

공시일 2022-06-08

기준일 2022-06-07

포커스농산물모(채권-파생형)

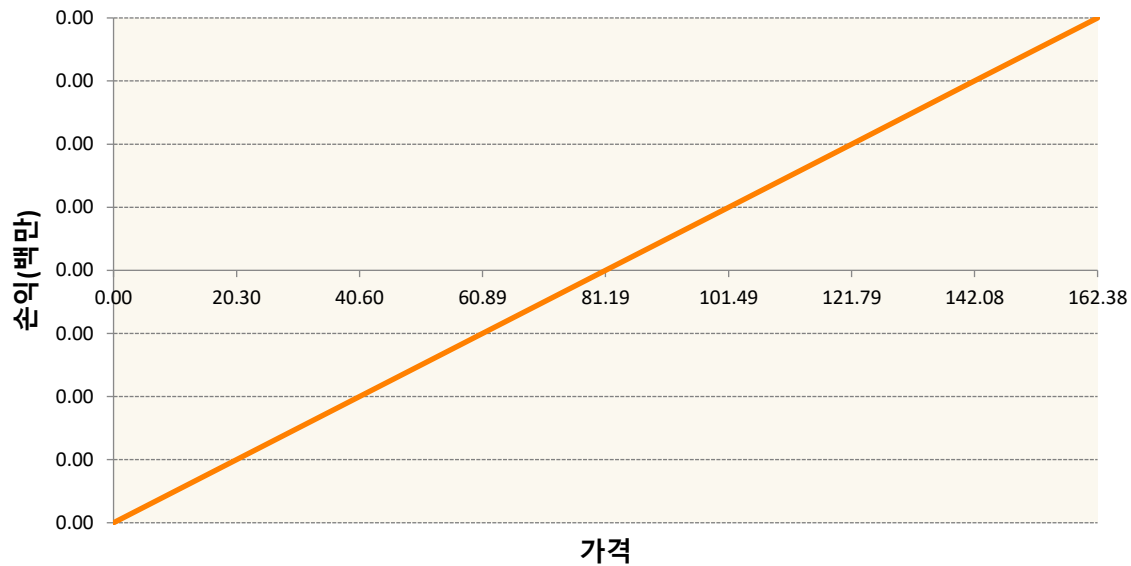
1. 계약금액

(단위:USD 백만)

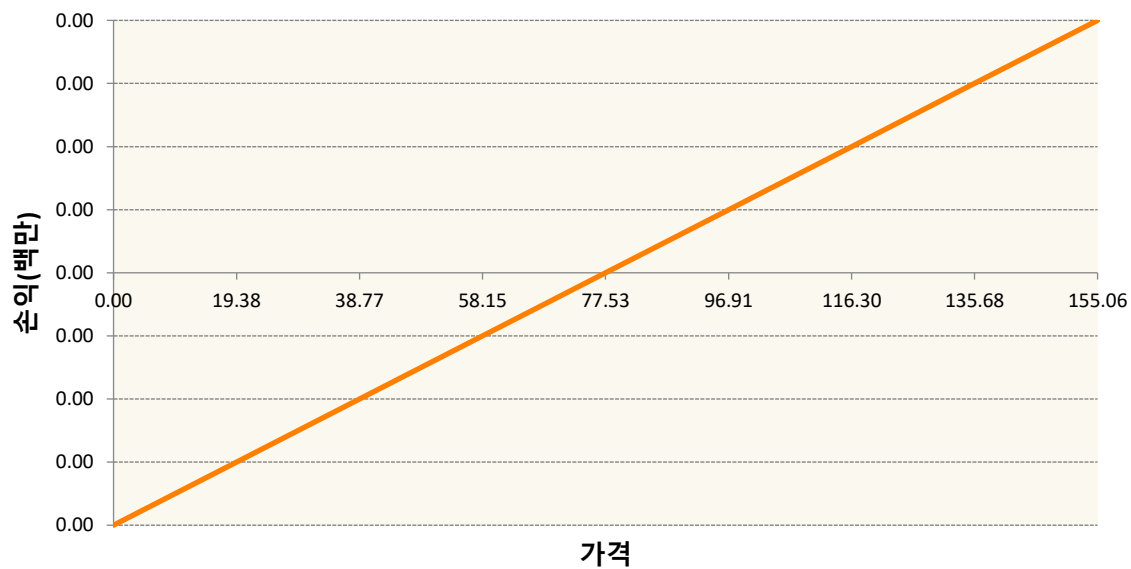
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	8,625	1,949	6,676	

