

공시일	2022-05-30
기준일	2022-05-27

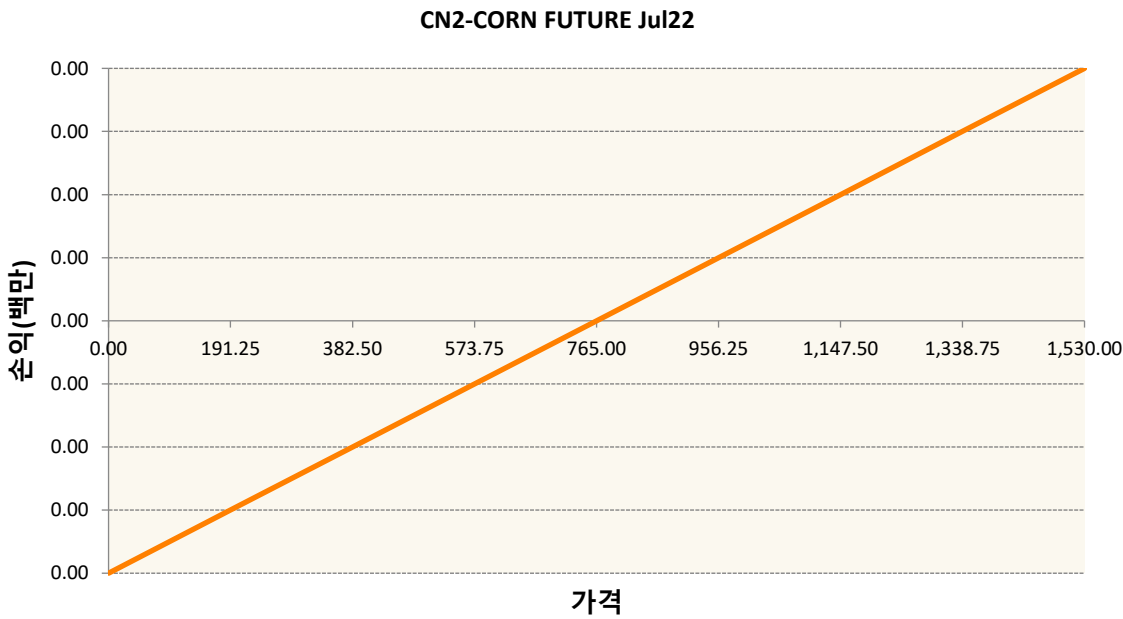
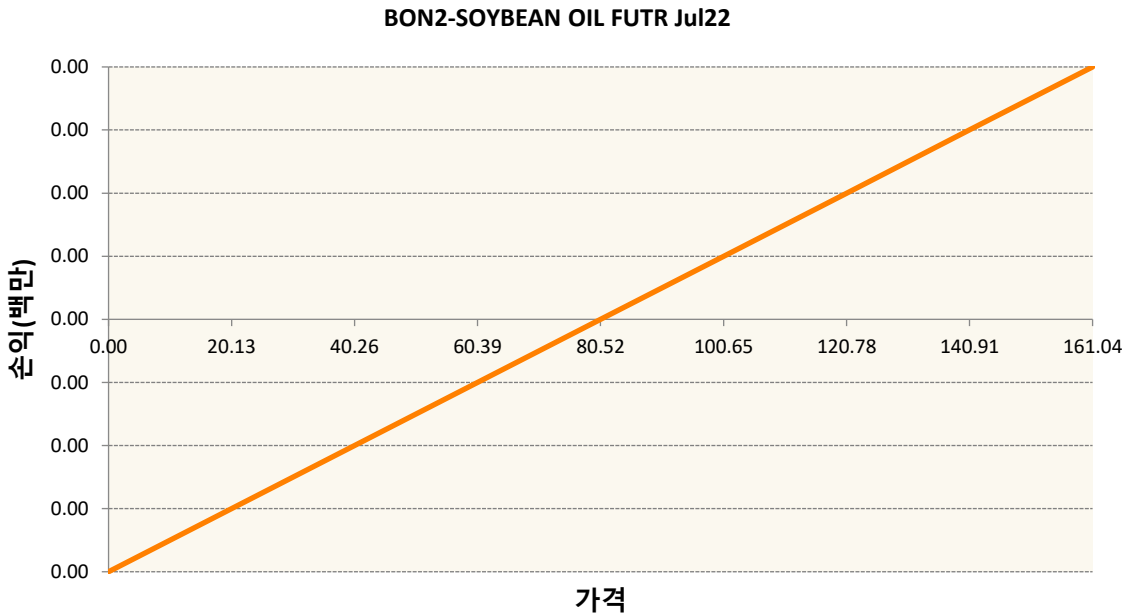
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

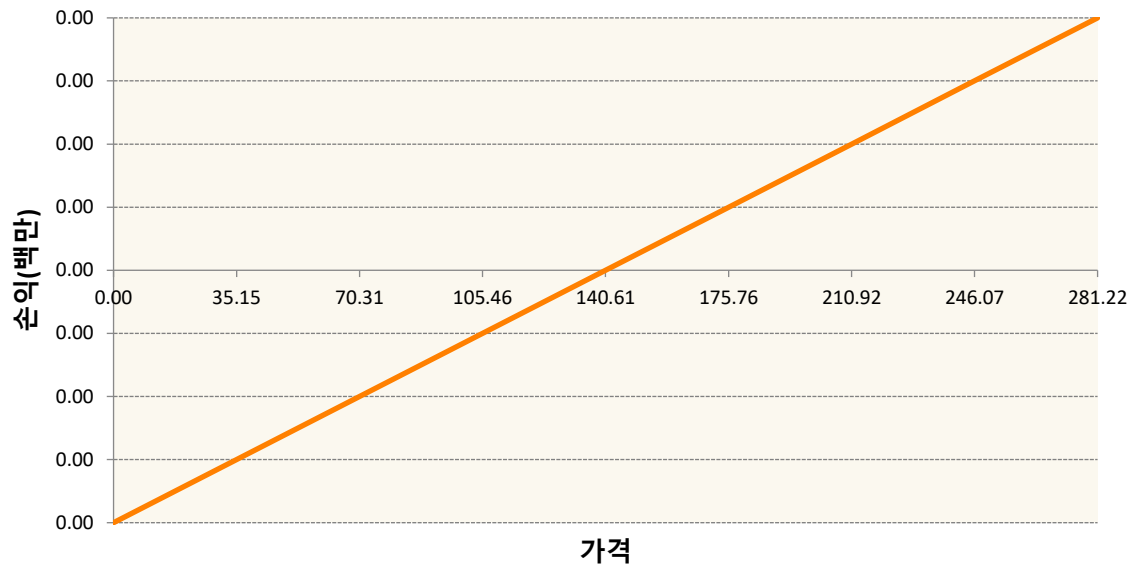
(단위:USD 백만)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	8,735	1,945	6,790	

