펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2020-05-25

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	1,103	0	1,103	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	4	1,038	-1,034	장내
합계			1,107	1,038	69	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	45

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	253

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

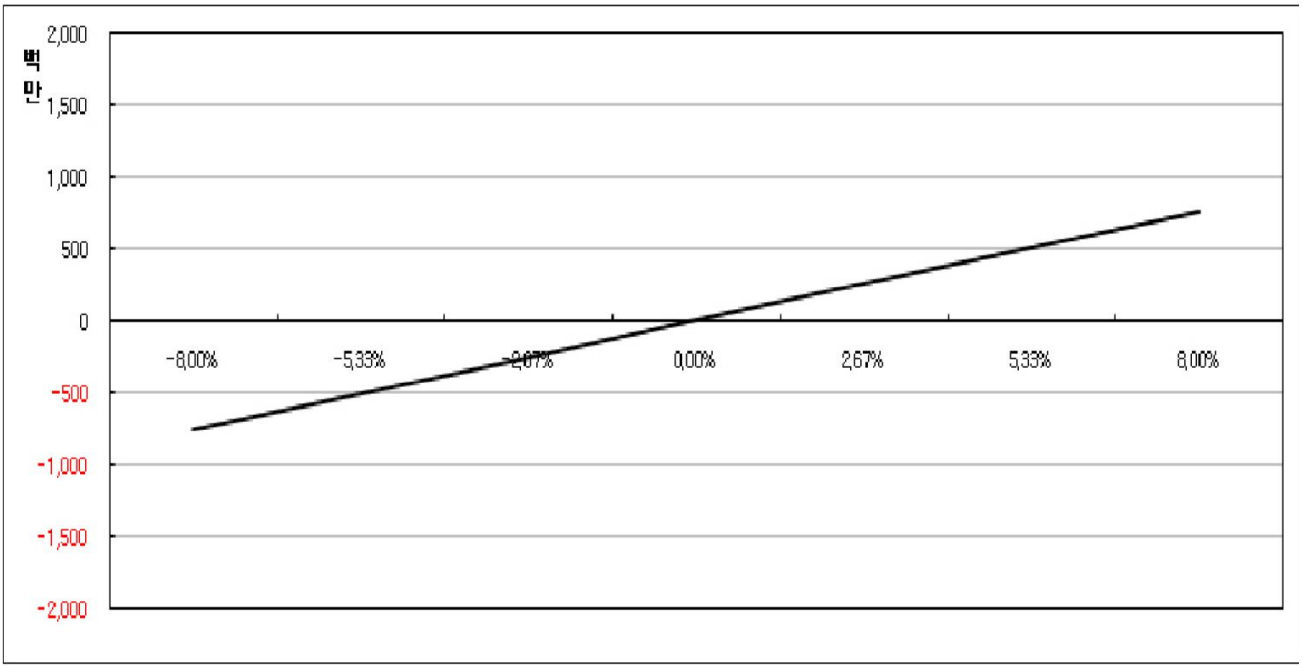
공시일: 2020-05-25

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	1,038	0	1,038	장내
합계			1,038	0	1,038	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

