

공시일 2022-05-24

기준일 2022-05-23

포커스농산물모(채권-파생형)

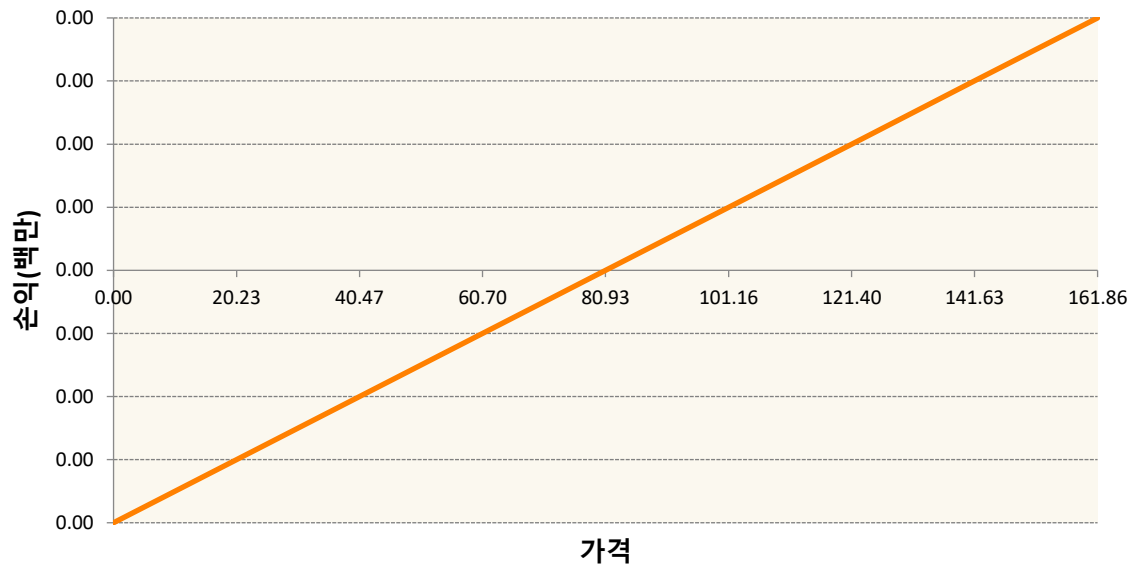
1. 계약금액

(단위:USD 백만)

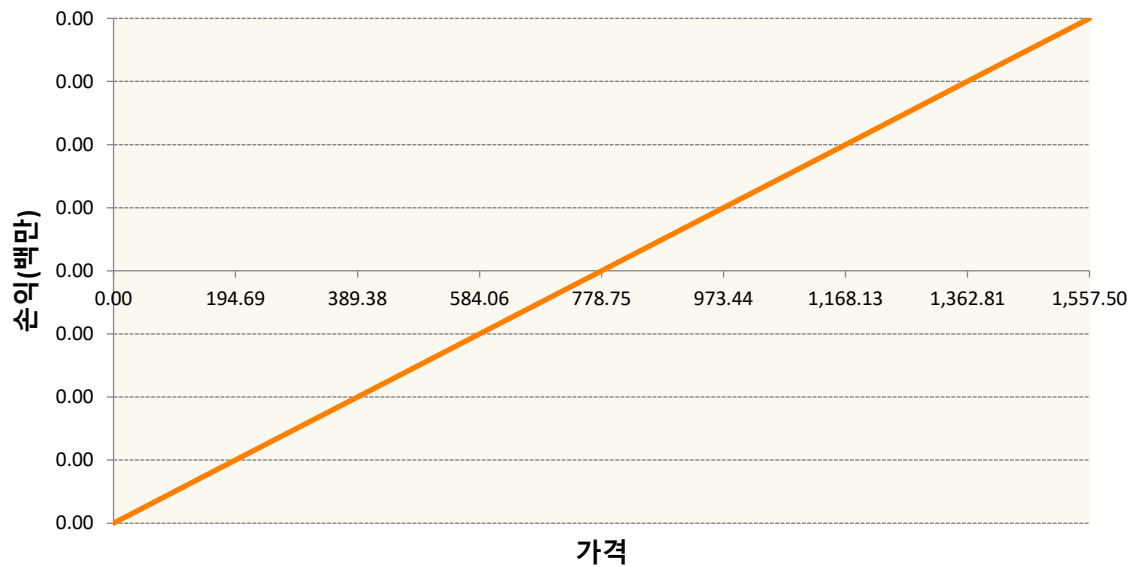
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	8,576	1,957	6,618	

