펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2020-05-12

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	2,040	-2,039	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,084	0	1,084	장내
합계			1,084	2,040	-956	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	73

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	73

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

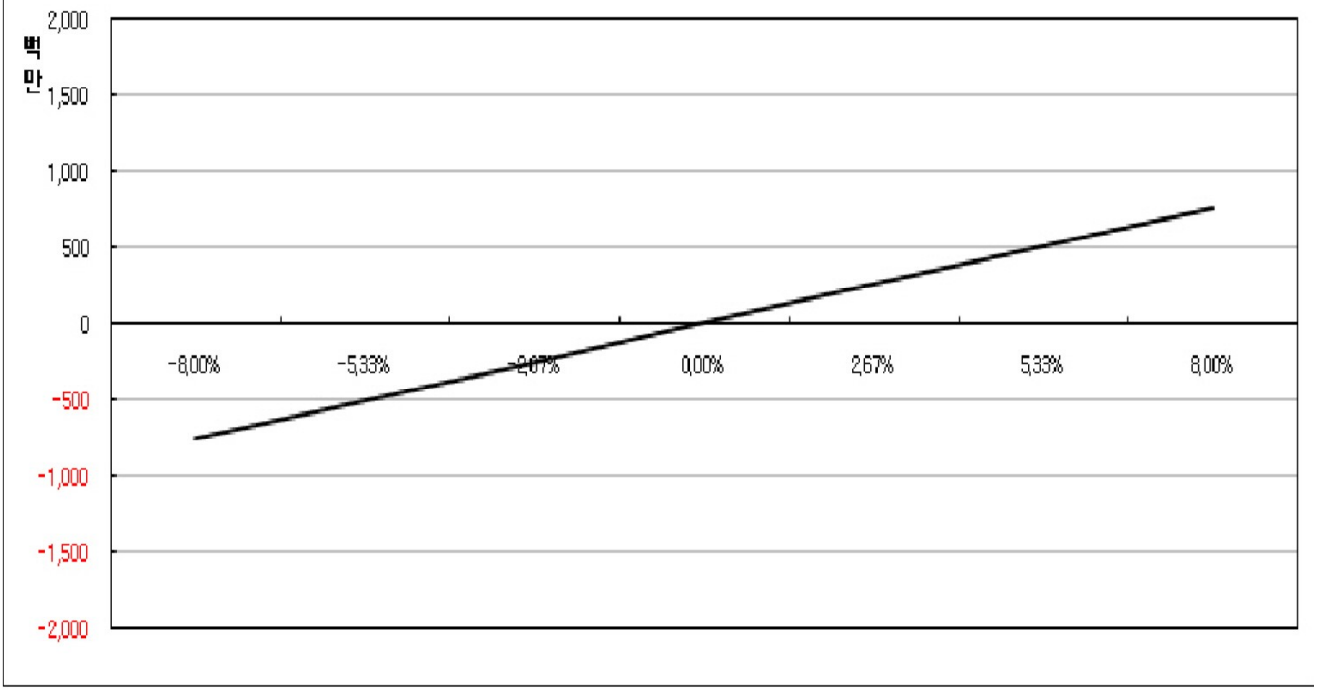
공시일: 2020-05-12

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

81

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

560