2. 만기시점의 손익구조

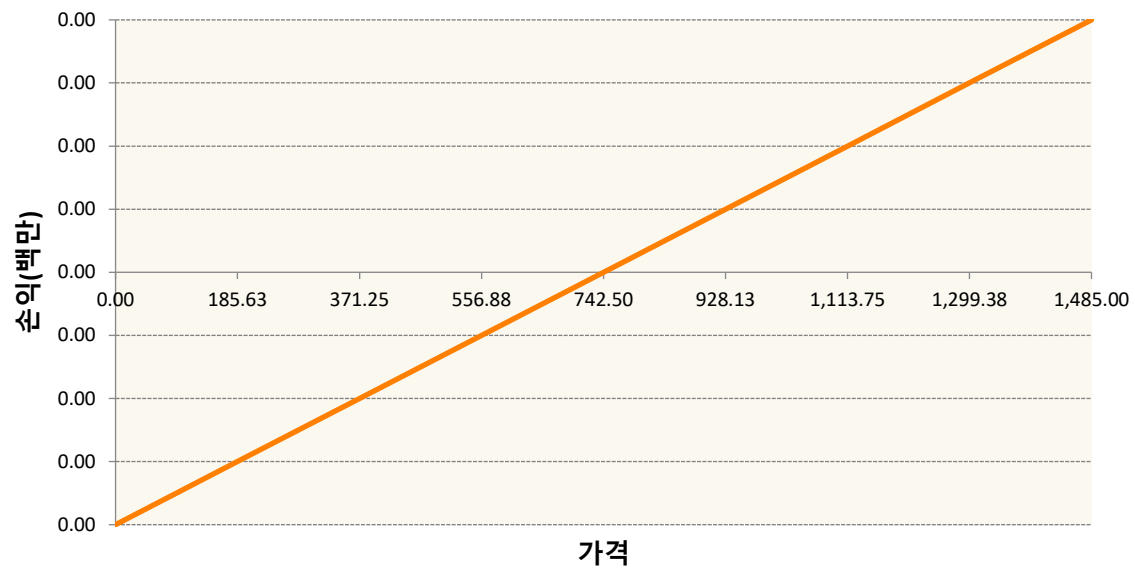
BON2-SOYBEAN OIL FUTR Jul22



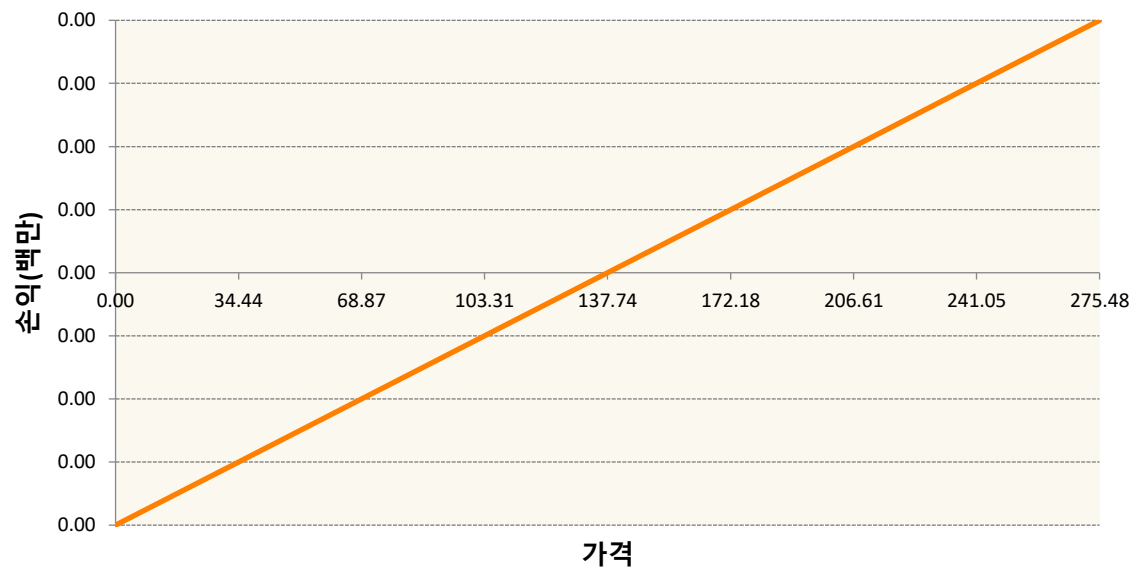
BOZ2-SOYBEAN OIL FUTR Dec22



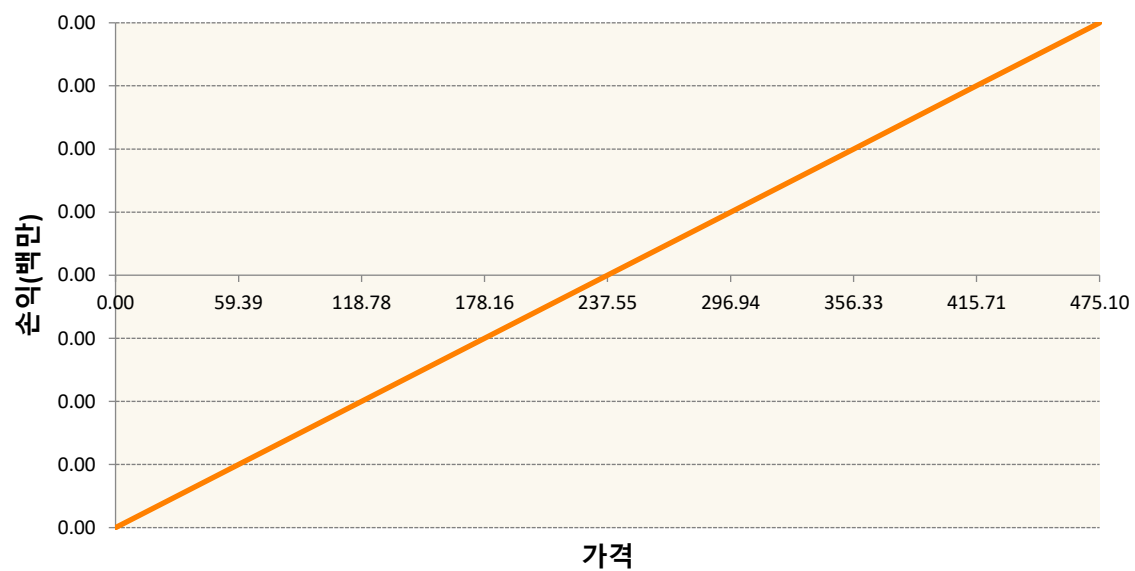
CN2-CORN FUTURE Jul22



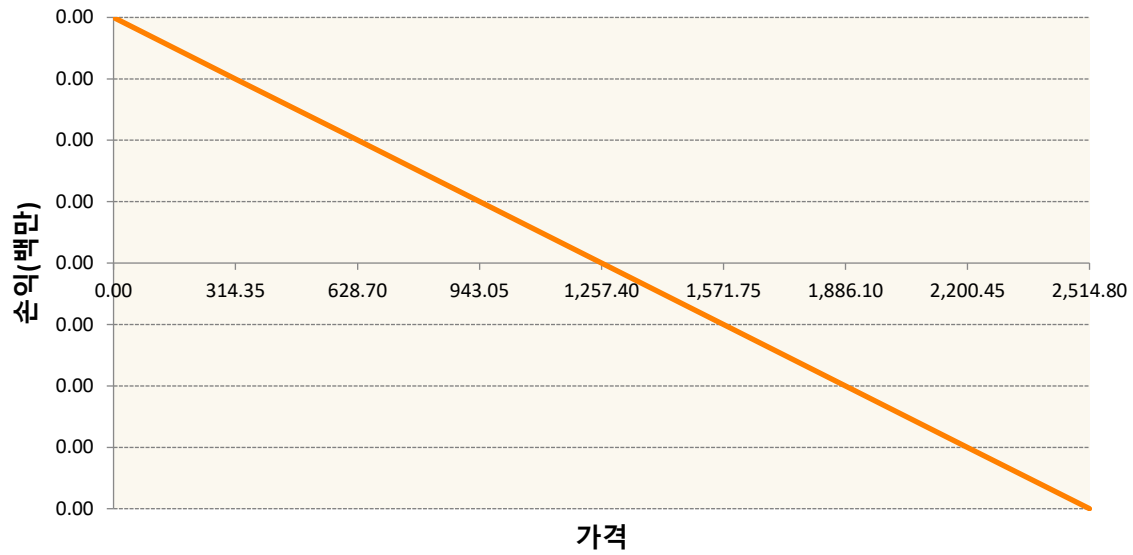
CTN2-COTTON NO.2 FUTR Jul22



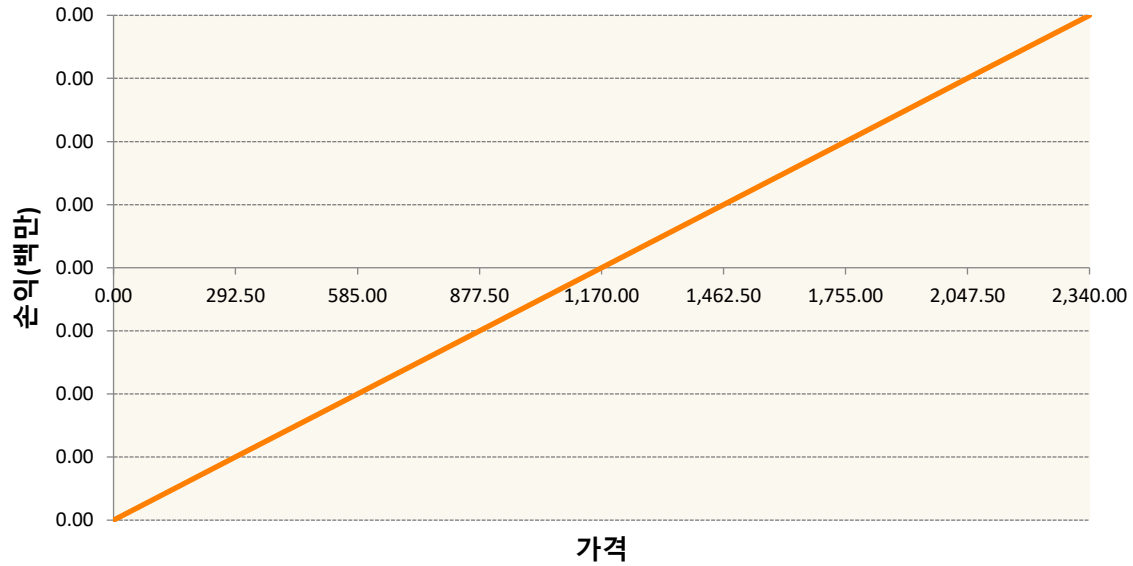
KCN2-COFFEE 'C' FUTURE Jul22



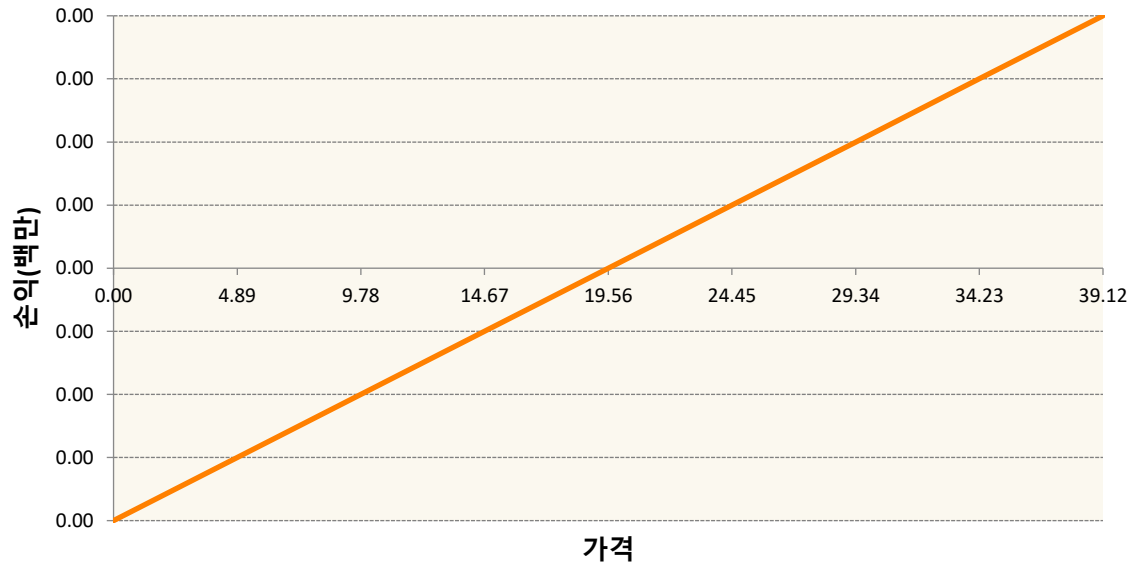
KR4175S60002-2022-06 달러선물



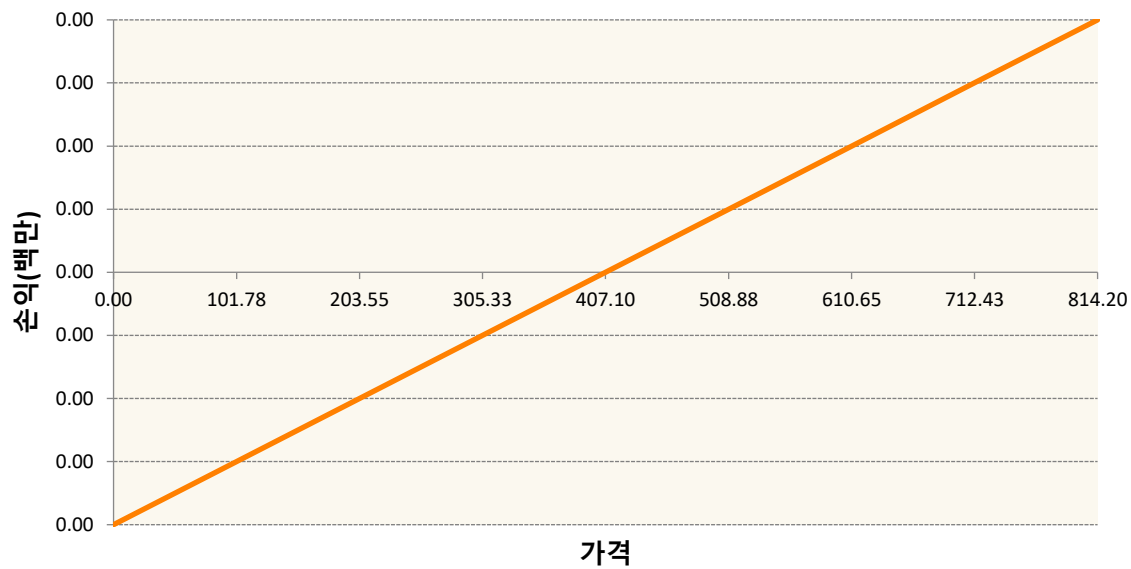
KWN2-KC HRW WHEAT FUT Jul22



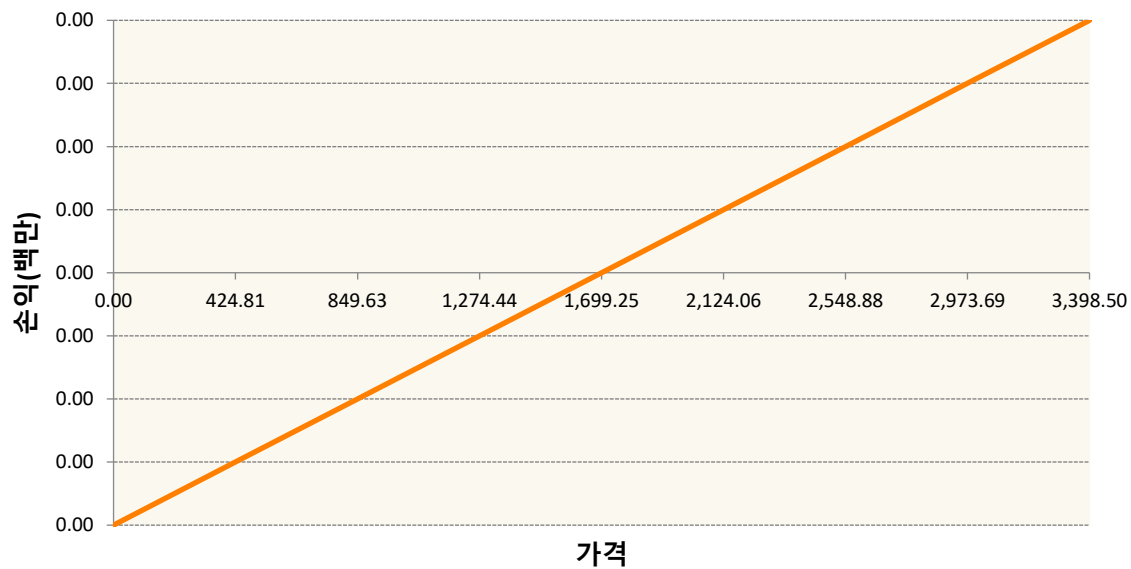
SBN2-Sugar #11 (WORLD) Jul22



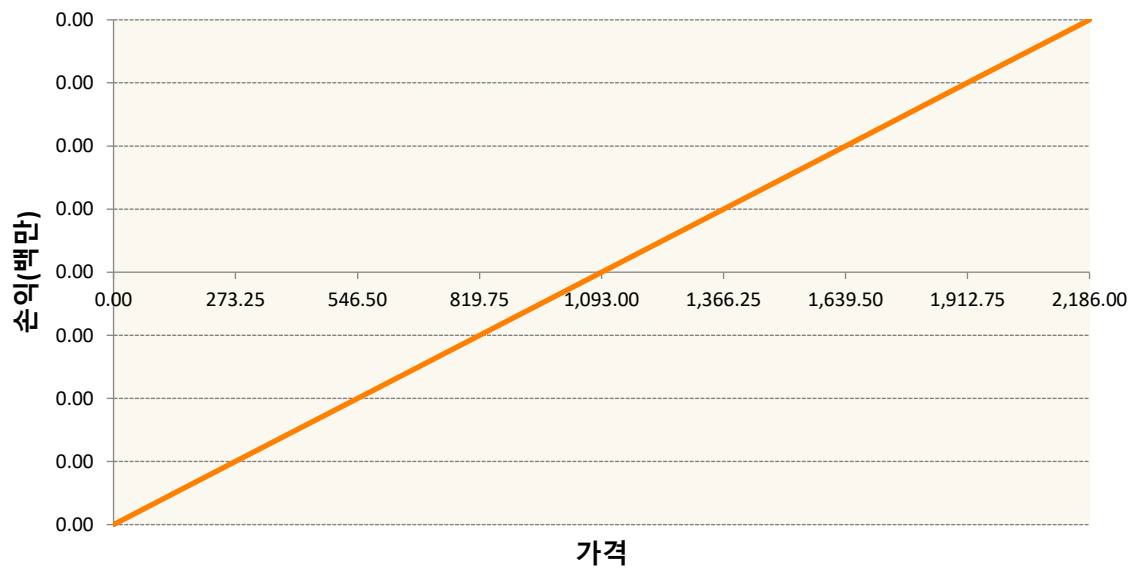
SMN2-SOYBEAN MEAL FUTR Jul22



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	2022-06-08
기준일	2022-06-07

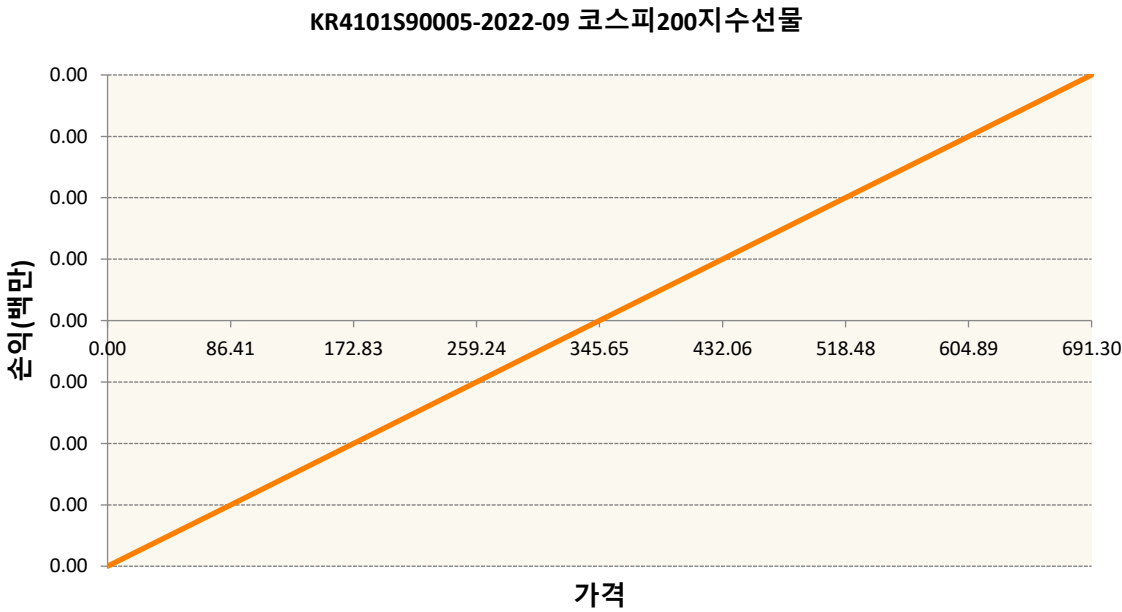
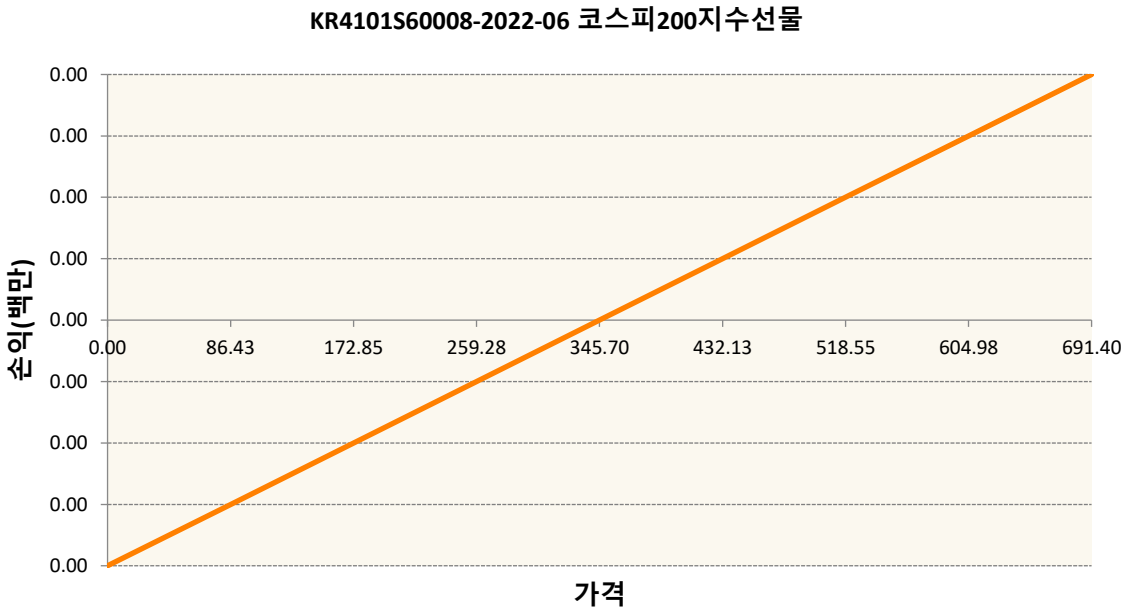
스마트인덱스모

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	778	0	778	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
