

공시일	2022-05-20
기준일	2022-05-19

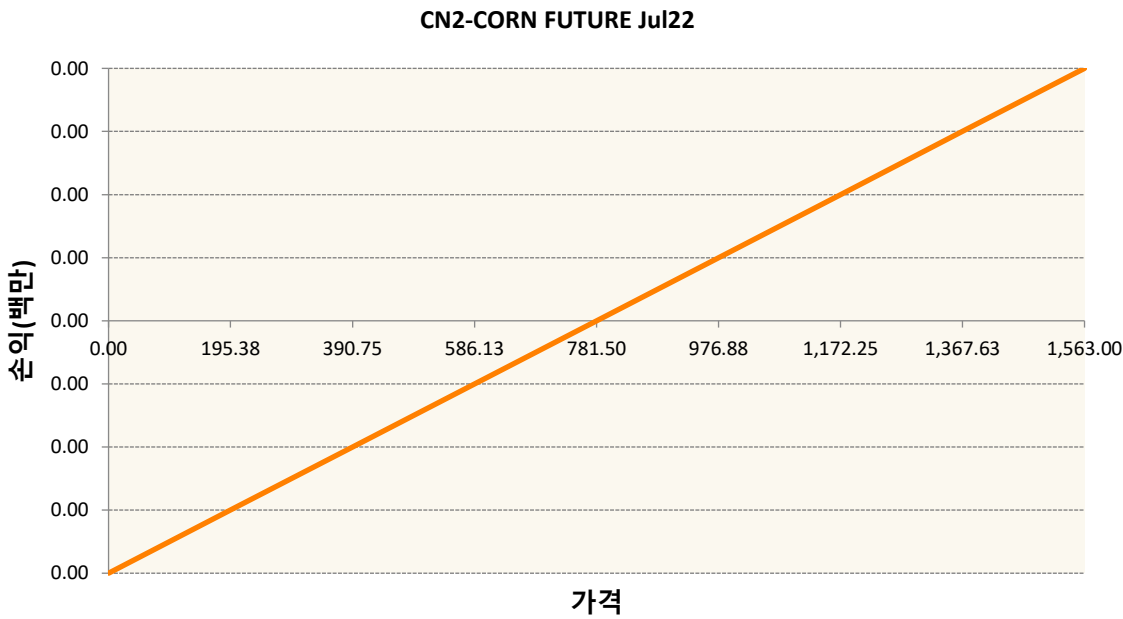
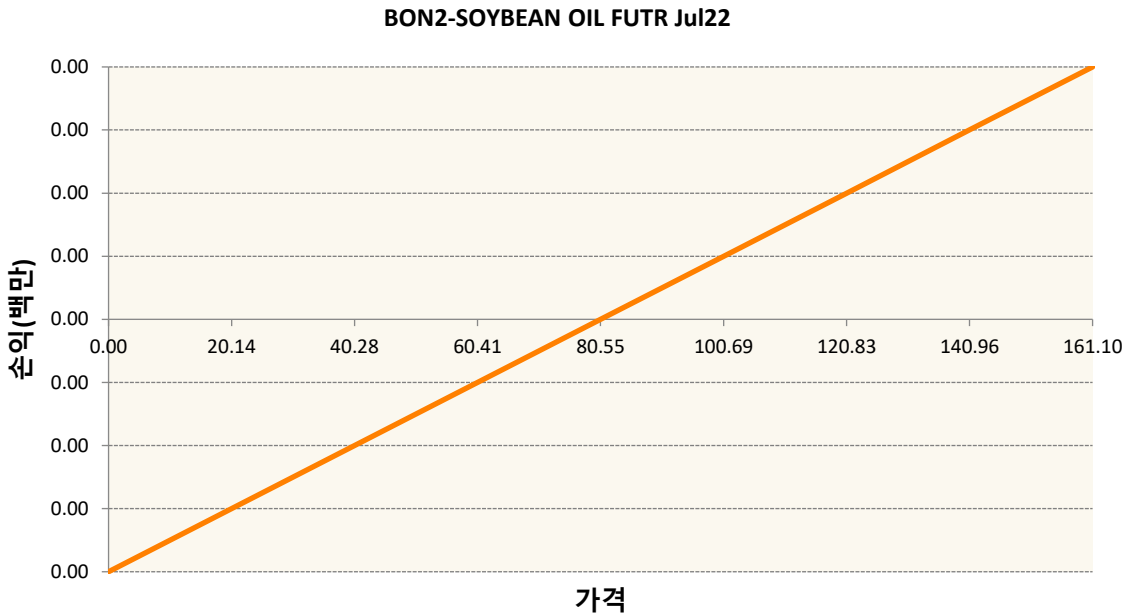
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

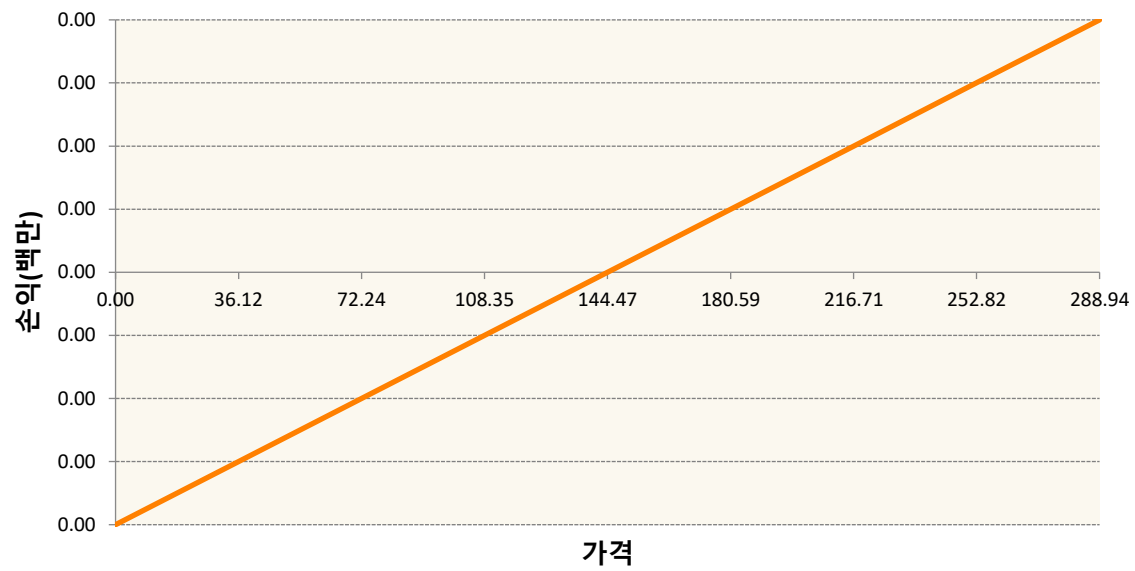
(단위:USD 백만)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	8,602	1,982	6,621	