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

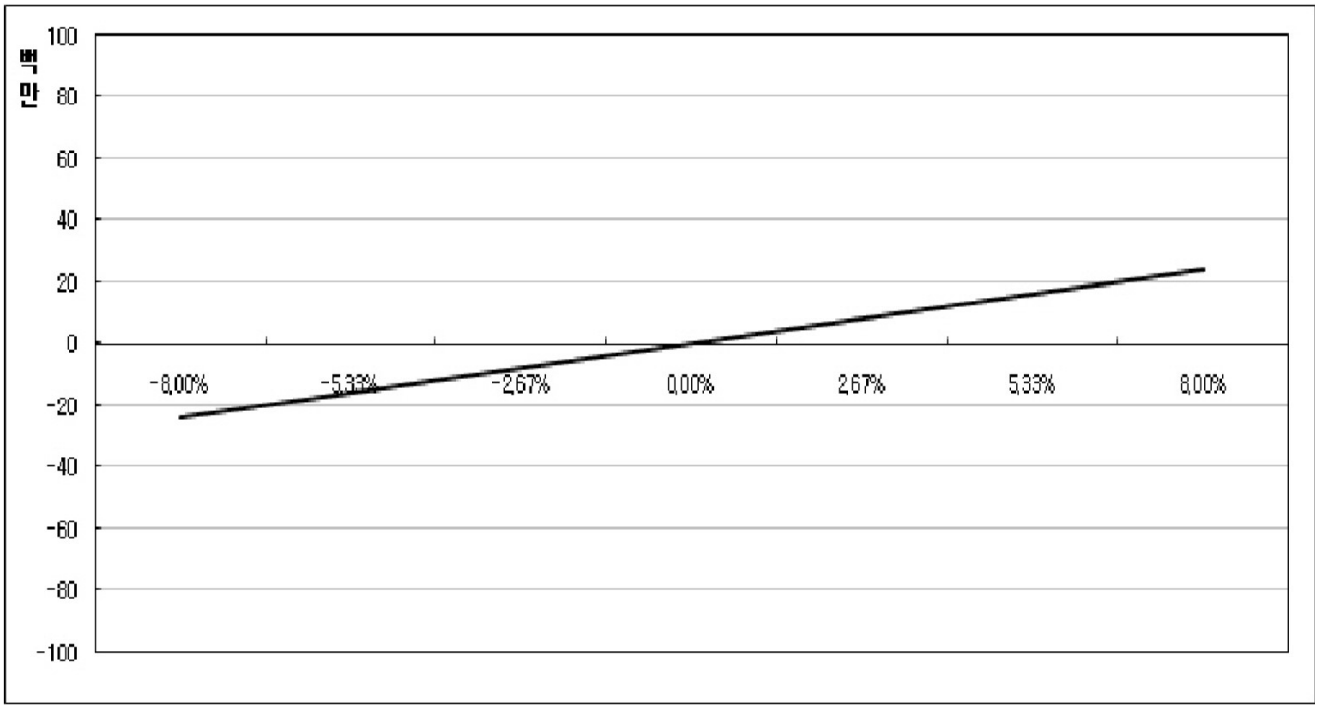
공시일: 2020-05-12

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	2,167	0	2,167	장내
합계			2,167	0	2,167	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

173

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

887

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

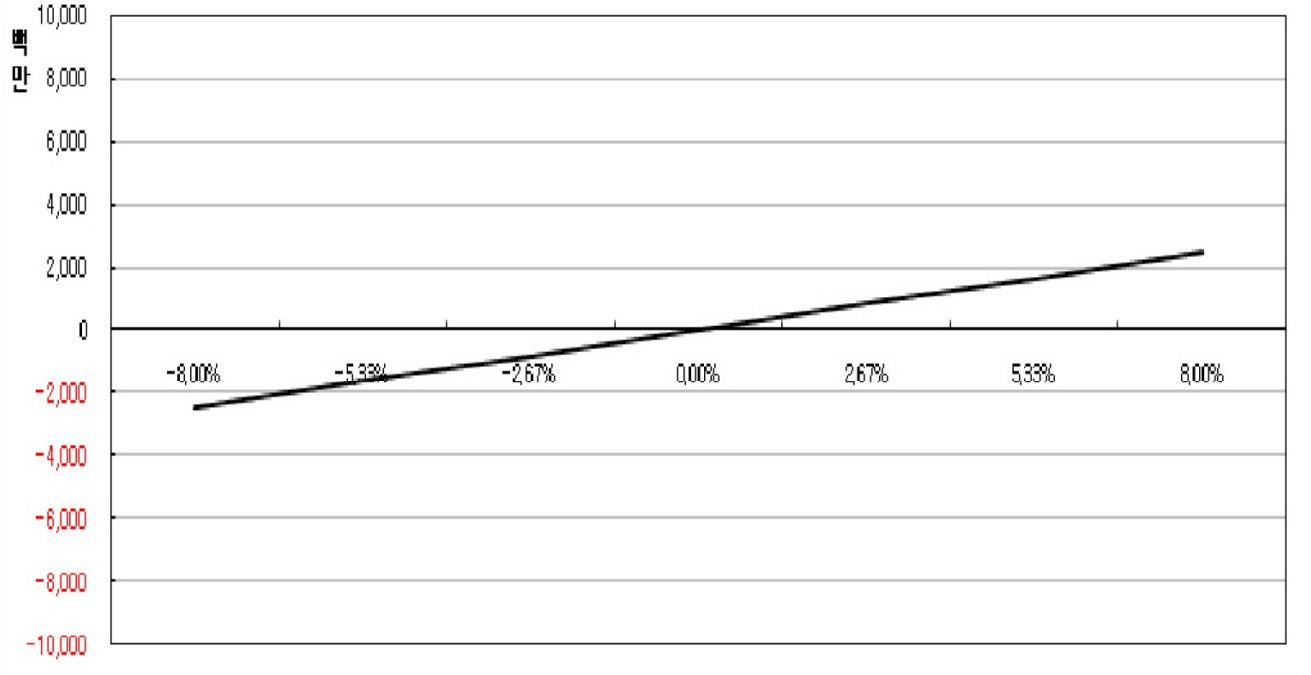
공시일: 2020-05-12

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	8,031	0	8,031	장내
합계			8,031	0	8,031	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