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	2022-06-08
기준일	2022-06-07

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

367

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

468

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2022-06-08
기준일	2022-06-07

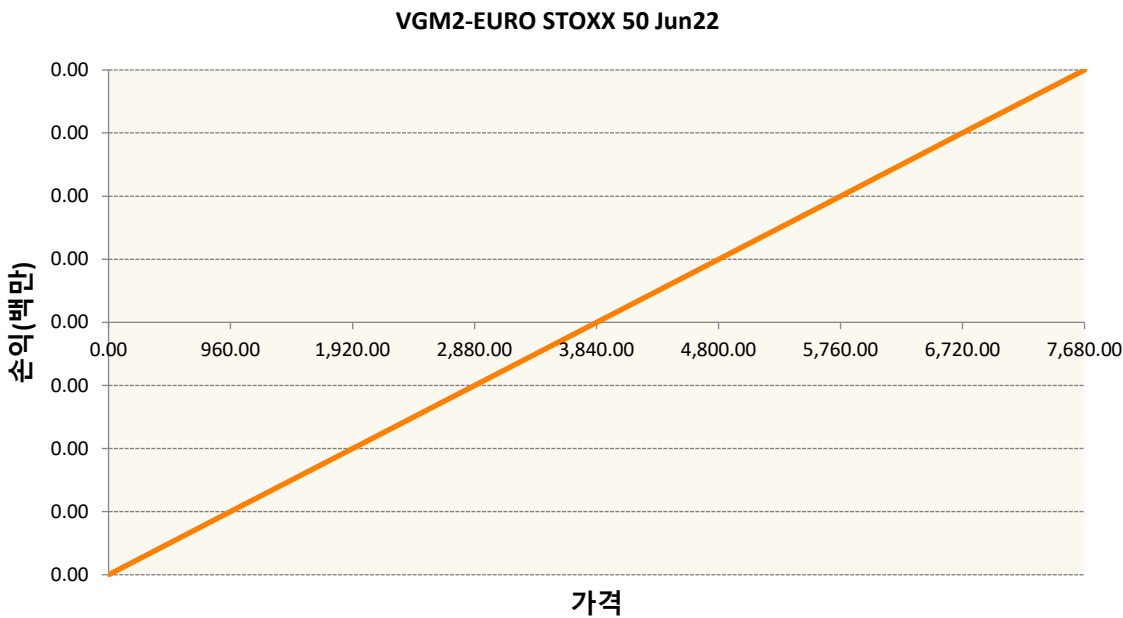
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	573	0	573	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM2	EURO STOXX 50 Jun22	46
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

44

공시일	2022-06-08
기준일	2022-06-07

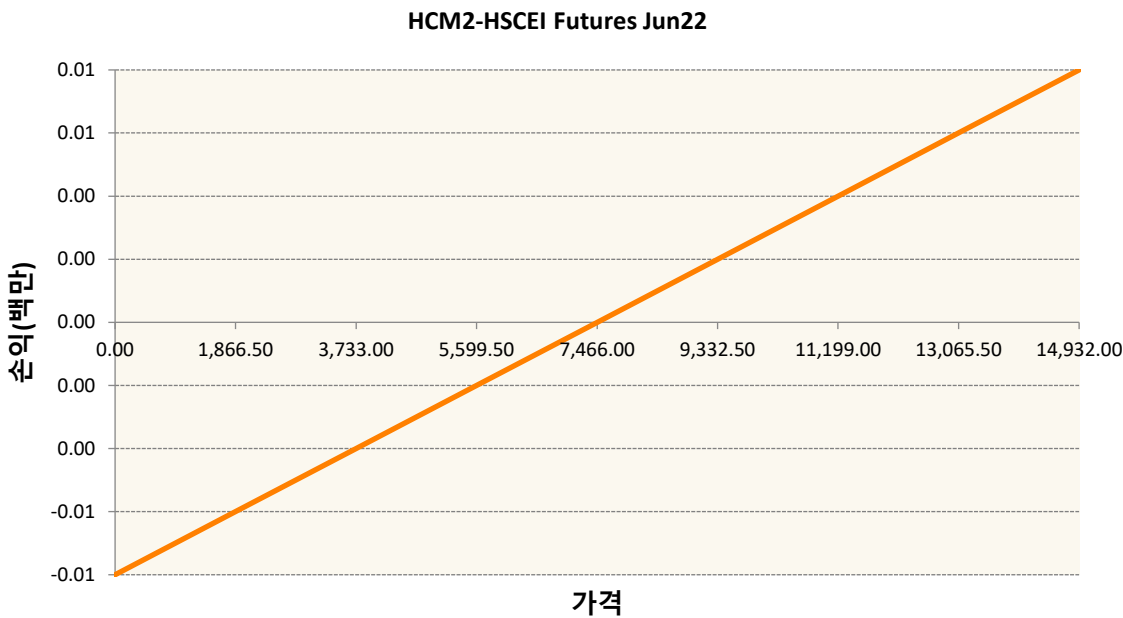
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,195	0	1,195	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCM2	HSCEI Futures Jun22	96
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

138

공시일	2022-06-08
기준일	2022-06-07

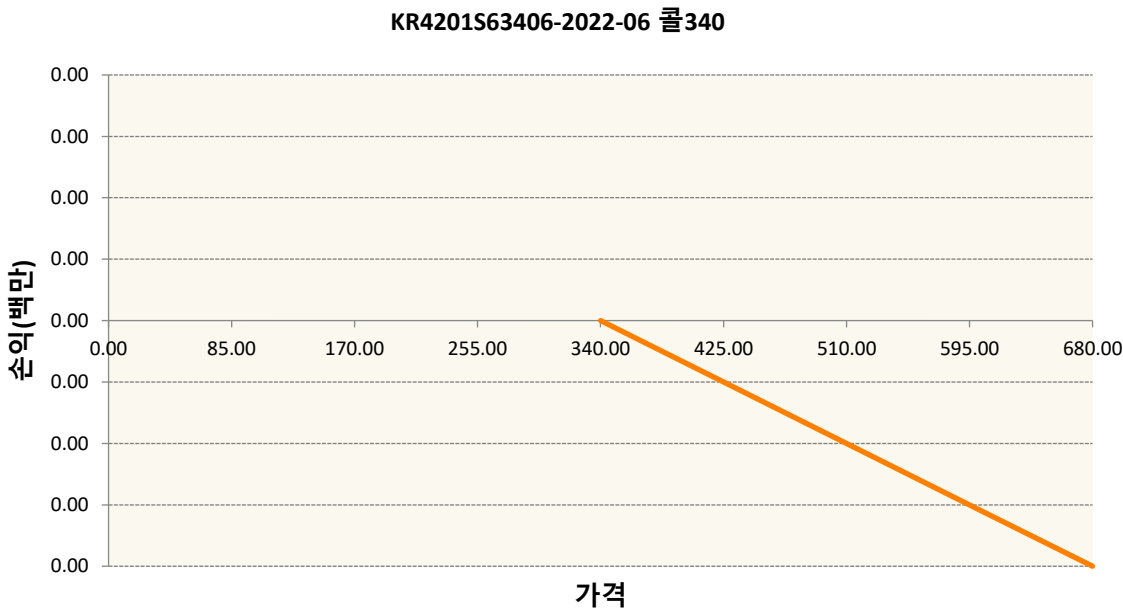
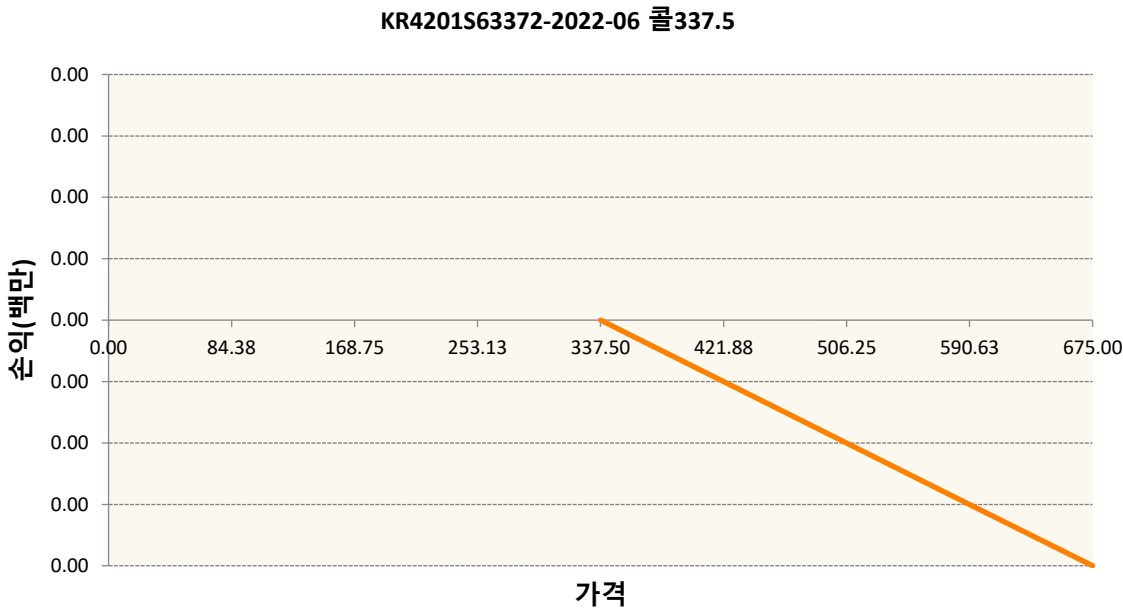
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

