펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2020-05-21

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	1,117	0	1,117	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	3	1,051	-1,048	장내
합계			1,119	1,051	68	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	41

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	358

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

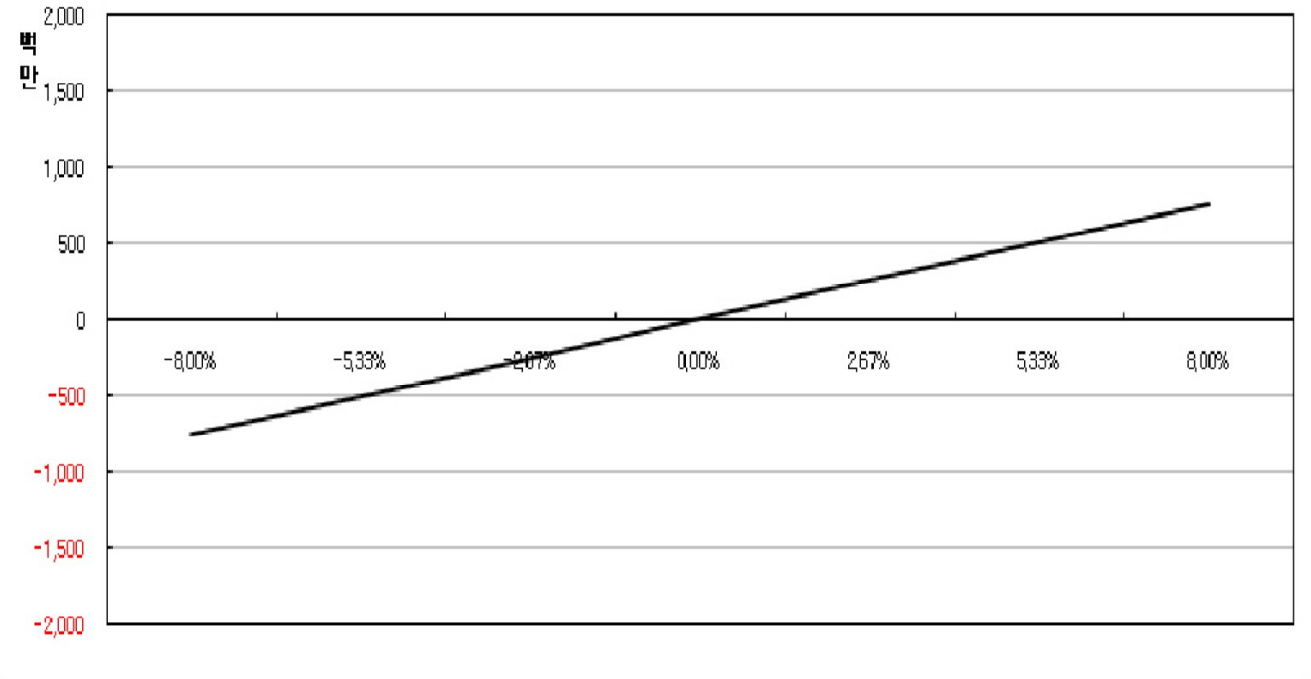
공시일: 2020-05-21

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	1,051	0	1,051	장내
합계			1,051	0	1,051	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

