펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2020-07-16

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	877	0	877	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	4	1,900	-1,896	장내
합계			880	1,900	-1,019	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	54

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	456

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

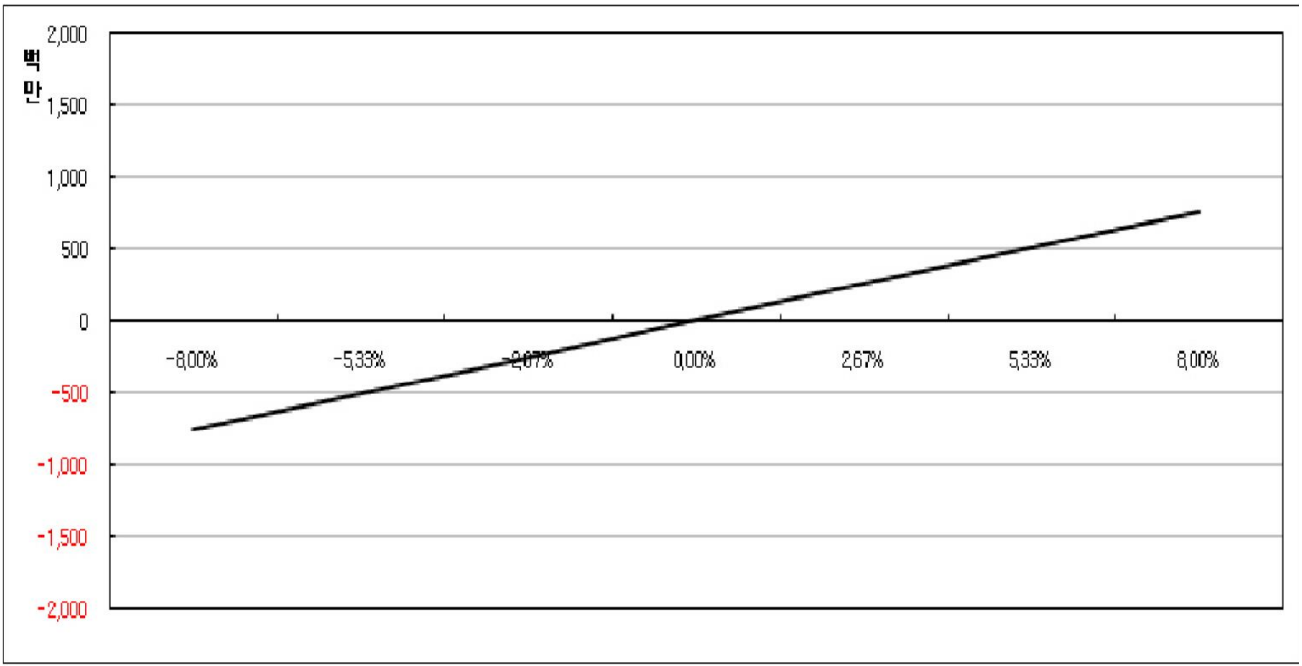
공시일: 2020-07-16

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	1,169	0	1,169	장내
합계			1,169	0	1,169	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

