펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2020-05-27

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	1,136	0	1,136	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	1	1,069	-1,068	장내
합계			1,137	1,069	68	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	35

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	327

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

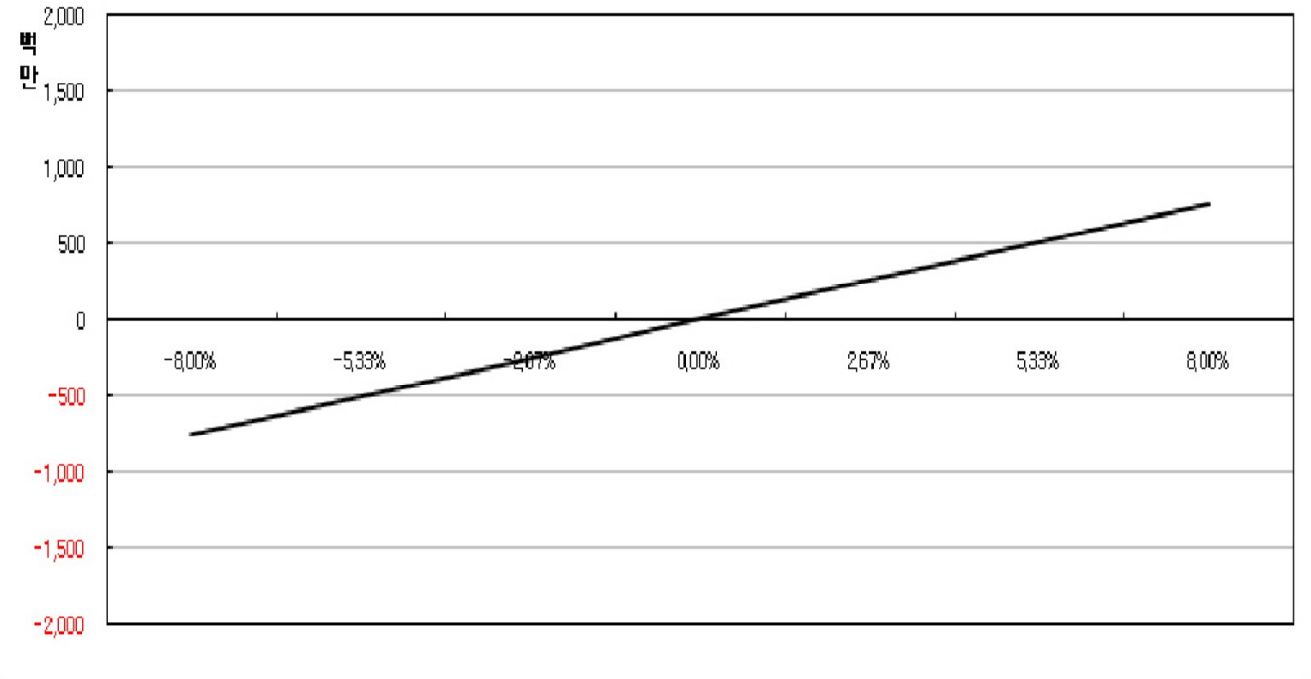
공시일: 2020-05-27

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	1,069	0	1,069	장내
합계			1,069	0	1,069	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