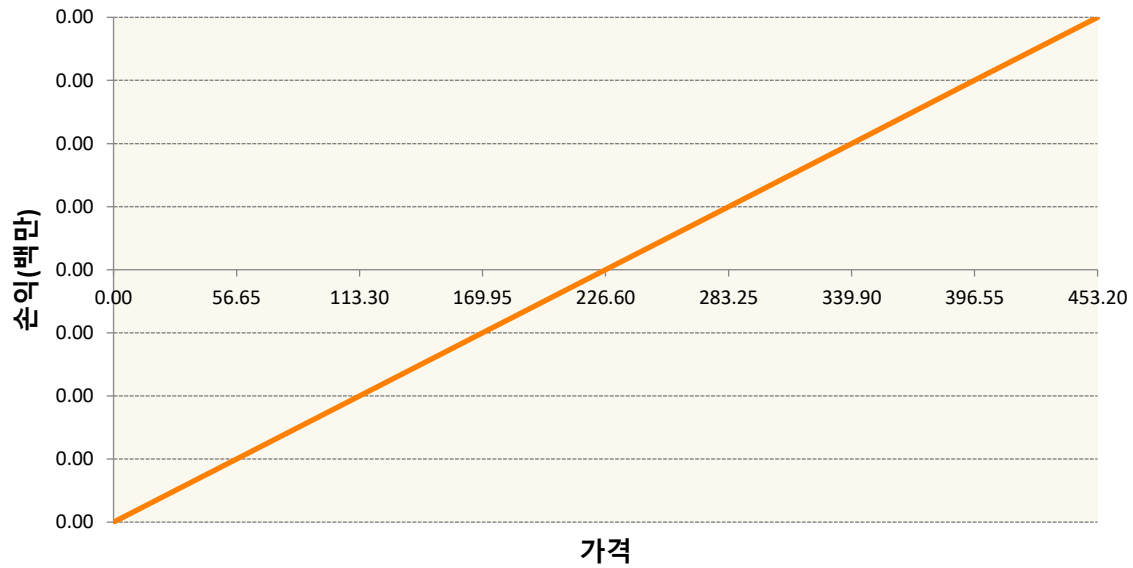
2. 만기시점의 손익구조



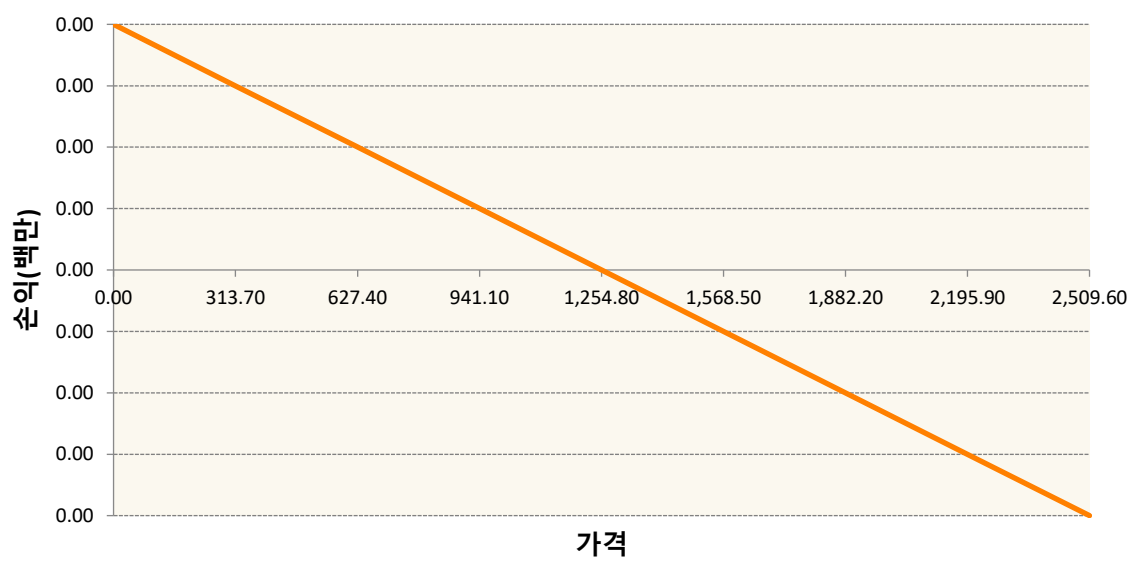
CTN2-COTTON NO.2 FUTR Jul22



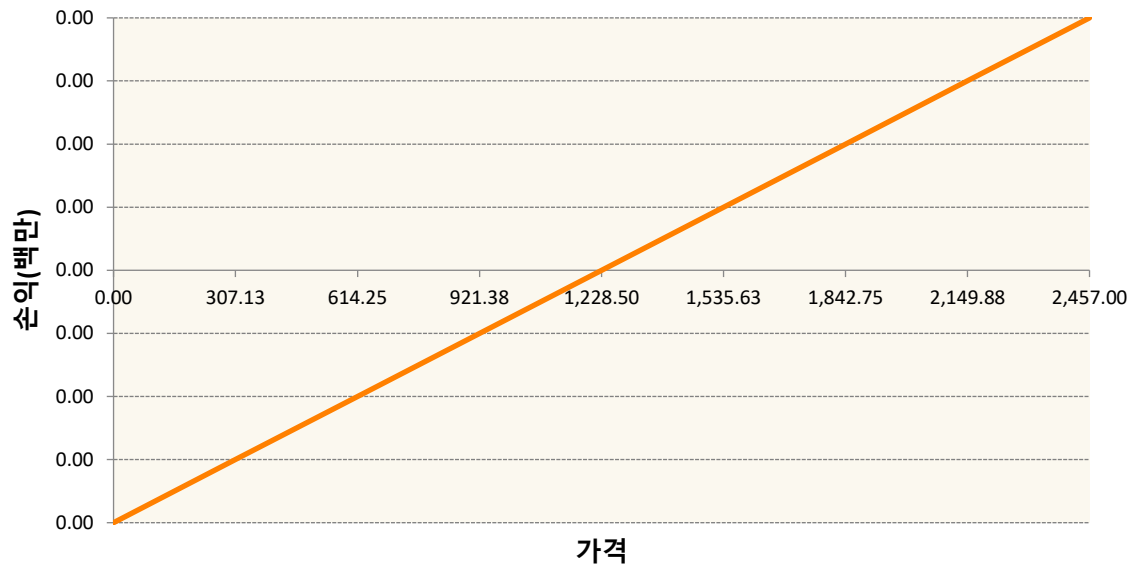
KCN2-COFFEE 'C' FUTURE Jul22



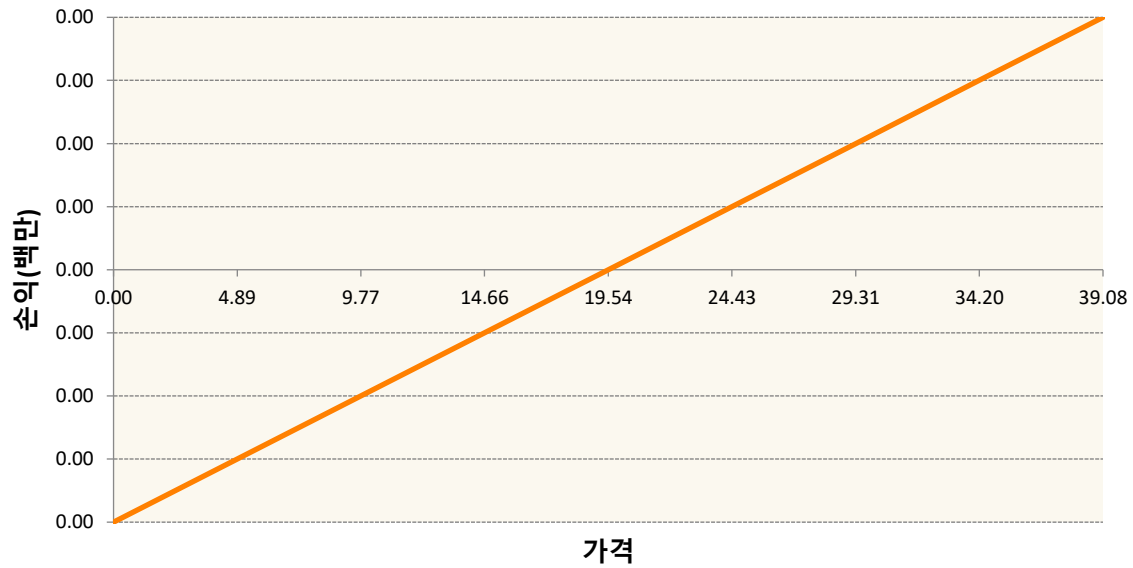
KR4175S60002-2022-06 달러선물



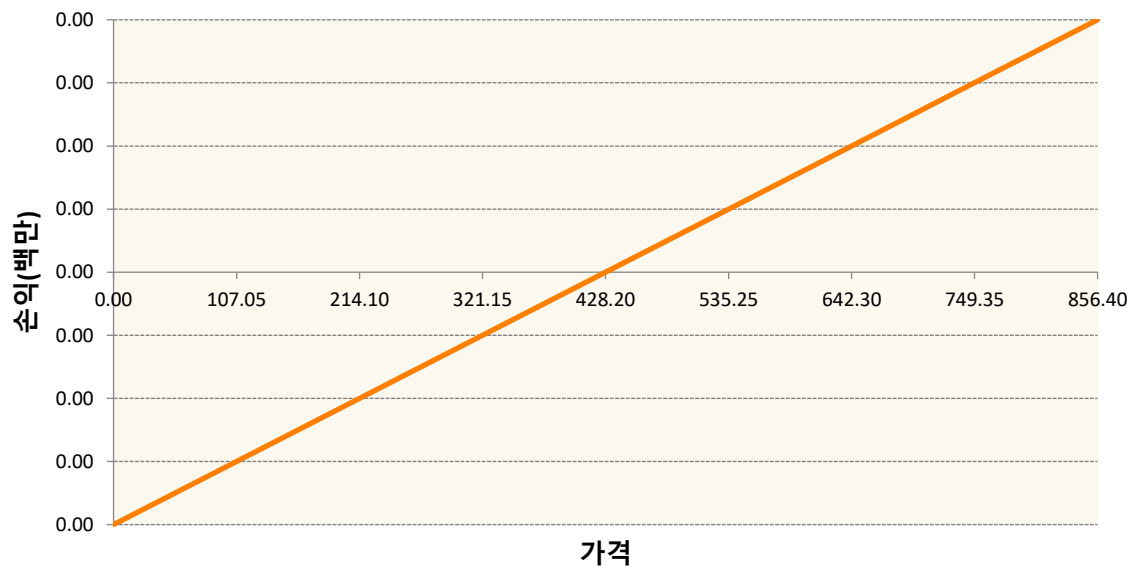
KWN2-KC HRW WHEAT FUT Jul22

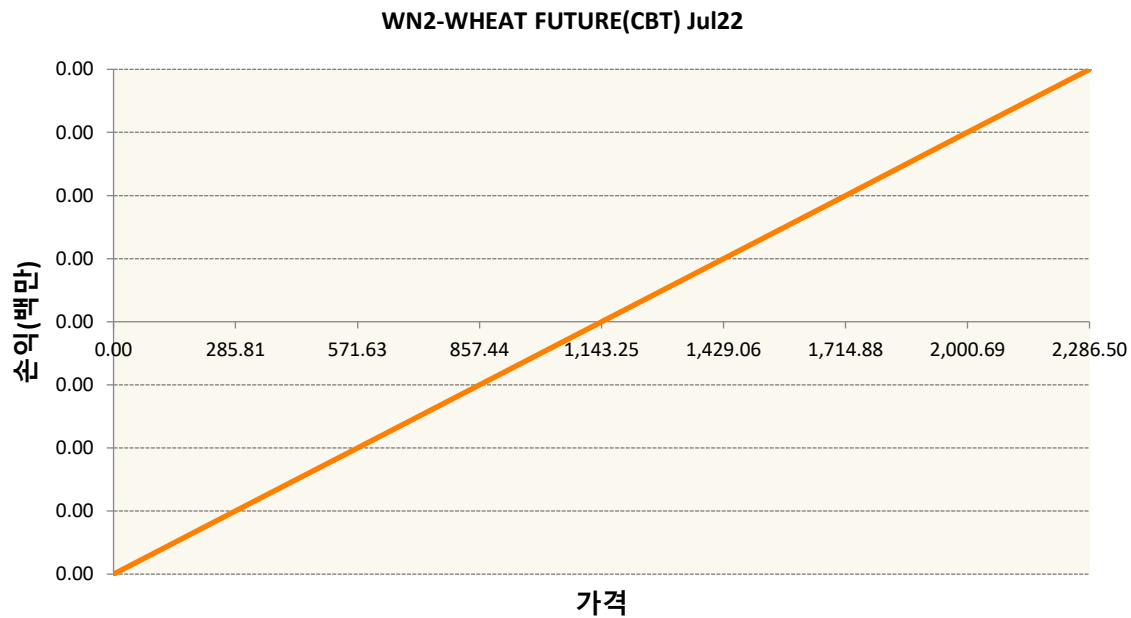
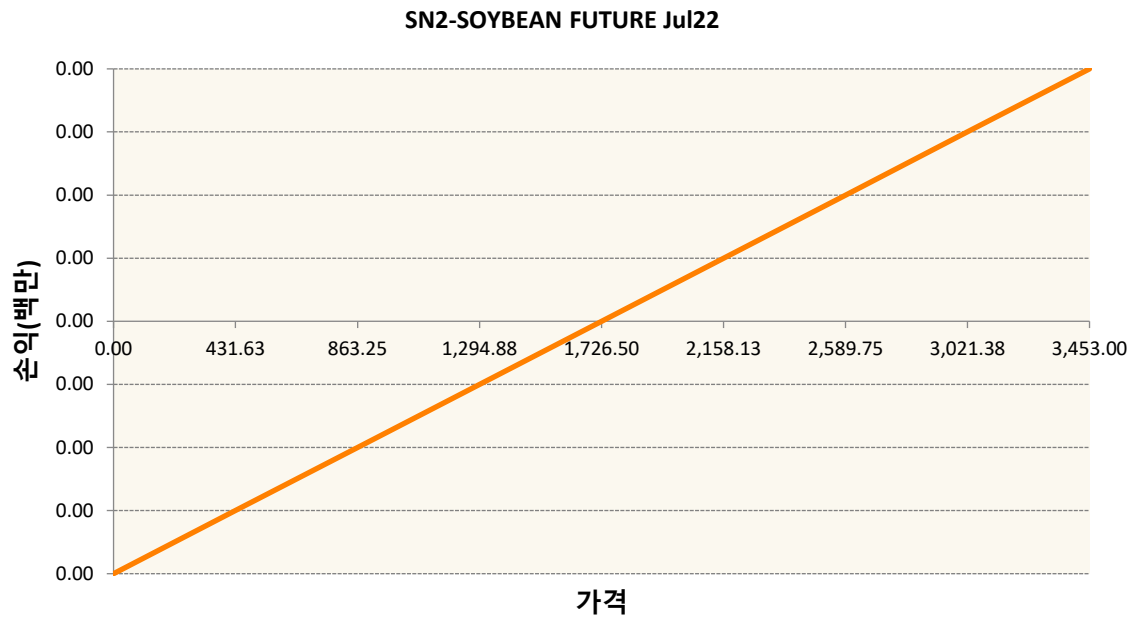


SBN2-Sugar #11 (WORLD) Jul22



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	2022-05-30
기준일	2022-05-27

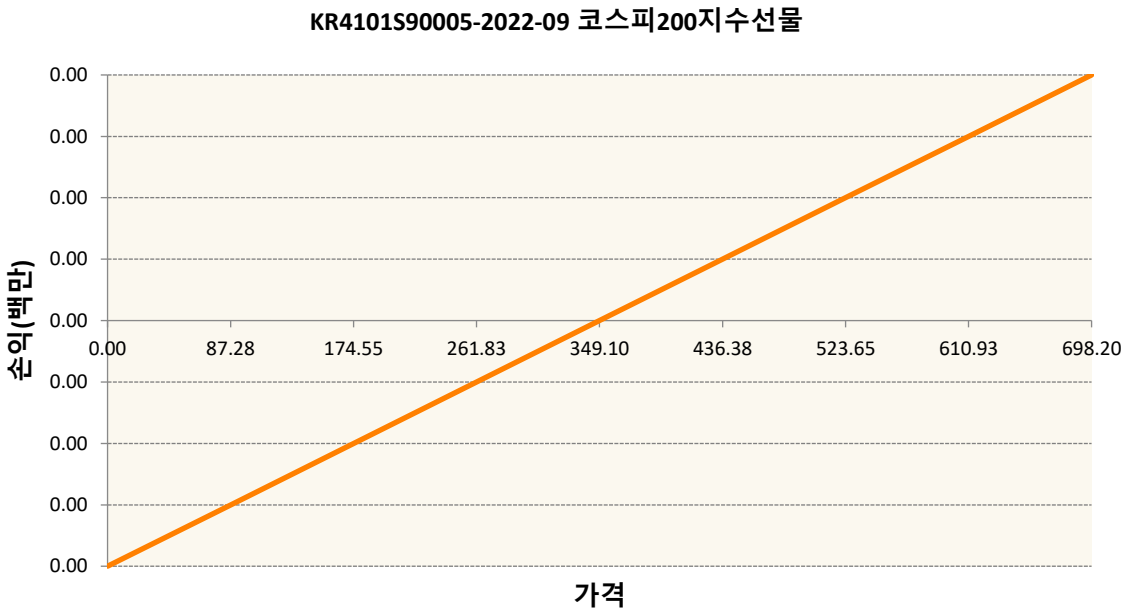
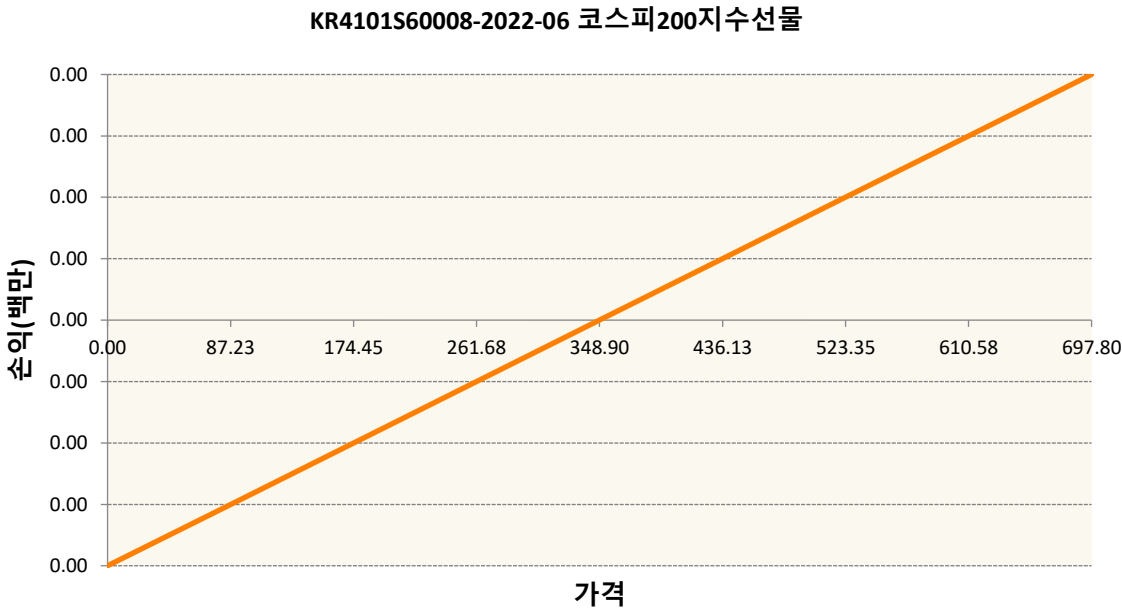
스마트인덱스모

