펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2020-05-18

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	63	0	63	장내
누계	주가지수	선물	1,142	0	1,142	장내
신규	주가지수	옵션	29	1,459	-1,430	장내
누계	주가지수	옵션	7	1,015	-1,009	장내
합계			1,149	1,015	133	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	54

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	227

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

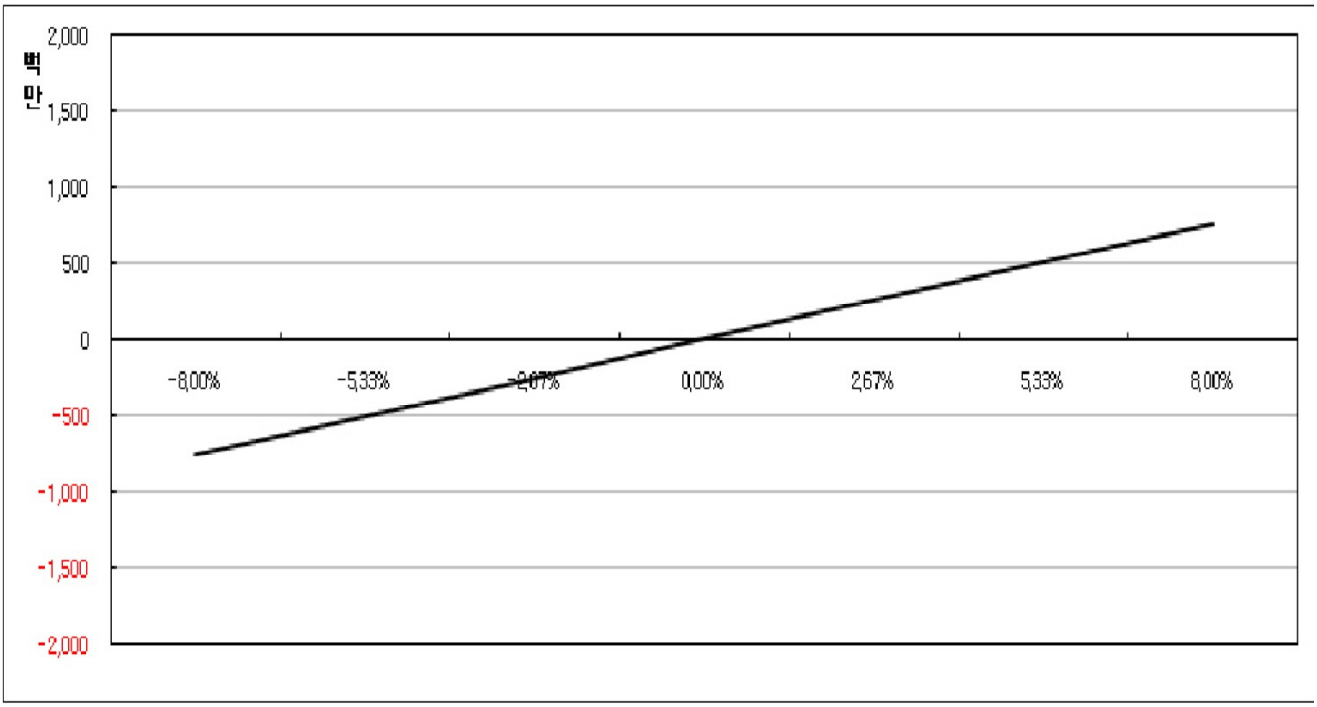
공시일: 2020-05-18

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)

