펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2020-03-02

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	1,206	0	1,206	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	69	0	69	장내
합계			1,276	0	1,276	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	40

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	354

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

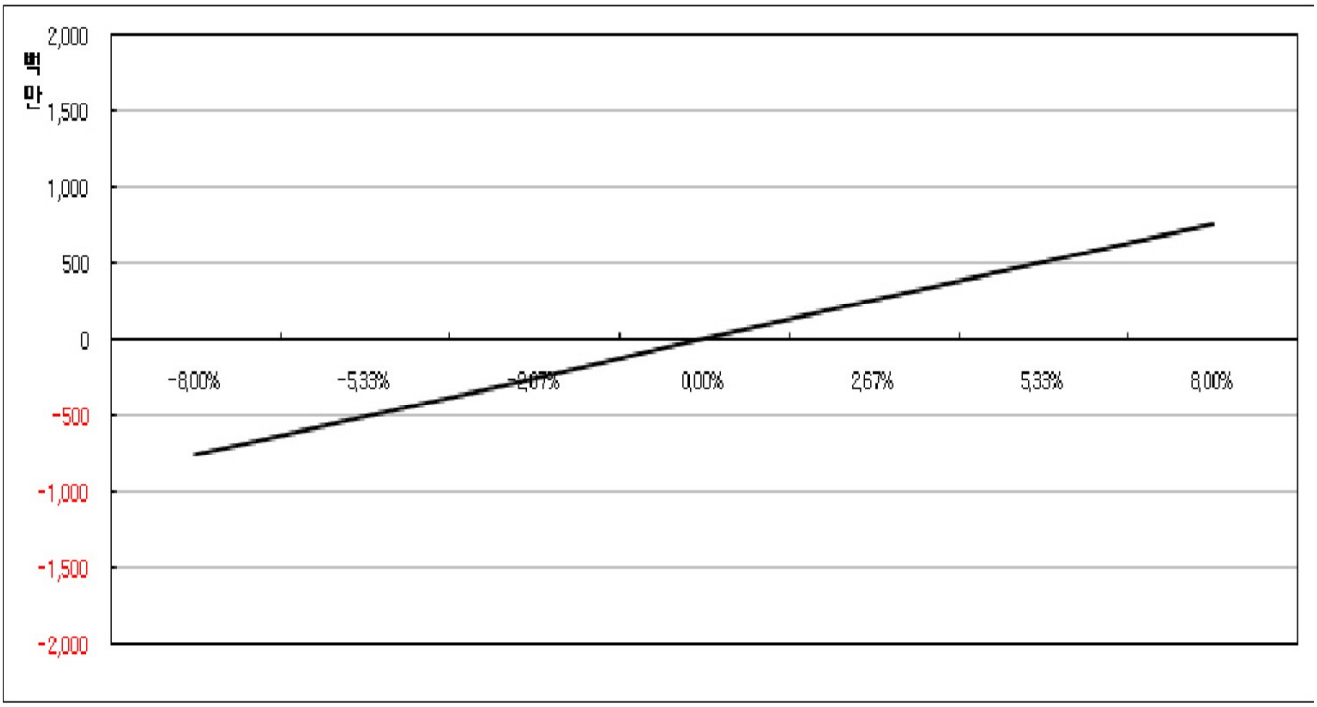
공시일: 2020-03-02

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	402	0	402	장내
합계			402	0	402	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