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	785	0	785	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101S60008		2022-06 코스피200지수선물					56
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-56	-56	-56	-56	-56	-56	-56
-5.33%	-37	-37	-37	-37	-37	-37	-37
-2.67%	-19	-19	-19	-19	-19	-19	-19
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	19	19	19	19	19	19	19
5.33%	37	37	37	37	37	37	37
8.00%	56	56	56	56	56	56	56
KR4101S90005		2022-09 코스피200지수선물					7
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-7	-7	-7	-7	-7	-7	-7
-5.33%	-5	-5	-5	-5	-5	-5	-5
-2.67%	-2	-2	-2	-2	-2	-2	-2
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	2	2	2	2	2	2	2
5.33%	5	5	5	5	5	5	5
8.00%	7	7	7	7	7	7	7

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

58

공시일	2022-05-30
기준일	2022-05-27

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	345
-----------------------------	-----

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

438

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2022-05-30
기준일	2022-05-27

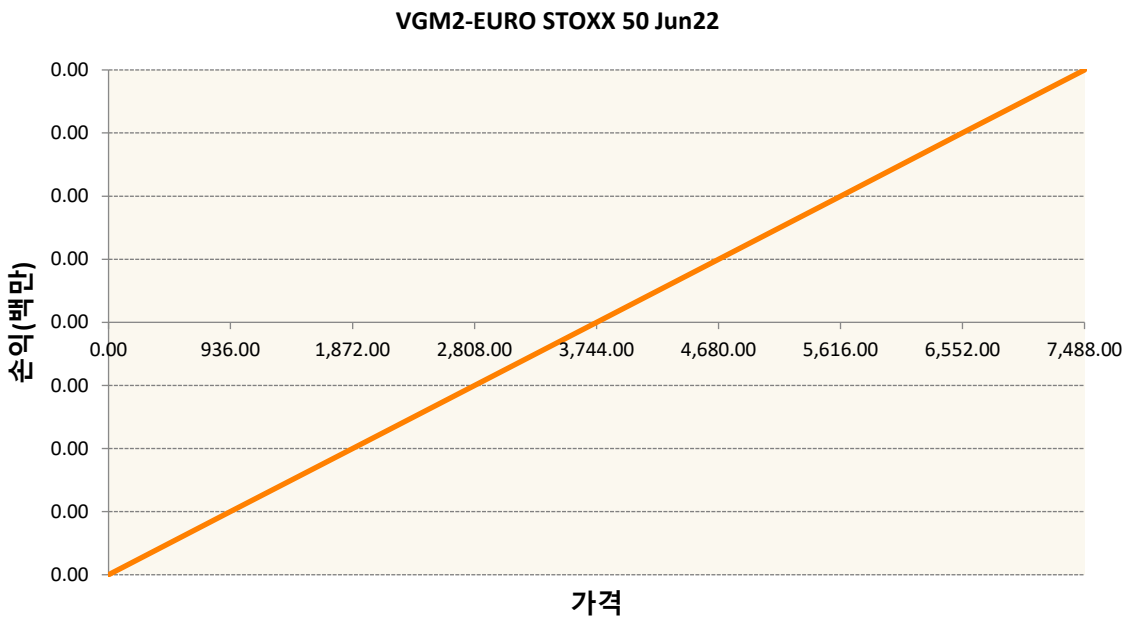
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	559	0	559	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

43

공시일	2022-05-30
기준일	2022-05-27

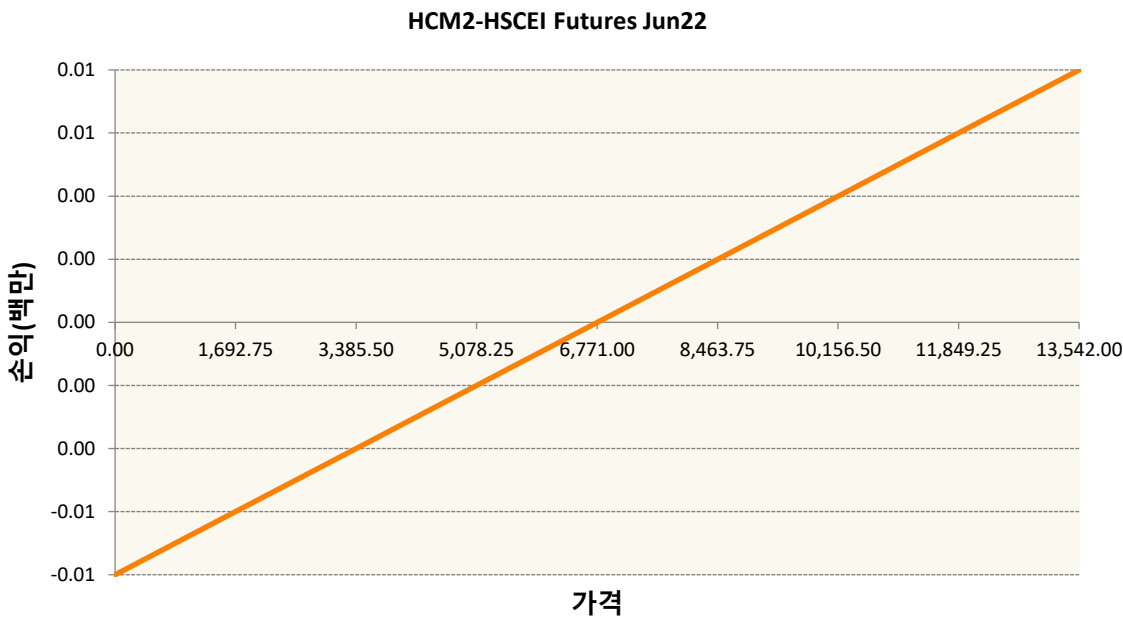
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,083	0	1,083	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCM2	HSCEI Futures Jun22	87
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

123

공시일 2022-05-30

기준일 2022-05-27

커버드콜모(주식혼합-파생형)

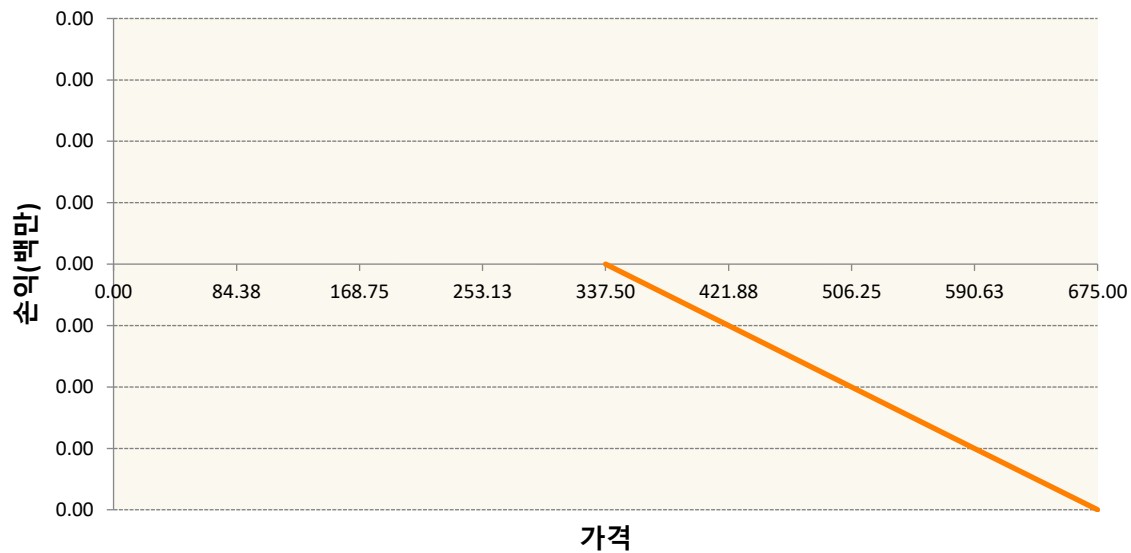
1. 계약금액

(단위:백만원)

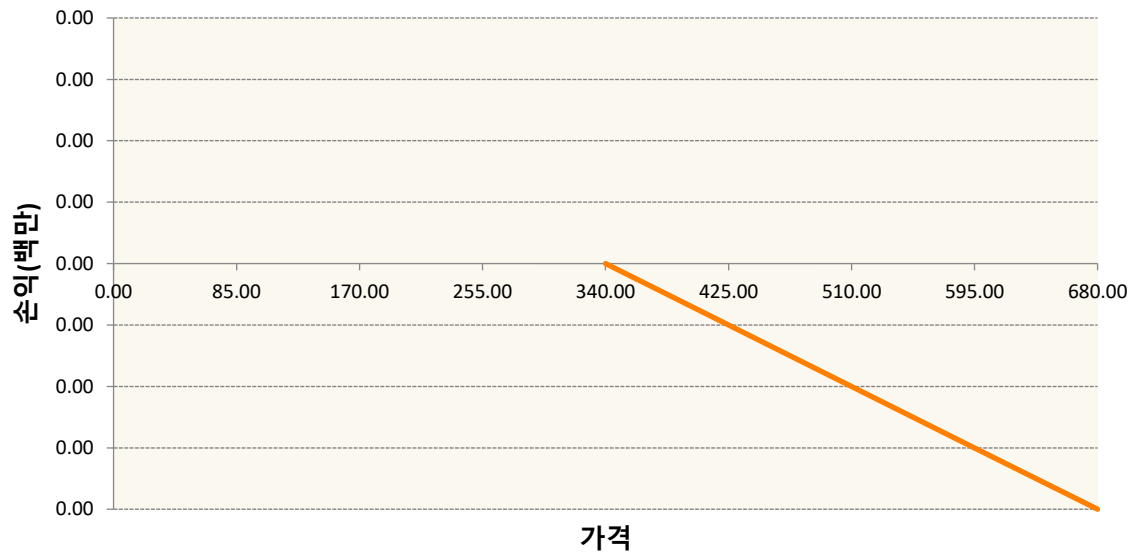
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	63,028	-63,028	장내

2. 만기시점의 손익구조

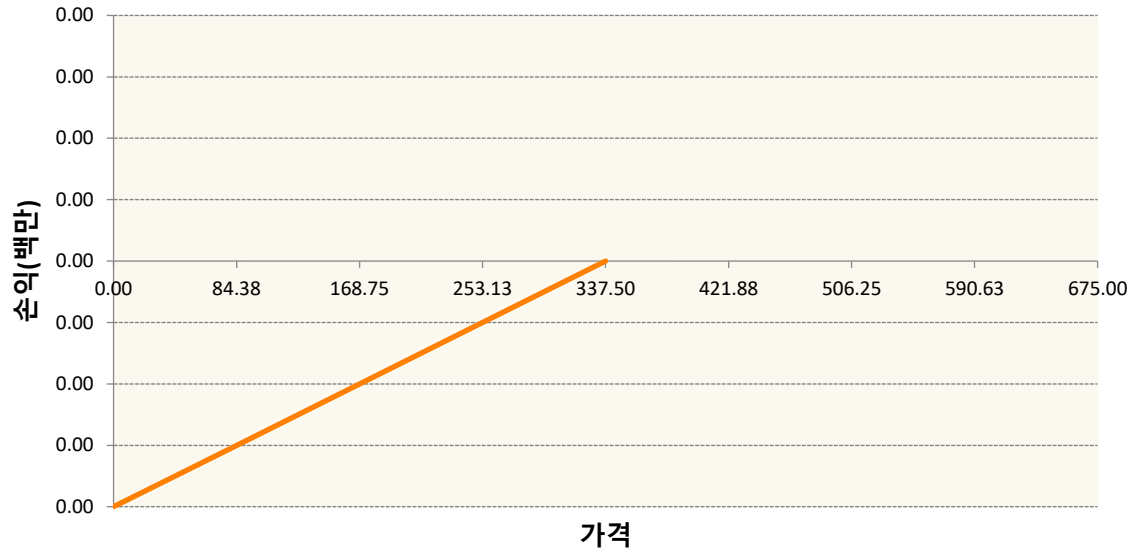
KR4201S63372-2022-06 콜337.5



KR4201S63406-2022-06 콜340



KR4301S63370-2022-06 풋337.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201S63372			2022-06 콜337.5				3,006
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,603	1,567	1,526	1,481	1,433	1,381	1,327
-5.33%	1,391	1,327	1,261	1,194	1,126	1,057	988
-2.67%	929	854	779	704	629	554	479
0%	187	127	65	0	-66	-134	-202
2.67%	-766	-799	-838	-882	-930	-981	-1,034
5.33%	-1,828	-1,842	-1,860	-1,884	-1,912	-1,945	-1,982
8.00%	-2,930	-2,934	-2,941	-2,952	-2,966	-2,984	-3,006
KR4201S63406			2022-06 콜340				816
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	397	389	379	368	357	344	330
-5.33%	352	335	319	301	283	265	246
-2.67%	243	222	201	180	159	138	117
0%	57	38	19	0	-20	-40	-60
2.67%	-195	-207	-219	-233	-248	-264	-281
5.33%	-485	-490	-497	-505	-514	-525	-536
8.00%	-790	-792	-794	-798	-803	-809	-816
KR4301S63370			2022-06 풋337.5				551
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-526	-528	-531	-535	-540	-545	-551
-5.33%	-249	-258	-267	-278	-288	-299	-310
-2.67%	-56	-69	-82	-95	-108	-121	-134
0%	24	17	9	0	-9	-19	-30

