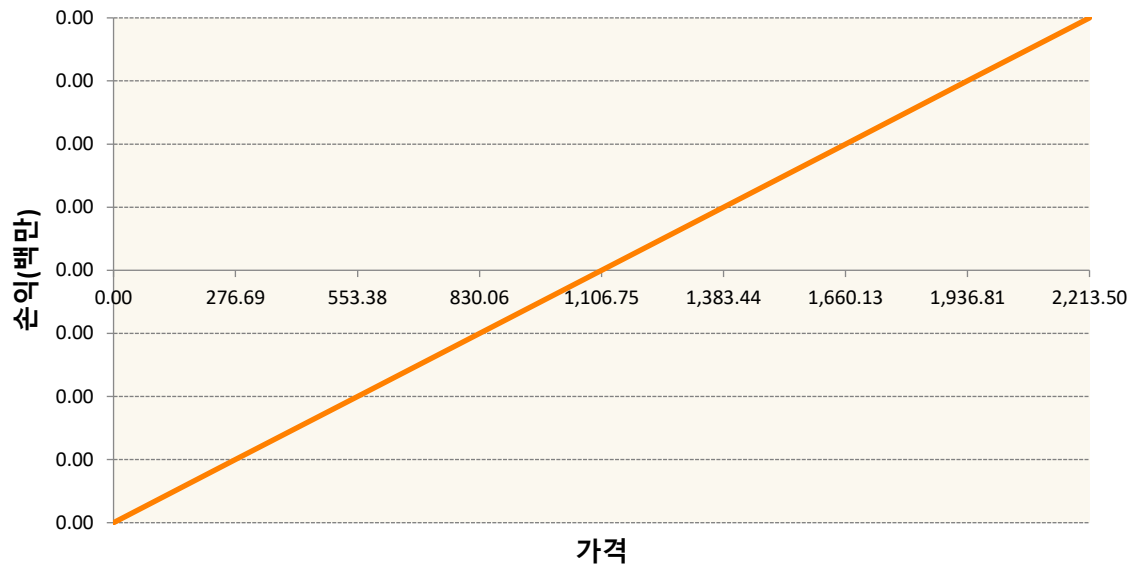
KCK2-COFFEE 'C' FUTURE May22



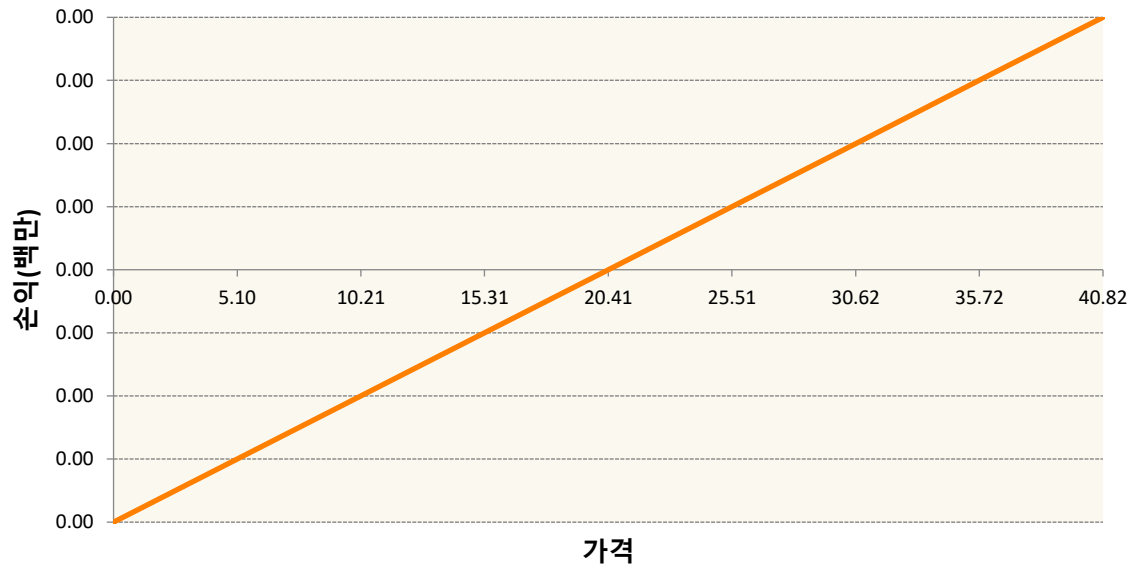
KR4175S40004-2022-04 달러선물



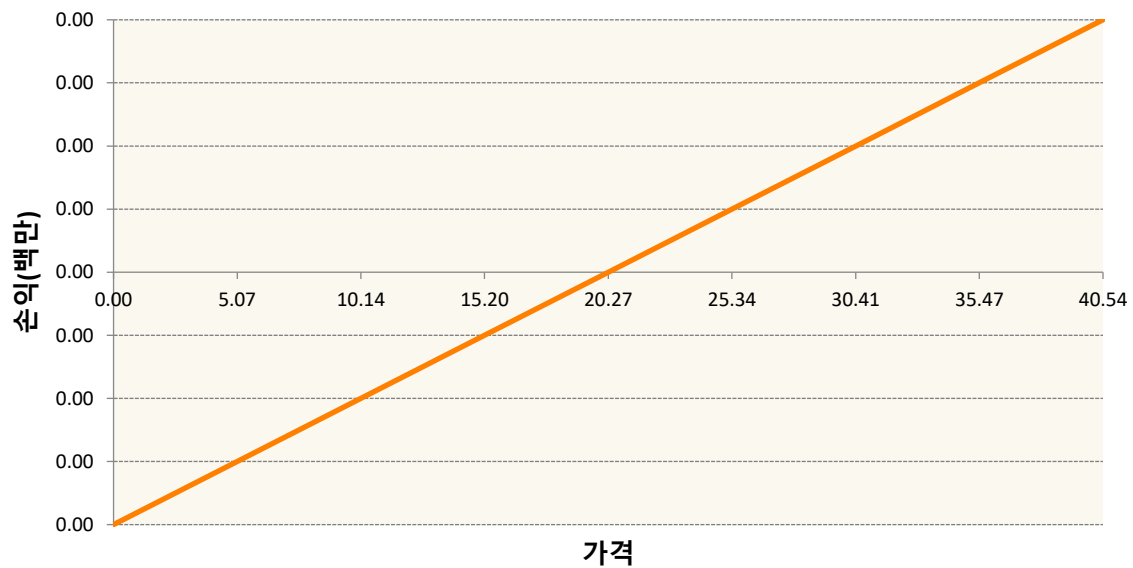
KWK2-KC HRW WHEAT FUT May22



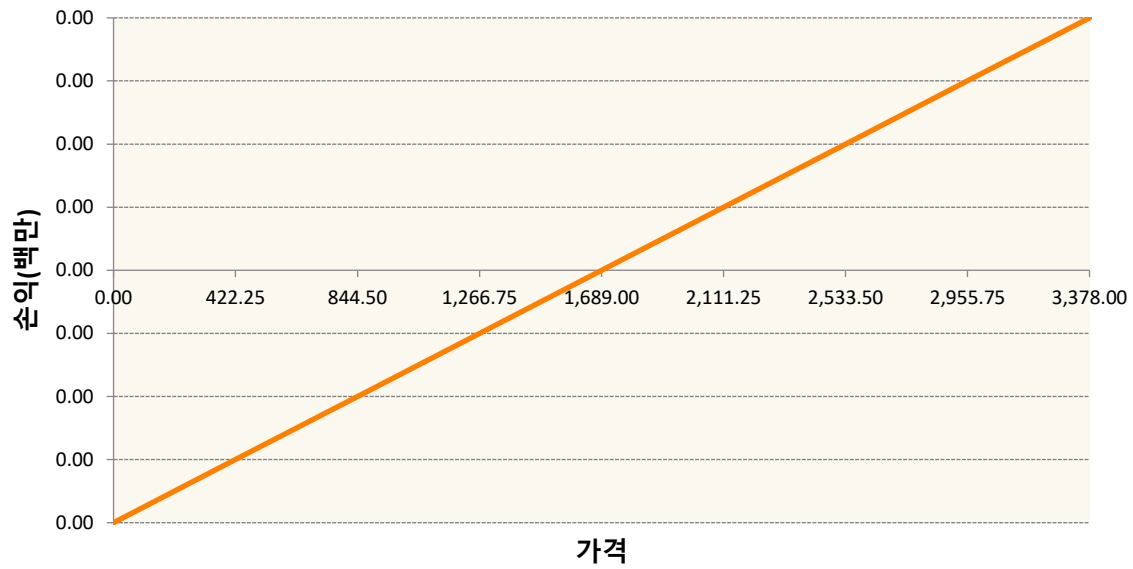
SBK2-Sugar May22



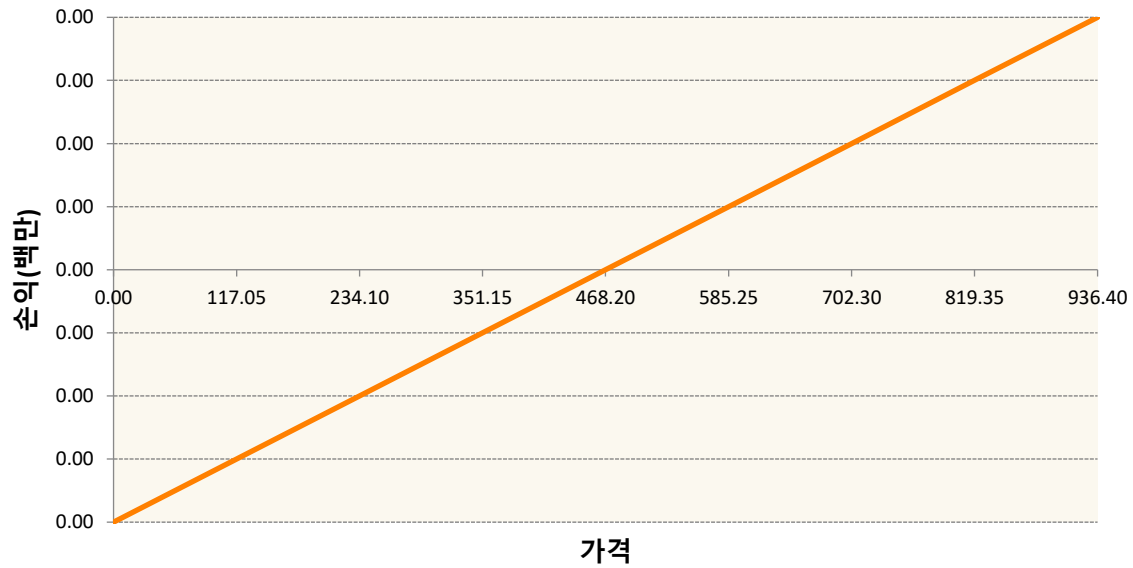
SBN2-Sugar #11 (WORLD) Jul22



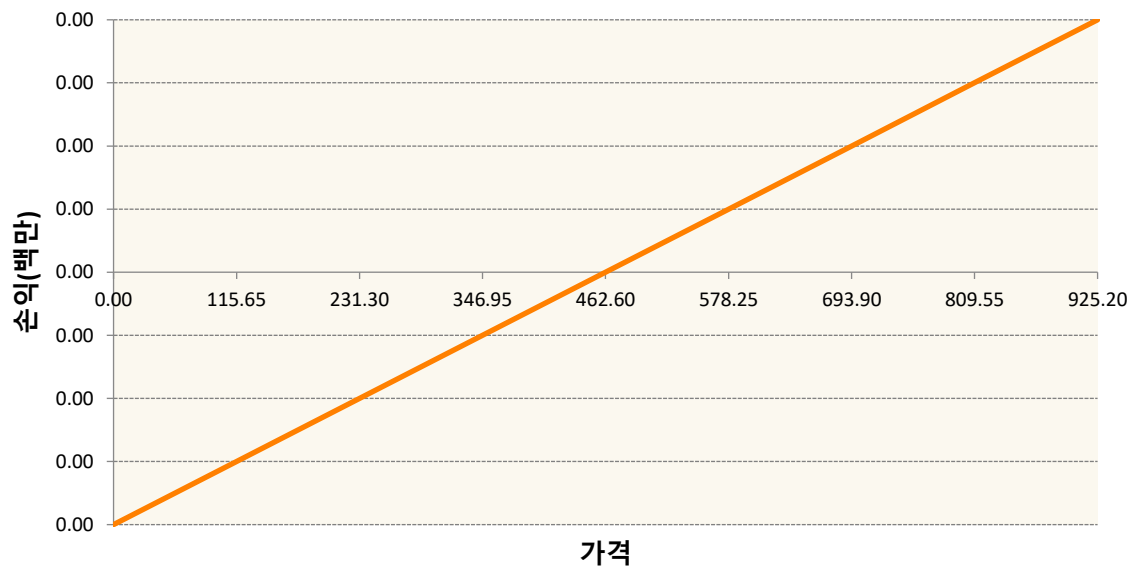
SK2-SOYBEAN FUTURE May22



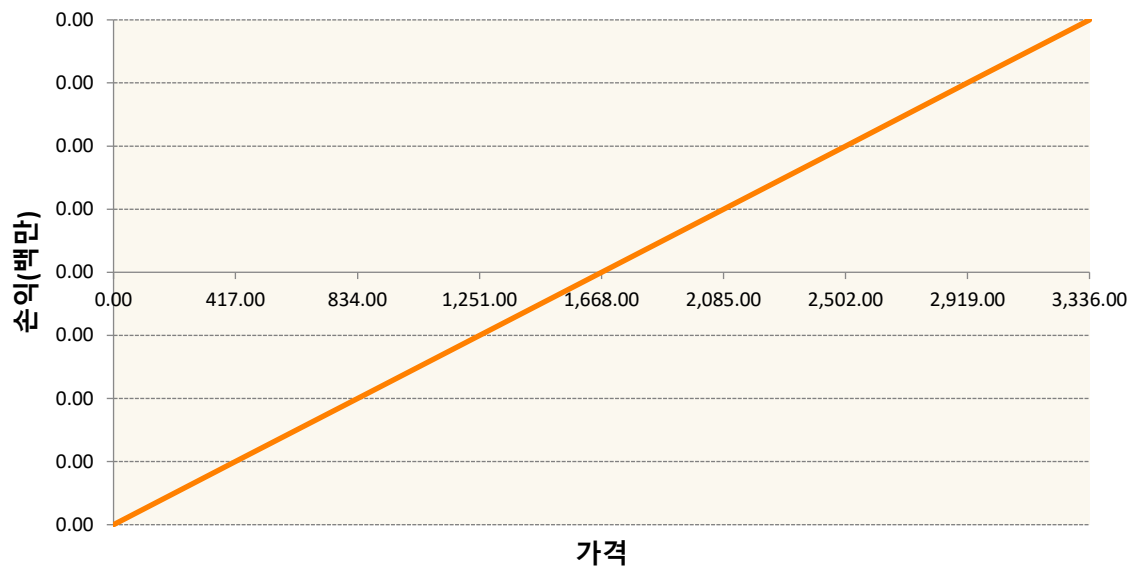
SMK2-SOYBEAN MEAL FUTR May22



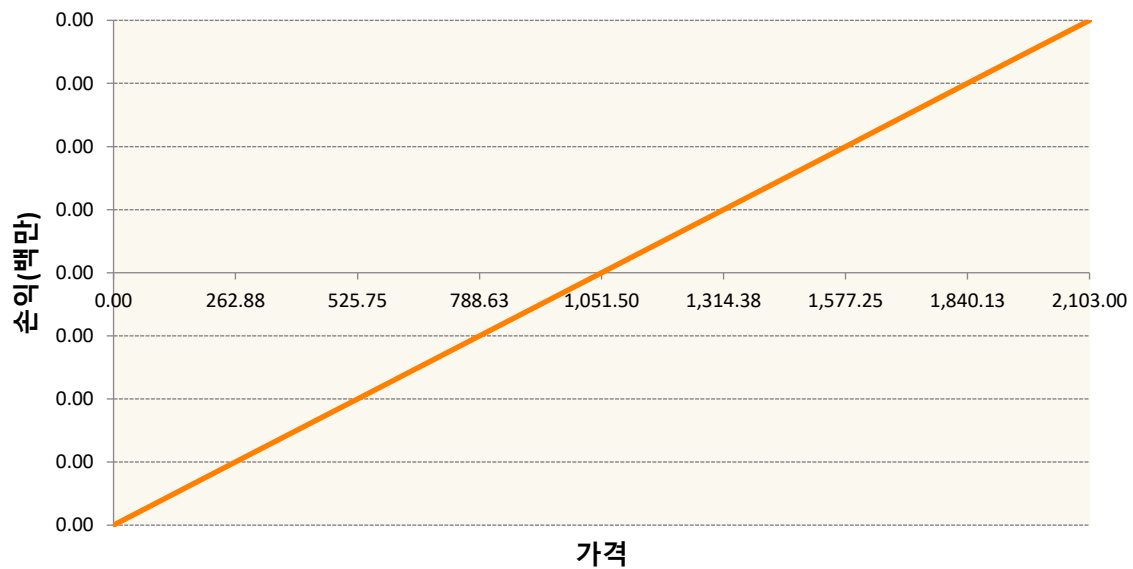
SMN2-SOYBEAN MEAL FUTR Jul22



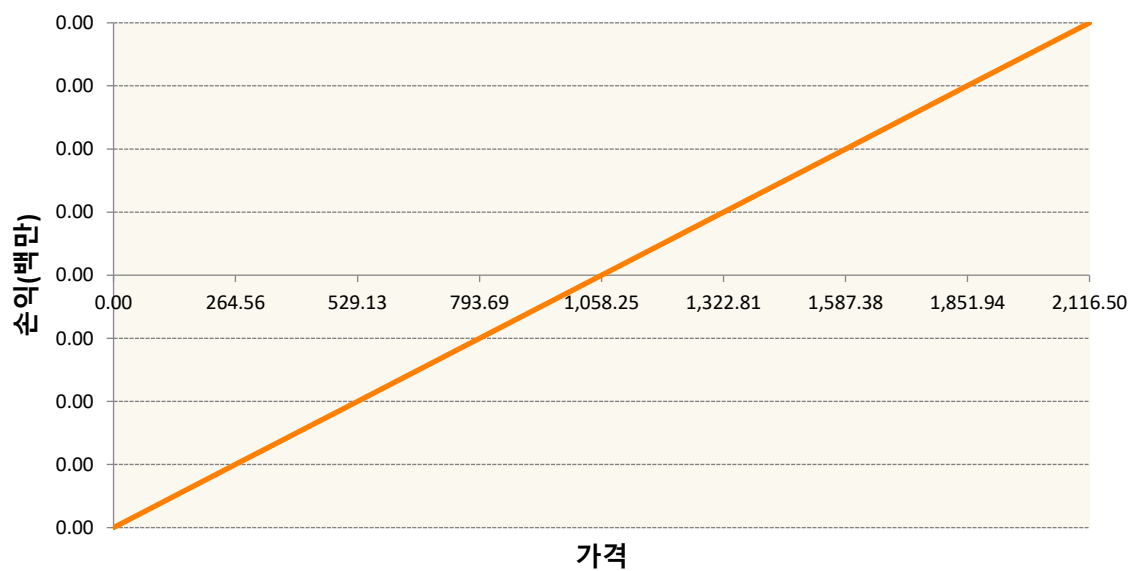
SN2-SOYBEAN FUTURE Jul22



WK2-WHEAT FUTURE(CBT) May22



WN2-WHEAT FUTURE(CBT) Jul22



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

공시일	2022-04-12
기준일	2022-04-11

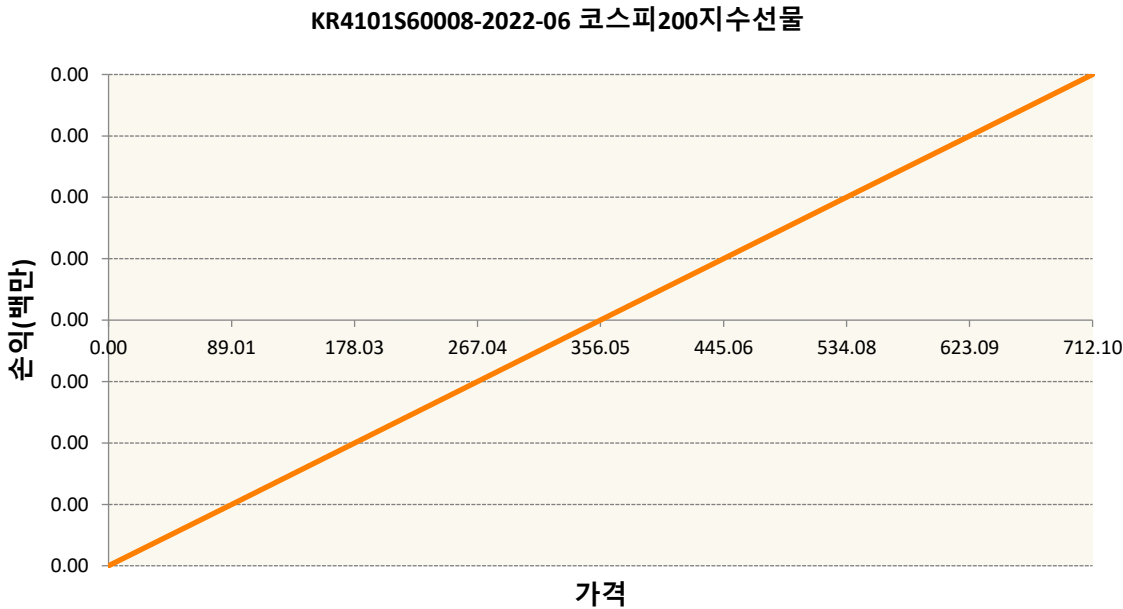
스마트인덱스모

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	1,602	0	1,602	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101S60008			2022-06 코스피200지수선물				128
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-128	-128	-128	-128	-128	-128	-128
-5.33%	-85	-85	-85	-85	-85	-85	-85
