펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2020-05-07

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	1	2,040	-2,039	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,084	0	1,084	장내
합계			1,085	2,040	-955	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	61

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	213

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

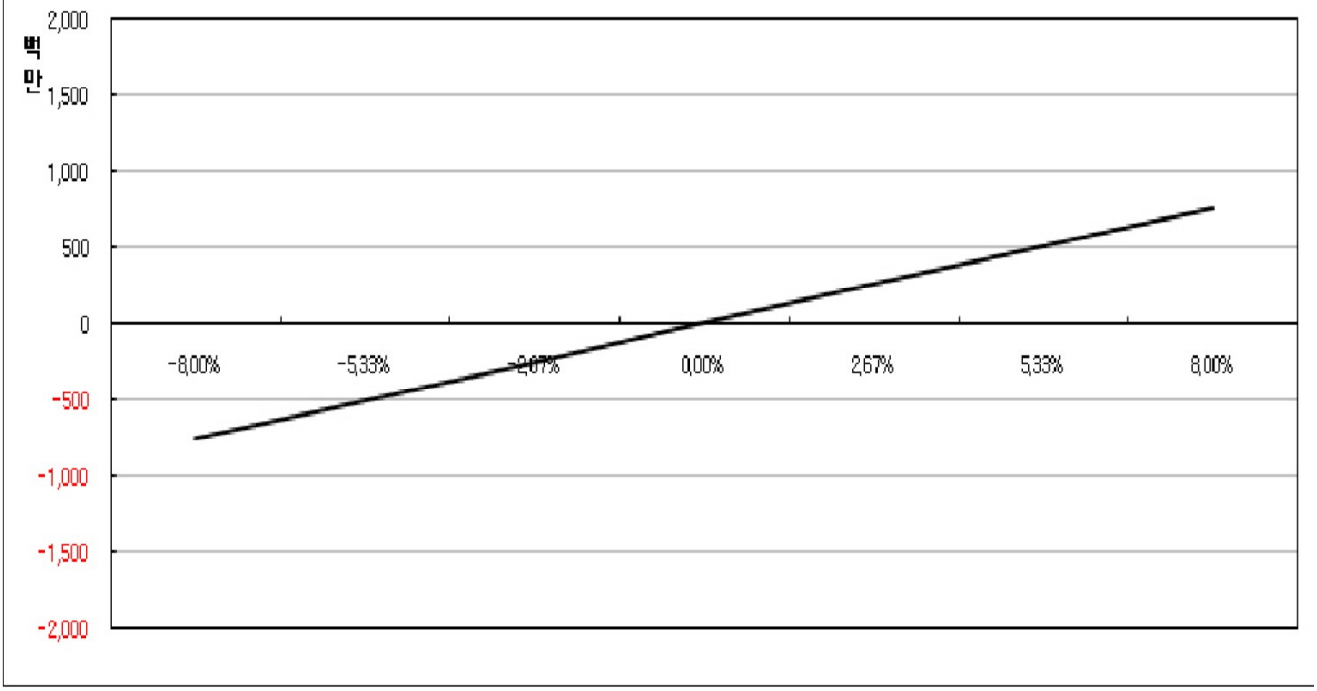
공시일: 2020-05-07

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	1,020	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)

