펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2020-04-23

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	1,070	0	1,070	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	6	2,015	-2,009	장내
합계			1,077	2,015	-938	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	48

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	592

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

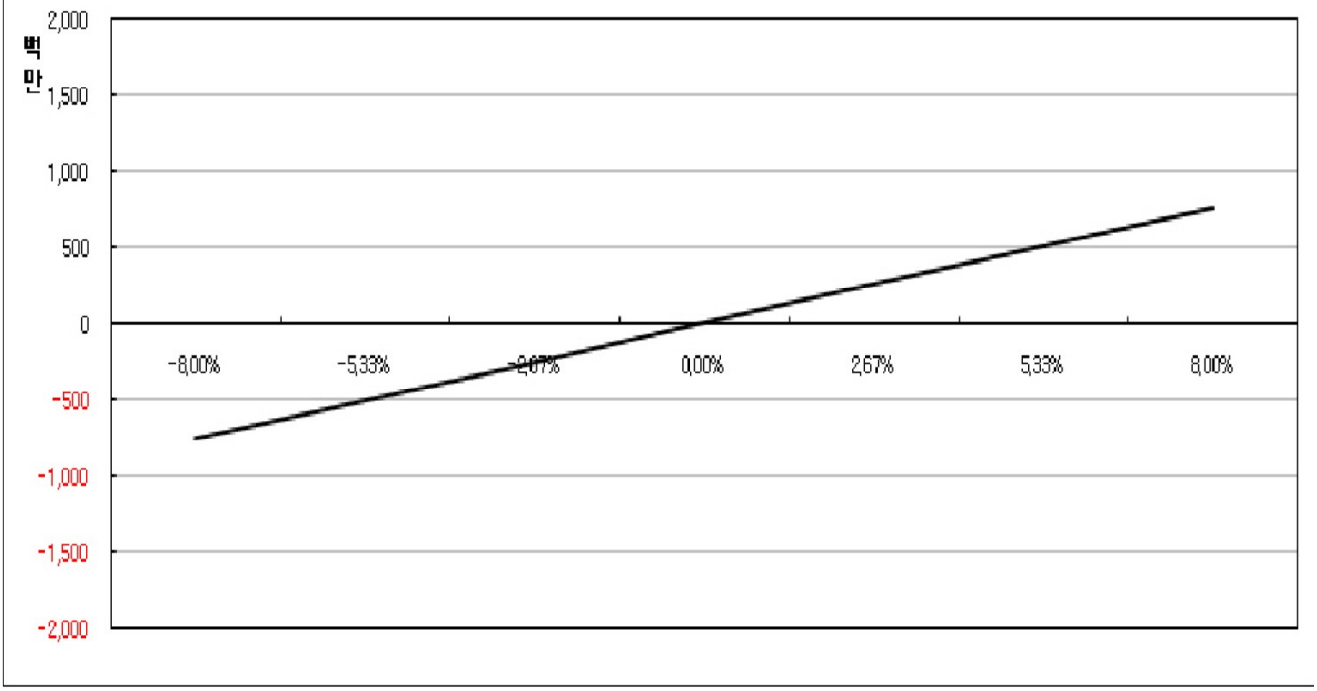
공시일: 2020-04-23

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	1,008	0	1,008	장내
합계			1,008	0	1,008	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