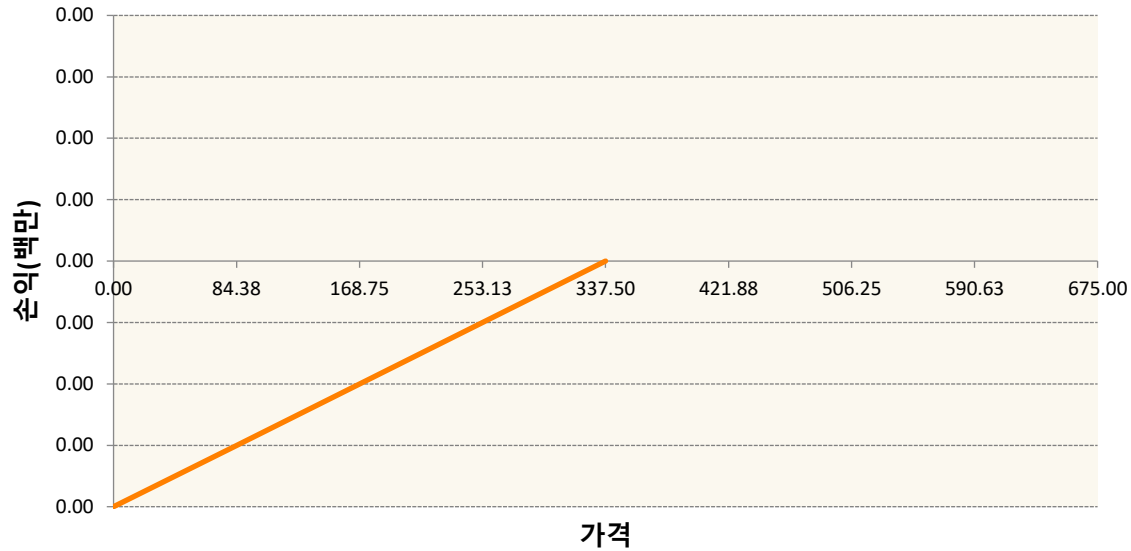
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	63,281	-63,281	장내

2. 만기시점의 손익구조



KR4301S63370-2022-06 풋337.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201S63372			2022-06 콜337.5				3,277
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,048	1,048	1,048	1,047	1,047	1,045	1,043
-5.33%	1,041	1,035	1,027	1,018	1,006	993	979
-2.67%	842	813	784	755	726	696	667
0%	40	29	15	0	-17	-36	-55
2.67%	-1,052	-1,052	-1,053	-1,055	-1,057	-1,061	-1,066
5.33%	-2,164	-2,164	-2,164	-2,164	-2,164	-2,165	-2,165
8.00%	-3,277	-3,277	-3,277	-3,277	-3,277	-3,277	-3,277
KR4201S63406			2022-06 콜340				901
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	224	224	224	224	224	223	223
-5.33%	223	223	221	220	218	216	213
-2.67%	195	188	181	173	166	158	151
0%	17	12	6	0	-6	-13	-20
2.67%	-279	-279	-280	-281	-282	-284	-286
5.33%	-590	-590	-590	-590	-590	-590	-590
8.00%	-901	-901	-901	-901	-901	-901	-901
KR4301S63370			2022-06 풋337.5				636
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-636	-636	-636	-636	-636	-636	-636
-5.33%	-334	-334	-334	-334	-335	-335	-336
-2.67%	-61	-66	-71	-76	-81	-85	-90
0%	2	2	1	0	-1	-3	-4

공시일	2022-06-08
기준일	2022-06-07

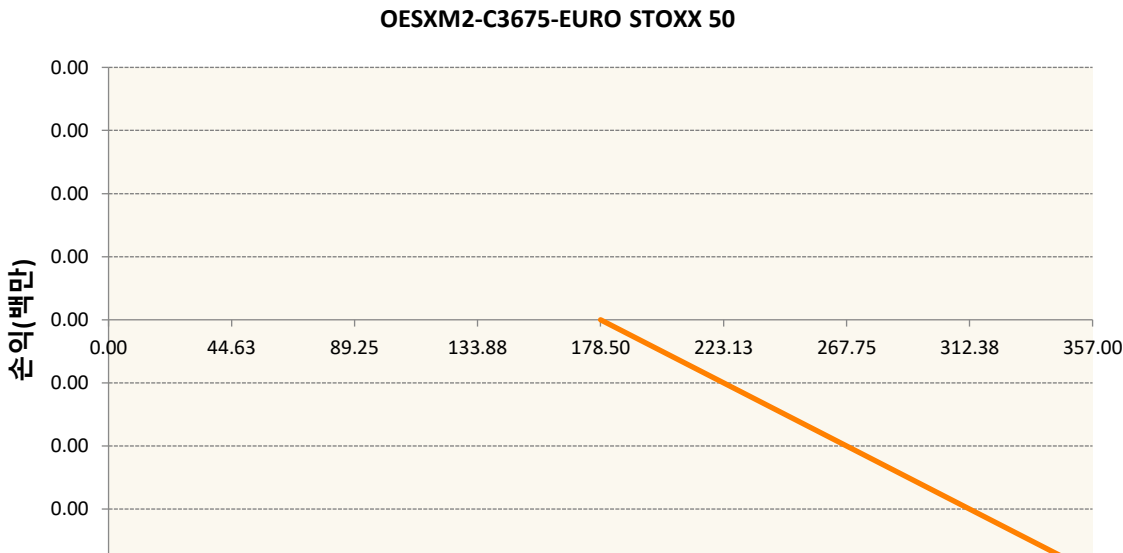
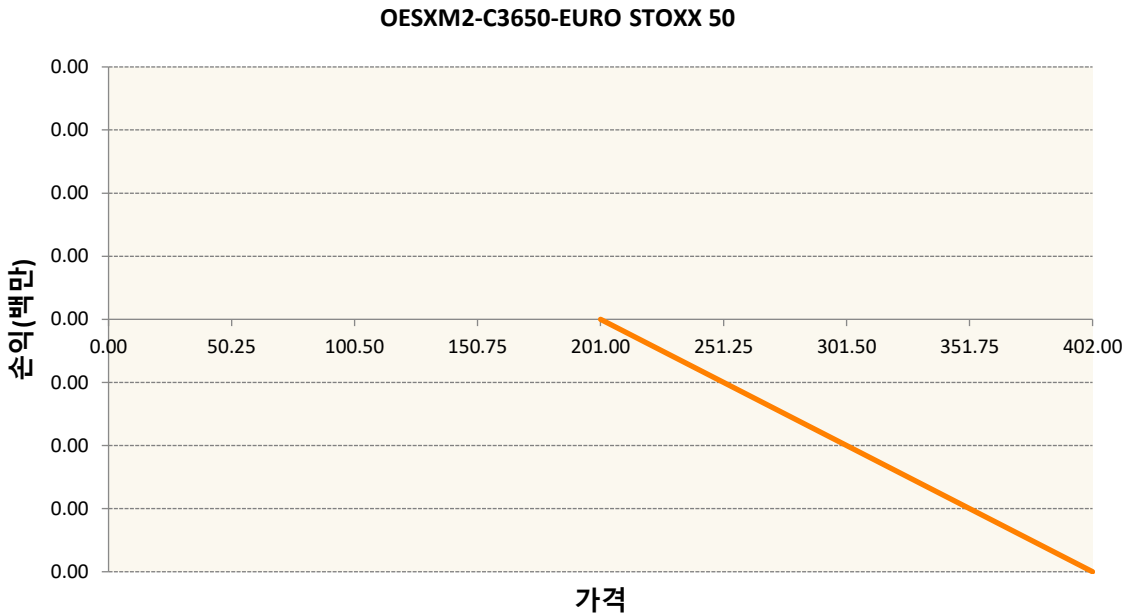
유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

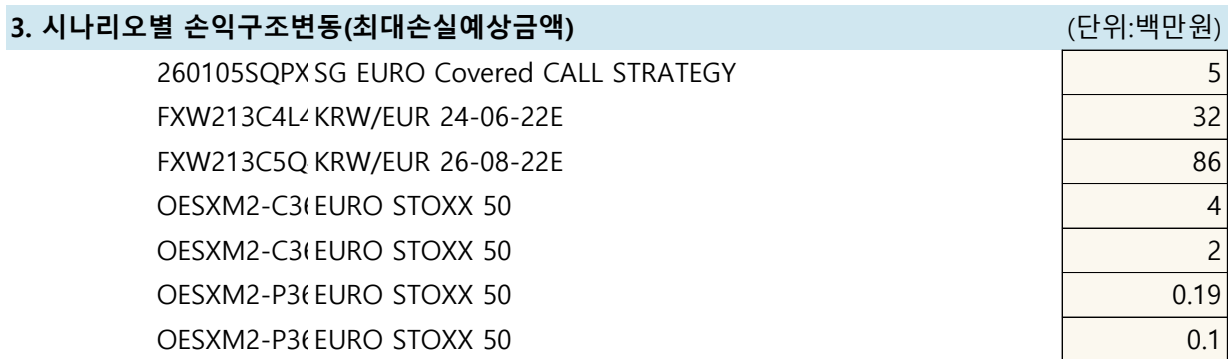
1. 계약금액

(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	71	-71	장내
누계	지수	스왑	10	0	10	장외
누계	통화	선도	0	1,479	-1,479	장외

2. 만기시점의 손익구조





공시일 2022-06-08

기준일 2022-06-07

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

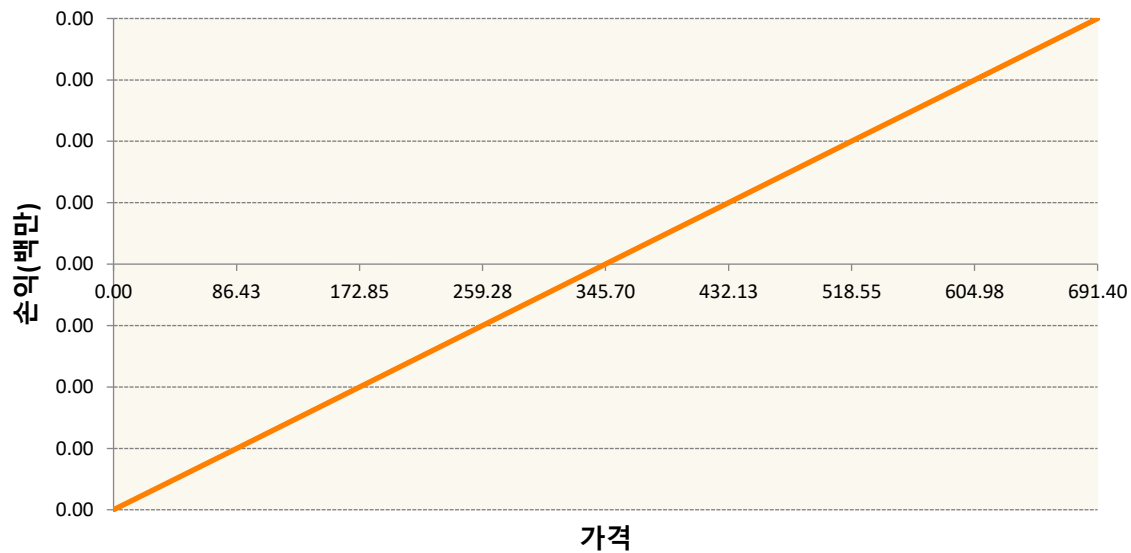
1. 계약금액

(단위:백만원)

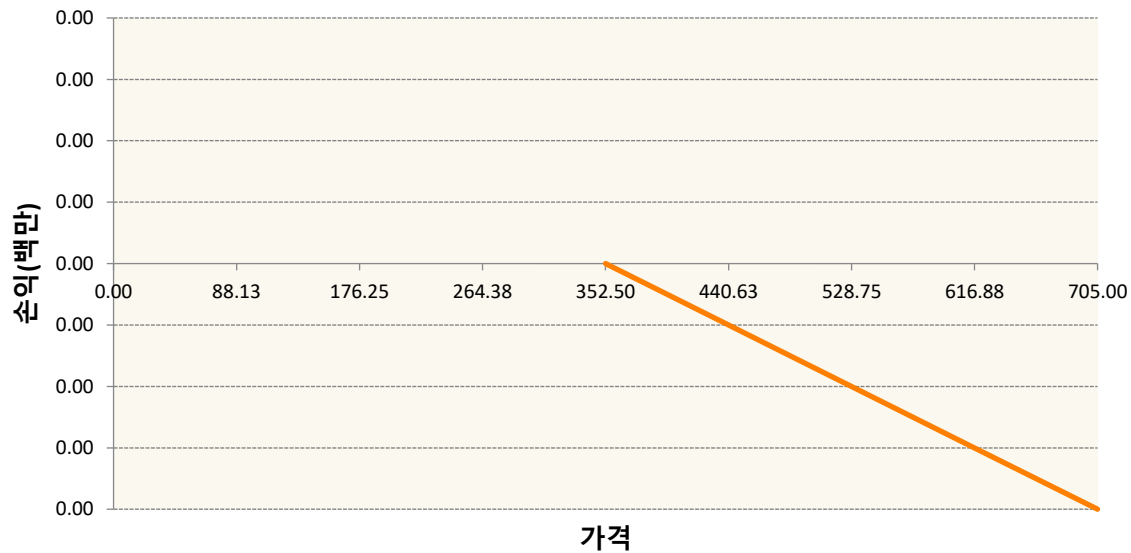
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	519	0	519	장내
누계	유가증권	옵션	338	4,613	-4,274	장내