559

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

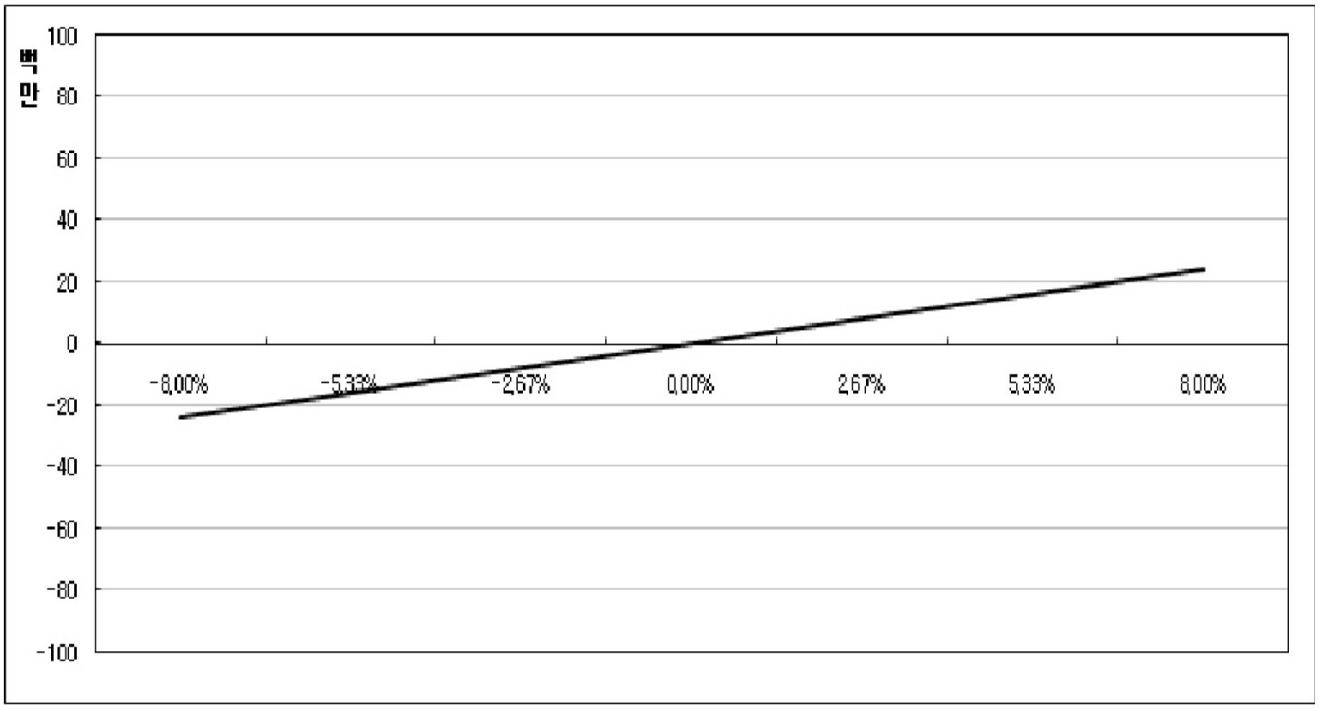
공시일: 2020-05-18

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	2,157	0	2,157	장내
합계			2,157	0	2,157	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

172

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

884

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

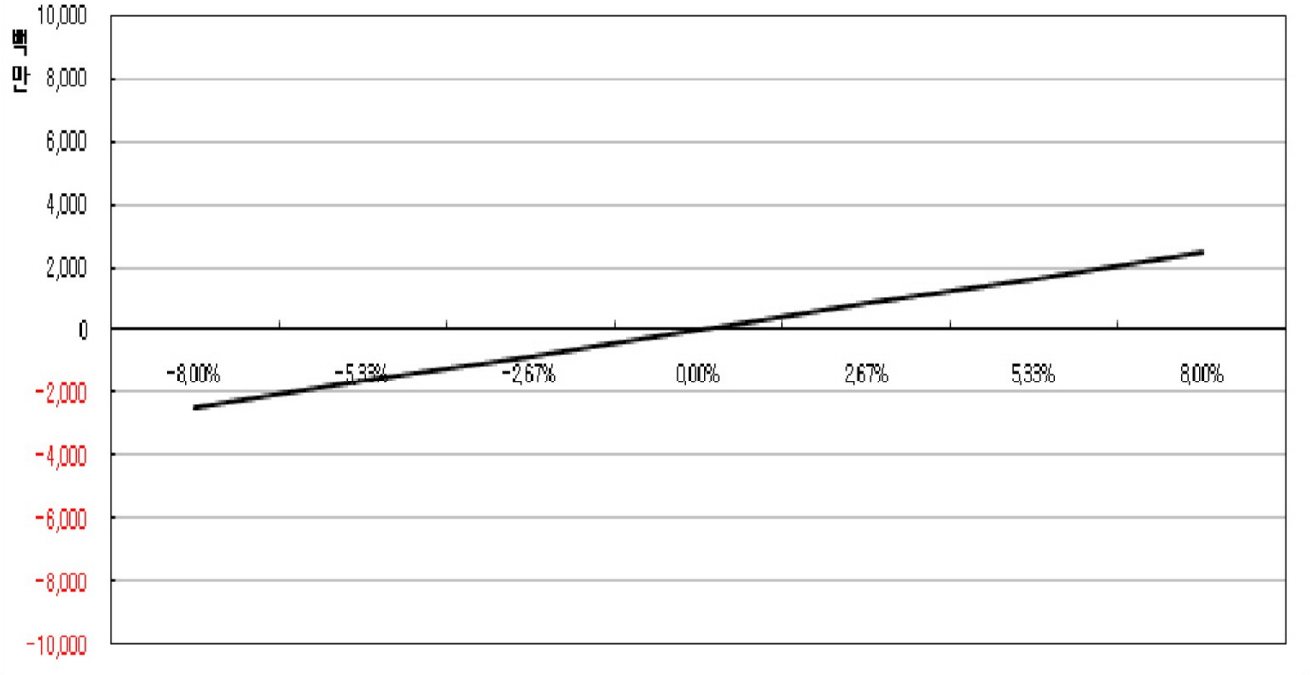
공시일: 2020-05-18

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	8,121	0	8,121	장내
합계			8,121	0	8,121	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