2. 만기시점의 손익구조

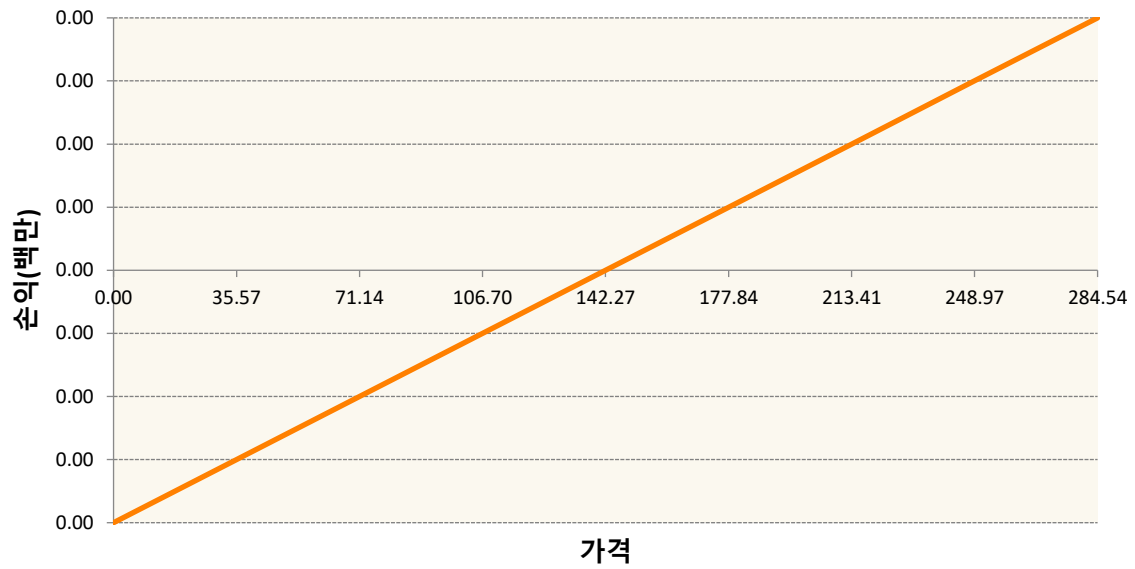
BON2-SOYBEAN OIL FUTR Jul22



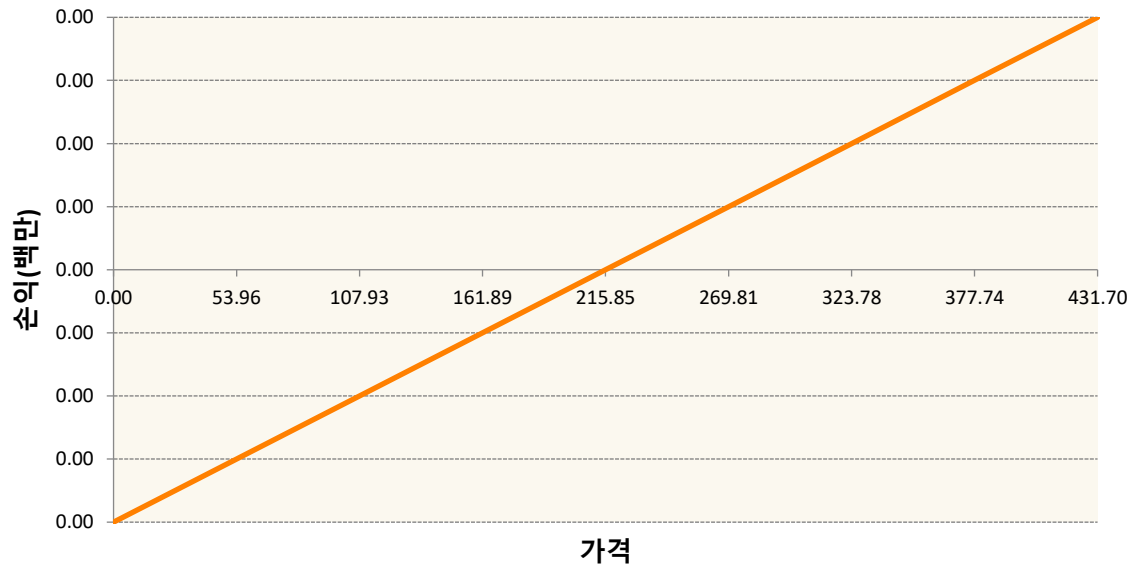
CN2-CORN FUTURE Jul22



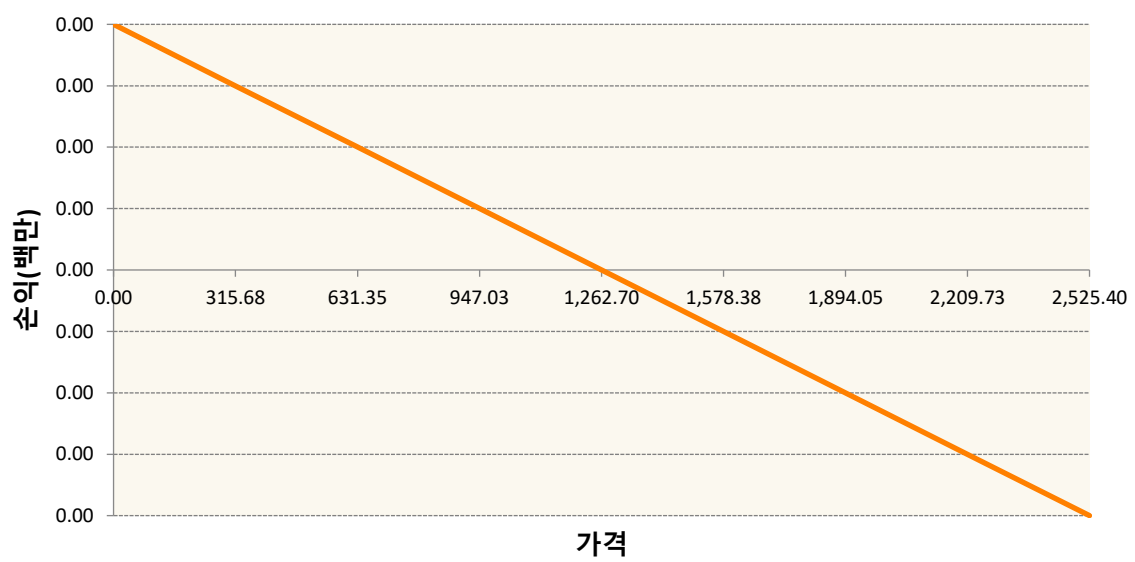
CTN2-COTTON NO.2 FUTR Jul22



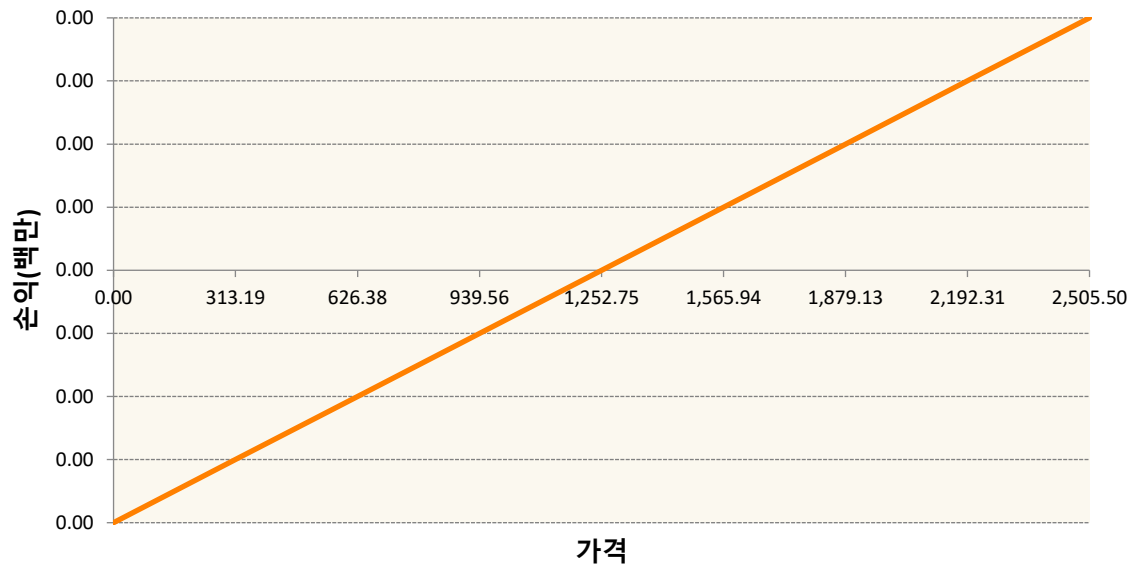
KCN2-COFFEE 'C' FUTURE Jul22



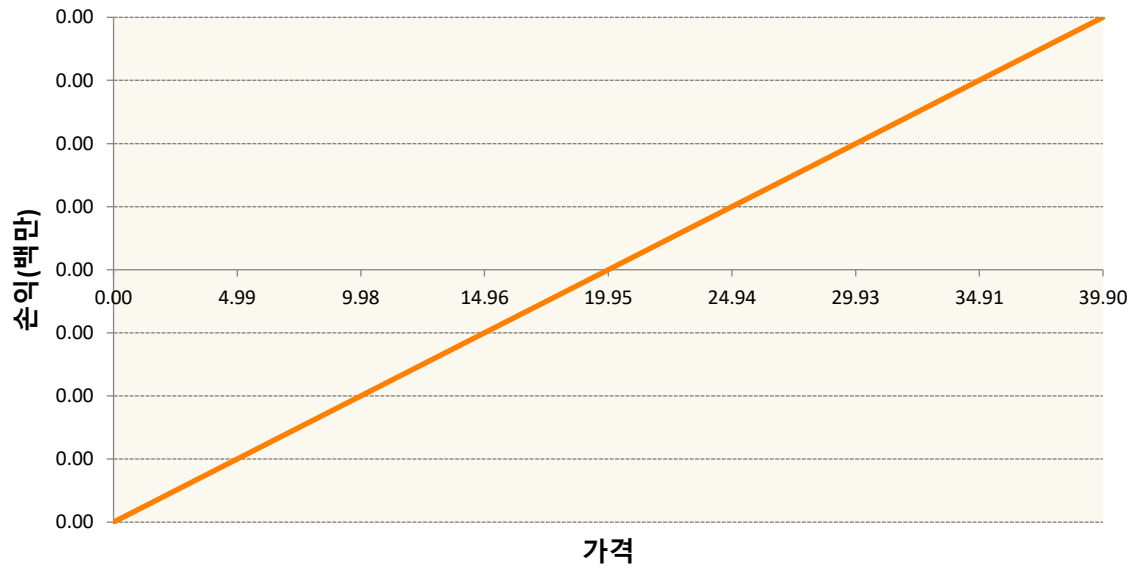
KR4175S60002-2022-06 달러선물



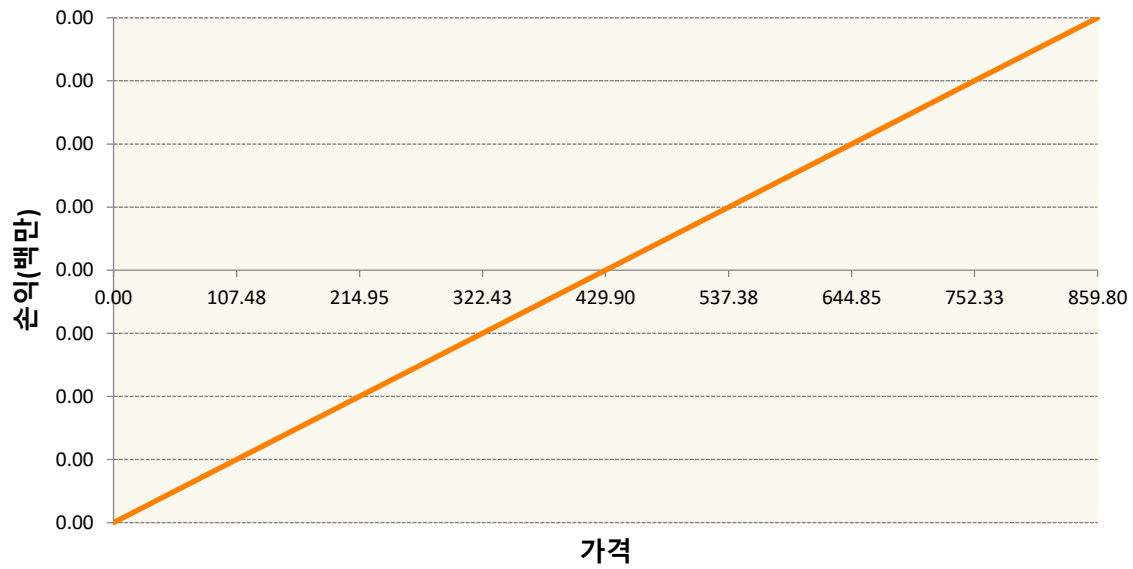
KWN2-KC HRW WHEAT FUT Jul22



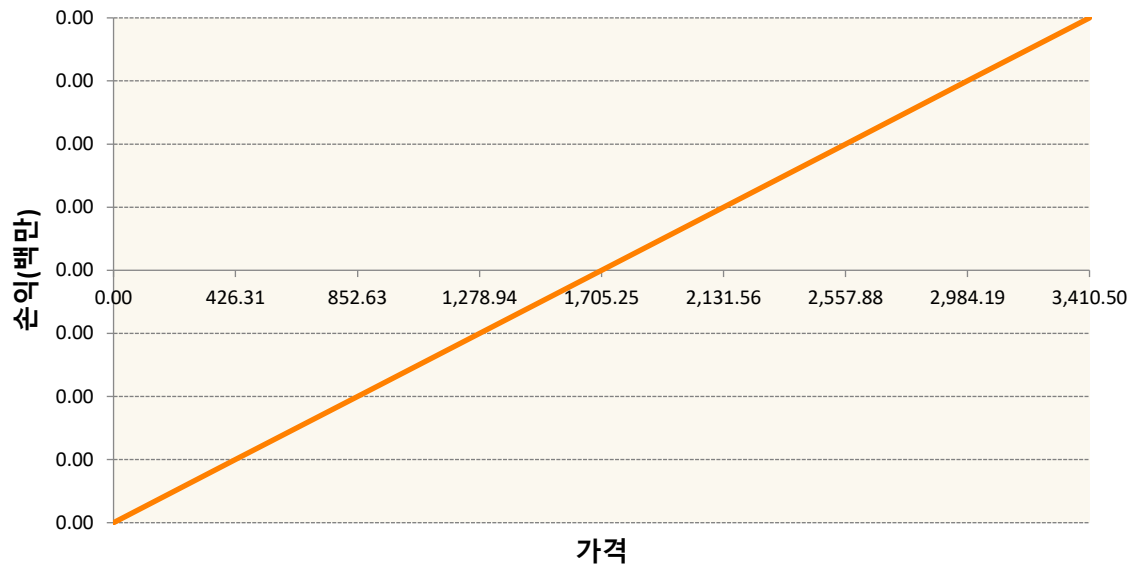
SBN2-Sugar #11 (WORLD) Jul22



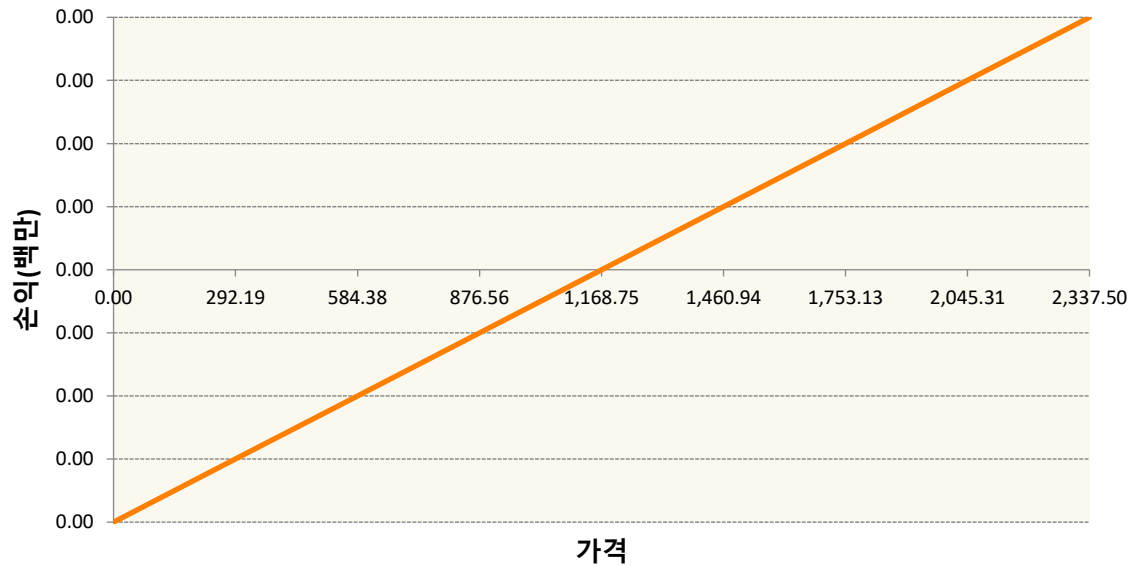
SMN2-SOYBEAN MEAL FUTR Jul22



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	2022-05-24
기준일	2022-05-23

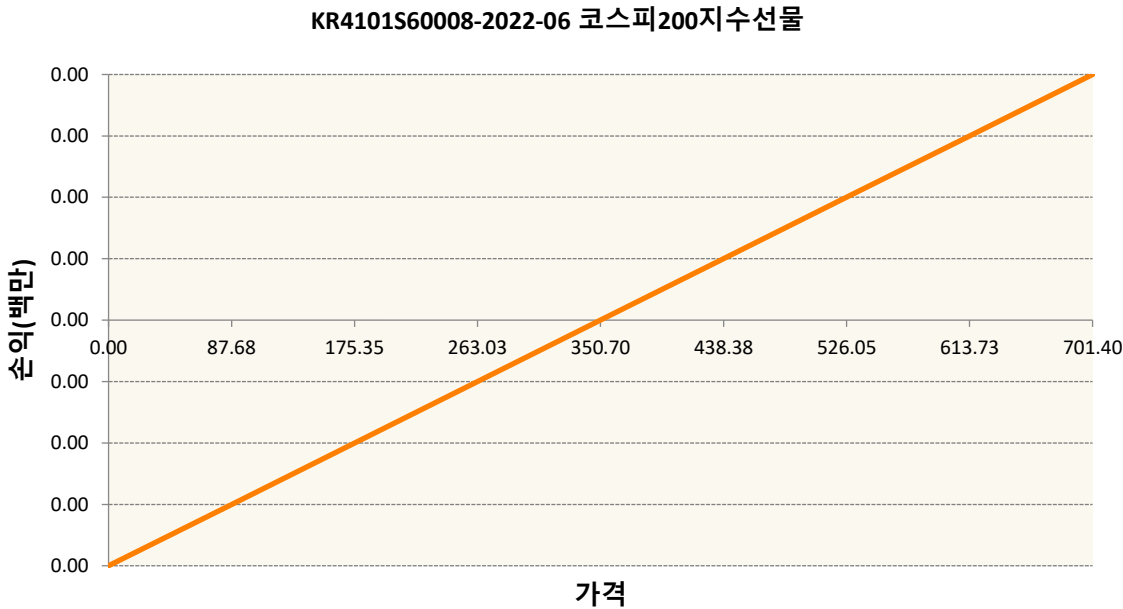
스마트인덱스모

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	701	0	701	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