-2.67%	-43	-43	-43	-43	-43	-43	-43
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	43	43	43	43	43	43	43
5.33%	85	85	85	85	85	85	85
8.00%	128	128	128	128	128	128	128

공시일	2022-04-12
기준일	2022-04-11

SMART합성-MSCI선진국증권상장

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	1,733	0	1,733	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWMXWO0C 신한MSCI선진국미래20220225	144
------------------------------	-----

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

91

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2022-04-12
기준일	2022-04-11

SMART중국본토중소형CSI500상장

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	4,900	0	4,900	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 신한CSI500미래220311

385

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

396

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2022-04-12
기준일	2022-04-11

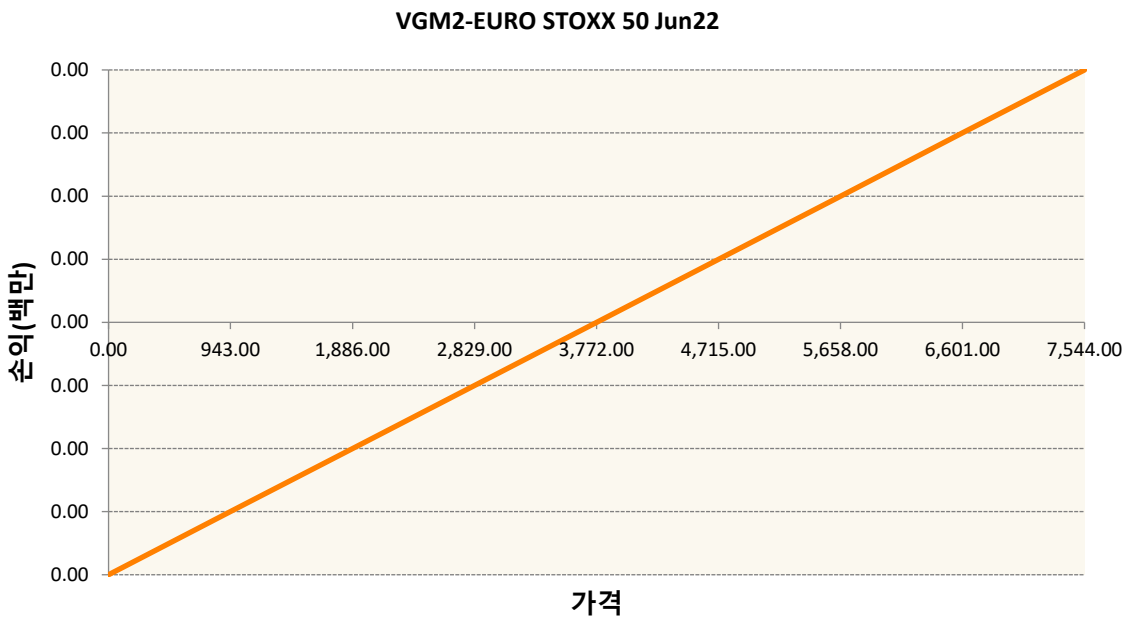
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	563	0	563	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM2	EURO STOXX 50 Jun22	45
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

