펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2020-05-04

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	1,097	0	1,097	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	2	2,065	-2,063	장내
합계			1,099	2,065	-966	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	64

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	548

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

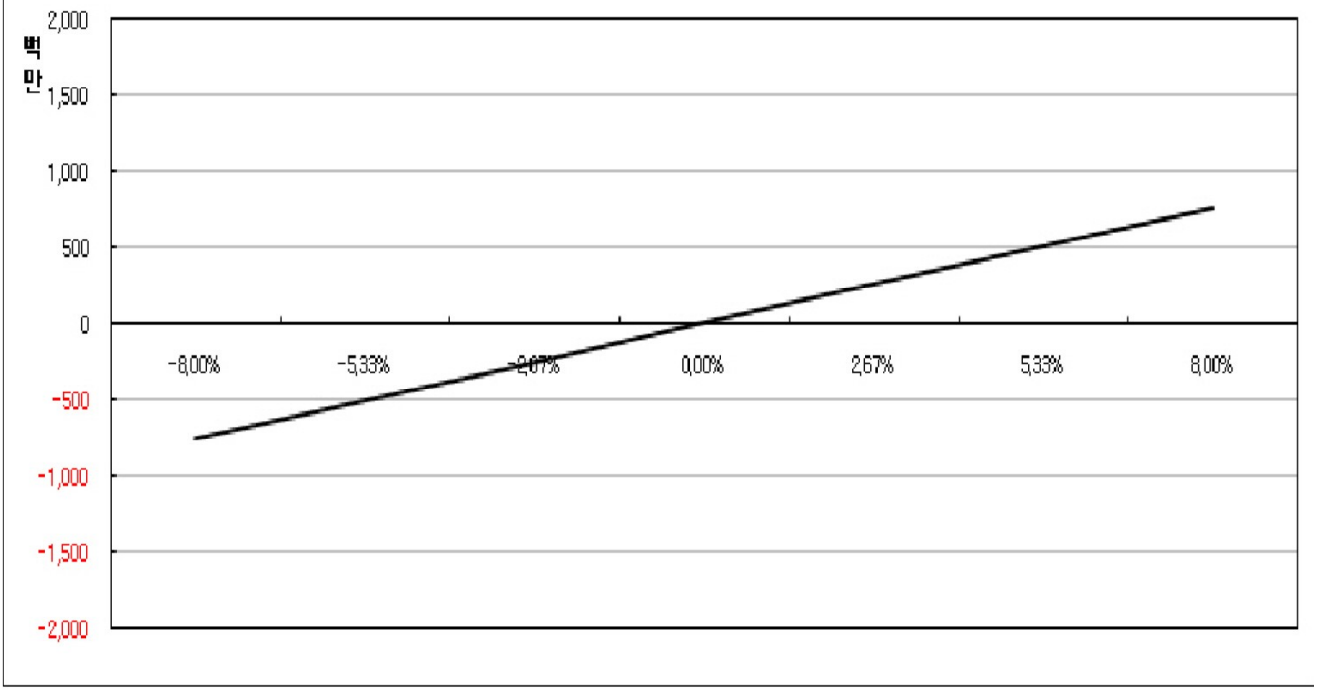
공시일: 2020-05-04

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	1,033	0	1,033	장내
합계			1,033	0	1,033	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

