

공시일 2022-05-17

기준일 2022-05-16

포커스농산물모(채권-파생형)

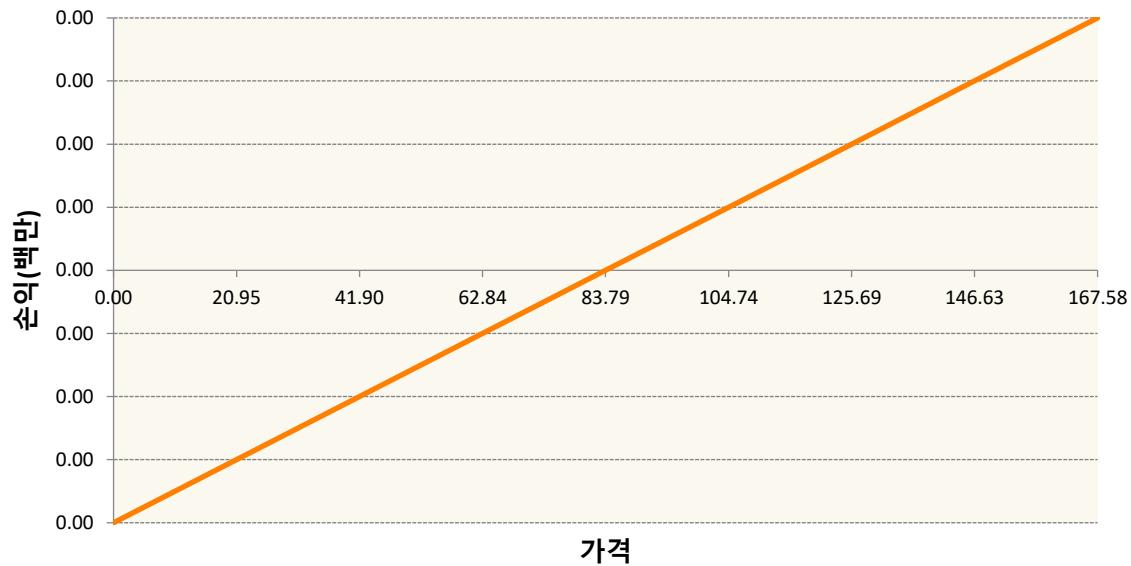
1. 계약금액

(단위:USD 백만)

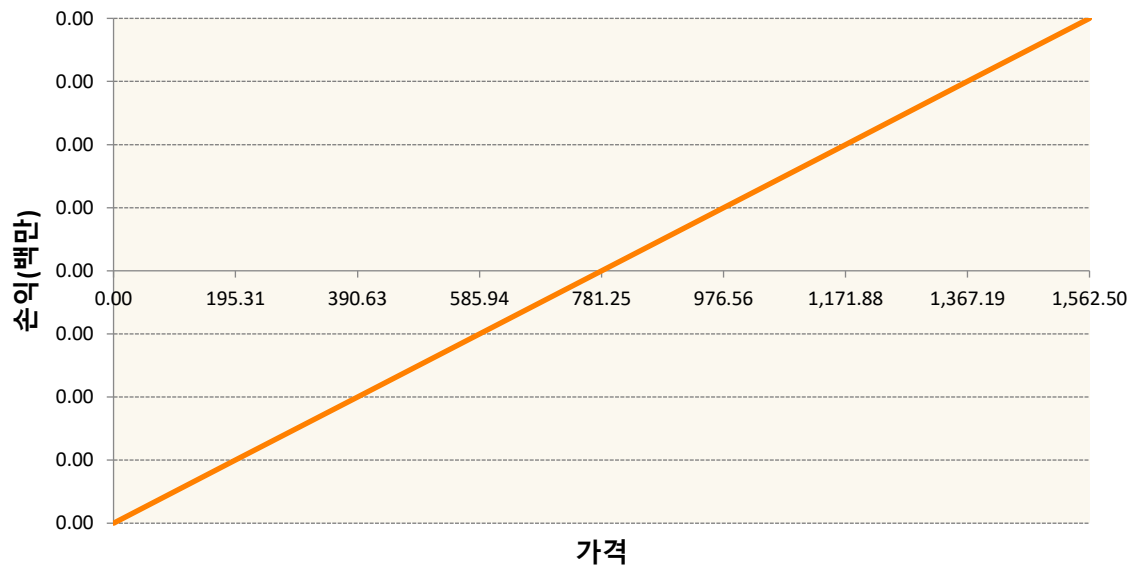
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	8,516	1,989	6,527	