565

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

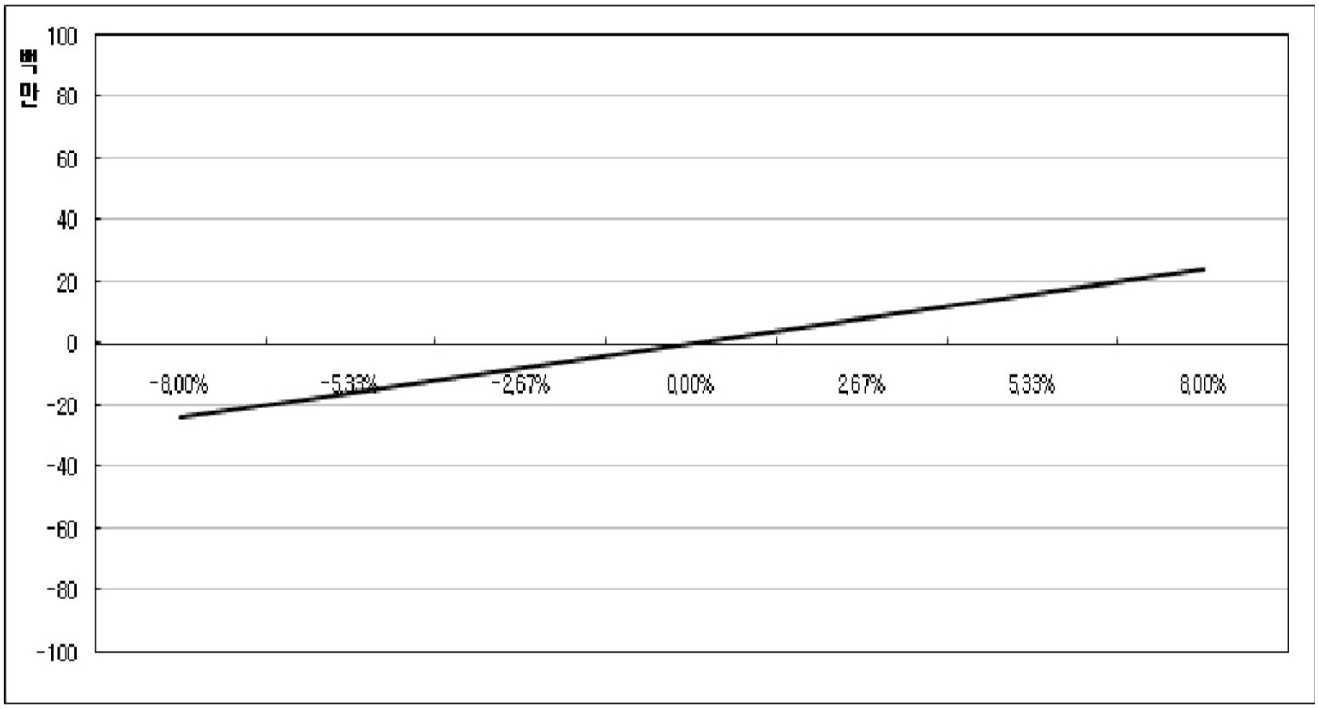
공시일: 2020-05-07

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	2,168	0	2,168	장내
합계			2,168	0	2,168	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

174

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

897

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

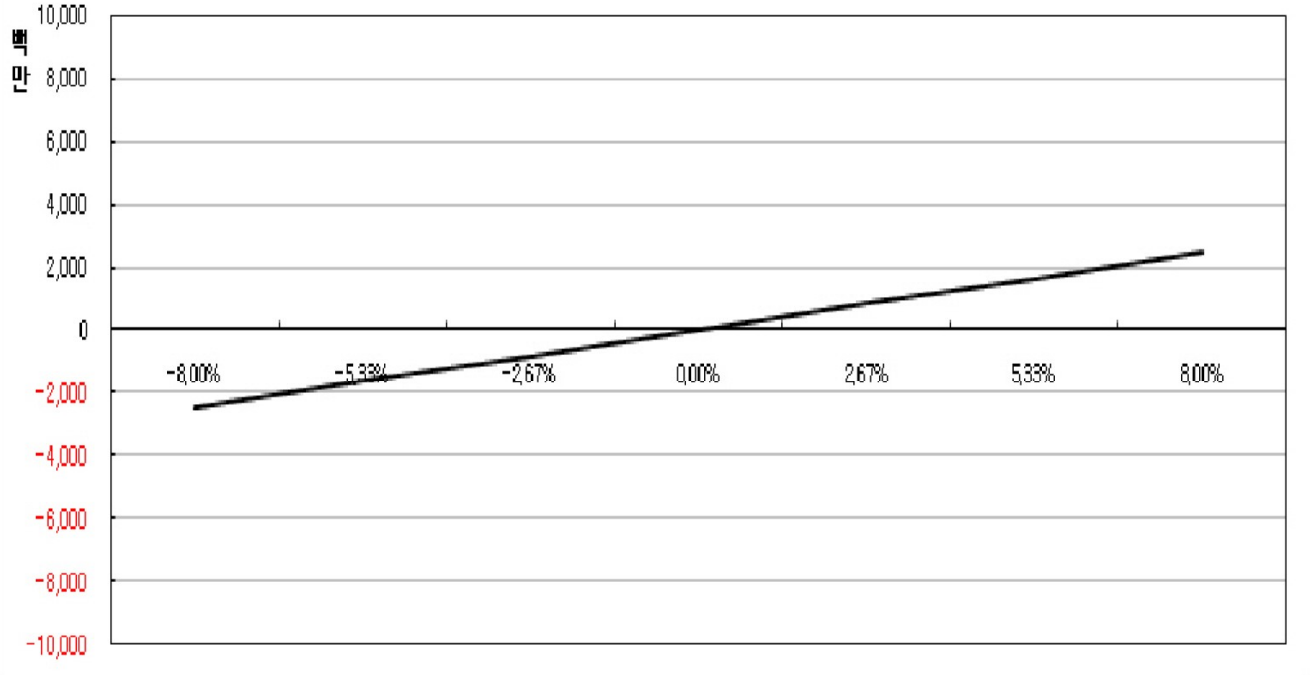
공시일: 2020-05-07

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	8,224	0	8,224	장내
합계			8,224	0	8,224	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