2.67%	41	39	37	34	29	25	19
5.33%	43	43	42	42	40	39	37
8.00%	43	43	43	43	43	42	42

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

(단위:백만원)

4,502

공시일 2022-05-30

기준일 2022-05-27

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

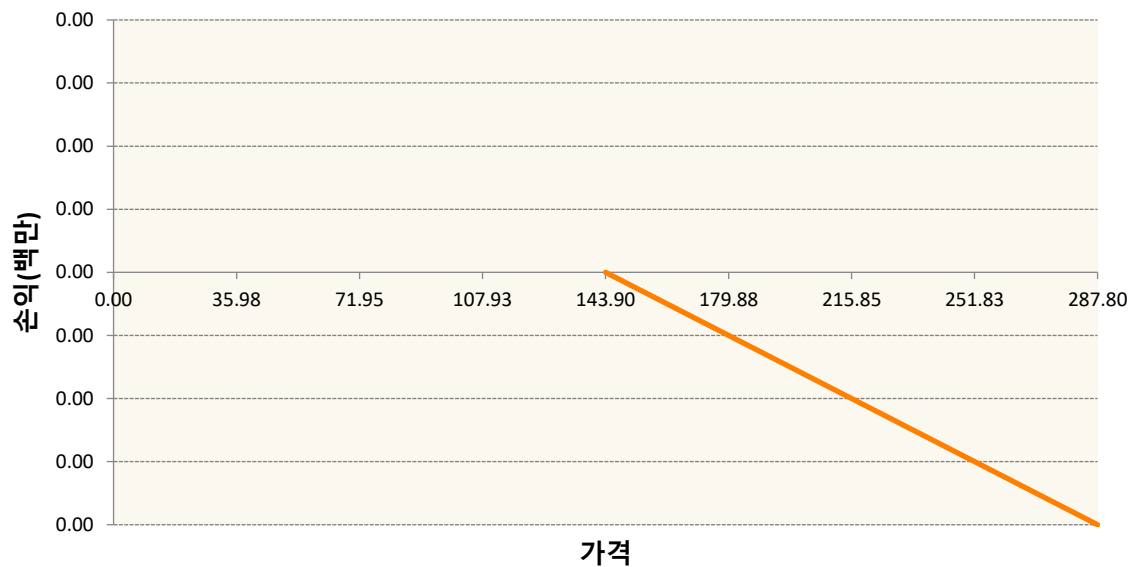
1. 계약금액

(단위:백만원)

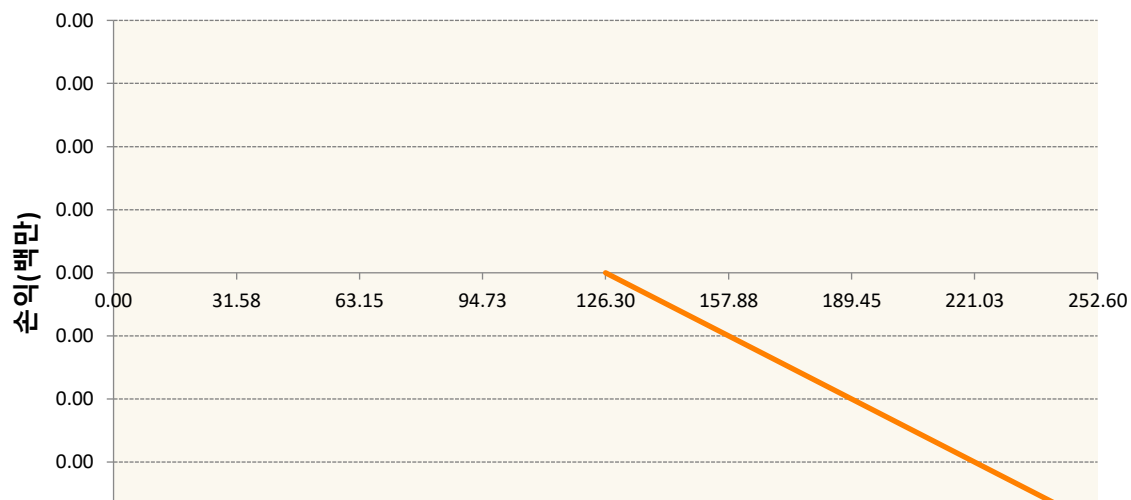
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	옵션	0	65	-65	장내
누계	지수	스왑	10	0	10	장외
누계	통화	선도	0	1,484	-1,484	장외

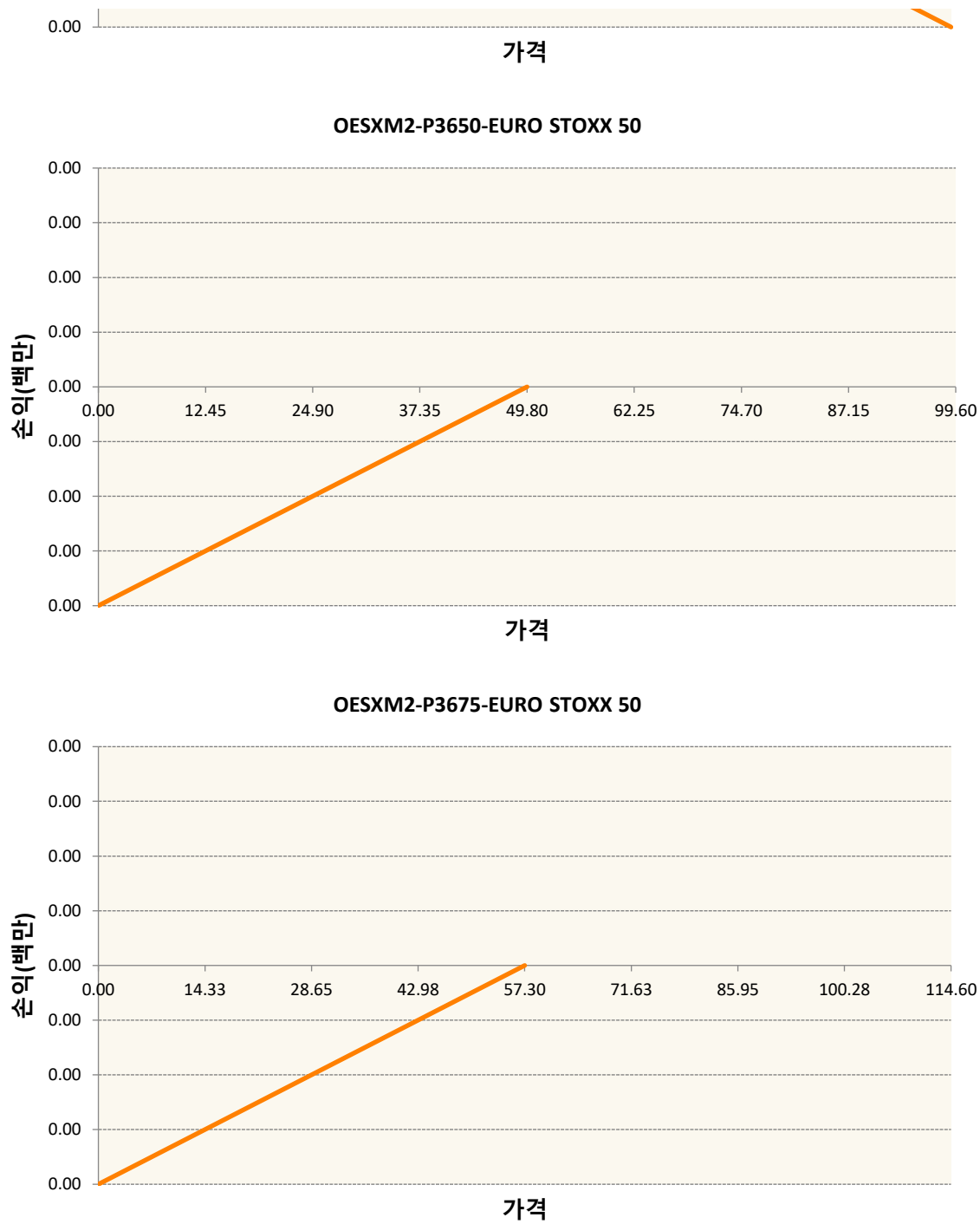
2. 만기시점의 손익구조

OESXM2-C3650-EURO STOXX 50



OESXM2-C3675-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY
 FXW213C4L KRW/EUR 24-06-22E
 FXW213C5Q KRW/EUR 26-08-22E
 OESXM2-C3 EURO STOXX 50
 OESXM2-C3 EURO STOXX 50
 OESXM2-P3 EURO STOXX 50
 OESXM2-P3 EURO STOXX 50

14
32
86
3
1
1
0.43

공시일 2022-05-30

기준일 2022-05-27

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

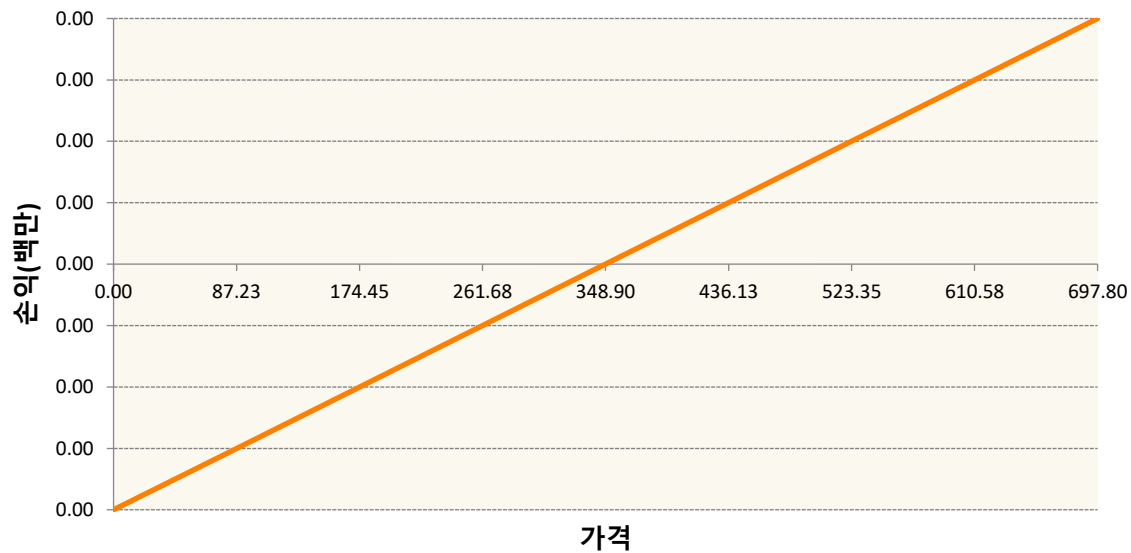
1. 계약금액

(단위:백만원)

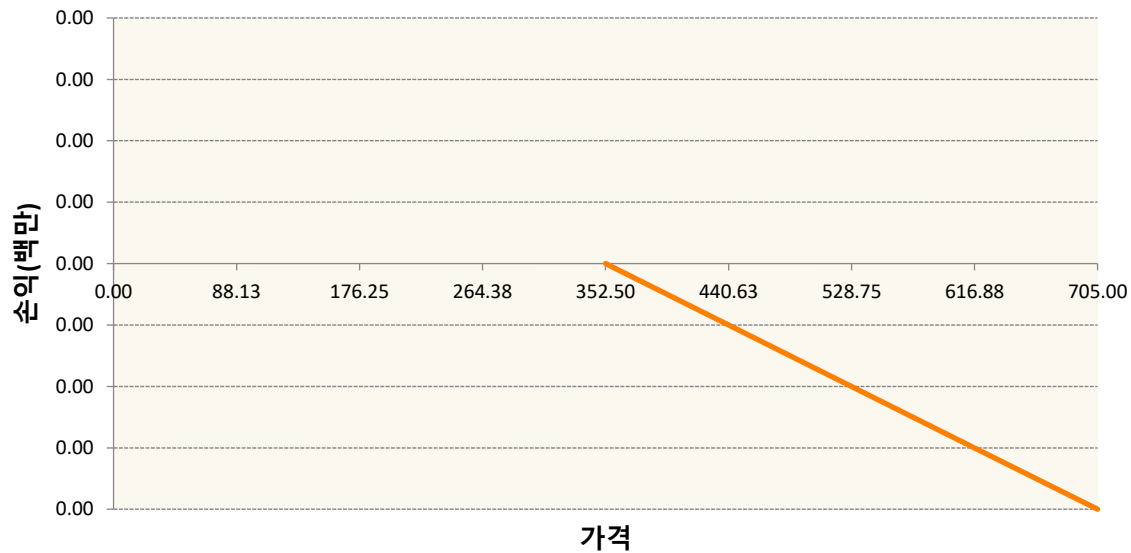
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	523	0	523	장내
누계	유가증권	옵션	338	4,613	-4,274	장내