2. 만기시점의 손익구조

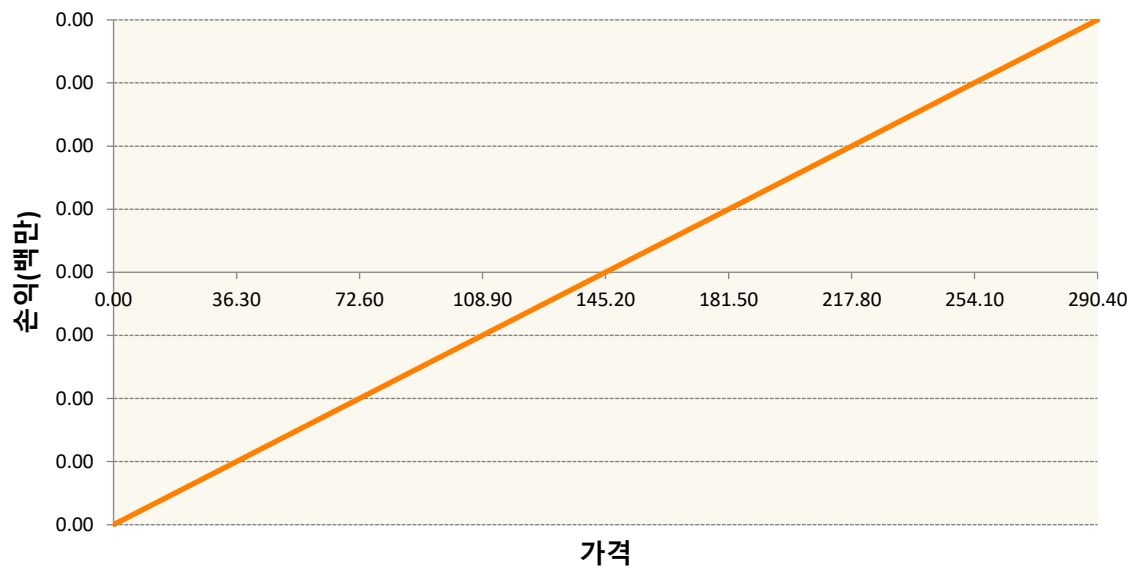
BON2-SOYBEAN OIL FUTR Jul22



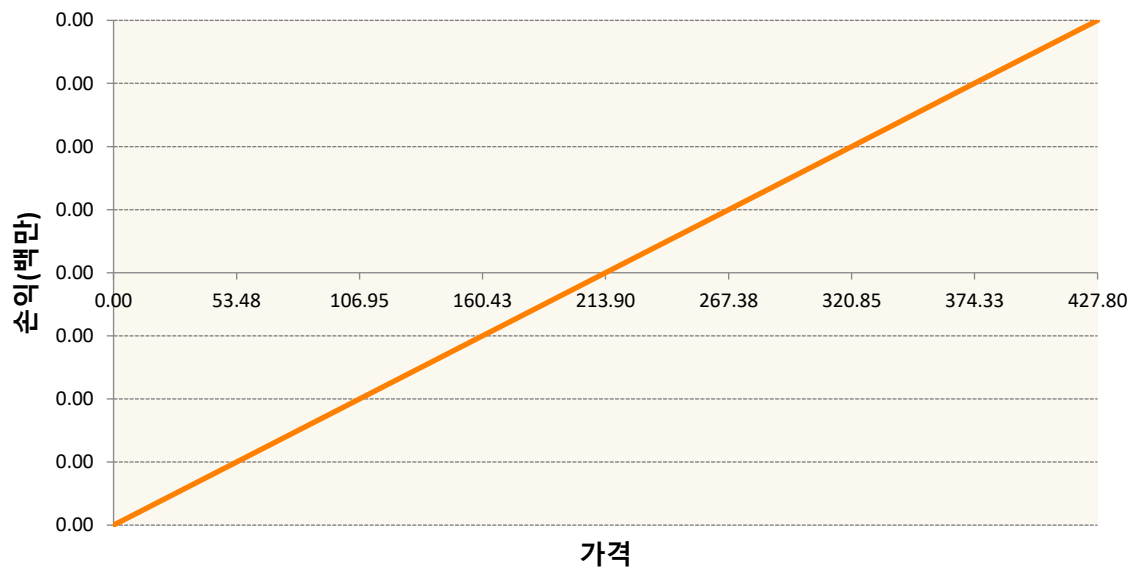
CN2-CORN FUTURE Jul22



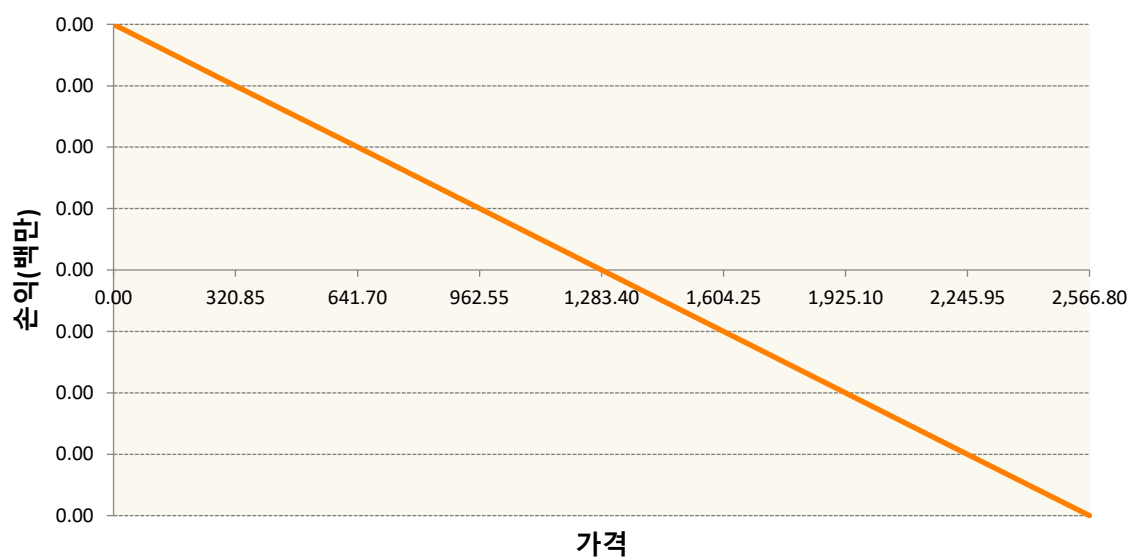
CTN2-COTTON NO.2 FUTR Jul22



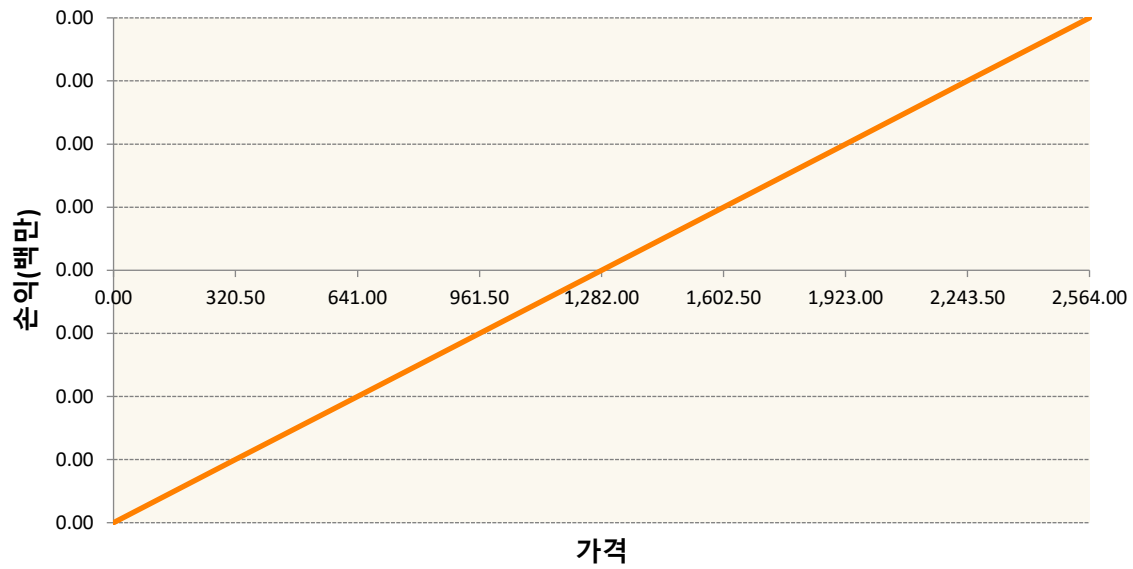
KCN2-COFFEE 'C' FUTURE Jul22



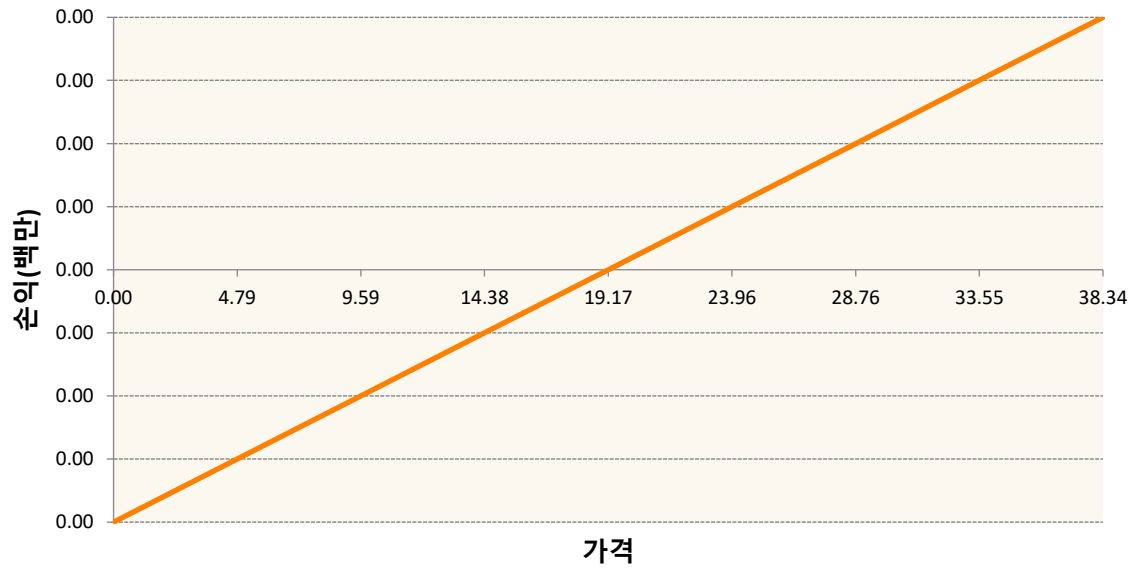
KR4175S60002-2022-06 달러선물



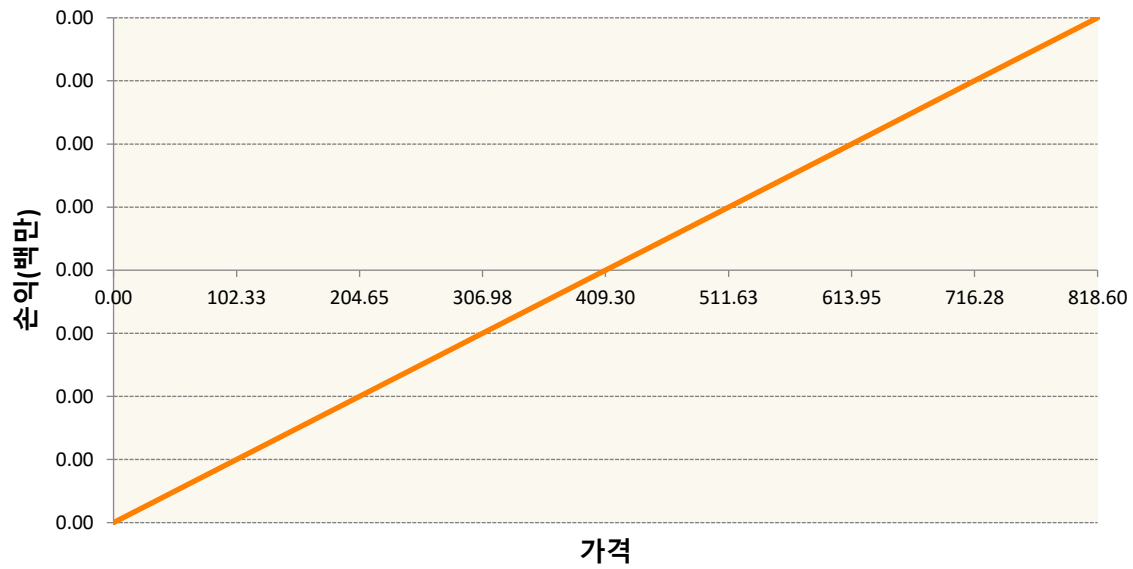
KWN2-KC HRW WHEAT FUT Jul22



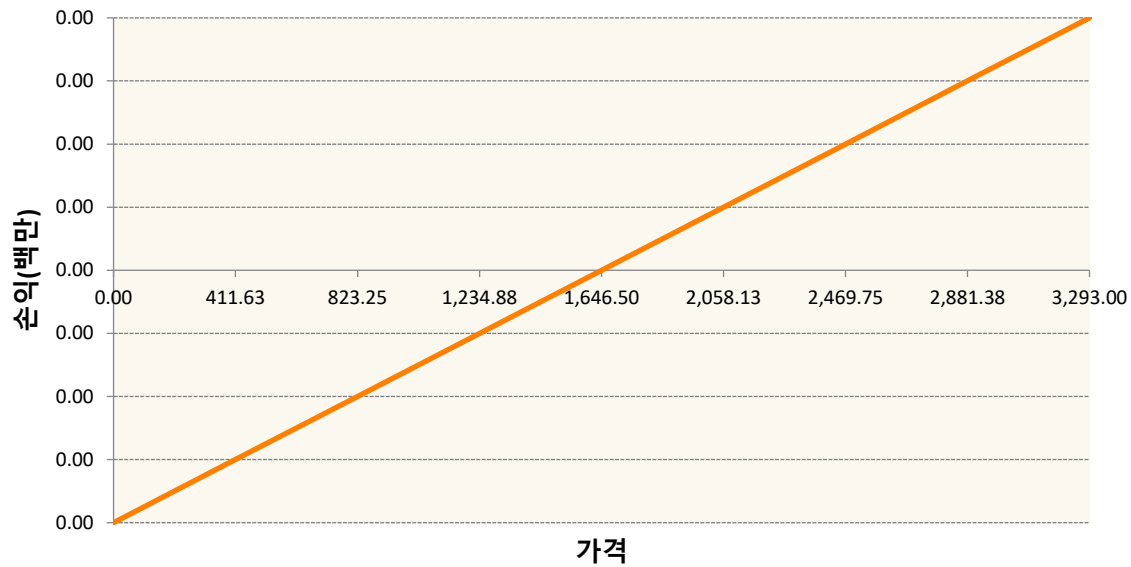
SBN2-Sugar #11 (WORLD) Jul22



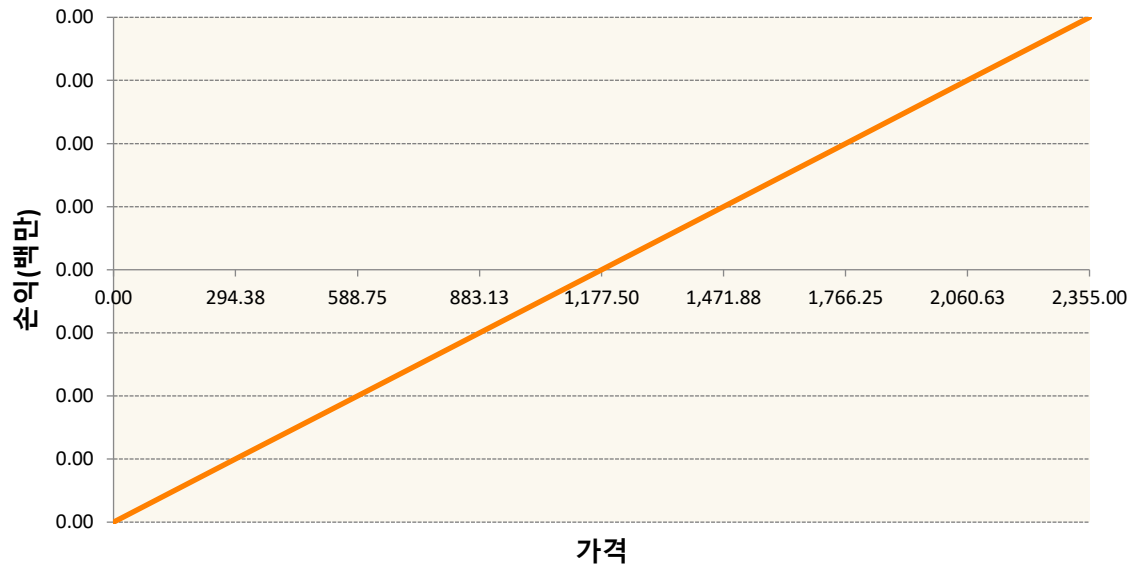
SMN2-SOYBEAN MEAL FUTR Jul22



SN2-SOYBEAN FUTURE Jul22



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	2022-05-17
기준일	2022-05-16

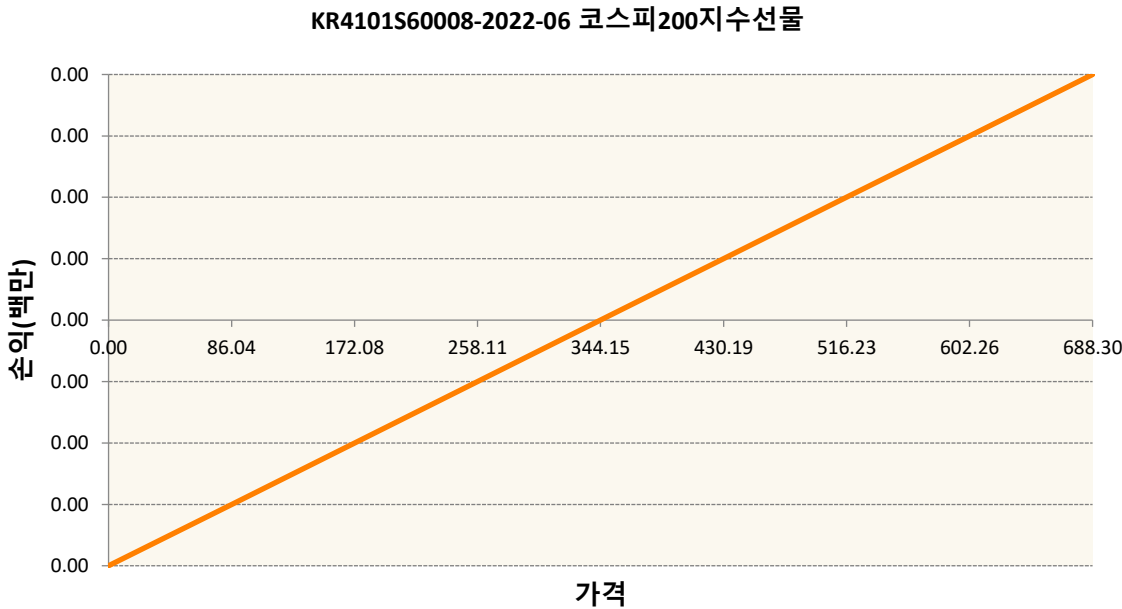
스마트인덱스모

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	774	0	774	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101S60008			2022-06 코스피200지수선물				62
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-62	-62	-62	-62	-62	-62	-62
-5.33%	-41	-41	-41	-41	-41	-41	-41
-2.67%	-21	-21	-21	-21	-21	-21	-21
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	21	21	21	21	21	21	21
5.33%	41	41	41	41	41	41	41
8.00%	62	62	62	62	62	62	62

