펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2020-04-20

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	0	0	장내
누계	주가지수	선물	1,084	0	1,084	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	4	2,040	-2,036	장내
합계			1,088	2,040	-952	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	54

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	938

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

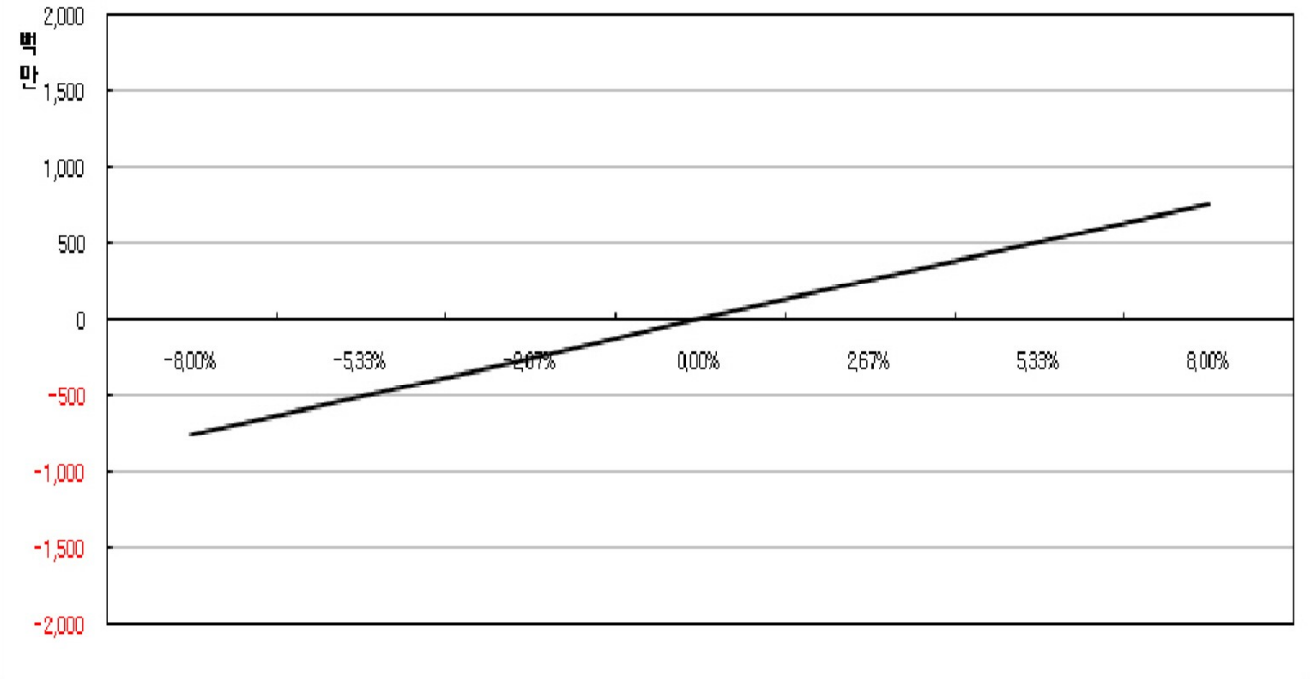
공시일: 2020-04-20

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	0	0	장내
누계	주가지수	선물	1,020	0	1,020	장내
합계			1,020	0	1,020	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