32

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

358

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

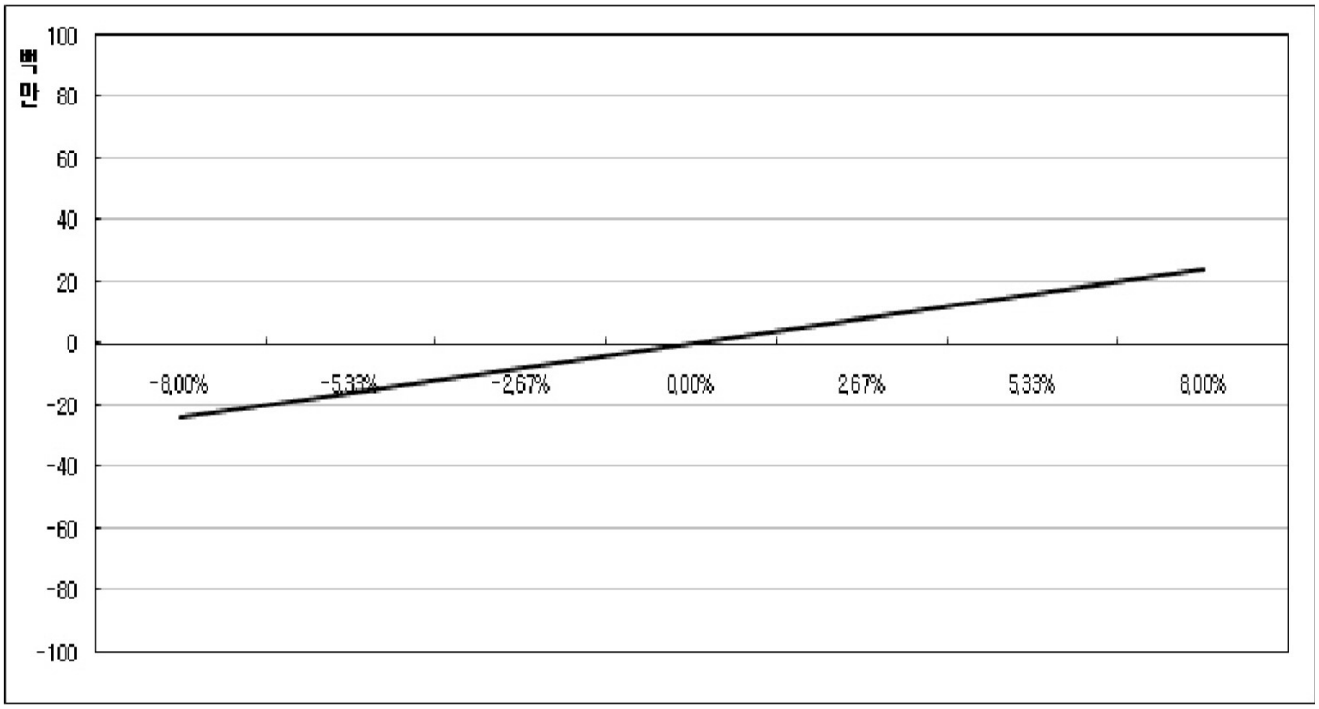
공시일: 2020-03-02

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	1,273	0	1,273	장내
합계			1,273	0	1,273	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

102

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

500

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

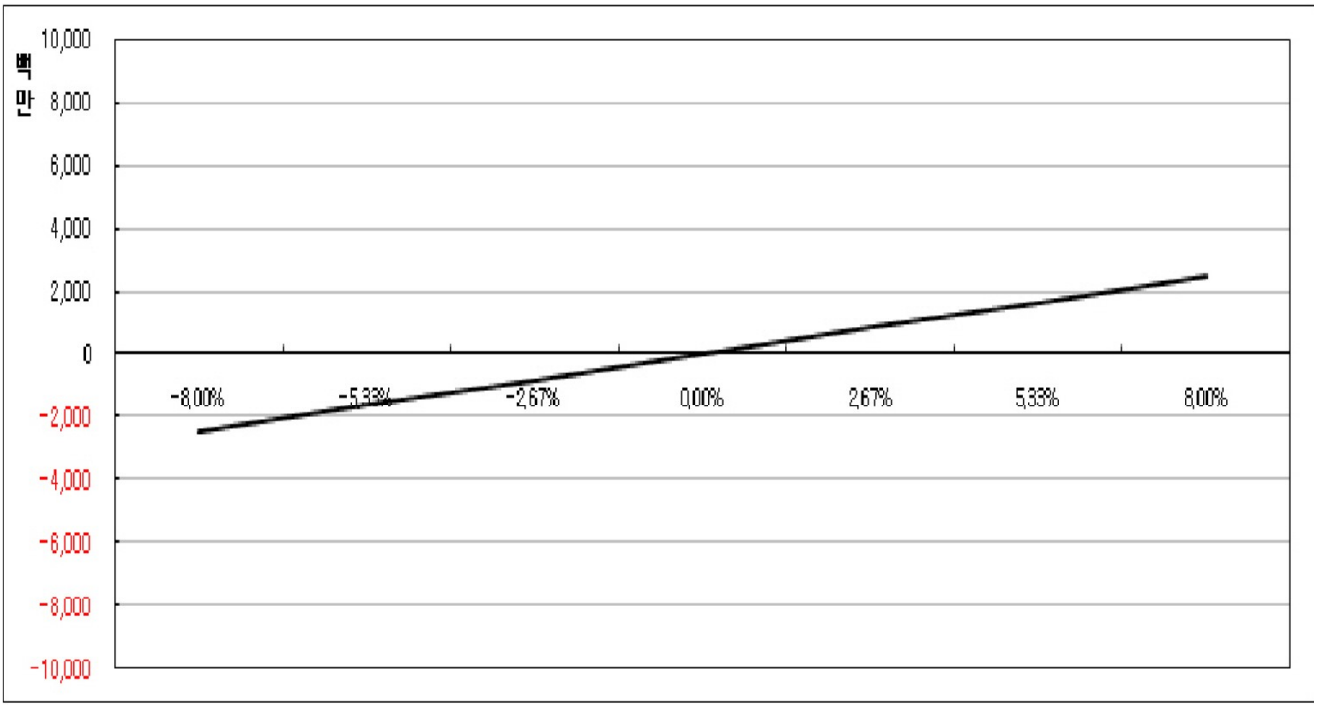
공시일: 2020-03-02

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	3,819	0	3,819	장내
합계			3,819	0	3,819	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

