펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2020-05-14

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	1,087	0	1,087	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	0	2,047	-2,047	장내
합계			1,087	2,047	-959	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	76

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	58

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

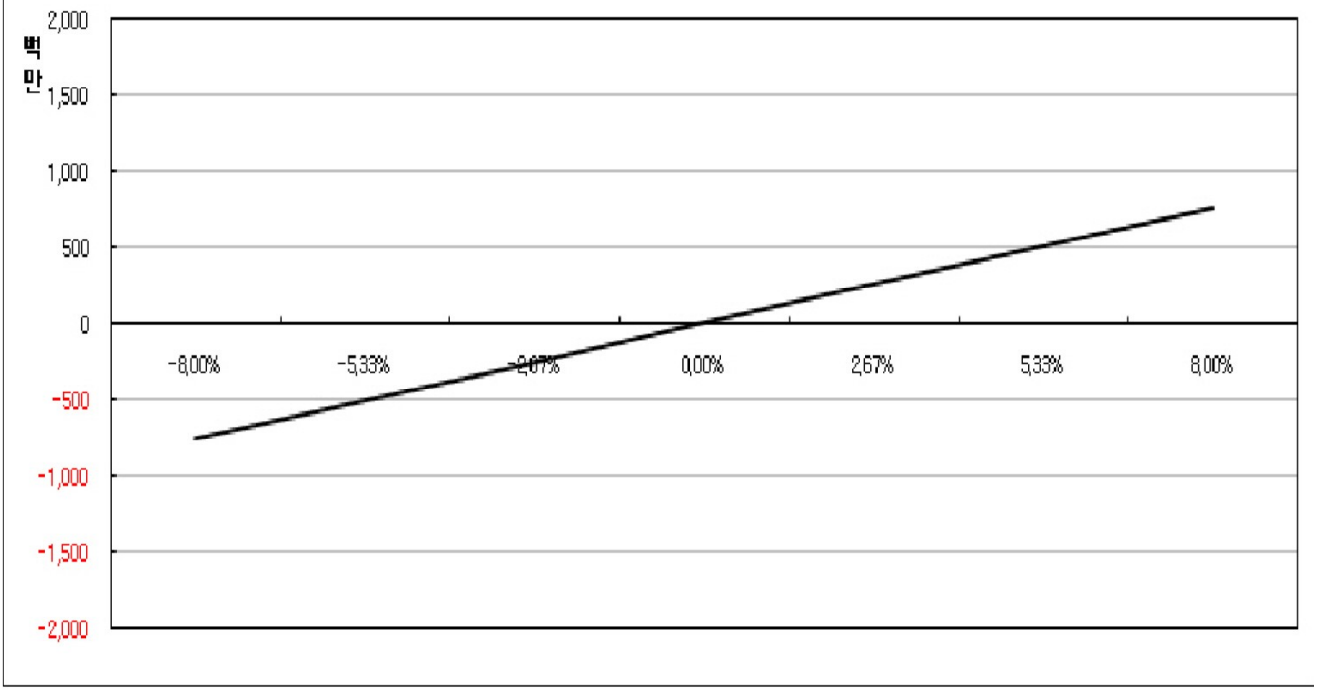
공시일: 2020-05-14

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	1,023	0	1,023	장내
합계			1,023	0	1,023	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