649

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

1,654

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

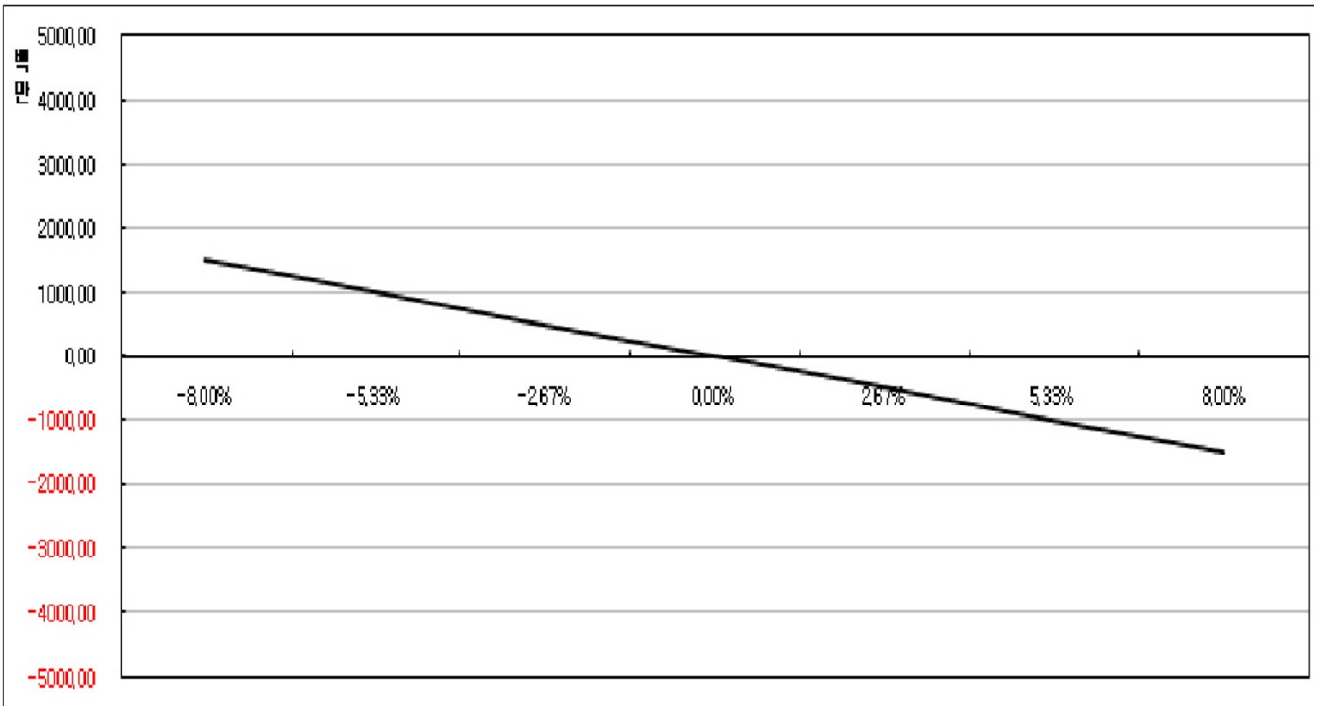
공시일: 2020-05-18

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	63	-63	장내
누계	주가지수	선물	0	2,094	-2,094	장내
합계			0	2,094	-2,094	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

167

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

250

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

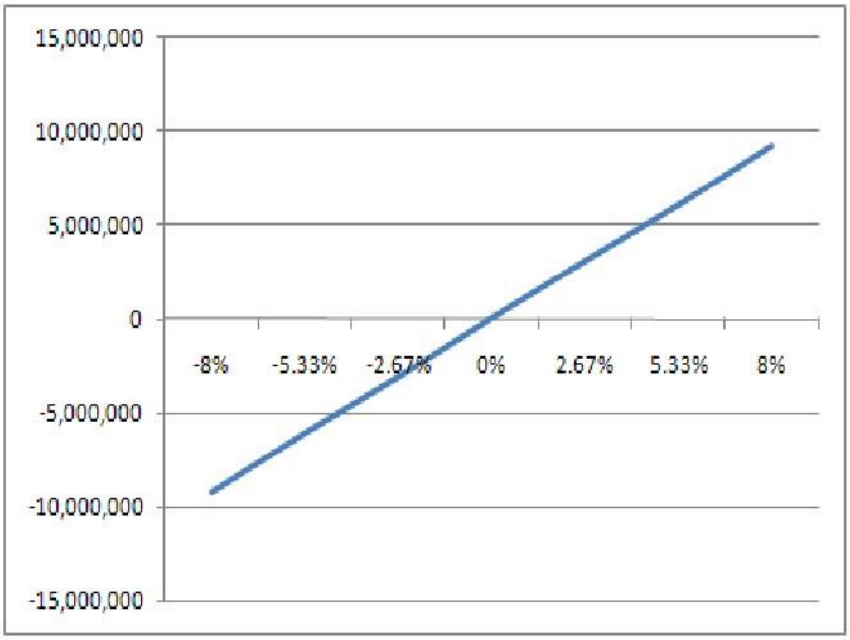
공시일: 2020-05-18

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	444	0	444	장내
누계	주가지수	선물	78,485	0	78,485	장내
합계			78,485	0	78,485	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

6,274

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

15,480