42

공시일	2022-04-12
기준일	2022-04-11

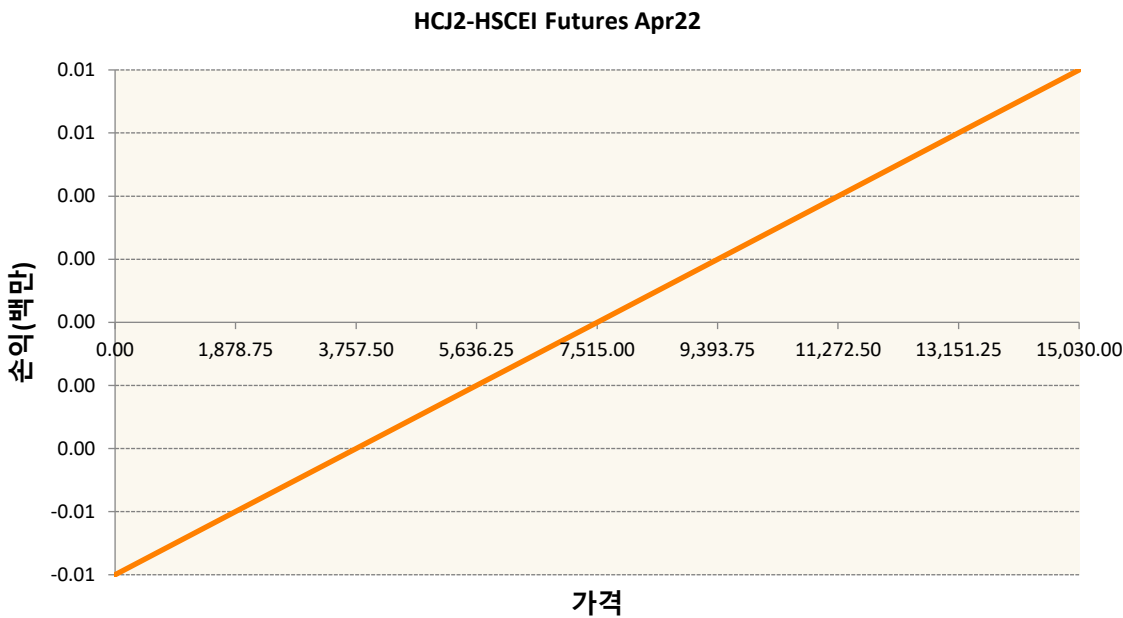
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,162	0	1,162	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCI2	HSCEI Futures Apr22	93
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

124

공시일 2022-04-12

기준일 2022-04-11

커버드콜모(주식혼합-파생형)

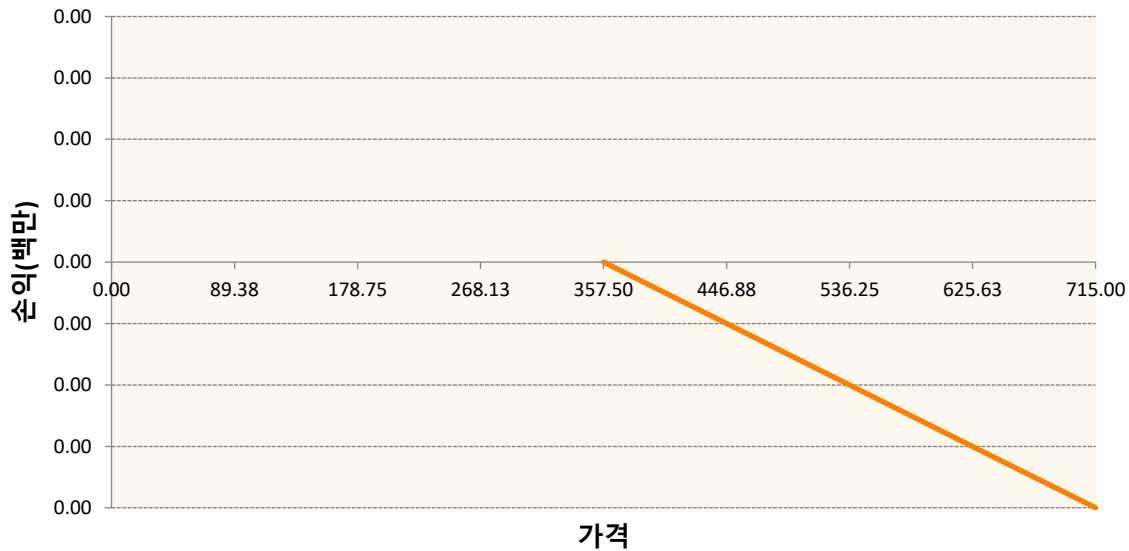
1. 계약금액

(단위:백만원)

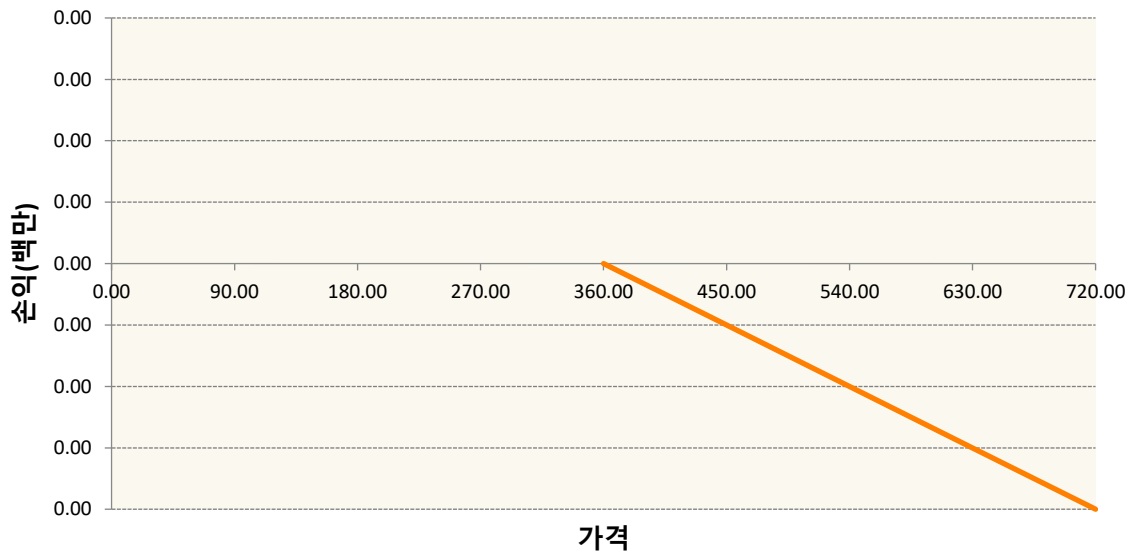
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	66,410	-66,410	장내

2. 만기시점의 손익구조

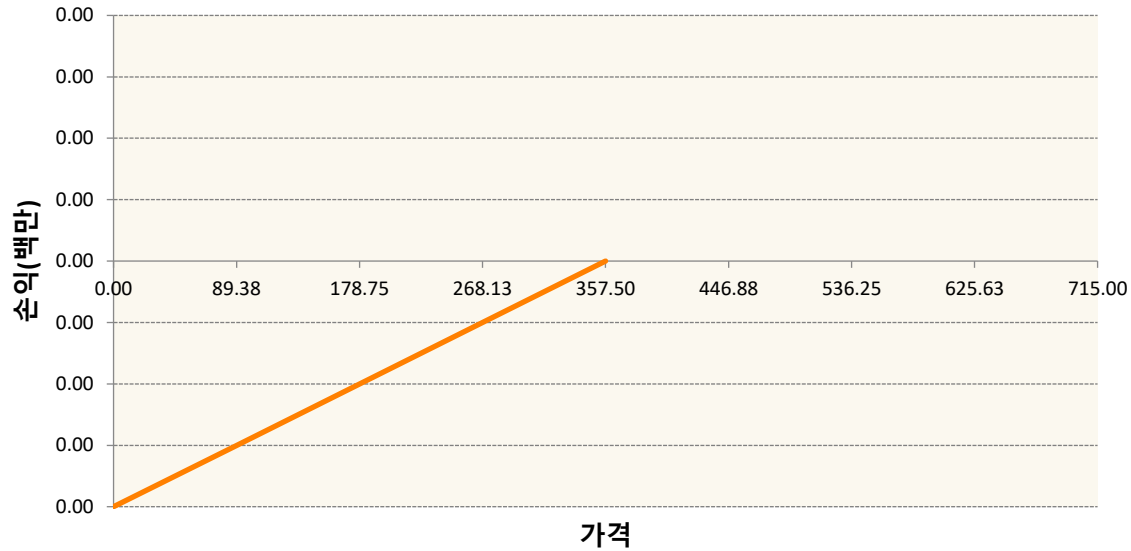
KR4201S43572-2022-04 콜357.5



KR4201S43606-2022-04 콜360



KR4301S43570-2022-04 풋357.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201S43572		2022-04 콜357.5						2,763
		기초자산의 변동성						
가격		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	348	348	348	347	347	347	347	346
-5.33%	347	347	347	345	343	339	334	328
-2.67%	328	317	302	286	267	247	224	224
0%	108	72	36	0	-36	-72	-108	-108
2.67%	-615	-637	-661	-687	-714	-743	-773	-773
5.33%	-1,657	-1,661	-1,665	-1,672	-1,681	-1,692	-1,705	-1,705
8.00%	-2,755	-2,755	-2,756	-2,756	-2,758	-2,760	-2,763	-2,763
KR4201S43606		2022-04 콜360						836
		기초자산의 변동성						
가격		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	77	77	77	77	77	77	77	77
-5.33%	77	77	77	77	76	75	74	74
-2.67%	75	73	70	66	62	56	51	51
0%	31	21	11	0	-11	-22	-33	-33
2.67%	-157	-167	-177	-187	-198	-208	-219	-219
5.33%	-478	-480	-483	-487	-491	-496	-502	-502
8.00%	-832	-832	-832	-833	-834	-835	-836	-836
KR4301S43570		2022-04 풋357.5						862
		기초자산의 변동성						
가격		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-862	-862	-862	-862	-862	-862	-862	-862
-5.33%	-559	-559	-559	-559	-559	-559	-559	-559
-2.67%	-255	-255	-256	-257	-258	-259	-260	-260
0%	17	11	6	0	-6	-12	-18	-18

2.67%	101	100	98	96	93	90	87
5.33%	103	103	103	103	103	103	102
8.00%	103	103	103	103	103	103	103

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

(단위:백만원)

5,376

공시일 2022-04-12

기준일 2022-04-11

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

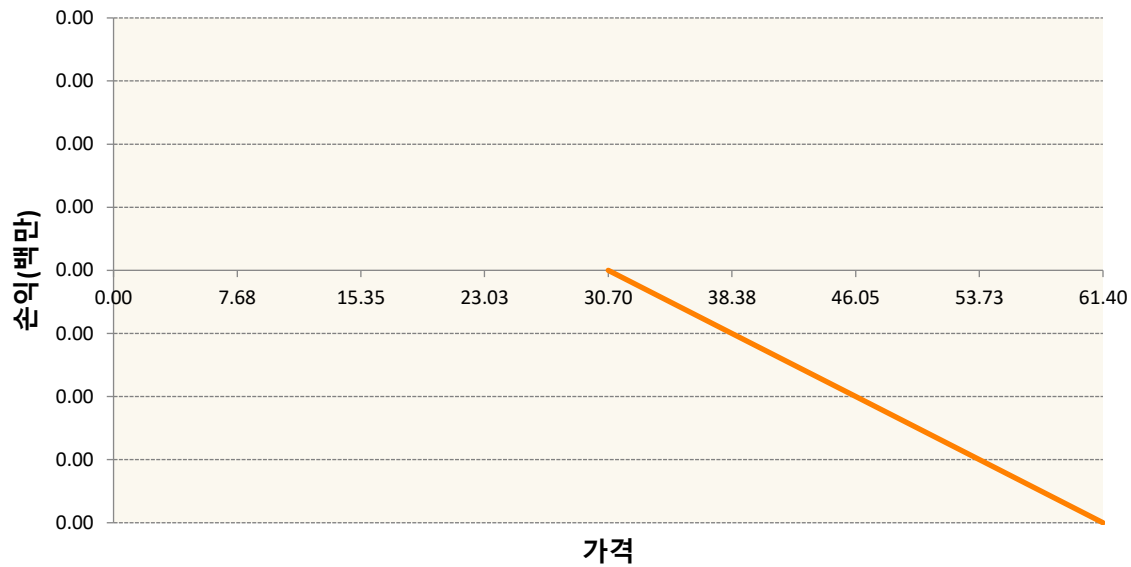
1. 계약금액

(단위:백만원)