2. 만기시점의 손익구조

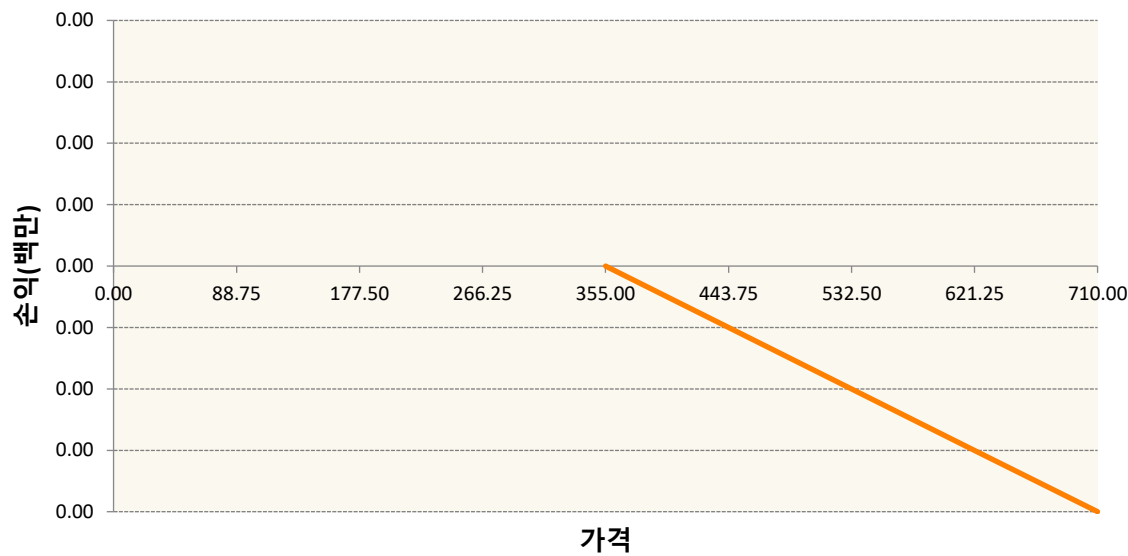
KR4101S60008-2022-06 코스피200지수선물



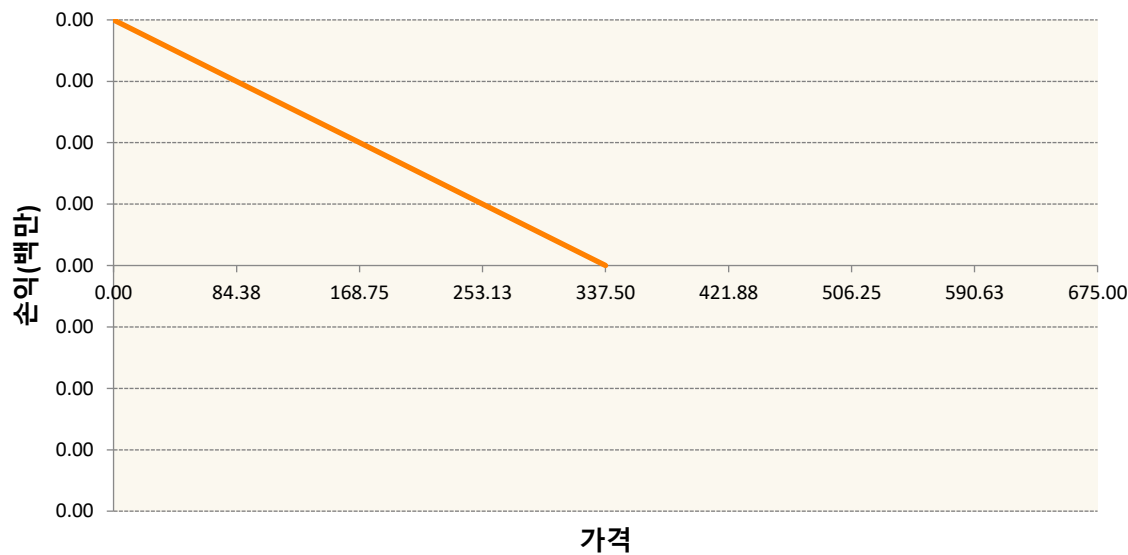
KR4201S63521-2022-06 콜352.5



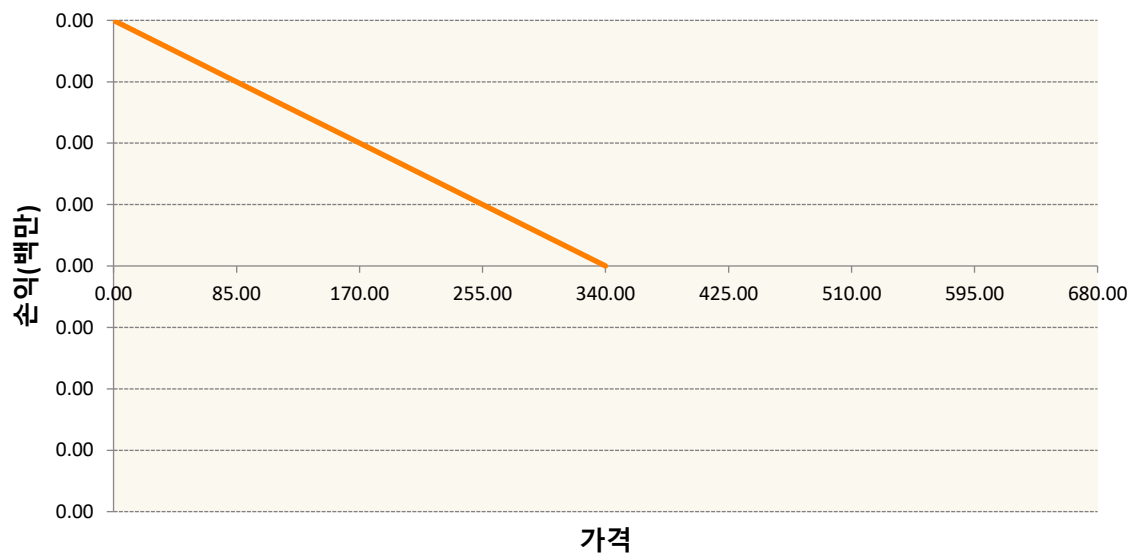
KR4201S63554-2022-06 콜355



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				20
	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	1	
0%	0	0	0	0	0	0	-1	
2.67%	-3	-3	-3	-4	-4	-4	-4	
5.33%	-11	-11	-11	-11	-11	-11	-11	
8.00%	-20	-20	-20	-20	-20	-20	-20	
KR4201S63554				2022-06 콜355				216
	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%	5	5	5	5	5	5	5	
-2.67%	5	5	5	5	5	4	4	
0%	3	2	1	0	-2	-3	-5	
2.67%	-22	-25	-28	-31	-35	-38	-41	
5.33%	-106	-107	-109	-110	-112	-114	-116	
8.00%	-215	-215	-215	-215	-216	-216	-216	
KR4301S63370				2022-06 풋337.5				15
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	15	15	15	15	15	15	15	
-5.33%	8	8	8	8	8	8	8	
-2.67%	1	2	2	2	2	2	2	
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	
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	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)

242

공시일	2022-06-08
기준일	2022-06-07

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	9,600	0	9,600	

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	2022-06-08
기준일	2022-06-07

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	7,244	0	7,244	

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	2022-06-08
기준일	2022-06-07

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	22,893	0	22,893	
누계	통화	선도	2,327	25,318	-22,991	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213C4MKRW/USD 27-06-22E	2,025
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)

791

공시일	2022-06-08
기준일	2022-06-07

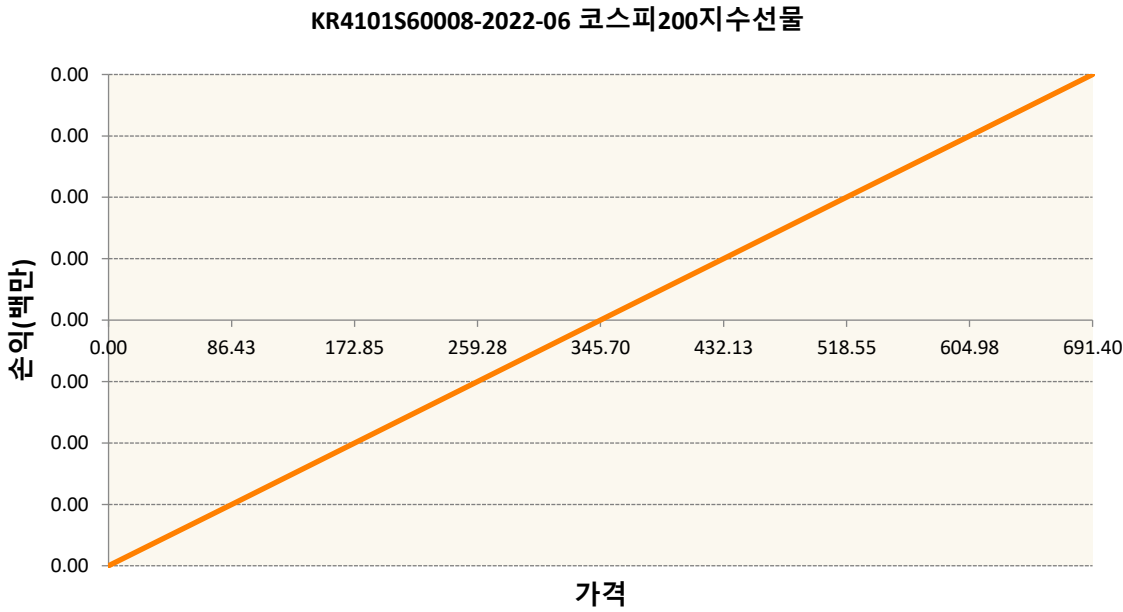
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

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	1,124	0	1,124	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 2022-06-08

기준일 2022-06-07

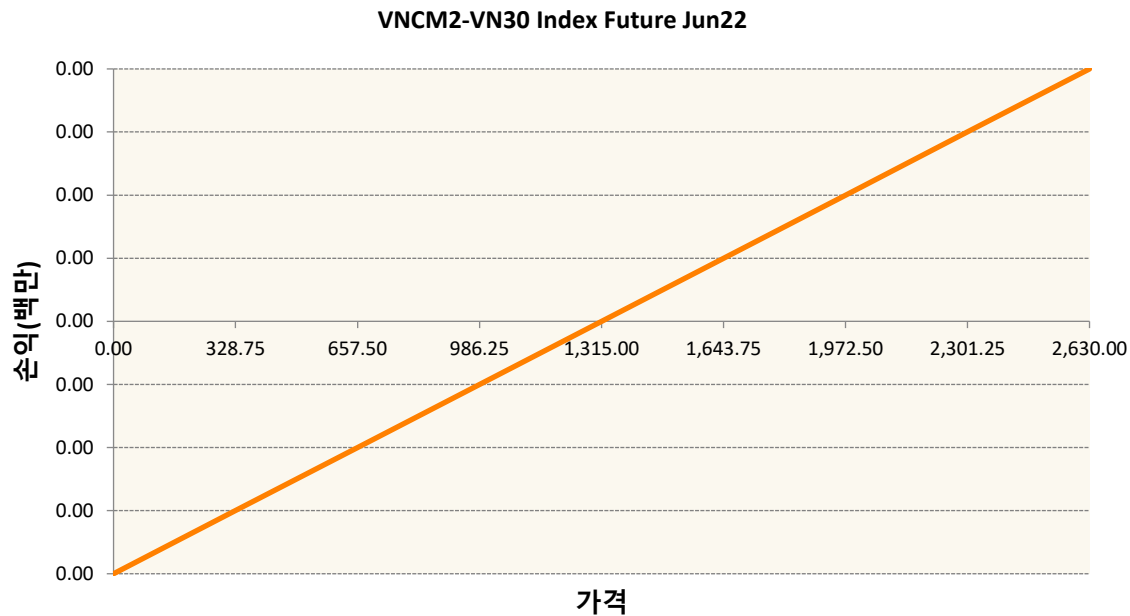
스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

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	799	0	799	
누계	유가증권	스왑	1,738	0	1,738	장외
누계	통화	선도	0	982	-982	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	64

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

(단위:백만원)

