펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2020-07-01

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	980	0	980	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	7	1,961	-1,954	장내
합계			987	1,961	-973	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	34

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	154

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

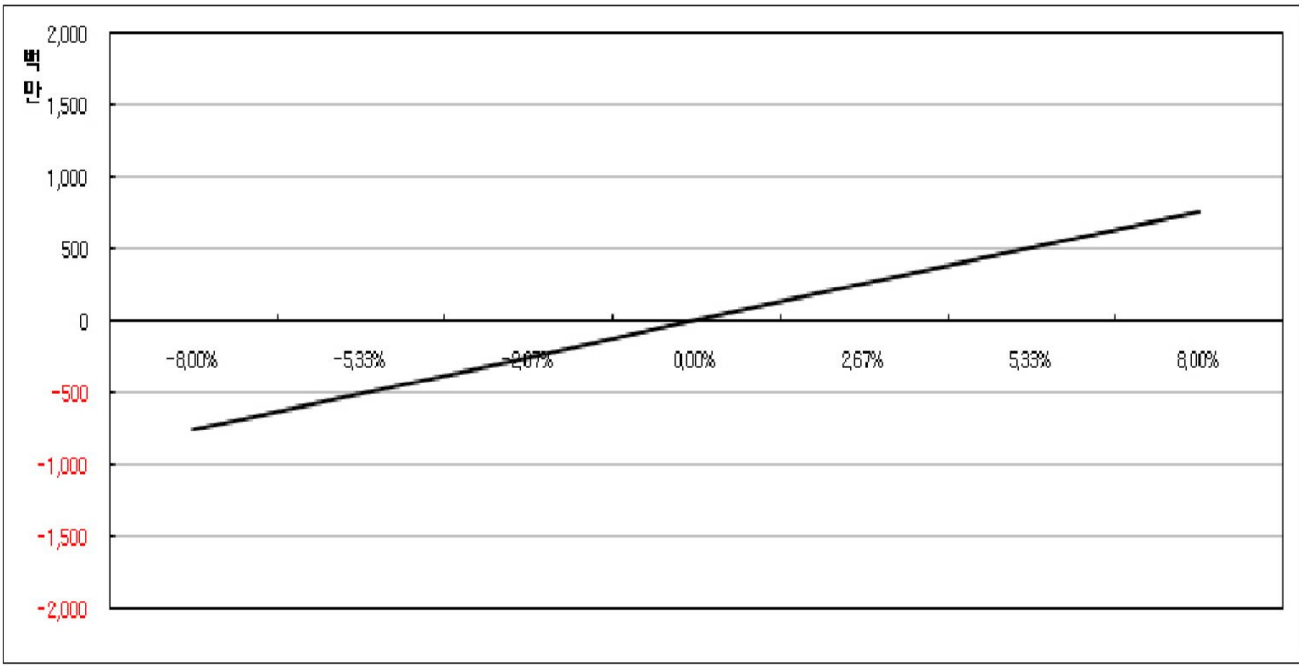
공시일: 2020-07-01

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	1,120	0	1,120	장내
합계			1,120	0	1,120	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