공시일	2022-05-17
기준일	2022-05-16

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

333

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

413

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2022-05-17
기준일	2022-05-16

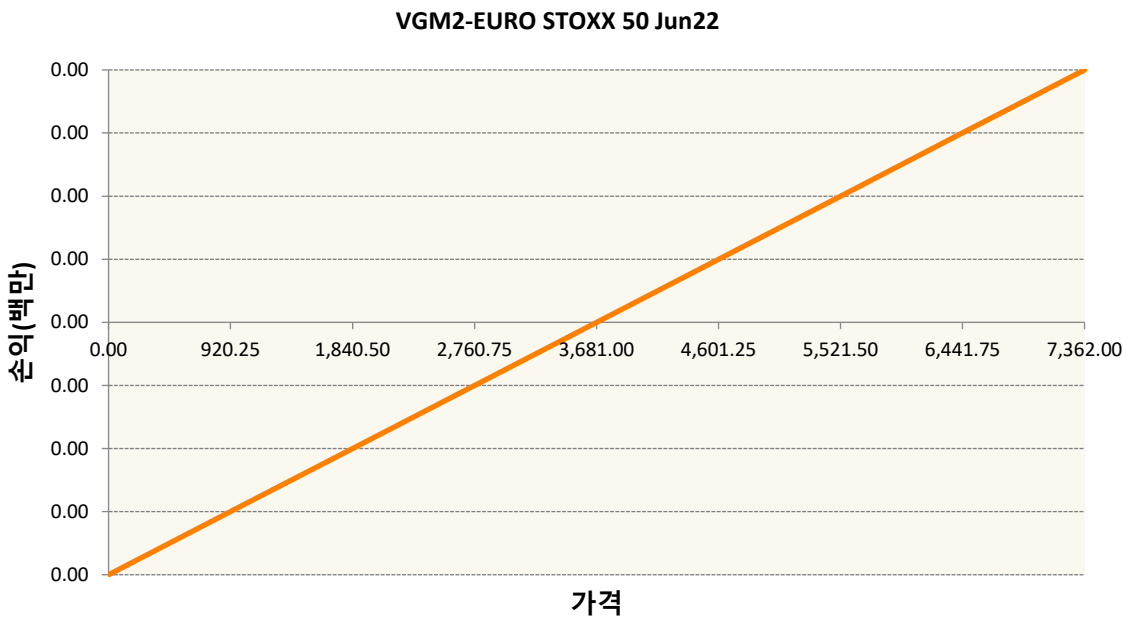
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	549	0	549	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

43

공시일	2022-05-17
기준일	2022-05-16

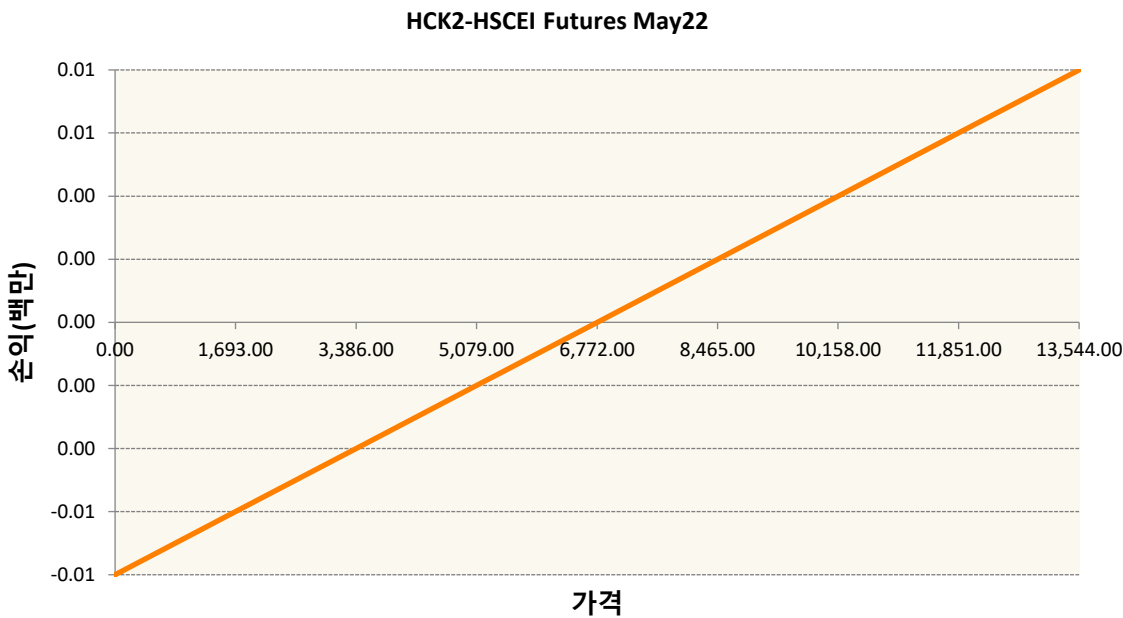
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,092	0	1,092	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCK2	HSCEI Futures May22	87
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

123

공시일	2022-05-17
기준일	2022-05-16

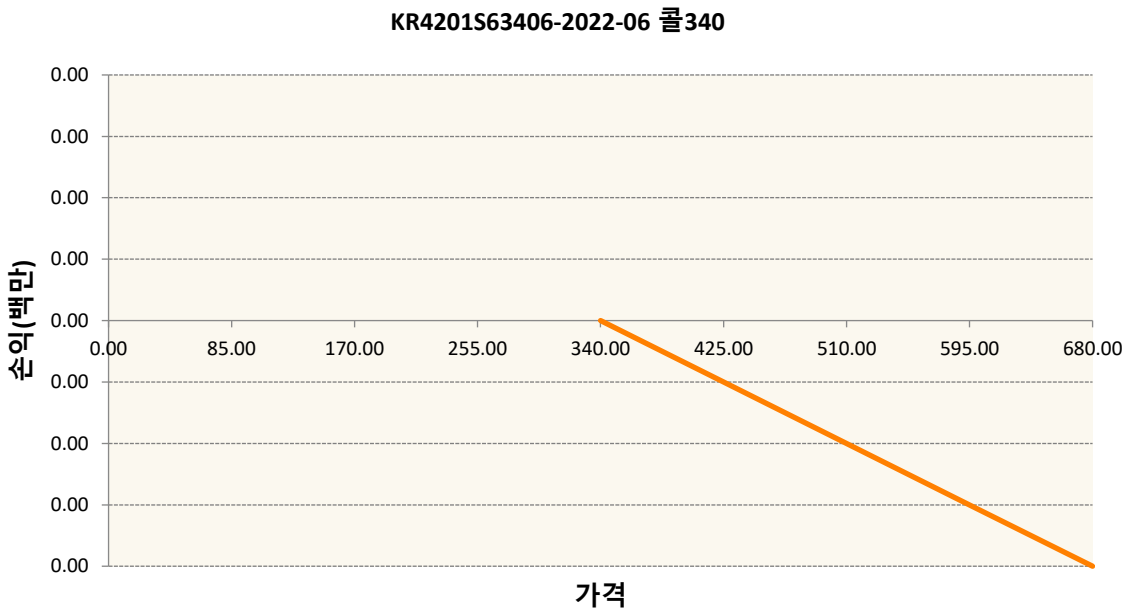
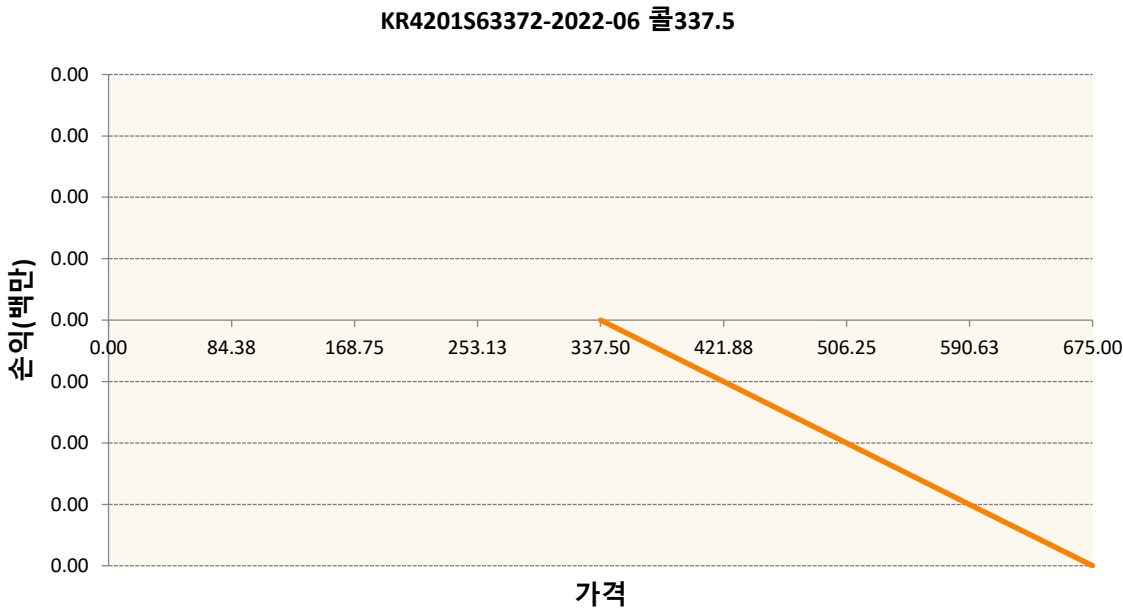
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

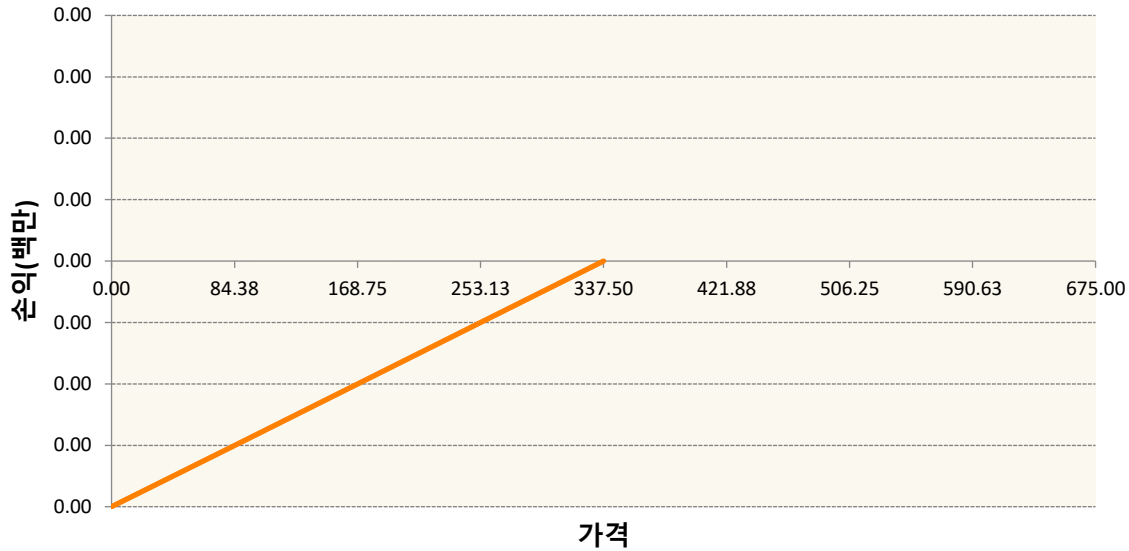
(단위:백만원)