83

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

568

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

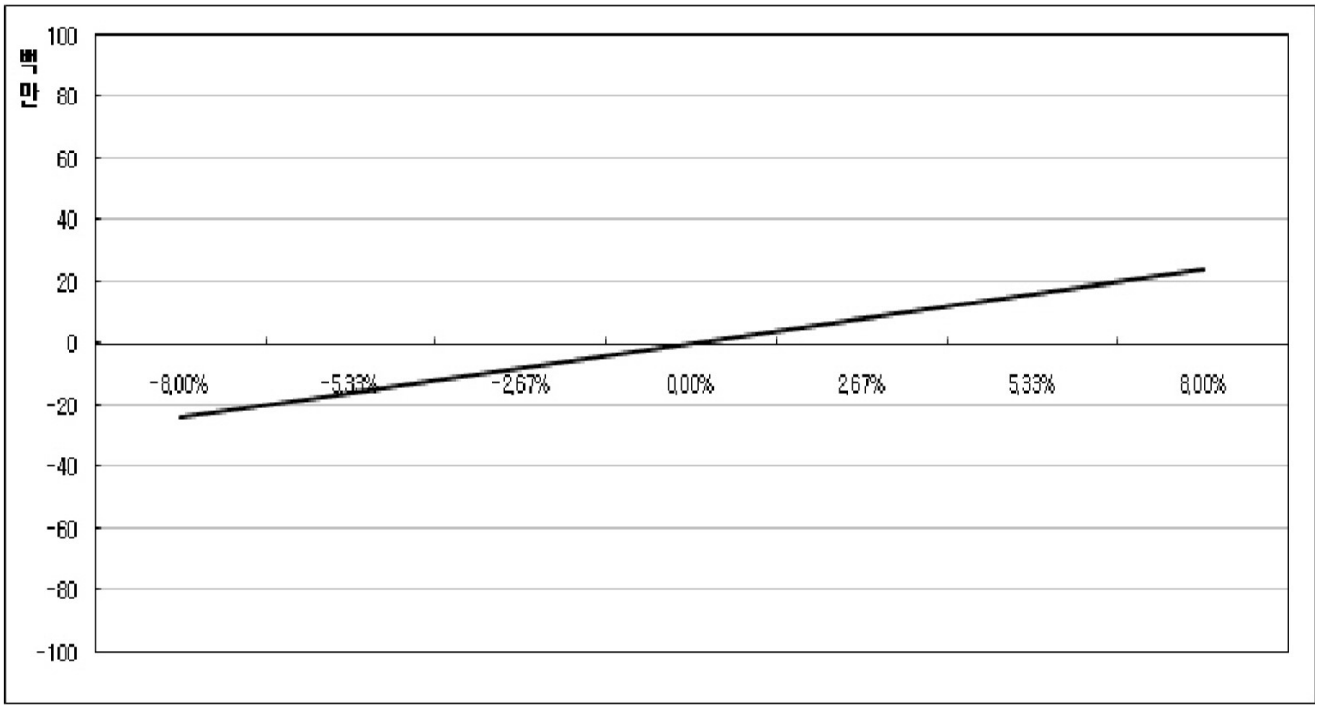
공시일: 2020-05-04

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	2,259	0	2,259	장내
합계			2,259	0	2,259	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

181

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

908

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

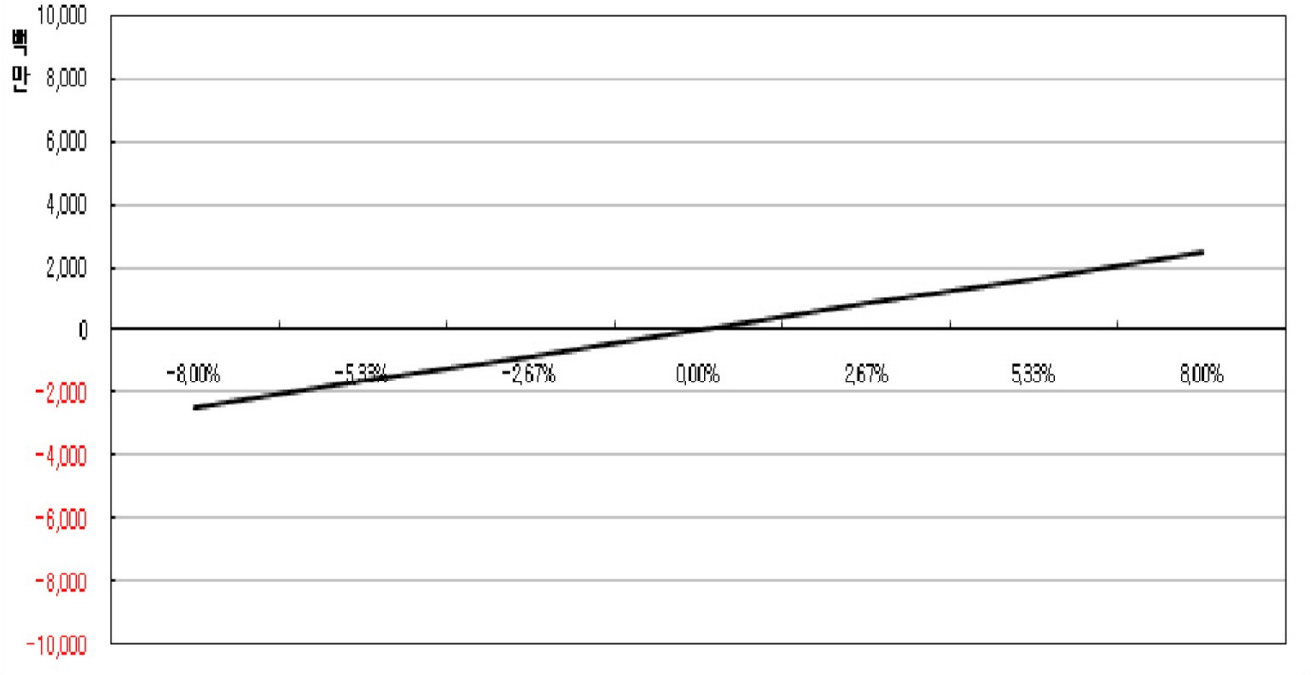
공시일: 2020-05-04

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	8,390	0	8,390	장내
합계			8,390	0	8,390	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