94

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

664

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

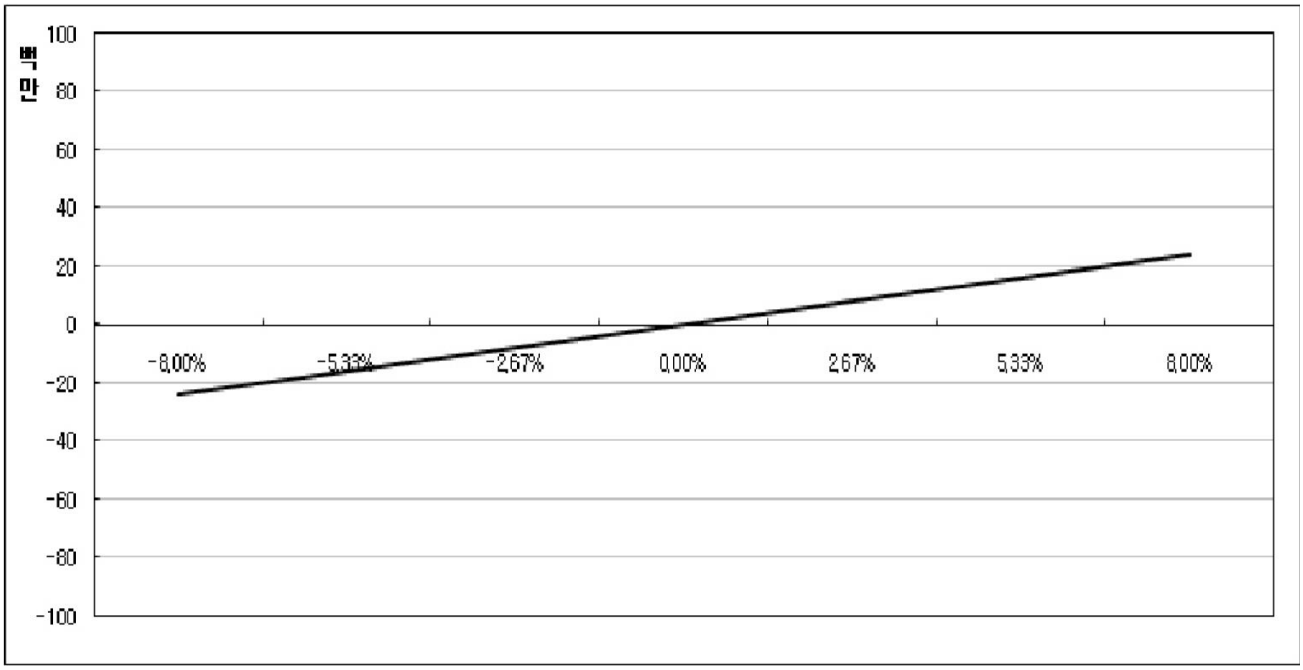
공시일: 2020-07-16

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	1,315	0	1,315	장내
합계			1,315	0	1,315	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	105

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	968

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

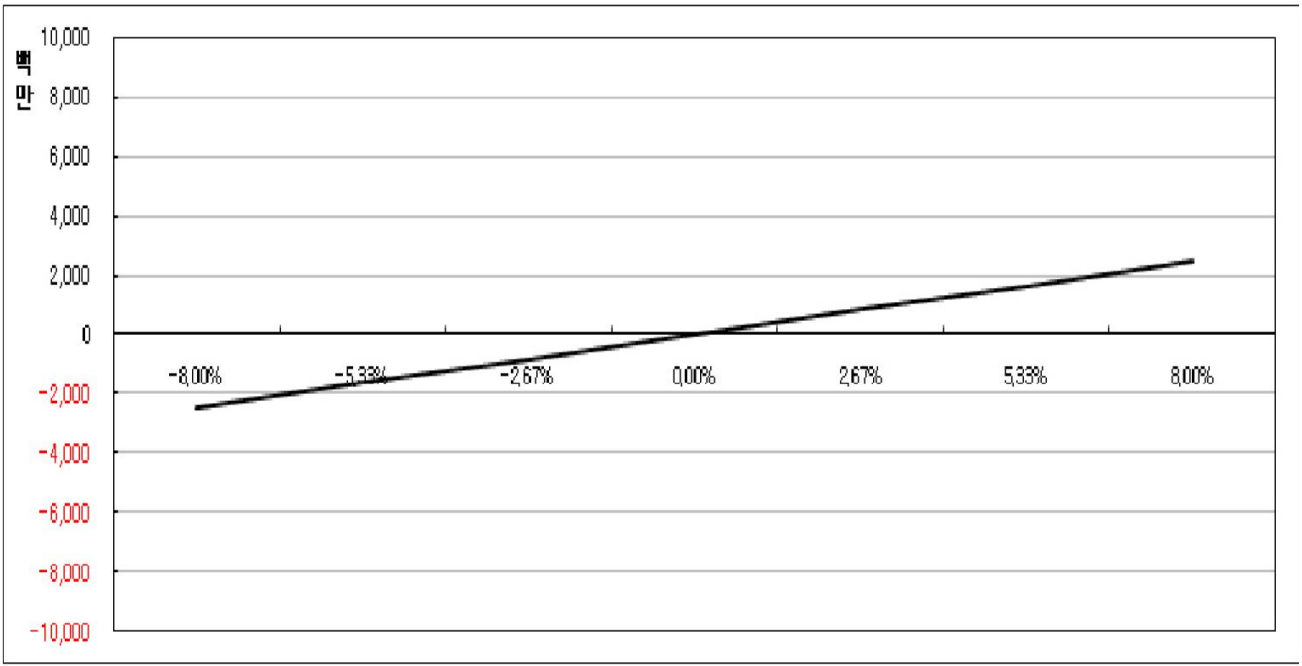
공시일: 2020-07-16

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	511	-511	장내
누계	주가지수	선물	4,311	0	4,311	장내
합계			4,311	0	4,311	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

