펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2020-03-03

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	1,217	0	1,217	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	60	0	60	장내
합계			1,276	0	1,276	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	38

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	255

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

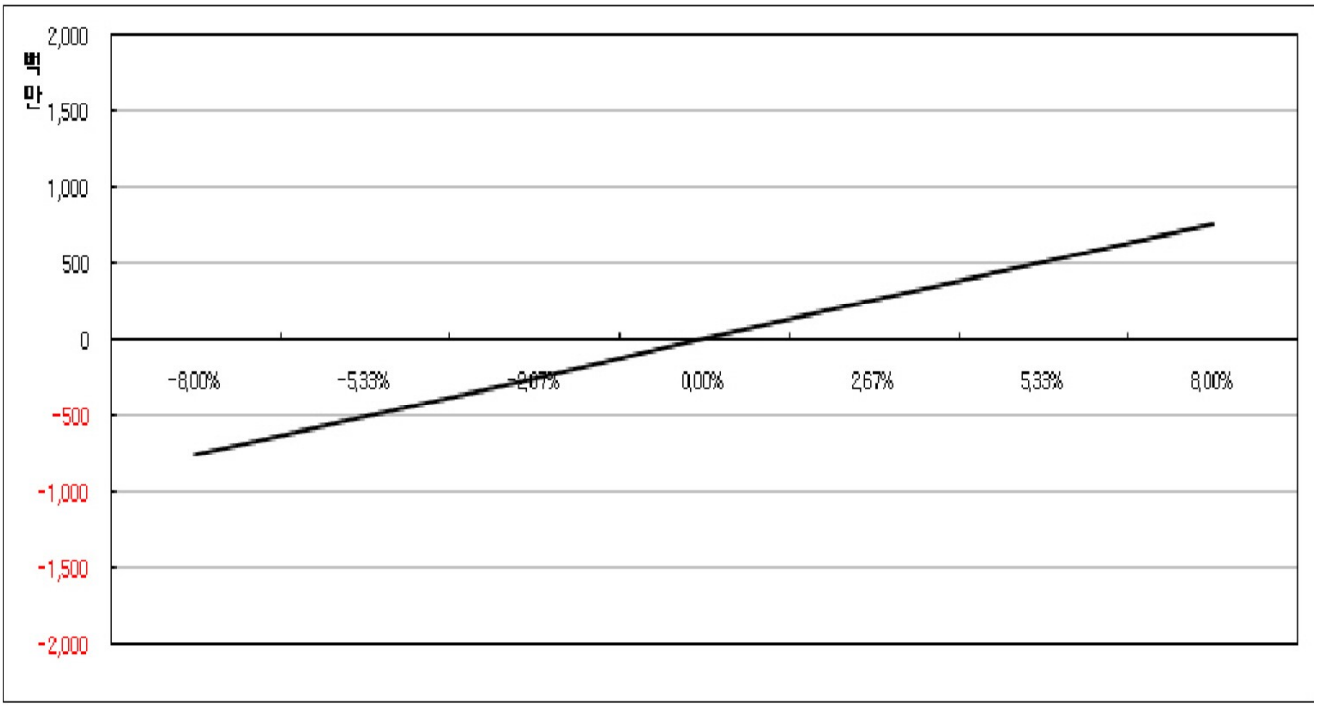
공시일: 2020-03-03

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	406	0	406	장내
합계			406	0	406	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