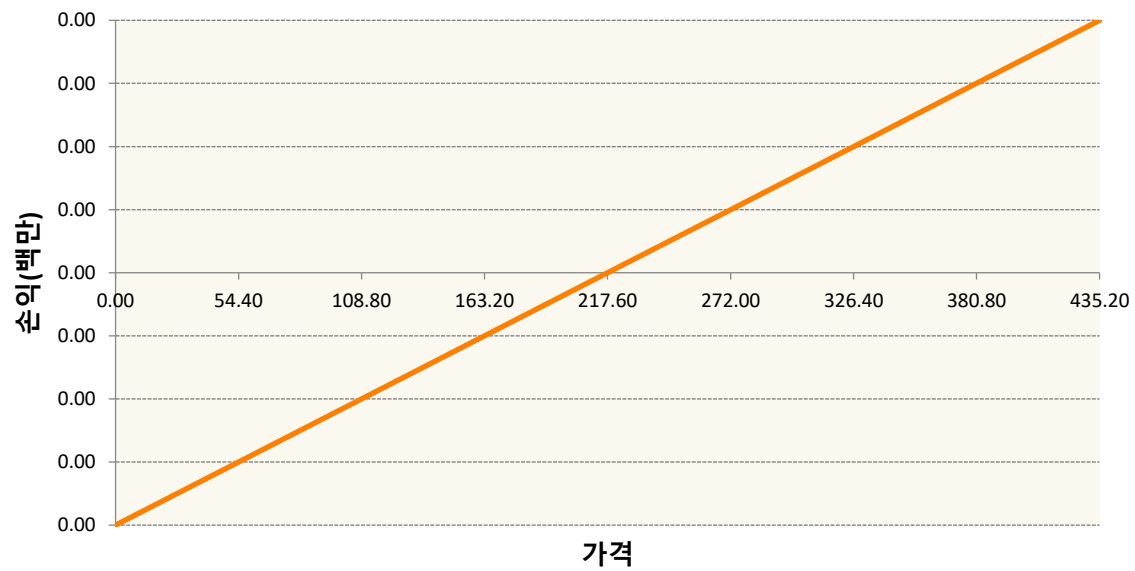
2. 만기시점의 손익구조



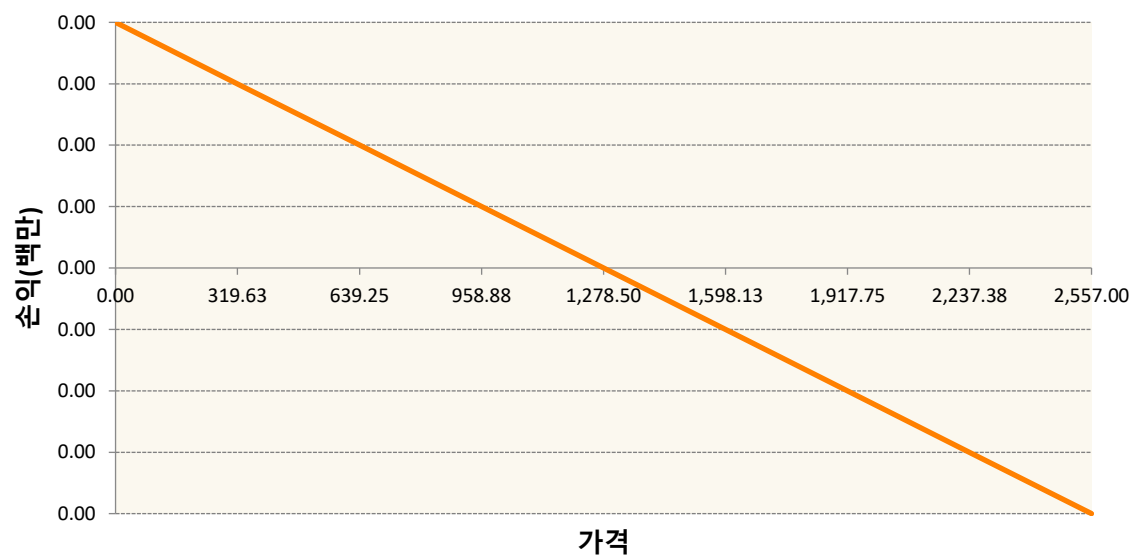
CTN2-COTTON NO.2 FUTR Jul22



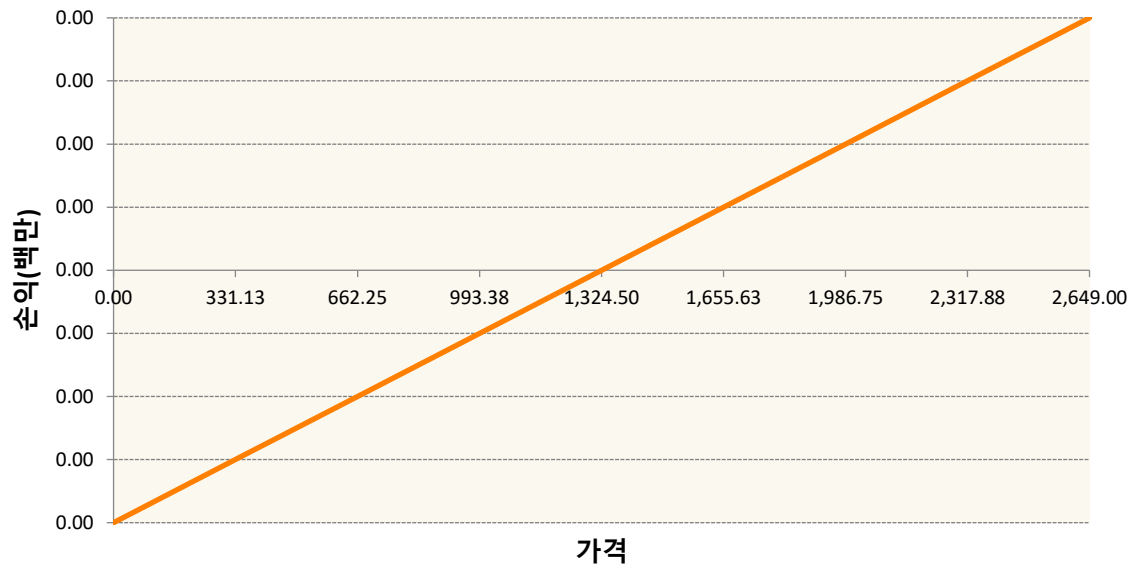
KCN2-COFFEE 'C' FUTURE Jul22



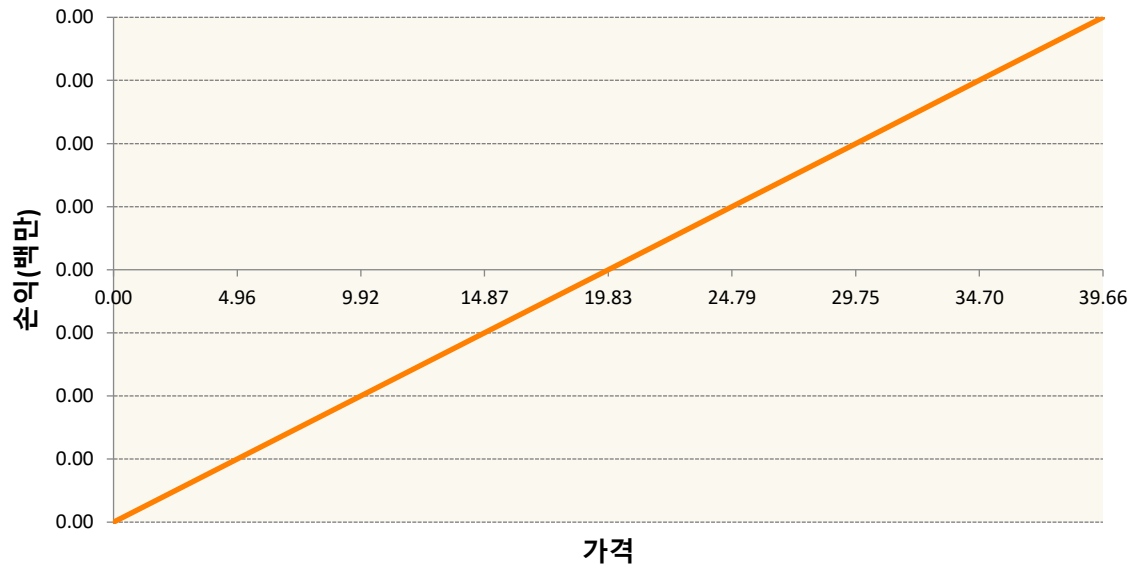
KR4175S60002-2022-06 달러선물



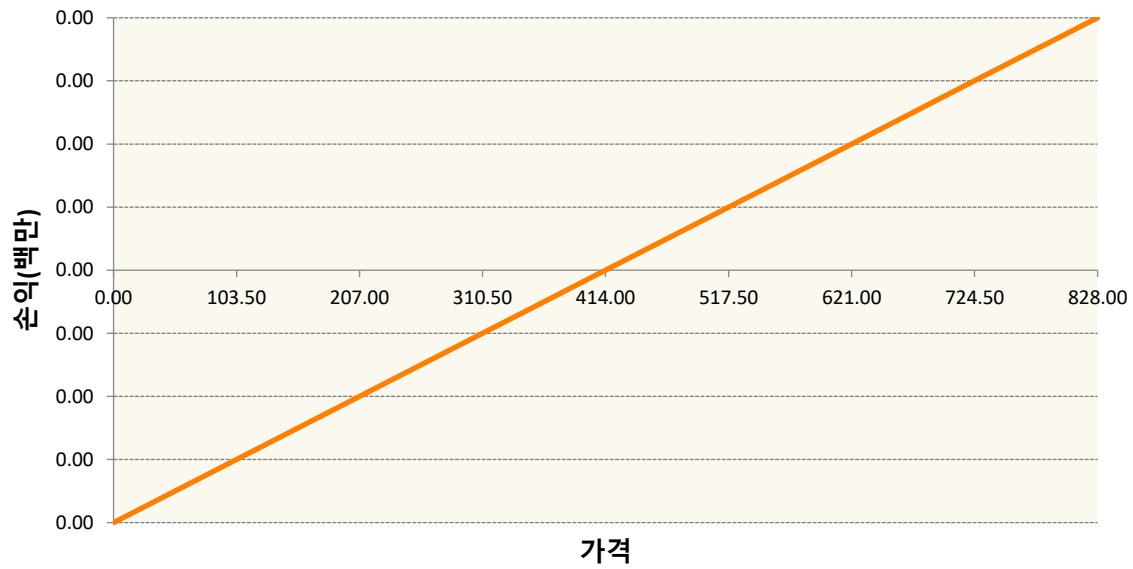
KWN2-KC HRW WHEAT FUT Jul22

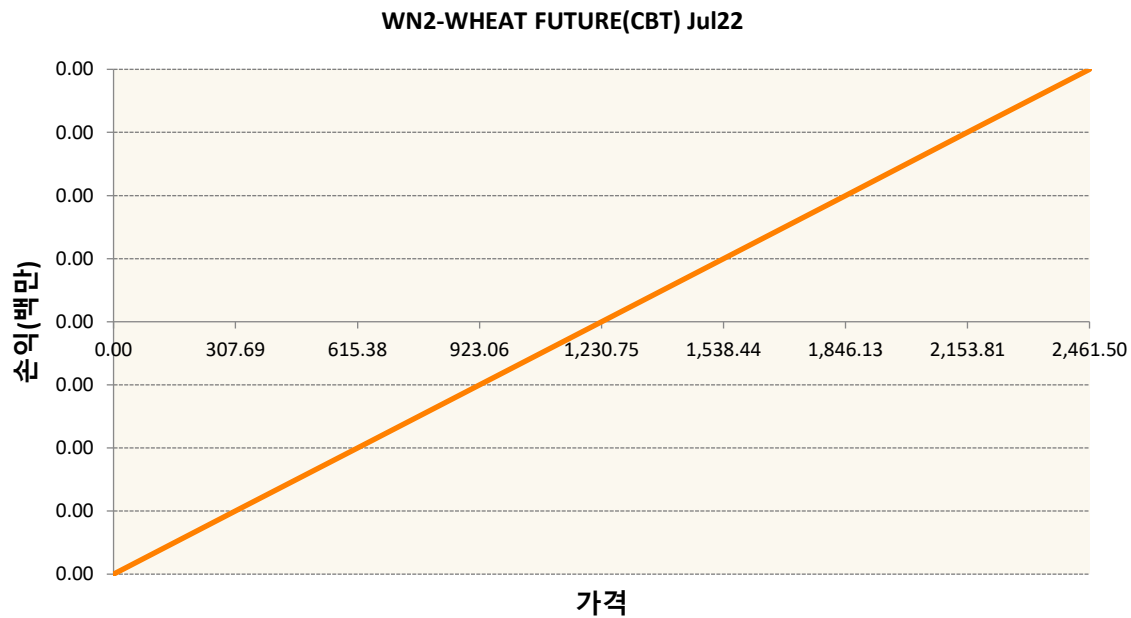
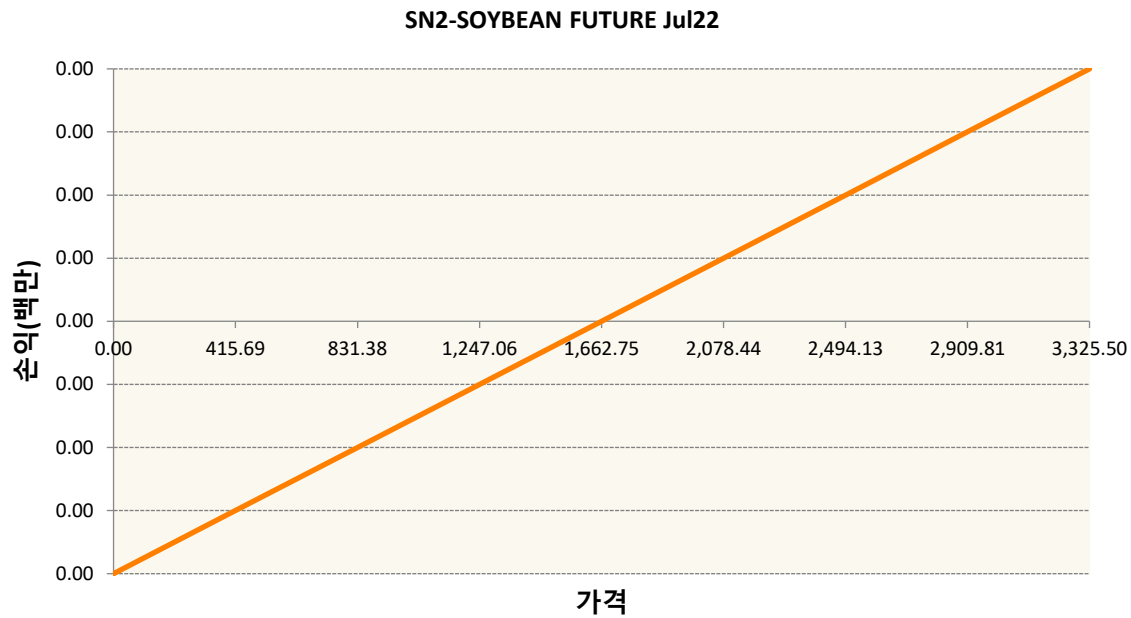


SBN2-Sugar #11 (WORLD) Jul22



SMN2-SOYBEAN MEAL FUTR 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	2022-05-20
기준일	2022-05-19

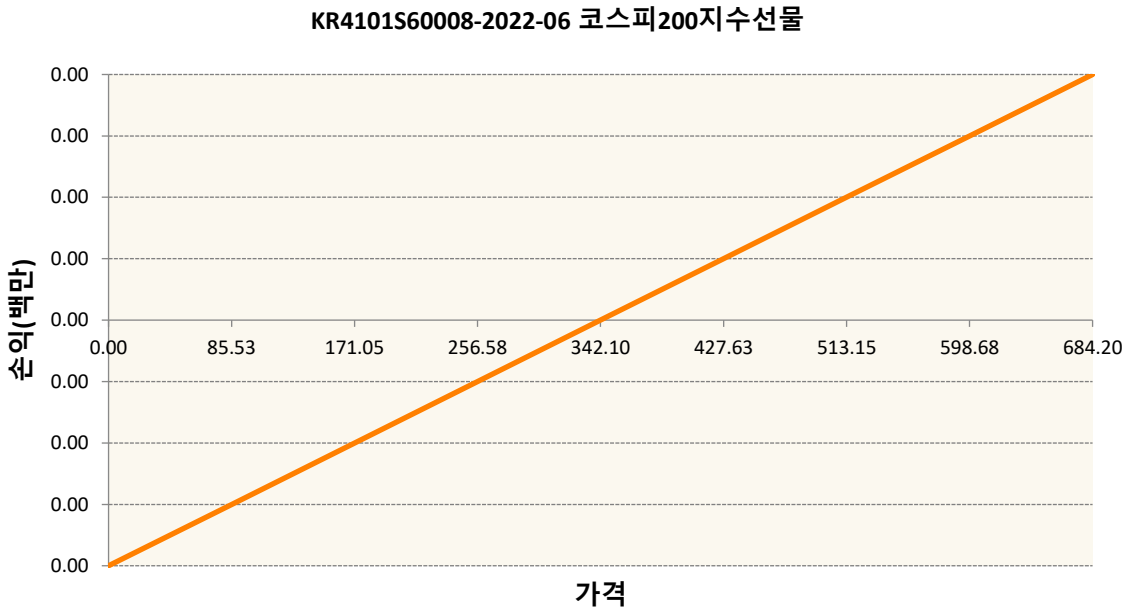
스마트인덱스모

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	684	0	684	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101S60008				2022-06 코스피200지수선물			55
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-55	-55	-55	-55	-55	-55	-55
-5.33%	-37	-37	-37	-37	-37	-37	-37
-2.67%	-18	-18	-18	-18	-18	-18	-18
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	18	18	18	18	18	18	18
5.33%	37	37	37	37	37	37	37
8.00%	55	55	55	55	55	55	55

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

(단위:백만원)