345

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

1,714

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

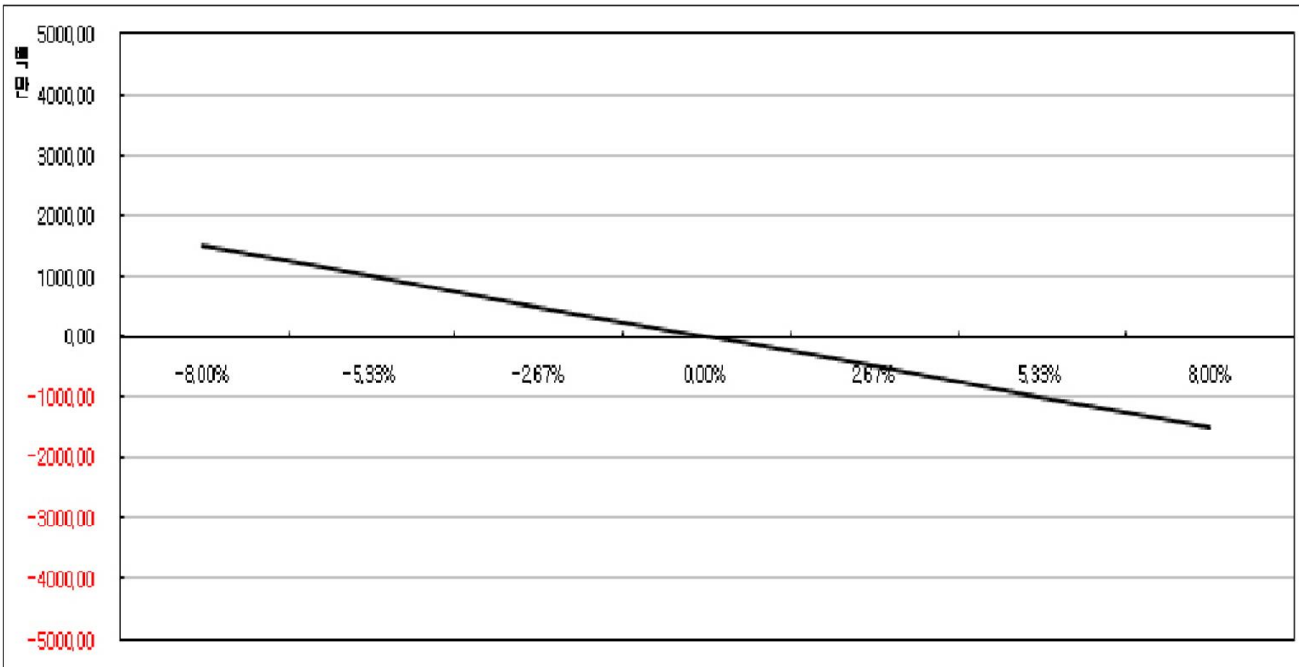
공시일: 2020-07-16

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	73	0	73	장내
누계	주가지수	선물	0	1,973	-1,973	장내
합계			0	1,973	-1,973	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

158

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

253

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

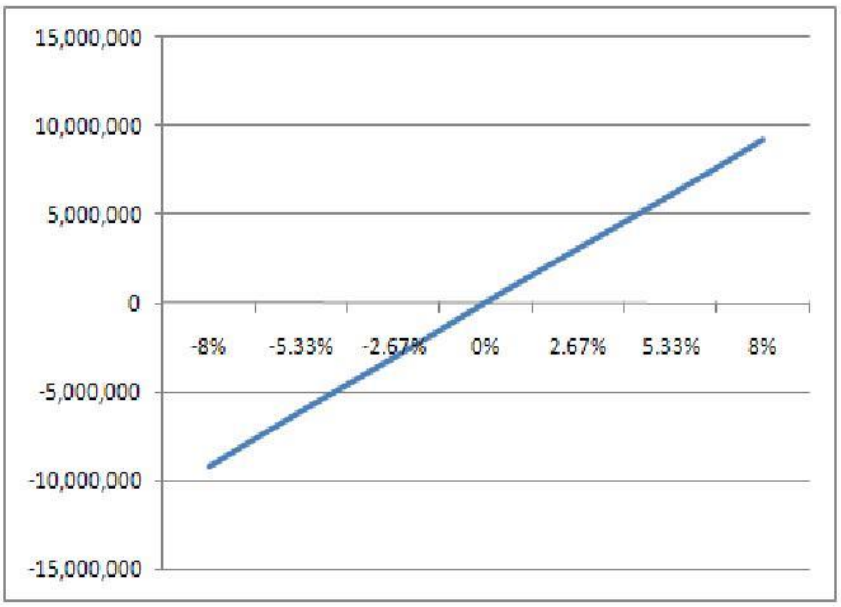
공시일: 2020-07-16

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	2,192	-2,192	장내
누계	주가지수	선물	60,208	0	60,208	장내
합계			60,208	0	60,208	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

4,821

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

15,611