80

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

554

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

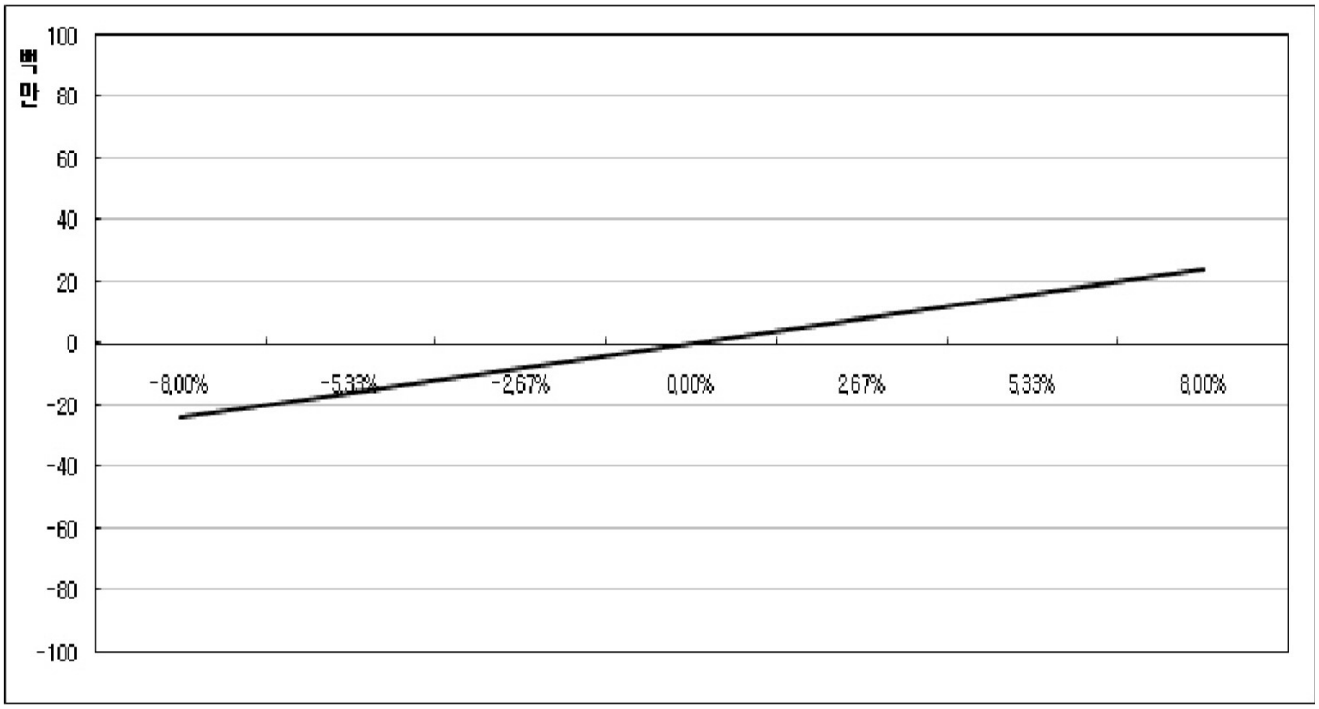
공시일: 2020-04-23

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	2,645	0	2,645	장내
합계			2,645	0	2,645	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

211

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

892

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

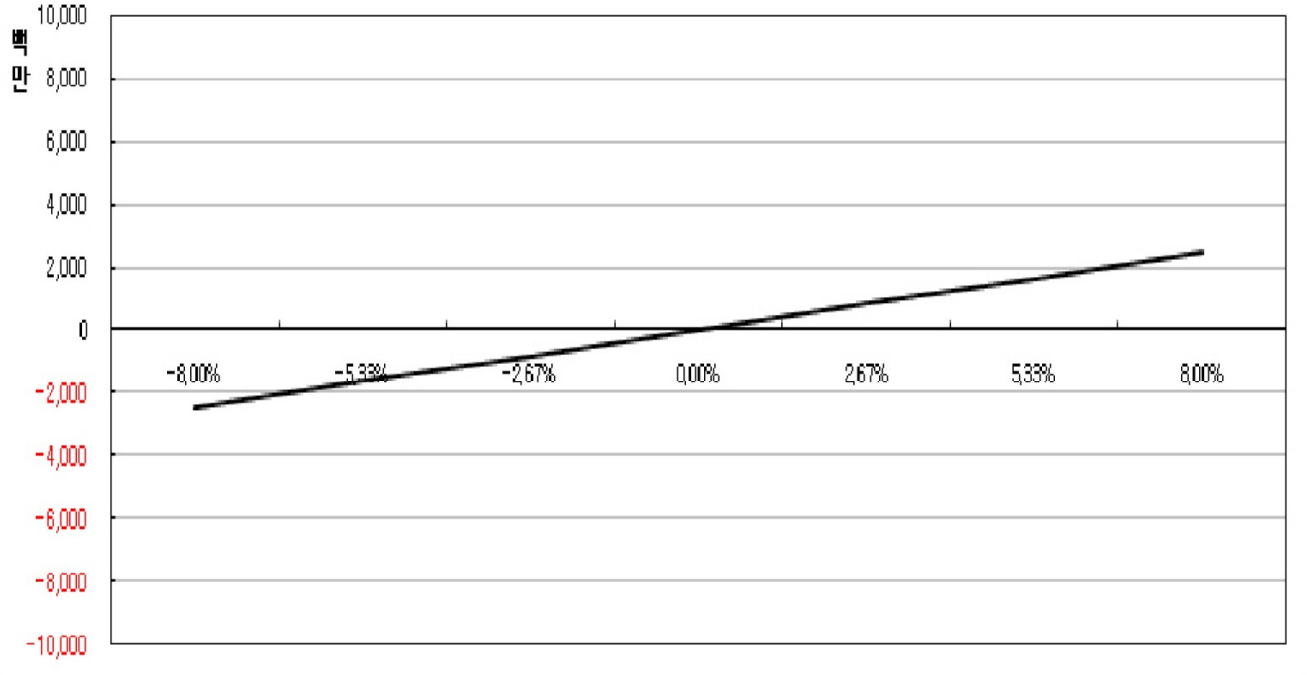
공시일: 2020-04-23

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	126	63	63	장내
누계	주가지수	선물	8,816	0	8,816	장내
합계			8,816	0	8,816	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