33

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

362

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

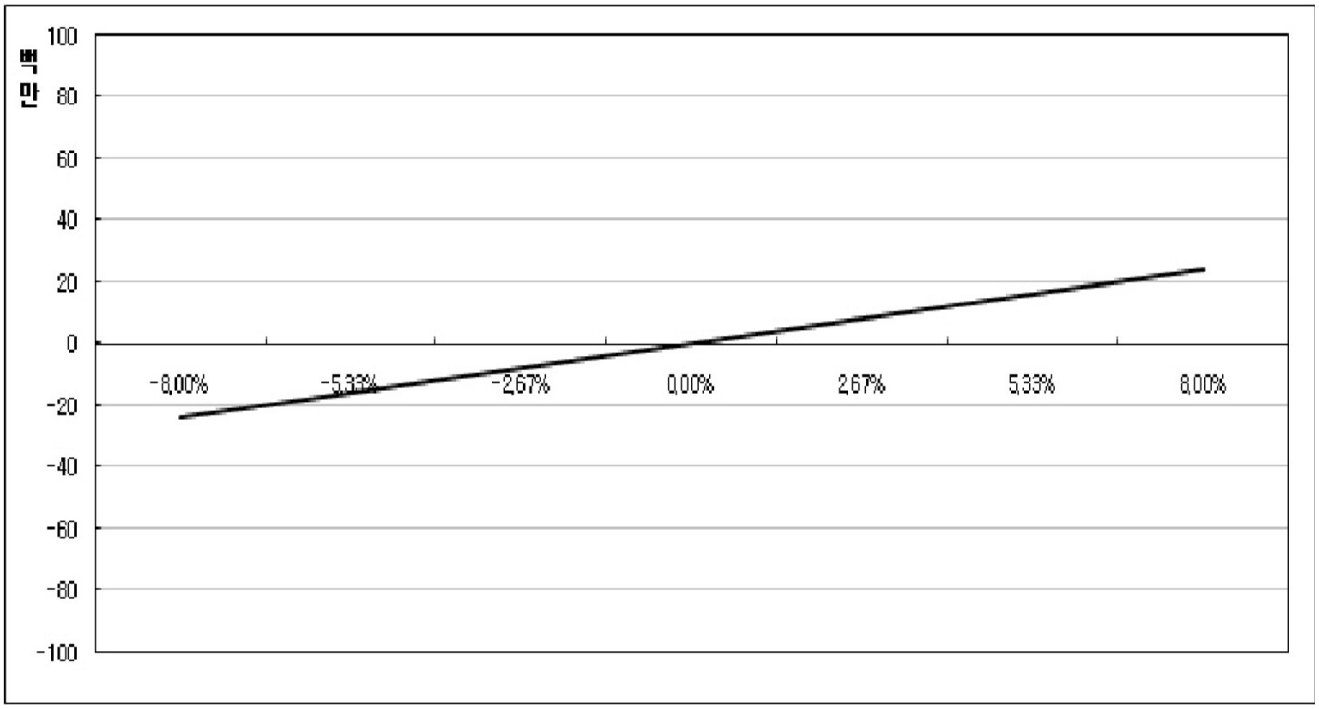
공시일: 2020-03-03

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	1,284	0	1,284	장내
합계			1,284	0	1,284	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

103

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

505

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

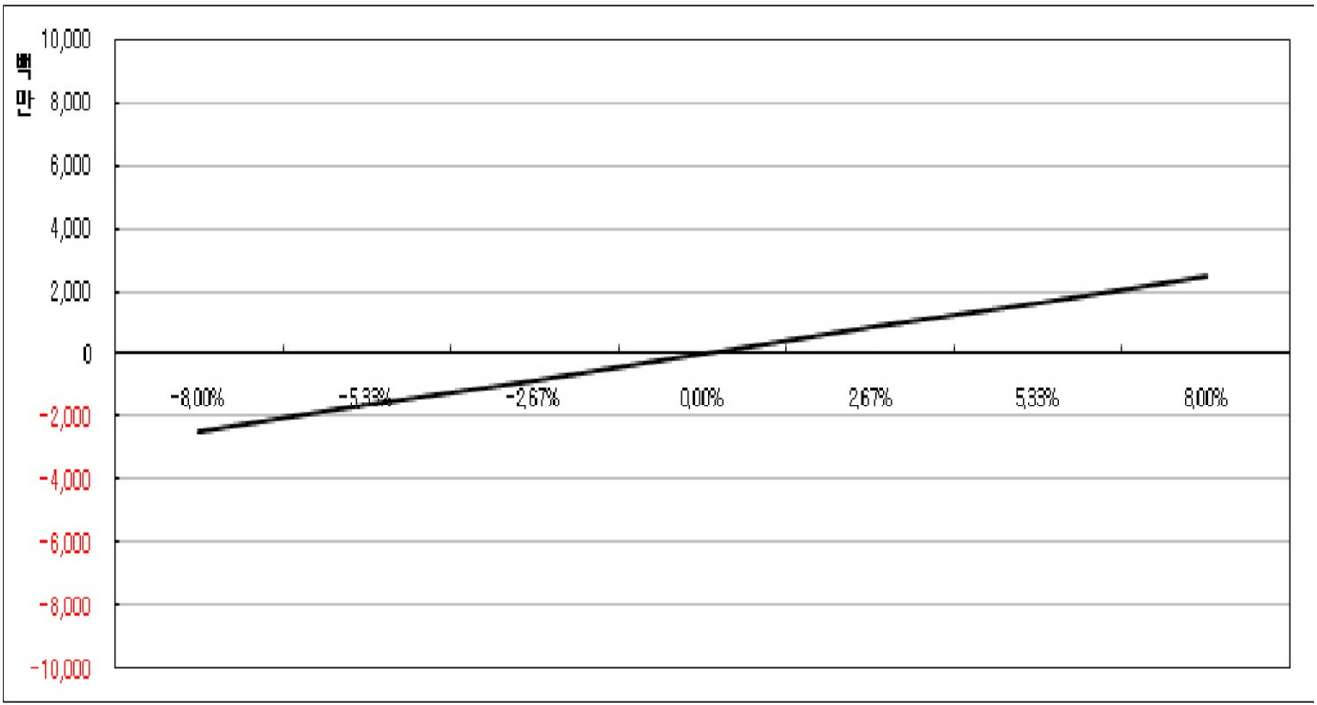
공시일: 2020-03-03

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	270	68	203	장내
누계	주가지수	선물	4,056	0	4,056	장내
합계			4,056	0	4,056	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