공시일	2022-05-24
기준일	2022-05-23

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	349
-----------------------------	-----

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

434

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일 2022-05-24

기준일 2022-05-23

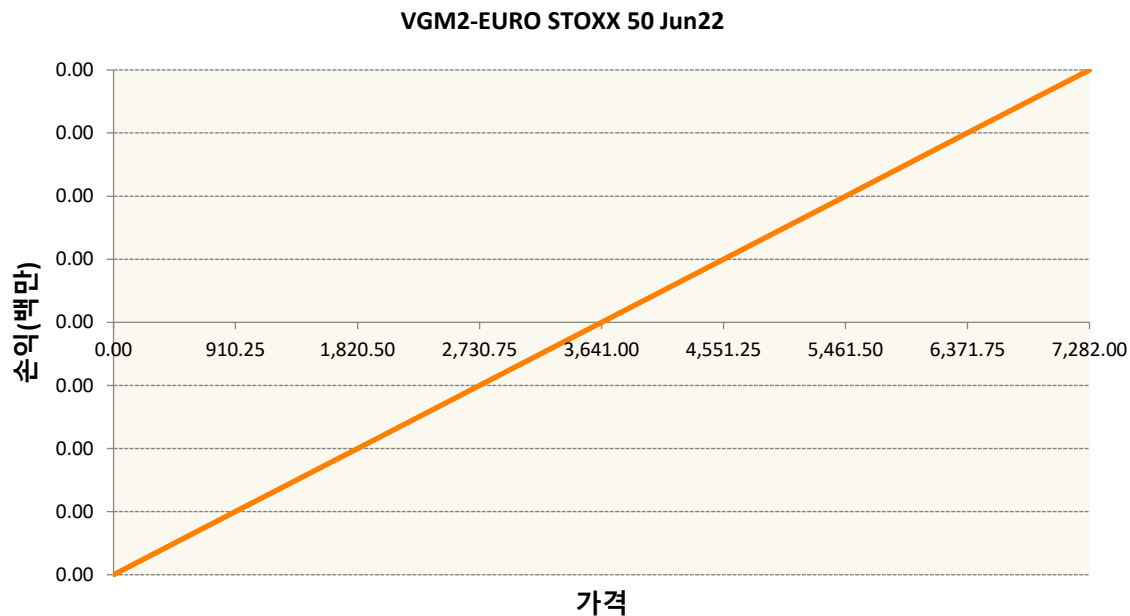
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	543	0	543	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM2	EURO STOXX 50 Jun22	43
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

42

공시일	2022-05-24
기준일	2022-05-23

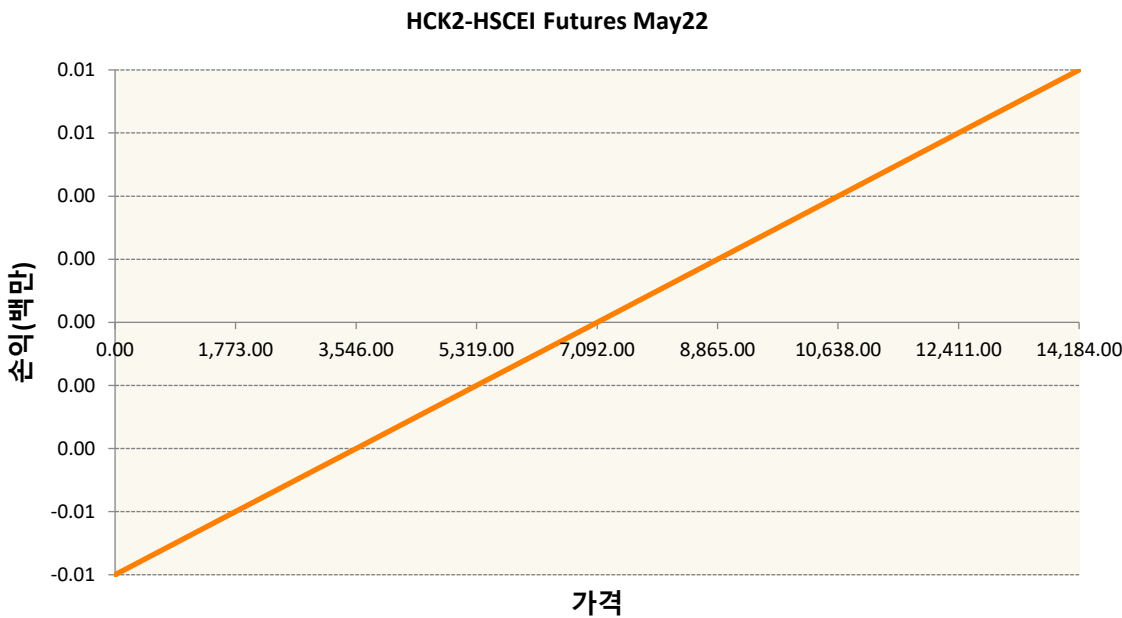
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,143	0	1,143	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

130

공시일	2022-05-24
기준일	2022-05-23

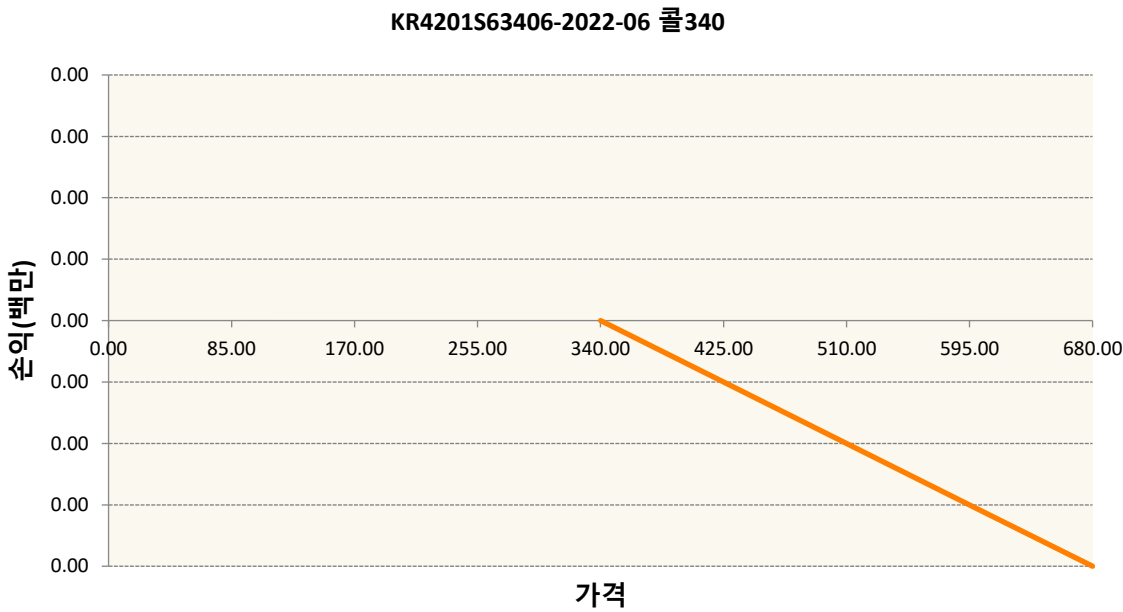
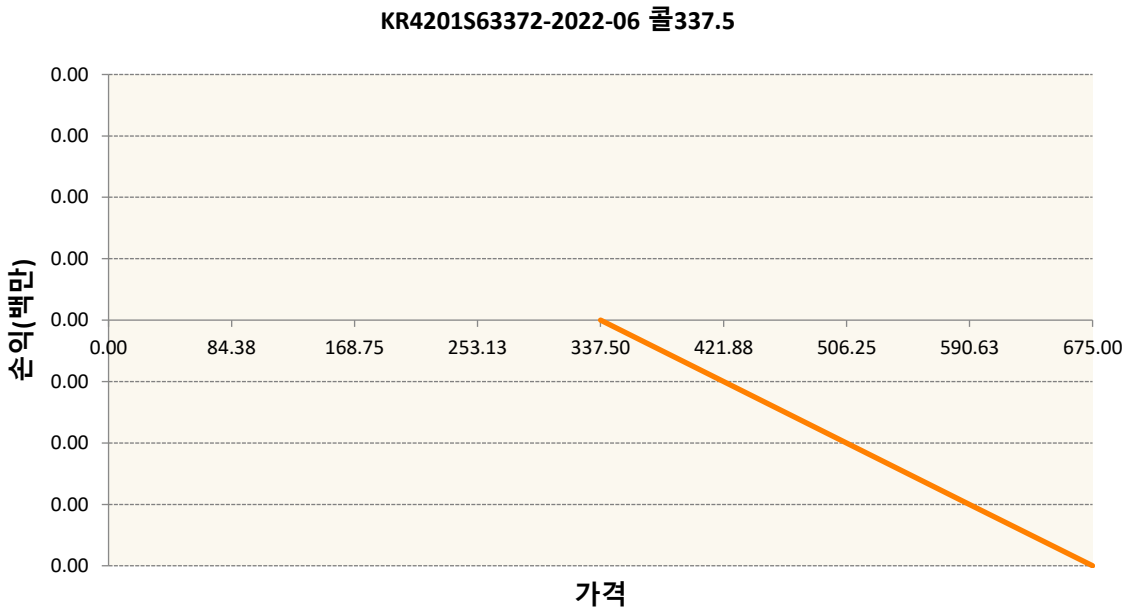
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

