펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2020-08-18

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	160	0	160	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	0	319	-319	장내
합계			160	319	-160	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	10

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	45

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

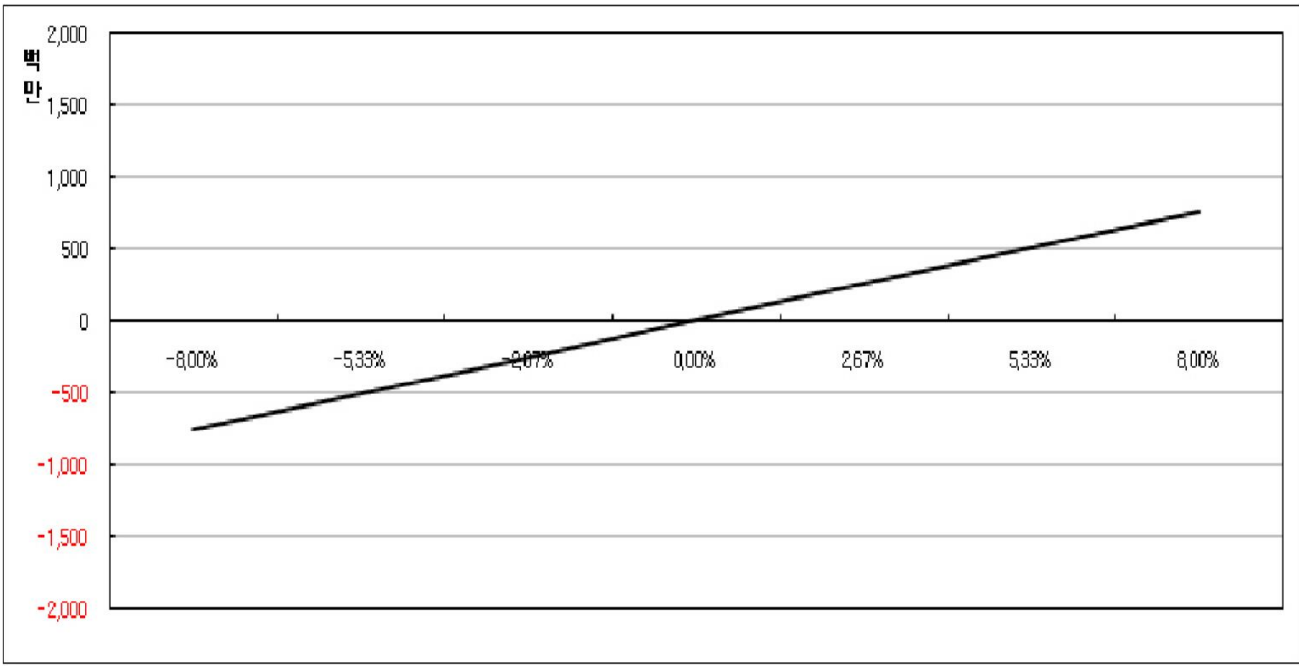
공시일: 2020-08-18

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	160	-160	장내
누계	주가지수	선물	1,038	0	1,038	장내
합계			1,038	0	1,038	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

