펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2020-06-30

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	973	0	973	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	10	1,946	-1,936	장내
합계			983	1,946	-963	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	32

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	156

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

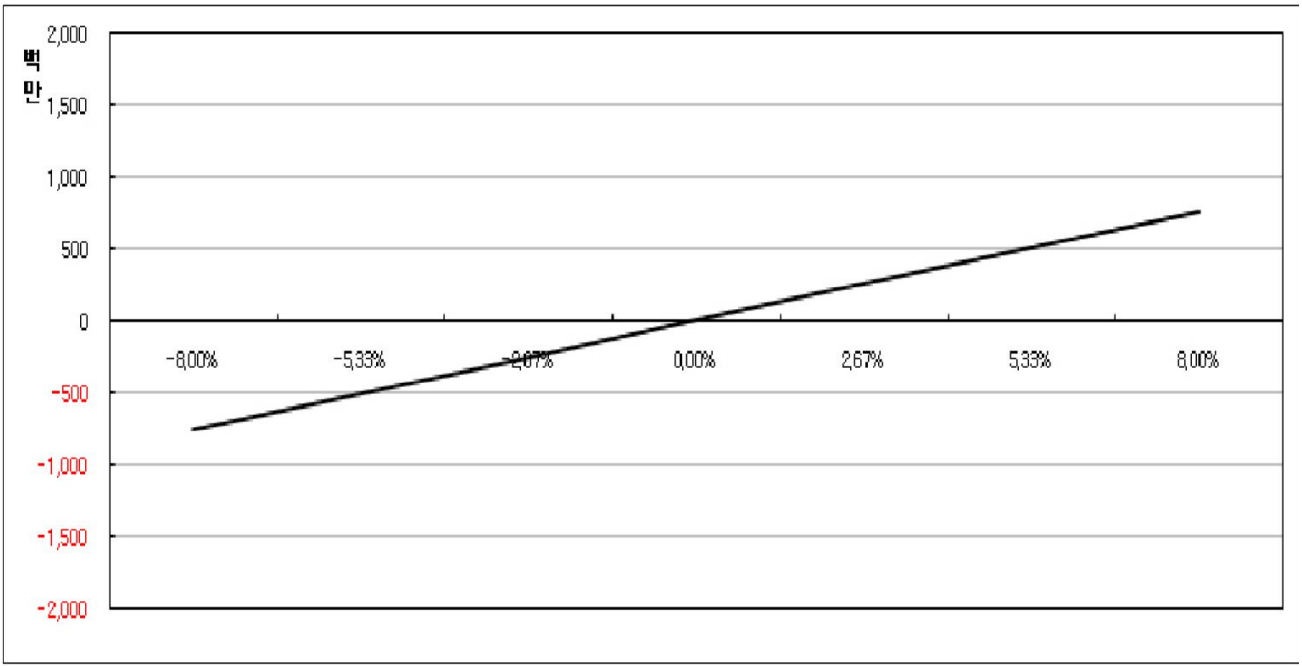
공시일: 2020-06-30

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	1,112	0	1,112	장내
합계			1,112	0	1,112	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