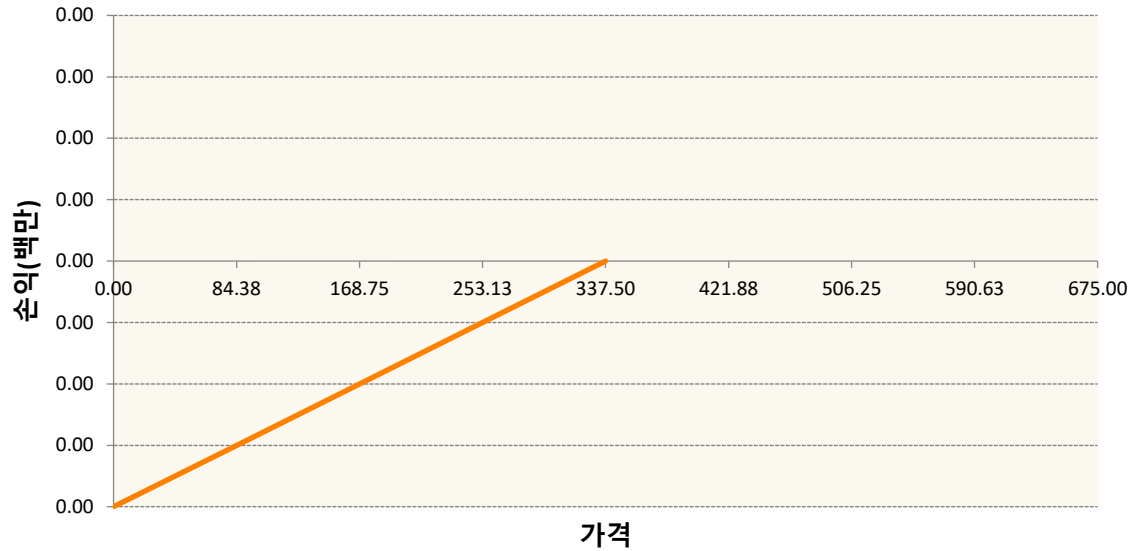
(단위:백만원)

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				3,021
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,836	1,779	1,717	1,652	1,584	1,514	1,442
-5.33%	1,534	1,452	1,370	1,286	1,202	1,118	1,034
-2.67%	994	908	821	735	648	561	474
0%	215	146	74	0	-77	-155	-234
2.67%	-743	-785	-833	-886	-944	-1,006	-1,071
5.33%	-1,801	-1,821	-1,848	-1,880	-1,919	-1,962	-2,010
8.00%	-2,903	-2,911	-2,923	-2,940	-2,962	-2,989	-3,021
KR4201S63406			2022-06 콜340				823
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	466	452	437	421	403	385	366
-5.33%	397	376	353	331	308	286	262
-2.67%	265	241	216	191	167	142	118
0%	65	44	22	0	-23	-45	-69
2.67%	-190	-204	-220	-236	-254	-273	-292
5.33%	-479	-486	-495	-506	-518	-532	-547
8.00%	-783	-786	-791	-797	-804	-813	-823
KR4301S63370			2022-06 풋337.5				531
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-479	-486	-493	-501	-511	-520	-531
-5.33%	-215	-229	-243	-258	-273	-288	-303
-2.67%	-43	-59	-74	-90	-106	-122	-138
0%	30	21	11	0	-12	-24	-37

2.67%	49	46	42	37	31	24	17
5.33%	52	51	50	49	46	43	40
8.00%	52	52	52	51	51	50	48

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

(단위:백만원)

4,387

공시일	2022-05-24
기준일	2022-05-23

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	10	0	10	장외
누계	통화	선도	0	1,474	-1,474	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY	26
FXW213C2F KRW/EUR 27-05-22E	21
FXW213C38 KRW/EUR 27-05-22E	64
FXW213C4L KRW/EUR 24-06-22E	32

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

(단위:백만원)

110

공시일 2022-05-24

기준일 2022-05-23

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

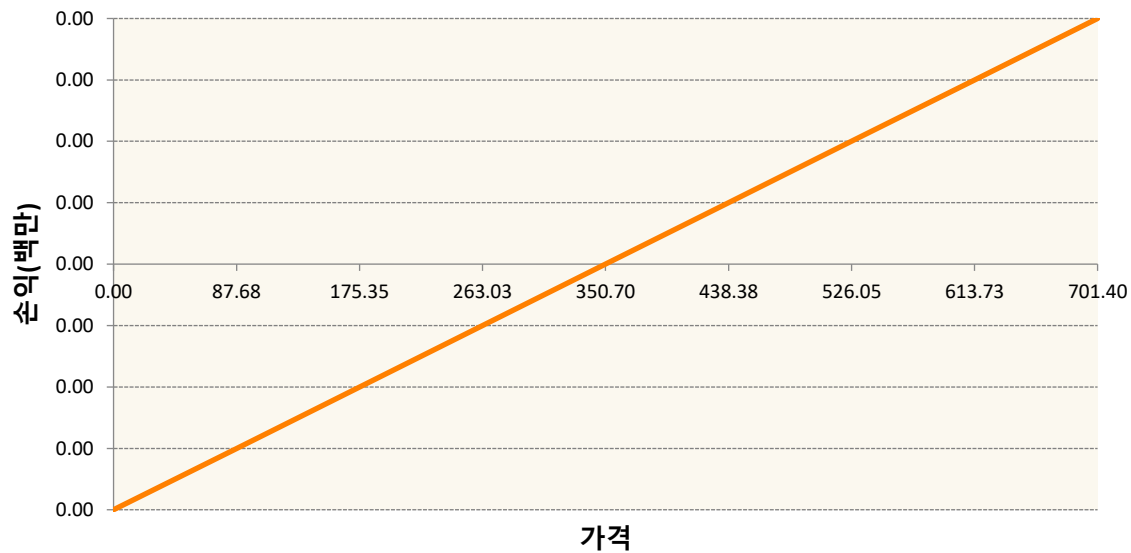
1. 계약금액

(단위:백만원)

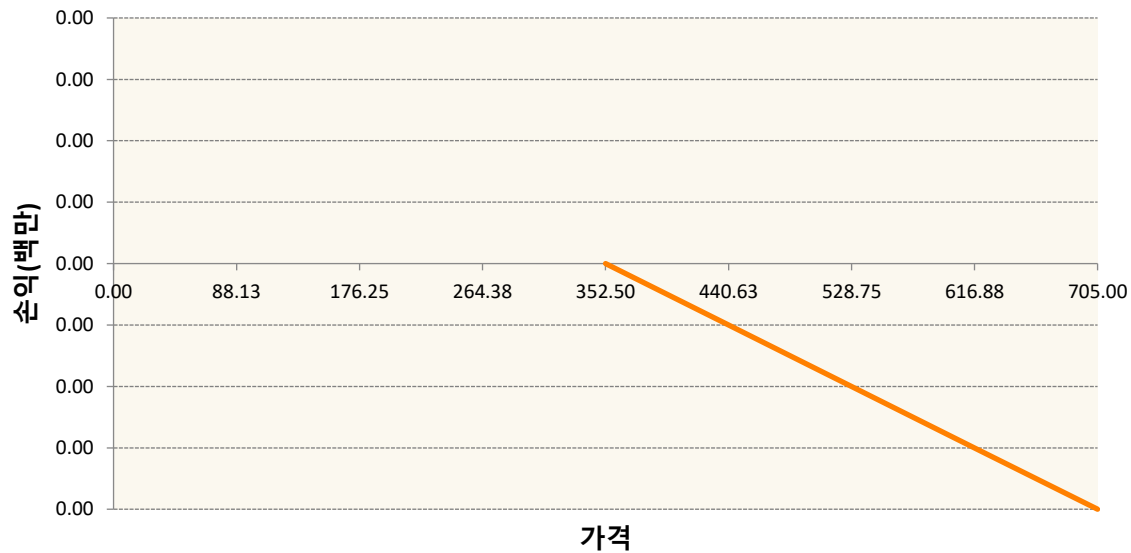
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	526	0	526	장내
누계	유가증권	옵션	338	4,613	-4,274	장내