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



KR4301S63370-2022-06 풋337.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201S63372			2022-06 콜337.5				2,733
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,550	1,489	1,422	1,351	1,275	1,195	1,113
-5.33%	1,319	1,230	1,139	1,045	950	854	756
-2.67%	914	809	703	598	492	387	281
0%	311	208	104	0	-105	-210	-315
2.67%	-476	-560	-648	-739	-833	-929	-1,026
5.33%	-1,402	-1,461	-1,526	-1,597	-1,674	-1,754	-1,838
8.00%	-2,418	-2,453	-2,496	-2,546	-2,603	-2,666	-2,733
KR4201S63406			2022-06 콜340				741
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	395	380	363	345	325	304	282
-5.33%	341	318	294	269	243	217	191
-2.67%	242	213	184	155	126	97	68
0%	89	59	30	0	-30	-60	-89
2.67%	-117	-142	-168	-195	-223	-251	-279
5.33%	-365	-384	-404	-426	-449	-473	-497
8.00%	-642	-654	-668	-684	-701	-720	-741
KR4301S63370			2022-06 풋337.5				634
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-581	-586	-594	-602	-612	-623	-634
-5.33%	-301	-315	-330	-345	-361	-377	-394
-2.67%	-82	-101	-121	-141	-161	-181	-201
0%	56	38	19	0	-19	-39	-58

2.67%	121	109	97	83	68	53	37
5.33%	143	138	132	124	115	105	94
8.00%	149	147	145	141	137	131	124

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

(단위:백만원)

3,945

공시일	2022-05-17
기준일	2022-05-16

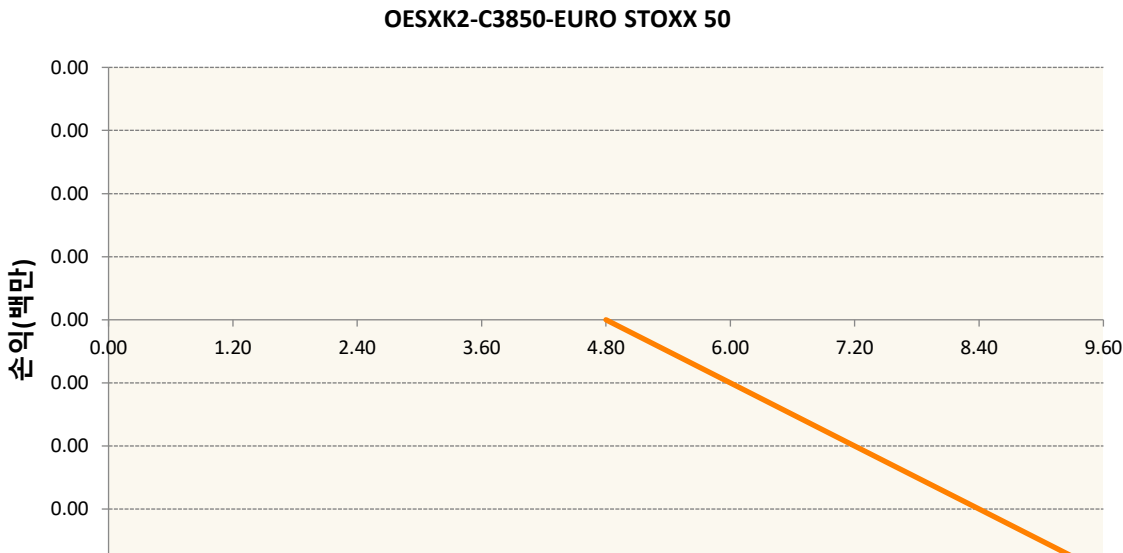
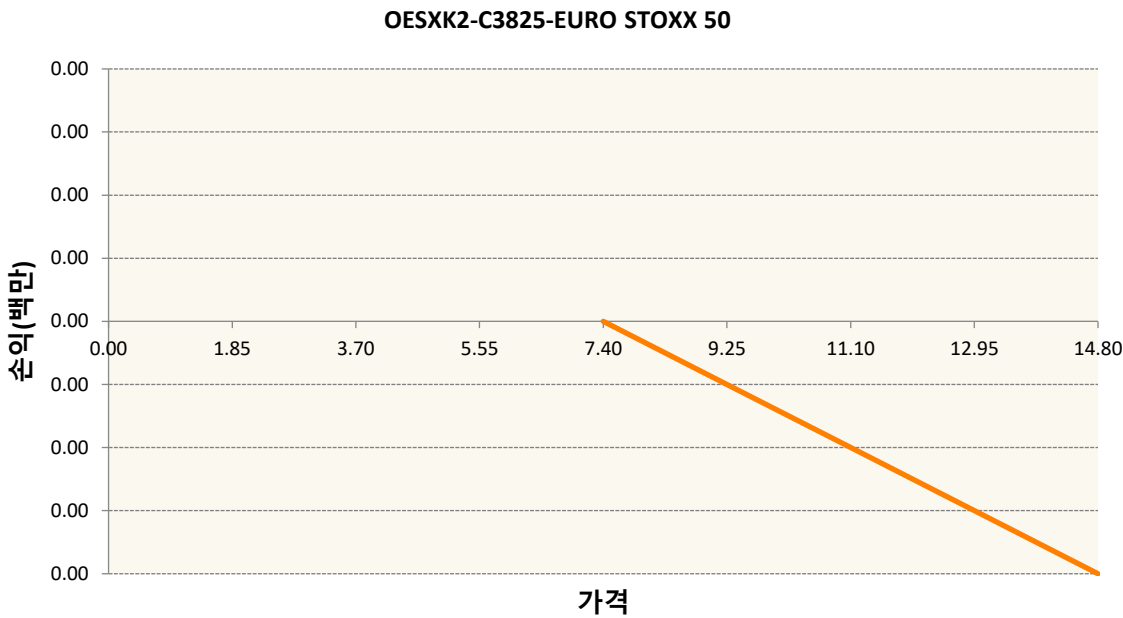
유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

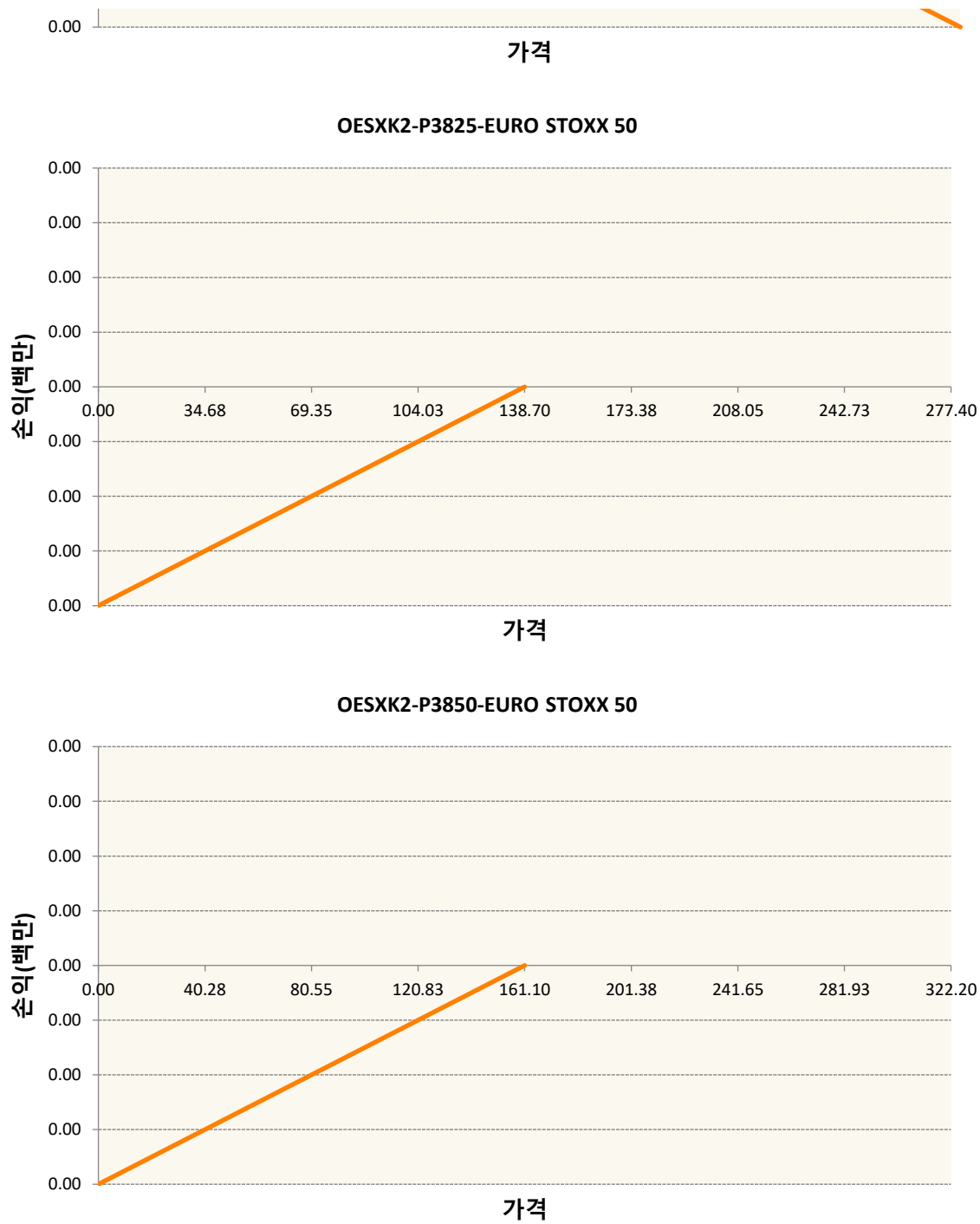
1. 계약금액

(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	53	-53	장내
누계	지수	스왑	10	0	10	장외
누계	통화	선도	0	1,469	-1,469	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

18
21
64
32
0.01
0.13
0.15
4

공시일 2022-05-17

기준일 2022-05-16

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

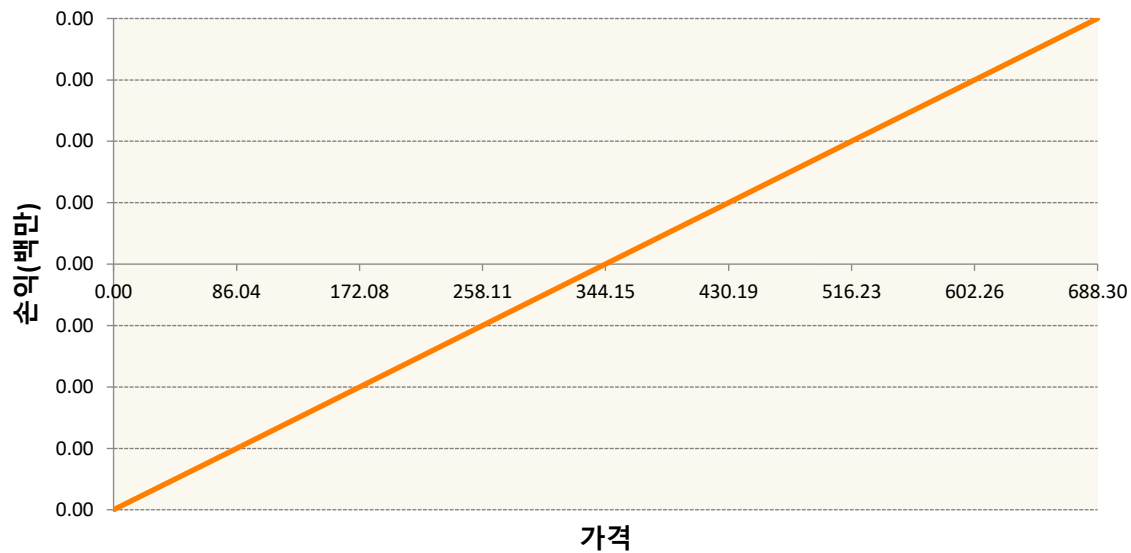
1. 계약금액

(단위:백만원)

