펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2020-07-29

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	225	0	225	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	0	600	-600	장내
합계			225	600	-375	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	27

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	112

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

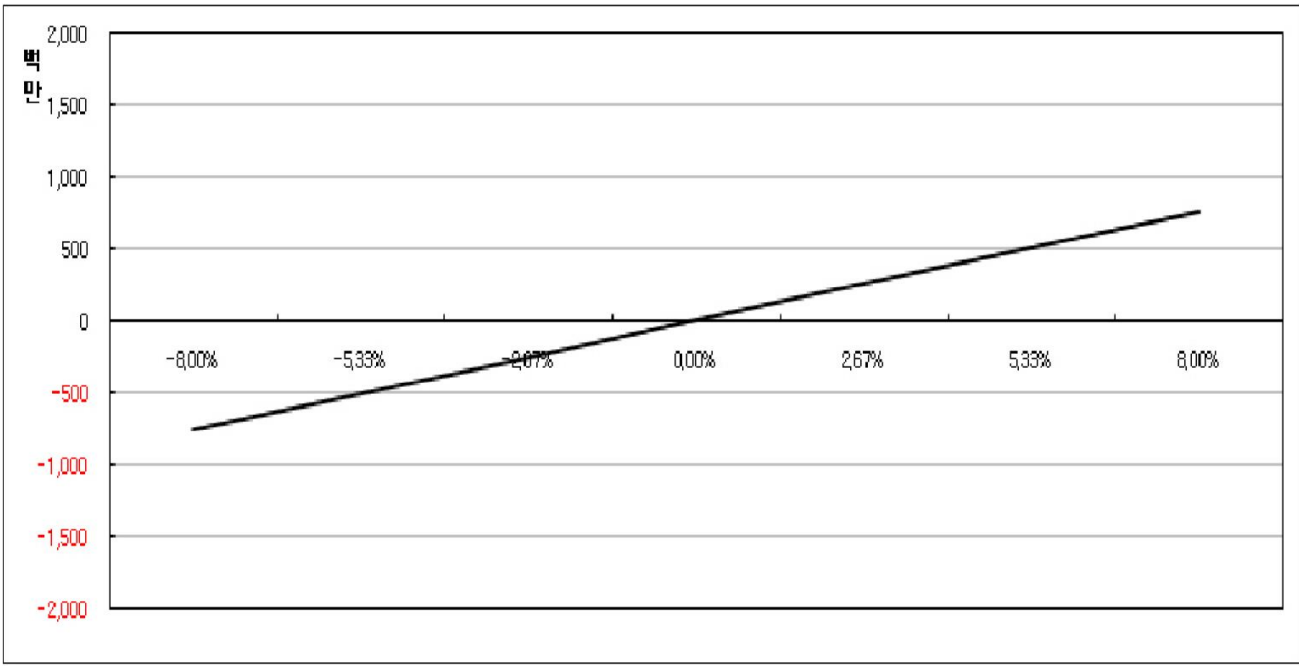
공시일: 2020-07-29

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	1,125	0	1,125	장내
합계			1,125	0	1,125	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	90