2. 만기시점의 손익구조

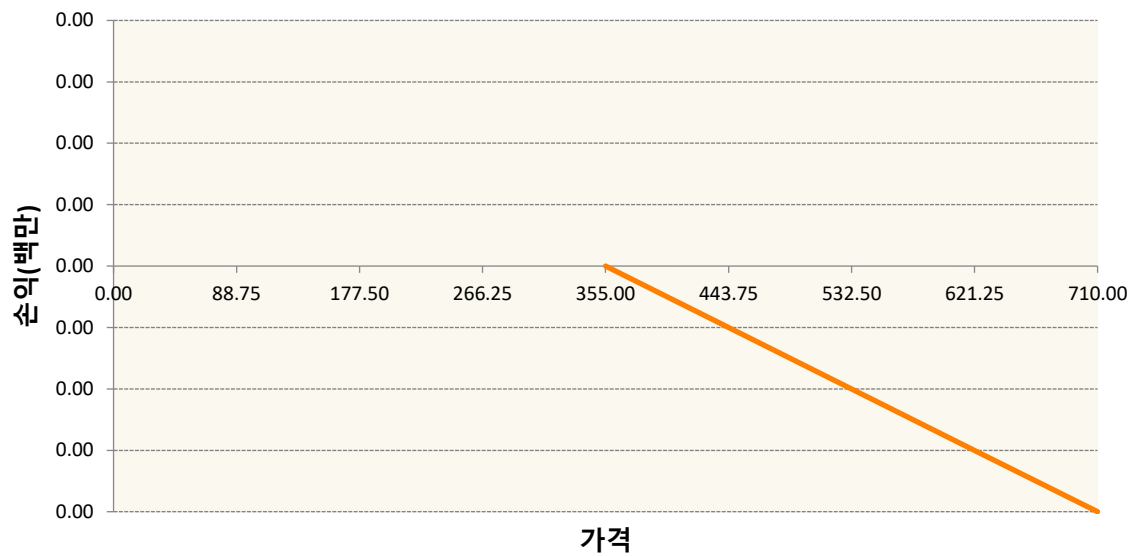
KR4101S60008-2022-06 코스피200지수선물



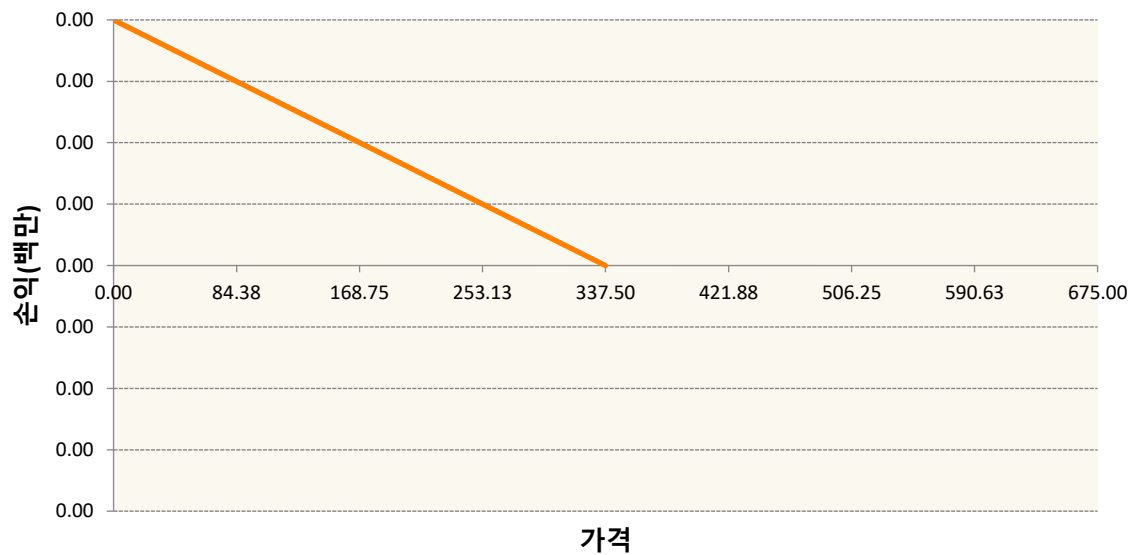
KR4201S63521-2022-06 콜352.5



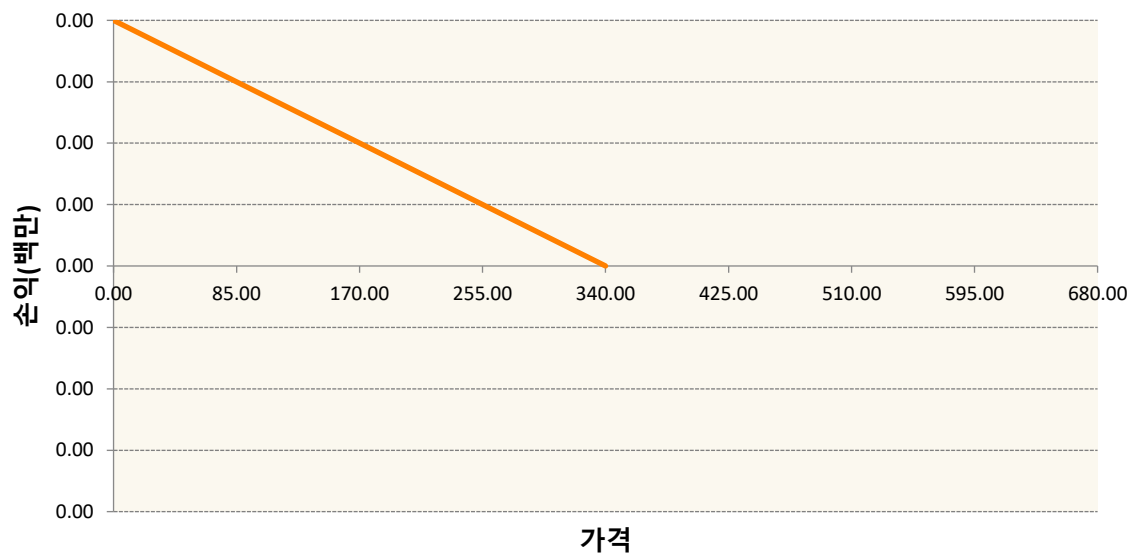
KR4201S63554-2022-06 콜355



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		21	
	기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%		
-8.00%	8	8	7	7	7	7	6		
-5.33%	7	7	6	6	5	5	4		
-2.67%	6	5	4	4	3	2	2		
0%	2	2	1	0	-1	-2	-2		
2.67%	-3	-4	-4	-5	-6	-7	-7		
5.33%	-10	-11	-11	-12	-12	-13	-14		
8.00%	-18	-19	-19	-19	-20	-20	-21		
KR4201S63554						2022-06 콜355		240	
	기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%		
-8.00%	82	81	79	76	73	69	65		
-5.33%	76	73	68	64	58	52	46		
-2.67%	61	54	47	40	32	24	16		
0%	27	18	9	0	-9	-18	-27		
2.67%	-30	-39	-48	-57	-67	-76	-85		
5.33%	-110	-117	-124	-132	-140	-148	-156		
8.00%	-206	-210	-215	-221	-227	-233	-240		
KR4301S63370						2022-06 풋337.5		12	
	기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%		
-8.00%	10	11	11	11	11	11	12		
-5.33%	5	5	5	6	6	6	7		
-2.67%	1	1	2	2	2	3	3		
0%	-1	0	0	0	0	1	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		4	
	기초자산의 변동성								

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

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

(단위:백만원)

291

공시일	2022-05-24
기준일	2022-05-23

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	9,527	0	9,527	

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	2022-05-24
기준일	2022-05-23

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	7,264	0	7,264	

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	2022-05-24
기준일	2022-05-23

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	22,719	0	22,719	
누계	통화	선도	2,339	25,446	-23,108	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213C4MKRW/USD 27-06-22E	2,036
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)

767

공시일	2022-05-24
기준일	2022-05-23

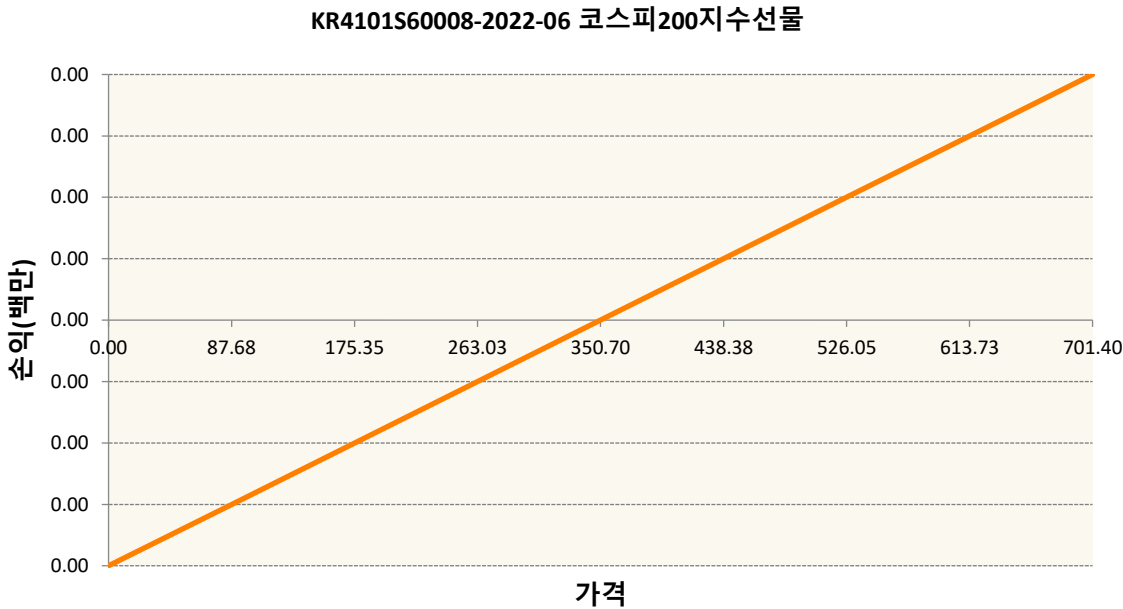
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

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	1,140	0	1,140	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101S60008			2022-06 코스피200지수선물				91
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-91	-91	-91	-91	-91	-91	-91
-5.33%	-61	-61	-61	-61	-61	-61	-61
-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%	61	61	61	61	61	61	61
8.00%	91	91	91	91	91	91	91

공시일 2022-05-24

기준일 2022-05-23

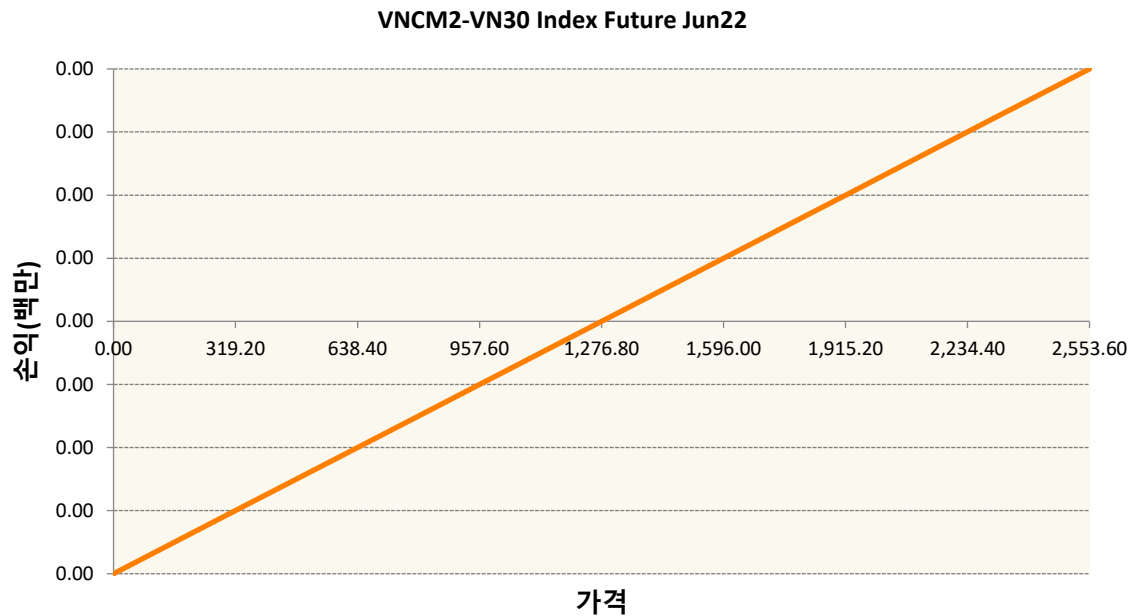
스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

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	749	0	749	
누계	유가증권	스왑	1,733	0	1,733	장외
누계	통화	선도	0	979	-979	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2.5504E+11 VN30TR Index(EUR)	139
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	60

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

(단위:백만원)

270

공시일	2022-05-24
기준일	2022-05-23

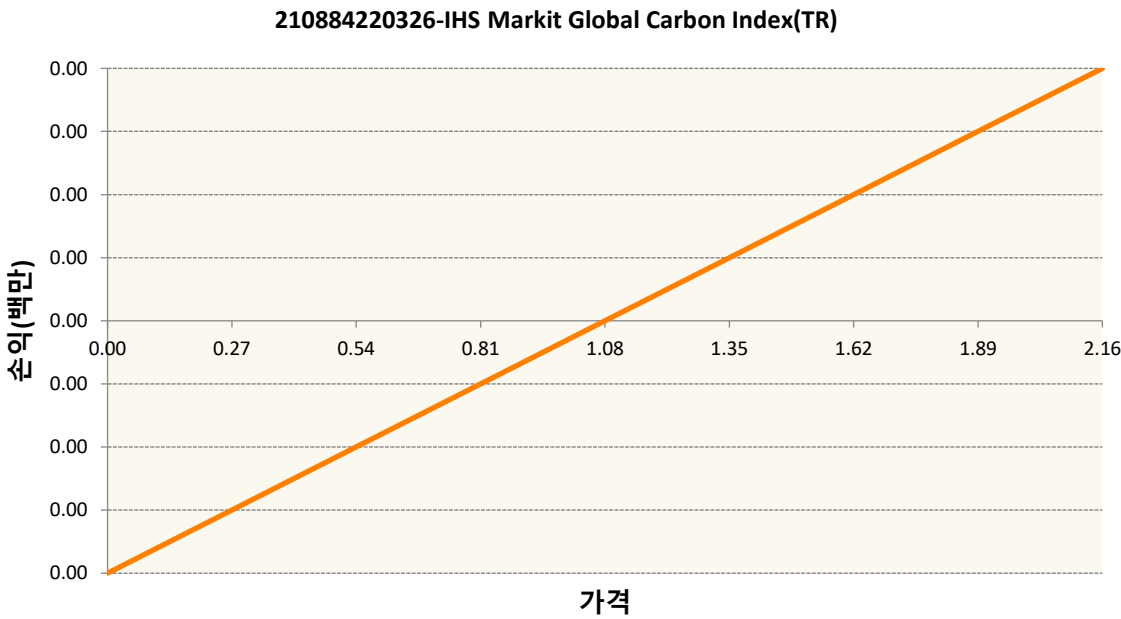
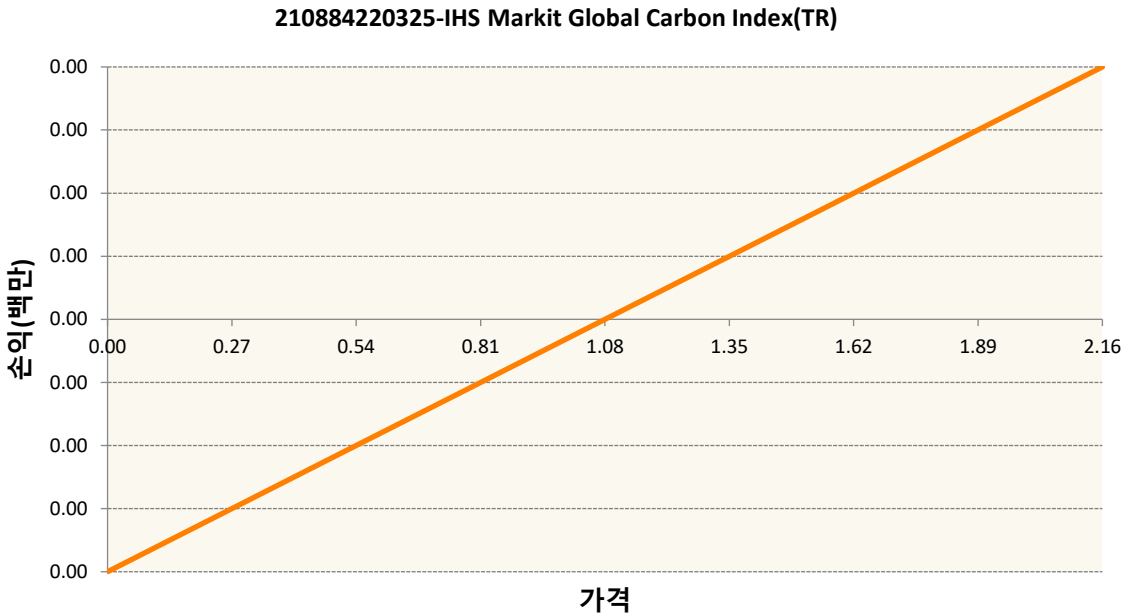
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