83

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

571

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

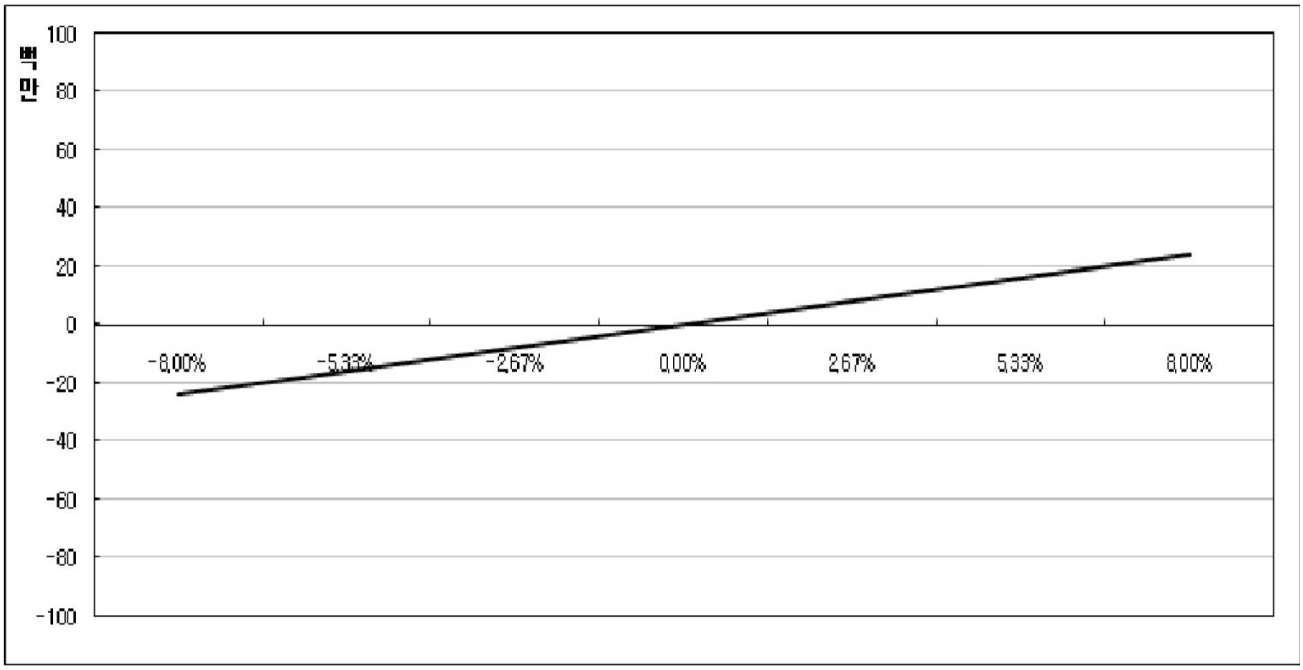
공시일: 2020-05-25

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	1,558	0	1,558	장내
합계			1,558	0	1,558	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	124

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	917

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

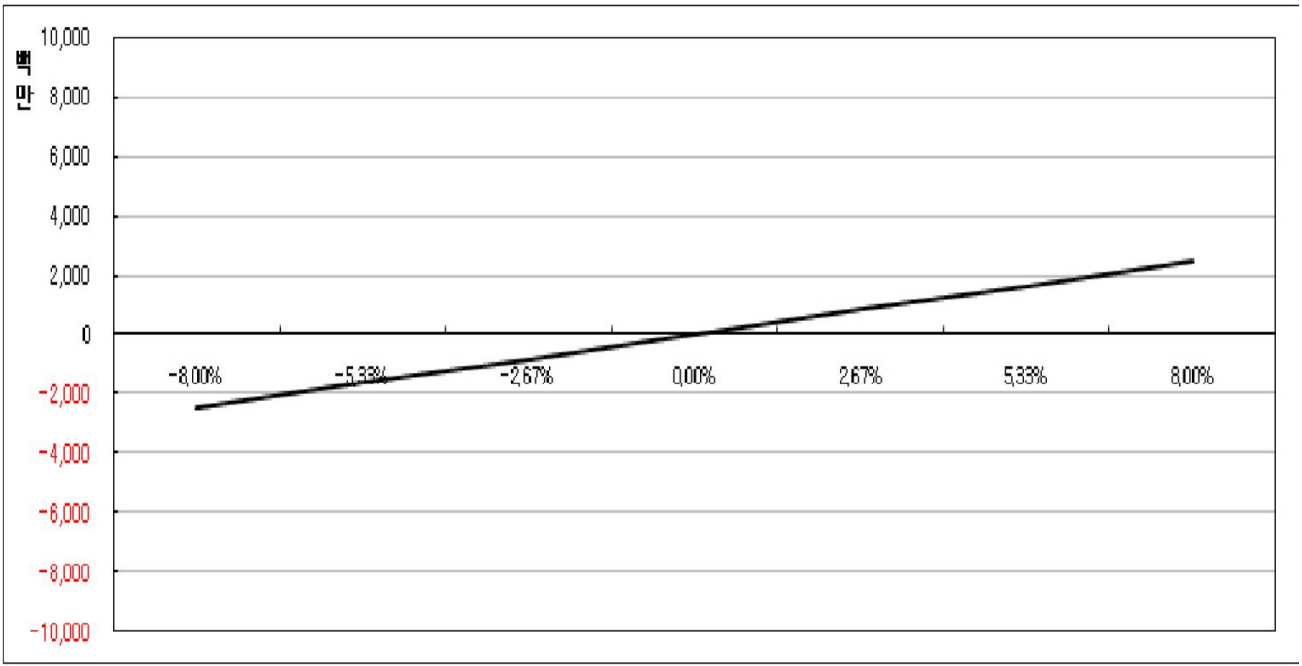
공시일: 2020-05-25

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	6,555	0	6,555	장내
합계			6,555	0	6,555	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