2. 만기시점의 손익구조

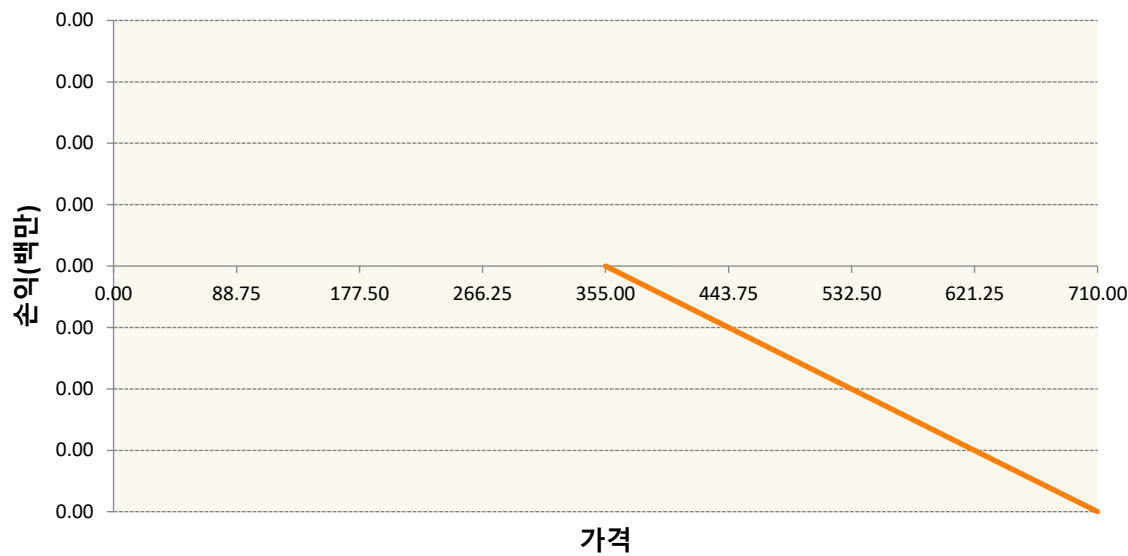
KR4101S60008-2022-06 코스피200지수선물



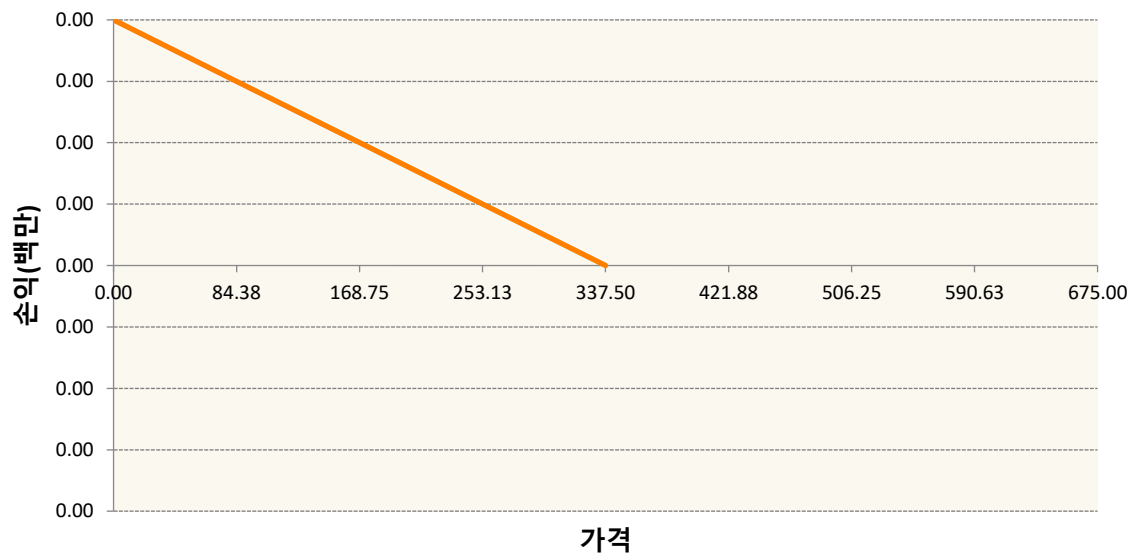
KR4201S63521-2022-06 콜352.5



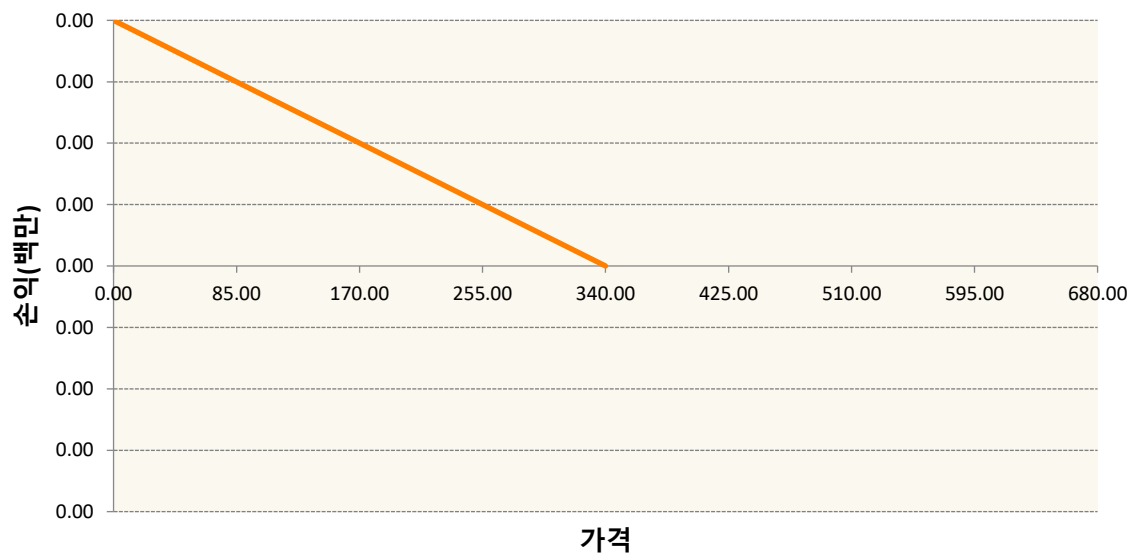
KR4201S63554-2022-06 콜355



KR4301S63370-2022-06 풋337.5



KR4301S63404-2022-06 풋340



(단위:백만원)

KR4101S60008							2022-06 코스피200지수선물		42	
	기초자산의 변동성									
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%			
-8.00%	-42	-42	-42	-42	-42	-42	-42			
-5.33%	-28	-28	-28	-28	-28	-28	-28			
-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%	28	28	28	28	28	28	28			
8.00%	42	42	42	42	42	42	42			
KR4201S63521							2022-06 콜352.5		20	
	기초자산의 변동성									
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%			
-8.00%	6	6	6	5	5	5	5			
-5.33%	5	5	5	5	4	4	4			
-2.67%	4	4	4	3	3	2	2			
0%	2	1	1	0	-1	-1	-2			
2.67%	-3	-4	-4	-5	-5	-6	-7			
5.33%	-10	-10	-11	-11	-12	-12	-13			
8.00%	-18	-18	-19	-19	-19	-20	-20			
KR4201S63554							2022-06 콜355		228	
	기초자산의 변동성									
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%			
-8.00%	57	57	56	55	53	51	49			
-5.33%	55	53	51	48	45	41	37			
-2.67%	46	42	37	32	26	21	14			
0%	22	14	7	0	-7	-15	-22			
2.67%	-28	-36	-44	-52	-60	-67	-75			
5.33%	-104	-110	-117	-123	-130	-137	-145			
8.00%	-200	-203	-207	-212	-217	-222	-228			
KR4301S63370							2022-06 풋337.5		13	
	기초자산의 변동성									
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%			
-8.00%	12	12	12	12	12	12	13			
-5.33%	6	6	6	6	7	7	7			
-2.67%	1	2	2	2	2	3	3			
0%	-1	0	0	0	0	0	1			
2.67%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	0			
5.33%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1			
8.00%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1			
KR4301S63404							2022-06 풋340		5	
	기초자산의 변동성									

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	4	4	5	5	5	5	5
-5.33%	2	2	2	2	3	3	3
-2.67%	1	1	1	1	1	1	1
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	0	0	0	0	0	0	0
5.33%	0	0	0	0	0	0	0
8.00%	0	0	0	0	0	0	0

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

(단위:백만원)

279

공시일	2022-05-30
기준일	2022-05-27

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	9,525	0	9,525	

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	2022-05-30
기준일	2022-05-27

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	7,187	0	7,187	

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	2022-05-30
기준일	2022-05-27

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	22,714	0	22,714	
누계	통화	선도	2,324	25,287	-22,963	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213C4MKRW/USD 27-06-22E	2,023
FXW213C4N USD/KRW 27-06-22E	121
FXW213C52 USD/KRW 27-06-22E	35
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)

759

공시일	2022-05-30
기준일	2022-05-27

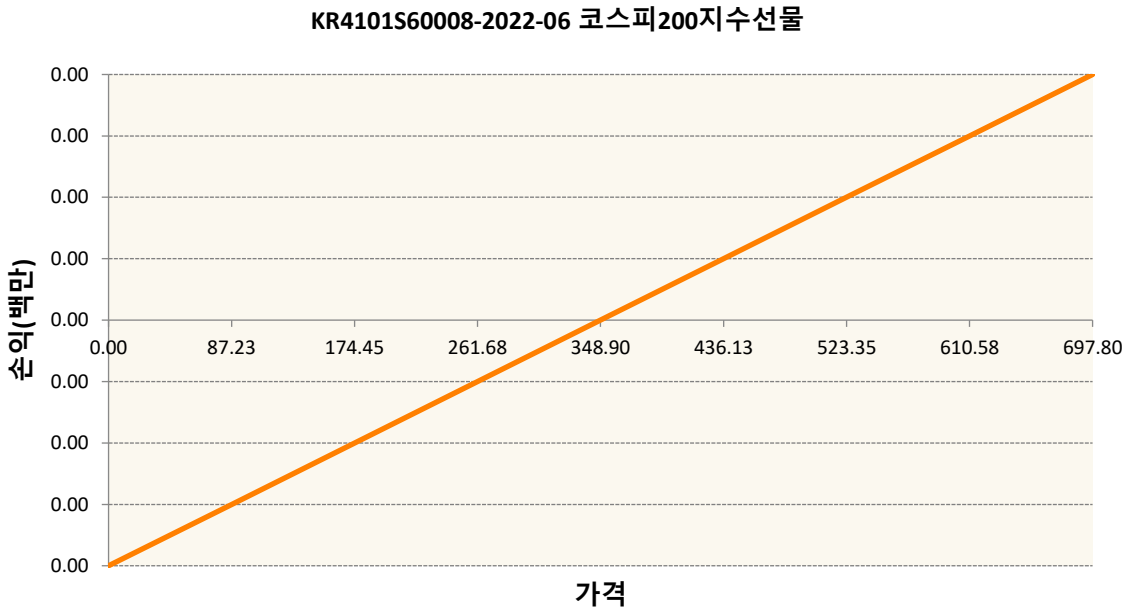
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

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	1,134	0	1,134	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101S60008			2022-06 코스피200지수선물				90
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-90	-90	-90	-90	-90	-90	-90
-5.33%	-60	-60	-60	-60	-60	-60	-60
-2.67%	-30	-30	-30	-30	-30	-30	-30
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	30	30	30	30	30	30	30
5.33%	60	60	60	60	60	60	60
8.00%	90	90	90	90	90	90	90

공시일 2022-05-30

기준일 2022-05-27

스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

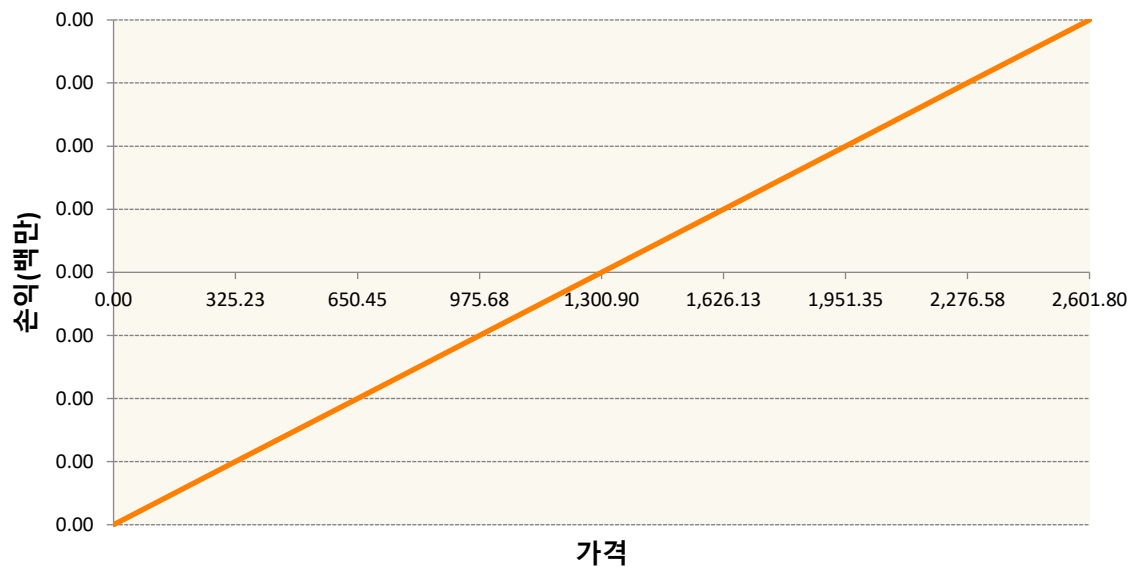
1. 계약금액

(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	741	0	741	
누계	유가증권	스왑	1,744	0	1,744	장외
누계	통화	선도	0	985	-985	장외