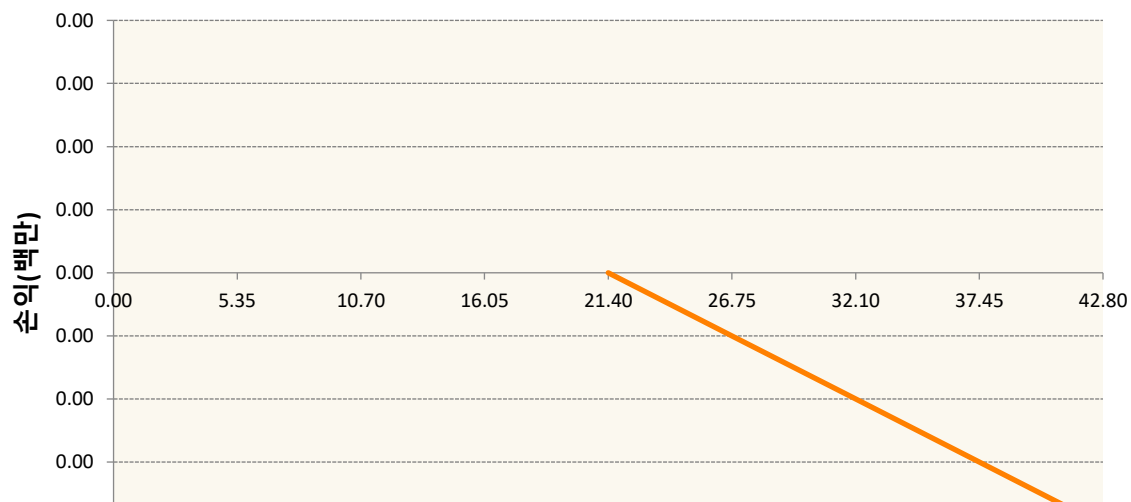
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	옵션	0	43	-43	장내
누계	지수	스왑	10	0	10	장외
누계	통화	선도	0	2,012	-2,012	장외

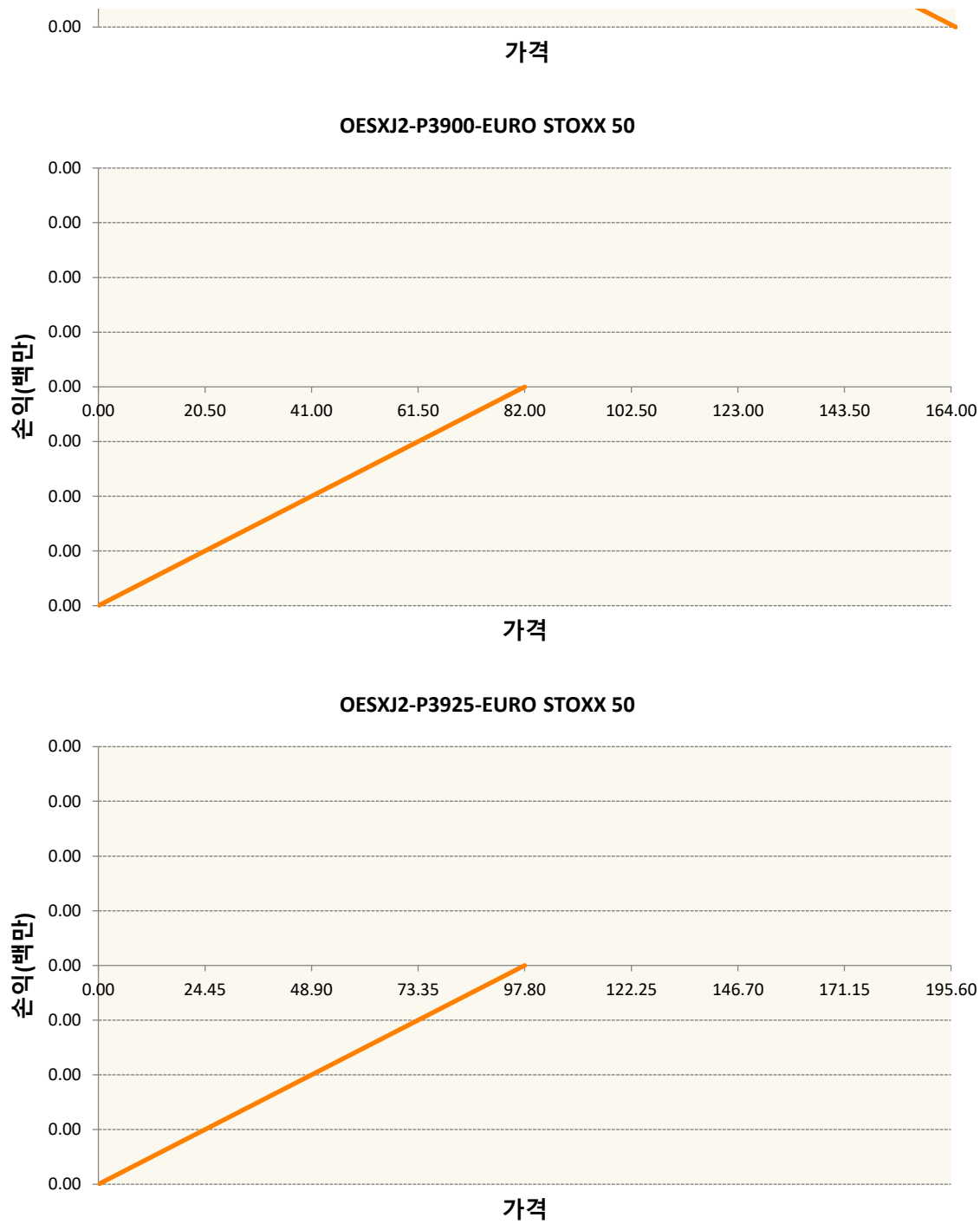
2. 만기시점의 손익구조

OESXJ2-C3900-EURO STOXX 50



OESXJ2-C3925-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY	10
FXW213C2F KRW/EUR 27-05-22E	21
FXW213C2F KRW/EUR 22-04-22E	32
FXW213C38 KRW/EUR 27-05-22E	64
FXW213C3A KRW/EUR 22-04-22E	43
OESXJ2-C39(EURO STOXX 50	1
OESXJ2-C39(EURO STOXX 50	0.07
OESXJ2-P39(EURO STOXX 50	2
OESXJ2-P39(EURO STOXX 50	0.31

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

(단위:백만원)

101

공시일 2022-04-12

기준일 2022-04-11

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

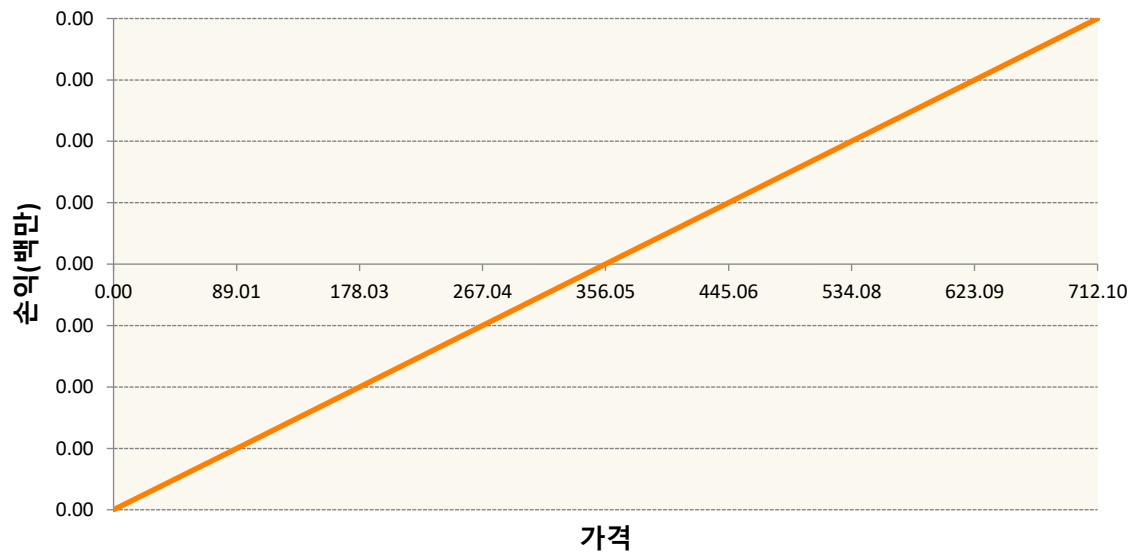
1. 계약금액

(단위:백만원)

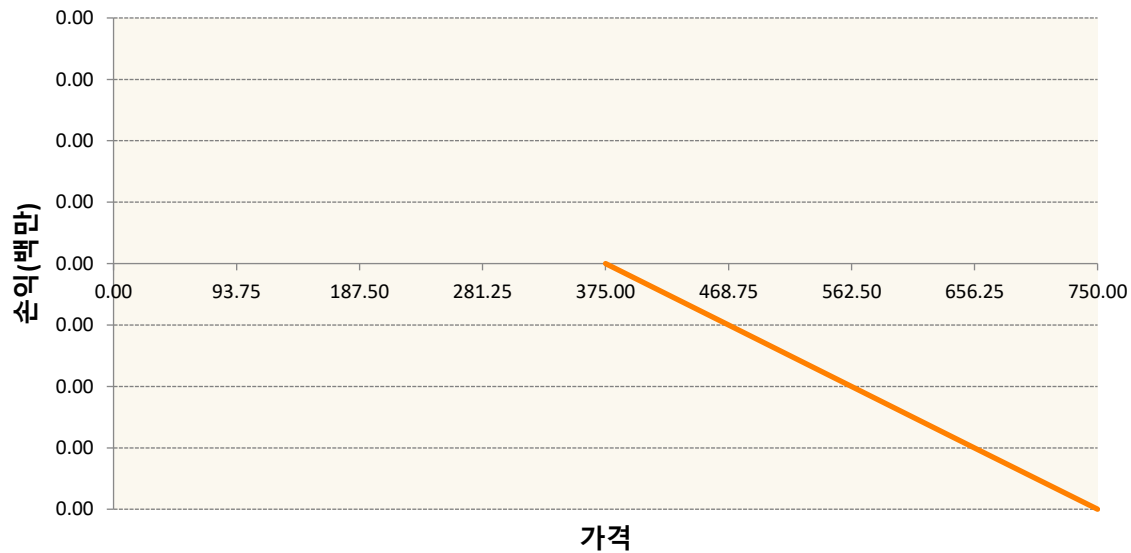
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	445	0	445	장내
누계	유가증권	옵션	358	4,699	-4,341	장내