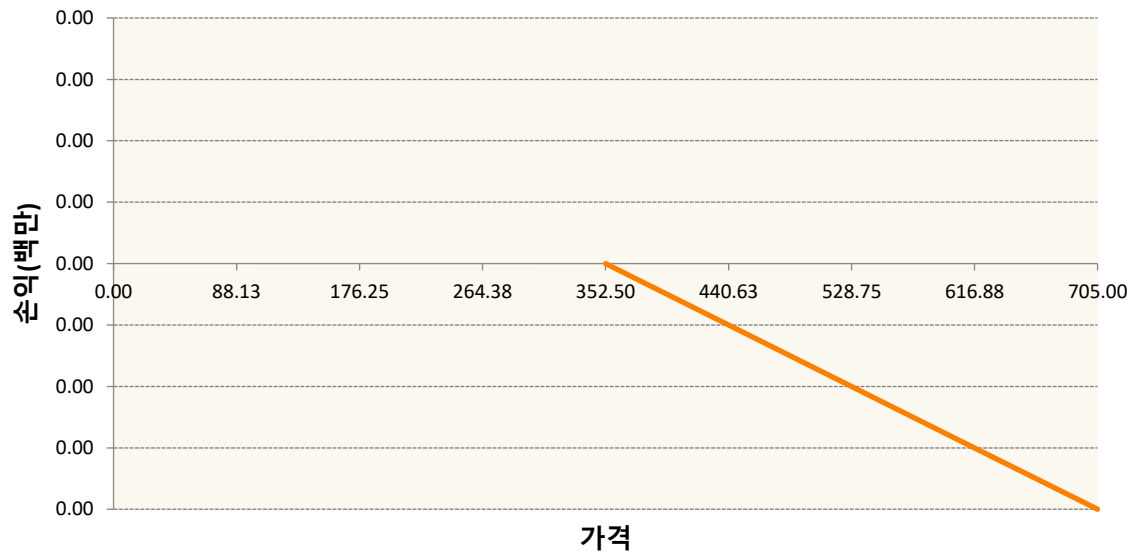
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	516	0	516	장내
누계	유가증권	옵션	338	4,613	-4,274	장내

2. 만기시점의 손익구조

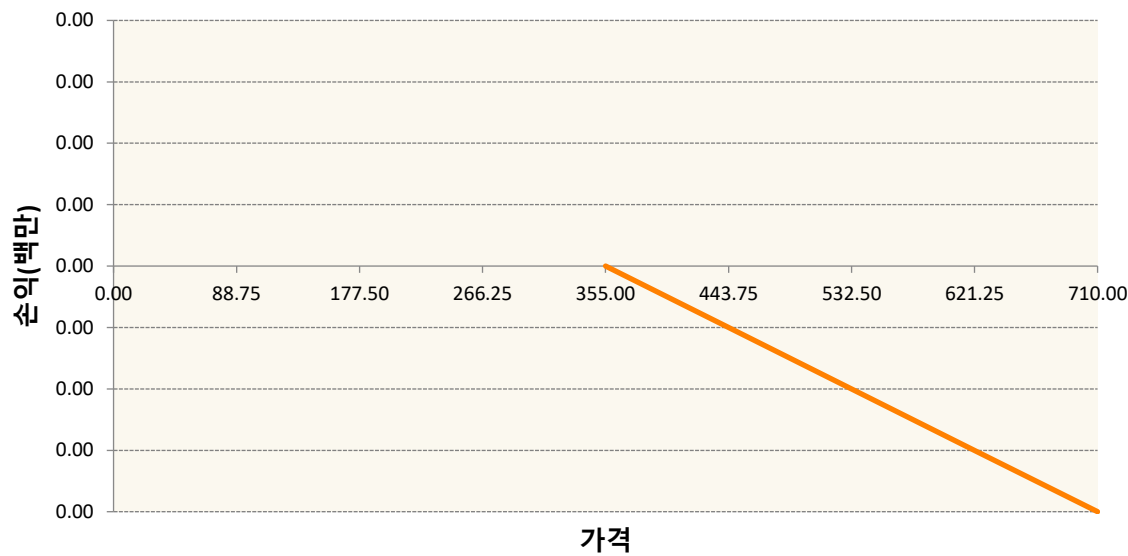
KR4101S60008-2022-06 코스피200지수선물



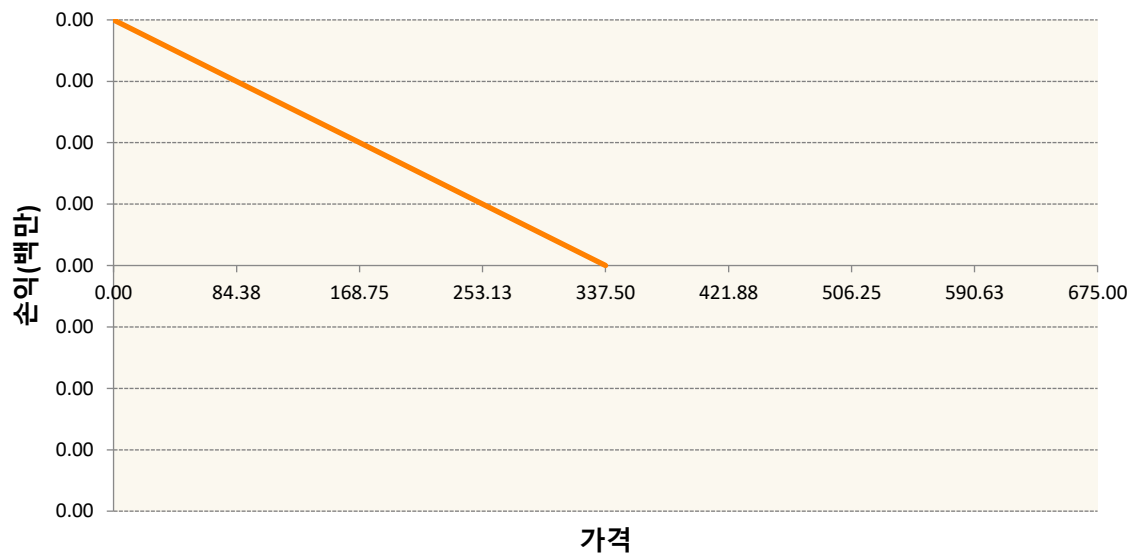
KR4201S63521-2022-06 콜352.5



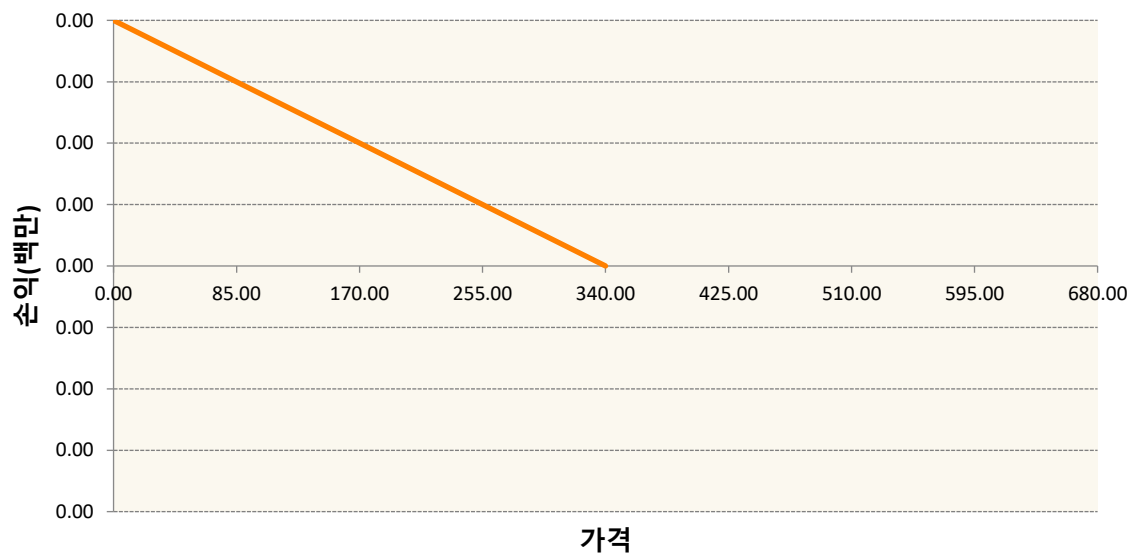
KR4201S63554-2022-06 콜355



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%	-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%	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%	7	7	6	6	6	5	5	
-5.33%	6	6	6	5	4	4	3	
-2.67%	5	4	4	3	2	2	1	
0%	3	2	1	0	-1	-2	-3	
2.67%	-1	-2	-3	-4	-5	-6	-7	
5.33%	-7	-8	-9	-10	-10	-11	-12	
8.00%	-14	-15	-15	-16	-17	-18	-18	
KR4201S63554				2022-06 콜355				212
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	74	72	69	66	62	57	52	
-5.33%	68	64	59	54	48	41	34	
-2.67%	55	48	41	33	24	16	7	
0%	30	20	10	0	-10	-21	-31	
2.67%	-13	-24	-35	-47	-58	-69	-80	
5.33%	-75	-86	-96	-107	-118	-129	-140	
8.00%	-154	-163	-172	-181	-191	-201	-212	
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	13	13	14	14	
-5.33%	7	7	7	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	-1	-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%	2	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)

245

공시일	2022-05-17
기준일	2022-05-16

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	9,599	0	9,599	

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	2022-05-17
기준일	2022-05-16

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	7,319	0	7,319	

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	2022-05-17
기준일	2022-05-16

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	23,156	0	23,156	
누계	통화	선도	2,183	25,849	-23,666	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213C4MKRW/USD 27-06-22E	2,068
FXW213C4N USD/KRW 27-06-22E	123
FXW213C52 USD/KRW 27-06-22E	36
FXW213C5C USD/KRW 27-06-22E	15
IE00BD8RGM75	

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

768

공시일	2022-05-17
기준일	2022-05-16

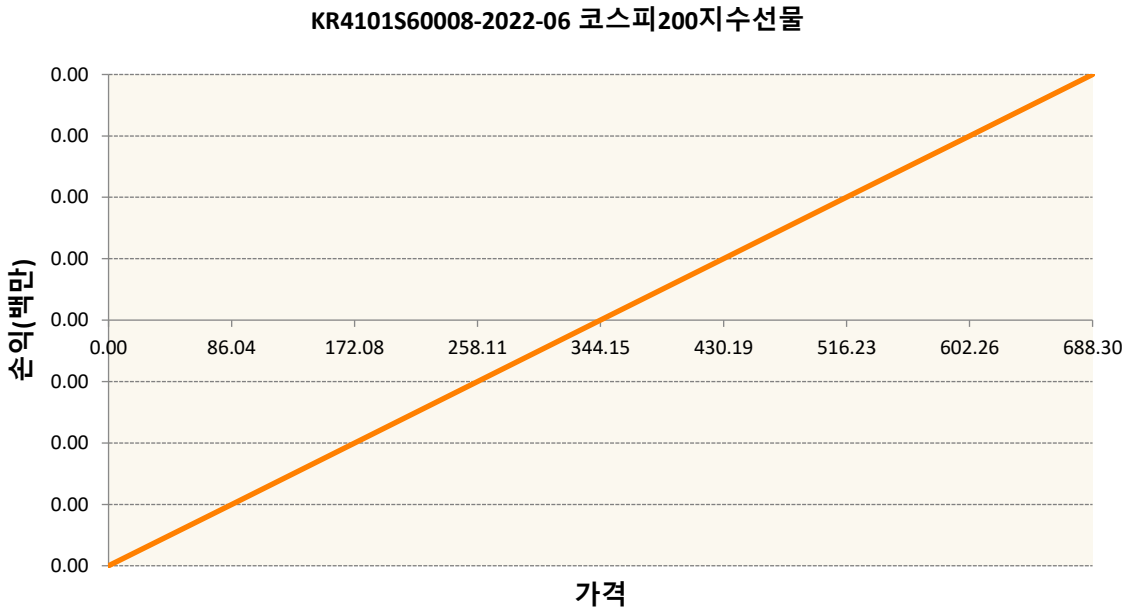
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

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	1,205	0	1,205	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 2022-05-17