2. 만기시점의 손익구조

VNCM2-VN30 Index Future Jun22



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2.5504E+11 VN30TR Index(EUR)	140
FXW213C3G·KRW/EUR 24-06-22E	32
FXW213C4L·KRW/EUR 22-07-22E	16
FXW213C5J4KRW/EUR 26-08-22E	30
VNCM2 VN30 Index Future Jun22	59

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

(단위:백만원)

272

공시일	2022-05-30
기준일	2022-05-27

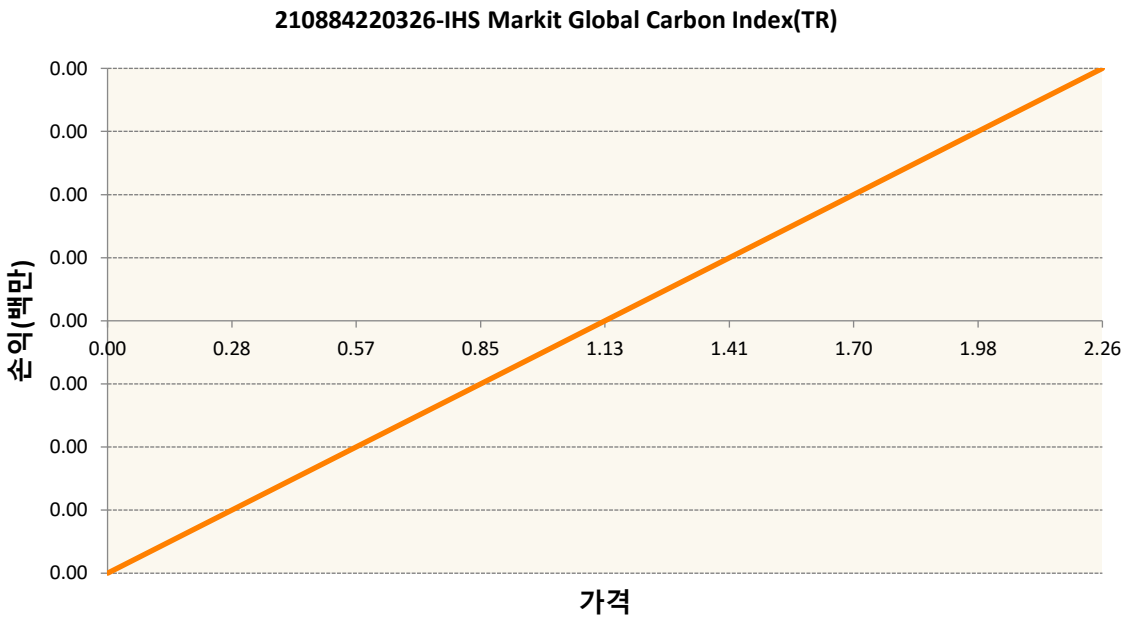
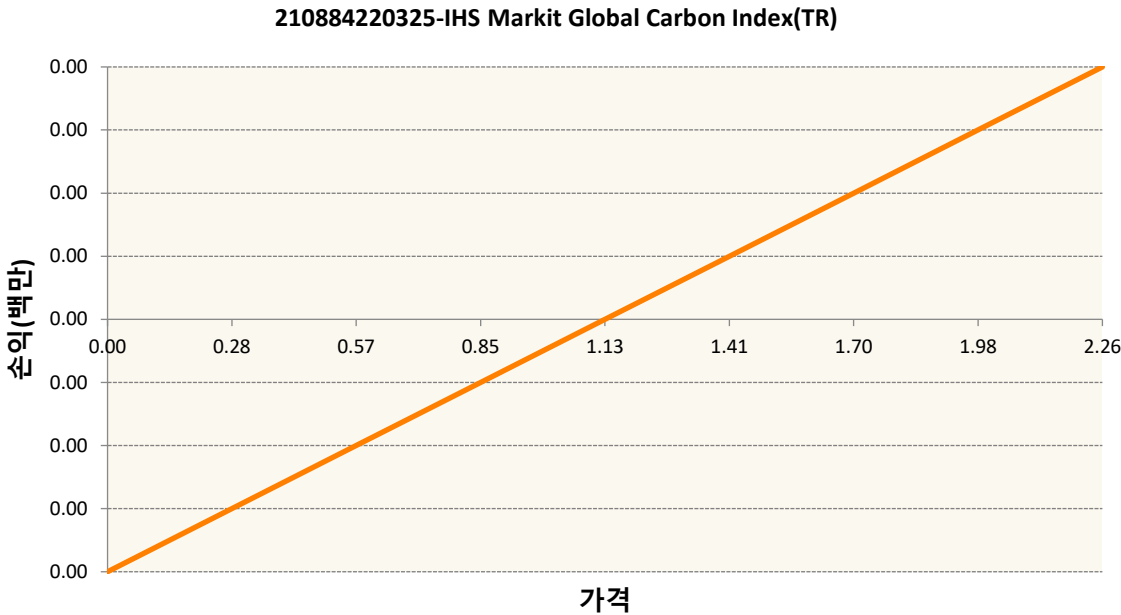
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

1. 계약금액

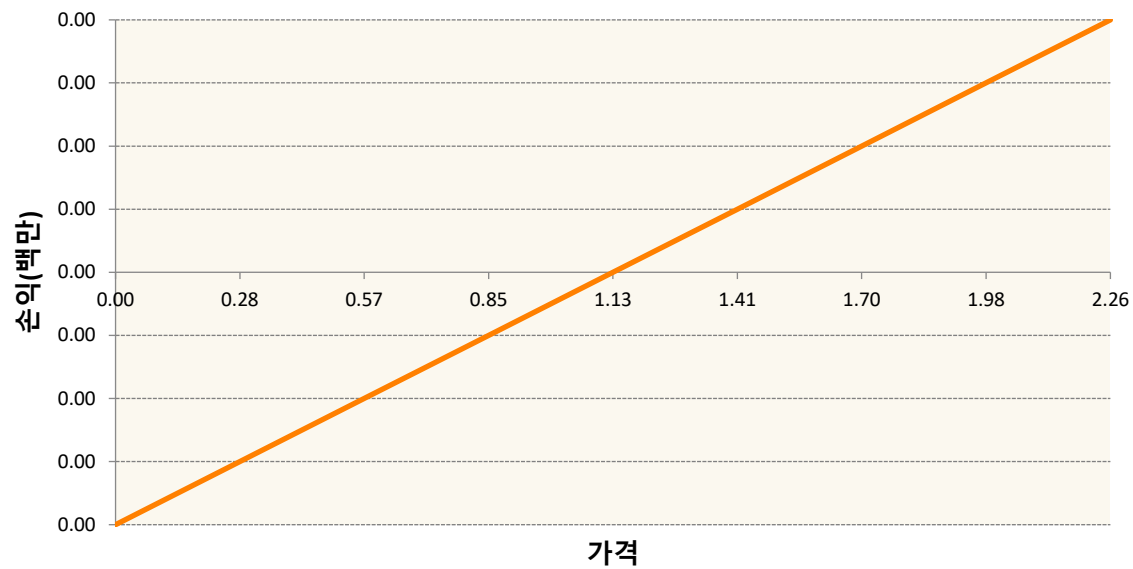
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	47,986	0	47,986	

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)

202

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

3,520

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

101

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

(단위:백만원)

7,147

공시일 2022-05-30

기준일 2022-05-27

SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

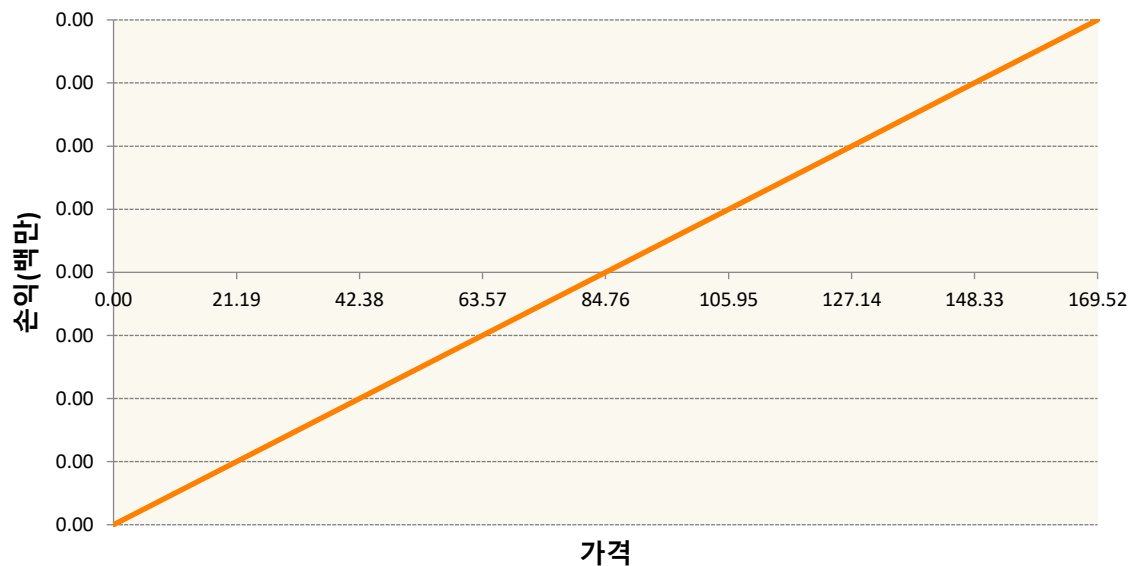
1. 계약금액

(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	14,643	0	14,643	
누계	통화	선도	0	7,960	-7,960	장외

2. 만기시점의 손익구조

MOZ22-ECX EMISSION Dec22



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213C5P KRW/EUR 27-06-22E

637

MOZ22 ECX EMISSION Dec22

1,171

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

(단위:백만원)

3,218

공시일	2022-05-30
기준일	2022-05-27

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)	28
SWCSI00000 신한CSI Index 220323 (키움)	28
SWCSI00000 신한CSI Index 220323 (미래)	28
SWCSI00000 신한CSI Index 220323 (메리츠)	28

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

(단위:백만원)

220

공시일	2022-05-30
기준일	2022-05-27

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)	4
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220113(미래)	5
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220113(메리츠)	4
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220113(NH)	4
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220426(메리츠)	1

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

(단위:백만원)