50

공시일	2022-05-20
기준일	2022-05-19

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

337

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

416

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2022-05-20
기준일	2022-05-19

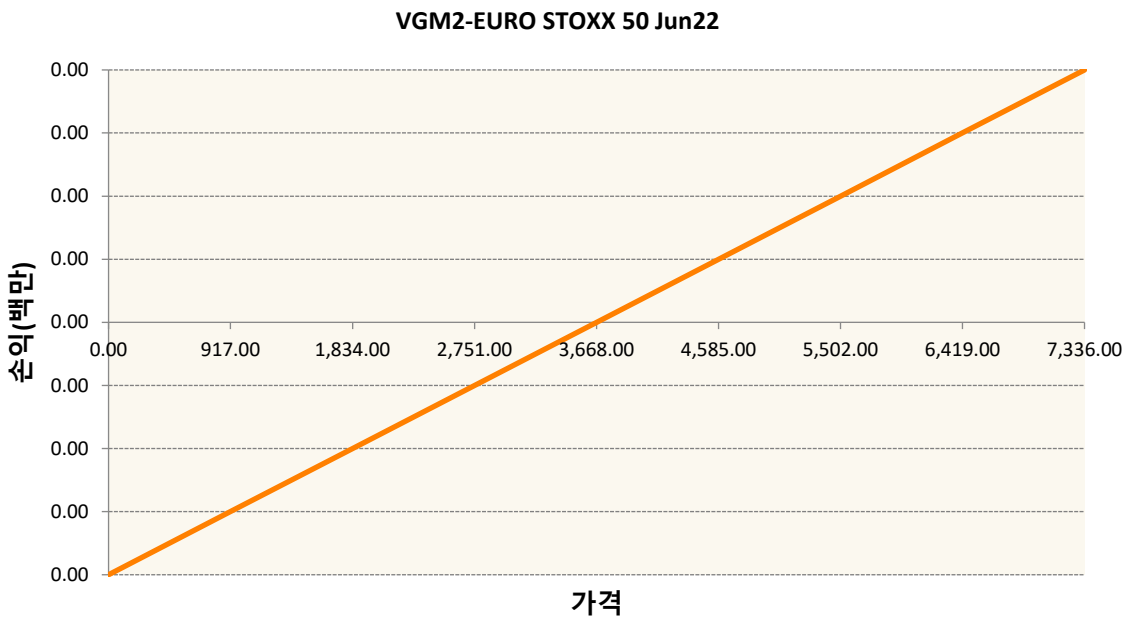
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	547	0	547	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM2	EURO STOXX 50 Jun22	44
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

42

공시일	2022-05-20
기준일	2022-05-19

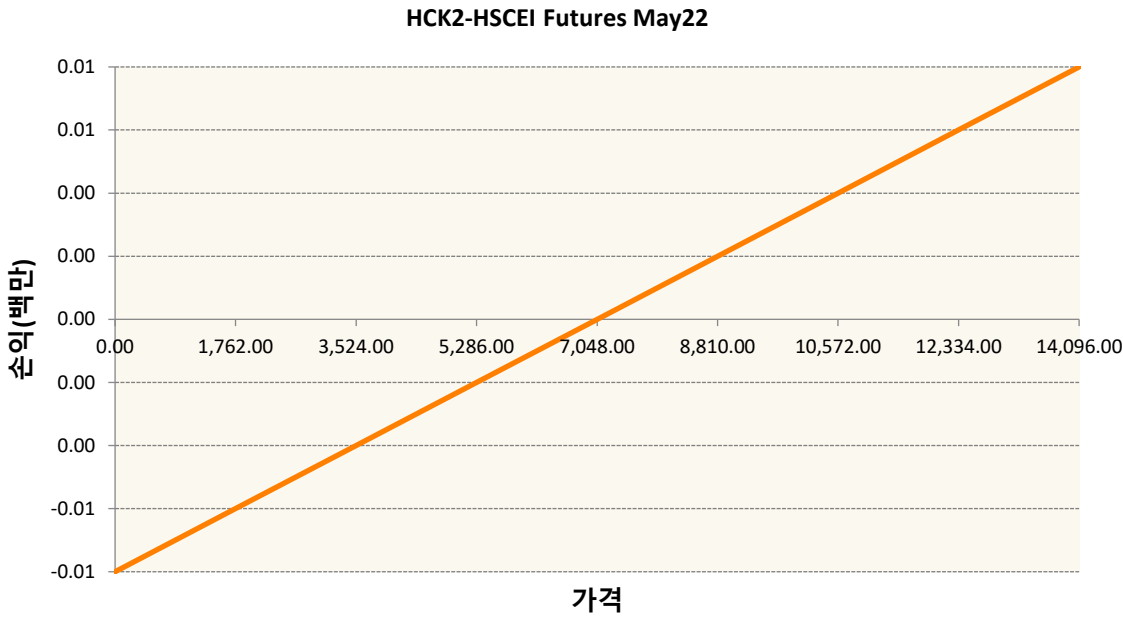
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,137	0	1,137	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCK2	HSCEI Futures May22	91
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

129

공시일 2022-05-20

기준일 2022-05-19

커버드콜모(주식혼합-파생형)

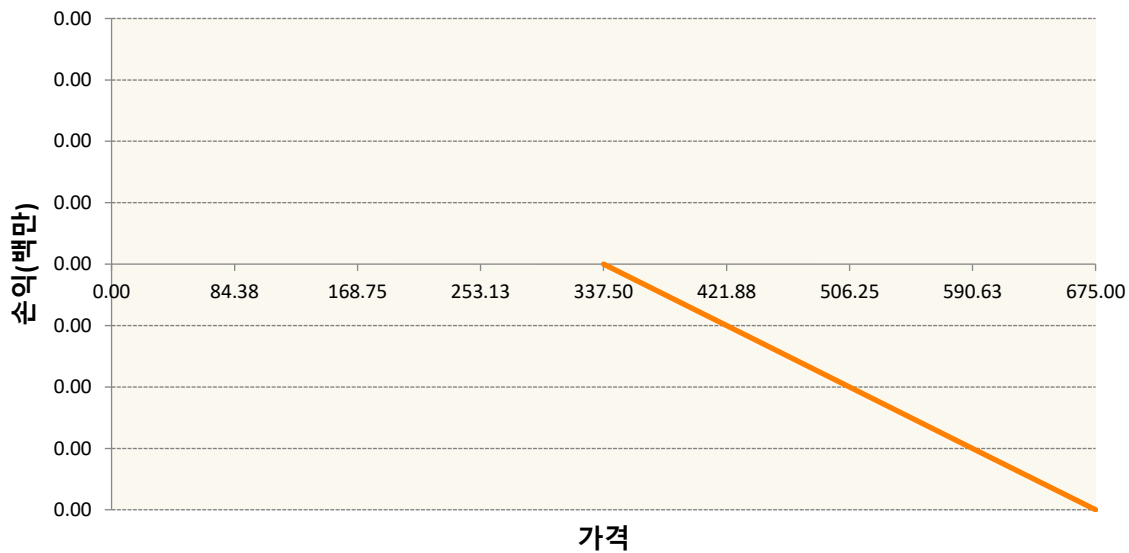
1. 계약금액

(단위:백만원)

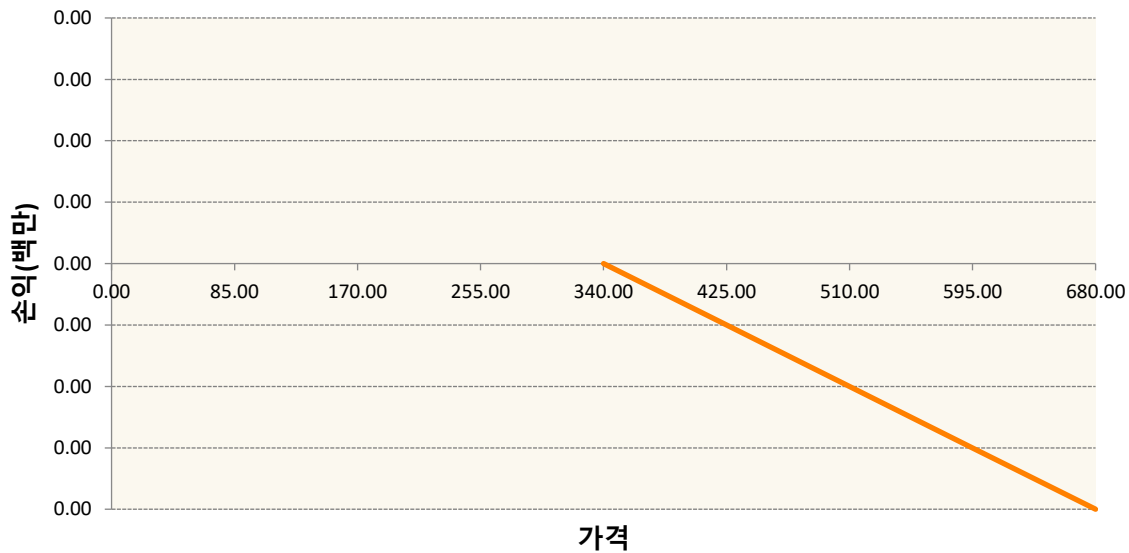
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	63,534	-63,534	장내

2. 만기시점의 손익구조

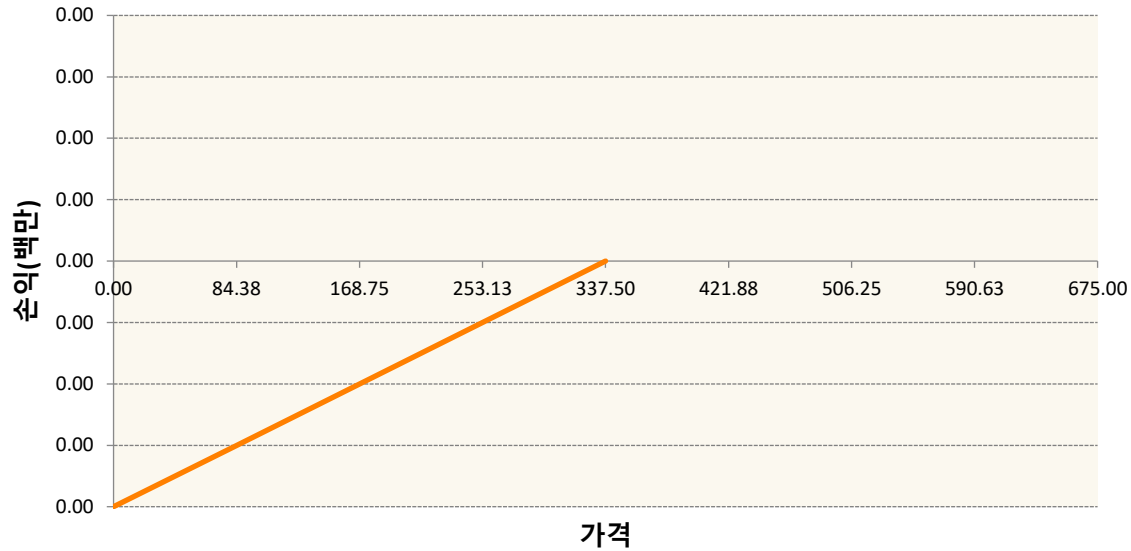
KR4201S63372-2022-06 콜337.5



KR4201S63406-2022-06 콜340



KR4301S63370-2022-06 풋337.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201S63372			2022-06 콜337.5				2,727
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,448	1,399	1,344	1,284	1,219	1,151	1,080
-5.33%	1,251	1,173	1,093	1,010	925	838	750
-2.67%	875	779	682	586	489	392	295
0%	286	192	96	0	-97	-193	-290
2.67%	-501	-577	-656	-739	-824	-912	-1,001
5.33%	-1,437	-1,487	-1,544	-1,606	-1,673	-1,745	-1,819
8.00%	-2,464	-2,491	-2,526	-2,567	-2,615	-2,669	-2,727
KR4201S63406			2022-06 콜340				737
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	365	353	339	324	308	290	272
-5.33%	320	300	279	257	235	212	188
-2.67%	230	204	177	151	124	98	71
0%	82	55	27	0	-27	-55	-82
2.67%	-123	-146	-170	-195	-220	-245	-271
5.33%	-374	-390	-408	-427	-447	-469	-491
8.00%	-654	-663	-674	-688	-703	-719	-737
KR4301S63370			2022-06 풋337.5				648
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-605	-609	-615	-622	-629	-638	-648
-5.33%	-319	-331	-343	-357	-371	-385	-401
-2.67%	-90	-108	-127	-145	-163	-182	-200
0%	53	36	18	0	-18	-36	-55

2.67%	118	107	96	83	69	55	40
5.33%	138	134	129	122	114	105	95
8.00%	143	142	140	137	134	129	123

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

(단위:백만원)