83

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

686

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

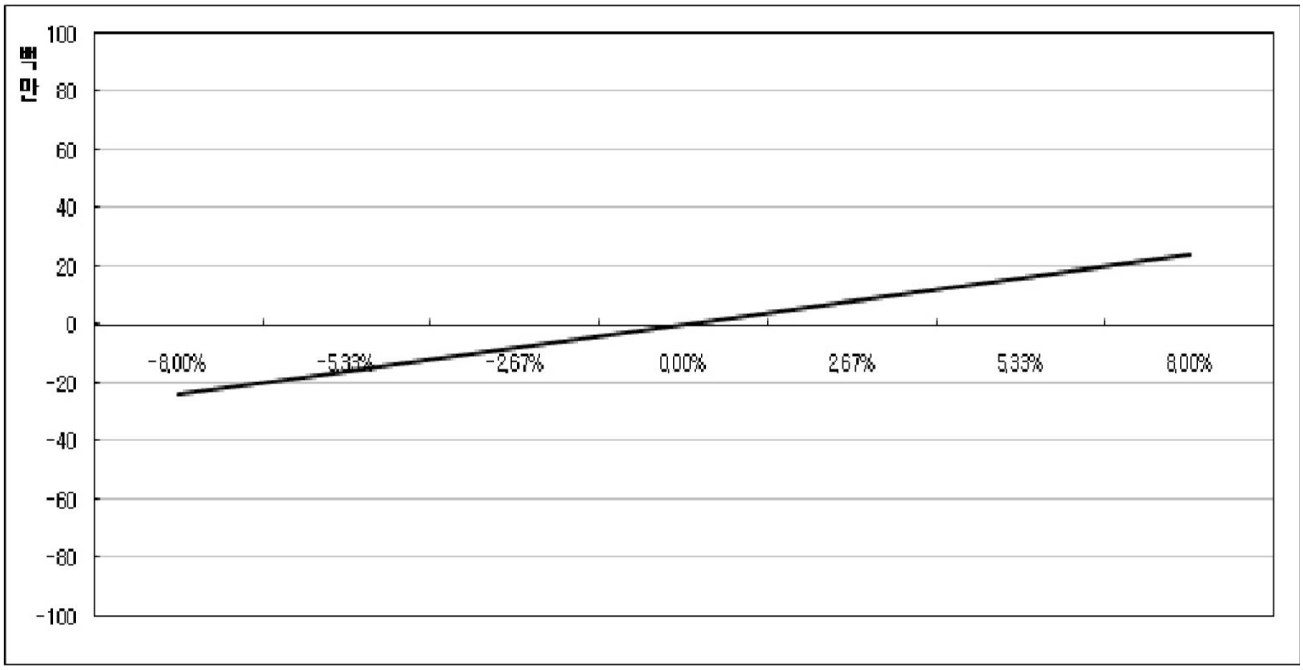
공시일: 2020-08-18

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	1,038	0	1,038	장내
합계			1,038	0	1,038	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	83

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	1,002

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

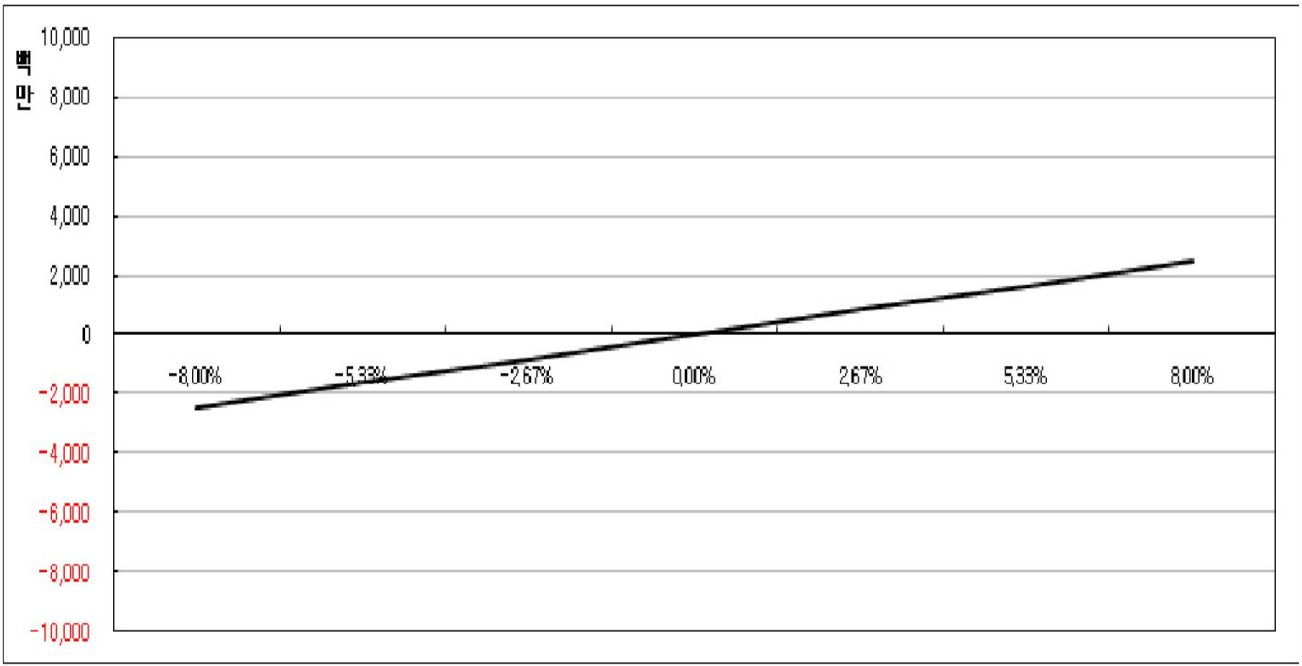
공시일: 2020-08-18

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	160	559	-399	장내
누계	주가지수	선물	1,995	0	1,995	장내
합계			1,995	0	1,995	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