24

공시일	2022-05-30
기준일	2022-05-27

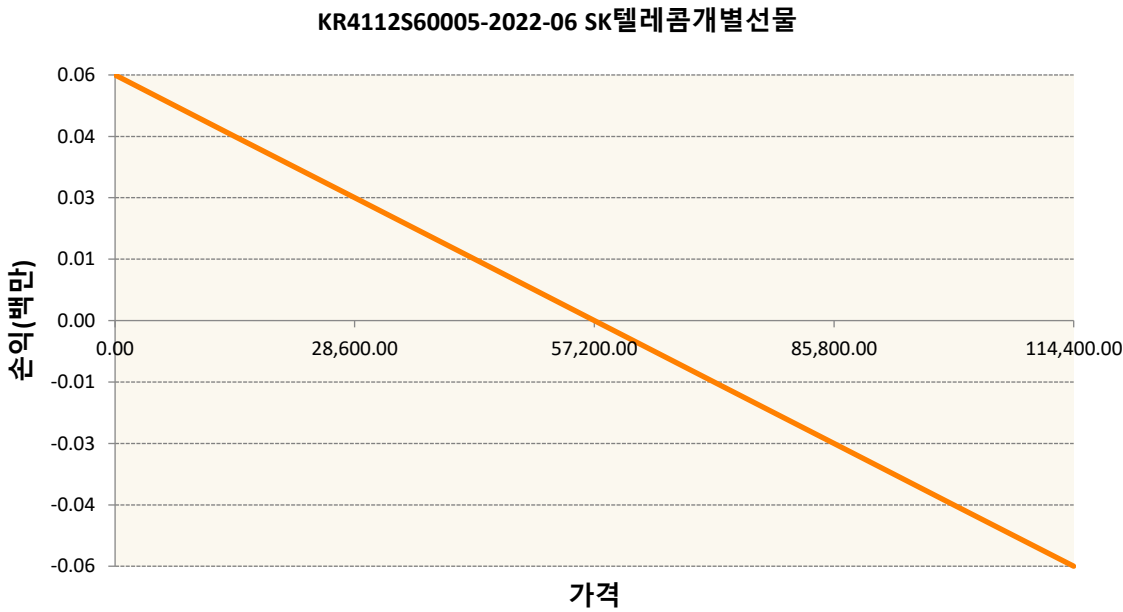
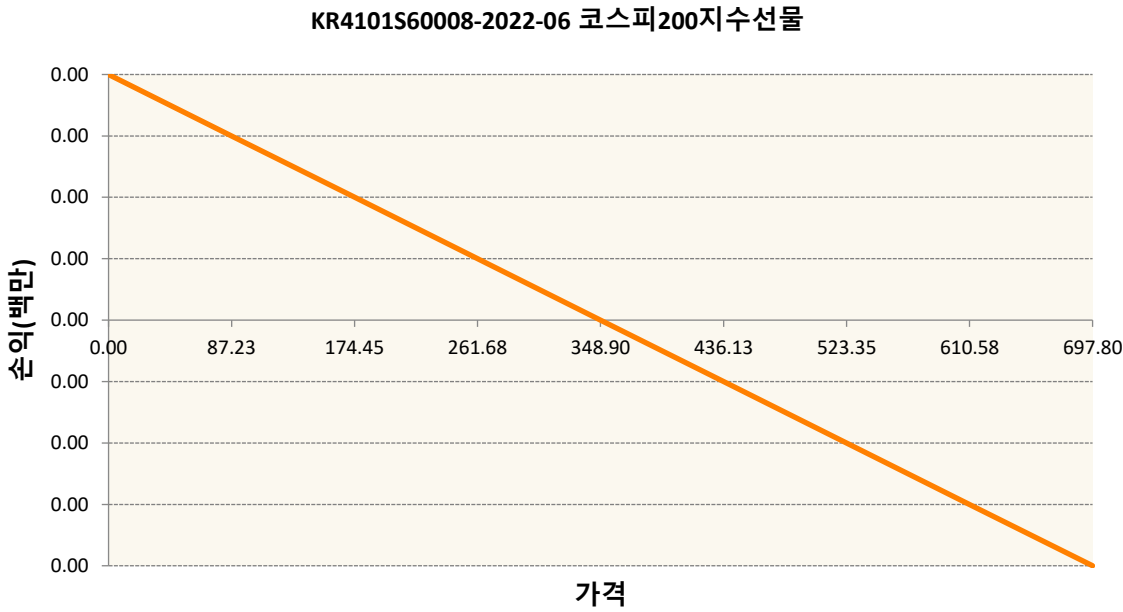
에쿼티알파일반사모혼합자산

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	2,088	-2,088	장내
누계	유가증권	스왑	0	0	0	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
KR4101S600 2022-06 코스피200지수선물		140
KR4112S600 2022-06 SK텔레콤개별선물		27
KRS0003014 SWAP_SPDR S&P O&G EXP_0322		3
KRS0003041 SWAP_MICRON TECH CORP_0331		0.11
KRS0003135 SWAP_MICROSOFT CP_0429		0.41

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	180

공시일 2022-05-30

기준일 2022-05-27

신한SOL한국형글로벌반도체엑티

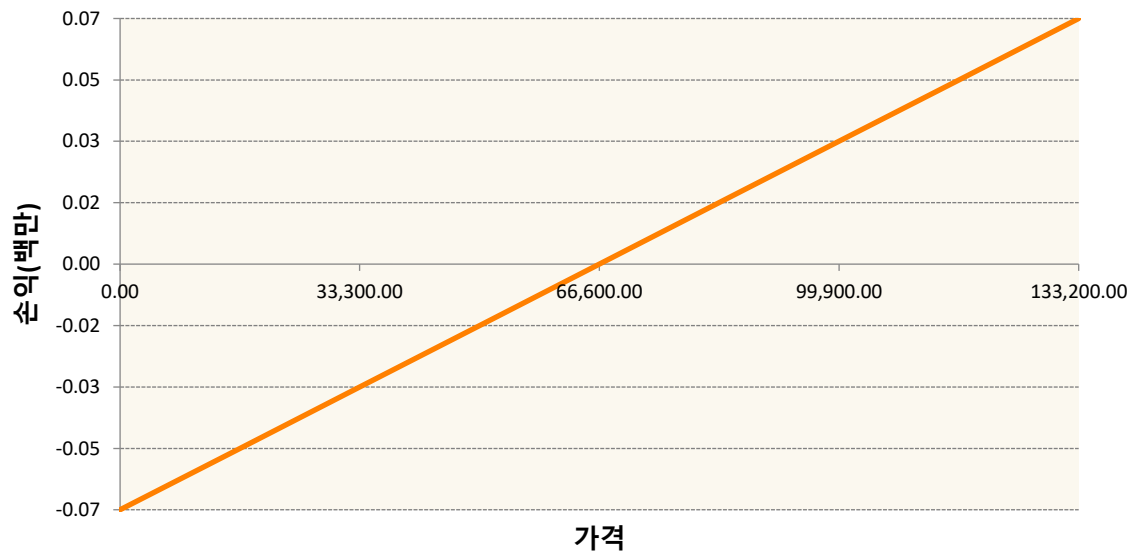
1. 계약금액

(단위:백만원)

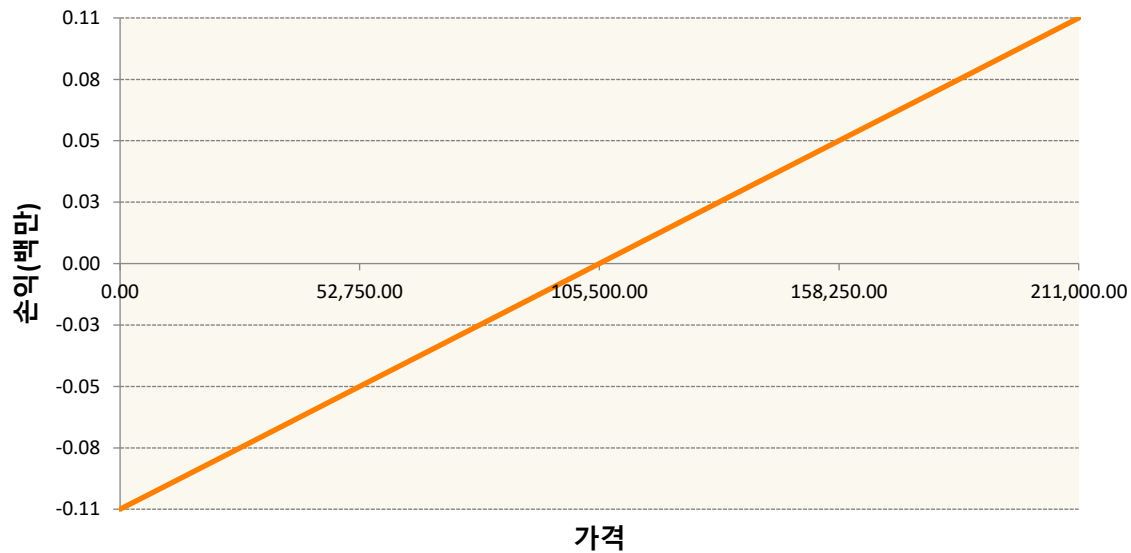
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	939	0	939	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4111S60007-2022-06 삼성전자개별선물



KR4150S60005-2022-06 SK하이닉스개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4111S60007		2022-06 삼성전자개별선물					38
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-38	-38	-38	-38	-38	-38	-38
-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%	38	38	38	38	38	38	38
KR4150S60005		2022-06 SK하이닉스개별선물					37
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-37	-37	-37	-37	-37	-37	-37
-5.33%	-25	-25	-25	-25	-25	-25	-25
-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%	25	25	25	25	25	25	25
8.00%	37	37	37	37	37	37	37

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

82

공시일	2022-05-30
기준일	2022-05-27

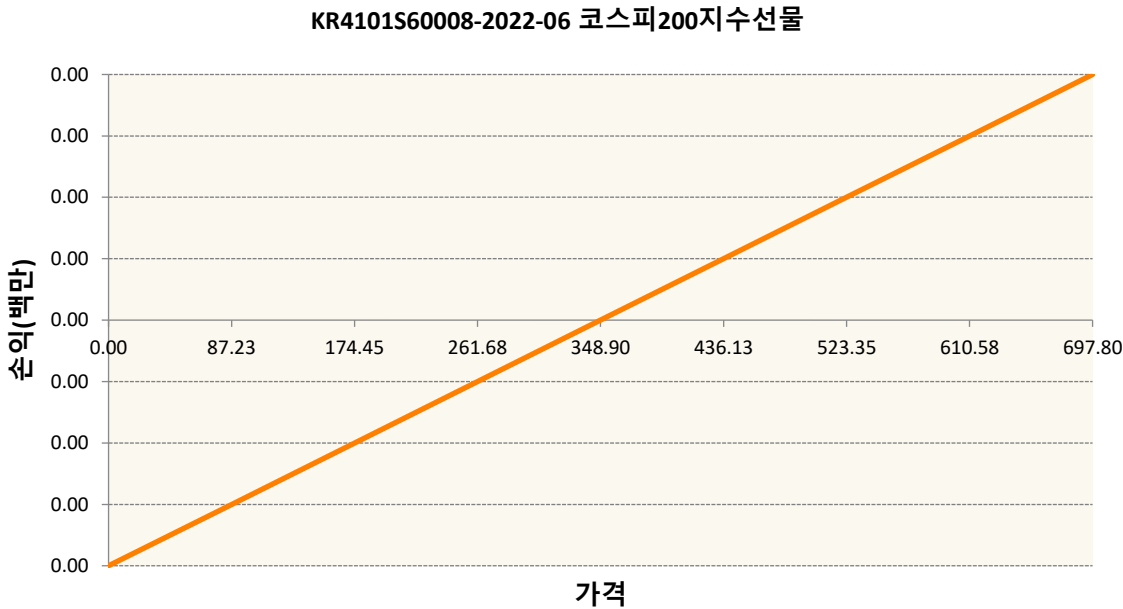
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

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	349	0	349	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101S60008			2022-06 코스피200지수선물				28
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-28	-28	-28	-28	-28	-28	-28
-5.33%	-19	-19	-19	-19	-19	-19	-19
-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%	19	19	19	19	19	19	19
8.00%	28	28	28	28	28	28	28

공시일 2022-05-30

기준일 2022-05-27

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

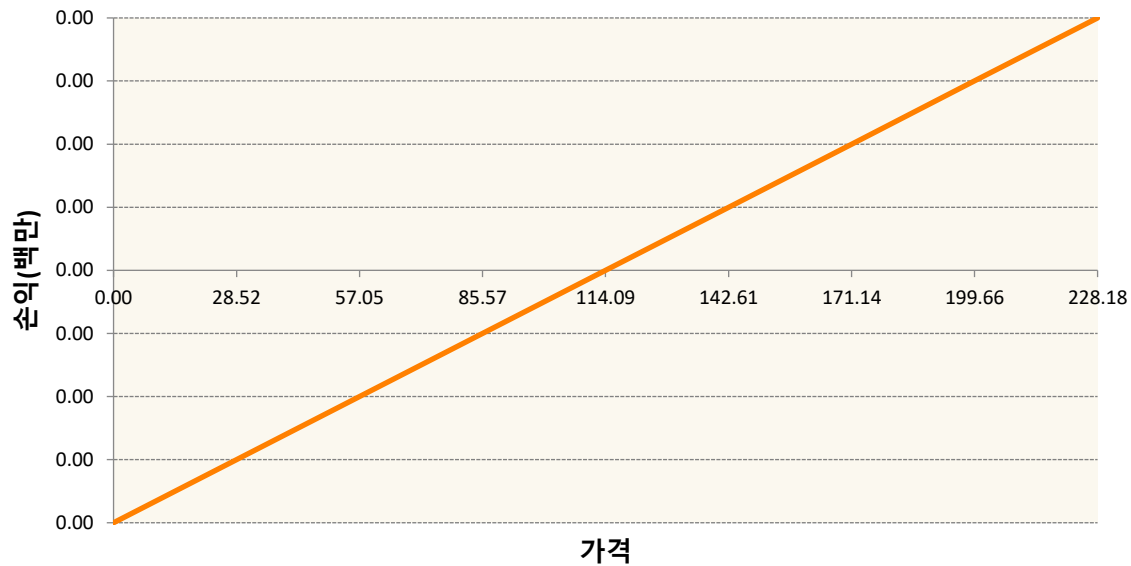
1. 계약금액

(단위:백만원)