4,013

공시일	2022-05-20
기준일	2022-05-19

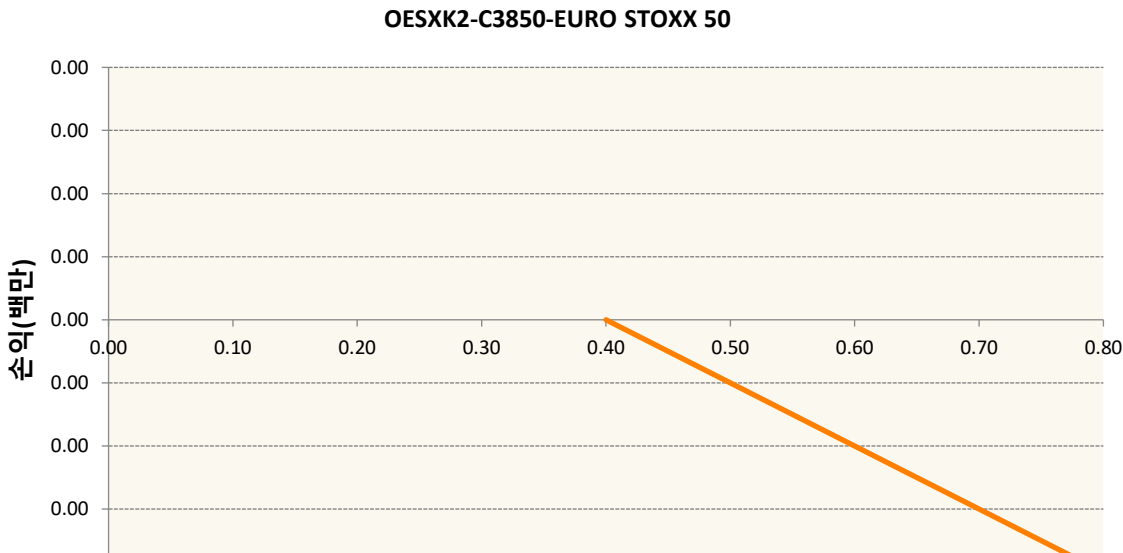
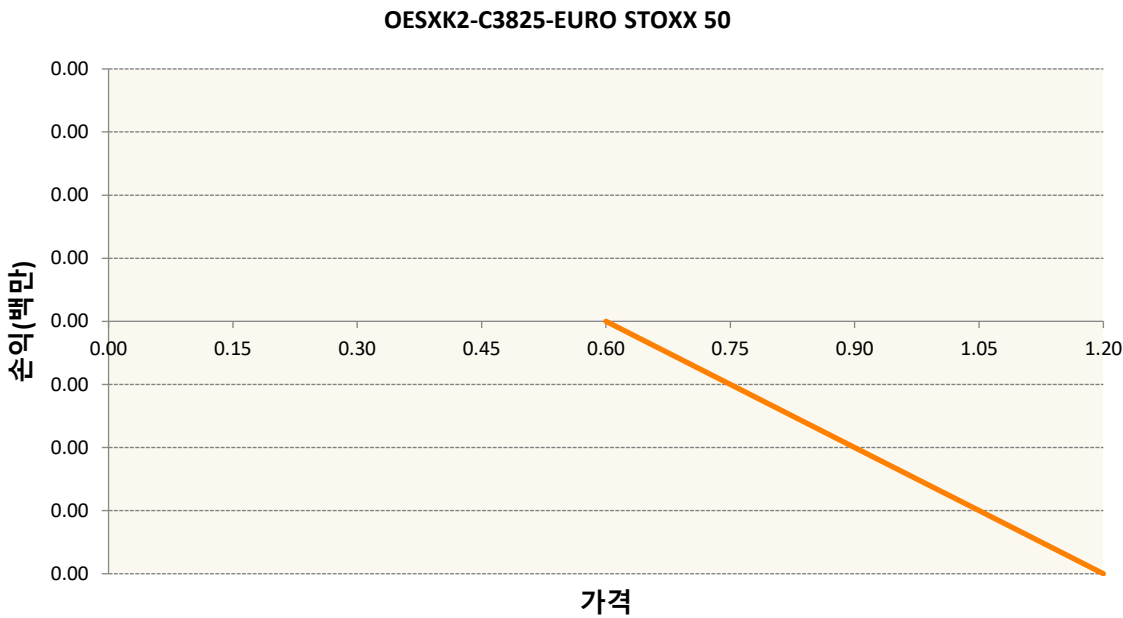
유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

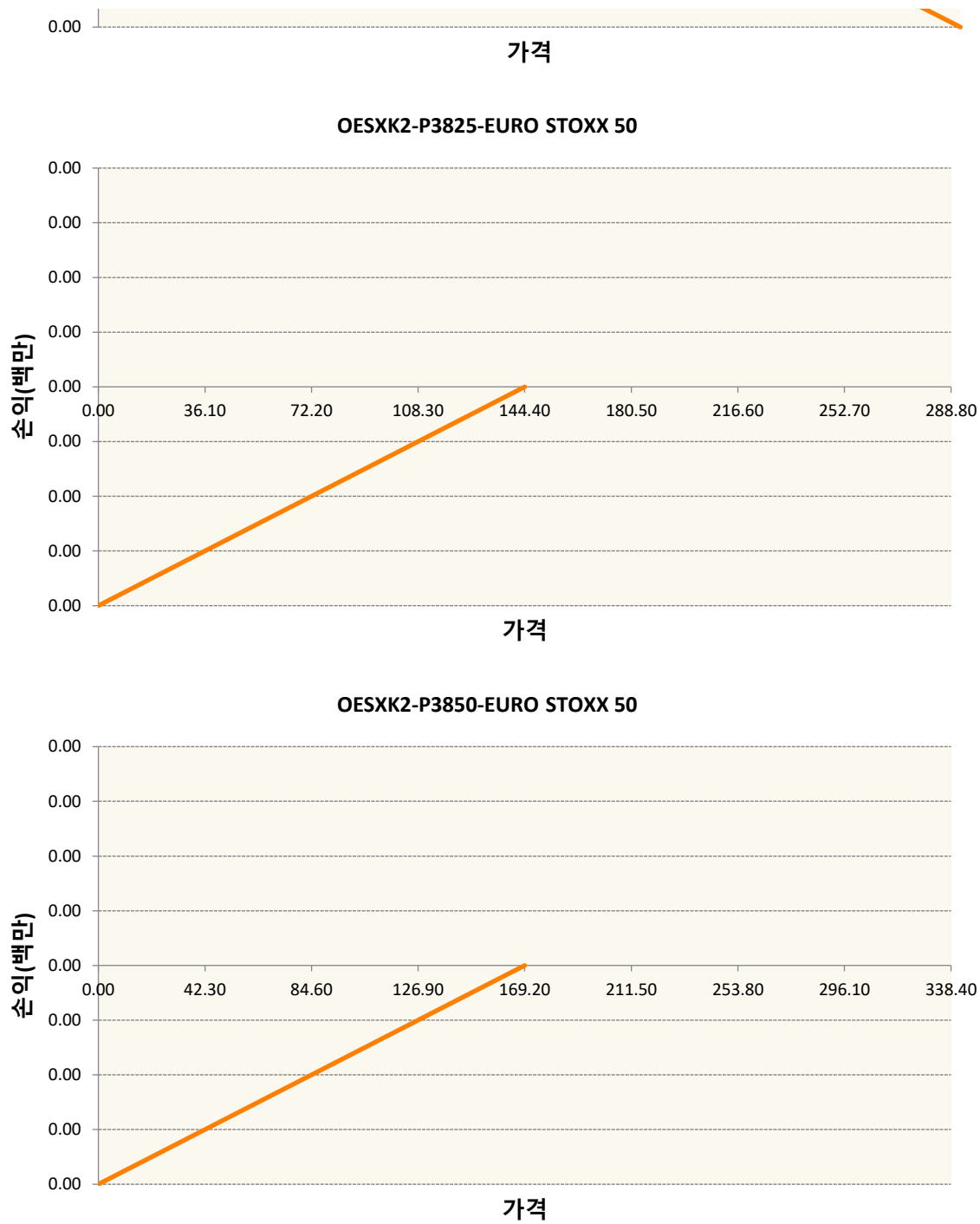
1. 계약금액

(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	59	-59	장내
누계	지수	스왑	10	0	10	장외
누계	통화	선도	0	1,473	-1,473	장외

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY
 FXW213C2F KRW/EUR 27-05-22E
 FXW213C38 KRW/EUR 27-05-22E
 FXW213C4L KRW/EUR 24-06-22E
 OESXK2-C38 EURO STOXX 50
 OESXK2-C38 EURO STOXX 50
 OESXK2-P38 EURO STOXX 50
 OESXK2-P38 EURO STOXX 50

19
21
64
32
0
0.01
0.15
5

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

(단위:백만원)

100

공시일 2022-05-20

기준일 2022-05-19

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

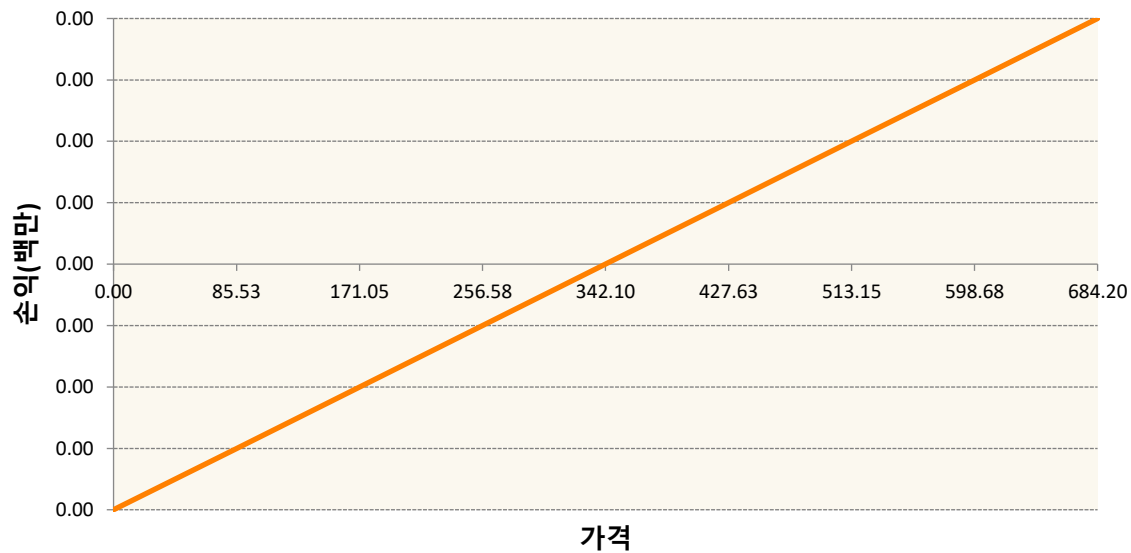
1. 계약금액

(단위:백만원)

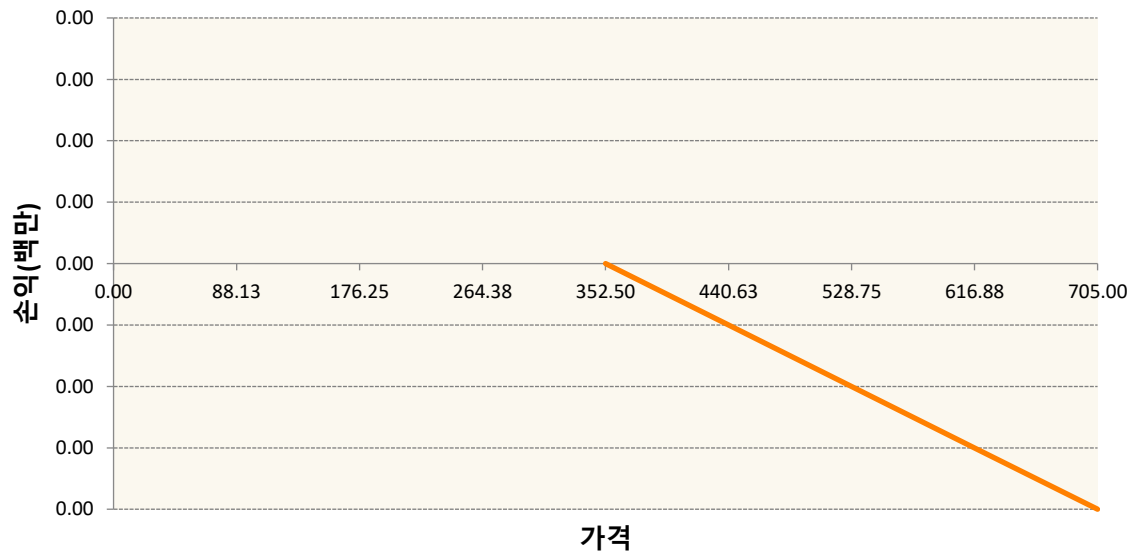
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	513	0	513	장내
누계	유가증권	옵션	338	4,613	-4,274	장내