2. 만기시점의 손익구조

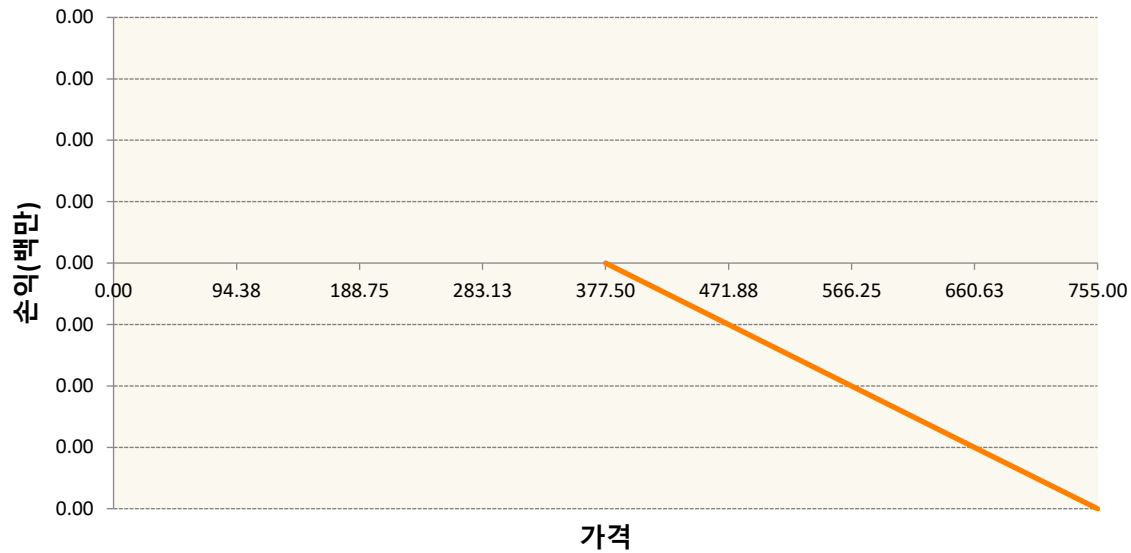
KR4101S60008-2022-06 코스피200지수선물



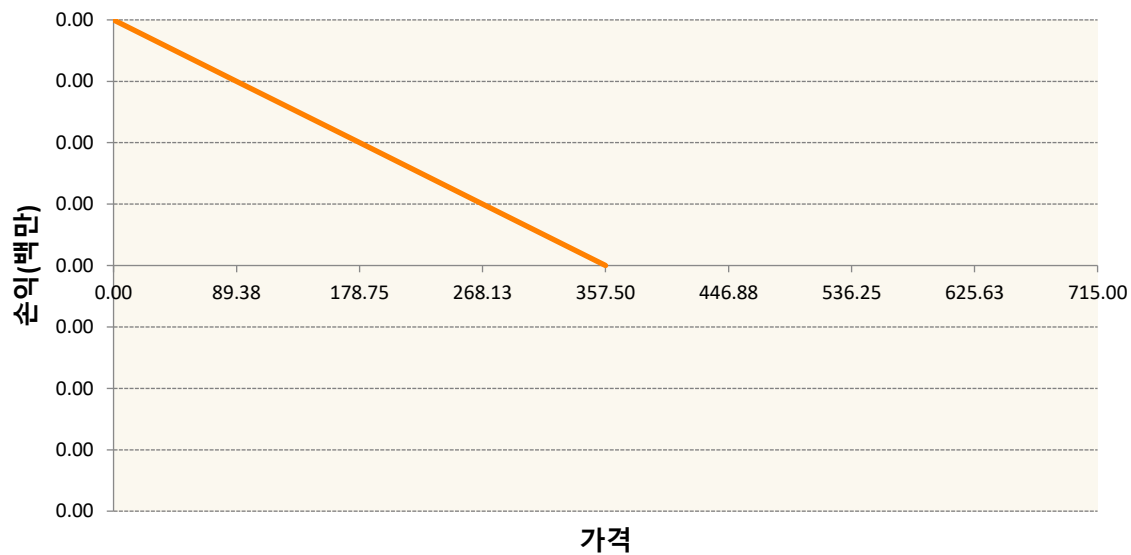
KR4201S43754-2022-04 콜375



KR4201S43770-2022-04 콜377.5



KR4301S43570-2022-04 ㄲ357.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101S60008		2022-06 코스피200지수선물					36
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-36	-36	-36	-36	-36	-36	-36
-5.33%	-24	-24	-24	-24	-24	-24	-24
-2.67%	-12	-12	-12	-12	-12	-12	-12
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	12	12	12	12	12	12	12
5.33%	24	24	24	24	24	24	24
8.00%	36	36	36	36	36	36	36
KR4201S43754		2022-04 콜375					87
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1	1	1	1	1	1	1
-5.33%	1	1	1	1	1	1	1
-2.67%	1	1	1	1	1	1	0
0%	1	1	0	0	0	-1	-2
2.67%	-2	-3	-4	-6	-8	-9	-11
5.33%	-22	-25	-28	-30	-33	-36	-38
8.00%	-77	-78	-80	-81	-83	-85	-87
KR4201S43770 2022-04 콜377.5							41

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	0	0	0	0	0	0	0
-5.33%	0	0	0	0	0	0	0
-2.67%	0	0	0	0	0	0	0
0%	0	0	0	0	0	0	-1
2.67%	0	-1	-1	-2	-3	-4	-5
5.33%	-8	-9	-11	-12	-14	-15	-17
8.00%	-34	-35	-36	-37	-38	-40	-41

KR4301S43570 2022-04 풋357.5							27
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	27	27	27	27	27	27	27
-5.33%	17	17	17	17	17	17	17
-2.67%	8	8	8	8	8	8	8
0%	-1	0	0	0	0	0	1
2.67%	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-3
5.33%	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-3
8.00%	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-3

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

(단위:백만원)

98

공시일	2022-04-12
기준일	2022-04-11

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	9,518	0	9,518	

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	2022-04-12
기준일	2022-04-11

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	7,501	0	7,501	

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	2022-04-12
기준일	2022-04-11

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	25,681	0	25,681	
누계	통화	선도	3,206	28,028	-24,822	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213C2N KRW/USD 25-04-22E	2,242
FXW213C33 USD/KRW 25-04-22E	39
FXW213C3P USD/KRW 25-04-22E	99
FXW213C4B USD/KRW 25-04-22E	118
IE00BD8RGM75	

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

845

공시일 2022-04-12

기준일 2022-04-11

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

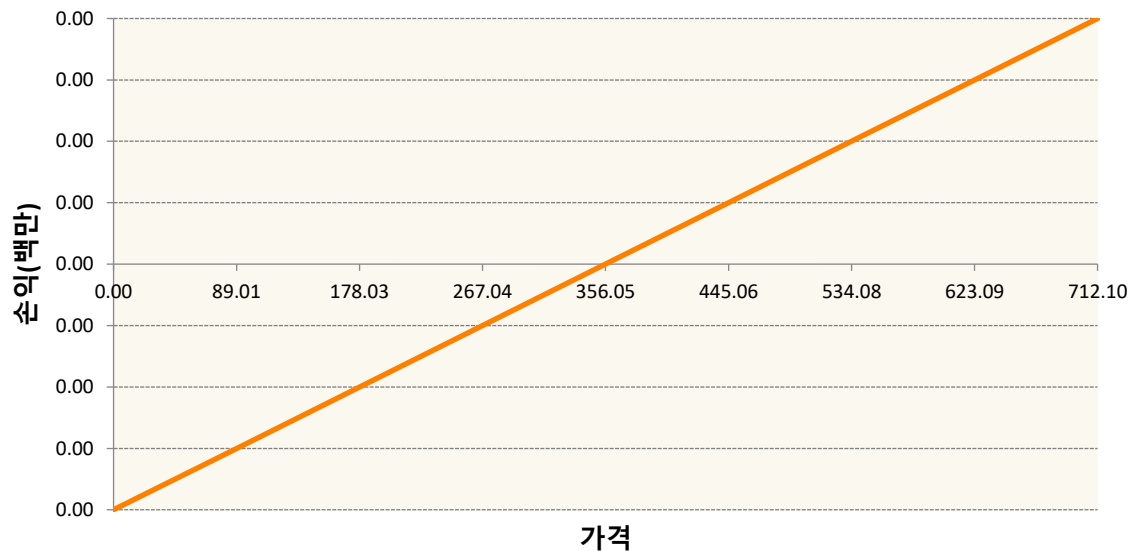
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,246	0	1,246	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101S60008-2022-06 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101S60008

2022-06 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 2022-04-12

기준일 2022-04-11

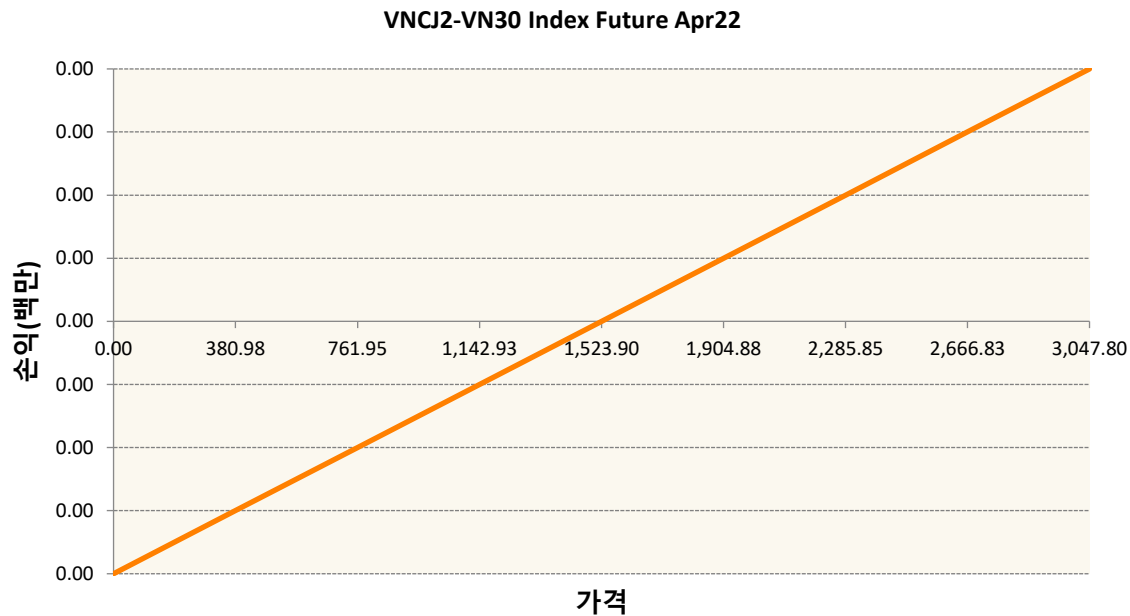
스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	838	0	838	
누계	유가증권	스왑	1,834	0	1,834	장외
누계	통화	선도	0	1,180	-1,180	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2.5504E+11 VN30TR Index(EUR)	147
FXW213C1K·KRW/EUR 22-04-22E	16
FXW213C2P·KRW/EUR 20-05-22E	46
FXW213C3G·KRW/EUR 24-06-22E	32
VNCJ2 VN30 Index Future Apr22	67

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

(단위:백만원)