278

공시일 2022-06-08

기준일 2022-06-07

SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

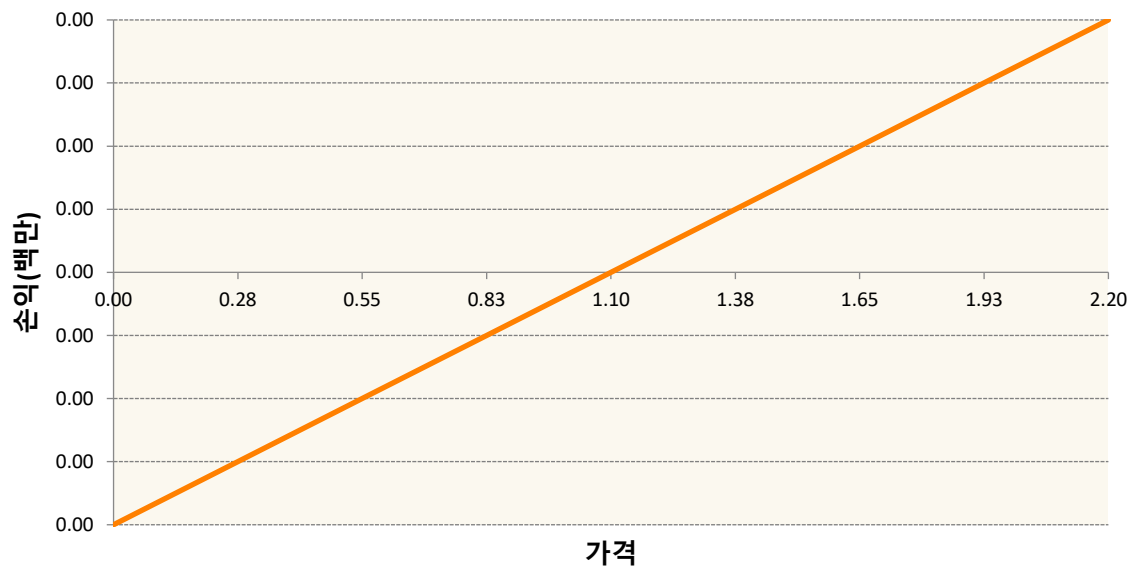
1. 계약금액

(단위:백만원)

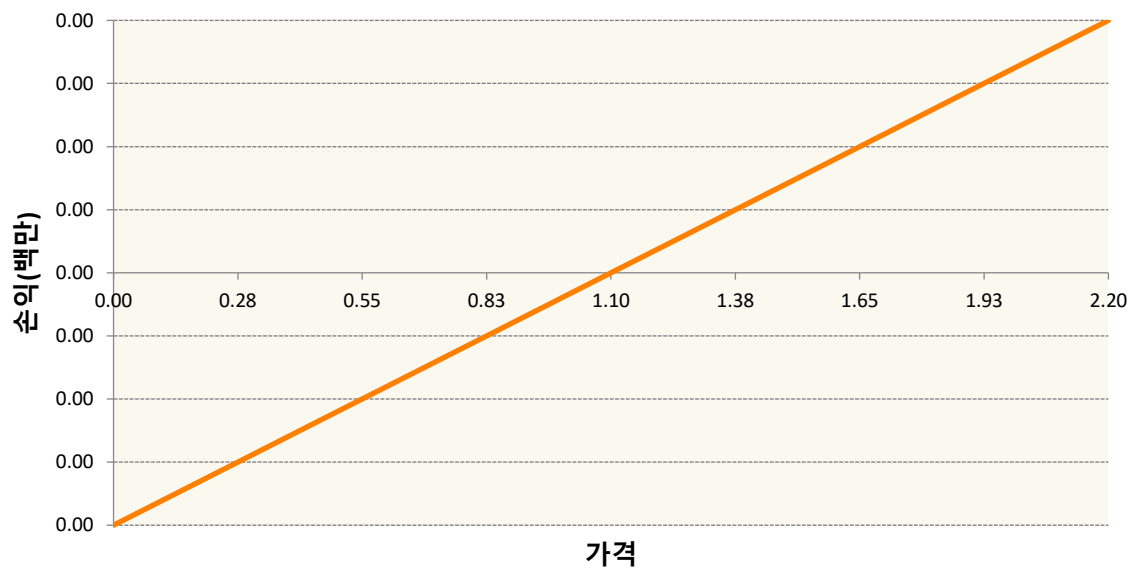
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	46,712	0	46,712	

2. 만기시점의 손익구조

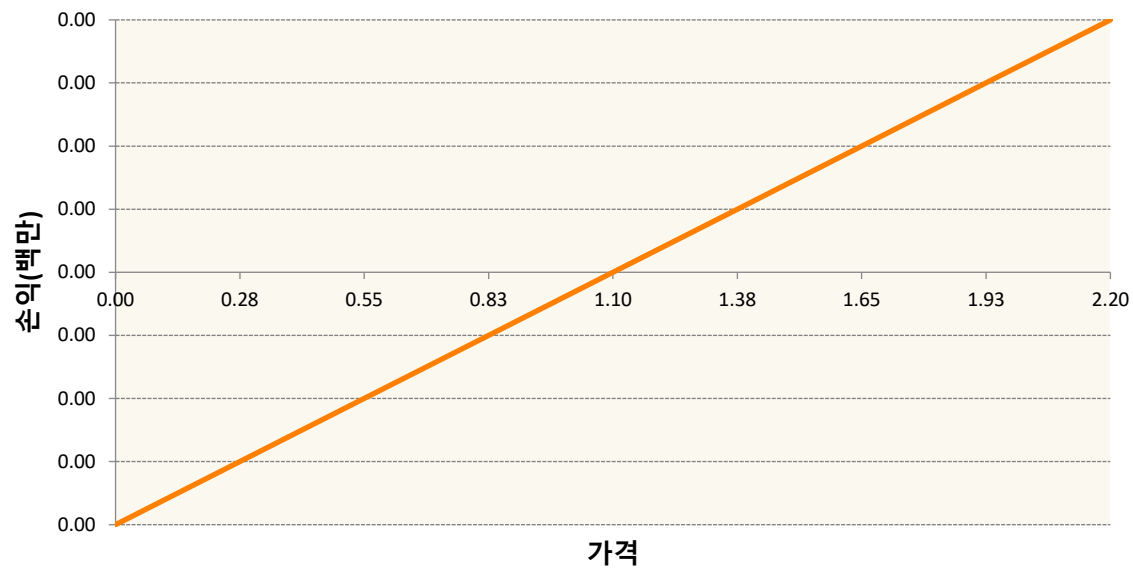
210884220325-IHS Markit Global Carbon Index(TR)



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)

198

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

3,454

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

99

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

(단위:백만원)

7,002

공시일 2022-06-08

기준일 2022-06-07

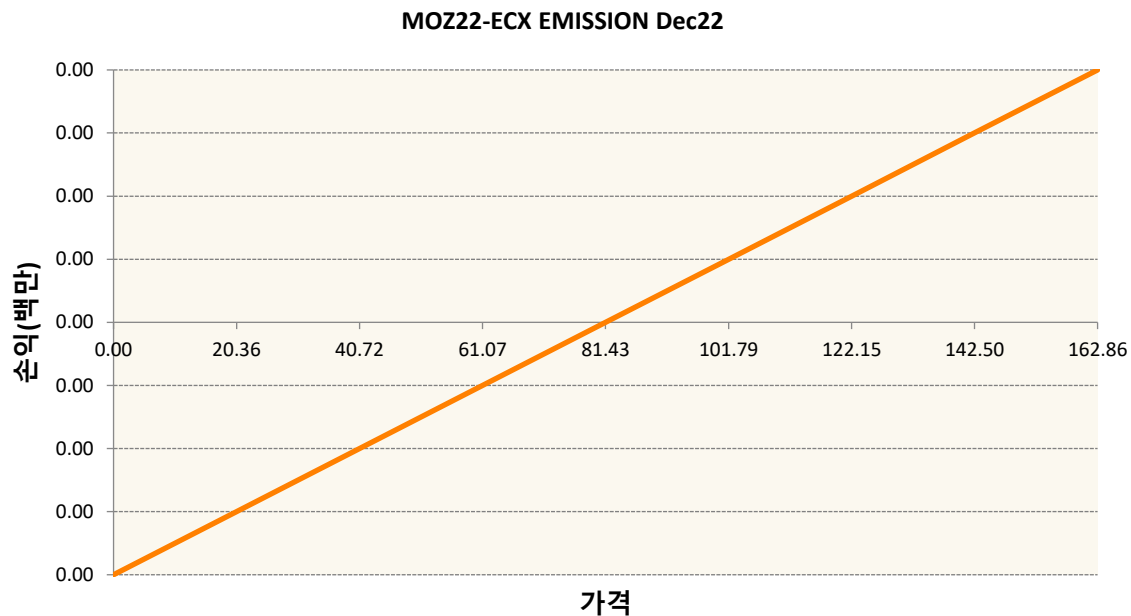
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	14,061	0	14,061	
누계	통화	선도	0	7,933	-7,933	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213C5P KRW/EUR 27-06-22E

635

MOZ22 ECX EMISSION Dec22

1,125

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

(단위:백만원)

3,128

공시일	2022-06-08
기준일	2022-06-07

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)	8
SWCSI00000 신한CSI Index 220323 (키움)	8
SWCSI00000 신한CSI Index 220323 (미래)	8
SWCSI00000 신한CSI Index 220323 (메리츠)	8

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

(단위:백만원)

61

공시일	2022-06-08
기준일	2022-06-07

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)	16
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220113(미래)	19
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220113(메리츠)	16
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220113(NH)	16
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220426(메리츠)	6

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

(단위:백만원)

98

공시일	2022-06-08
기준일	2022-06-07

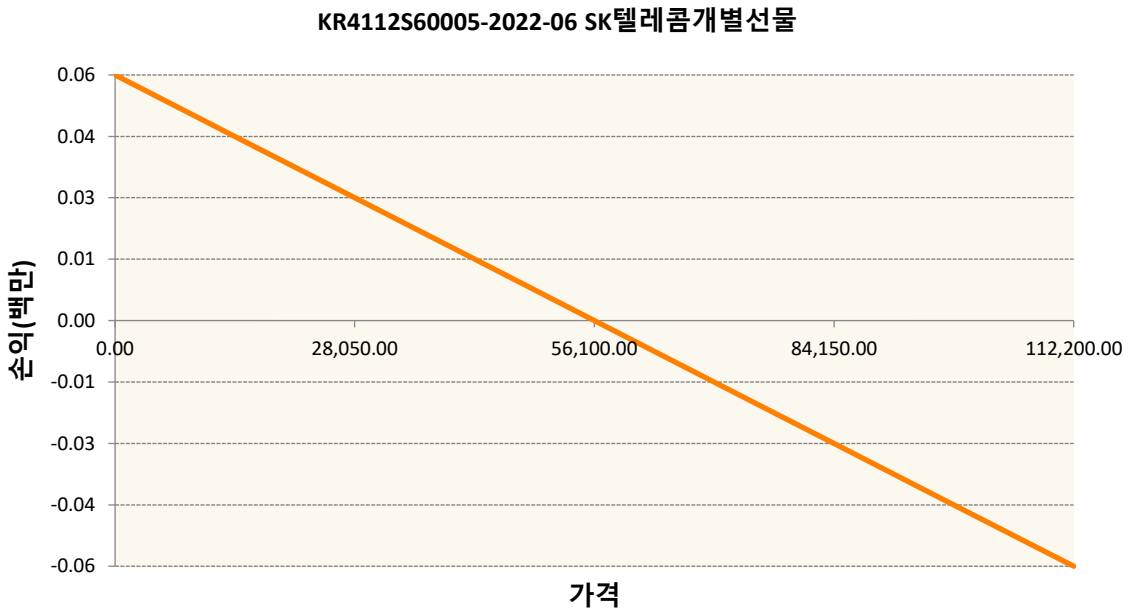
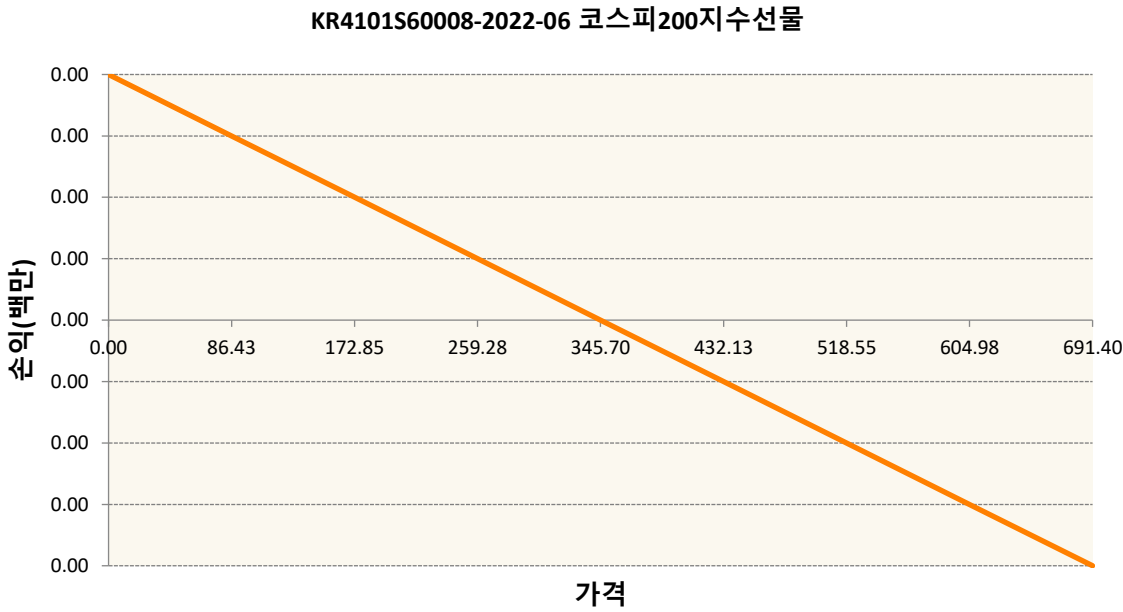
에퀴티알파일반사모혼합자산