85

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

589

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

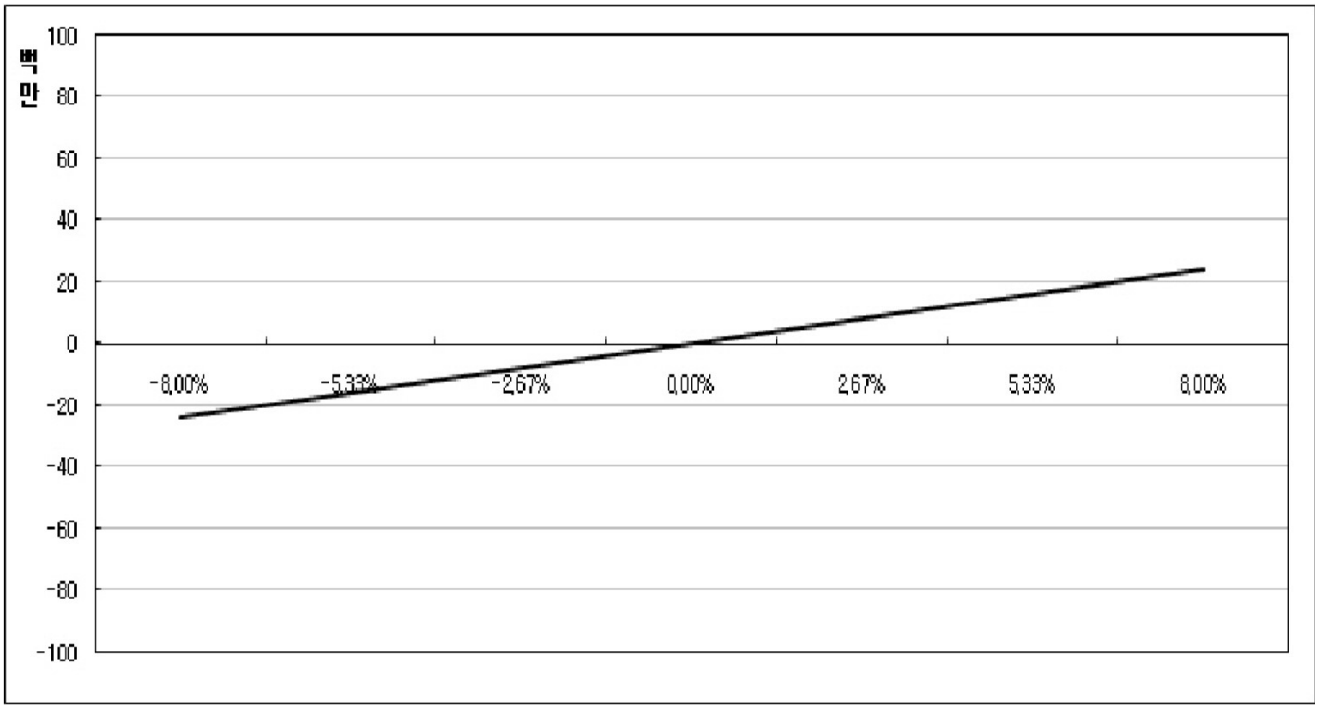
공시일: 2020-05-27

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	1,604	0	1,604	장내
합계			1,604	0	1,604	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

128

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

947

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

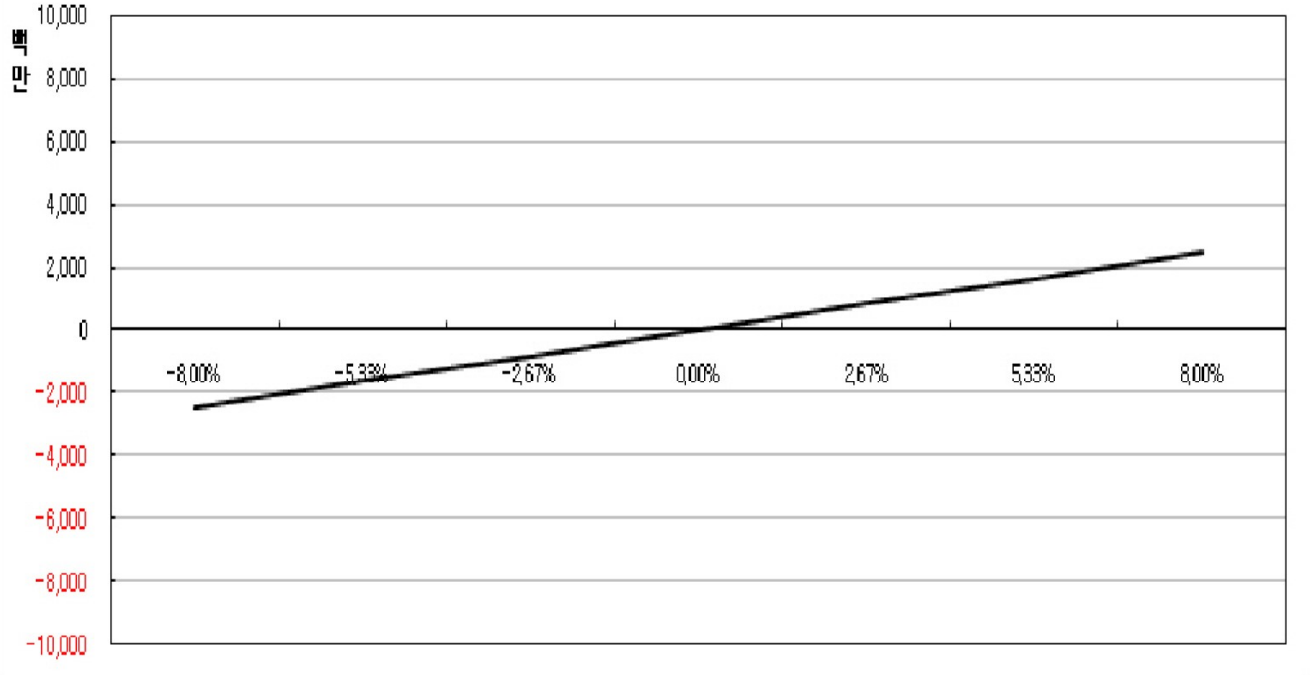
공시일: 2020-05-27

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	601	267	334	장내
누계	주가지수	선물	7,084	0	7,084	장내
합계			7,084	0	7,084	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

