펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2020-05-15

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	1,078	0	1,078	장내
신규	주가지수	옵션	37	1,519	-1,482	장내
누계	주가지수	옵션	6	1,012	-1,006	장내
합계			1,084	1,012	72	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	69

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	271

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

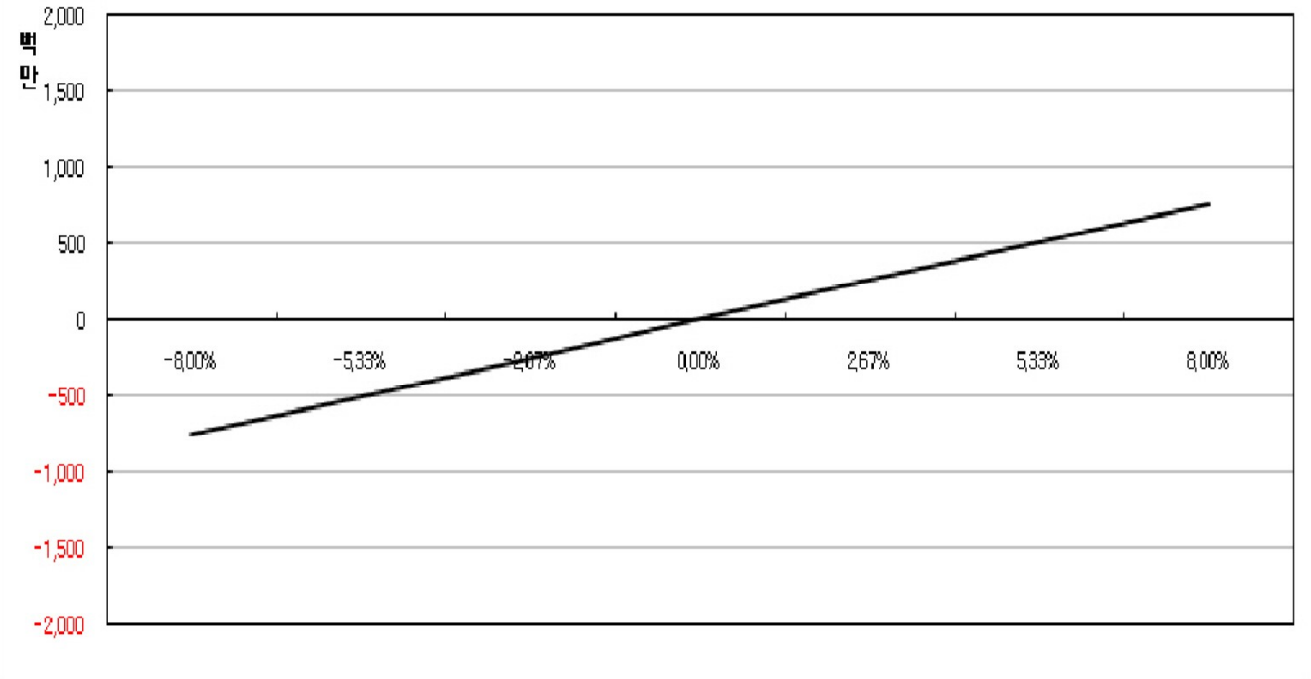
공시일: 2020-05-15

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	1,015	0	1,015	장내
합계			1,015	0	1,015	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