82

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

562

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

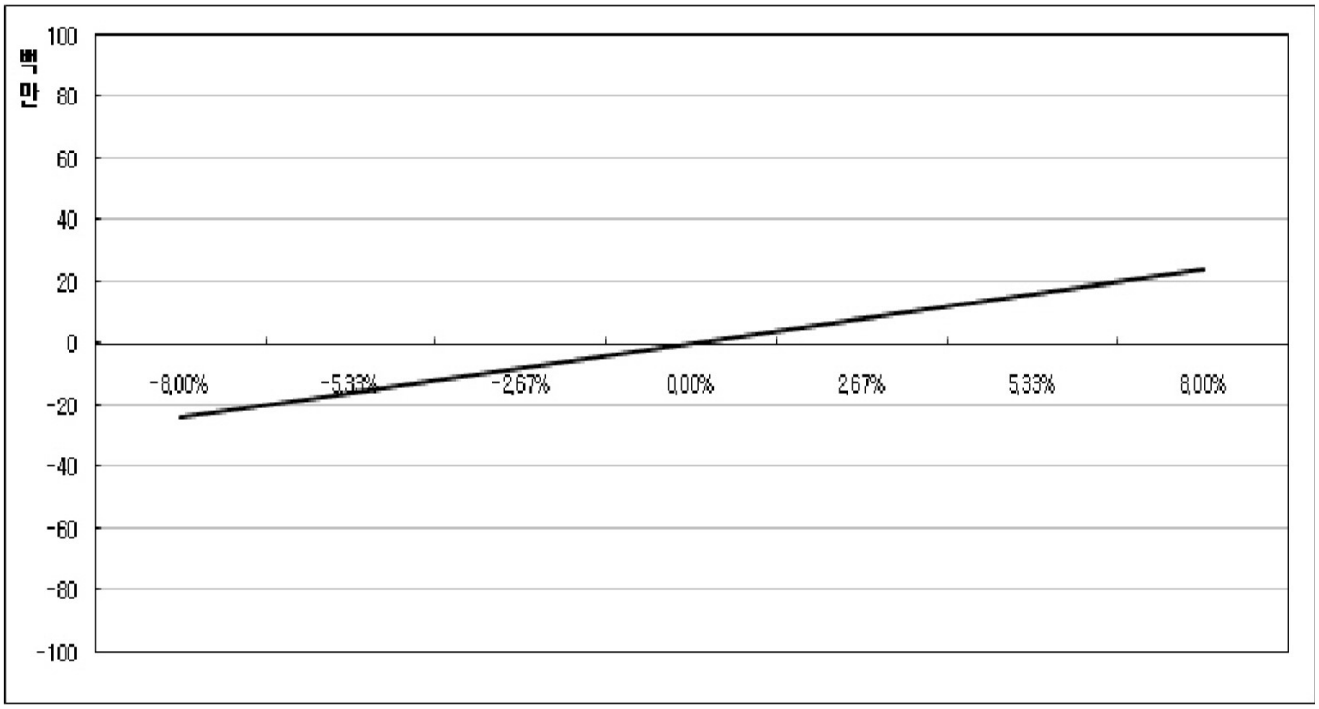
공시일: 2020-04-20

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	0	0	장내
누계	주가지수	선물	2,678	0	2,678	장내
합계			2,678	0	2,678	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

214

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

906

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

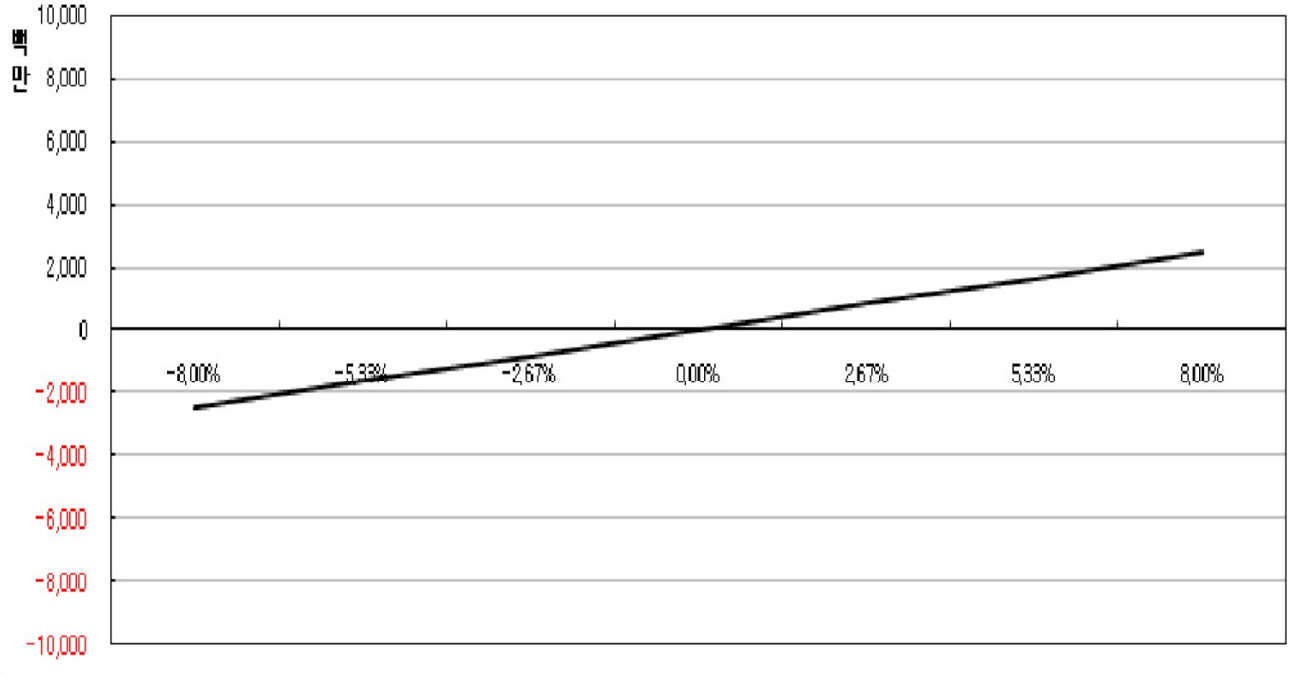
공시일: 2020-04-20

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	319	-319	장내
누계	주가지수	선물	8,862	0	8,862	장내
합계			8,862	0	8,862	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

