펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2020-05-11

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	0	2,053	-2,053	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,091	0	1,091	장내
합계			1,091	2,053	-962	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

69

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

162

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

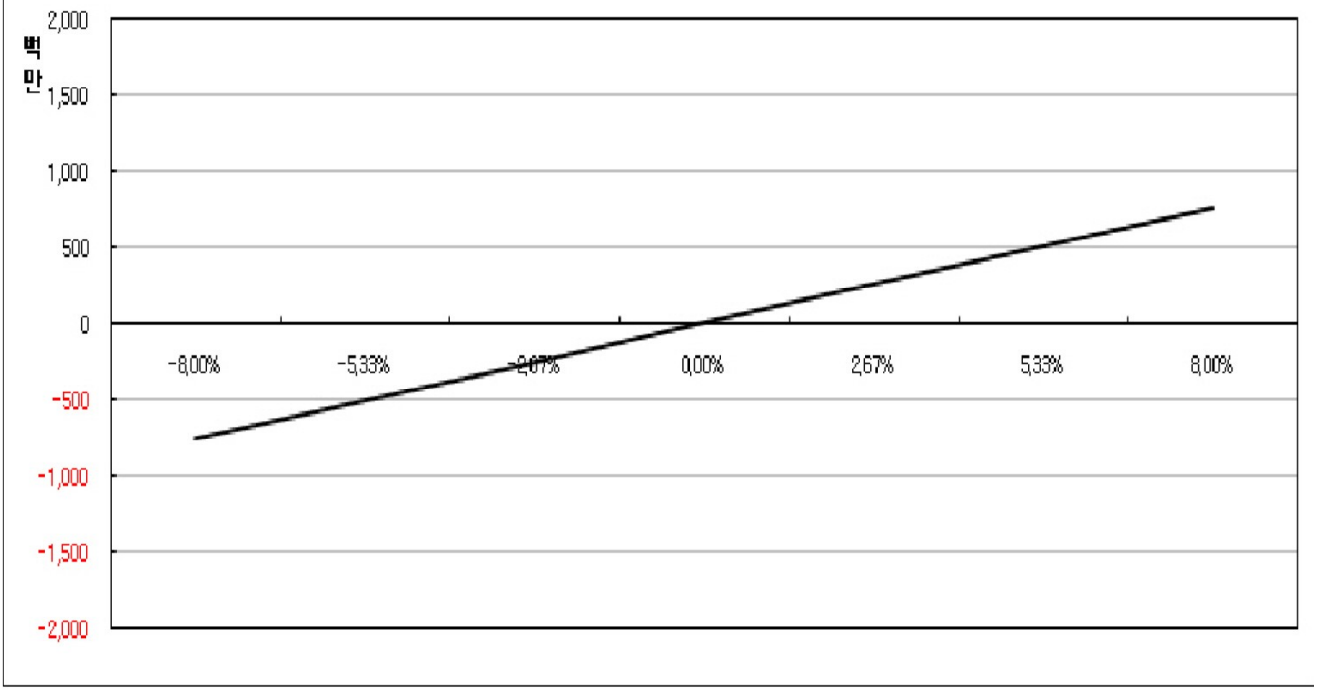
공시일: 2020-05-11

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	1,026	0	1,026	장내
합계			1,026	0	1,026	

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]