89

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

645

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

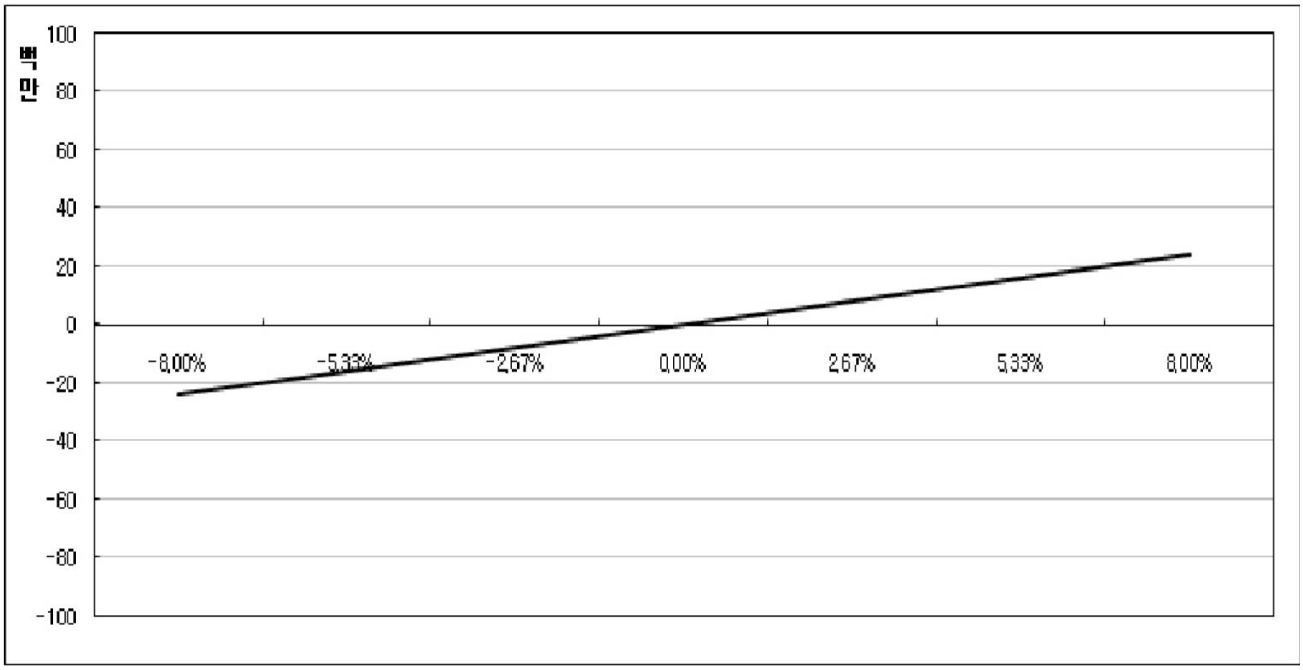
공시일: 2020-06-30

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	1,599	0	1,599	장내
합계			1,599	0	1,599	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

128

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

965

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

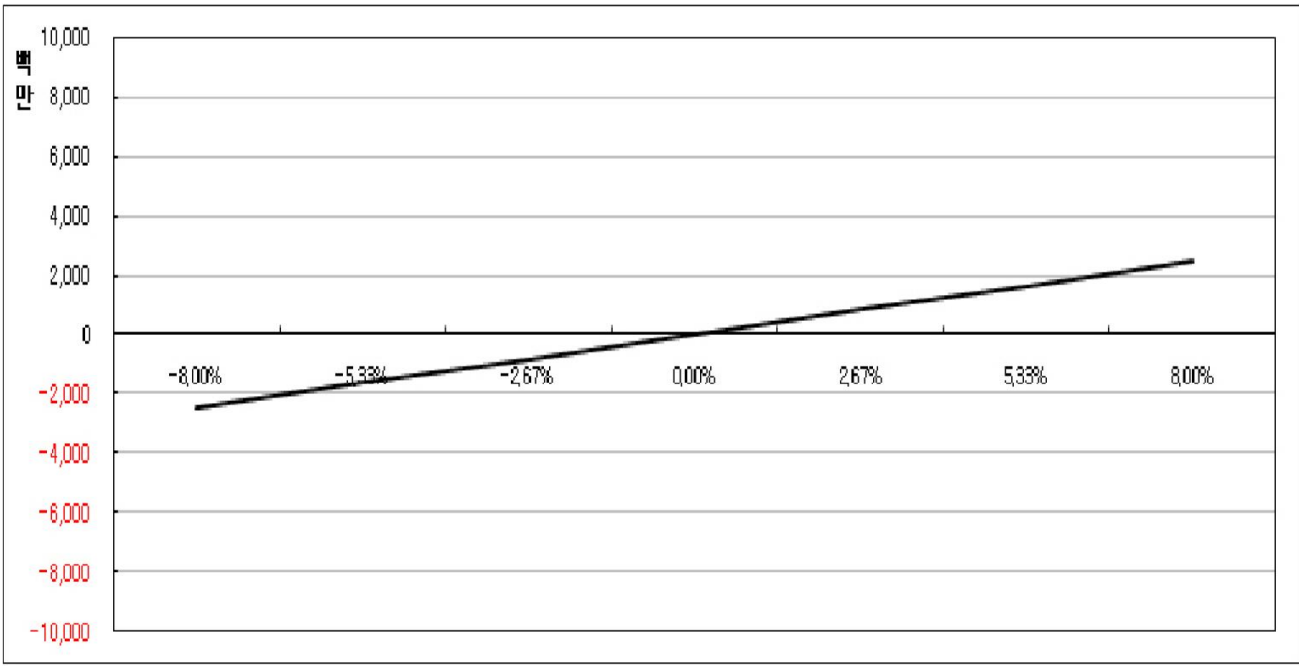
공시일: 2020-06-30

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	139	139	0	장내
누계	주가지수	선물	4,796	0	4,796	장내
합계			4,796	0	4,796	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

