펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2020-06-04

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	1,144	0	1,144	장내
신규	주가지수	옵션	8	0	8	장내
누계	주가지수	옵션	0	1,072	-1,072	장내
합계			1,144	1,072	72	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	21

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	376

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

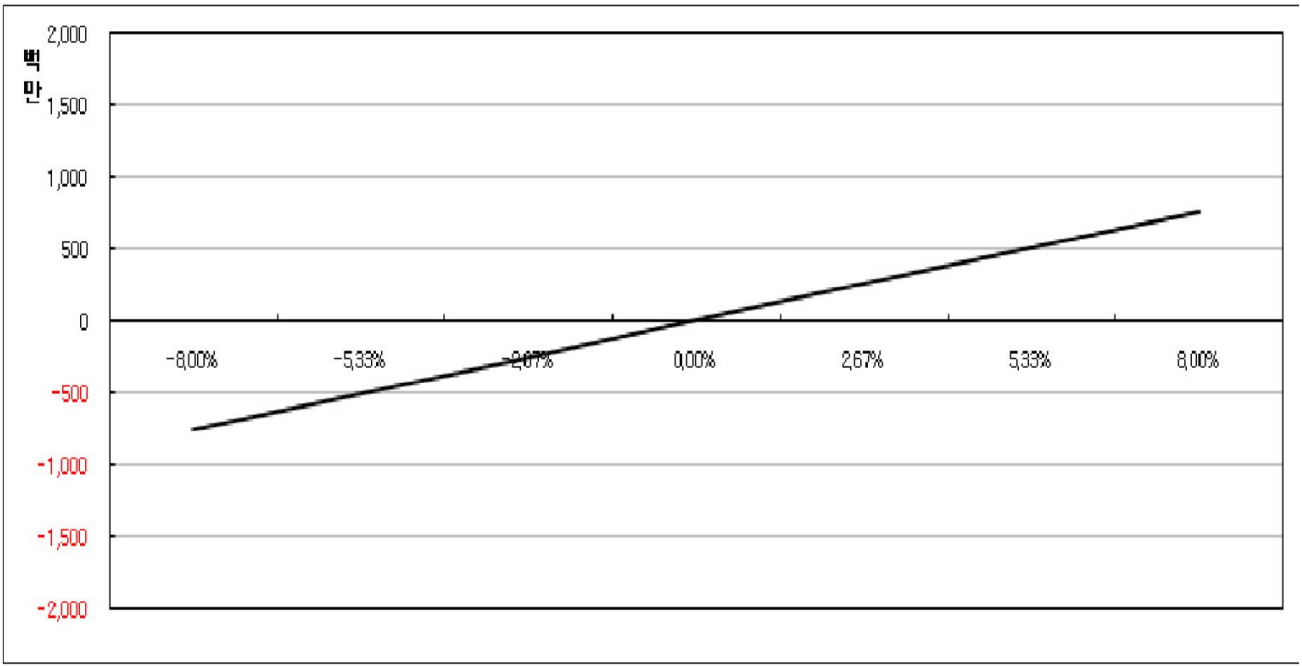
공시일: 2020-06-04

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	1,144	0	1,144	장내
합계			1,144	0	1,144	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