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	432	0	432	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	0	769	-769	장내
누계	유가증권	스왑	0	0	0	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
KR4101S600 2022-06 코스피200지수선물		35
KR4112S600 2022-06 SK텔레콤개별선물		27
KRS0003041 SWAP_MICRON TECH CORP_0331		0.16
KRS0003135 SWAP_MICROSOFT CP_0429		1
KRS0003224 SWAP_FIRST TRUST ECL_0602		0.08

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	77

공시일 2022-06-08

기준일 2022-06-07

신한SOL한국형글로벌반도체엑티

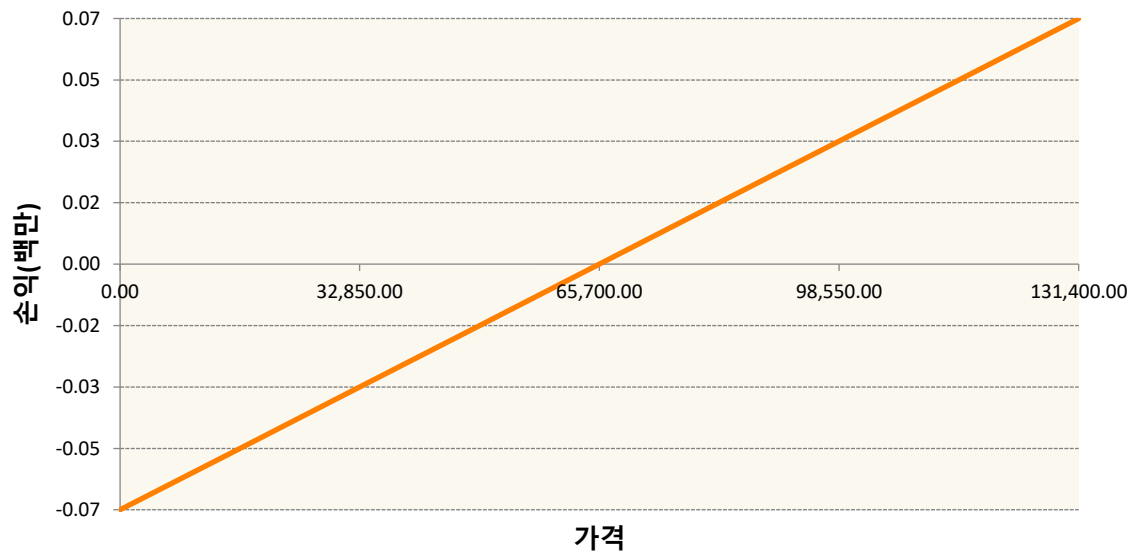
1. 계약금액

(단위:백만원)

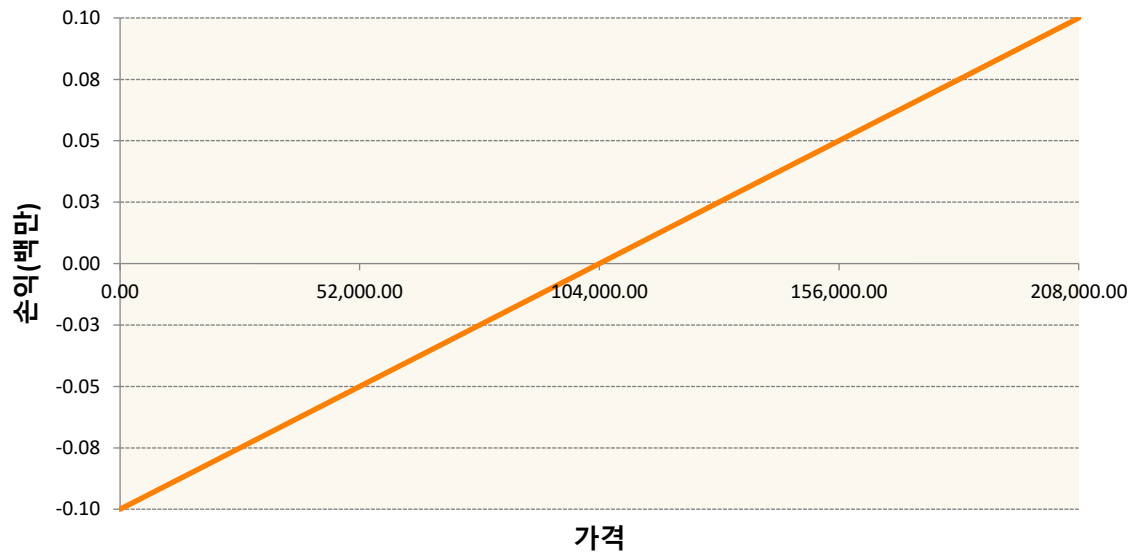
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	926	0	926	장내

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%	-25	-25	-25	-25	-25	-25	-25
-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%	25	25	25	25	25	25	25
8.00%	38	38	38	38	38	38	38
KR4150S60005		2022-06 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)

82

공시일 2022-06-08

기준일 2022-06-07

코리아인덱스(주식-파생형)(종)

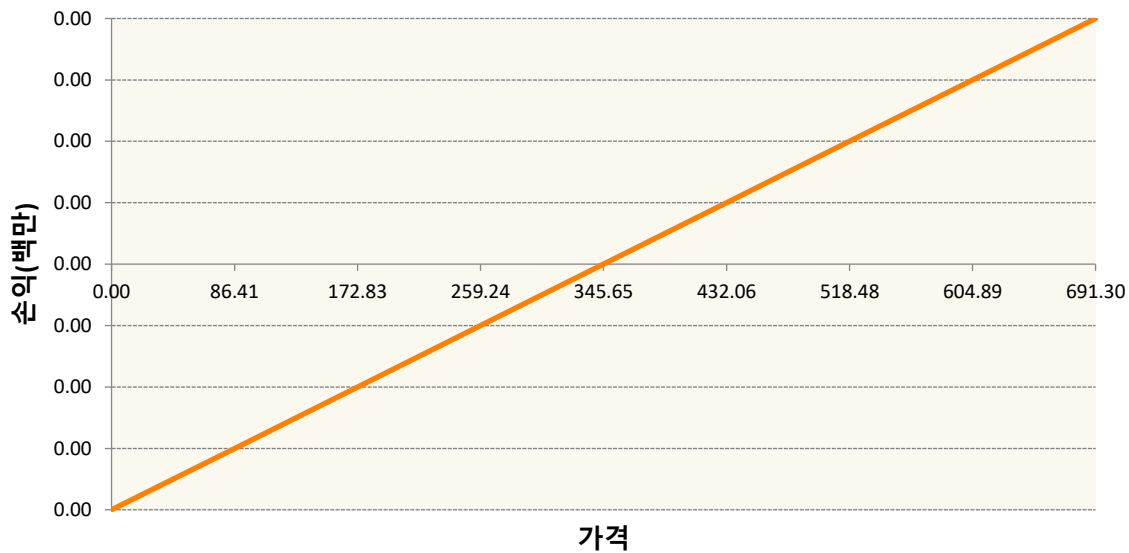
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	432	0	432	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101S90005-2022-09 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101S90005				2022-09 코스피200지수선물				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	

공시일 2022-06-08

기준일 2022-06-07

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

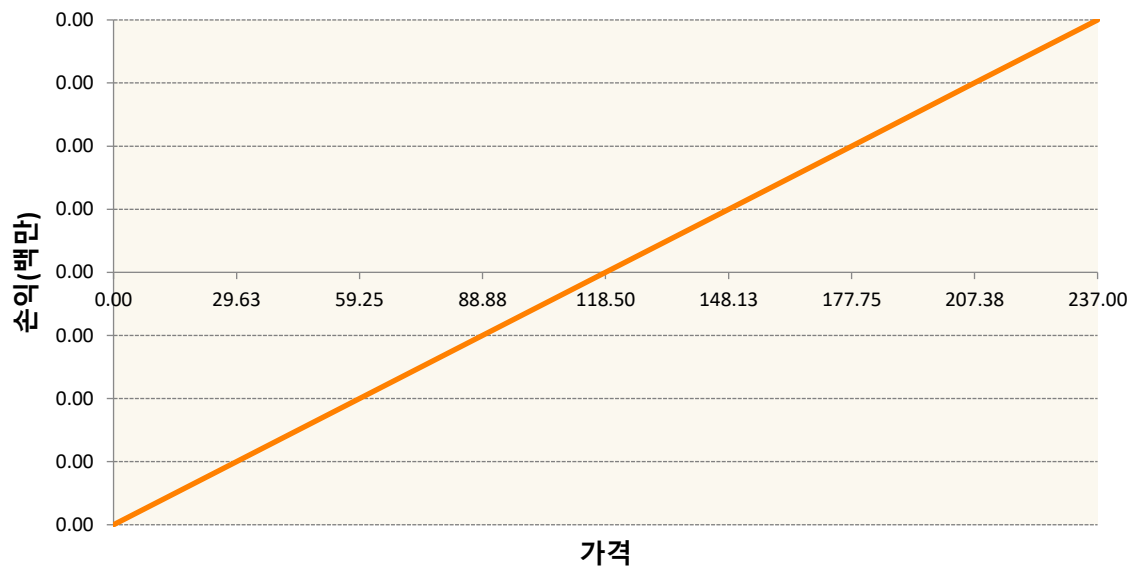
1. 계약금액

(단위:백만원)

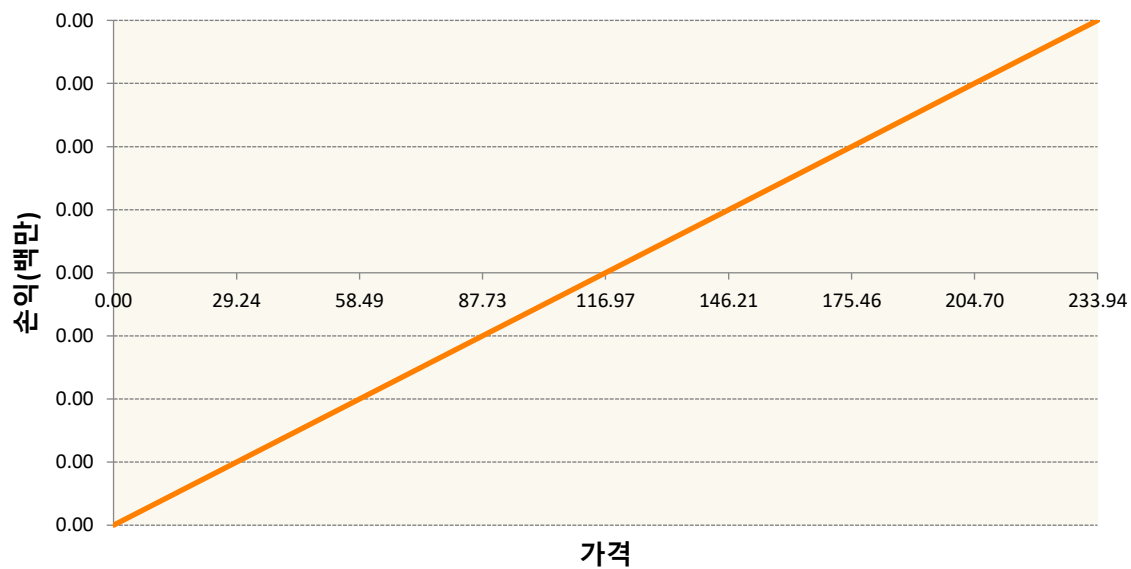
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,219	629	2,590	