기준일 2022-05-16

스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

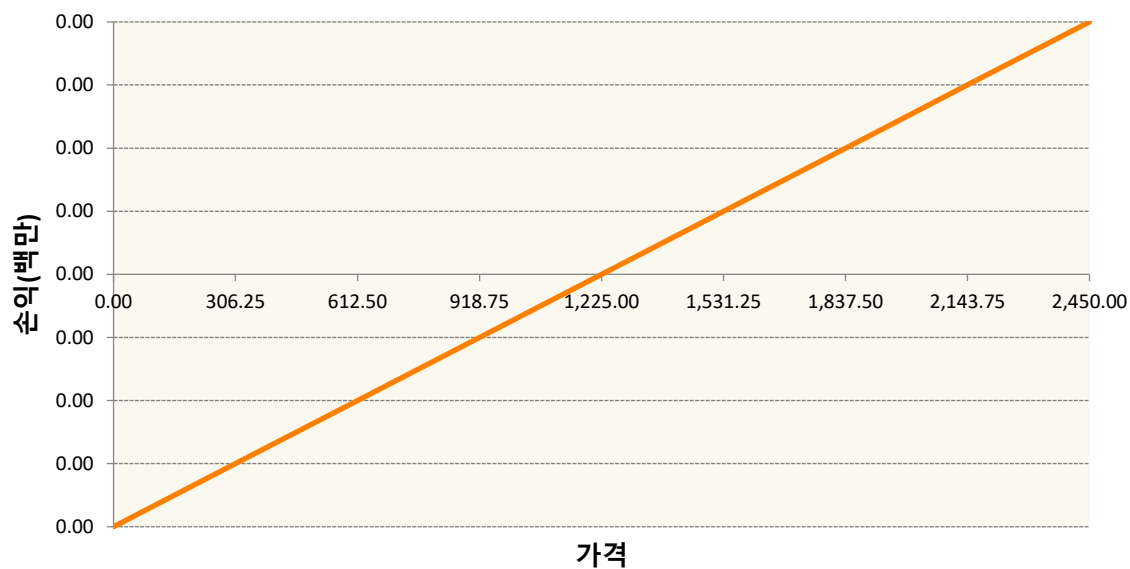
1. 계약금액

(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	631	0	631	
누계	유가증권	스왑	1,726	0	1,726	장외
누계	통화	선도	67	1,175	-1,108	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
VNCK2 VN30 Index Future May22	51

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

(단위:백만원)

공시일	2022-05-17
기준일	2022-05-16

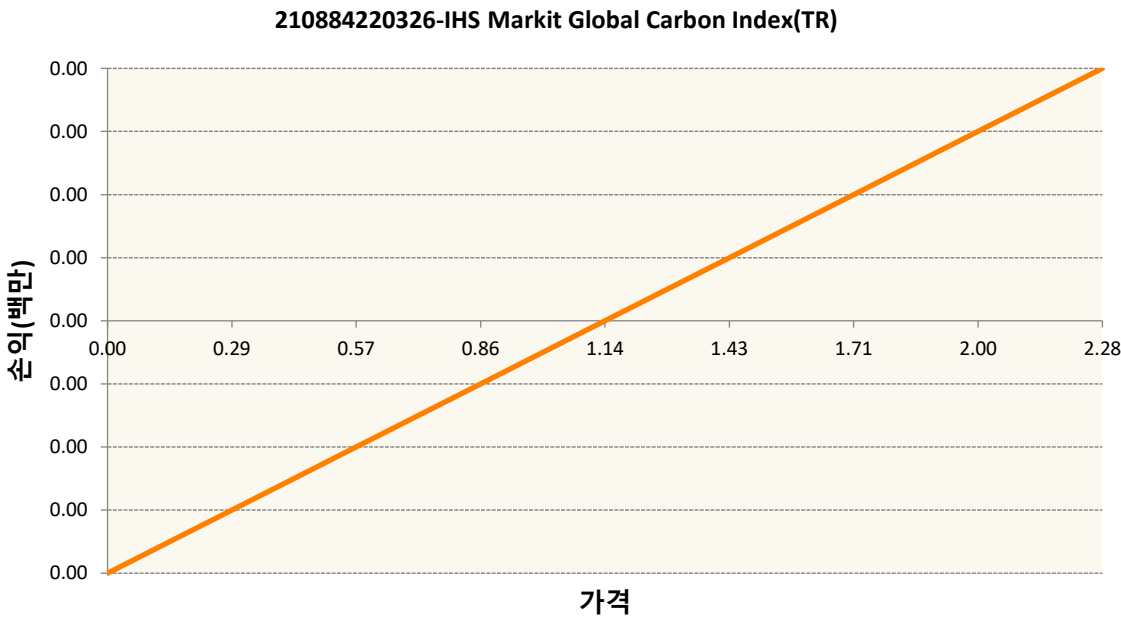
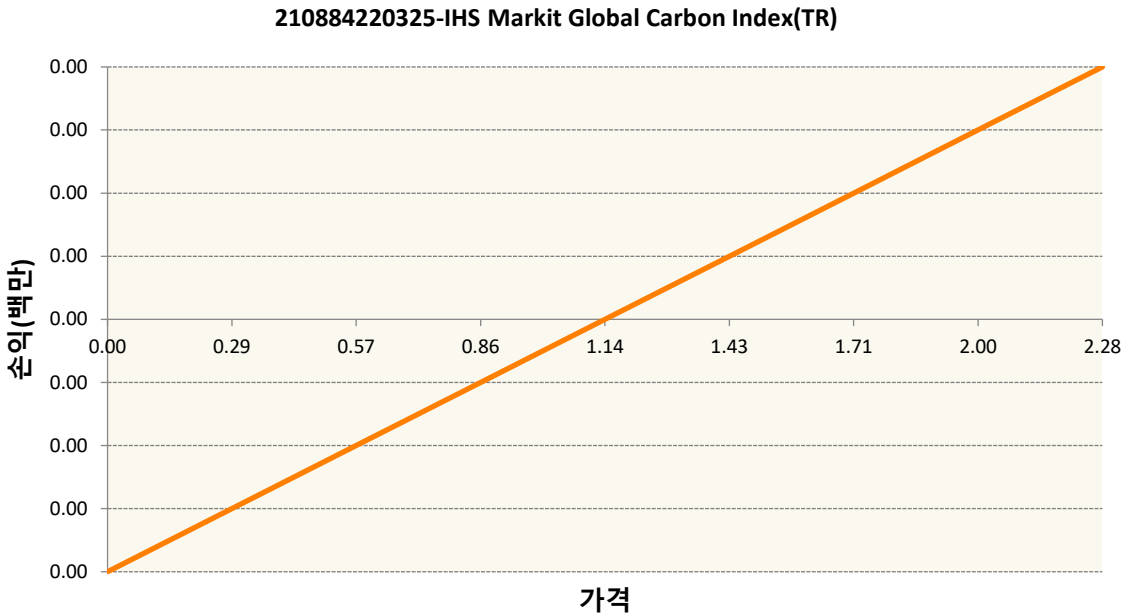
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

1. 계약금액

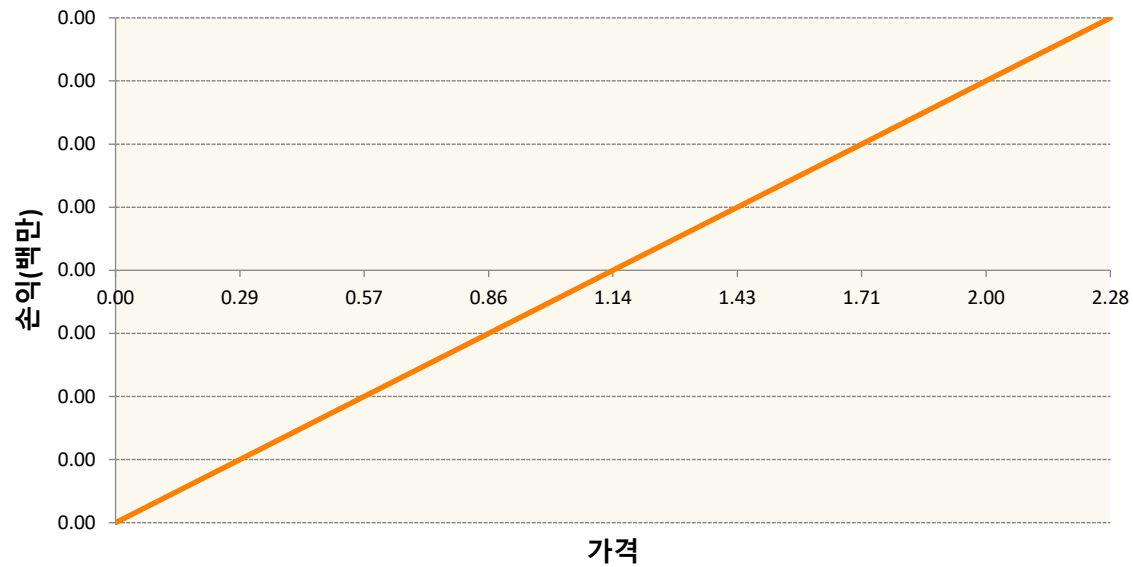
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	48,411	0	48,411	

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

205
3,570
102

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

(단위:백만원)

7,176

공시일 2022-05-17

기준일 2022-05-16

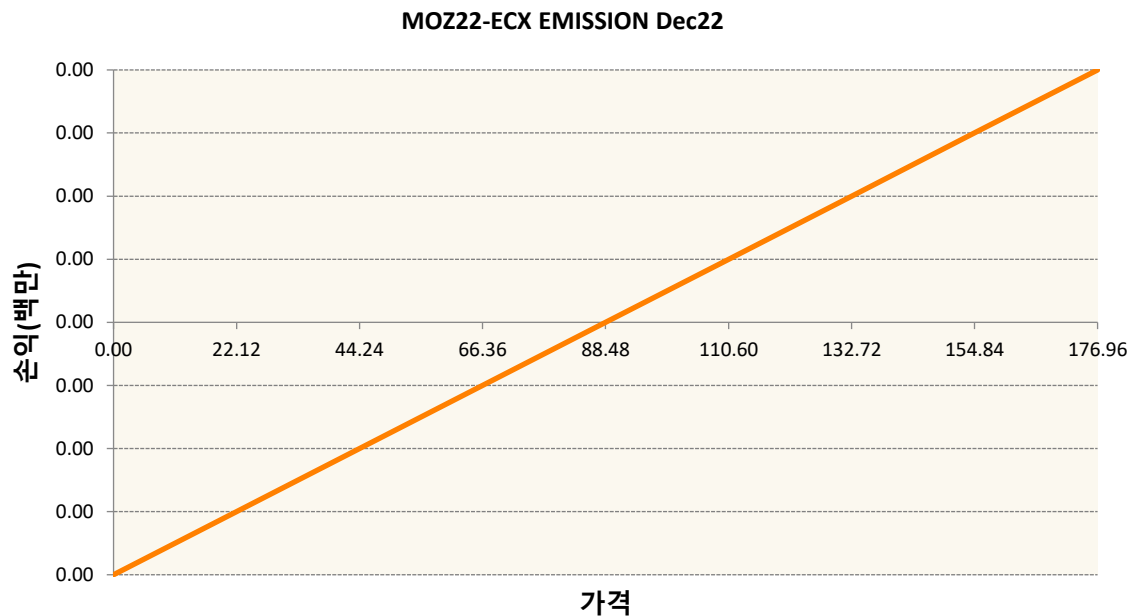
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	15,251	0	15,251	
누계	통화	선도	0	9,681	-9,681	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213C4R KRW/EUR 23-05-22E

774

MOZ22 ECX EMISSION Dec22

1,220

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

(단위:백만원)

3,358

공시일	2022-05-17
기준일	2022-05-16

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)	39
SWCSI00000 신한CSI Index 220323 (키움)	39
SWCSI00000 신한CSI Index 220323 (미래)	39
SWCSI00000 신한CSI Index 220323 (메리츠)	39

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

(단위:백만원)

303

공시일	2022-05-17
기준일	2022-05-16

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)

