펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2020-06-18

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	1,061	0	1,061	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	15	1,981	-1,966	장내
합계			1,076	1,981	-905	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	32

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	238

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

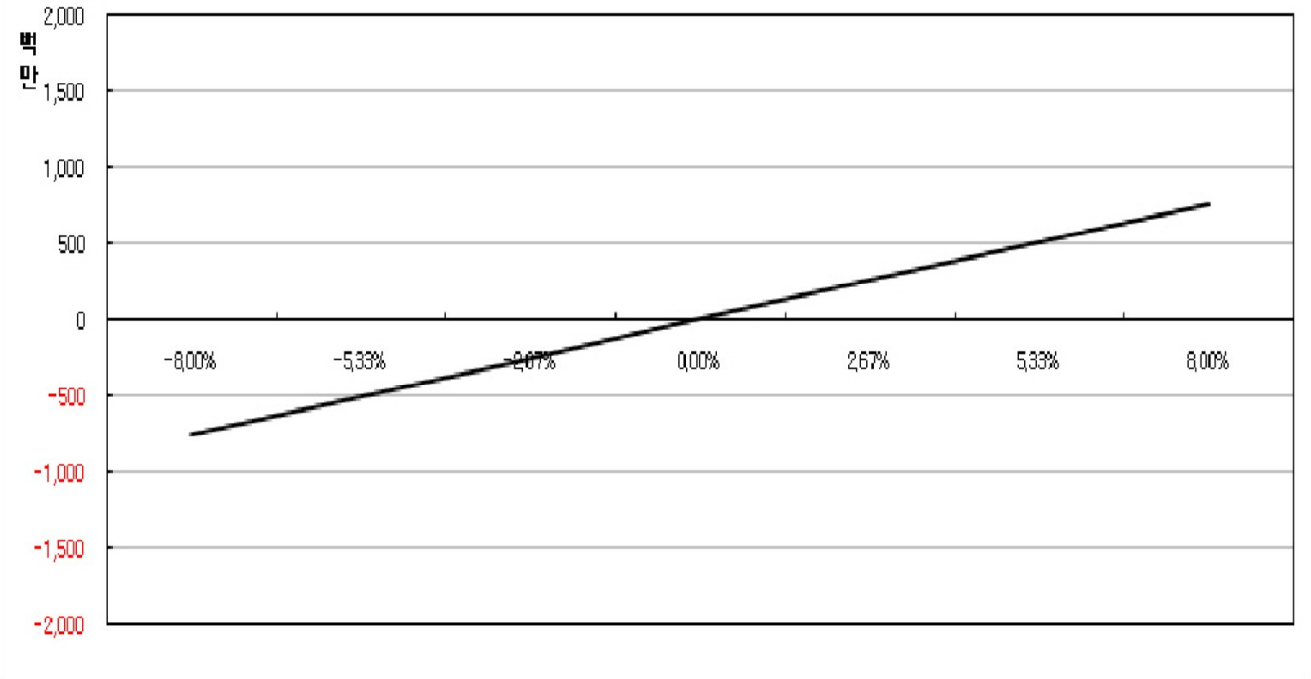
공시일: 2020-06-18

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	1,132	0	1,132	장내
합계			1,132	0	1,132	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