270

공시일	2022-04-12
기준일	2022-04-11

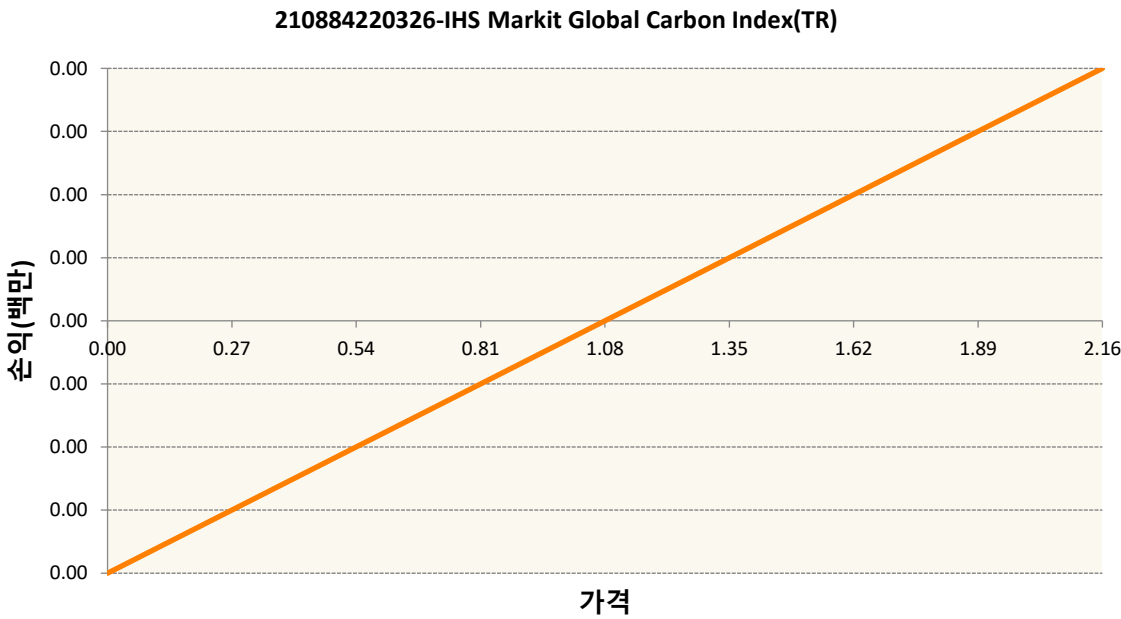
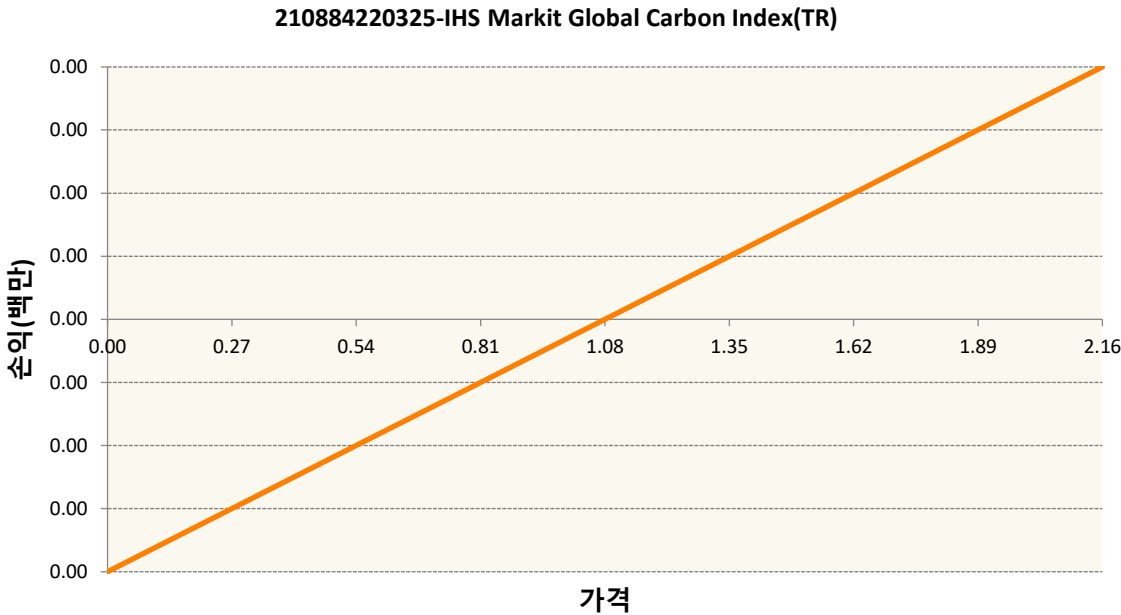
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

1. 계약금액

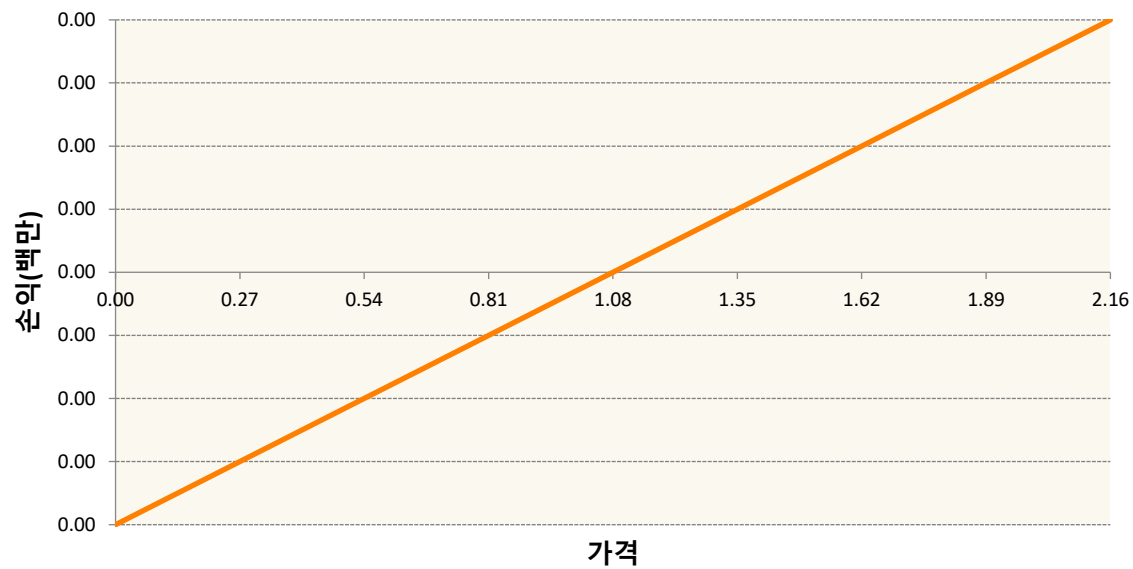
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	45,863	0	45,863	

2. 만기시점의 손익구조



210884220327-IHS Markit Global Carbon Index(TR)



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2.1088E+11 IHS Markit Global Carbon Index(TR)

193

2.1088E+11 IHS Markit Global Carbon Index(TR)

3,371

2.1088E+11 IHS Markit Global Carbon Index(TR)

97

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

(단위:백만원)

6,679

공시일 2022-04-12

기준일 2022-04-11

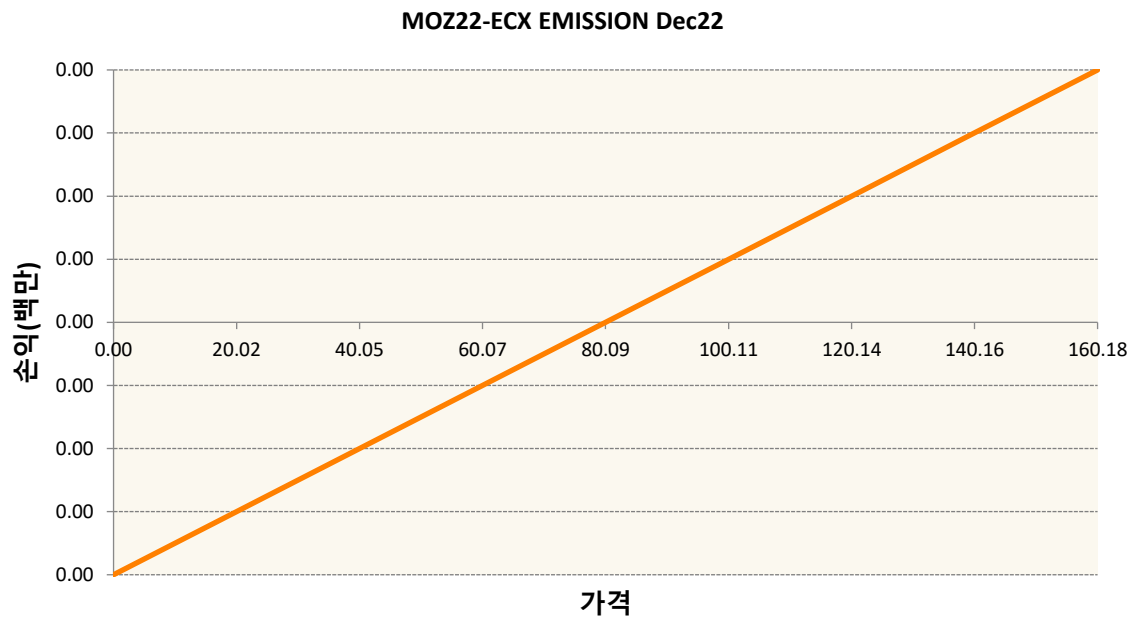
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	16,222	0	16,222	
누계	통화	선도	0	7,483	-7,483	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213C3V·KRW/EUR 25-04-22E

599

MOZ22 ECX EMISSION Dec22

1,298

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

(단위:백만원)

3,404

공시일	2022-04-12
기준일	2022-04-11

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	11,035	0	11,035	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI00000 신한CSI Index 220323 (NH)	27
SWCSI00000 신한CSI Index 220323 (키움)	27
SWCSI00000 신한CSI Index 220323 (미래)	27
SWCSI00000 신한CSI Index 220323 (메리츠)	27

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

(단위:백만원)

198

공시일	2022-04-12
기준일	2022-04-11

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	10,650	0	10,650	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220113(키움)	37
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220113(미래)	44
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220113(메리츠)	37
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220113(NH)	37

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

(단위:백만원)

193

공시일 2022-04-12

기준일 2022-04-11

에퀴티알파일반사모혼합자산

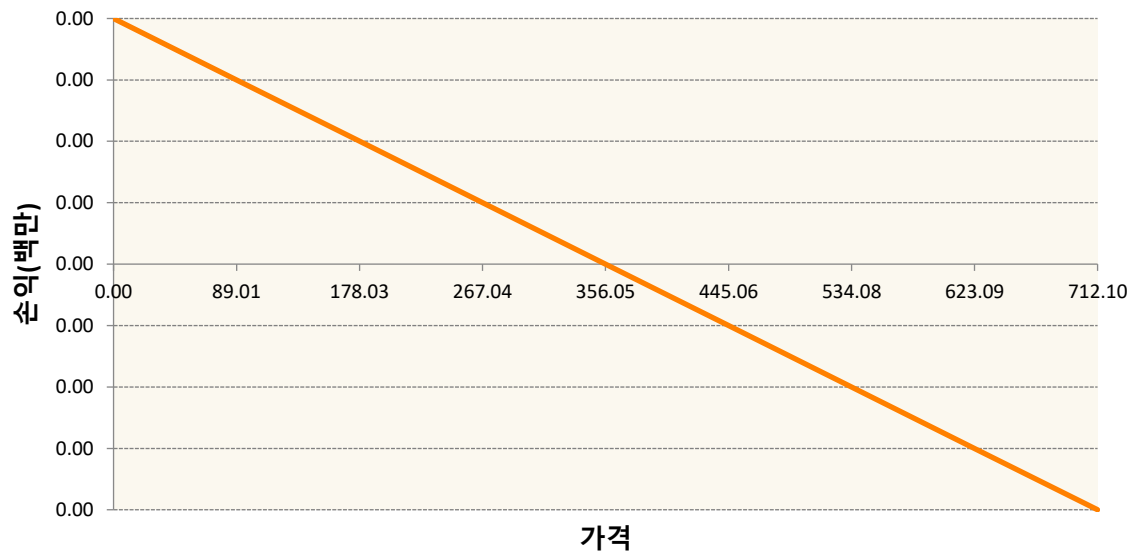
1. 계약금액

(단위:백만원)

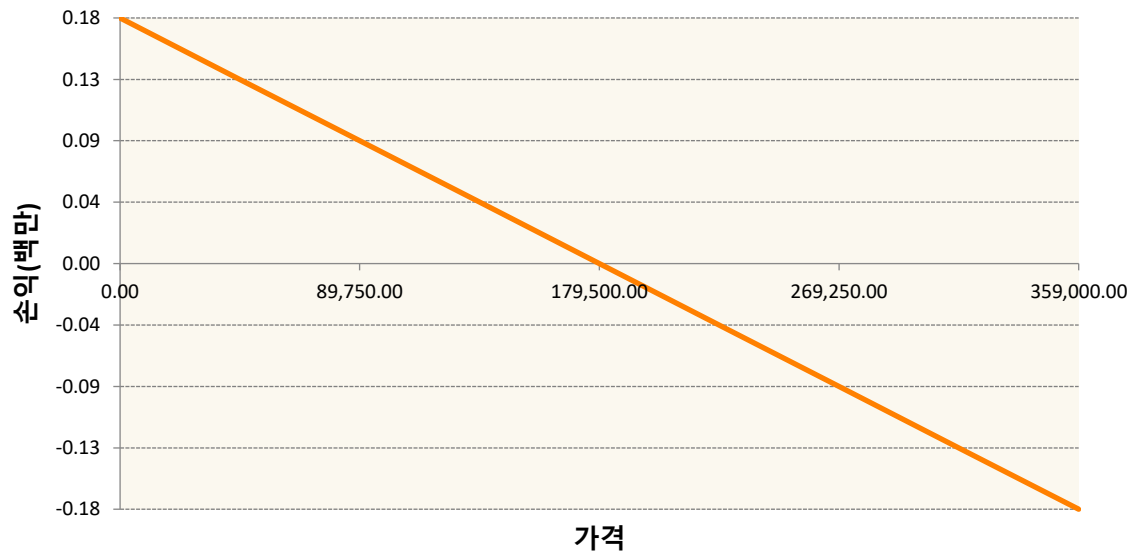
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	0	1,589	-1,589	장내
누계	유가증권	스왑	0	0	0	장외