2. 만기시점의 손익구조

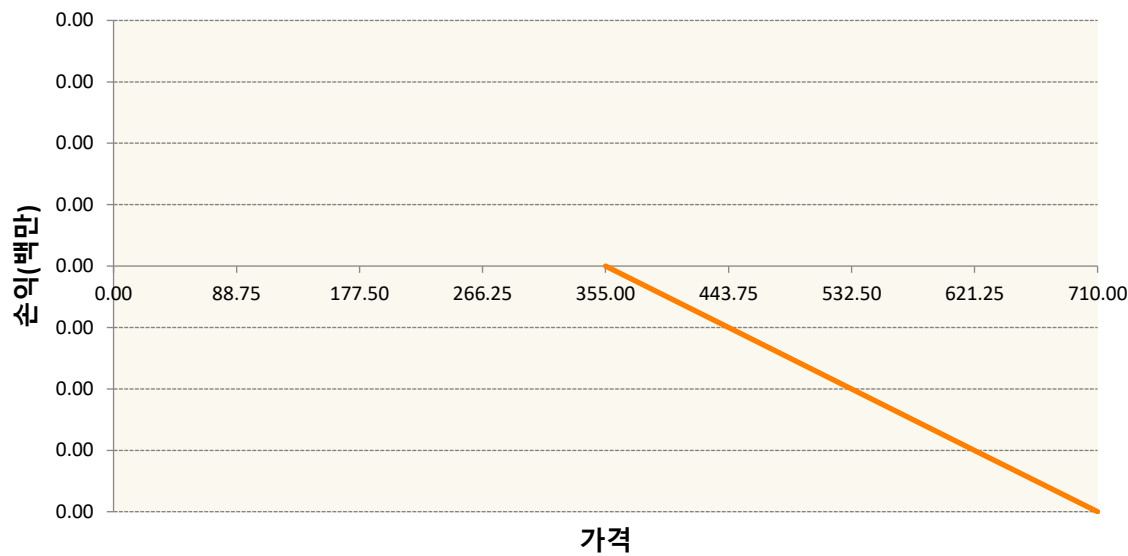
KR4101S60008-2022-06 코스피200지수선물



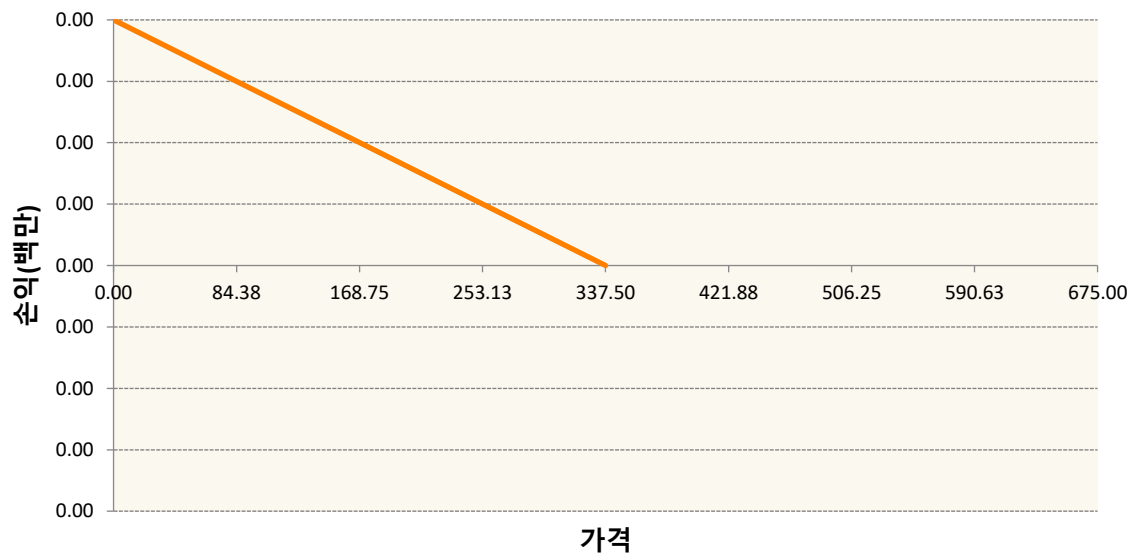
KR4201S63521-2022-06 콜352.5



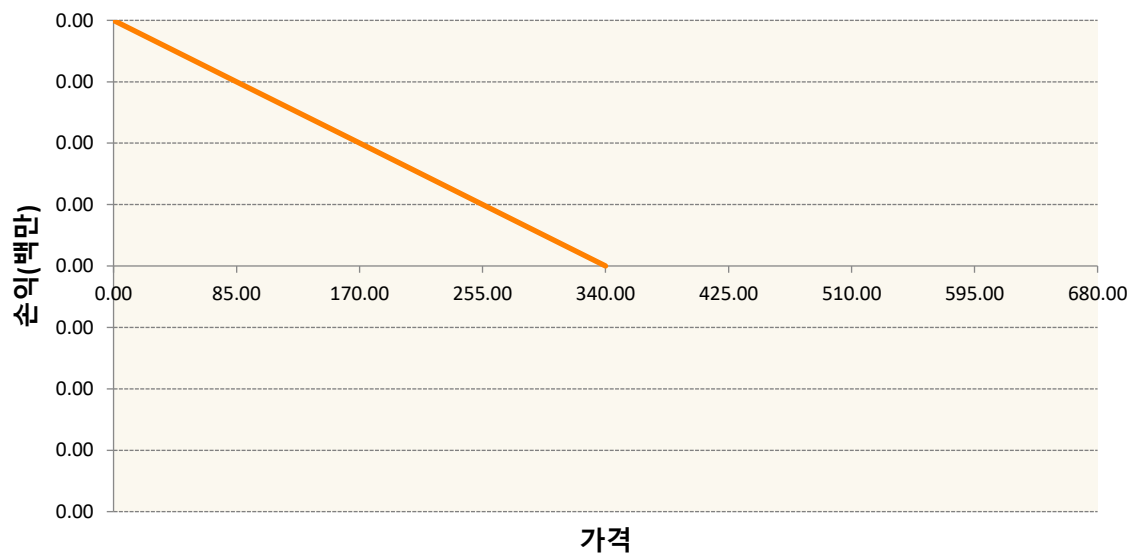
KR4201S63554-2022-06 콜355



KR4301S63370-2022-06 풋337.5



KR4301S63404-2022-06 풋340



(단위:백만원)

KR4101S60008				2022-06 코스피200지수선물			41
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-41	-41	-41	-41	-41	-41	-41
-5.33%	-27	-27	-27	-27	-27	-27	-27
-2.67%	-14	-14	-14	-14	-14	-14	-14
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	14	14	14	14	14	14	14
5.33%	27	27	27	27	27	27	27
8.00%	41	41	41	41	41	41	41
KR4201S63521				2022-06 콜352.5			18
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	6	6	6	5	5	5	4
-5.33%	6	5	5	5	4	4	3
-2.67%	5	4	3	3	2	1	1
0%	2	2	1	0	-1	-2	-2
2.67%	-1	-2	-3	-4	-5	-6	-7
5.33%	-7	-8	-9	-9	-10	-11	-12
8.00%	-14	-15	-15	-16	-17	-17	-18
KR4201S63554				2022-06 콜355			206
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	63	61	60	57	54	51	47
-5.33%	59	56	52	48	43	37	31
-2.67%	49	43	37	30	23	15	7
0%	26	18	9	0	-9	-18	-28
2.67%	-14	-24	-34	-44	-55	-65	-75
5.33%	-74	-84	-94	-104	-114	-124	-134
8.00%	-153	-161	-170	-178	-187	-196	-206
KR4301S63370				2022-06 풋337.5			14
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	13	13	13	14	14	14	14
-5.33%	7	7	8	8	8	8	9
-2.67%	2	2	3	3	4	4	4
0%	-1	-1	0	0	0	1	1
2.67%	-3	-2	-2	-2	-2	-1	-1
5.33%	-3	-3	-3	-3	-3	-2	-2
8.00%	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-3
KR4301S63404				2022-06 풋340			5
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	5	5	5	5	5	5	5
-5.33%	3	3	3	3	3	3	3
-2.67%	1	1	1	1	1	1	2
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-1	-1	-1	-1	-1	0	0
5.33%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1
8.00%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1

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

(단위:백만원)

241

공시일	2022-05-20
기준일	2022-05-19

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	9,609	0	9,609	

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	2022-05-20
기준일	2022-05-19

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	7,327	0	7,327	

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	2022-05-20
기준일	2022-05-19

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	22,914	0	22,914	
누계	통화	선도	2,364	25,720	-23,356	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213C4MKRW/USD 27-06-22E	2,058
FXW213C4N USD/KRW 27-06-22E	123
FXW213C52 USD/KRW 27-06-22E	36
FXW213C5C USD/KRW 27-06-22E	15
FXW213C5J4 USD/KRW 27-06-22E	15
IE00BD8RGM75	

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

772

공시일	2022-05-20
기준일	2022-05-19

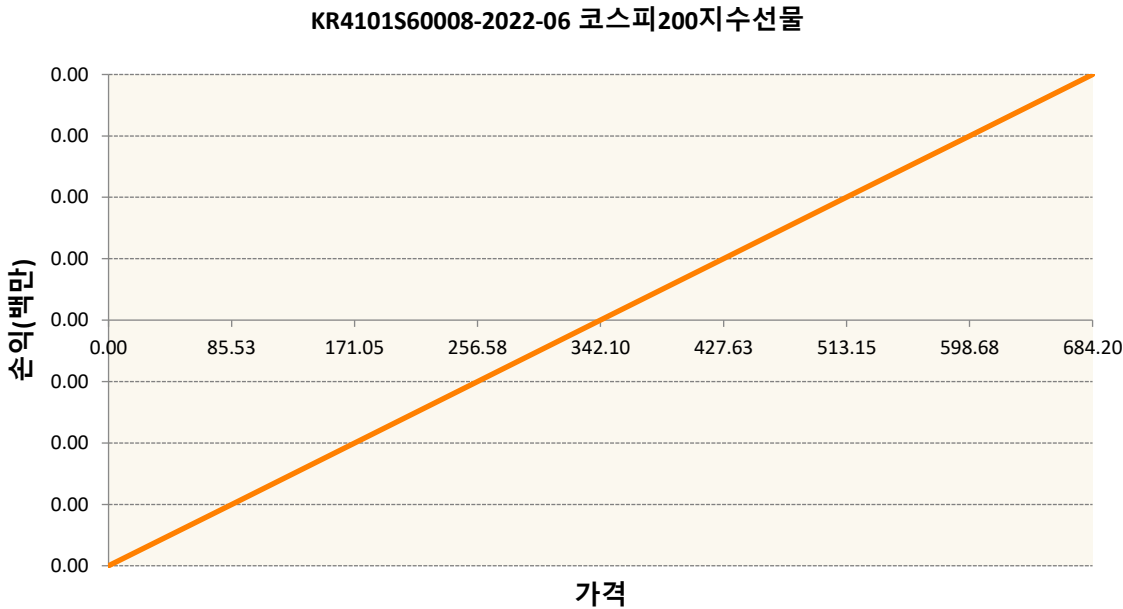
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

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	1,197	0	1,197	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101S60008			2022-06 코스피200지수선물				96
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-96	-96	-96	-96	-96	-96	-96
-5.33%	-64	-64	-64	-64	-64	-64	-64
-2.67%	-32	-32	-32	-32	-32	-32	-32
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	32	32	32	32	32	32	32
5.33%	64	64	64	64	64	64	64
8.00%	96	96	96	96	96	96	96

공시일 2022-05-20

기준일 2022-05-19

스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

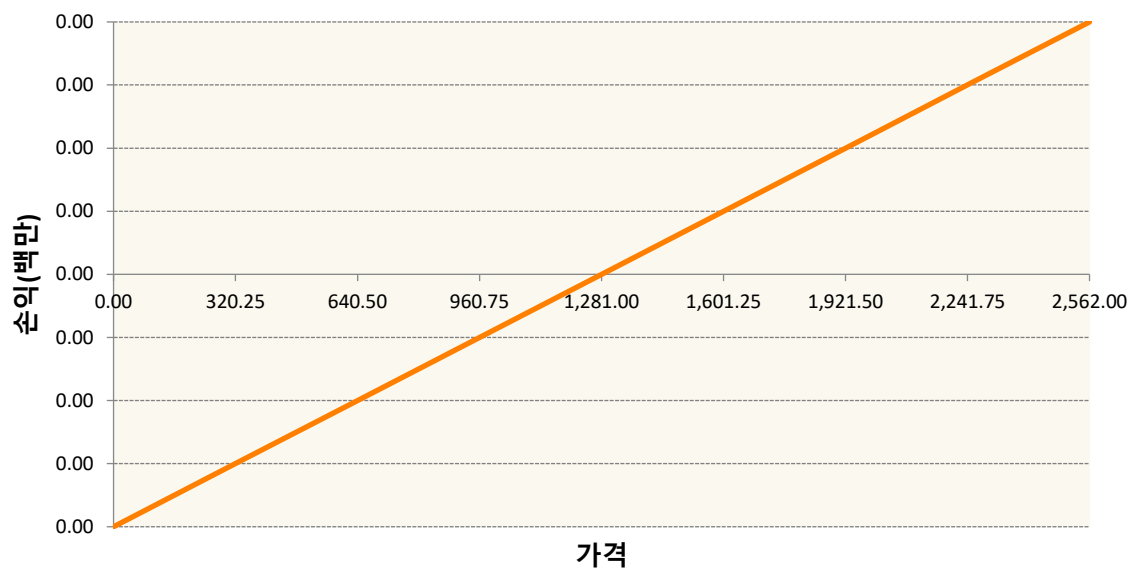
1. 계약금액

(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	697	0	697	
누계	유가증권	스왑	1,731	0	1,731	장외
누계	통화	선도	201	1,553	-1,352	장외