92

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

635

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

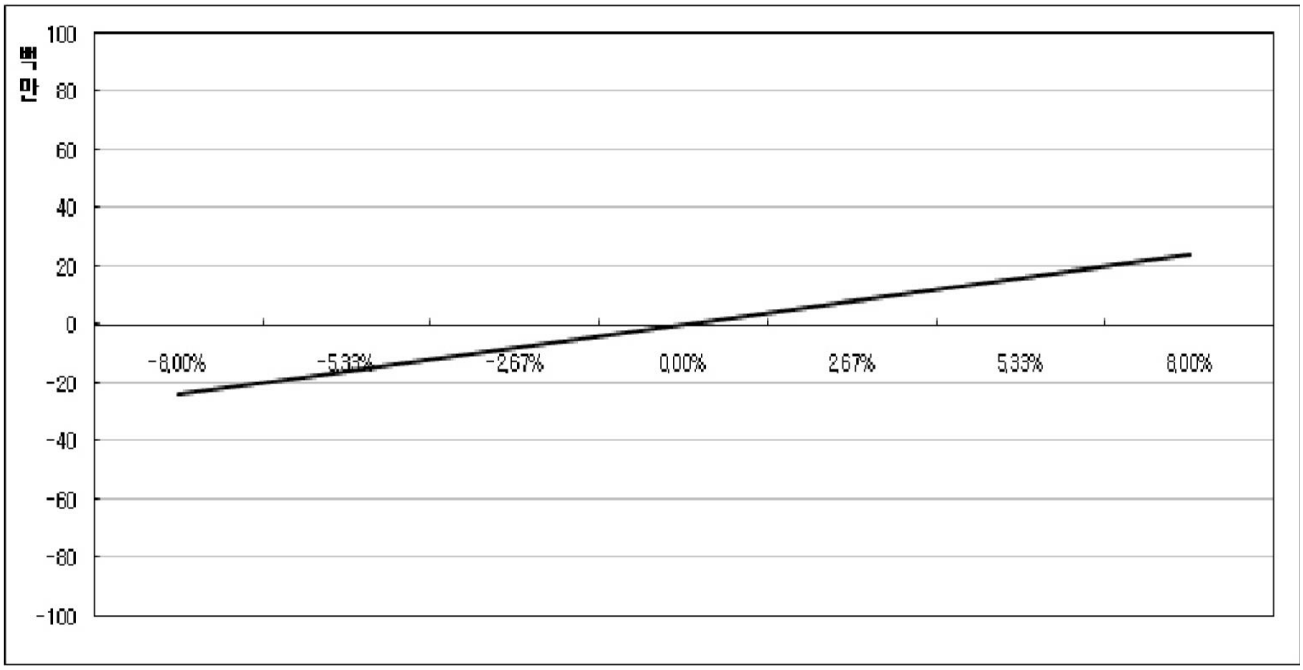
공시일: 2020-06-04

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	715	-715	장내
누계	주가지수	선물	929	0	929	장내
합계			929	0	929	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	74

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	1,033

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

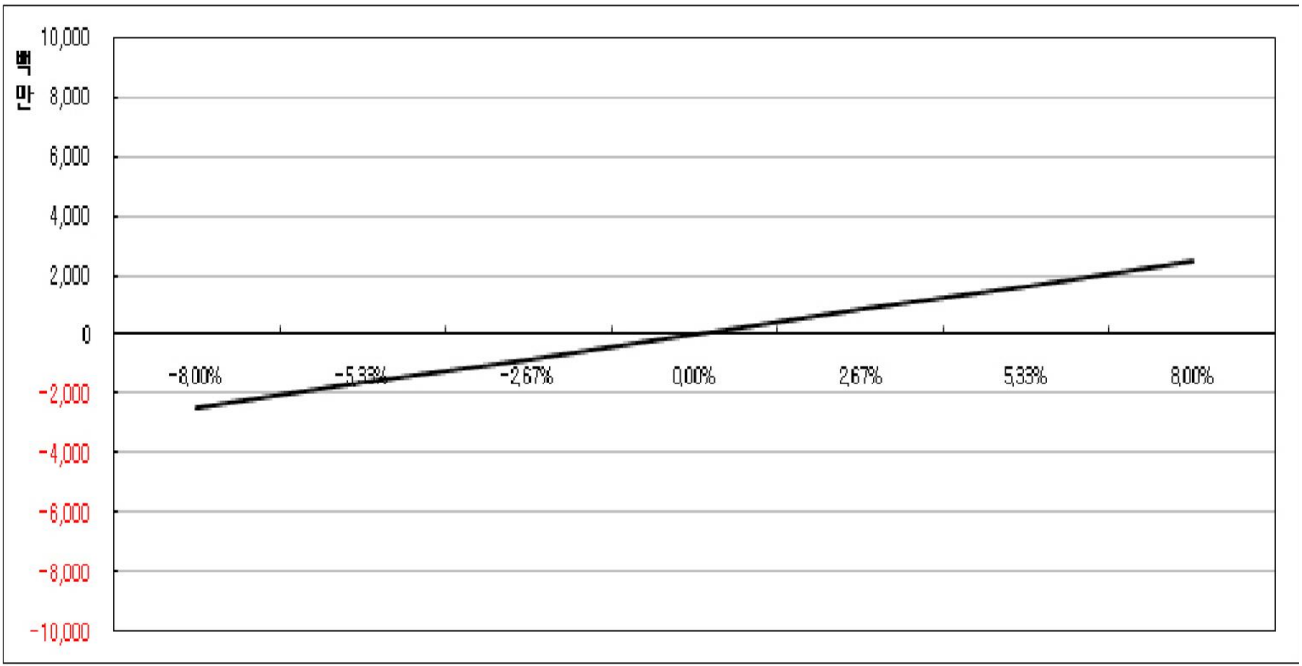
공시일: 2020-06-04

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	1,430	-1,430	장내
누계	주가지수	선물	5,432	0	5,432	장내
합계			5,432	0	5,432	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