2. 만기시점의 손익구조

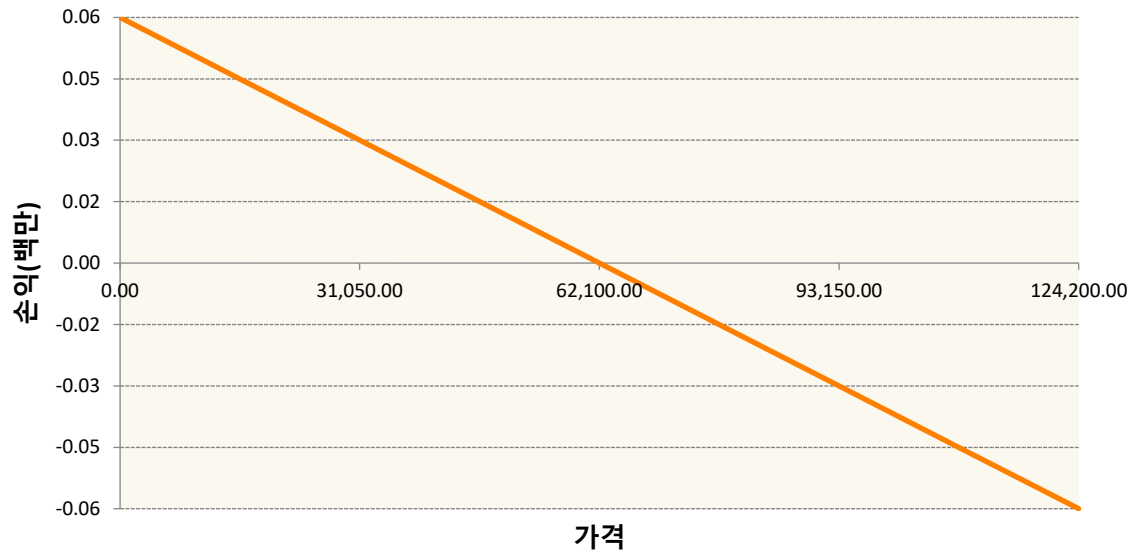
KR4101S60008-2022-06 코스피200지수선물



KR4116S40008-2022-04 현대차개별선물



KR41ERS40006-2022-04 DL이앤씨개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101S600 2022-06 코스피200지수선물	107
KR4116S400 2022-04 현대차개별선물	9
KR41ERS400 2022-04 DL이앤씨개별선물	12
KRS0003014 SWAP_SPDR S&P O&G EXP_0322	2
KRS0003014 SWAP_NVIDIA CORP_0322	2
KRS0003014 SWAP_CRWDSTRK HLD INC_0322	0.34
KRS0003041 SWAP_MICRON TECH CORP_0331	2
KRS0003070 SWAP_PRSH ST FTRS ETF_0407	1
KRS0003070 SWAP_CRWDSTRK HLD INC_0407	0.12

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

(단위:백만원)

142

공시일 2022-04-12

기준일 2022-04-11

신한SOL한국형글로벌반도체액티

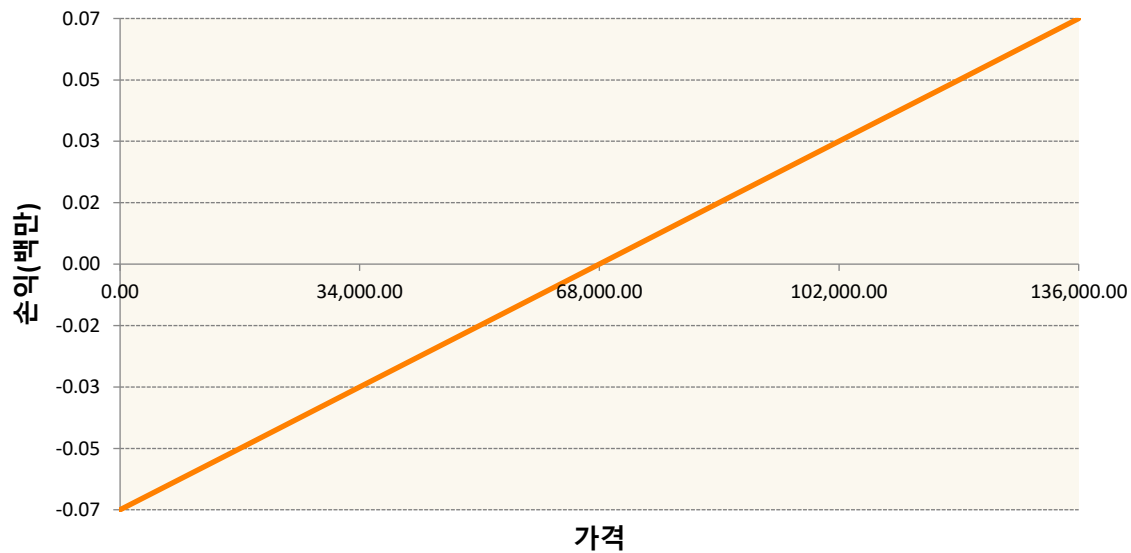
1. 계약금액

(단위:백만원)

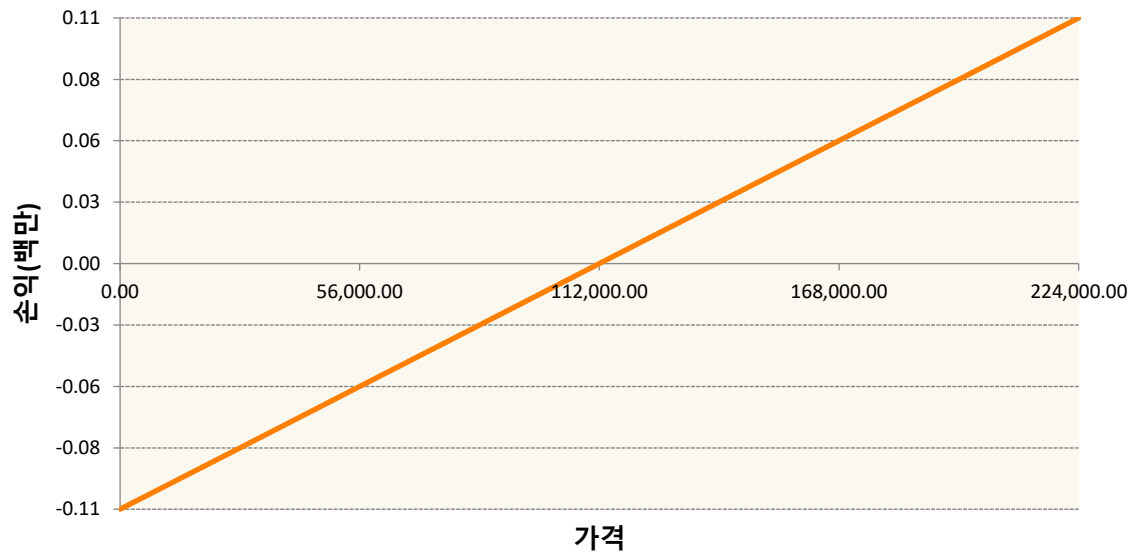
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	895	0	895	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4111S50008-2022-05 삼성전자개별선물



KR4150S50006-2022-05 SK하이닉스개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4111S50008		2022-05 삼성전자개별선물					35
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-35	-35	-35	-35	-35	-35	-35
-5.33%	-23	-23	-23	-23	-23	-23	-23
-2.67%	-12	-12	-12	-12	-12	-12	-12
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	12	12	12	12	12	12	12
5.33%	23	23	23	23	23	23	23
8.00%	35	35	35	35	35	35	35
KR4150S50006		2022-05 SK하이닉스개별선물					36
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-36	-36	-36	-36	-36	-36	-36
-5.33%	-24	-24	-24	-24	-24	-24	-24
-2.67%	-12	-12	-12	-12	-12	-12	-12
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	12	12	12	12	12	12	12
5.33%	24	24	24	24	24	24	24
8.00%	36	36	36	36	36	36	36

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

76

공시일 2022-04-12

기준일 2022-04-11

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

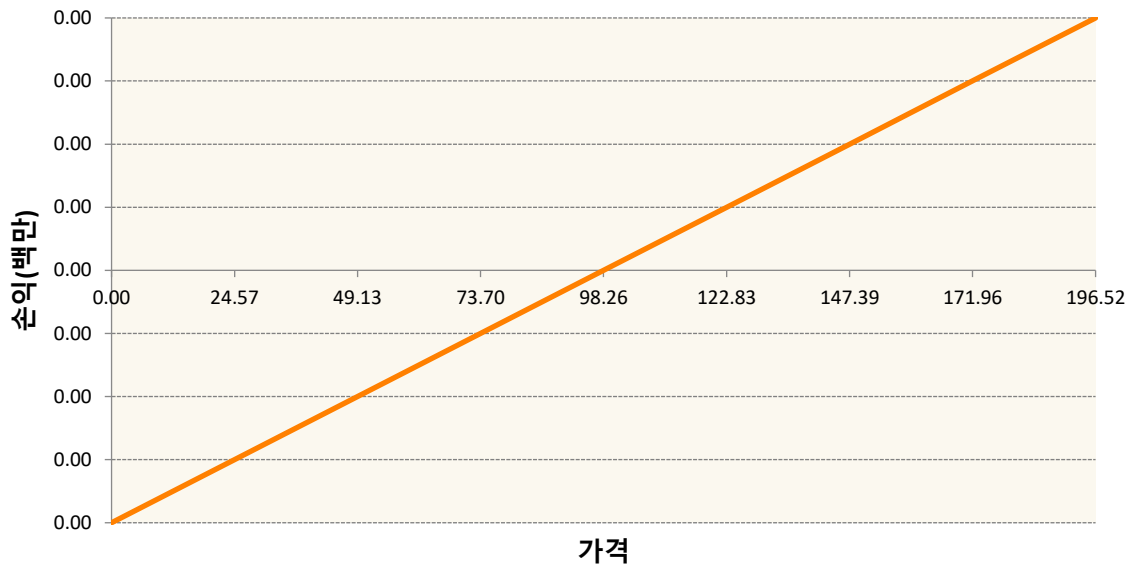
1. 계약금액

(단위:백만원)

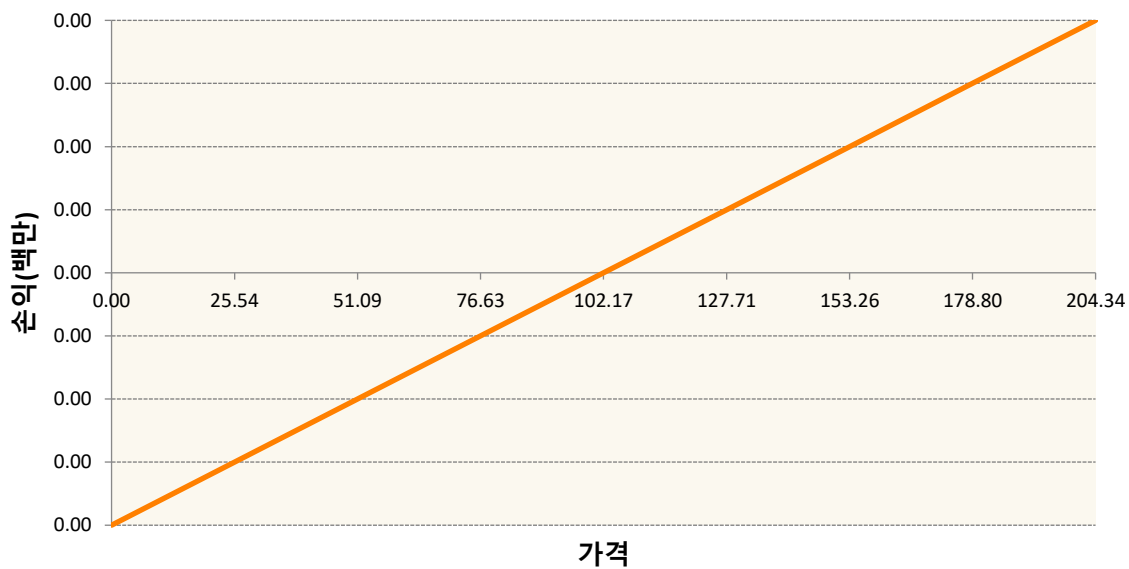
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,300	555	1,745	