1. 계약금액

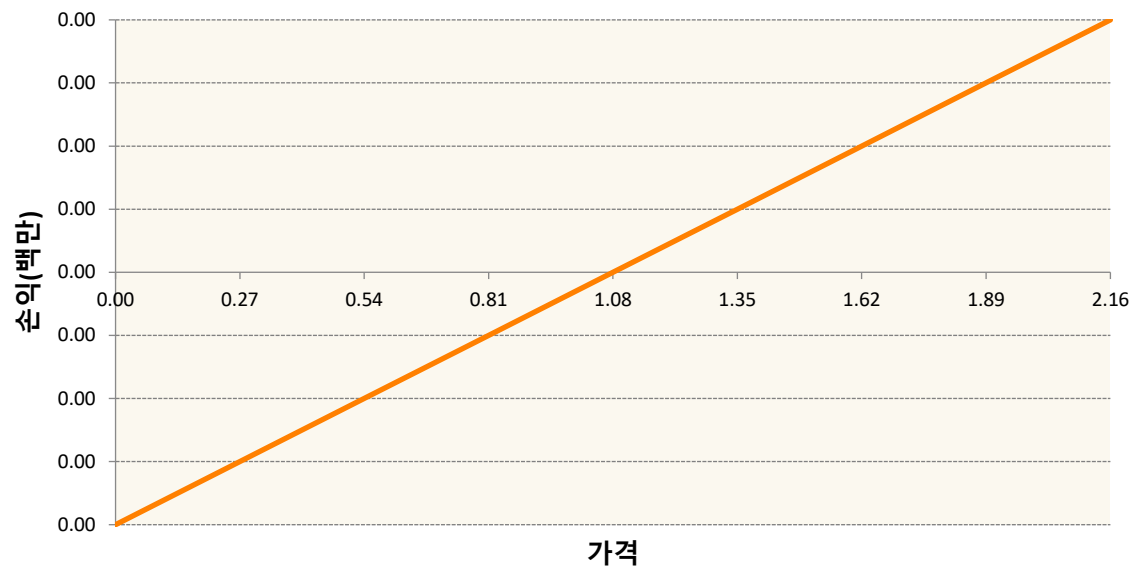
(단위:백만원)

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)

3,364

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

96

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

(단위:백만원)

6,806

공시일 2022-05-24

기준일 2022-05-23

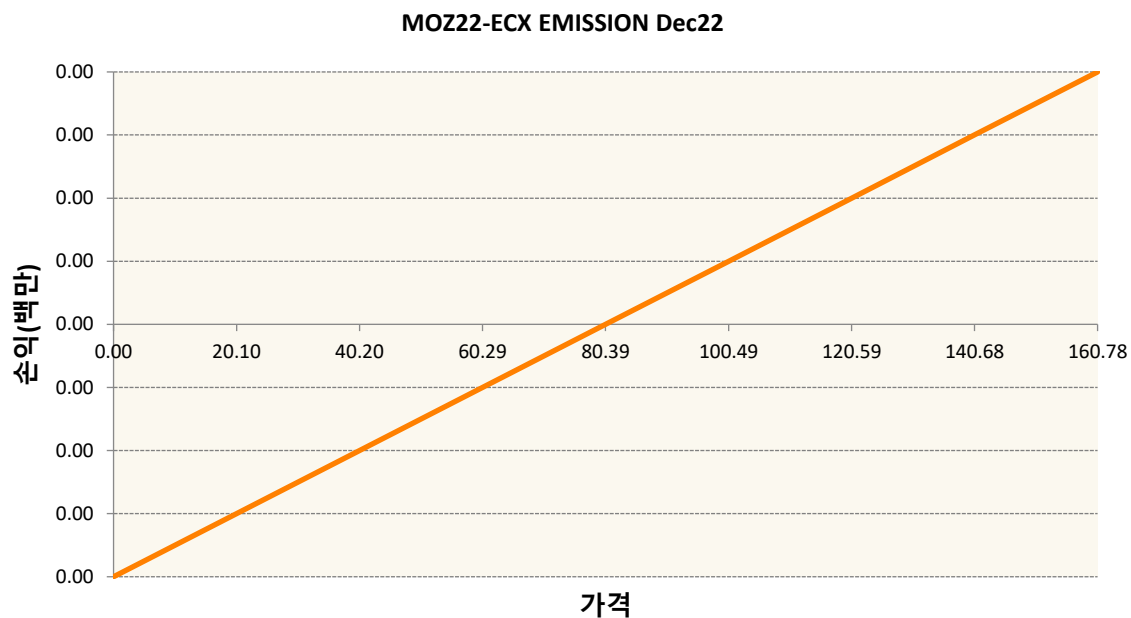
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	13,876	0	13,876	
누계	통화	선도	0	7,909	-7,909	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213C5P KRW/EUR 27-06-22E

633

MOZ22 ECX EMISSION Dec22

1,110

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

(단위:백만원)

3,057

공시일	2022-05-24
기준일	2022-05-23

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)	19
SWCSI00000 신한CSI Index 220323 (키움)	19
SWCSI00000 신한CSI Index 220323 (미래)	19
SWCSI00000 신한CSI Index 220323 (메리츠)	19

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

(단위:백만원)

147

공시일	2022-05-24
기준일	2022-05-23

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)	5
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220113(미래)	6
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220113(메리츠)	5
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220113(NH)	5
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220426(메리츠)	3

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

(단위:백만원)

33

공시일 2022-05-24

기준일 2022-05-23

에쿼티알파일반사모혼합자산

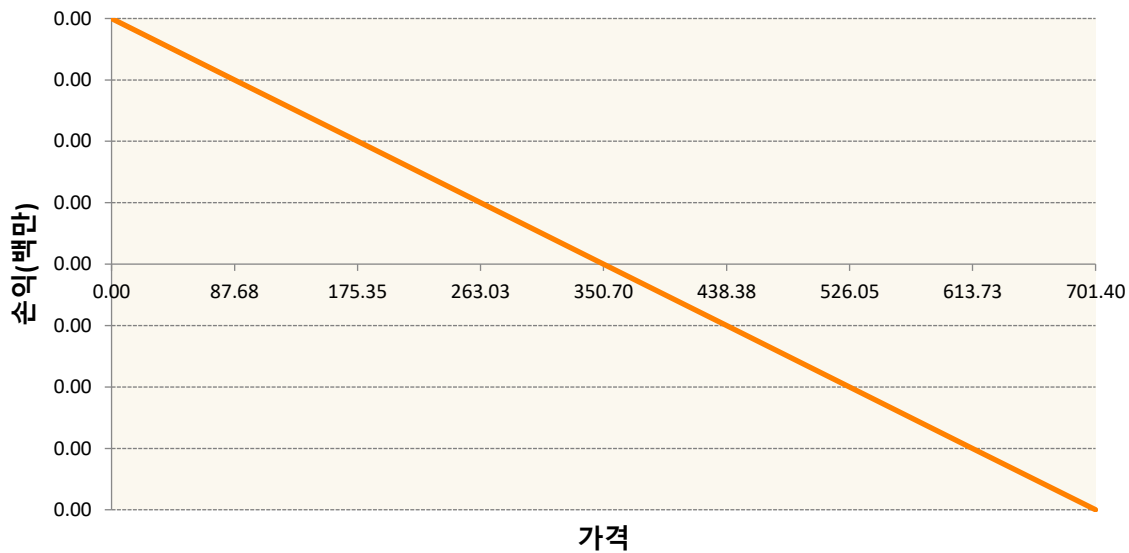
1. 계약금액

(단위:백만원)

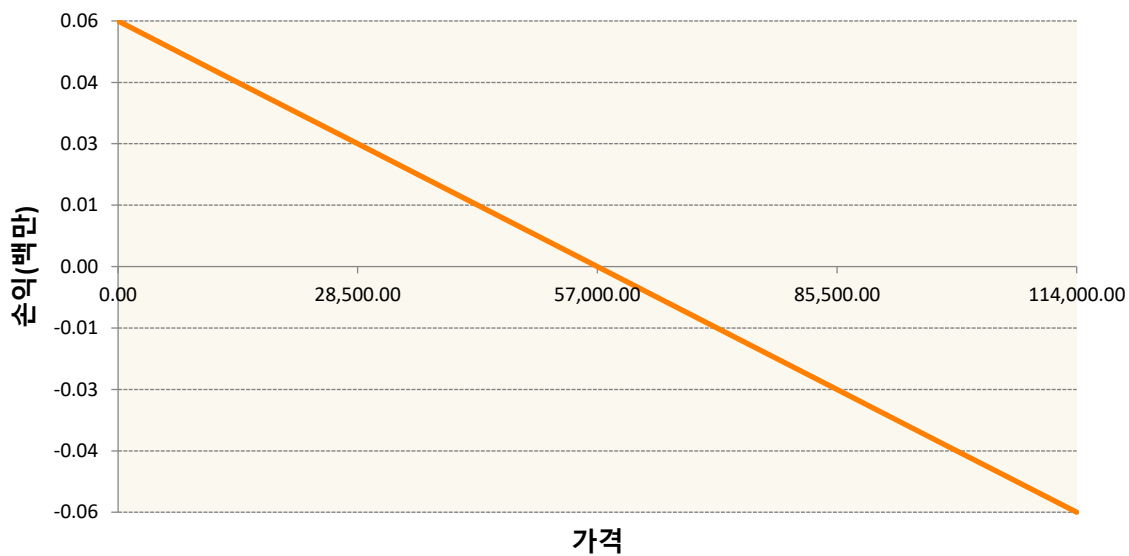
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	437	0	437	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	0	2,096	-2,096	장내
누계	유가증권	스왑	0	0	0	장외