8

공시일	2022-05-17
기준일	2022-05-16

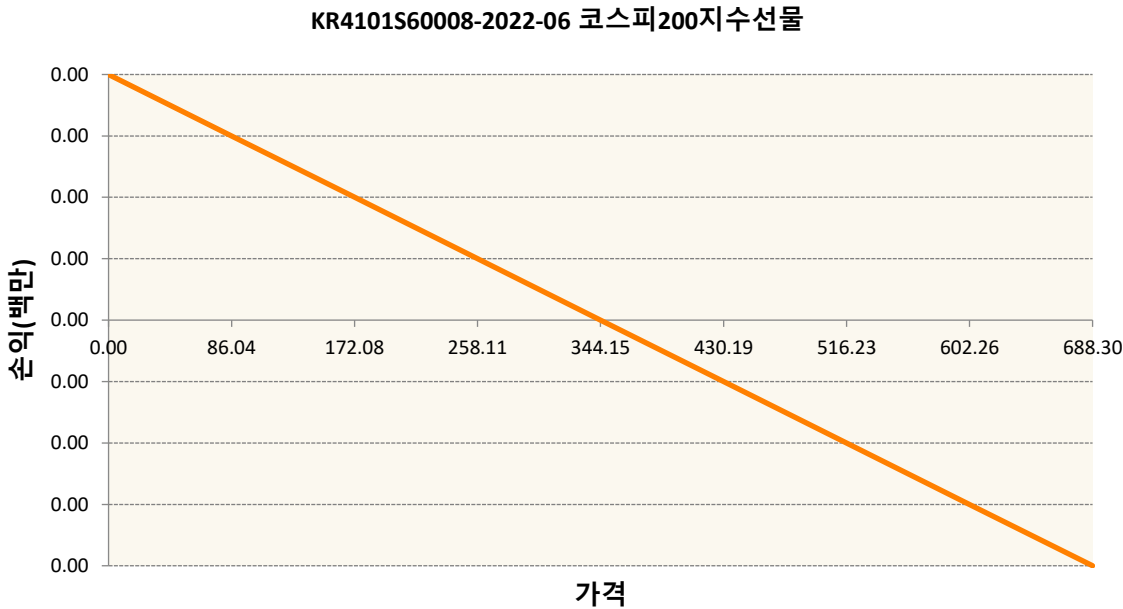
에퀴티알파일반사모혼합자산

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	2,151	-2,151	장내
누계	유가증권	스왑	0	0	0	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101S600 2022-06 코스피200지수선물	172
KRS0003014 SWAP_SPDR S&P O&G EXP_0322	2
KRS0003041 SWAP_MICRON TECH CORP_0331	0.17
KRS0003135 SWAP_MICROSOFT CP_0429	1

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

(단위:백만원)

167

공시일 2022-05-17

기준일 2022-05-16

신한SOL한국형글로벌반도체엑티

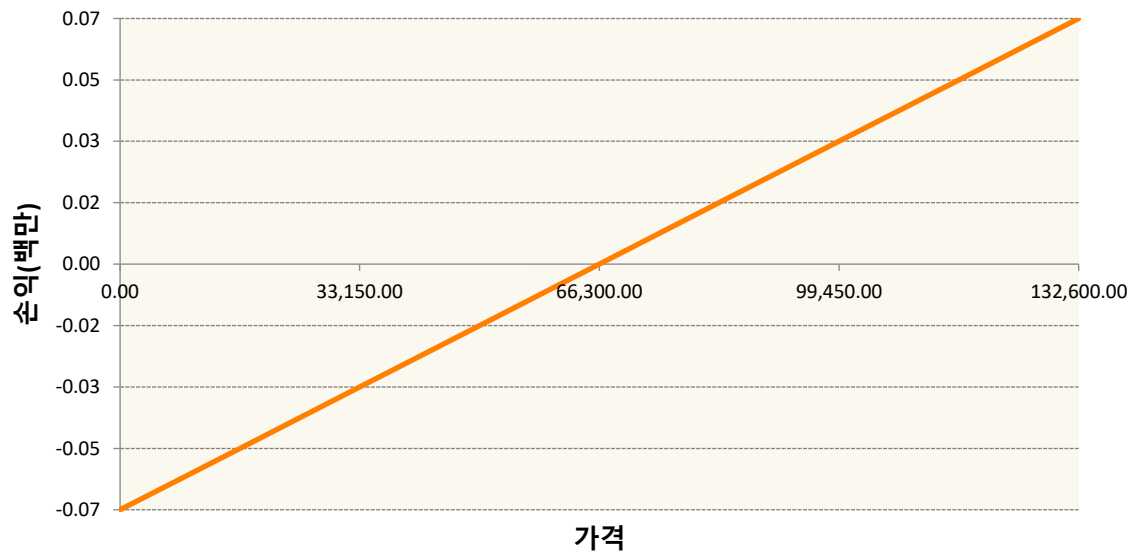
1. 계약금액

(단위:백만원)

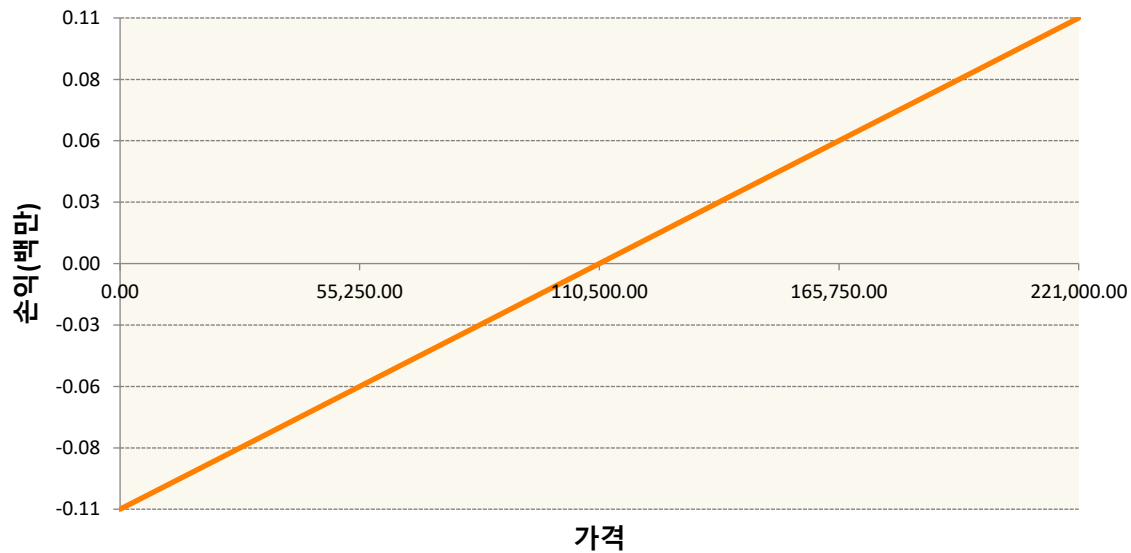
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	959	0	959	장내

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					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

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

83

공시일	2022-05-17
기준일	2022-05-16

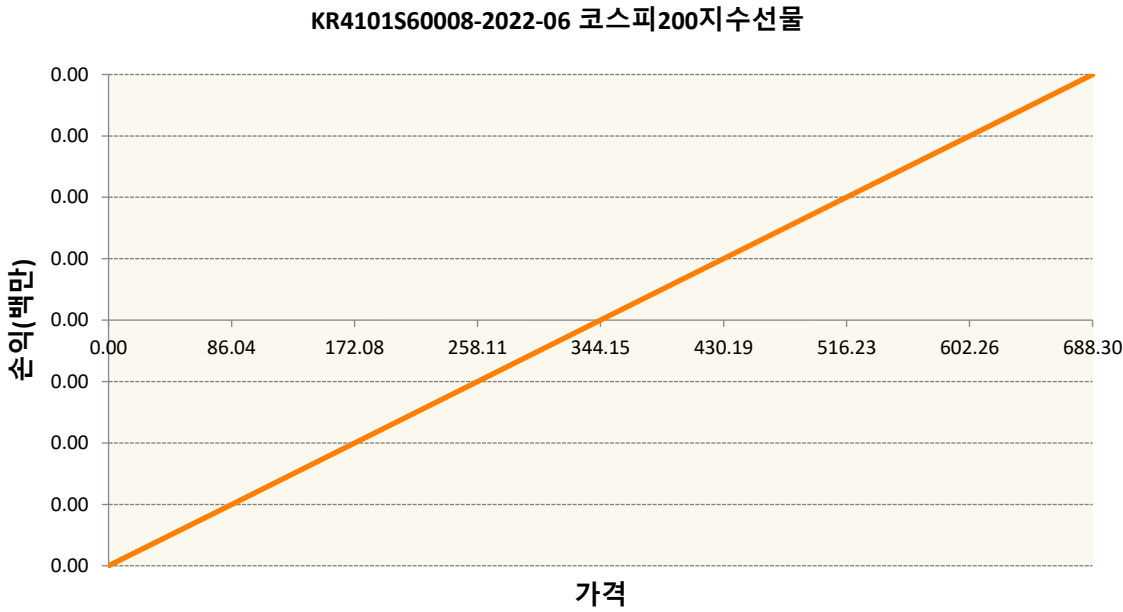
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

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	344	0	344	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%	-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%	28	28	28	28	28	28	28

공시일 2022-05-17

기준일 2022-05-16

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

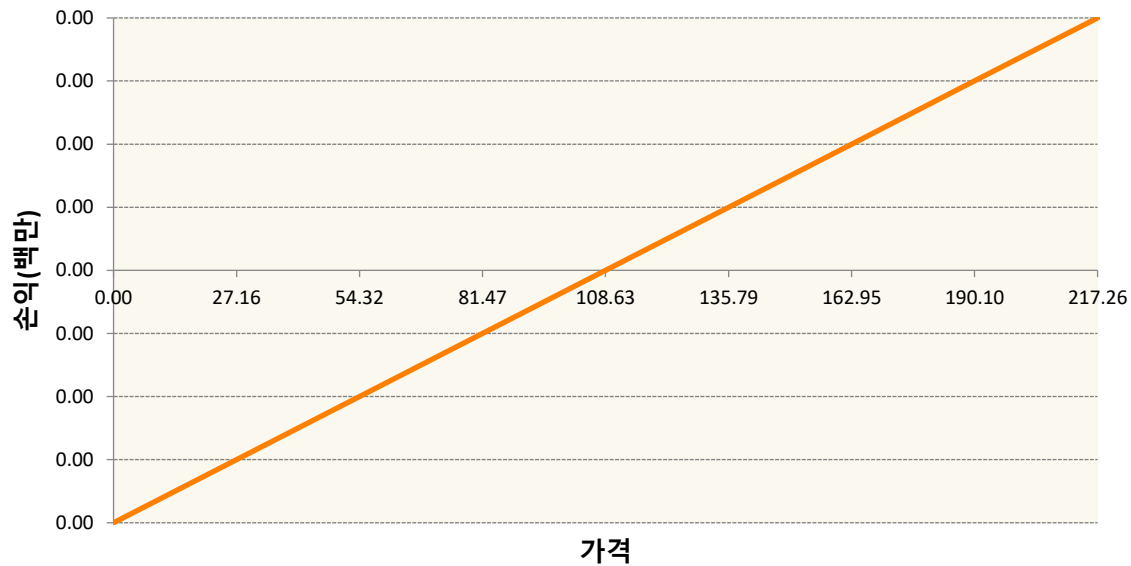
1. 계약금액

(단위:백만원)

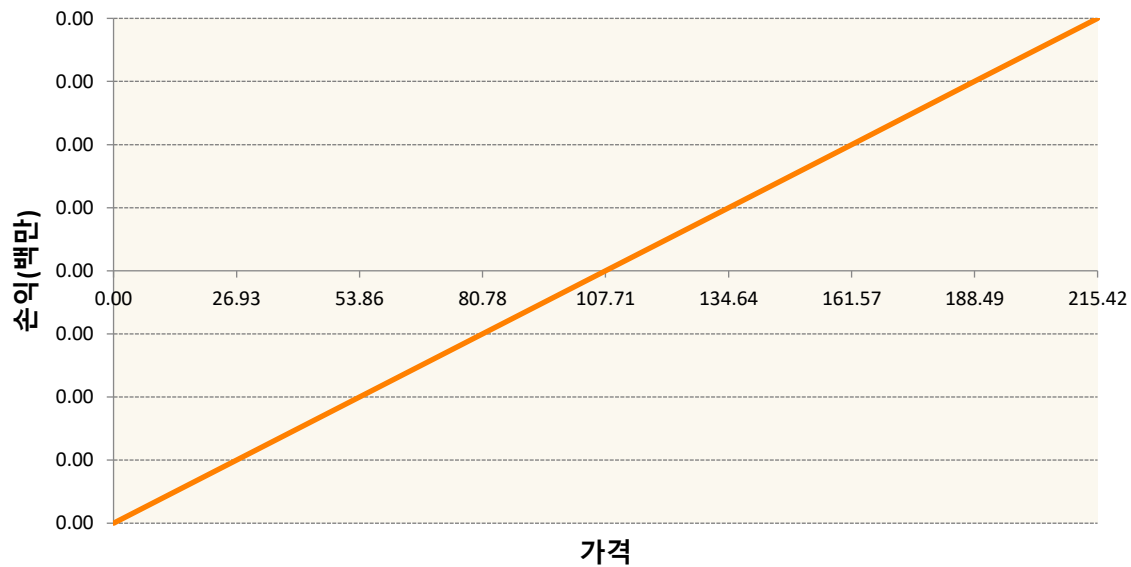
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,707	642	2,065	