81

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

558

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

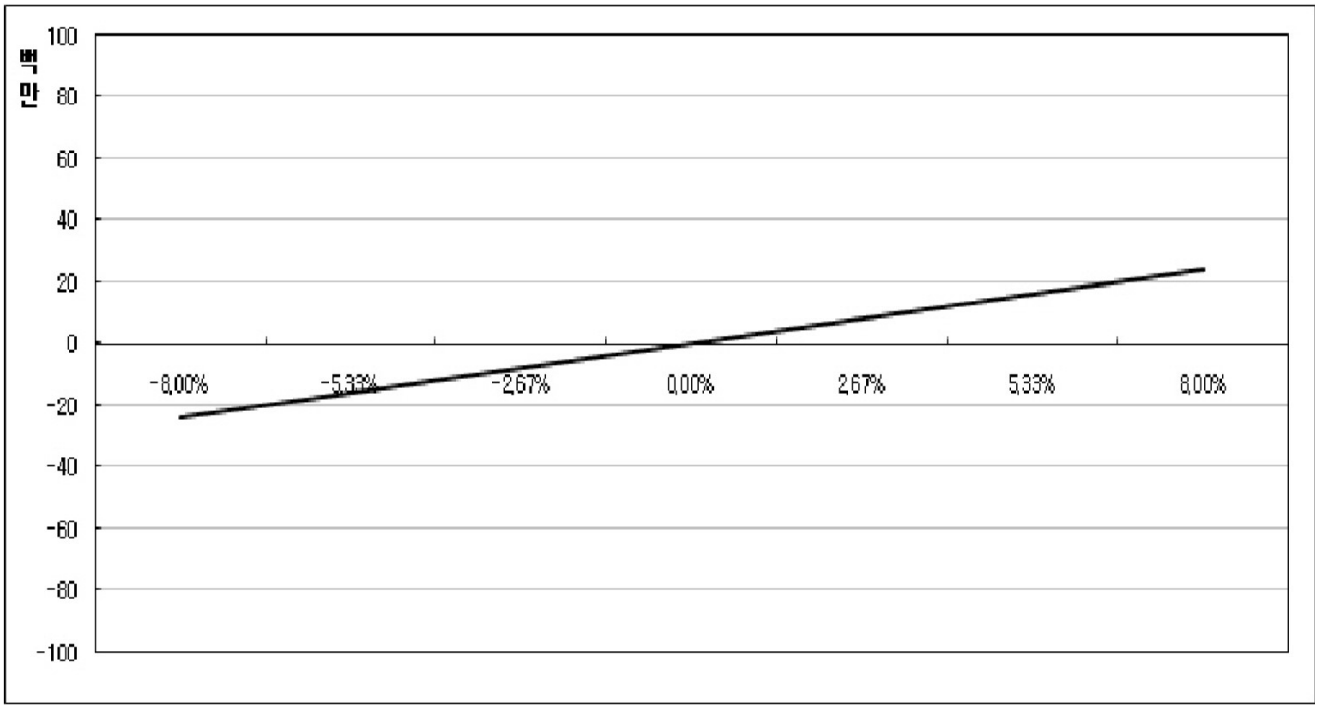
공시일: 2020-05-15

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	2,156	0	2,156	장내
합계			2,156	0	2,156	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

172

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

883

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

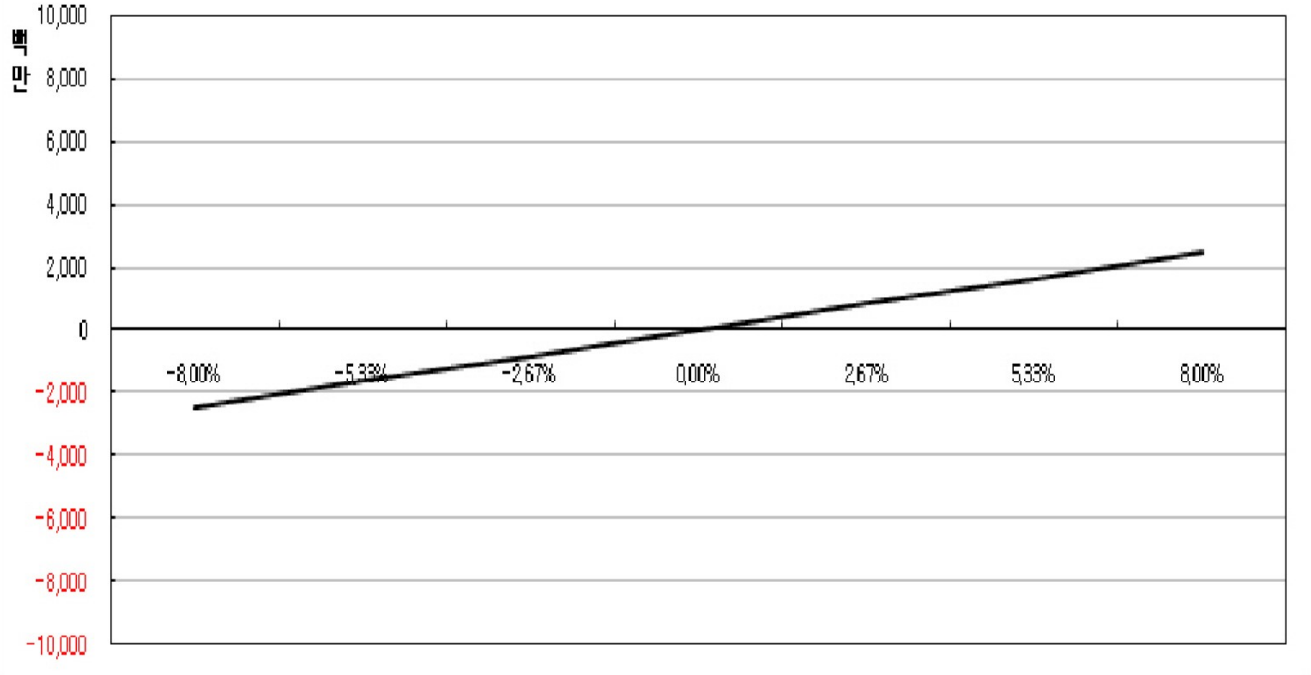
공시일: 2020-05-15

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	8,117	0	8,117	장내
합계			8,117	0	8,117	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