2. 만기시점의 손익구조

VNCK2-VN30 Index Future May22



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2.5504E+11 VN30TR Index(EUR)	138
FXW213C2P KRW/EUR 20-05-22E	46
FXW213C3G KRW/EUR 24-06-22E	32
FXW213C4L KRW/EUR 22-07-22E	16
FXW213C4T EUR/KRW 20-05-22E	5
FXW213C5H EUR/KRW 20-05-22E	11
FXW213C5J4 KRW/EUR 26-08-22E	30
VNCK2 VN30 Index Future May22	56

공시일 2022-05-20

기준일 2022-05-19

SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

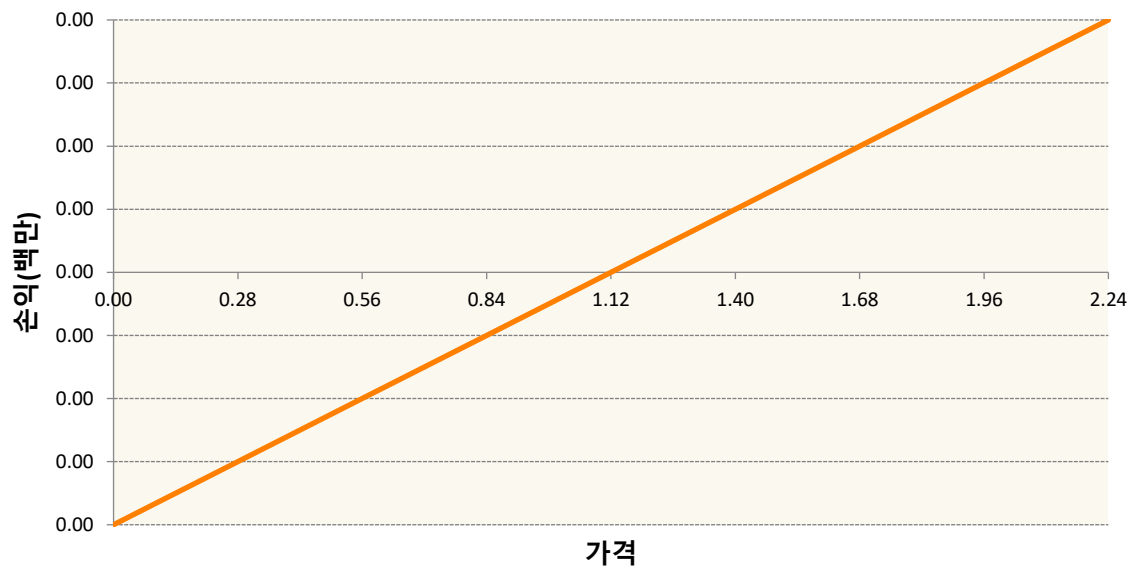
1. 계약금액

(단위:백만원)

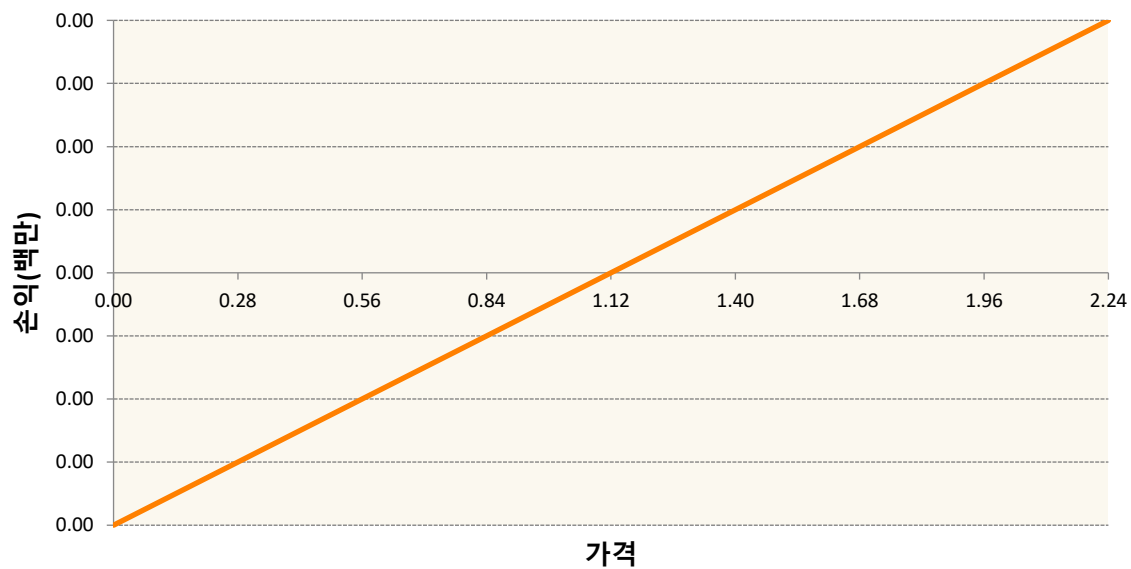
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	47,562	0	47,562	

2. 만기시점의 손익구조

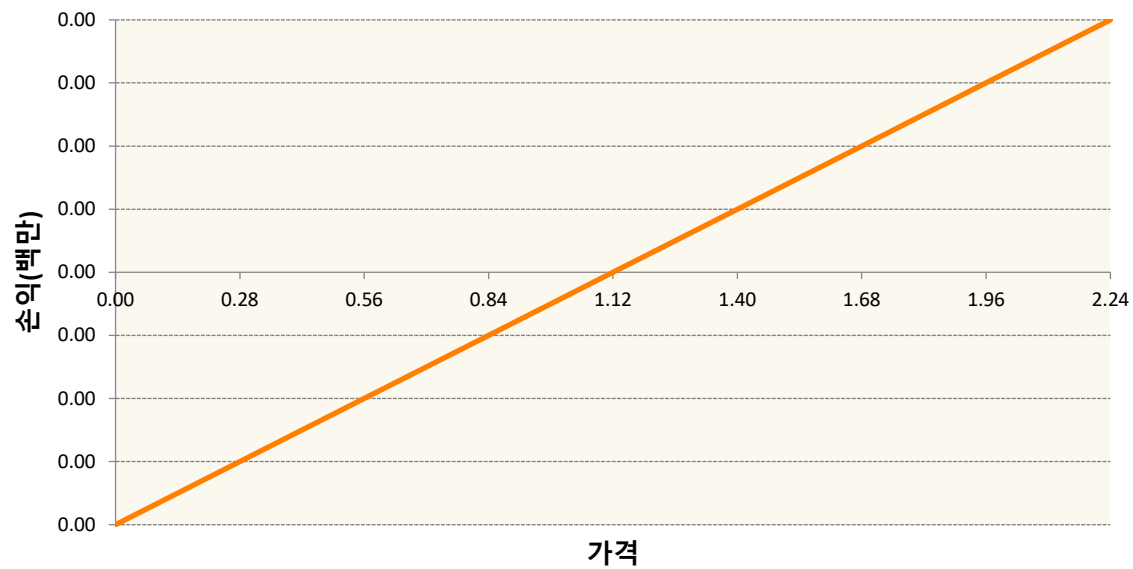
210884220325-IHS Markit Global Carbon Index(TR)



210884220326-IHS Markit Global Carbon Index(TR)



210884220327-IHS Markit Global Carbon Index(TR)



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

201

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

3,506

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

100

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

(단위:백만원)

7,093

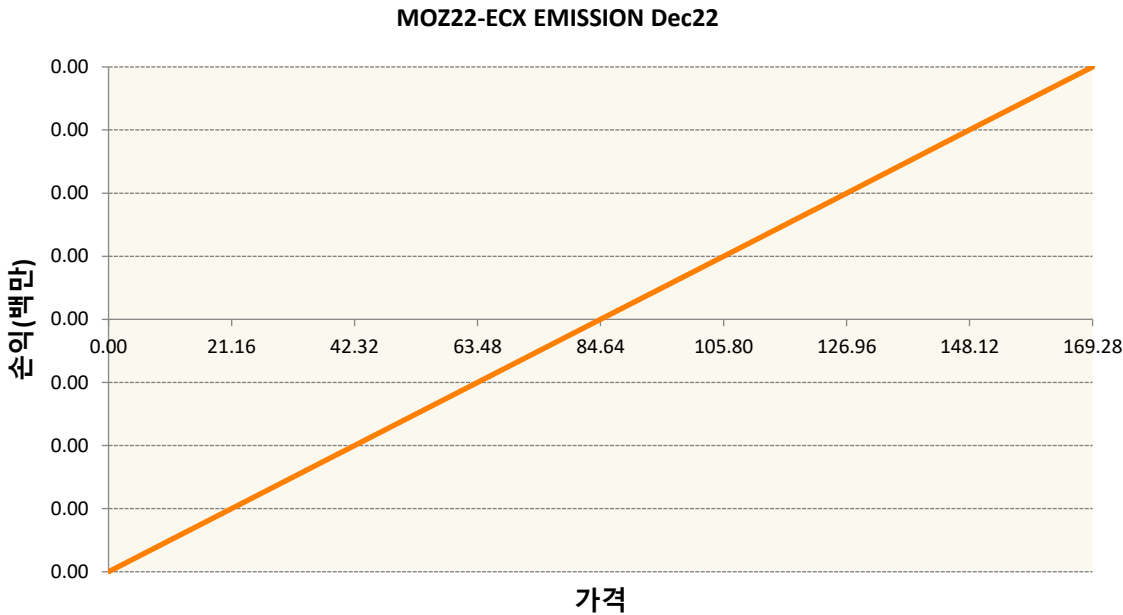
공시일	2022-05-20
기준일	2022-05-19

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	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	14,603	0	14,603	
누계	통화	선도	0	9,709	-9,709	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)		
FXW213C4R	KRW/EUR 23-05-22E	777
MOZ22	ECX EMISSION Dec22	1,168

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) (단위:백만원)	
3,264	

공시일	2022-05-20
기준일	2022-05-19

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	11,035	0	11,035	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI00000 신한CSI Index 220323 (NH)	32
SWCSI00000 신한CSI Index 220323 (키움)	32
SWCSI00000 신한CSI Index 220323 (미래)	32
SWCSI00000 신한CSI Index 220323 (메리츠)	32

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

(단위:백만원)

251

공시일	2022-05-20
기준일	2022-05-19

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	8,851	0	8,851	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220113(키움)	1
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220113(미래)	1
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220113(메리츠)	1
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220113(NH)	1
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220426(메리츠)	2

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

(단위:백만원)

6

공시일	2022-05-20
기준일	2022-05-19

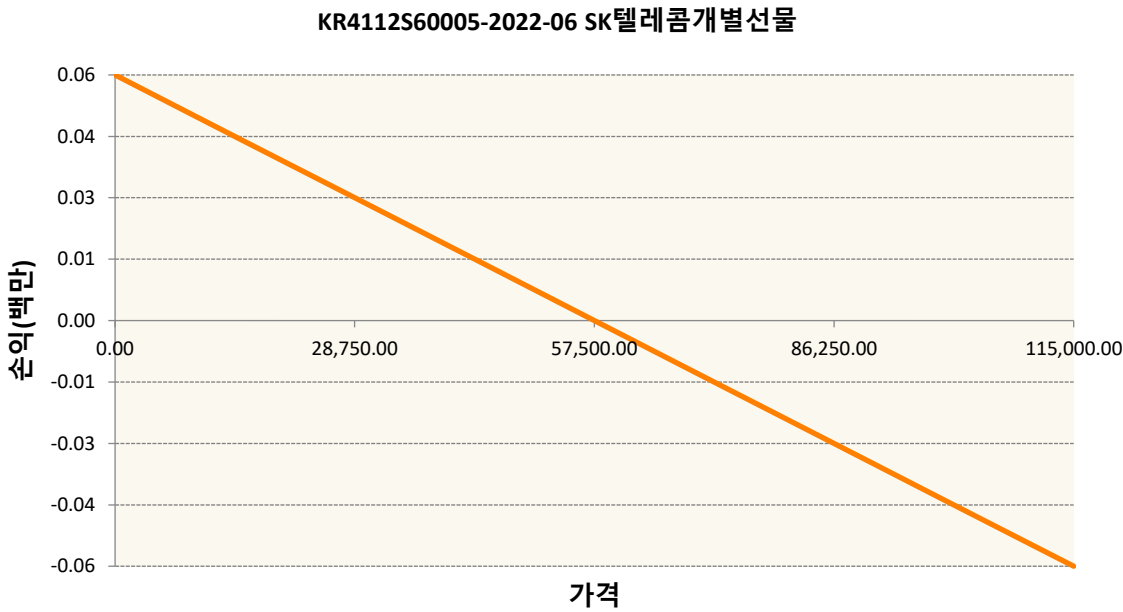
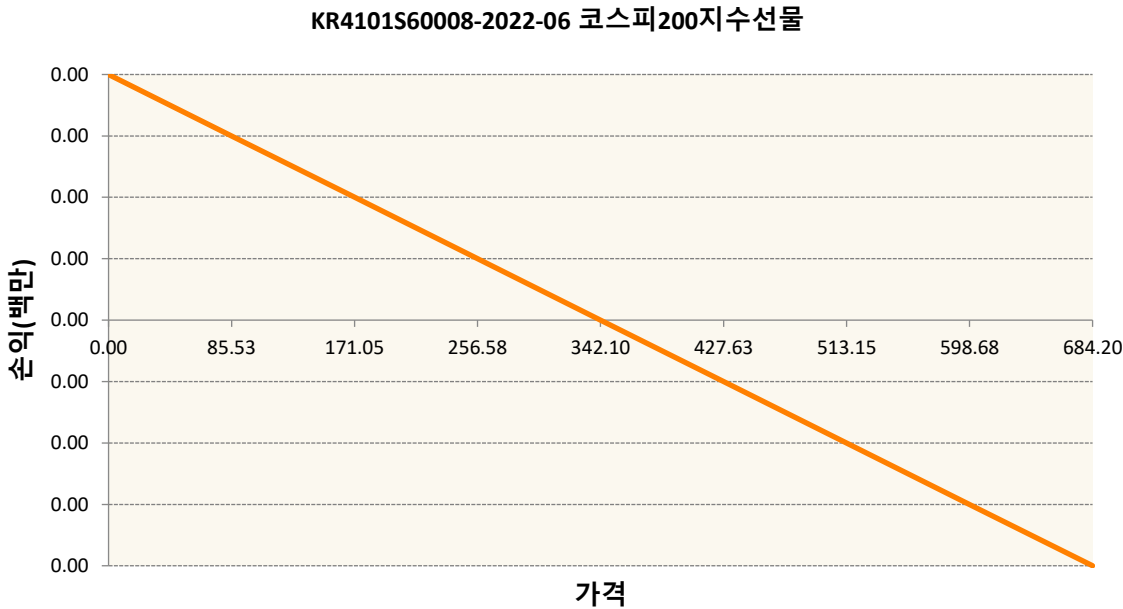
에쿼티알파일반사모혼합자산