435

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

1,761

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

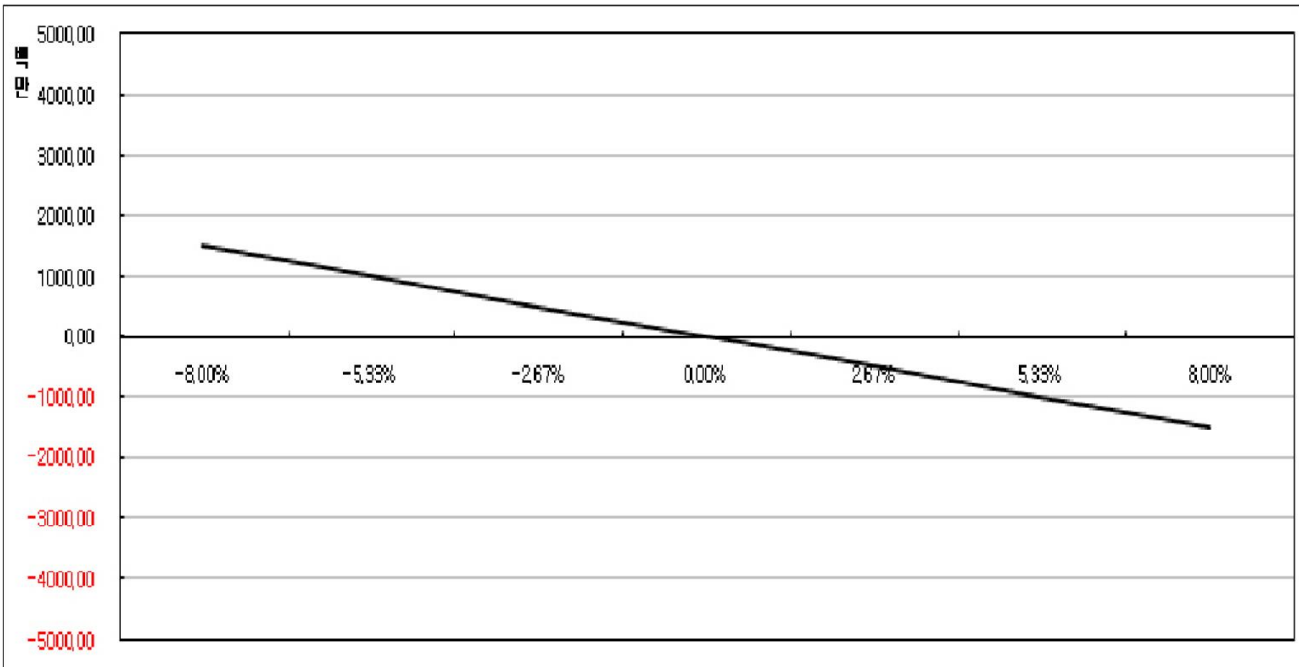
공시일: 2020-06-04

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	71	0	71	장내
누계	주가지수	선물	0	1,715	-1,715	장내
합계			0	1,715	-1,715	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

137

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

209

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

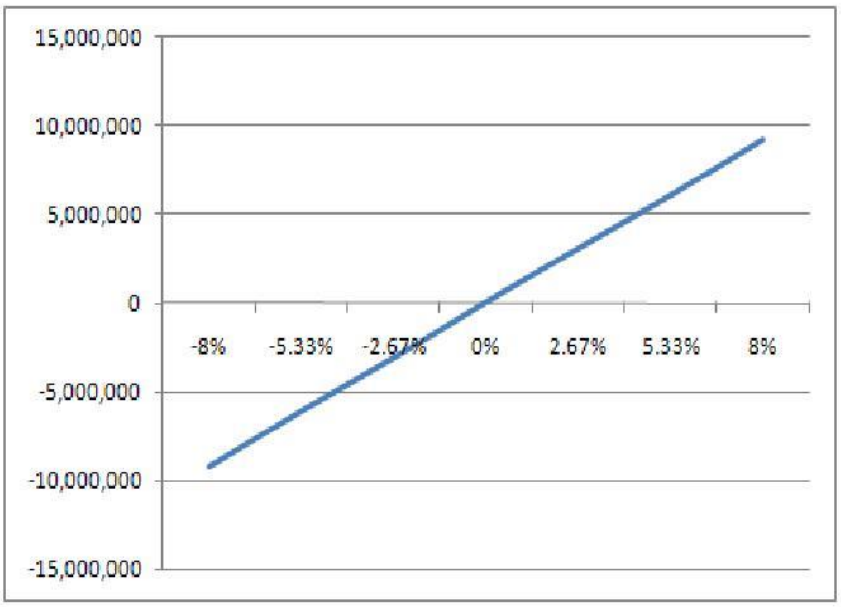
공시일: 2020-06-04

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	5,361	-5,361	장내
누계	주가지수	선물	81,985	0	81,985	장내
합계			81,985	0	81,985	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

6,567

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

17,369