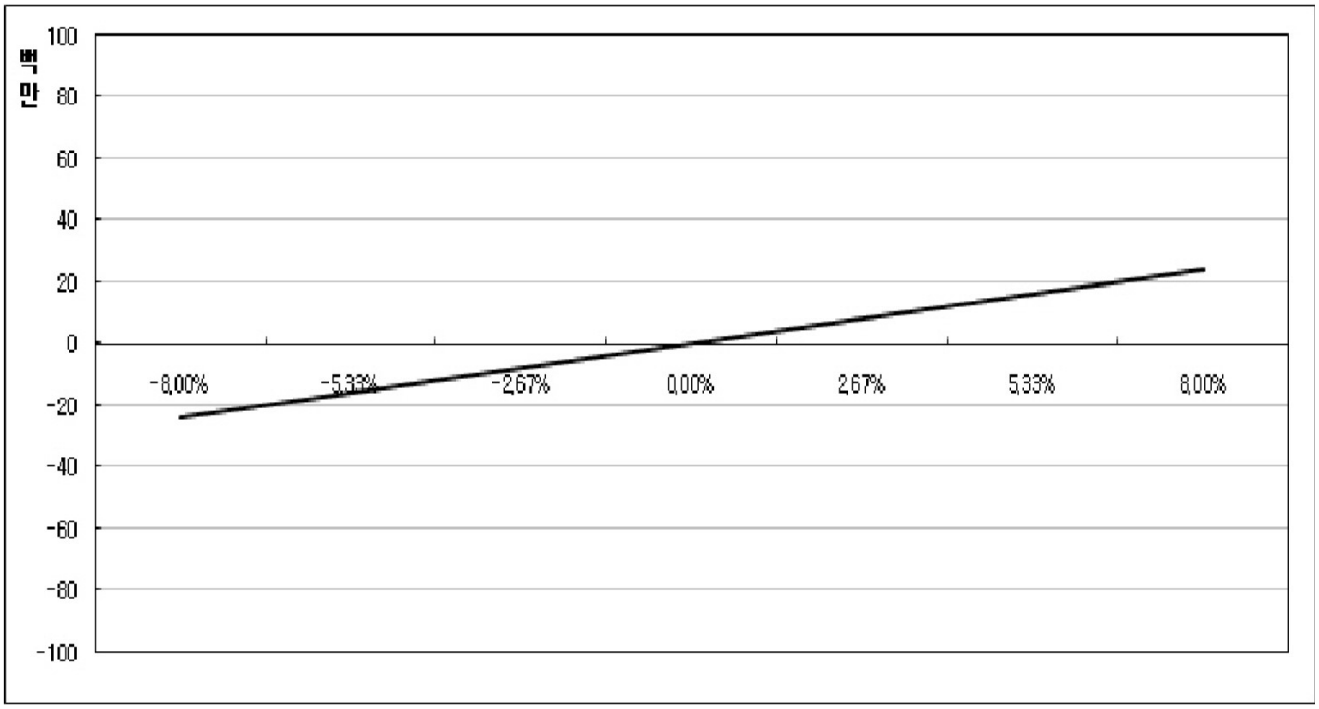
공시일: 2020-05-11

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	2,181	0	2,181	장내
합계			2,181	0	2,181	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

174

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

896

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

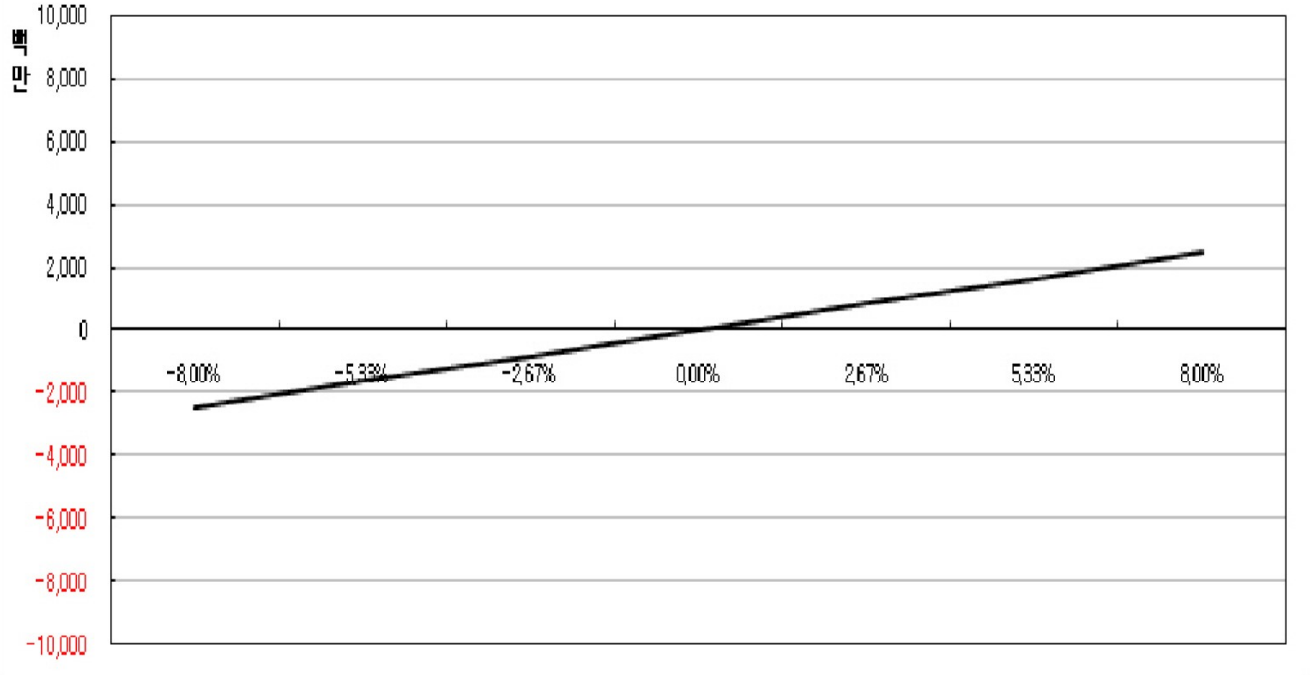
공시일: 2020-05-11

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	192	-192	장내
누계	유가증권	선물	8,084	0	8,084	장내
합계			8,084	0	8,084	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