90

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

650

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

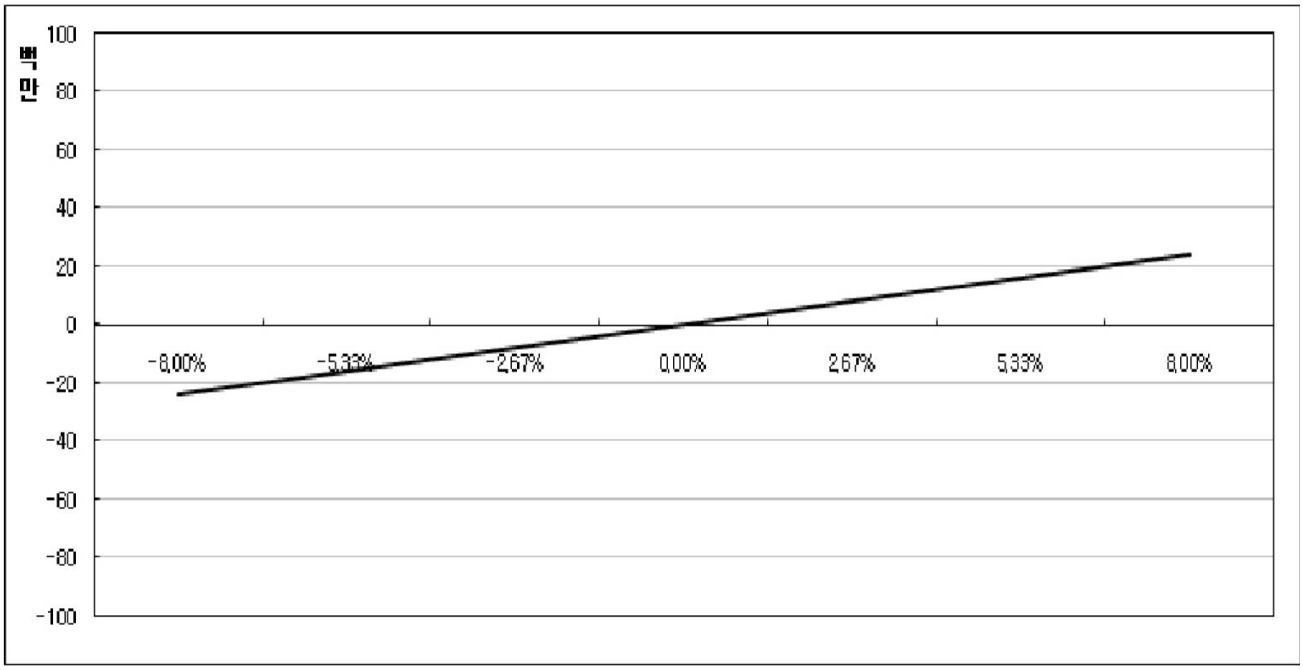
공시일: 2020-07-01

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	1,611	0	1,611	장내
합계			1,611	0	1,611	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	129

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	971

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

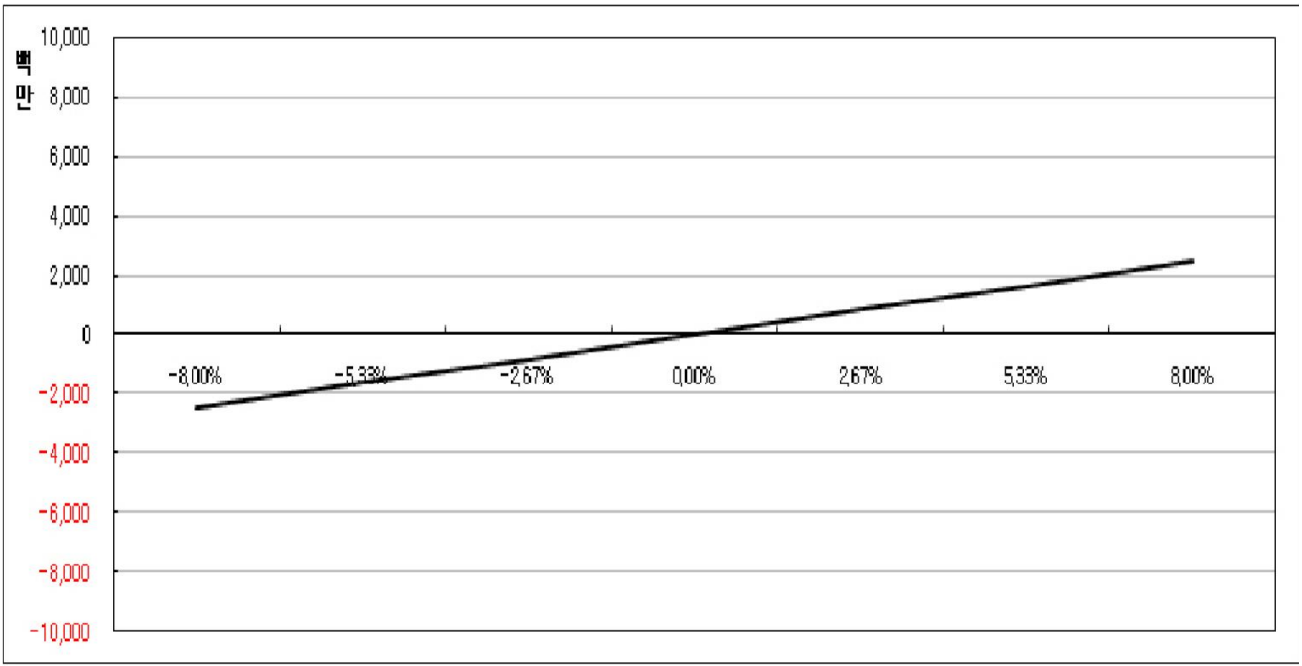
공시일: 2020-07-01

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	140	0	140	장내
누계	주가지수	선물	4,972	0	4,972	장내
합계			4,972	0	4,972	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