84

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

577

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

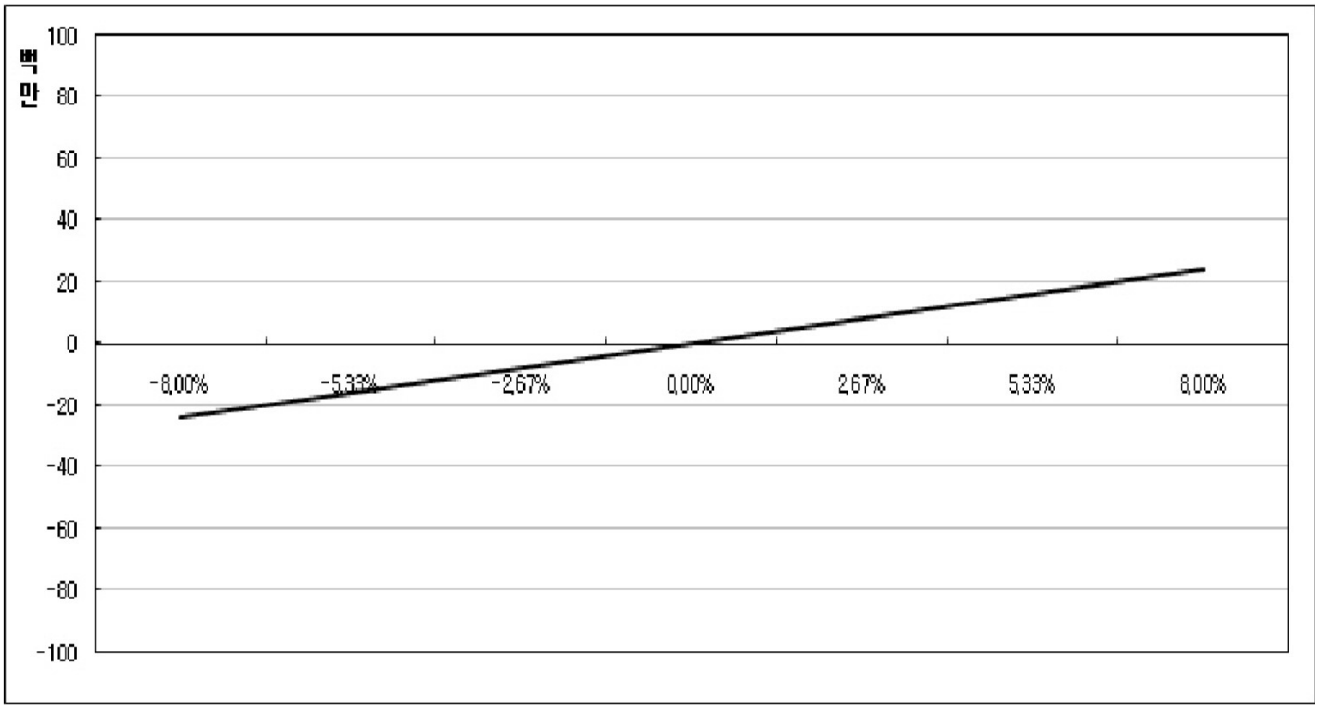
공시일: 2020-05-21

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	1,576	0	1,576	장내
합계			1,576	0	1,576	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

126

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

927

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

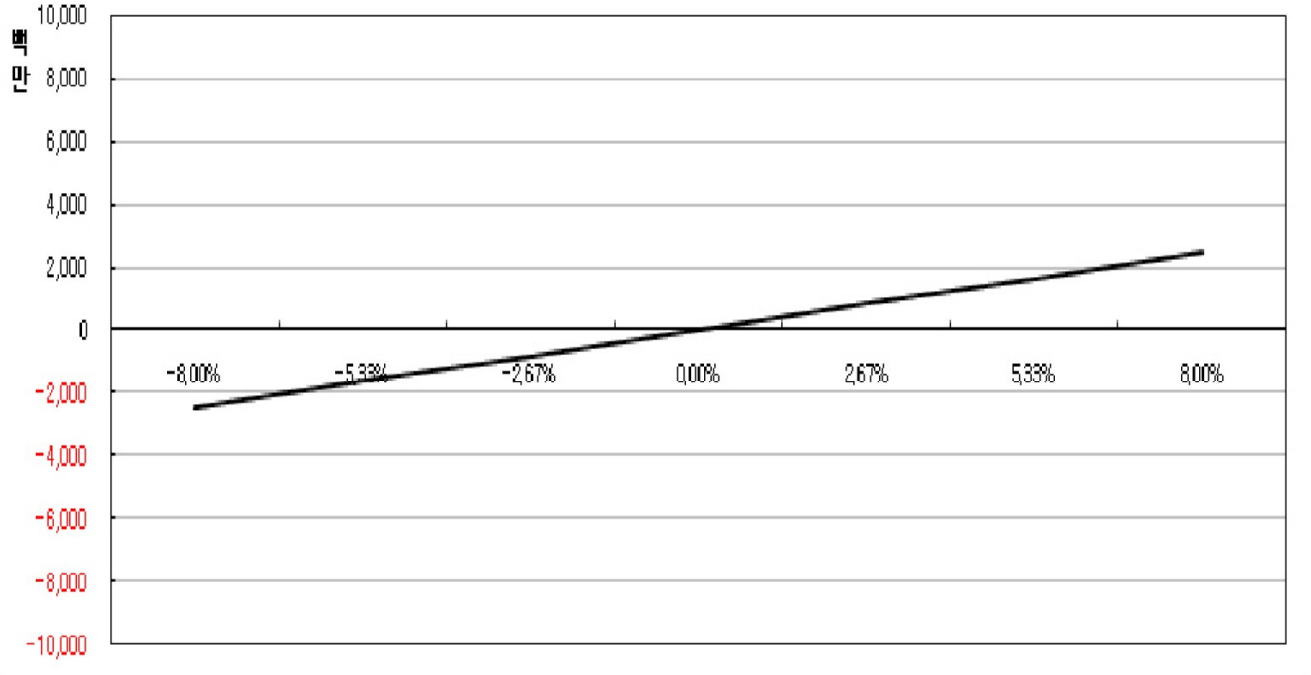
공시일: 2020-05-21

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	525	-525	장내
누계	주가지수	선물	6,765	0	6,765	장내
합계			6,765	0	6,765	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