646

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

1,647

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

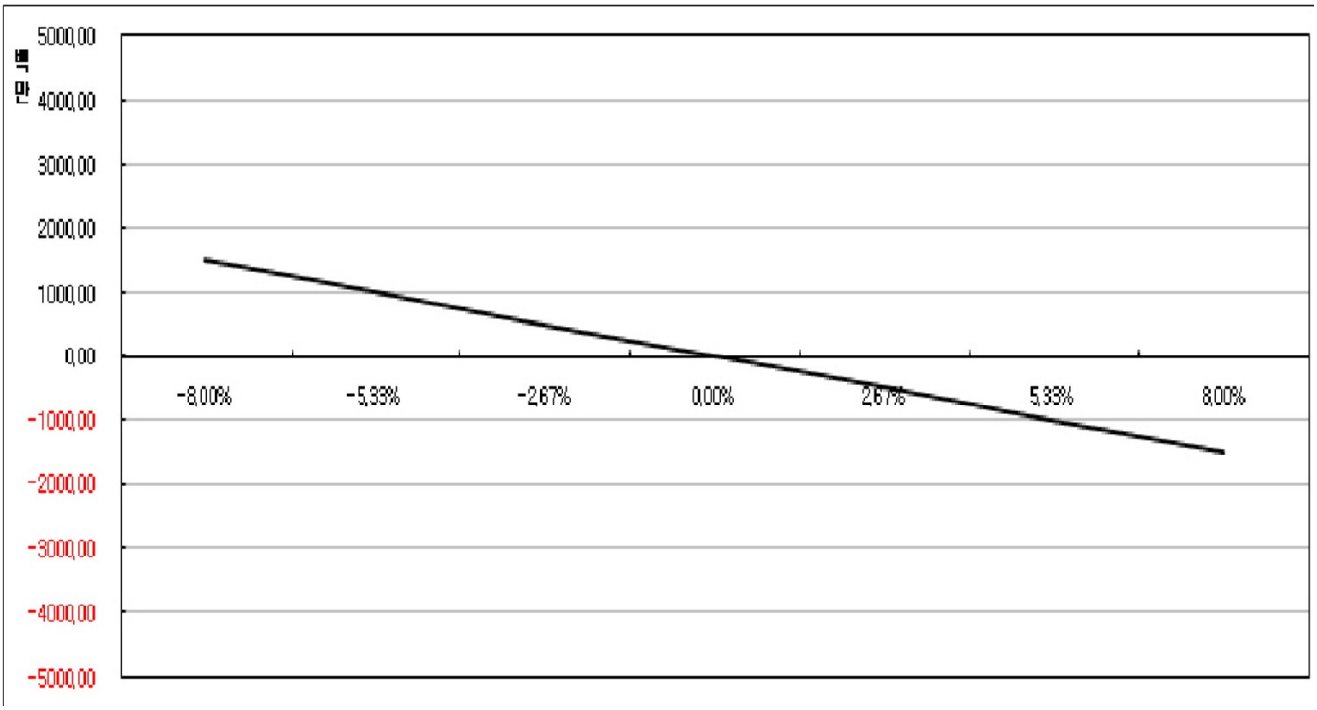
공시일: 2020-05-15

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	190	0	190	장내
누계	주가지수	선물	0	2,029	-2,029	장내
합계			0	2,029	-2,029	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

162

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

241

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

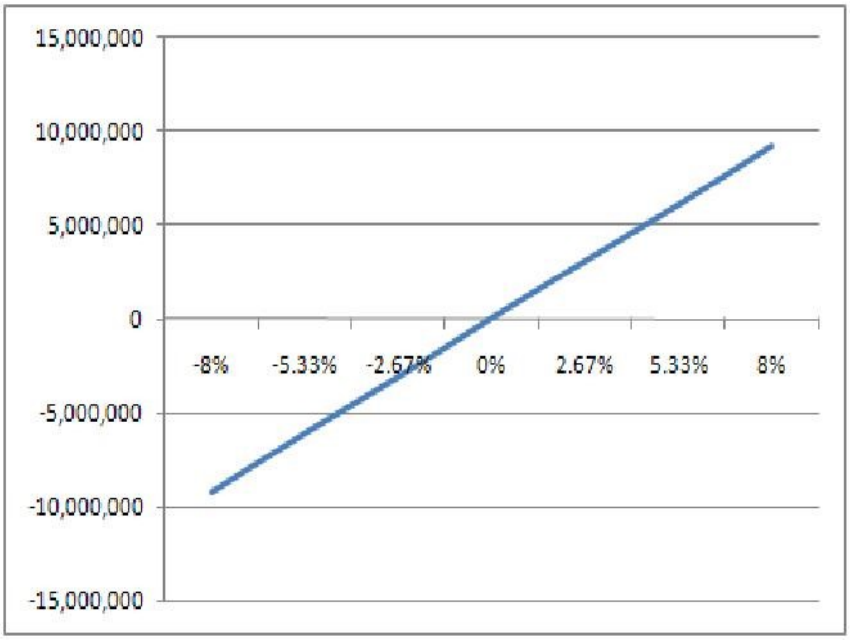
공시일: 2020-05-15

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	77,997	0	77,997	장내
합계			77,997	0	77,997	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

6,208

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

15,365