2. 만기시점의 손익구조

KR4101S60008-2022-06 코스피200지수선물



KR4112S60005-2022-06 SK텔레콤개별선물



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		0.15
KRS0003041 SWAP_MICRON TECH CORP_0331		1
KRS0003135 SWAP_MICROSOFT CP_0429		0.06

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	174

공시일 2022-05-24

기준일 2022-05-23

신한SOL한국형글로벌반도체엑티

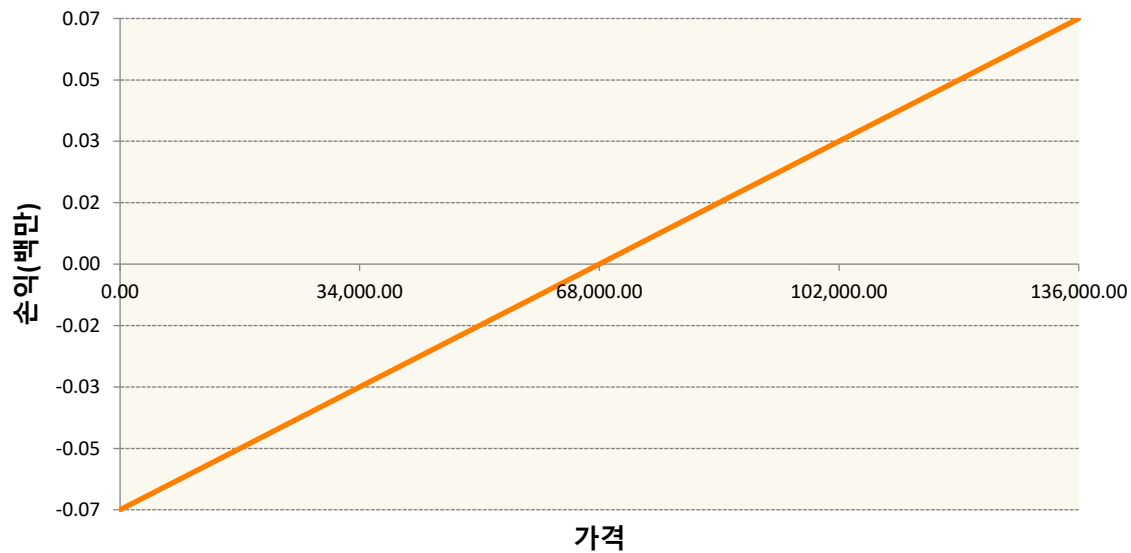
1. 계약금액

(단위:백만원)

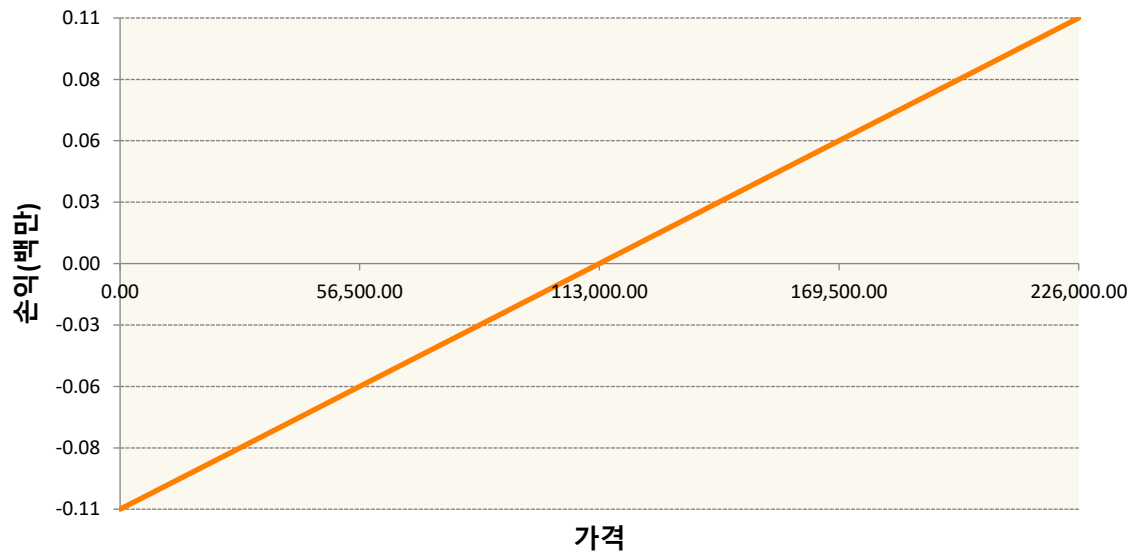
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	982	0	982	장내

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)

85

공시일 2022-05-24

기준일 2022-05-23

코리아인덱스(주식-파생형)(종)

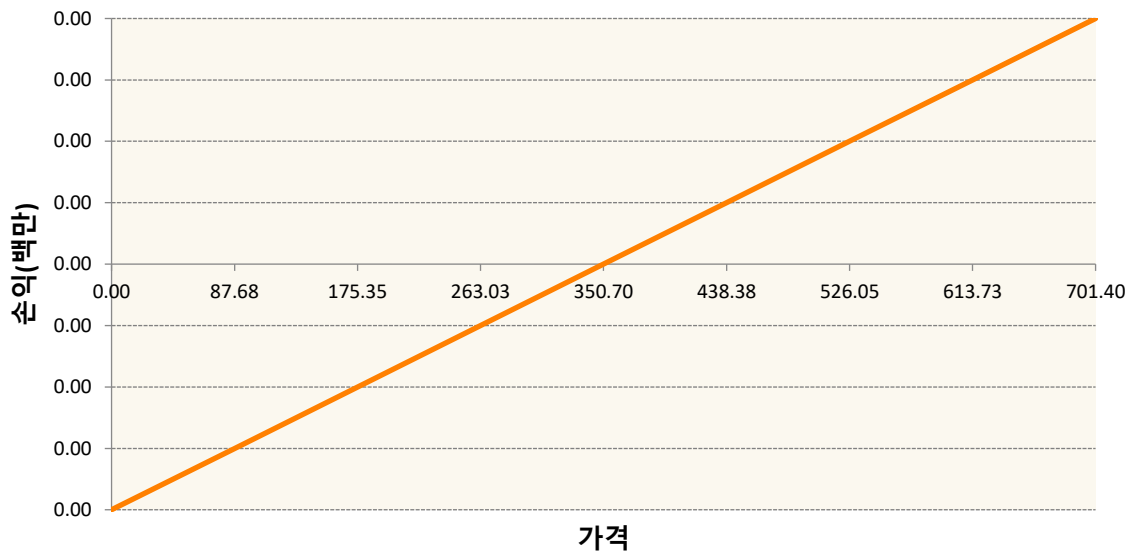
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	351	0	351	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101S60008-2022-06 코스피200지수선물



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 2022-05-24

기준일 2022-05-23

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

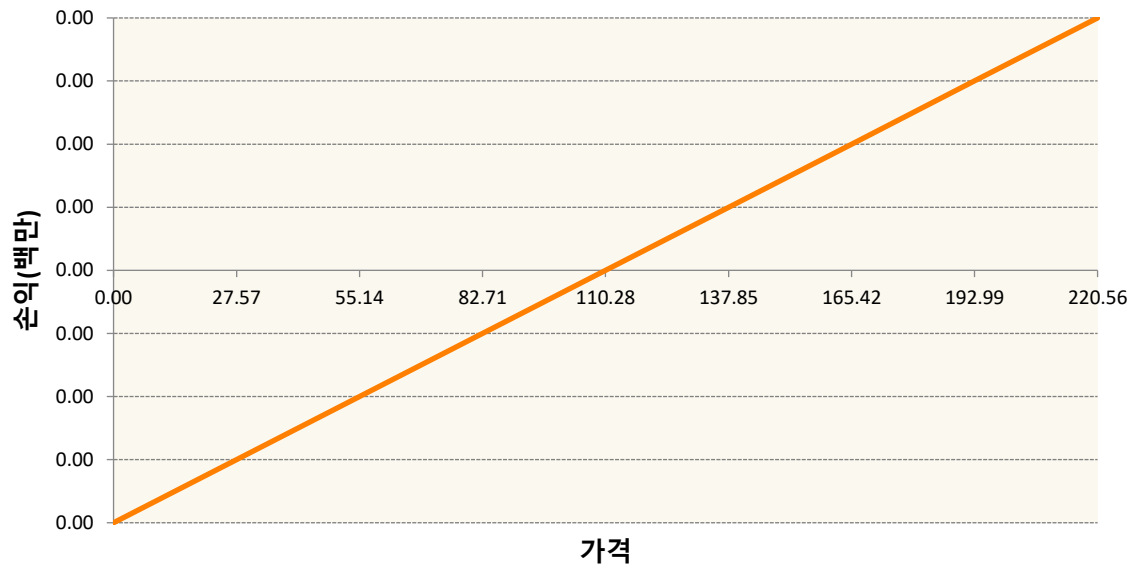
1. 계약금액

(단위:백만원)

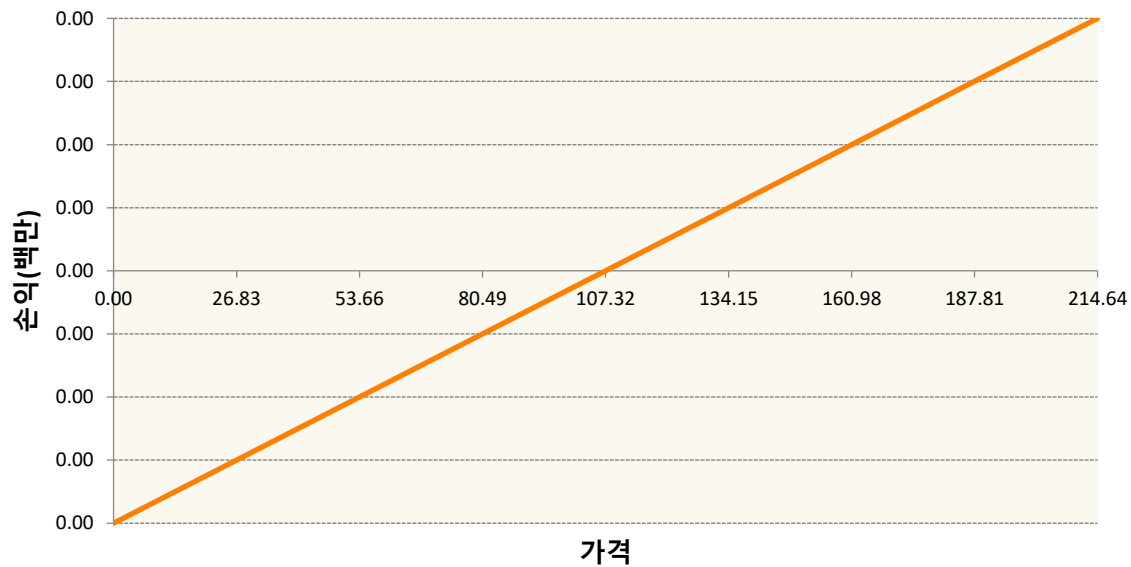
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,845	631	2,214	