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	2,483	-2,483	장내
누계	유가증권	스왑	0	0	0	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
KR4101S600 2022-06 코스피200지수선물		171
KR4112S600 2022-06 SK텔레콤개별선물		28
KRS0003014 SWAP_SPDR S&P O&G EXP_0322		0
KRS0003041 SWAP_MICRON TECH CORP_0331		0
KRS0003135 SWAP_MICROSOFT CP_0429		0

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	201

공시일 2022-05-20

기준일 2022-05-19

신한SOL한국형글로벌반도체엑티

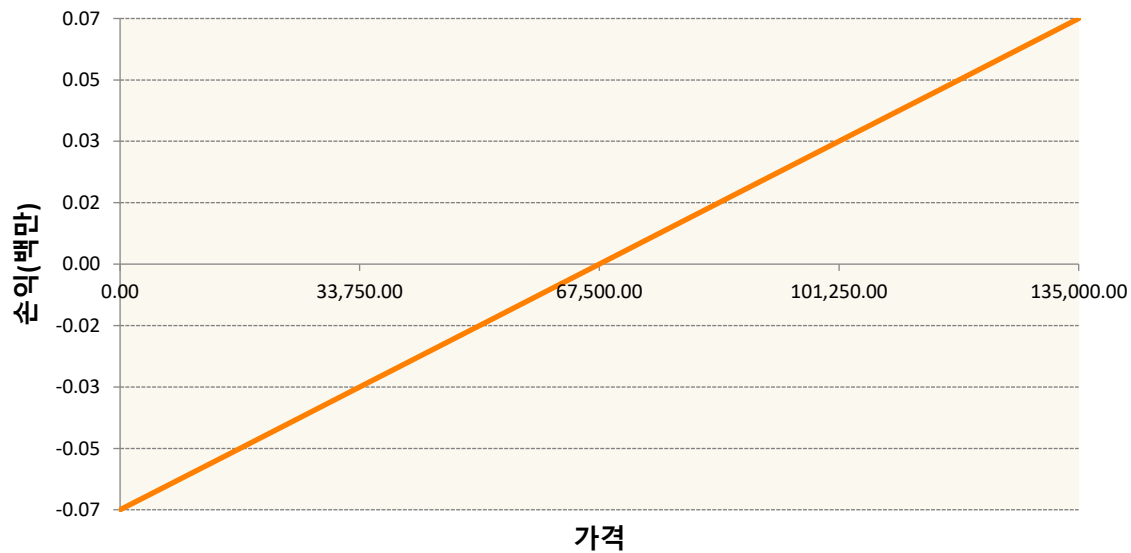
1. 계약금액

(단위:백만원)

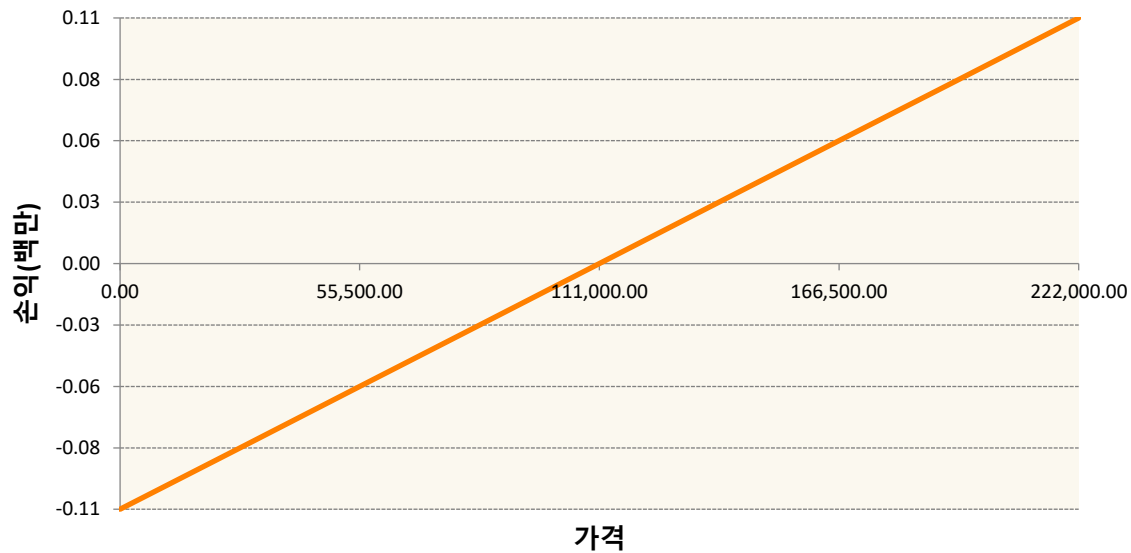
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	970	0	970	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4111S60007-2022-06 삼성전자개별선물



KR4150S60005-2022-06 SK하이닉스개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4111S60007		2022-06 삼성전자개별선물					39
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-39	-39	-39	-39	-39	-39	-39
-5.33%	-26	-26	-26	-26	-26	-26	-26
-2.67%	-13	-13	-13	-13	-13	-13	-13
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	13	13	13	13	13	13	13
5.33%	26	26	26	26	26	26	26
8.00%	39	39	39	39	39	39	39
KR4150S60005		2022-06 SK하이닉스개별선물					39
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-39	-39	-39	-39	-39	-39	-39
-5.33%	-26	-26	-26	-26	-26	-26	-26
-2.67%	-13	-13	-13	-13	-13	-13	-13
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	13	13	13	13	13	13	13
5.33%	26	26	26	26	26	26	26
8.00%	39	39	39	39	39	39	39

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

84

공시일	2022-05-20
기준일	2022-05-19

코리아인덱스(주식-파생형)(종)

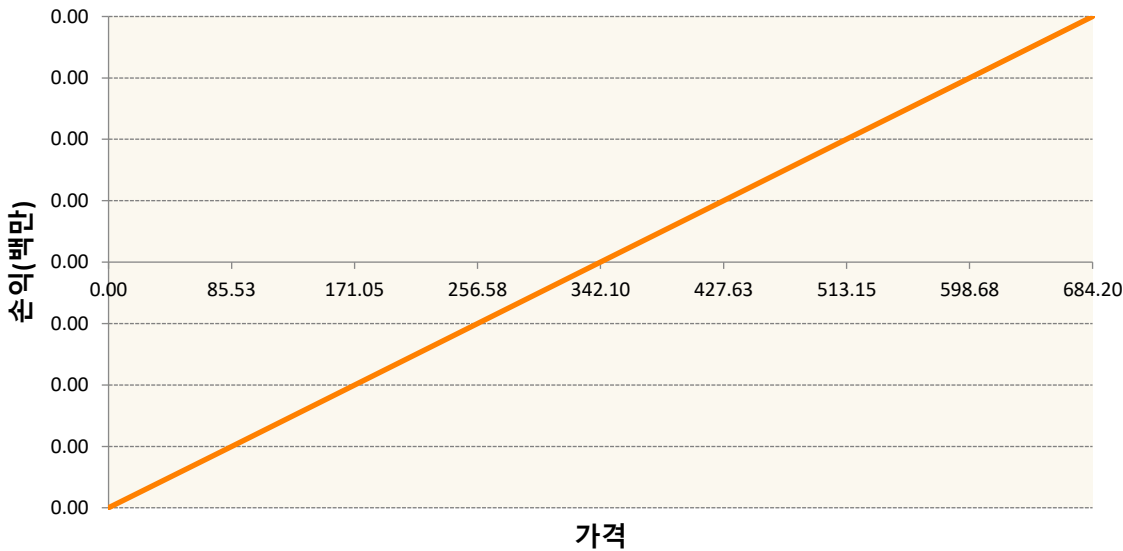
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	342	0	342	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101S60008-2022-06 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101S60008			2022-06 코스피200지수선물				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%	-18	-18	-18	-18	-18	-18	-18
-2.67%	-9	-9	-9	-9	-9	-9	-9
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	9	9	9	9	9	9	9
5.33%	18	18	18	18	18	18	18
8.00%	27	27	27	27	27	27	27

공시일 2022-05-20

기준일 2022-05-19

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

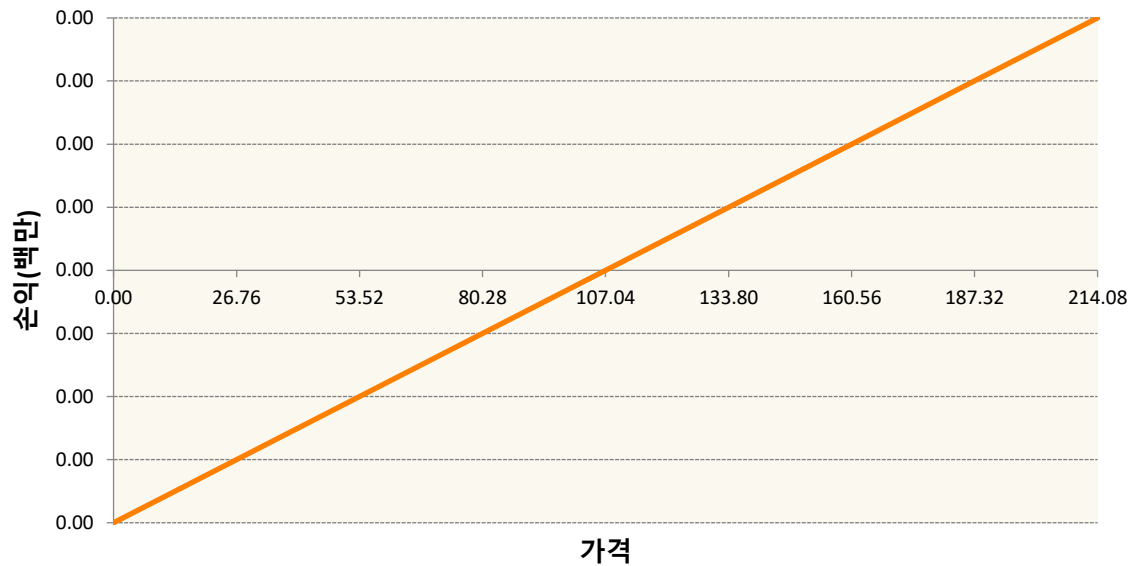
1. 계약금액

(단위:백만원)