641

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

1,643

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

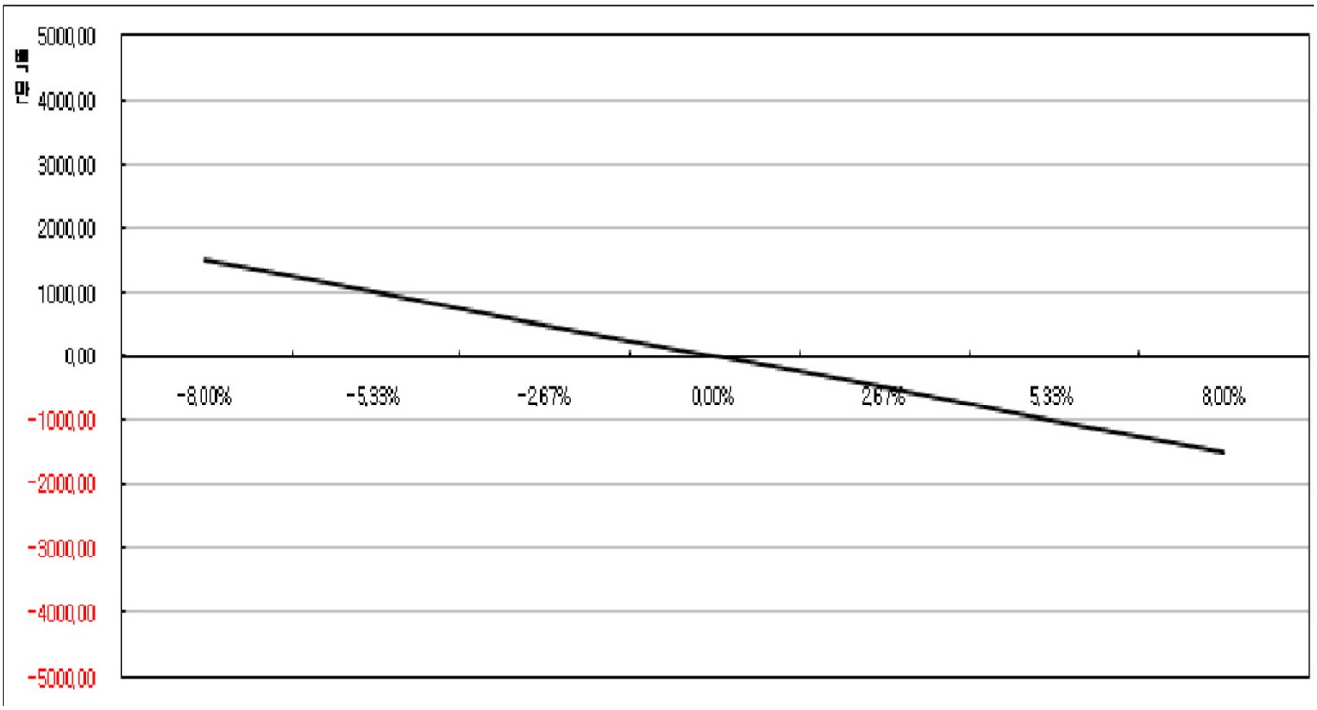
공시일: 2020-05-12

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	191	-191	장내
누계	유가증권	선물	0	2,231	-2,231	장내
합계			0	2,231	-2,231	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

178

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

266

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

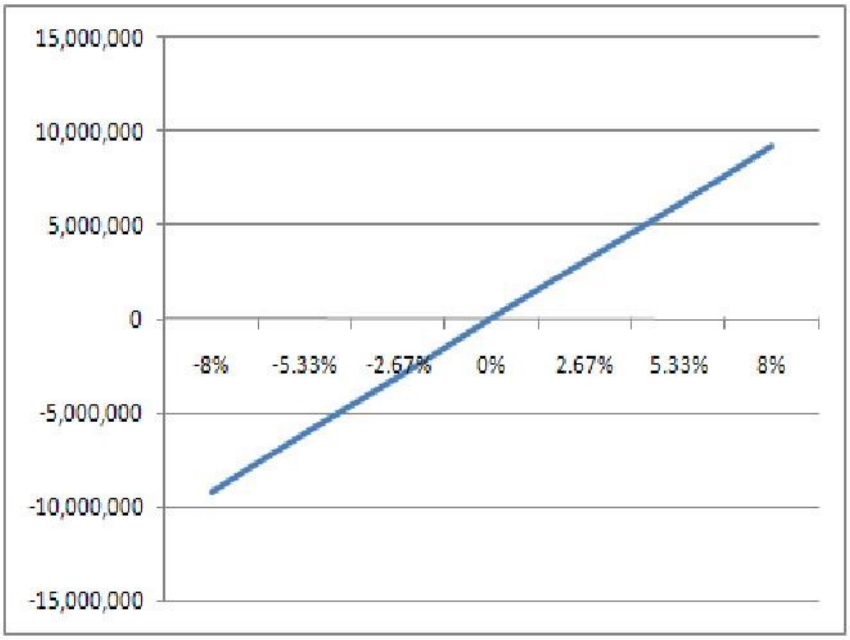
공시일: 2020-05-12

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	701	-701	장내
누계	유가증권	선물	77,951	0	77,951	장내
합계			77,951	0	77,951	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

6,219

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

15,410