523

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

1,641

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

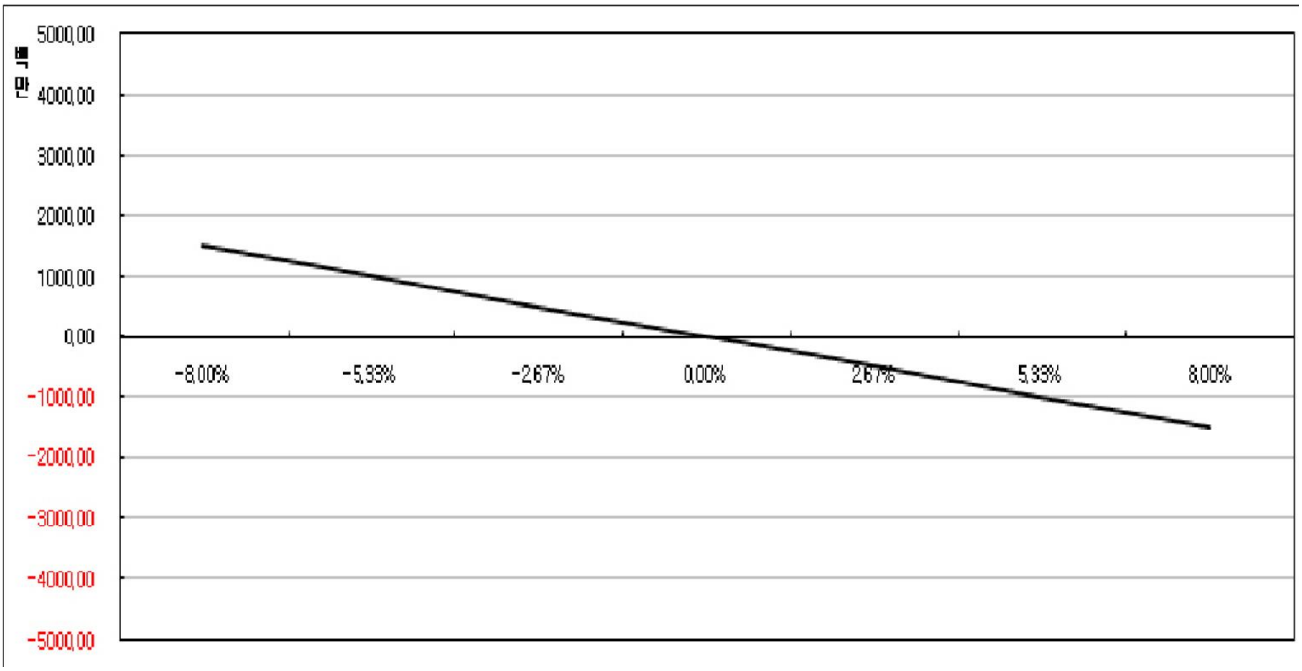
공시일: 2020-05-25

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	130	454	-325	장내
누계	주가지수	선물	0	2,207	-2,207	장내
합계			0	2,207	-2,207	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

176

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

265

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

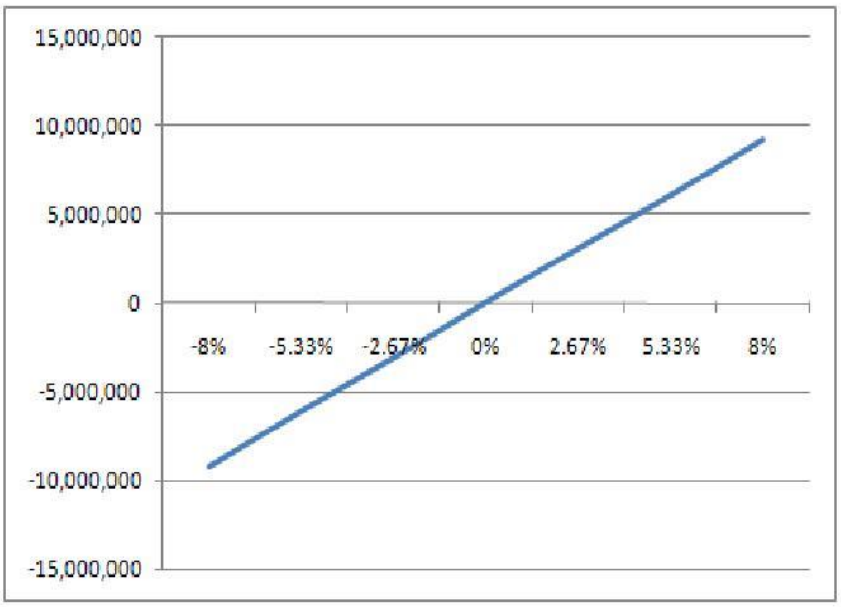
공시일: 2020-05-25

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	454	-454	장내
누계	주가지수	선물	79,509	0	79,509	장내
합계			79,509	0	79,509	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

6,341

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

15,707