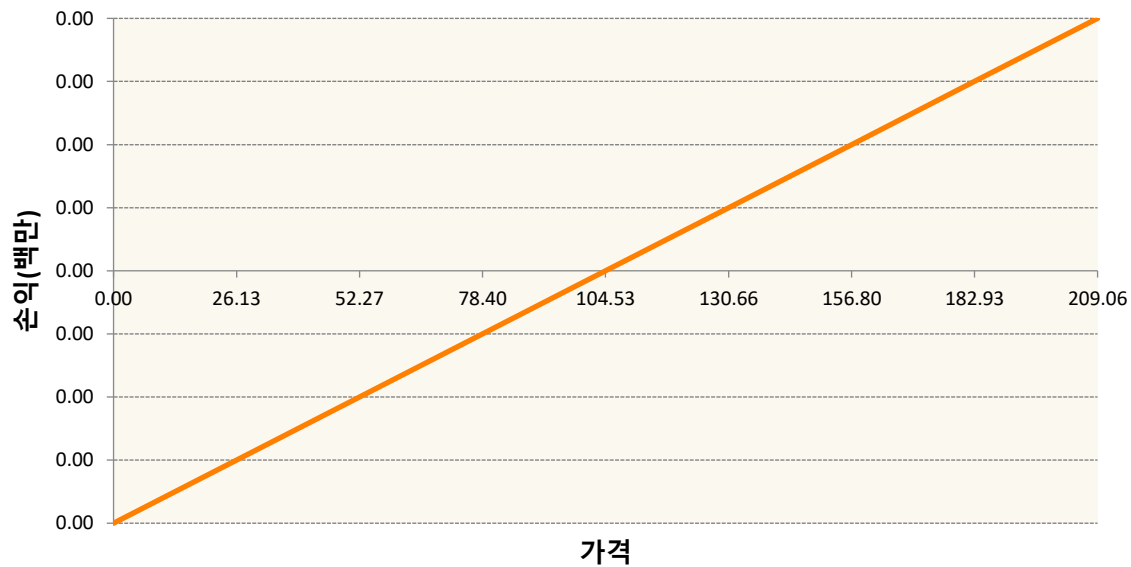
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,843	639	2,203	

2. 만기시점의 손익구조

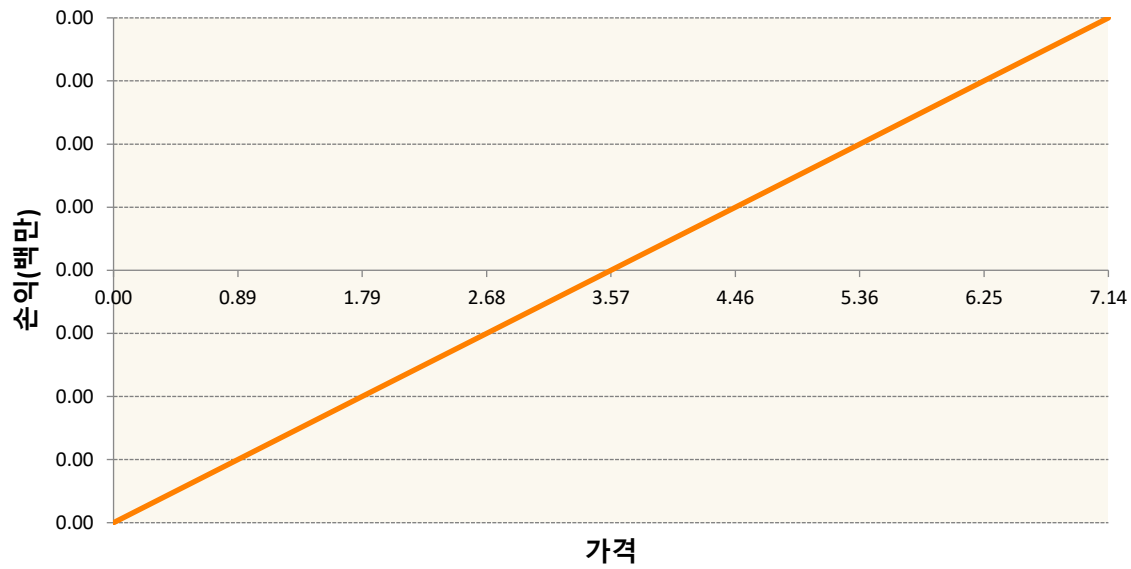
CLN2-WTI CRUDE FUTURE Jul22



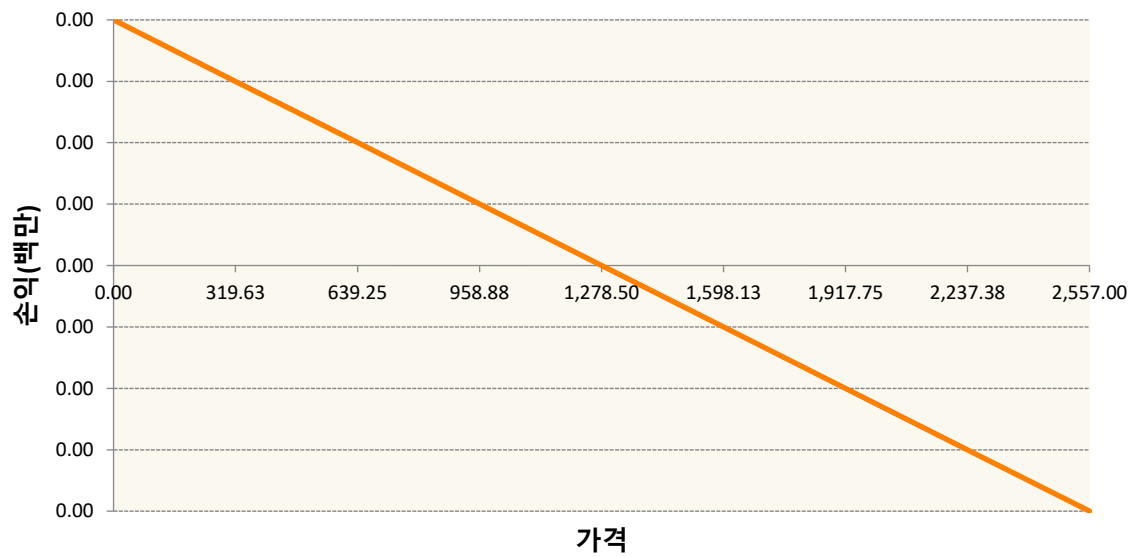
COU2-BRENT CRUDE FUTR Sep22



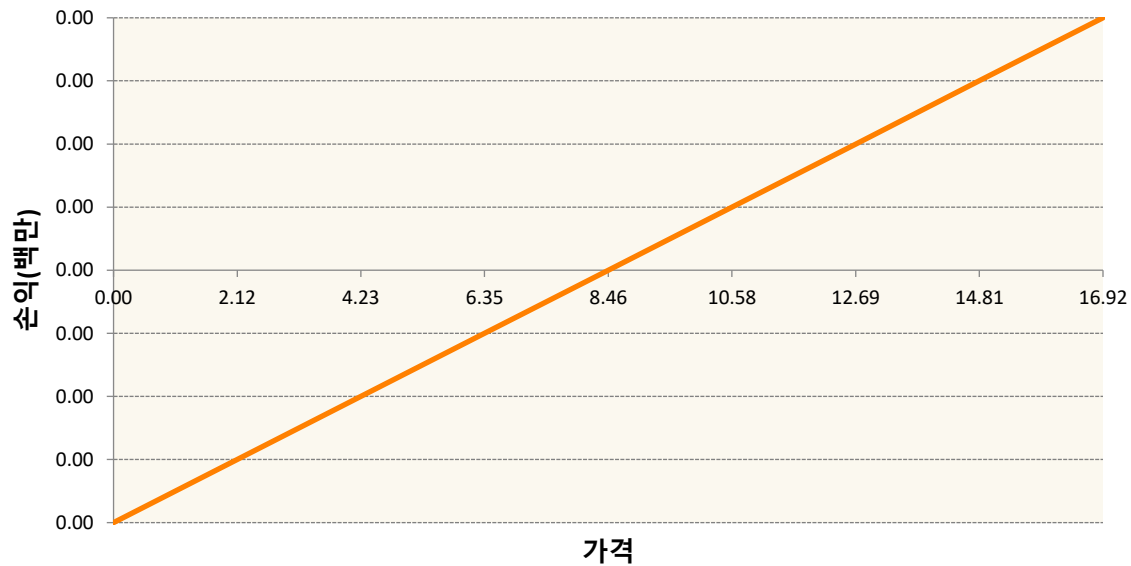
HON2-NY Harb ULSD Fut Jul22

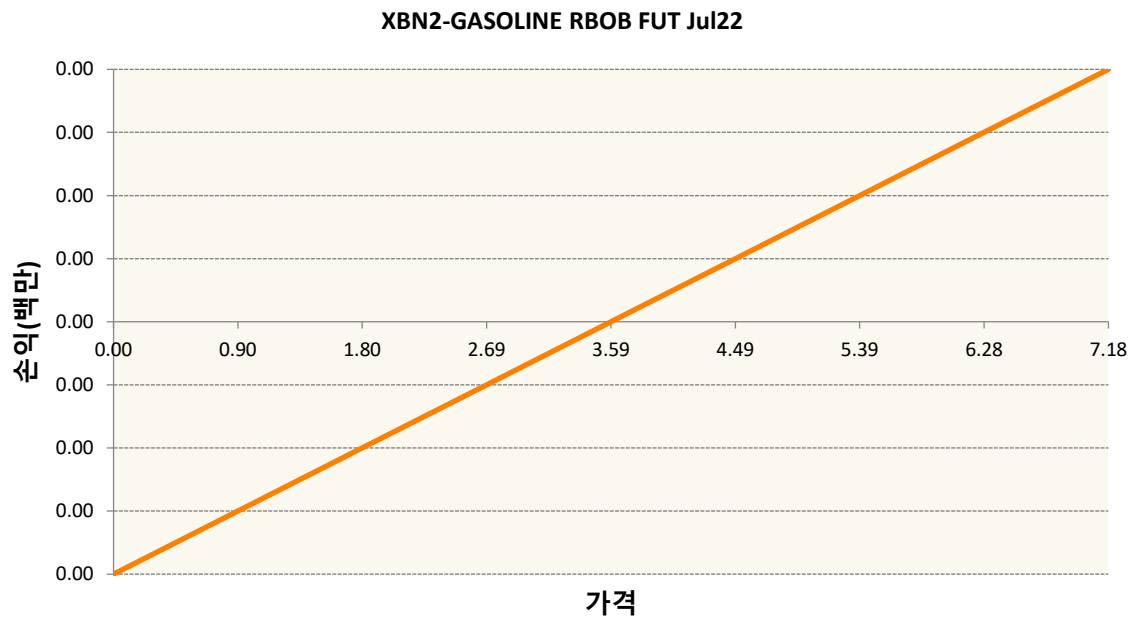
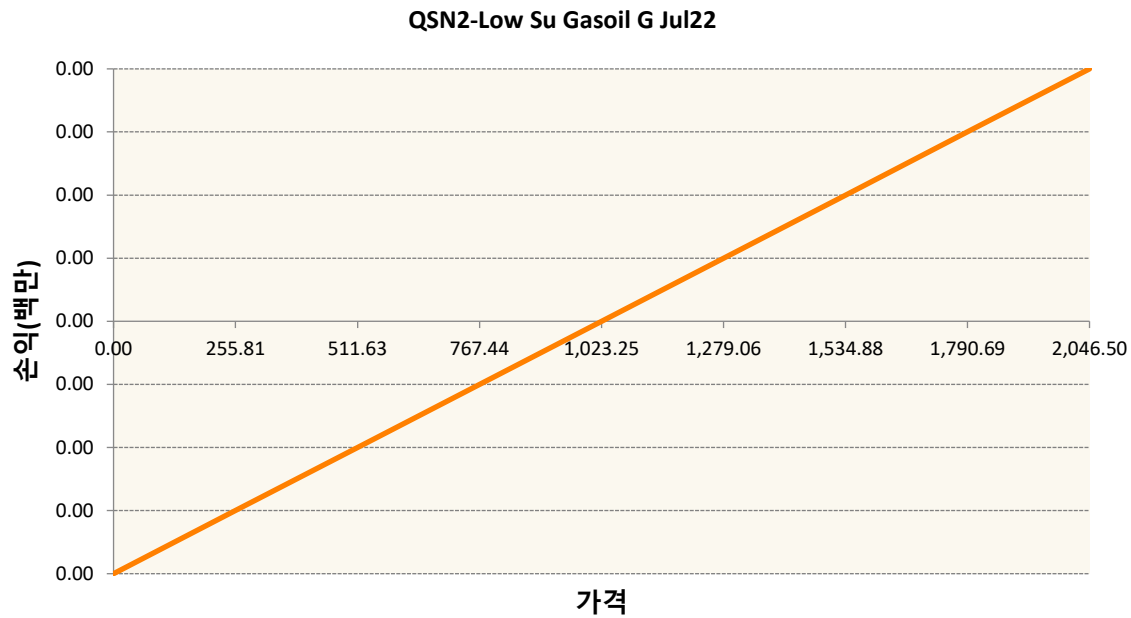


KR4175S60002-2022-06 달러선물



NGN22-NATURAL GAS FUTR Jul22





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
CLN2	WTI CRUDE FUTURE Jul22		42
COU2	BRENT CRUDE FUTR Sep22		43
HON2	NY Harb ULSD Fut Jul22		15
KR4175S600 2022-06 달러선물			51
NGN22	NATURAL GAS FUTR Jul22		92
QSN2	Low Su Gasoil G Jul22		20
XBN2	GASOLINE RBOB FUT Jul22		15

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)		(단위:백만원)
		689