325

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

937

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

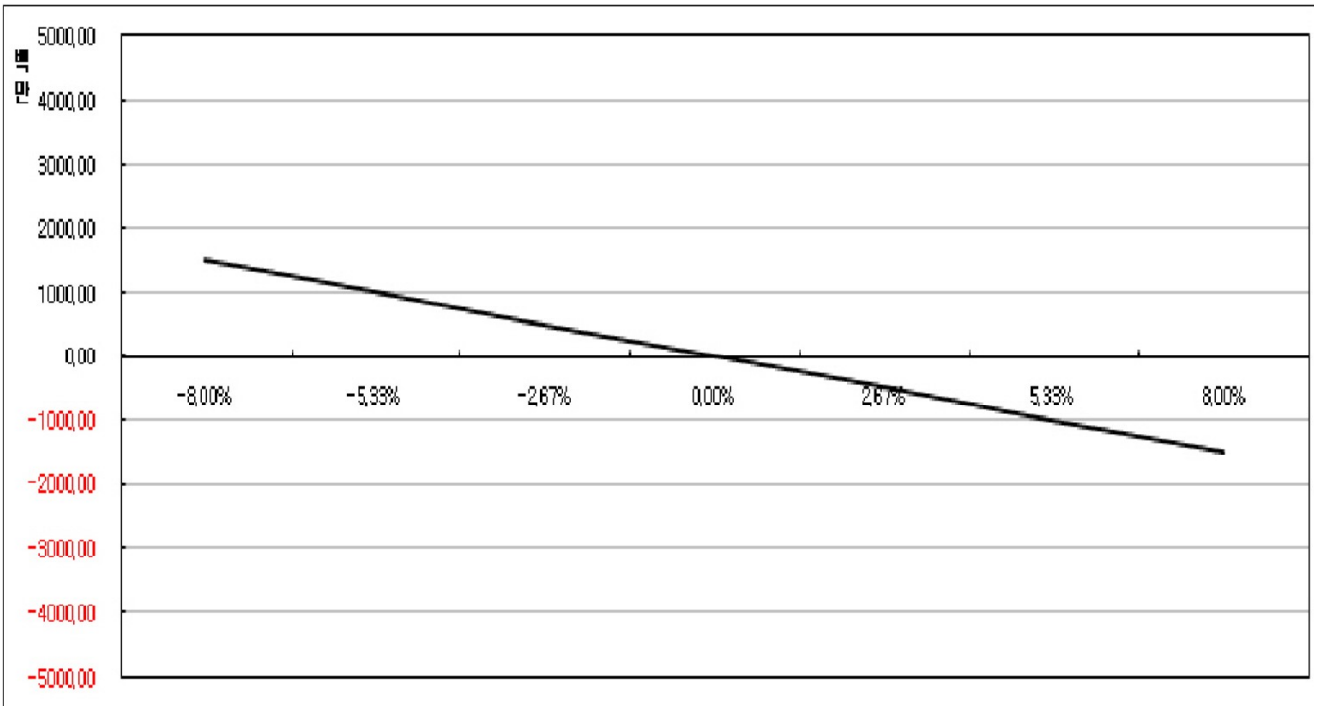
공시일: 2020-03-03

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	68	0	68	장내
누계	주가지수	선물	0	1,690	-1,690	장내
합계			0	1,690	-1,690	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

135

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

120

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

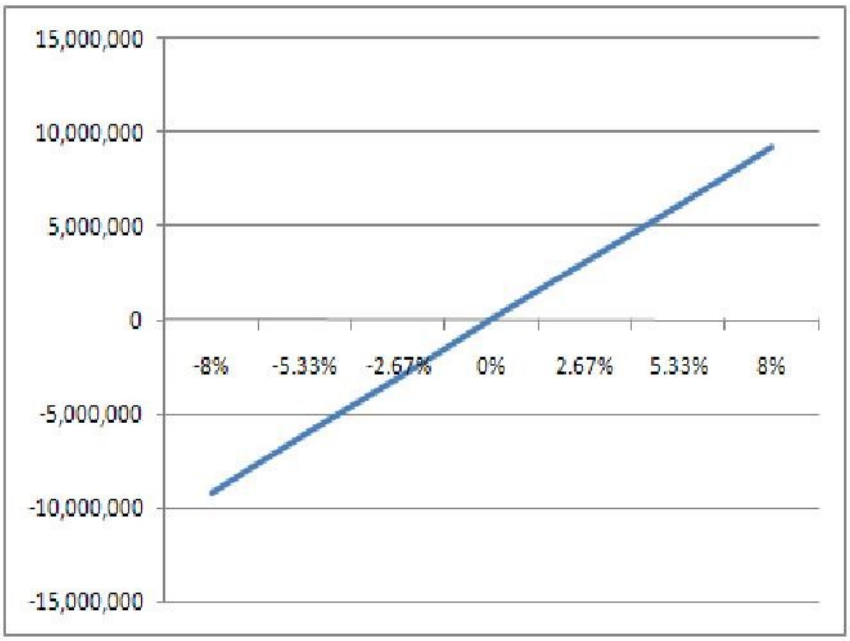
공시일: 2020-03-03

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	71,040	0	71,040	장내
합계			71,040	0	71,040	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,694

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

9,061