82

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

563

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

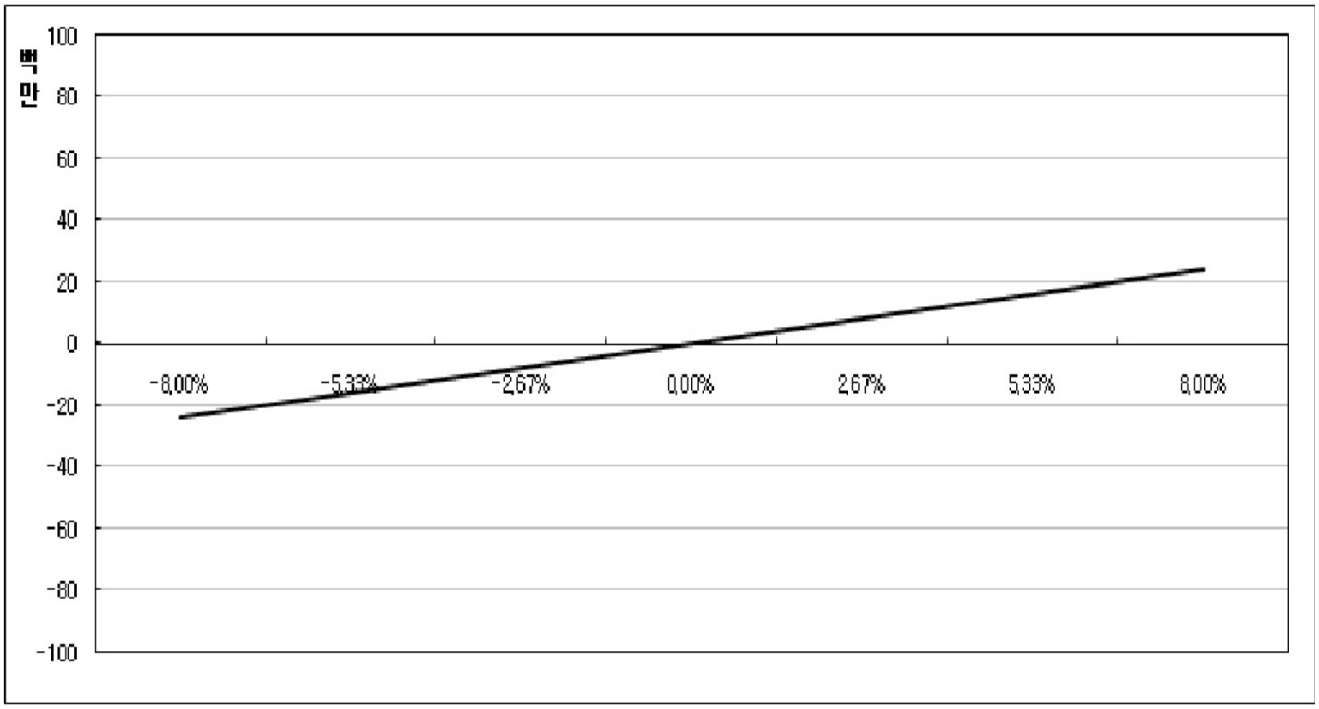
공시일: 2020-05-14

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	2,175	0	2,175	장내
합계			2,175	0	2,175	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

174

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

892

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

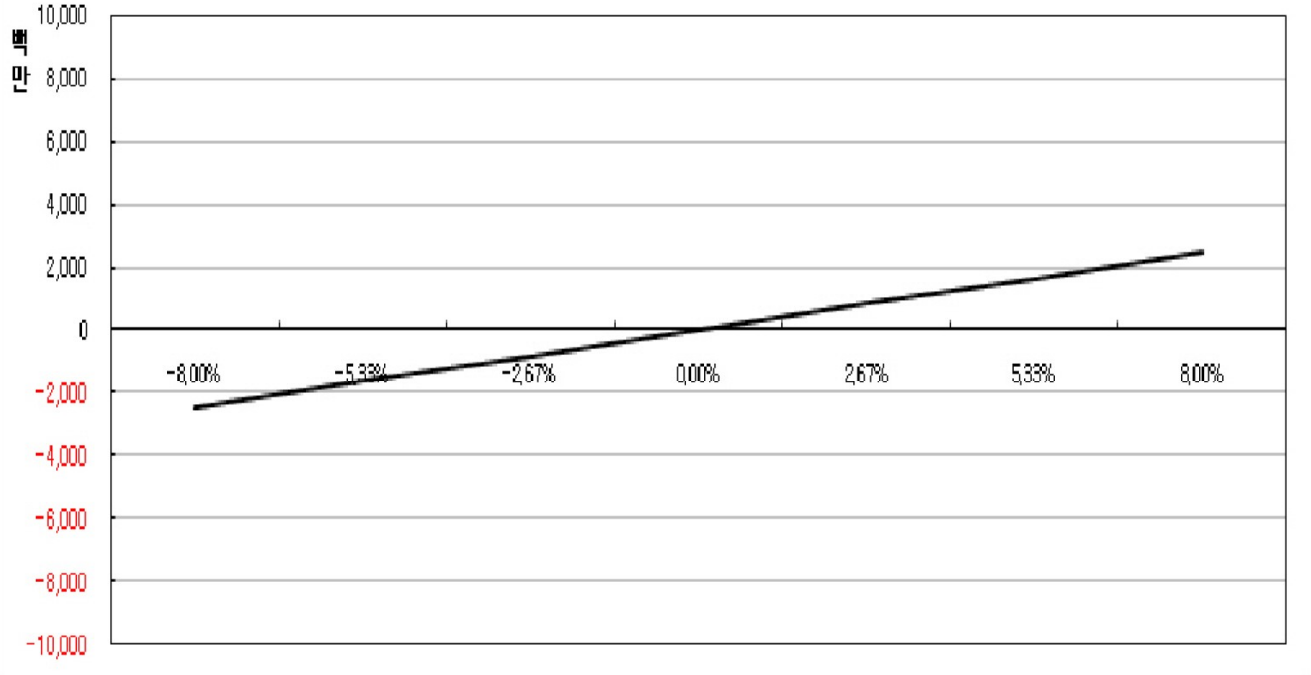
공시일: 2020-05-14

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	128	0	128	장내
누계	주가지수	선물	8,187	0	8,187	장내
합계			8,187	0	8,187	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