159

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

1,557

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

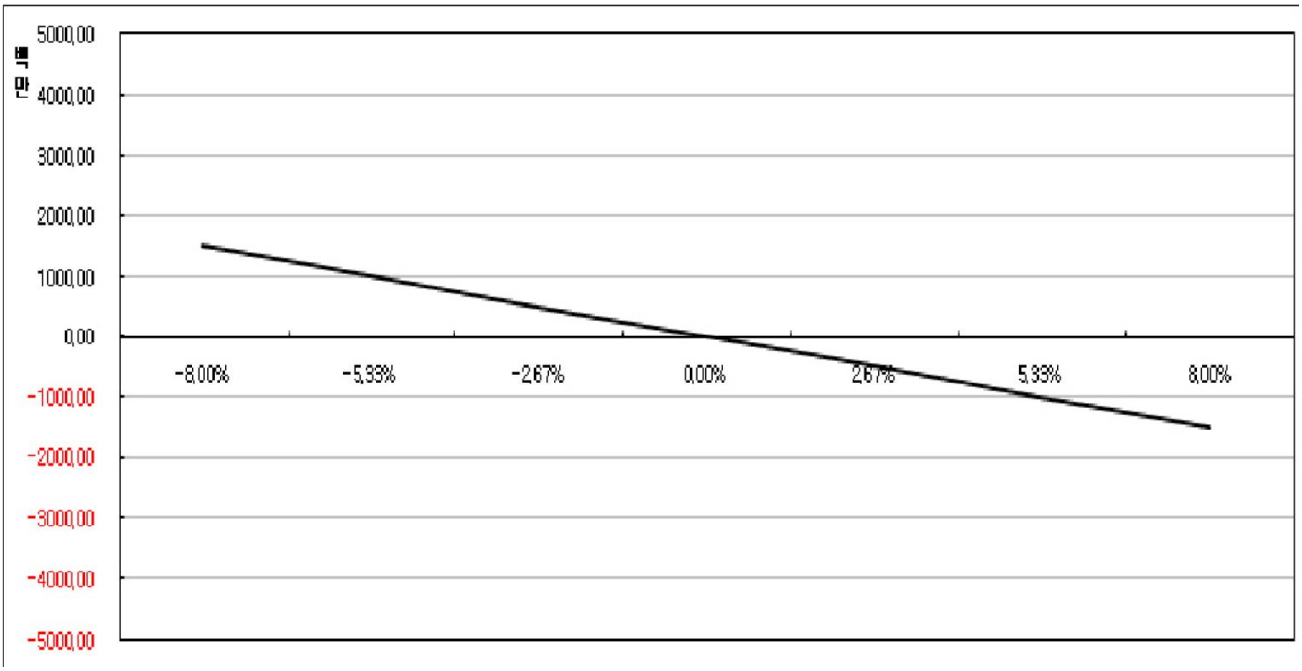
공시일: 2020-08-18

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	1,915	-1,915	장내
합계			0	1,915	-1,915	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	153

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	245

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

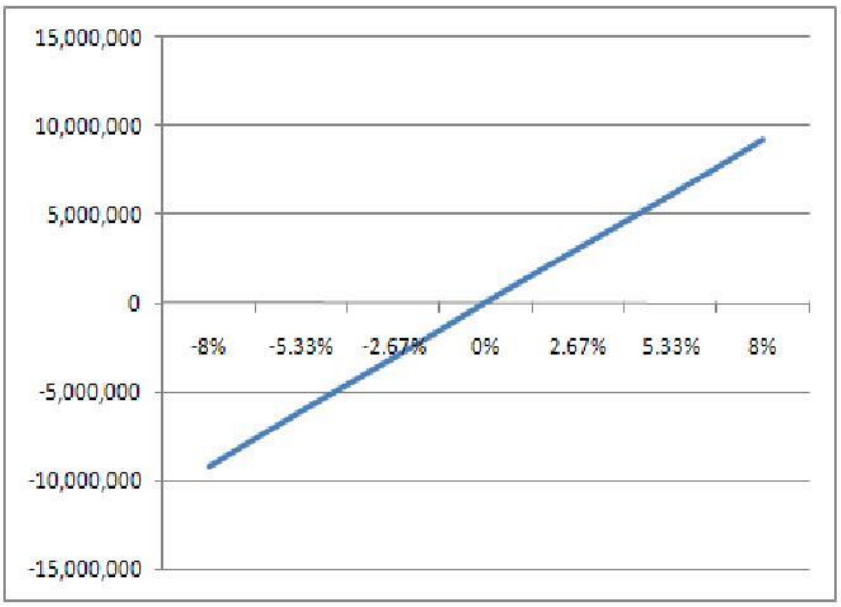
공시일: 2020-08-18

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	1,437	0	1,437	장내
누계	주가지수	선물	41,820	0	41,820	장내
합계			41,820	0	41,820	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

3,341

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

11,921