671

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

1,698

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

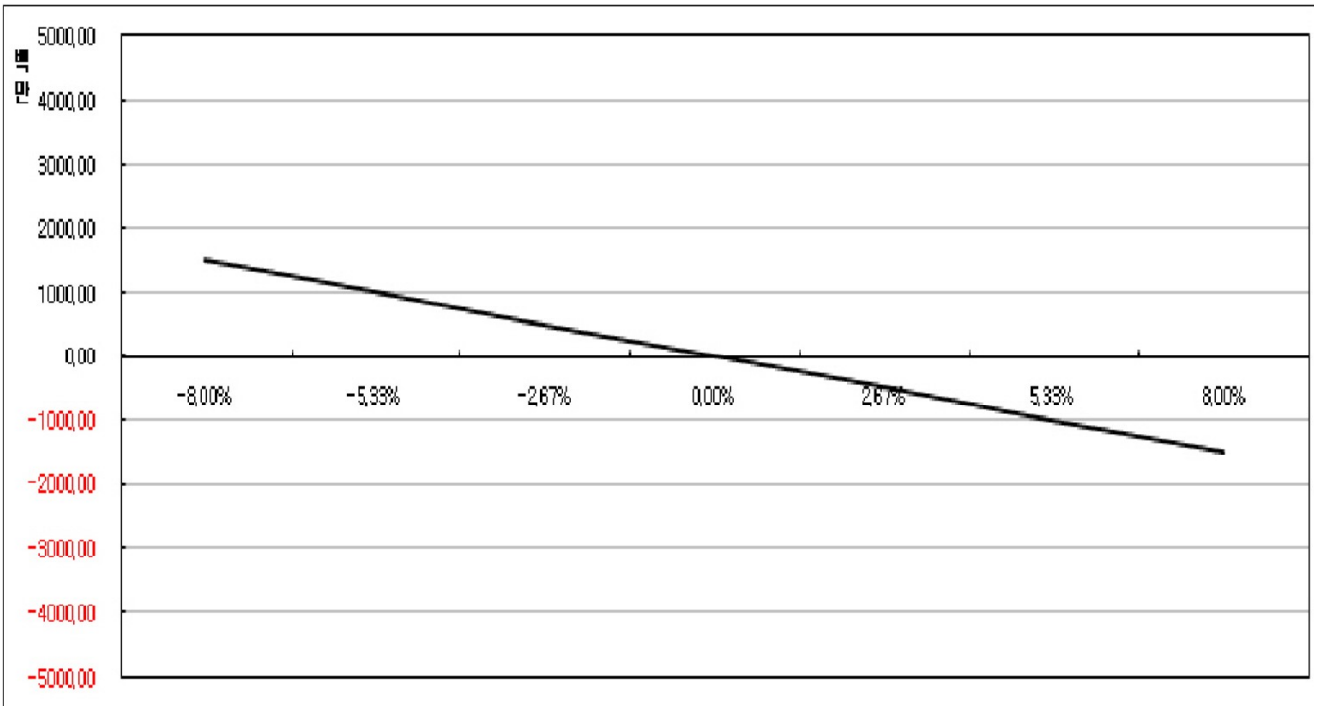
공시일: 2020-05-04

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	516	-516	장내
누계	주가지수	선물	0	2,194	-2,194	장내
합계			0	2,194	-2,194	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

176

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

263

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

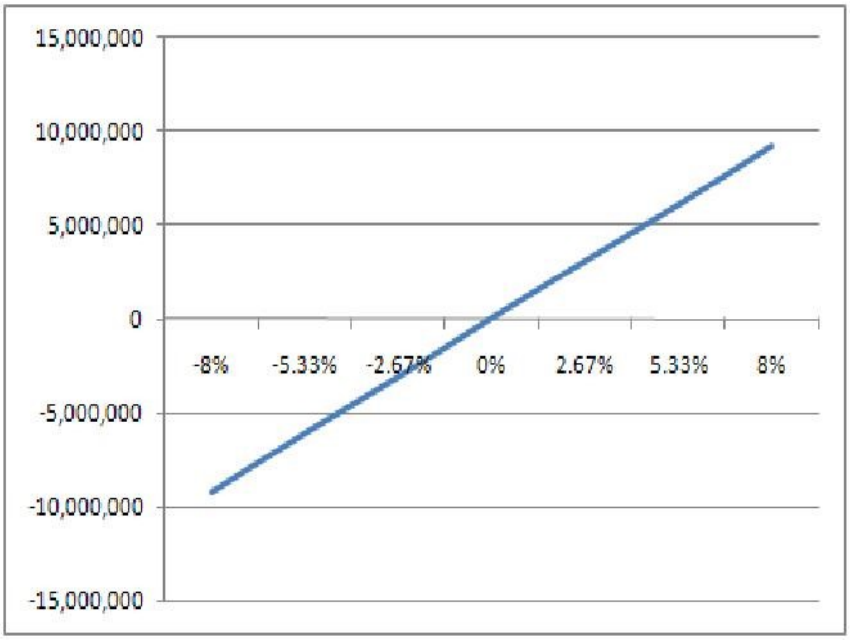
공시일: 2020-05-04

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	194	-194	장내
누계	주가지수	선물	79,639	0	79,639	장내
합계			79,639	0	79,639	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

6,370

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

15,915