654

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

1,667

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

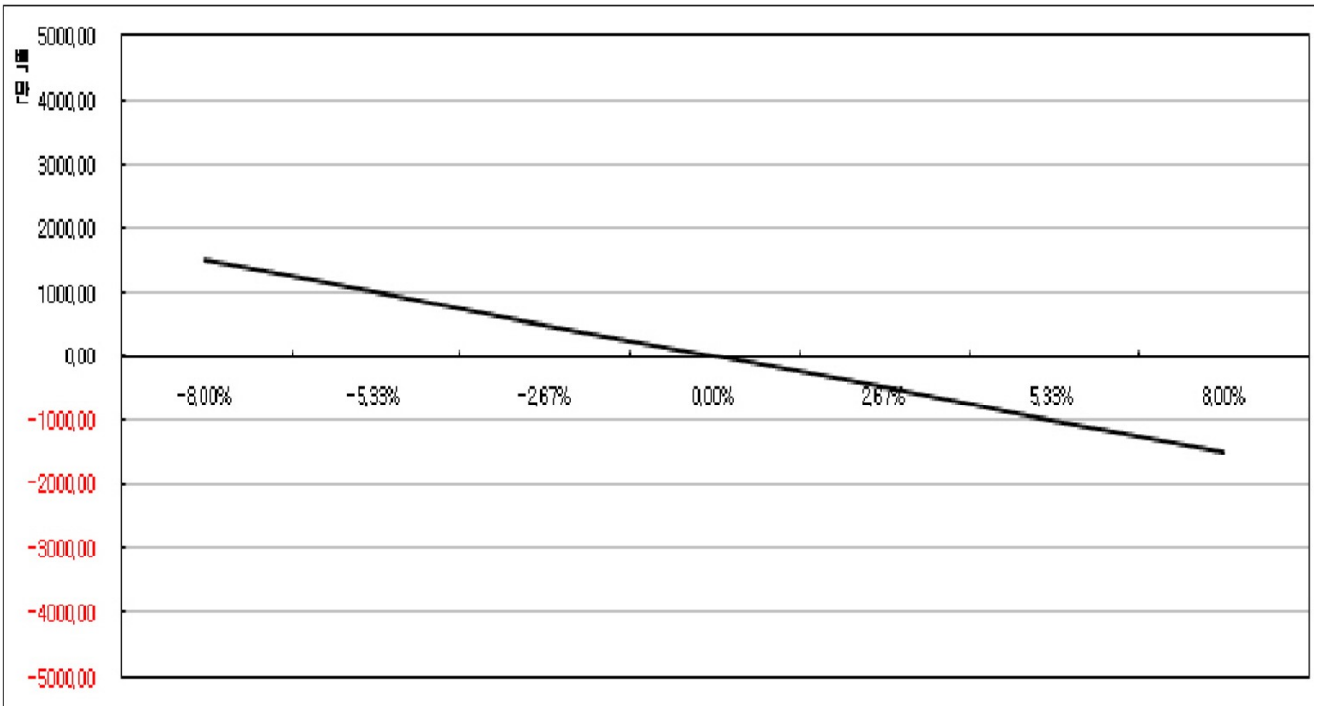
공시일: 2020-05-14

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	128	0	128	장내
누계	주가지수	선물	0	2,239	-2,239	장내
합계			0	2,239	-2,239	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

179

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

268

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

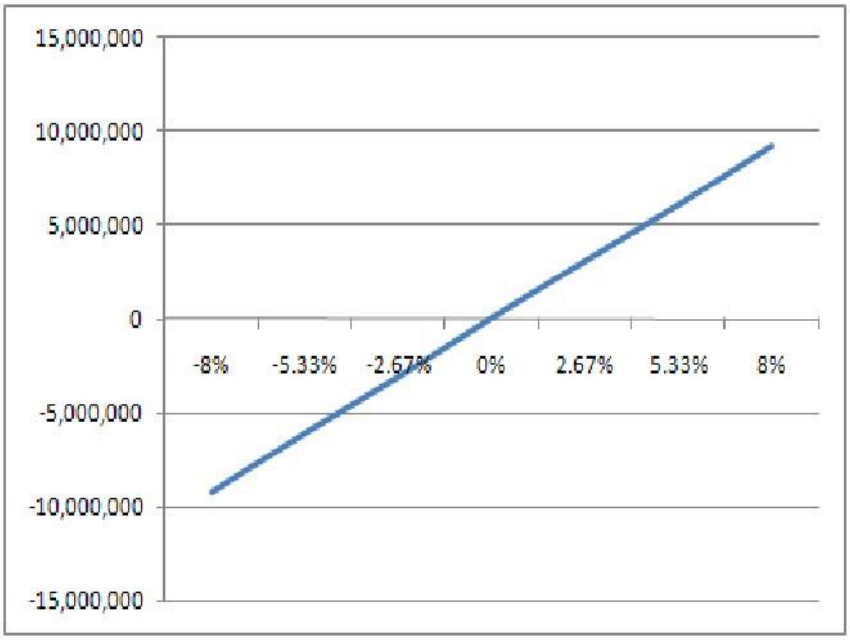
공시일: 2020-05-14

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	640	0	640	장내
누계	주가지수	선물	78,674	0	78,674	장내
합계			78,674	0	78,674	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

6,289

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

15,554