90

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

651

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

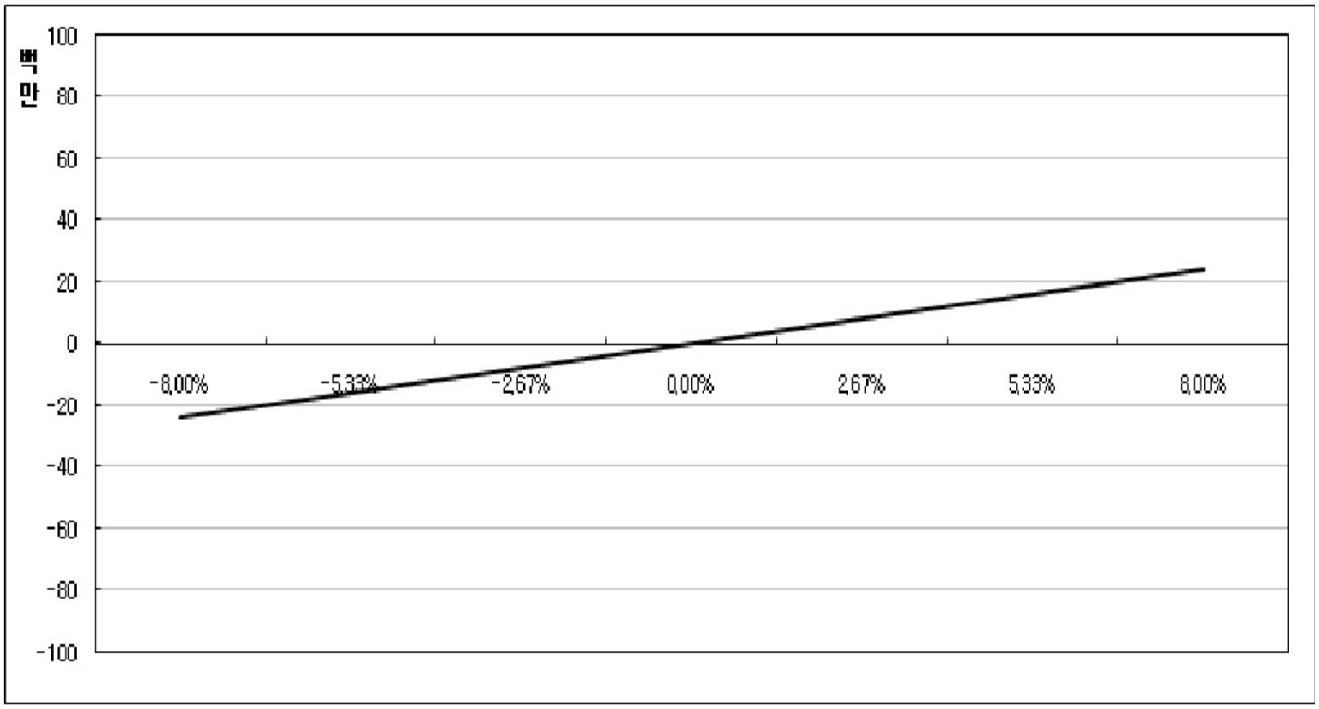
공시일: 2020-06-18

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	1,627	0	1,627	장내
합계			1,627	0	1,627	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

130

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

973

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

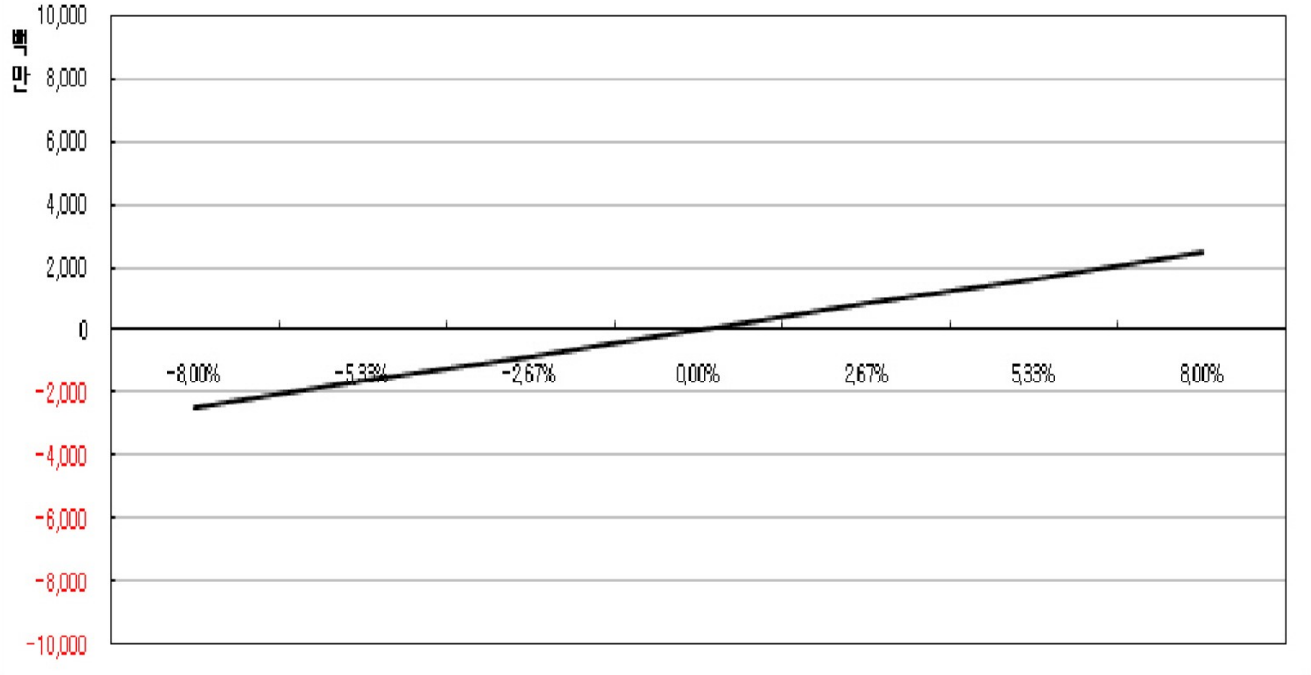
공시일: 2020-06-18

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	142	71	71	장내
누계	주가지수	선물	5,307	0	5,307	장내
합계			5,307	0	5,307	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