2. 만기시점의 손익구조

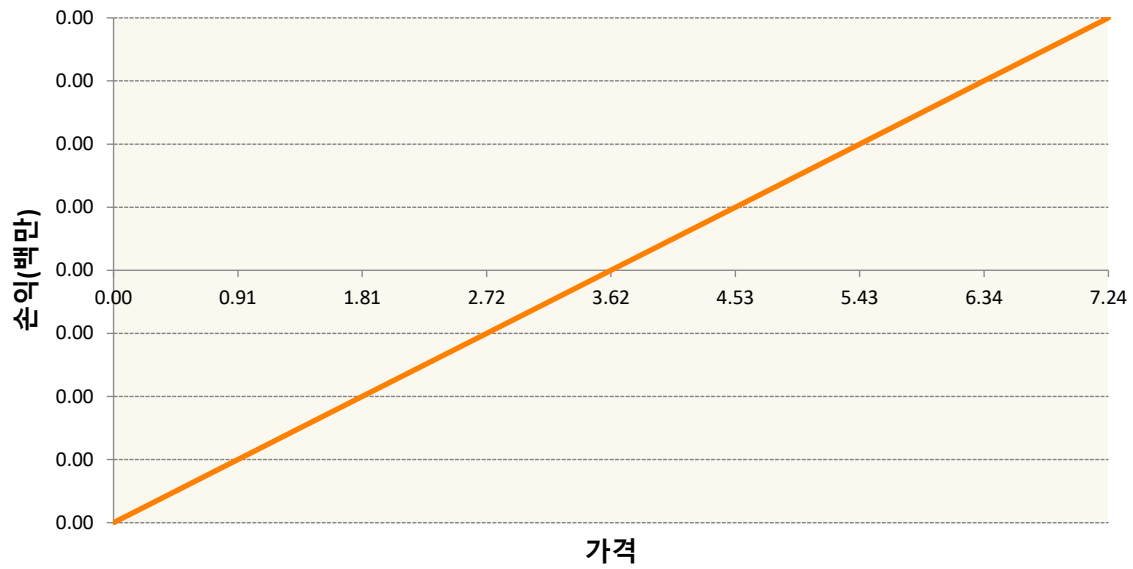
CLN2-WTI CRUDE FUTURE Jul22



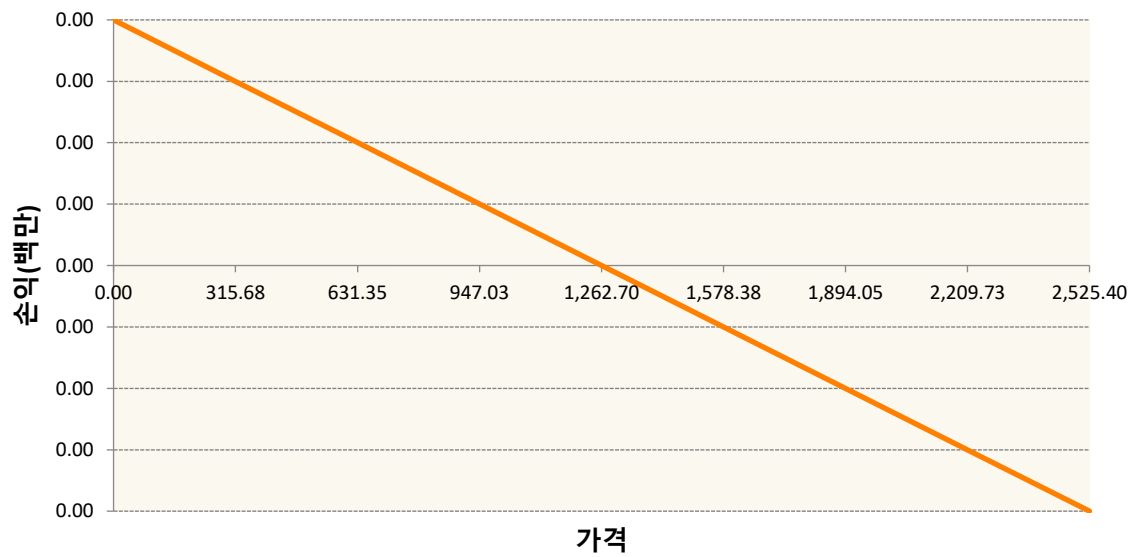
COU2-BRENT CRUDE FUTR Sep22



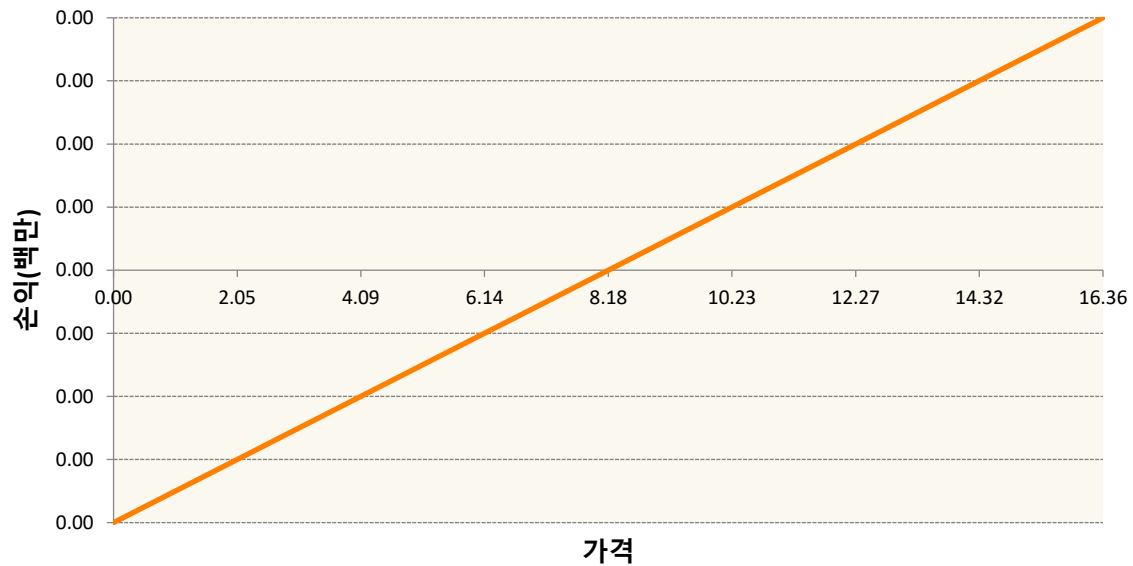
HON2-NY Harb ULSD Fut Jul22

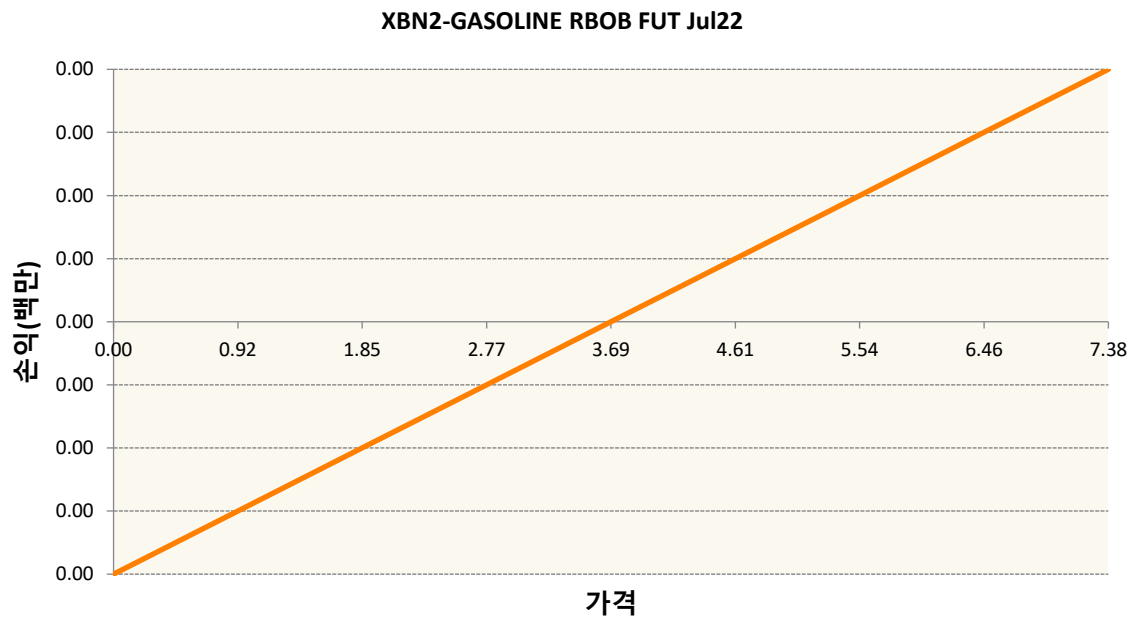
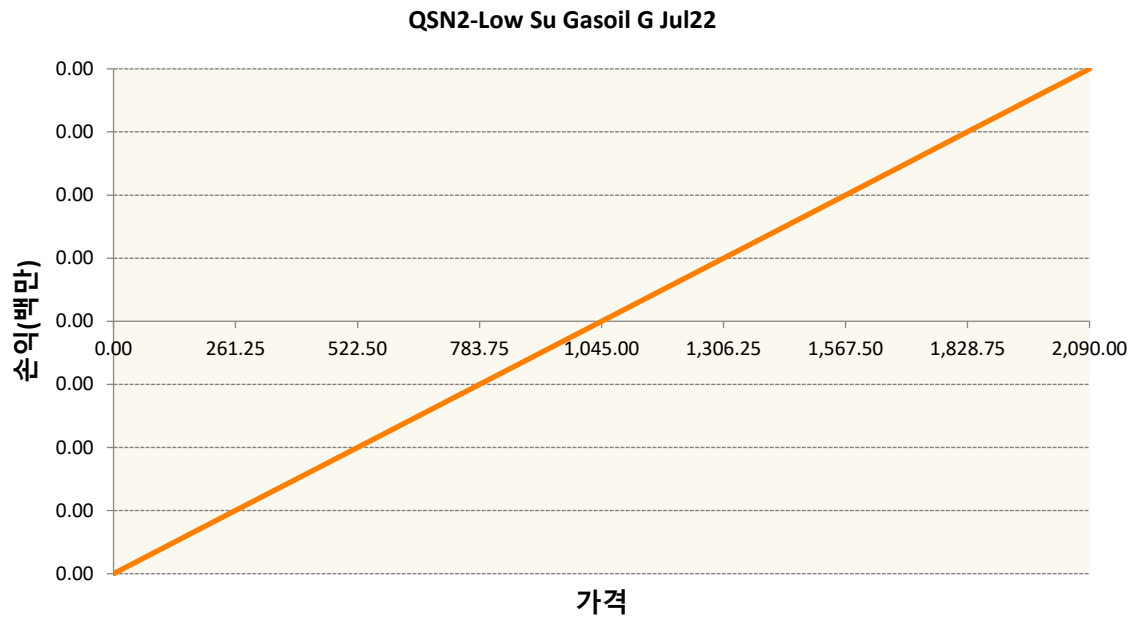


KR4175S60002-2022-06 달러선물



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		15
KR4175S600 2022-06 달러선물			51
NGN22	NATURAL GAS FUTR Jul22		89
QSN2	Low Su Gasoil G Jul22		21
XBN2	GASOLINE RBOB FUT Jul22		15

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)		(단위:백만원)
		684