2. 만기시점의 손익구조

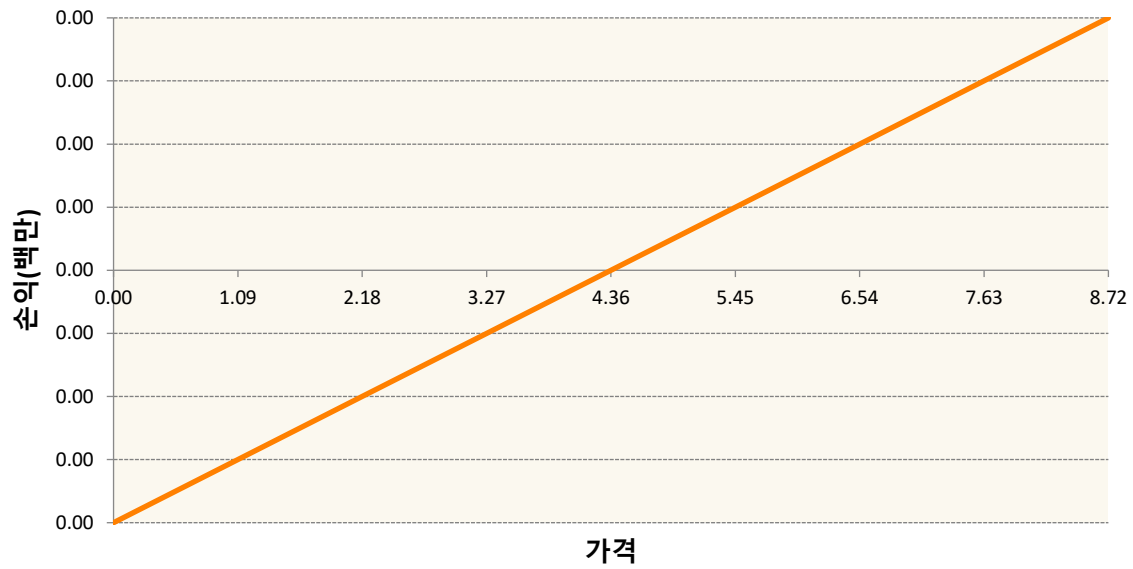
CLN2-WTI CRUDE FUTURE Jul22



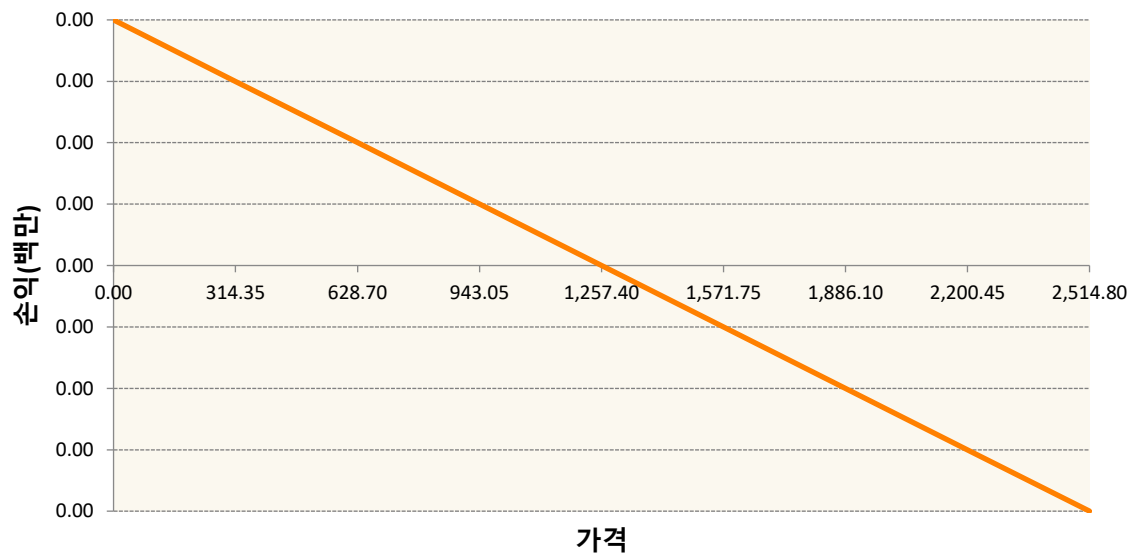
COU2-BRENT CRUDE FUTR Sep22



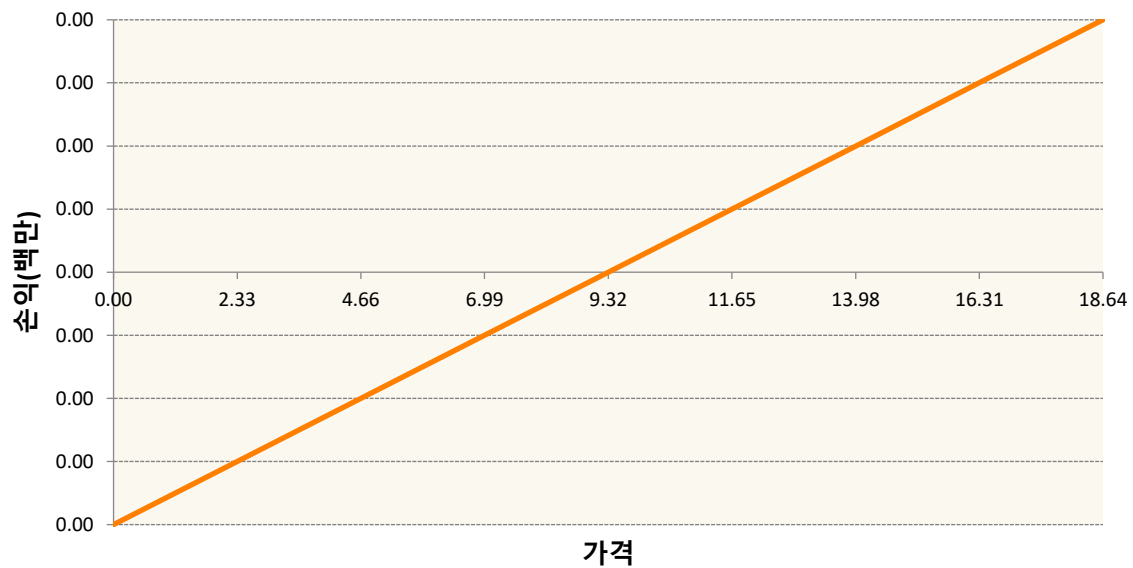
HON2-NY Harb ULSD Fut Jul22



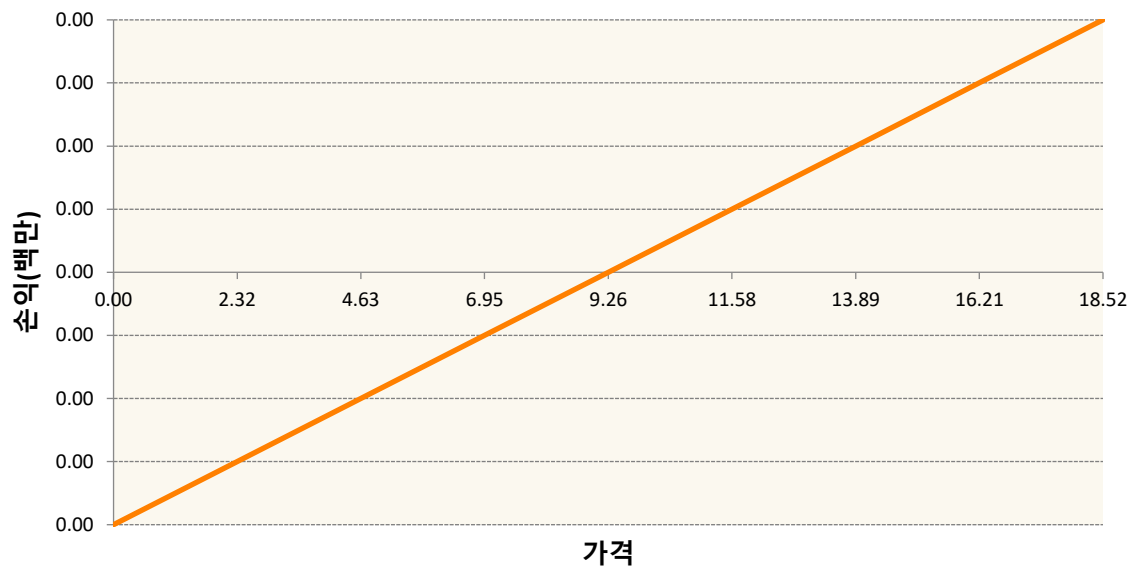
KR4175S60002-2022-06 달러선물



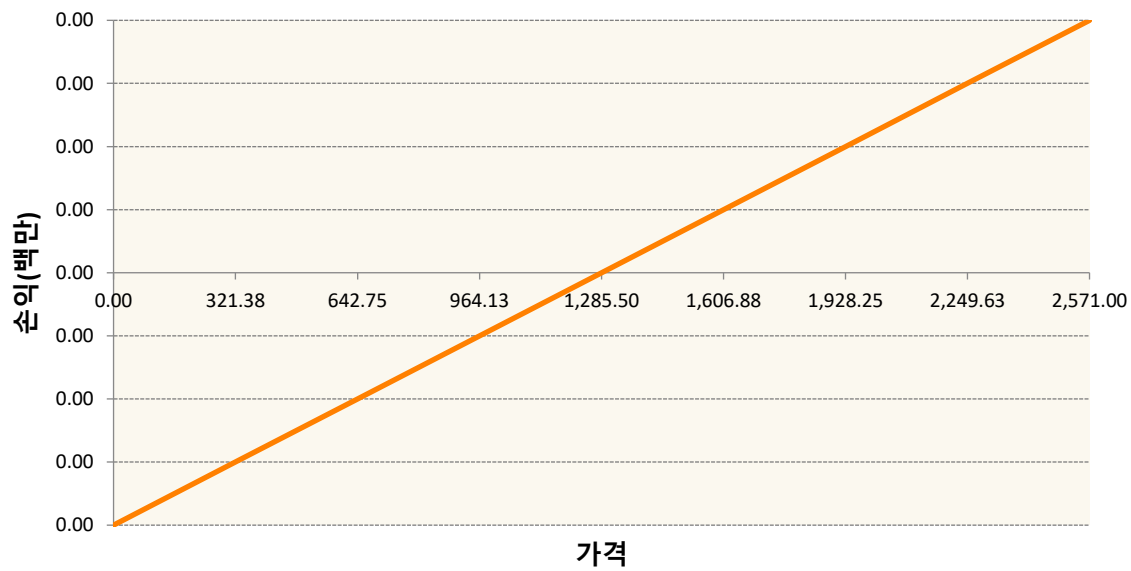
NGN22-NATURAL GAS FUTR Jul22



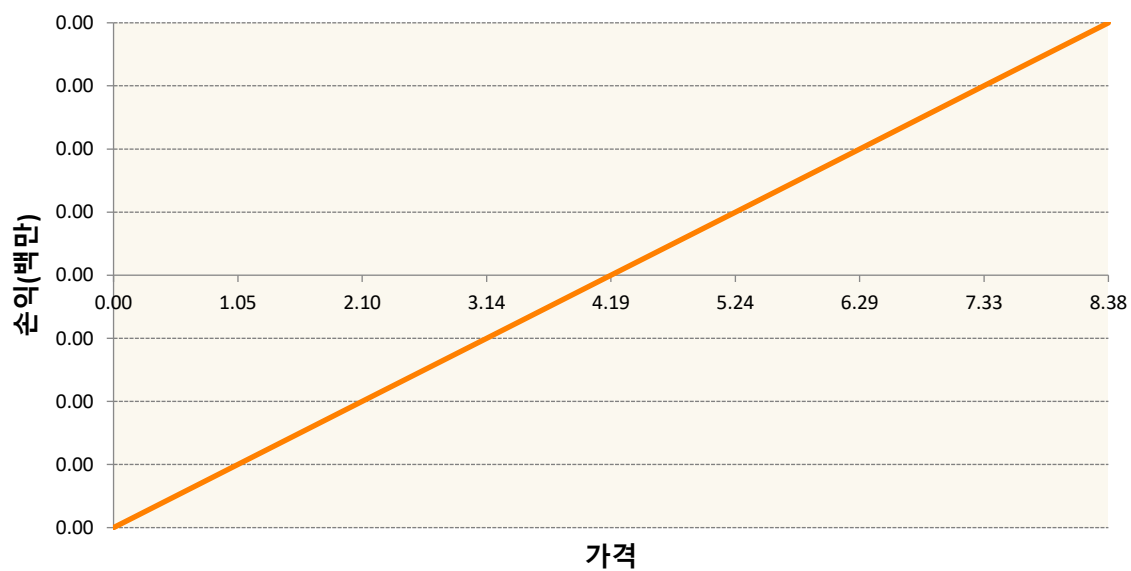
NGU22-NATURAL GAS FUTR Sep22



QSN2-Low Su Gasoil G Jul22



XBN2-GASOLINE RBOB FUT Jul22



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLN2	WTI CRUDE FUTURE Jul22	47
COU2	BRENT CRUDE FUTR Sep22	48
HON2	NY Harb ULSD Fut Jul22	18
KR4175S600	2022-06 달러선물	50
NGN22	NATURAL GAS FUTR Jul22	92
NGU22	NATURAL GAS FUTR Sep22	9
QSN2	Low Su Gasoil G Jul22	25
XBN2	GASOLINE RBOB FUT Jul22	17

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

773