646

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

1,659

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

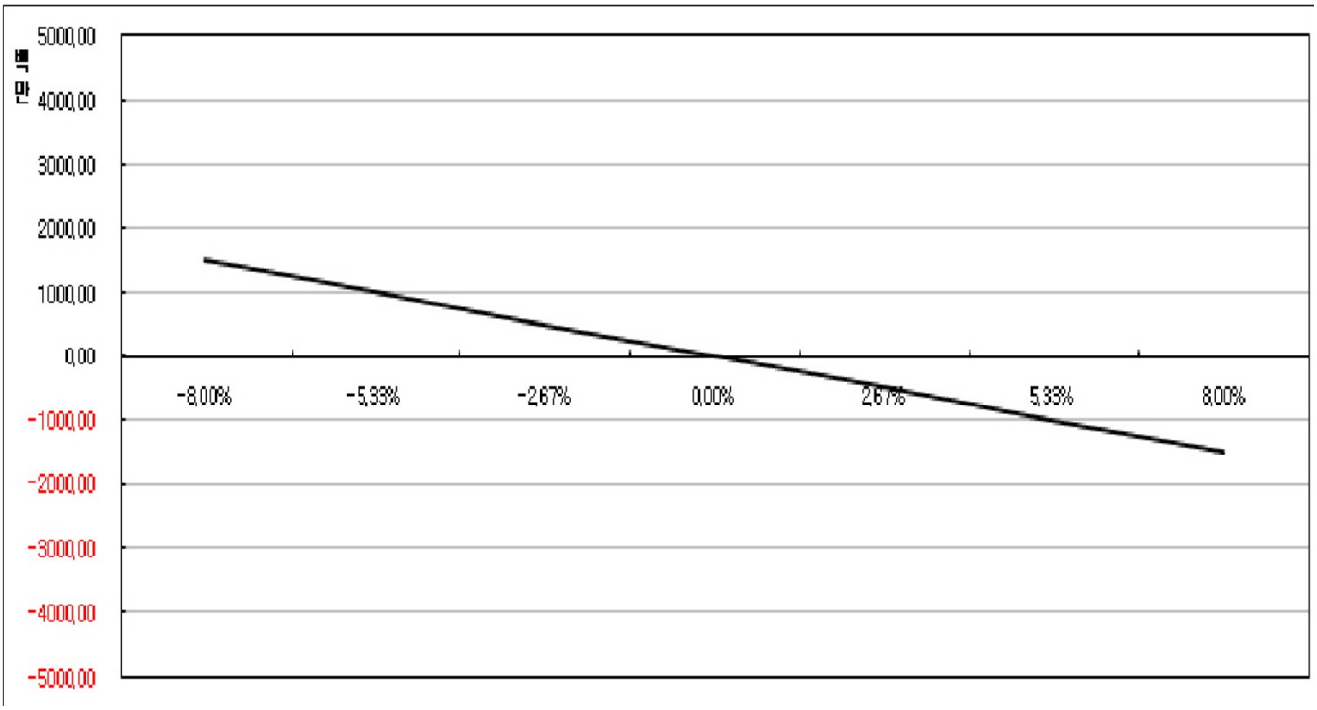
공시일: 2020-05-11

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	0	2,053	-2,053	장내
합계			0	2,053	-2,053	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

164

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

246

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

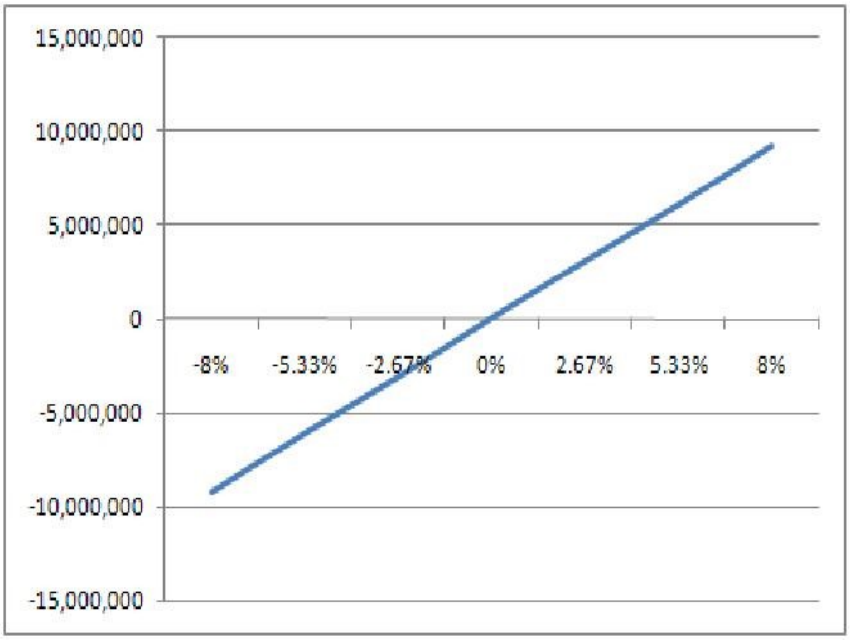
공시일: 2020-05-11

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	321	-321	장내
누계	유가증권	선물	79,167	0	79,167	장내
합계			79,167	0	79,167	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

6,328

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

15,644