702

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

1,690

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

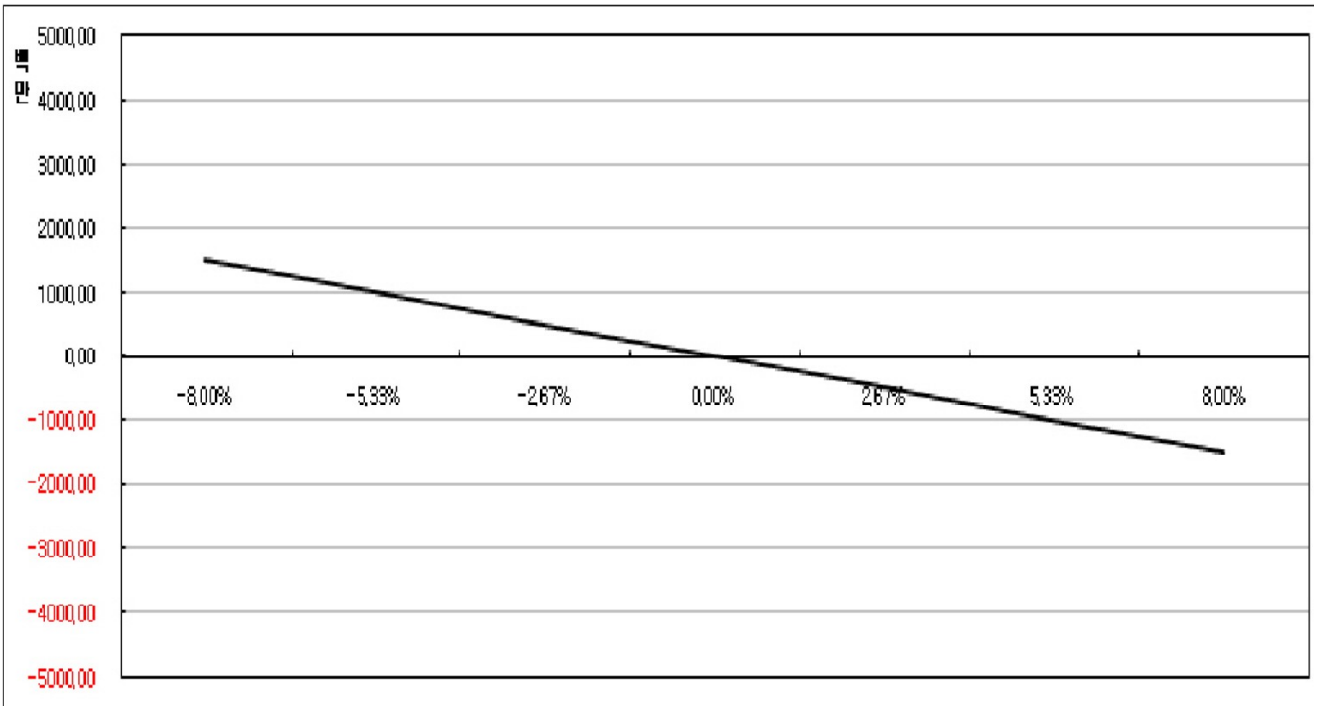
공시일: 2020-04-23

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	63	0	63	장내
누계	주가지수	선물	0	1,574	-1,574	장내
합계			0	1,574	-1,574	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

125

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

187

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

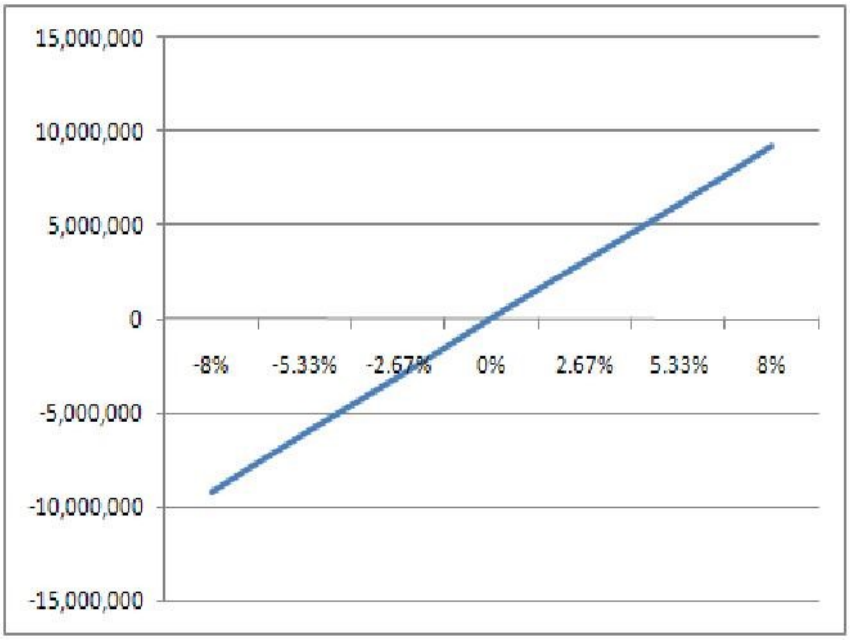
공시일: 2020-04-23

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	1,385	0	1,385	장내
누계	주가지수	선물	78,272	0	78,272	장내
합계			78,272	0	78,272	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

6,234

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

15,502