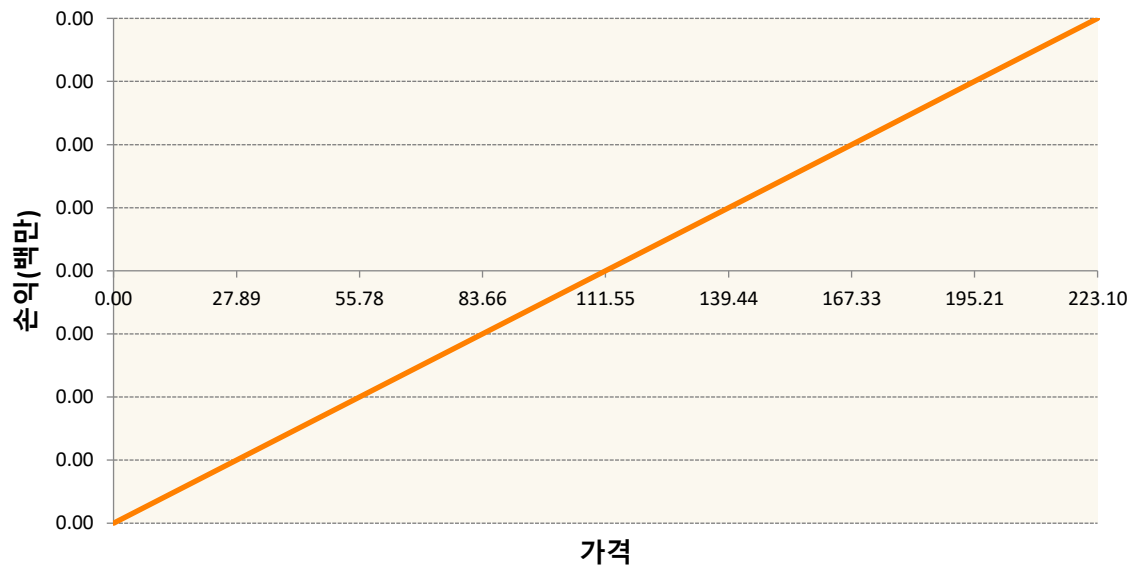
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,019	627	2,392	

2. 만기시점의 손익구조

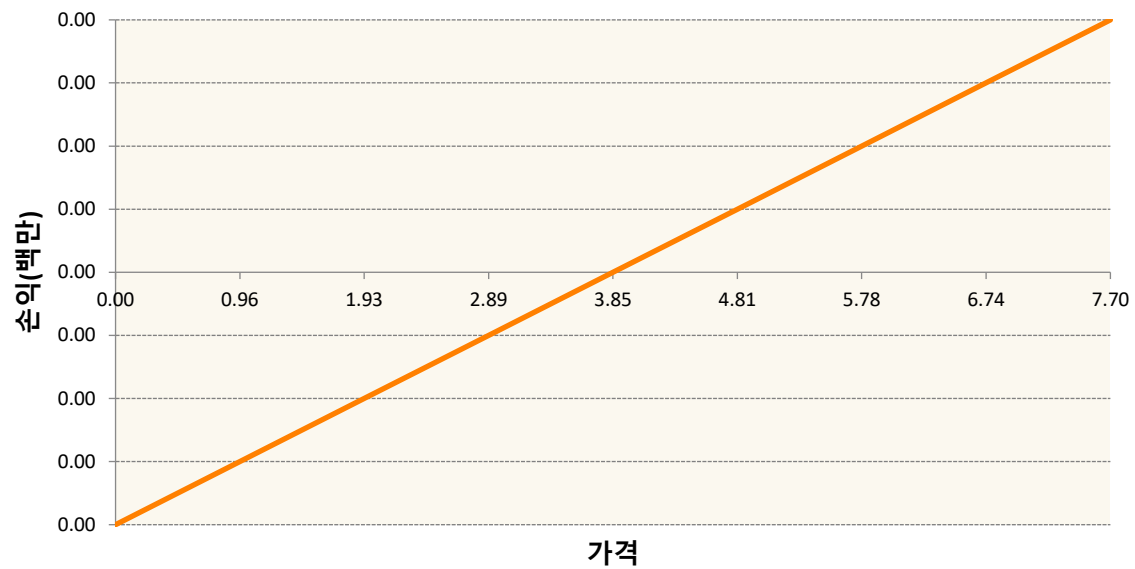
CLN2-WTI CRUDE FUTURE Jul22



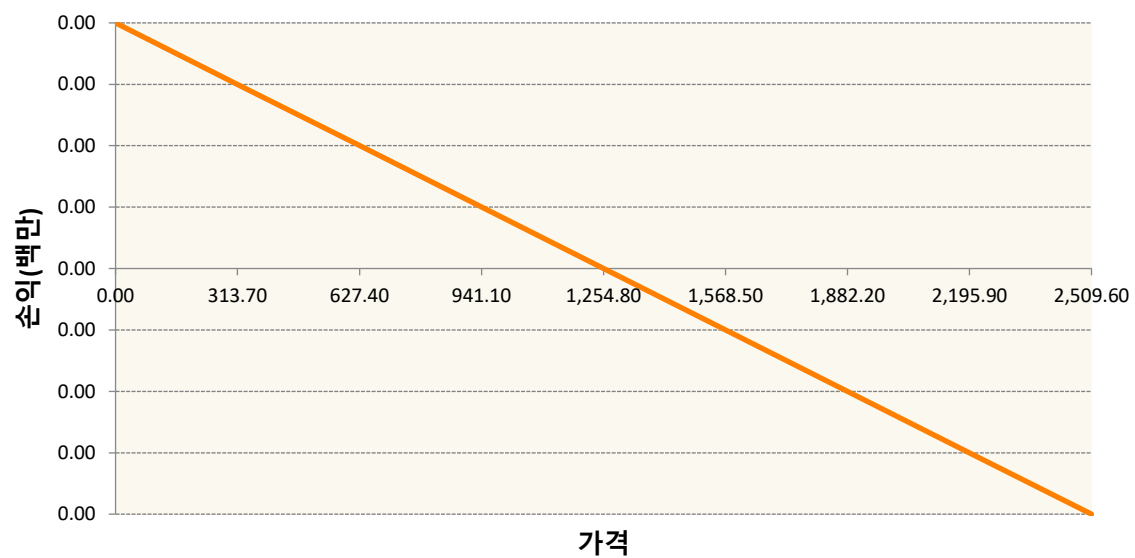
COU2-BRENT CRUDE FUTR Sep22



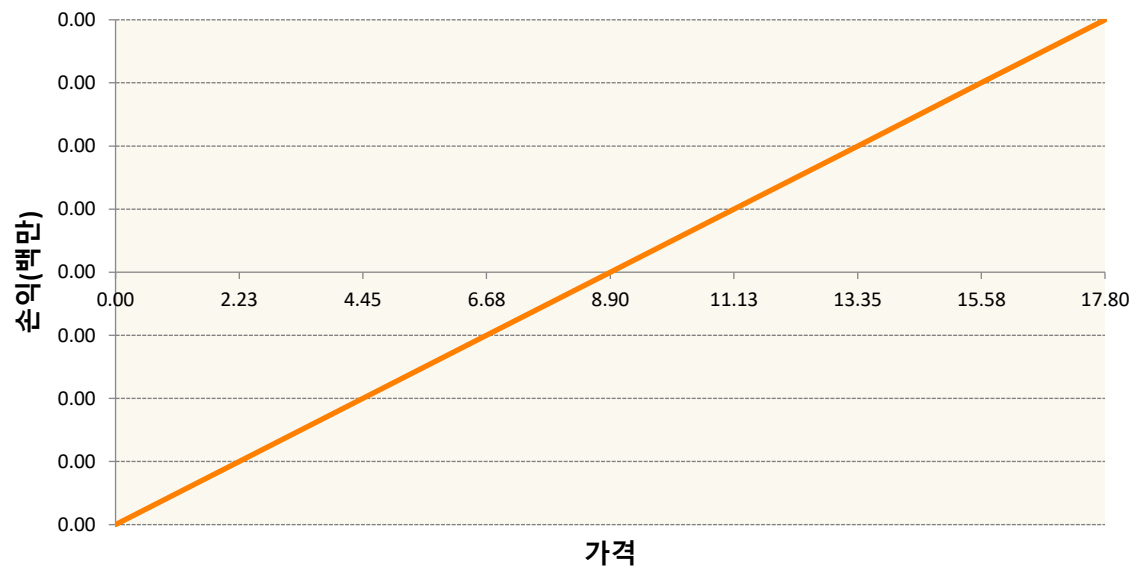
HON2-NY Harb ULSD Fut Jul22

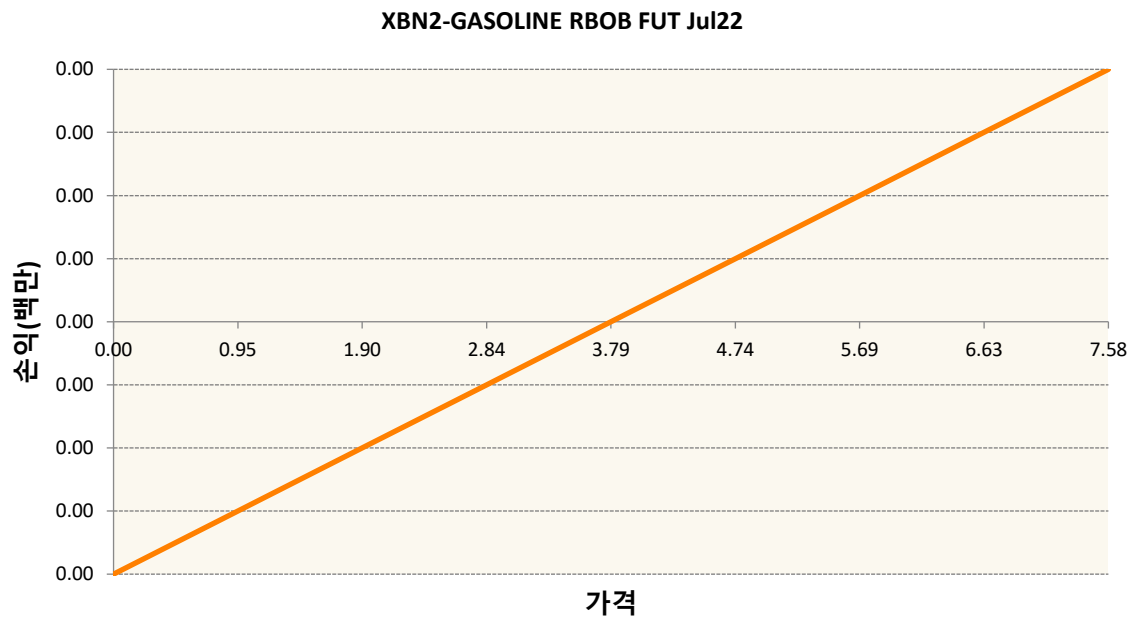
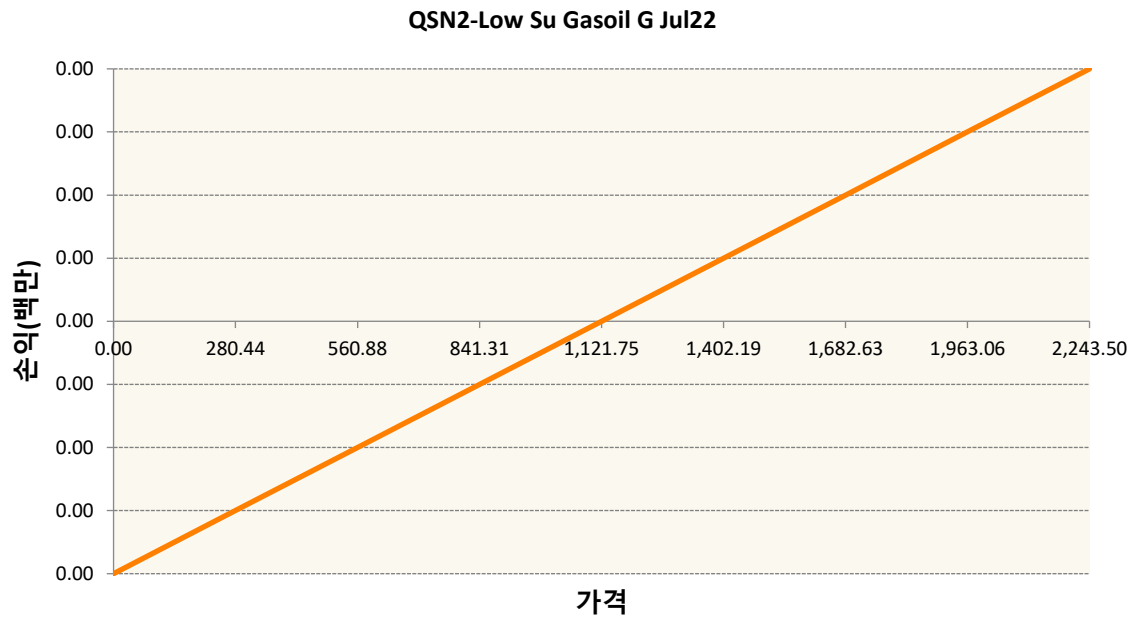


KR4175S60002-2022-06 달러선물



NGN22-NATURAL GAS FUTR Jul22





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
CLN2	WTI CRUDE FUTURE Jul22		45
COU2	BRENT CRUDE FUTR Sep22		46
HON2	NY Harb ULSD Fut Jul22		16
KR4175S600 2022-06 달러선물			50
NGN22	NATURAL GAS FUTR Jul22		97
QSN2	Low Su Gasoil G Jul22		22
XBN2	GASOLINE RBOB FUT Jul22		16

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)		(단위:백만원)
		728