708

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

1,711

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

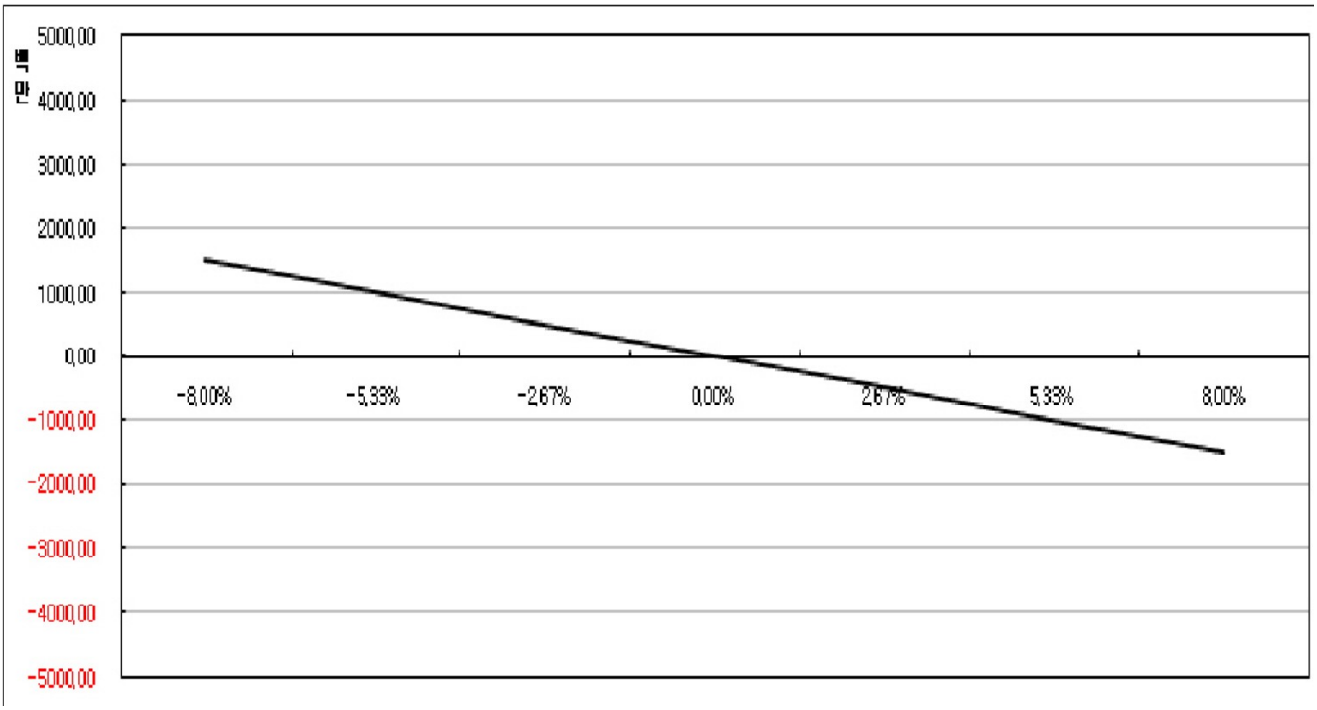
공시일: 2020-04-20

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	0	0	장내
누계	주가지수	선물	0	1,594	-1,594	장내
합계			0	1,594	-1,594	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

127

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

190

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

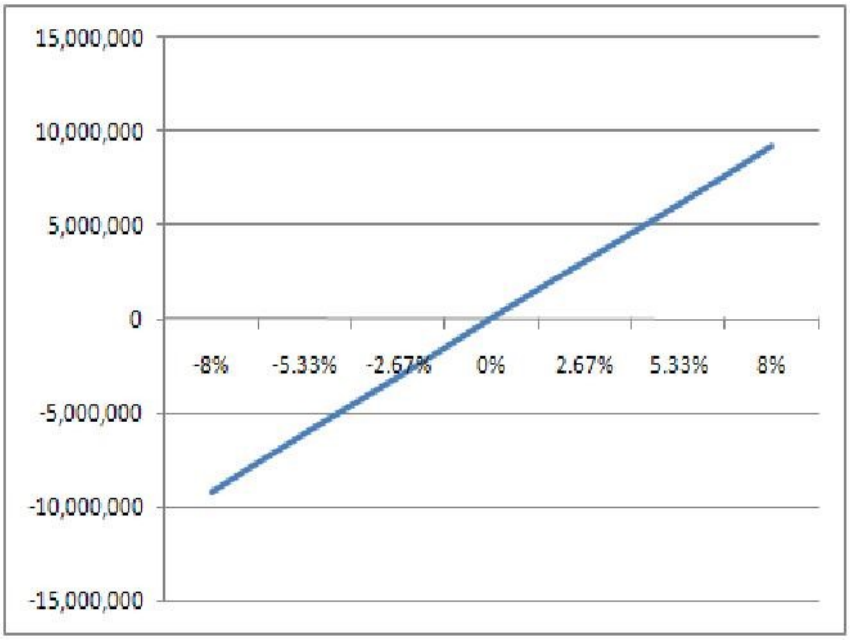
공시일: 2020-04-20

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	1,530	0	1,530	장내
누계	주가지수	선물	79,184	0	79,184	장내
합계			79,184	0	79,184	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

6,328

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

15,748