399

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

1,753

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

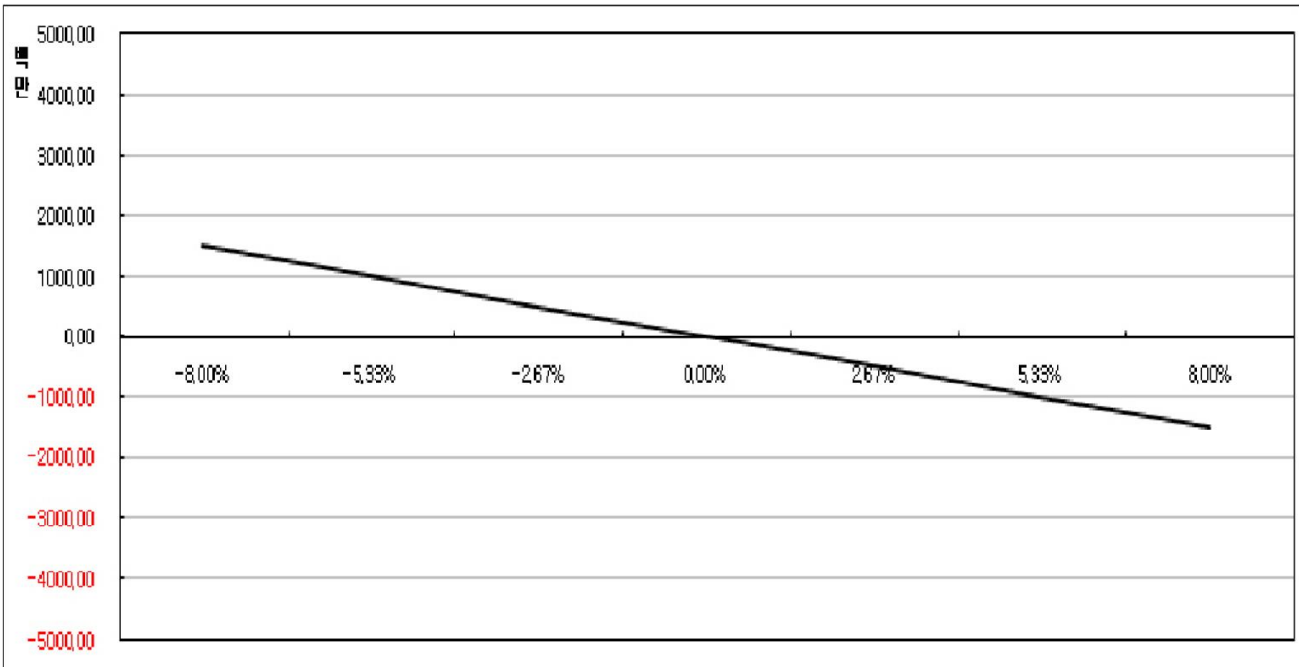
공시일: 2020-07-01

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	1,961	-1,961	장내
합계			0	1,961	-1,961	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

157

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

251

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

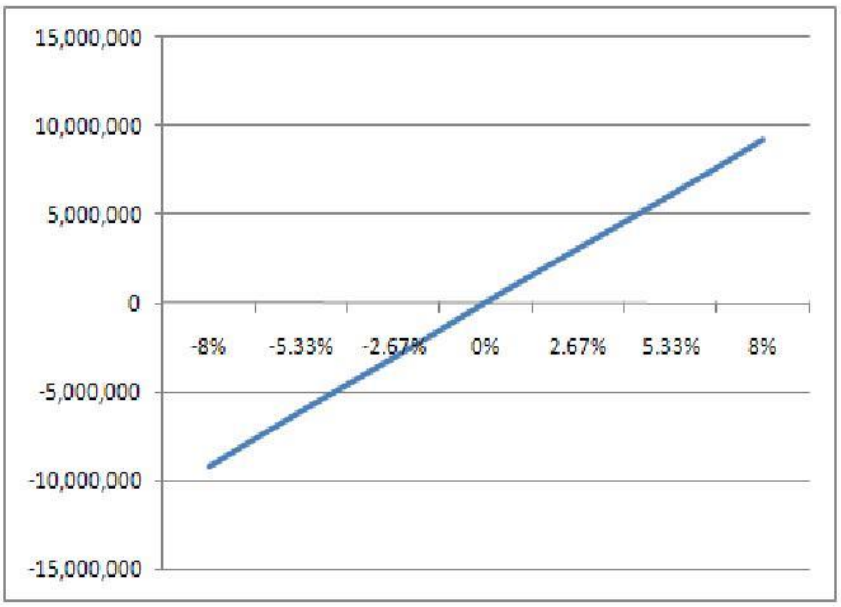
공시일: 2020-07-01

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	64,211	0	64,211	장내
합계			64,211	0	64,211	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,150

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

15,888