384

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

1,725

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

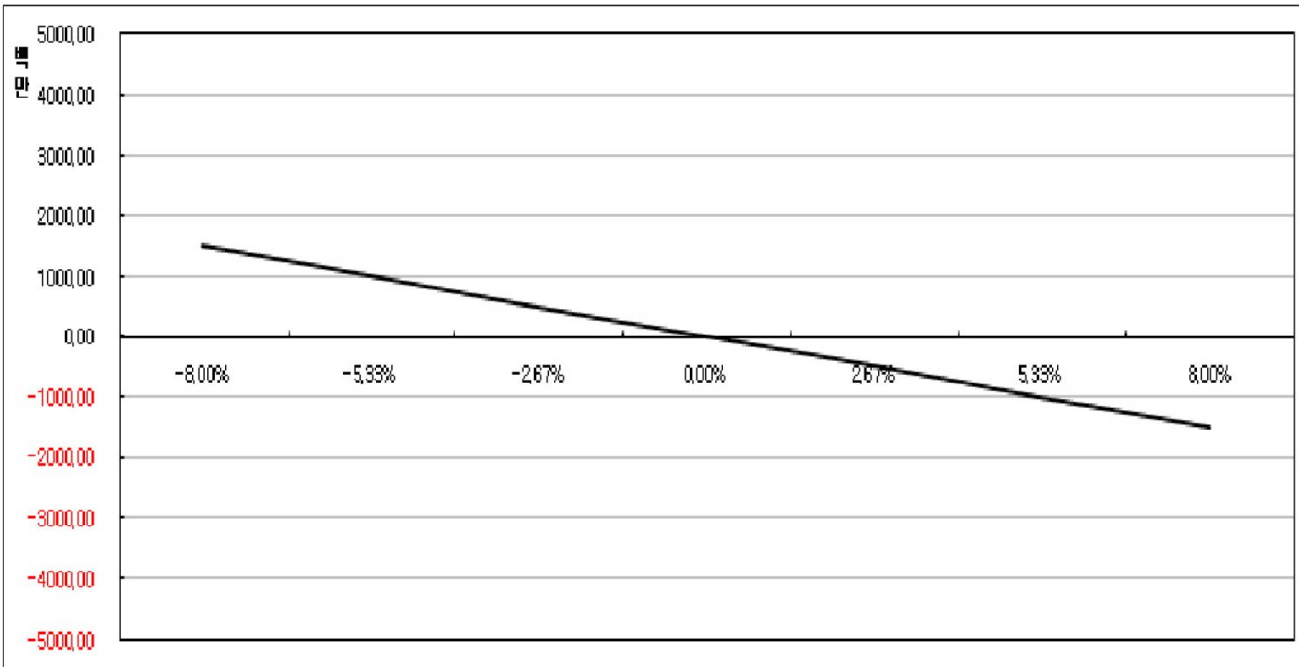
공시일: 2020-06-30

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	1,946	-1,946	장내
합계			0	1,946	-1,946	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

156

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

249

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

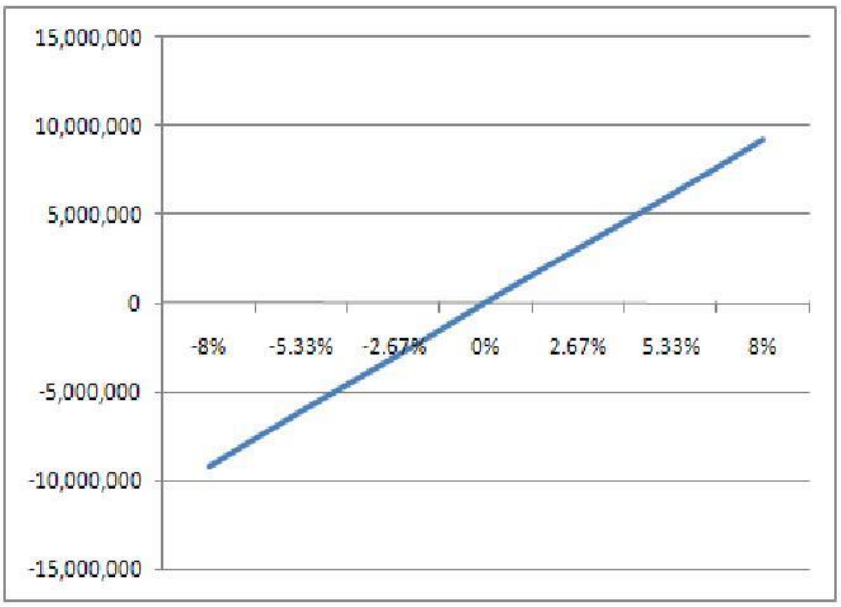
공시일: 2020-06-30

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	278	-278	장내
누계	주가지수	선물	63,741	0	63,741	장내
합계			63,741	0	63,741	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,101

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

15,763