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	661

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

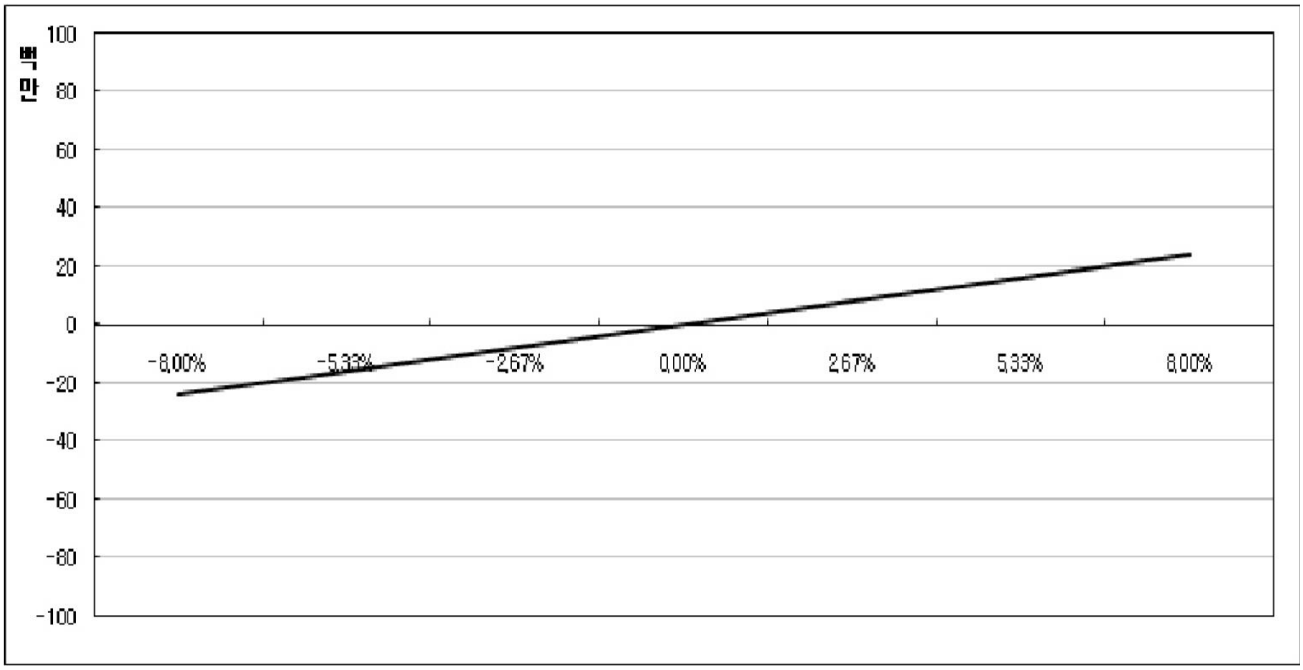
공시일: 2020-07-29

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	1,276	0	1,276	장내
합계			1,276	0	1,276	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	102

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	972

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

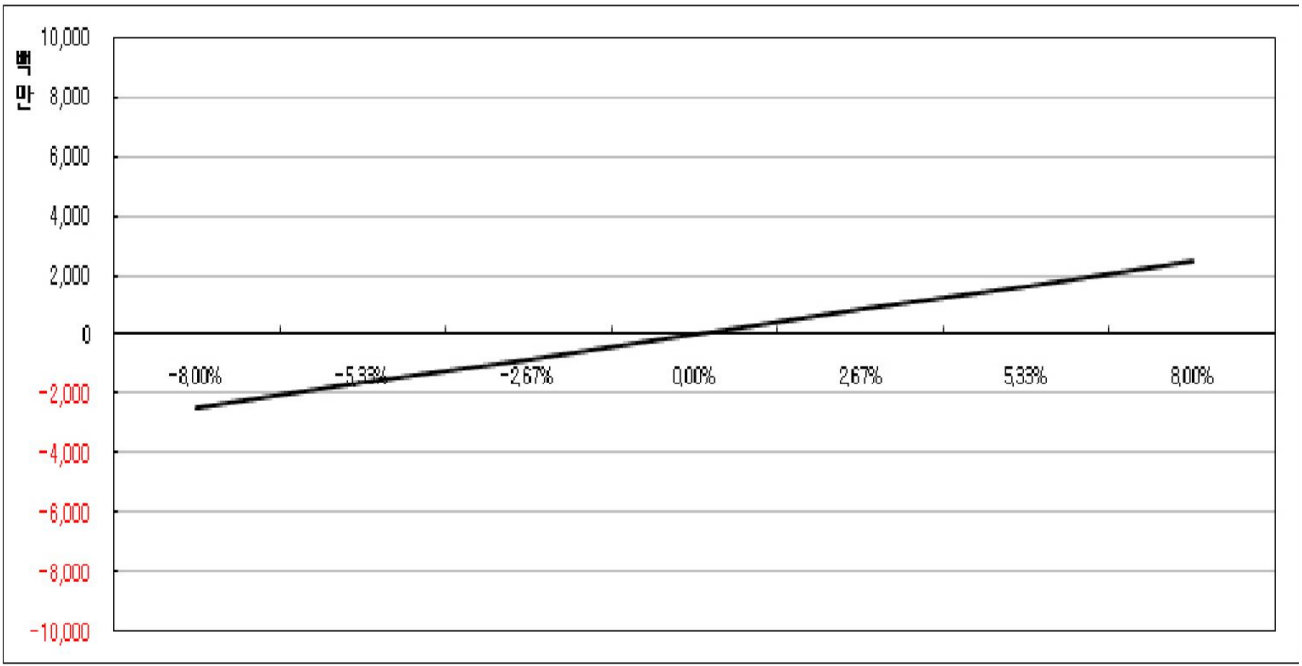
공시일: 2020-07-29

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	375	-375	장내
누계	주가지수	선물	3,677	0	3,677	장내
합계			3,677	0	3,677	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