658

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

1,683

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

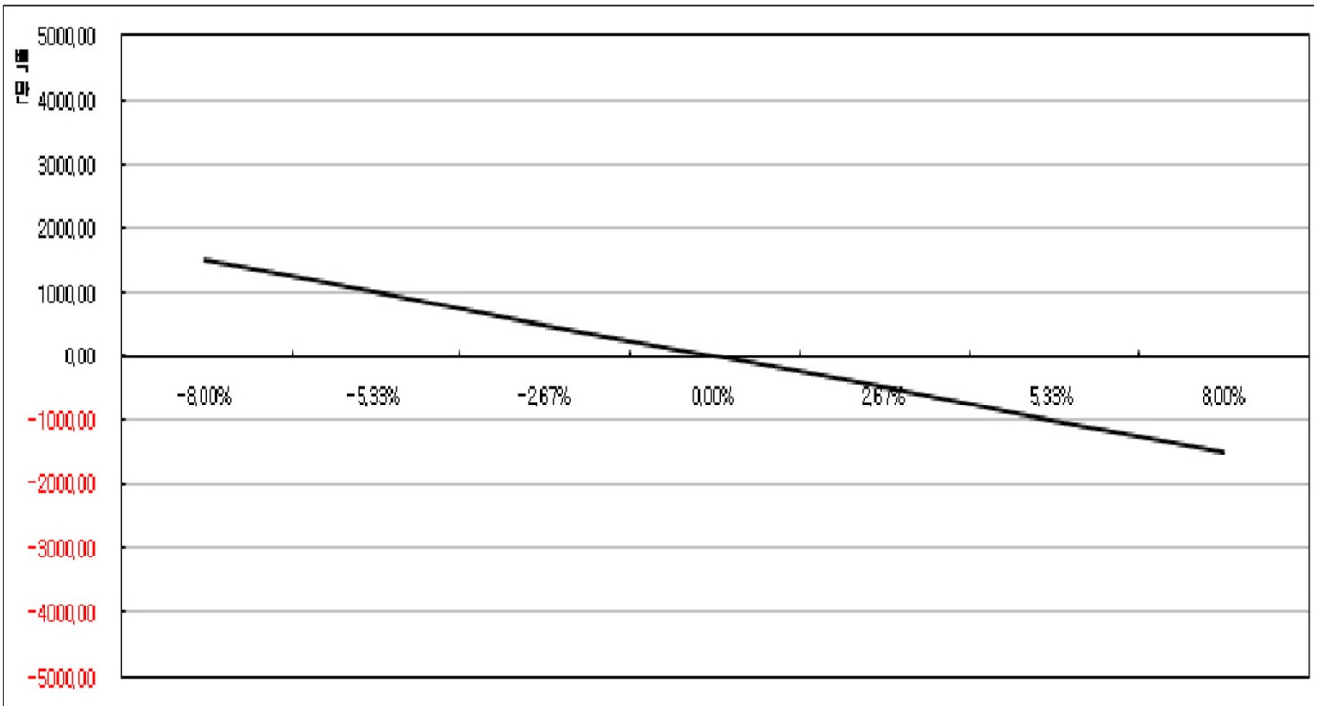
공시일: 2020-05-07

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	128	64	64	장내
누계	유가증권	선물	0	2,040	-2,040	장내
합계			0	2,040	-2,040	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

163

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

246

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

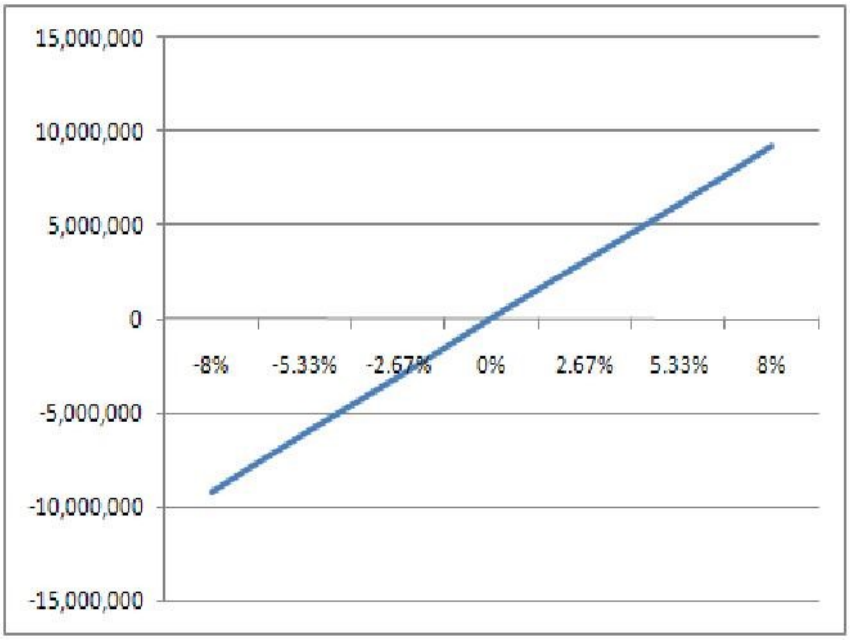
공시일: 2020-05-07

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	765	0	765	장내
누계	유가증권	선물	79,433	0	79,433	장내
합계			79,433	0	79,433	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

6,360

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

15,757