540

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

1,672

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

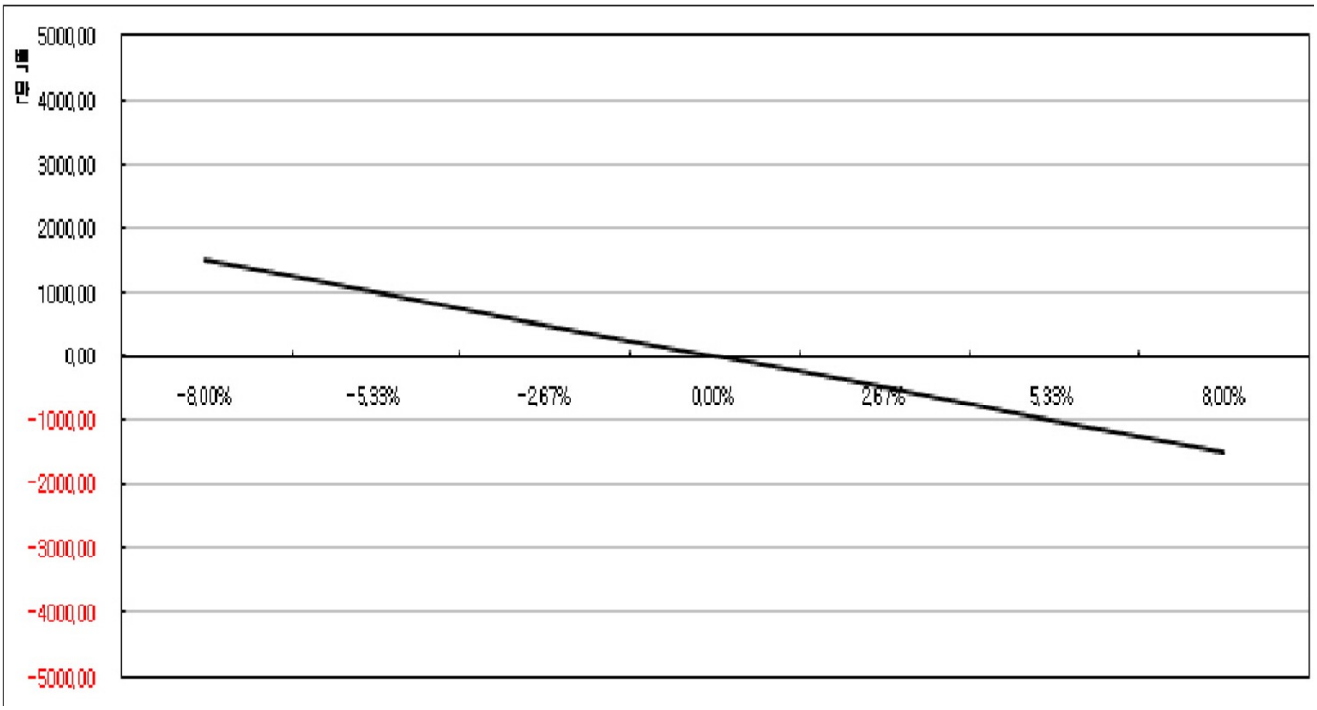
공시일: 2020-05-21

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	0	1,773	-1,773	장내
합계			0	1,773	-1,773	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

142

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

212

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

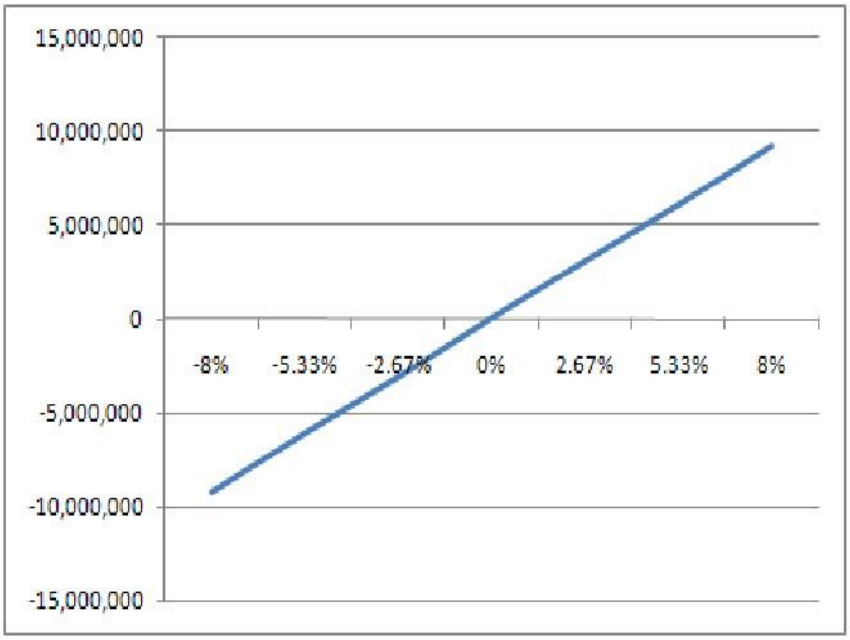
공시일: 2020-05-21

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	460	-460	장내
누계	주가지수	선물	81,443	0	81,443	장내
합계			81,443	0	81,443	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

6,501

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

15,968