565

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

1,732

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

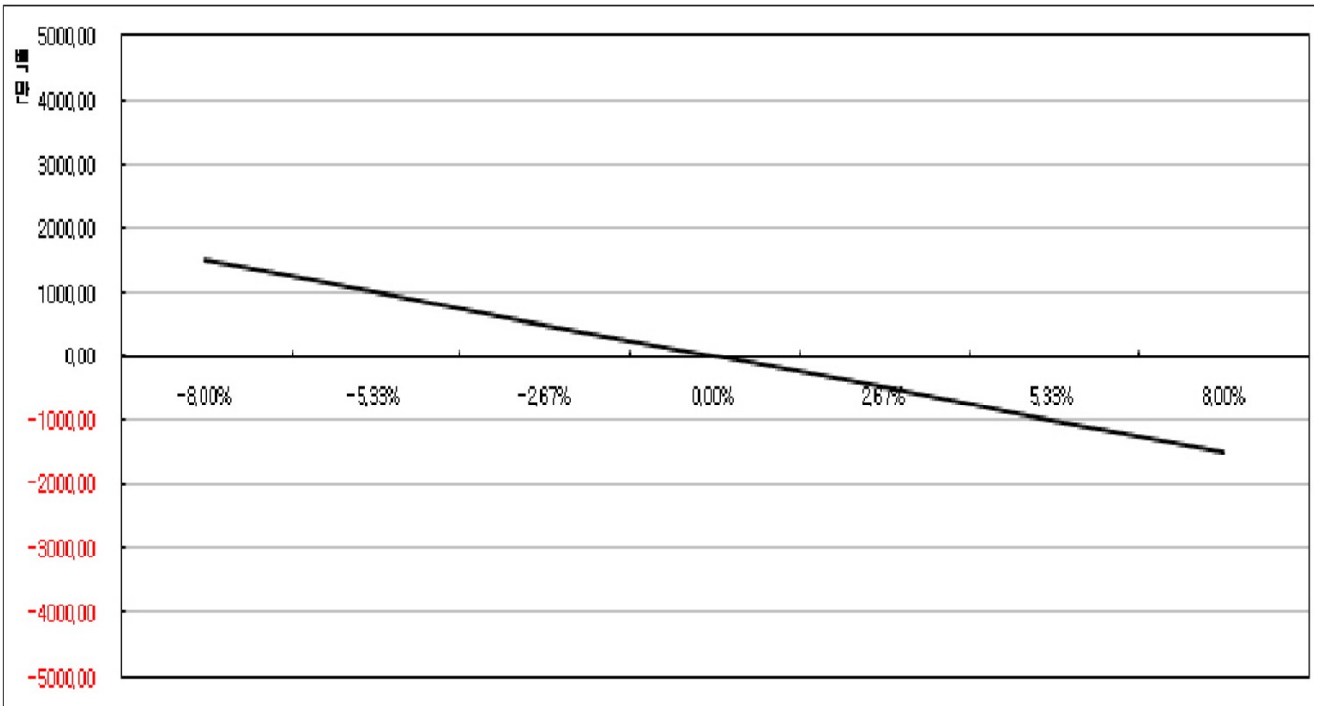
공시일: 2020-05-27

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	67	0	67	장내
누계	주가지수	선물	0	1,804	-1,804	장내
합계			0	1,804	-1,804	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

144

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

217

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

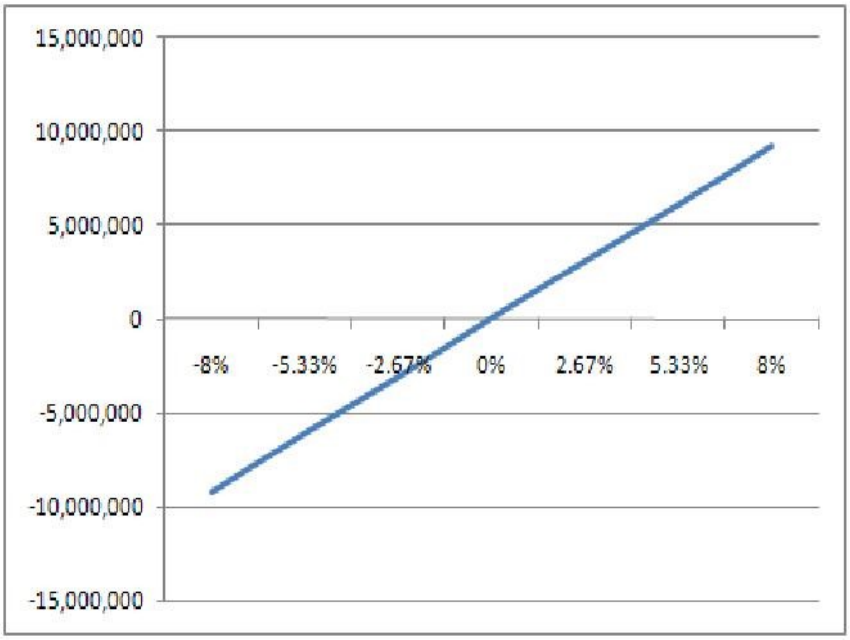
공시일: 2020-05-27

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	2,072	-2,072	장내
누계	주가지수	선물	81,195	0	81,195	장내
합계			81,195	0	81,195	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

6,480

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

16,139