293

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

1,638

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

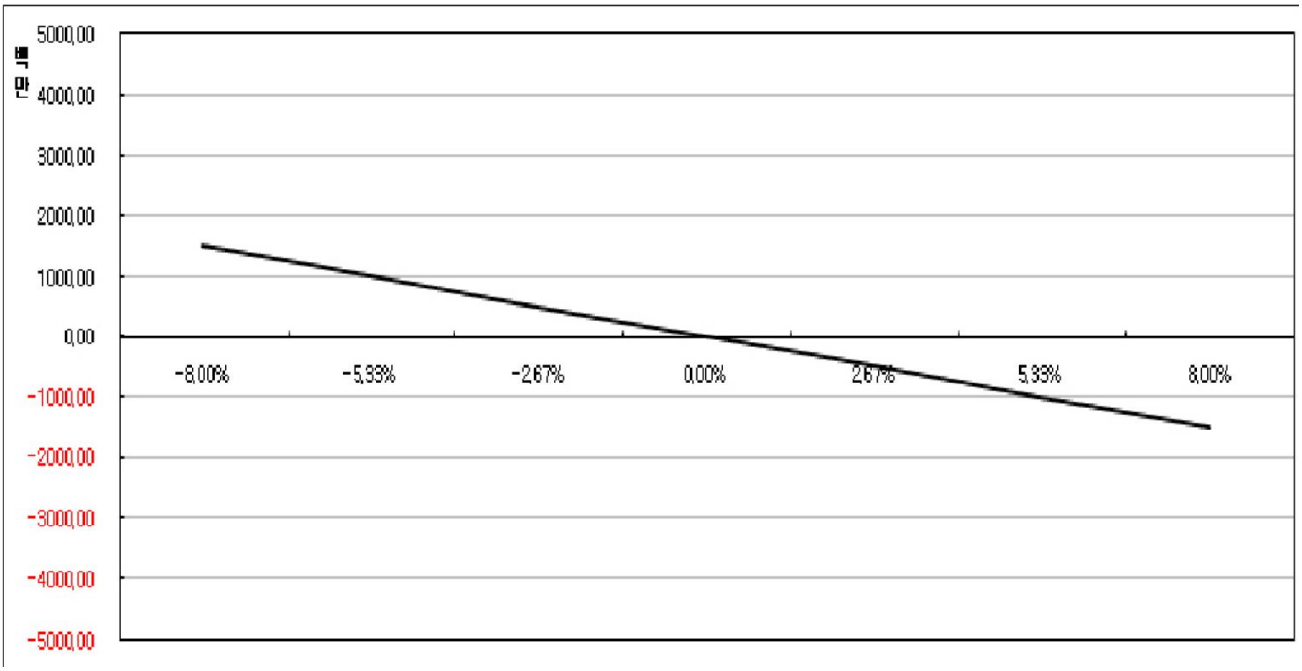
공시일: 2020-07-29

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	75	-75	장내
누계	주가지수	선물	0	1,876	-1,876	장내
합계			0	1,876	-1,876	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

150

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

240

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

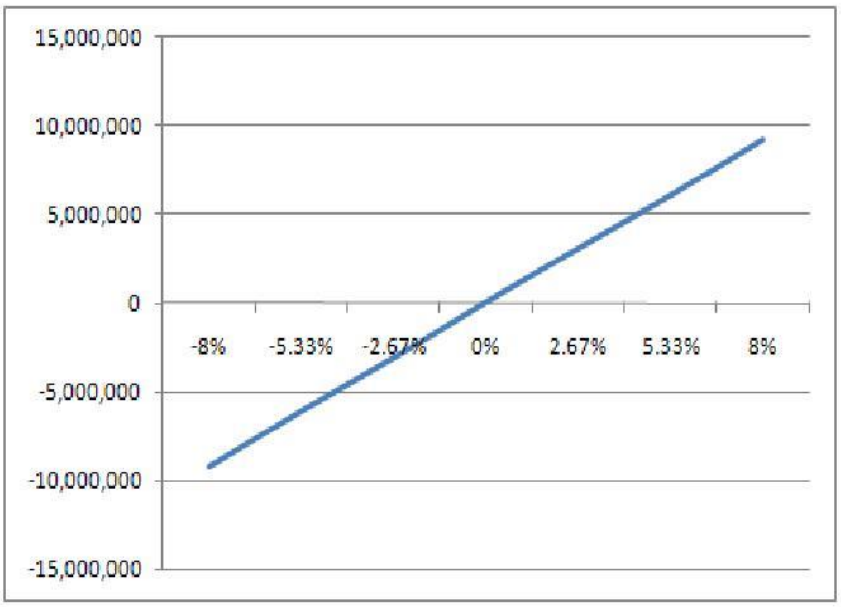
공시일: 2020-07-29

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	4,502	-4,502	장내
누계	주가지수	선물	55,374	0	55,374	장내
합계			55,374	0	55,374	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

4,416

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

14,793