423

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

1,786

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

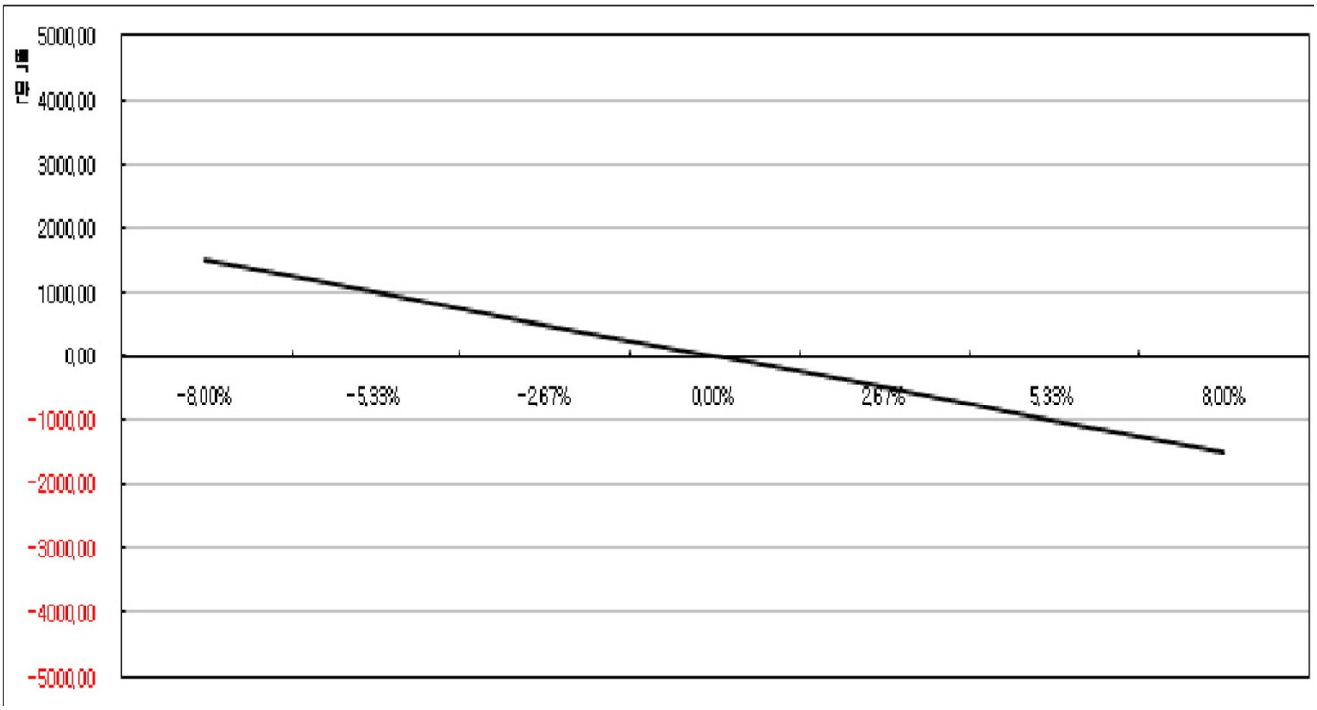
공시일: 2020-06-18

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	0	1,910	-1,910	장내
합계			0	1,910	-1,910	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

152

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

241

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

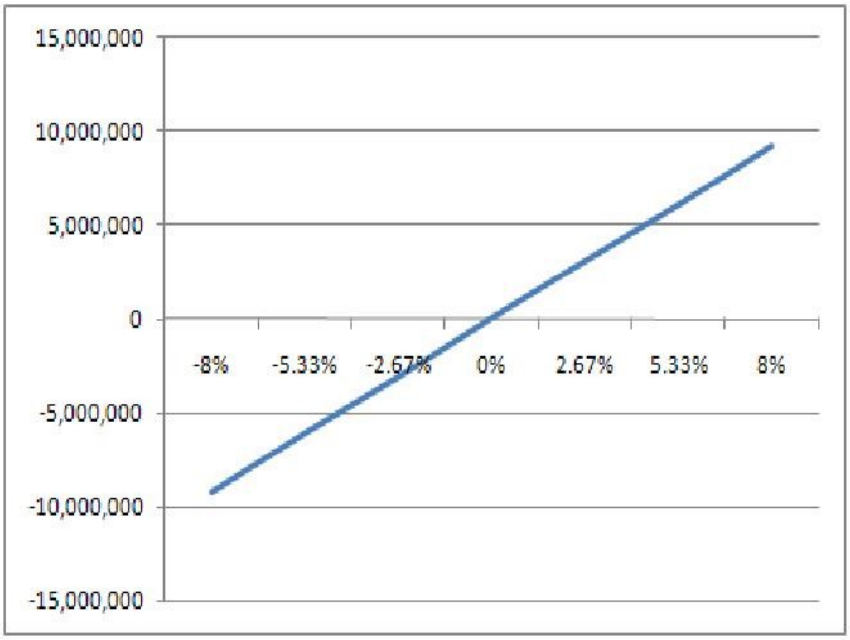
공시일: 2020-06-18

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	354	0	354	장내
누계	주가지수	선물	68,208	0	68,208	장내
합계			68,208	0	68,208	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,434

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

16,269