2. 만기시점의 손익구조

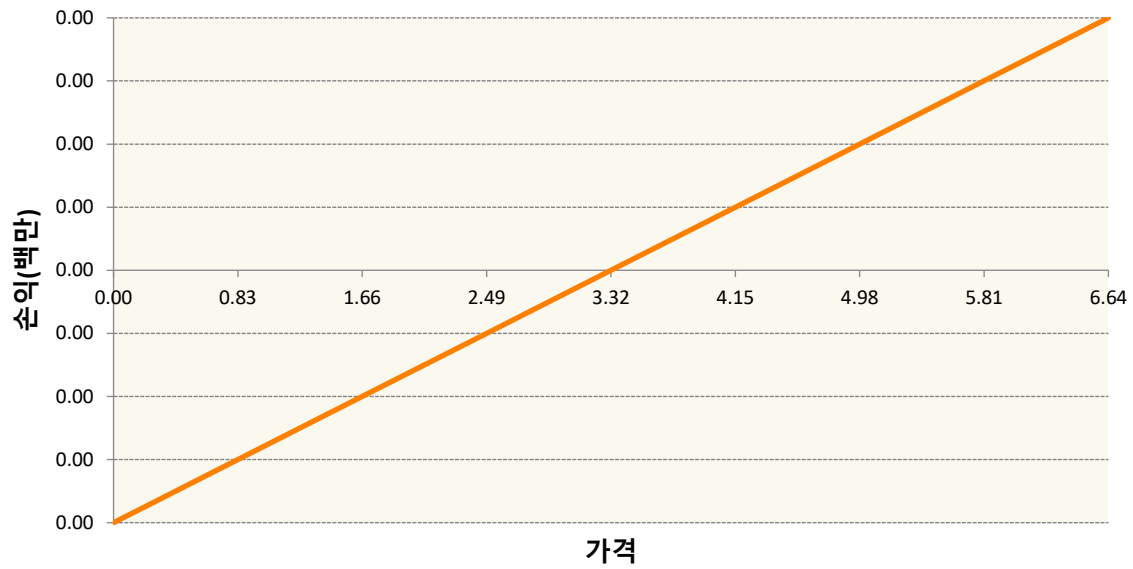
CLK2-WTI CRUDE FUTURE May22



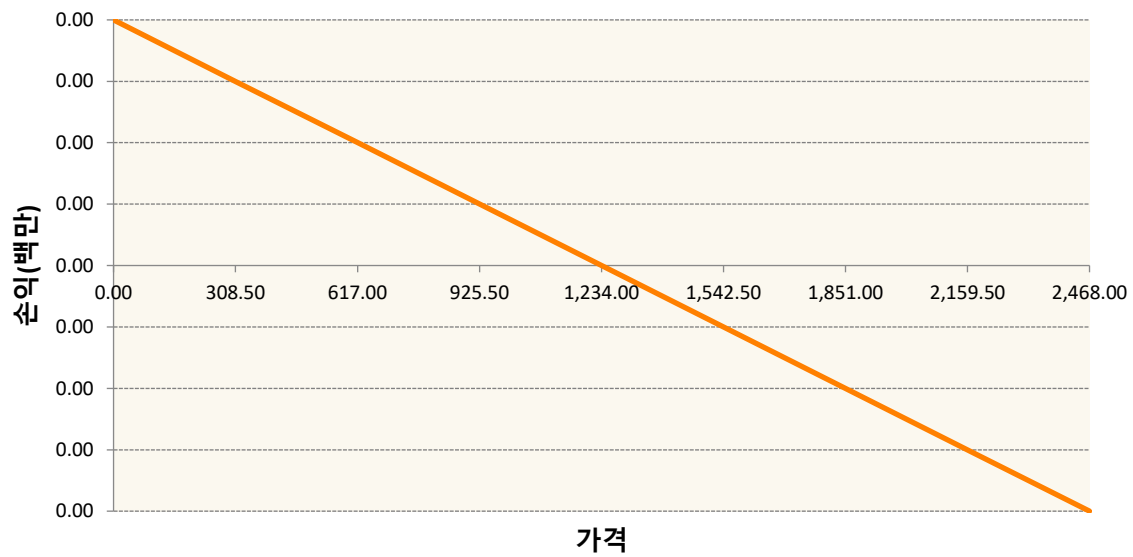
CON2-BRENT CRUDE FUTR Jul22



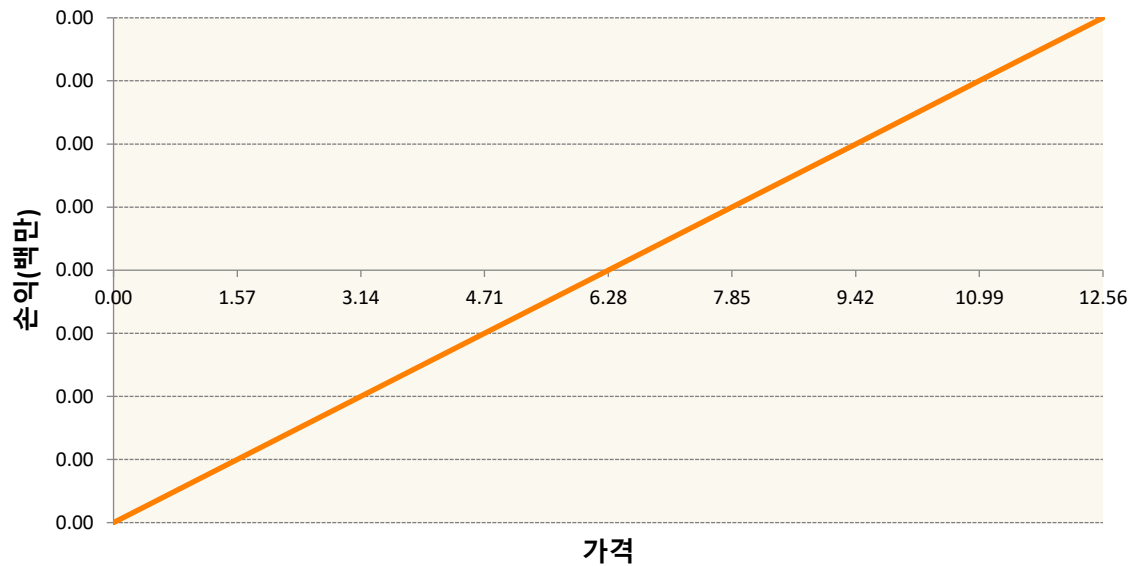
HOK2-NY Harb ULSD Fut May22

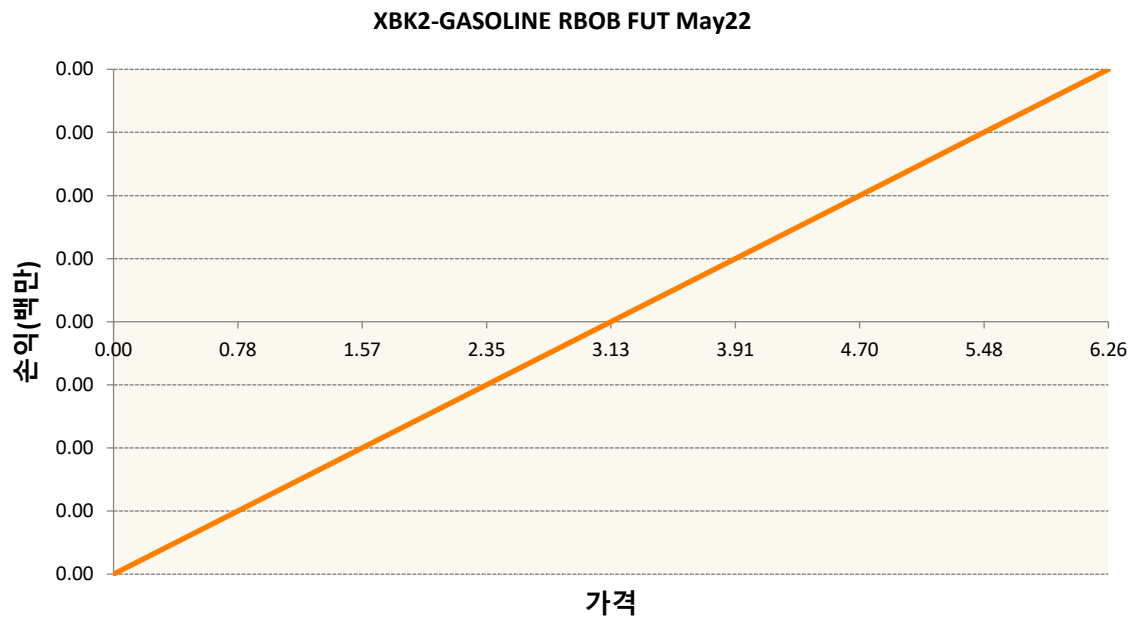
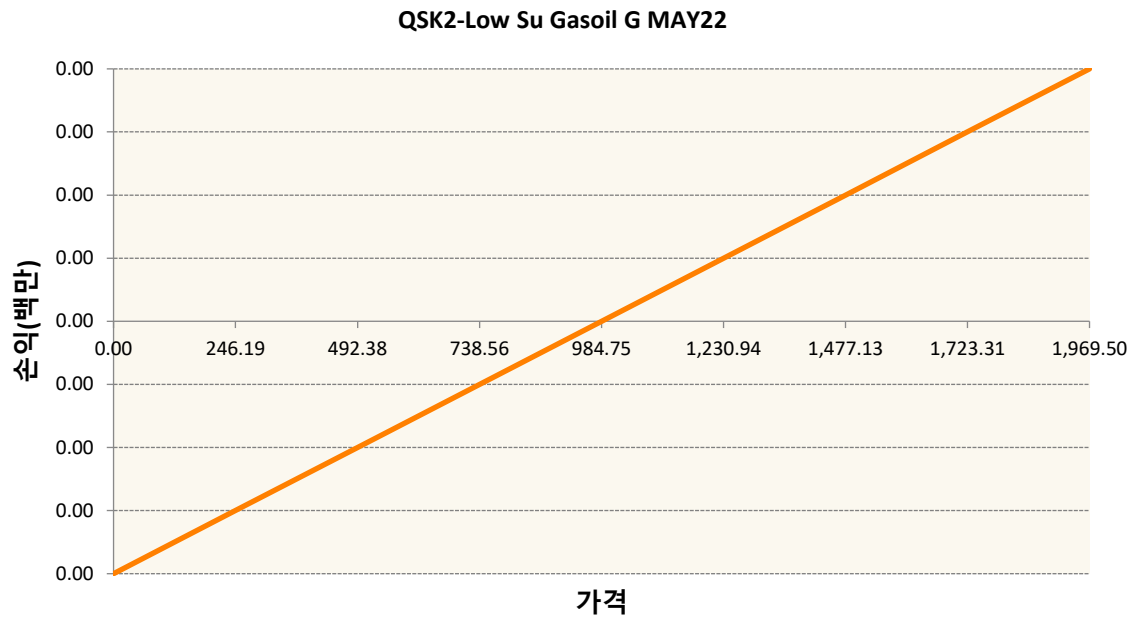


KR4175S40004-2022-04 달러선물



NGK22-NATURAL GAS FUTR May22





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
CLK2	WTI CRUDE FUTURE May22		38
CON2	BRENT CRUDE FUTR Jul22		40
HOK2	NY Harb ULSD Fut May22		13
KR4175S400 2022-04 달러선물			44
NGK22	NATURAL GAS FUTR May22		61
QSK2	Low Su Gasoil G MAY22		19
XBK2	GASOLINE RBOB FUT May22		13

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)		(단위:백만원)
		520