305

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

915

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

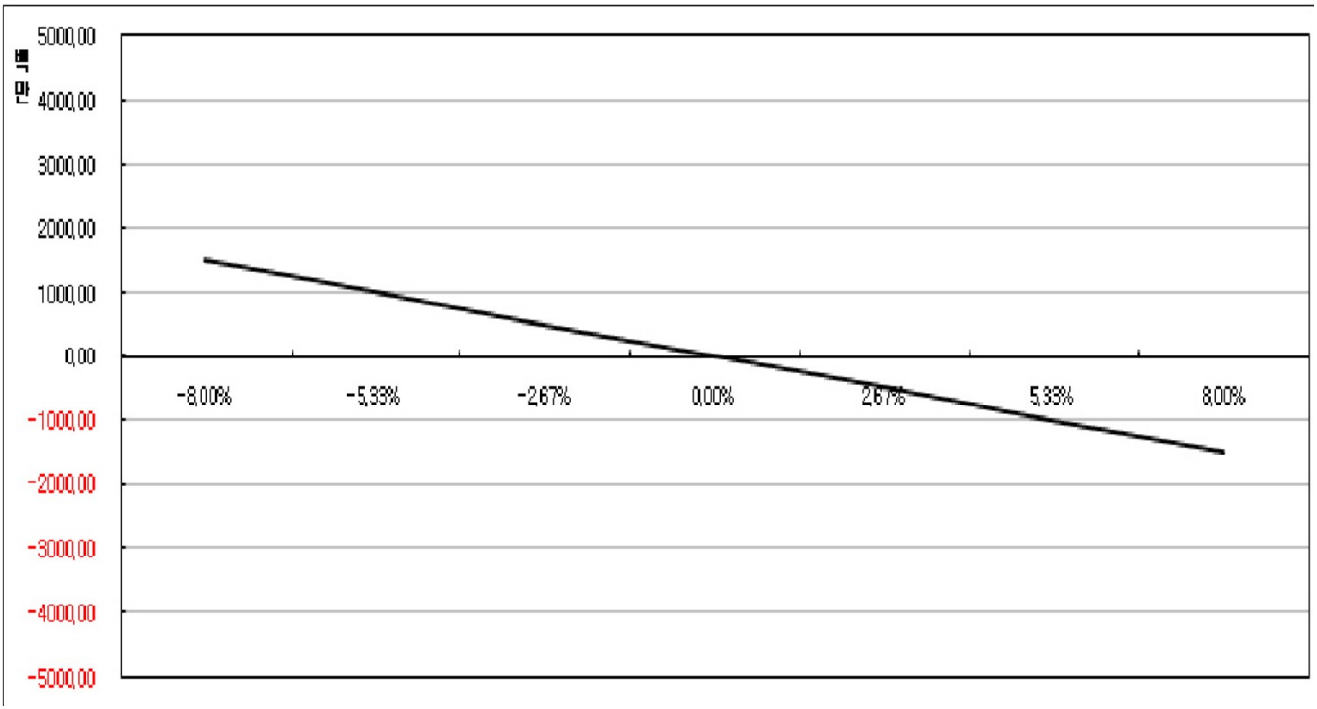
공시일: 2020-03-02

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	1,742	-1,742	장내
합계			0	1,742	-1,742	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

139

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

123

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

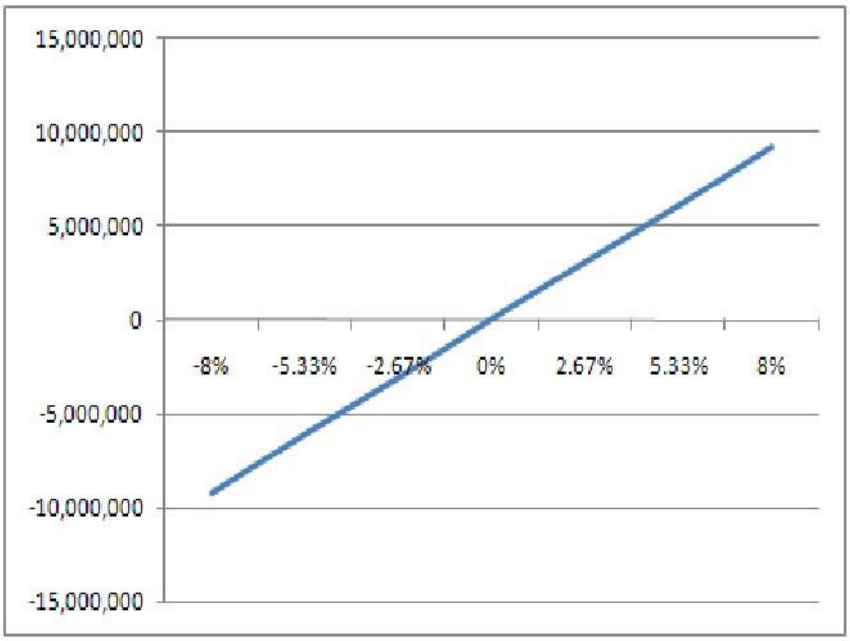
공시일: 2020-03-02

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	70,422	0	70,422	장내
합계			70,422	0	70,422	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,630

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

8,791