2. 만기시점의 손익구조

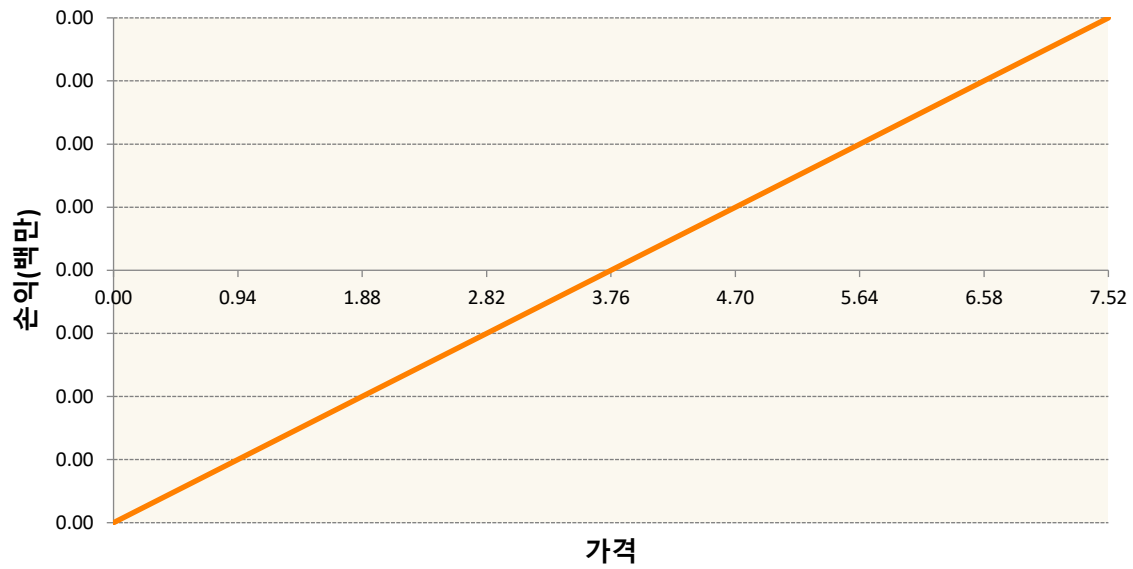
CLN2-WTI CRUDE FUTURE Jul22



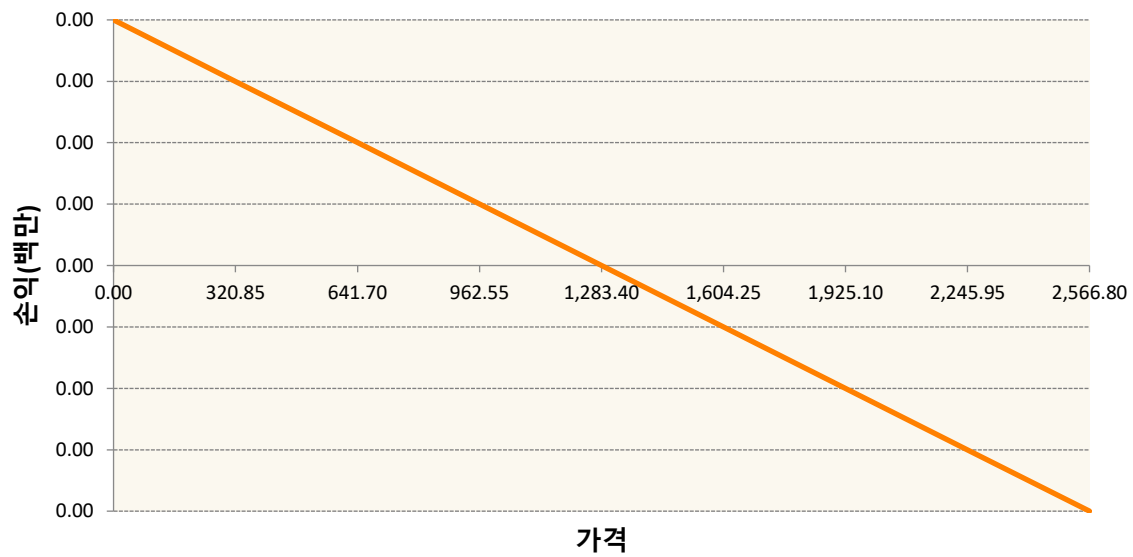
COU2-BRENT CRUDE FUTR Sep22



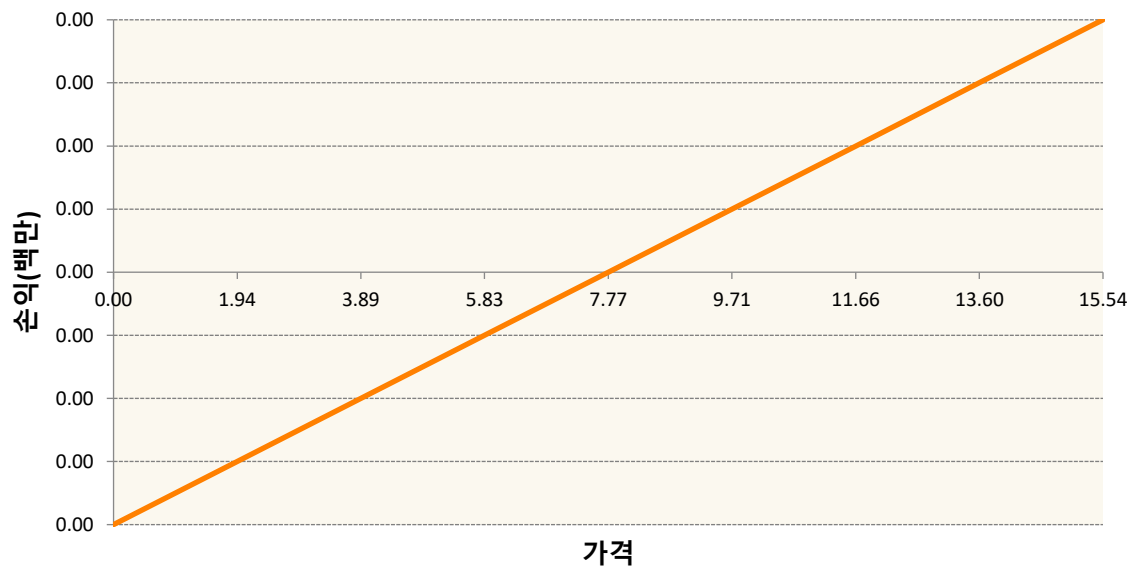
HON2-NY Harb ULSD Fut Jul22

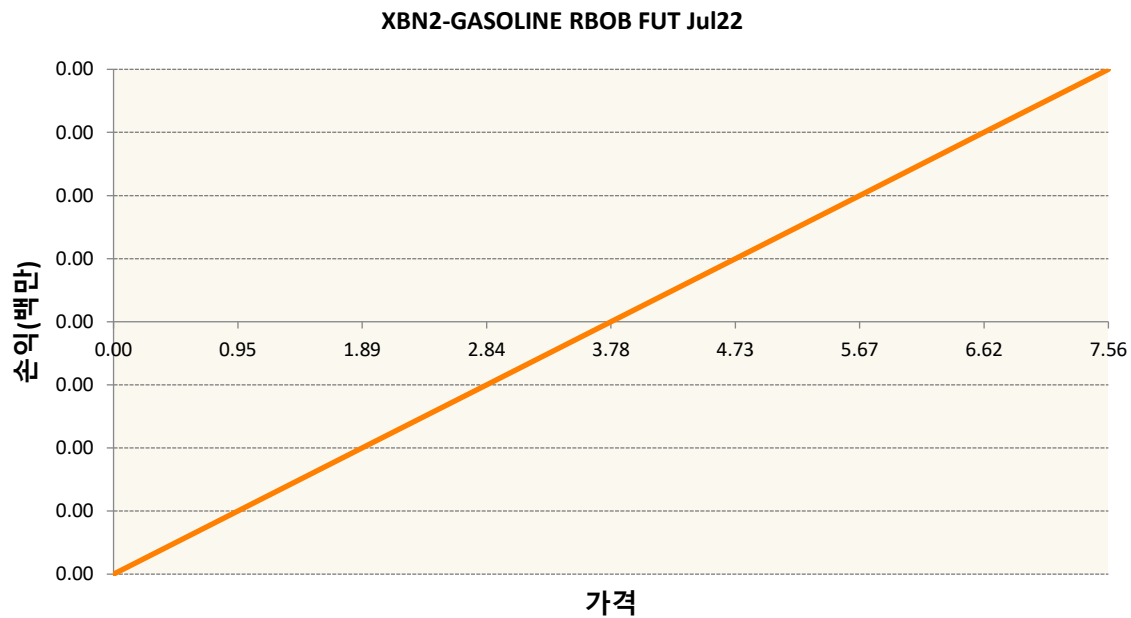
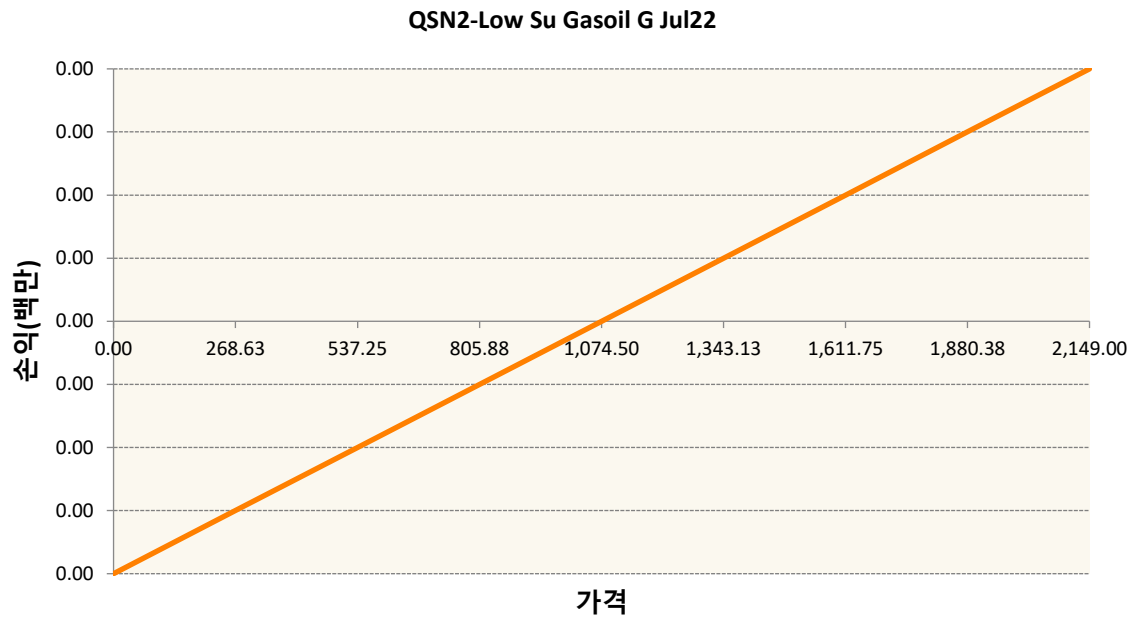


KR4175S60002-2022-06 달러선물



NGN22-NATURAL GAS FUTR Jul22





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
CLN2	WTI CRUDE FUTURE Jul22		43
COU2	BRENT CRUDE FUTR Sep22		44
HON2	NY Harb ULSD Fut Jul22		16
KR4175S600 2022-06 달러선물			51
NGN22	NATURAL GAS FUTR Jul22		77
QSN2	Low Su Gasoil G Jul22		21
XBN2	GASOLINE RBOB FUT Jul22		16

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)		(단위:백만원)
		641