펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2020-03-06

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	1,266	0	1,266	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	32	0	32	장내
합계			1,299	0	1,299	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	41

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	163

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

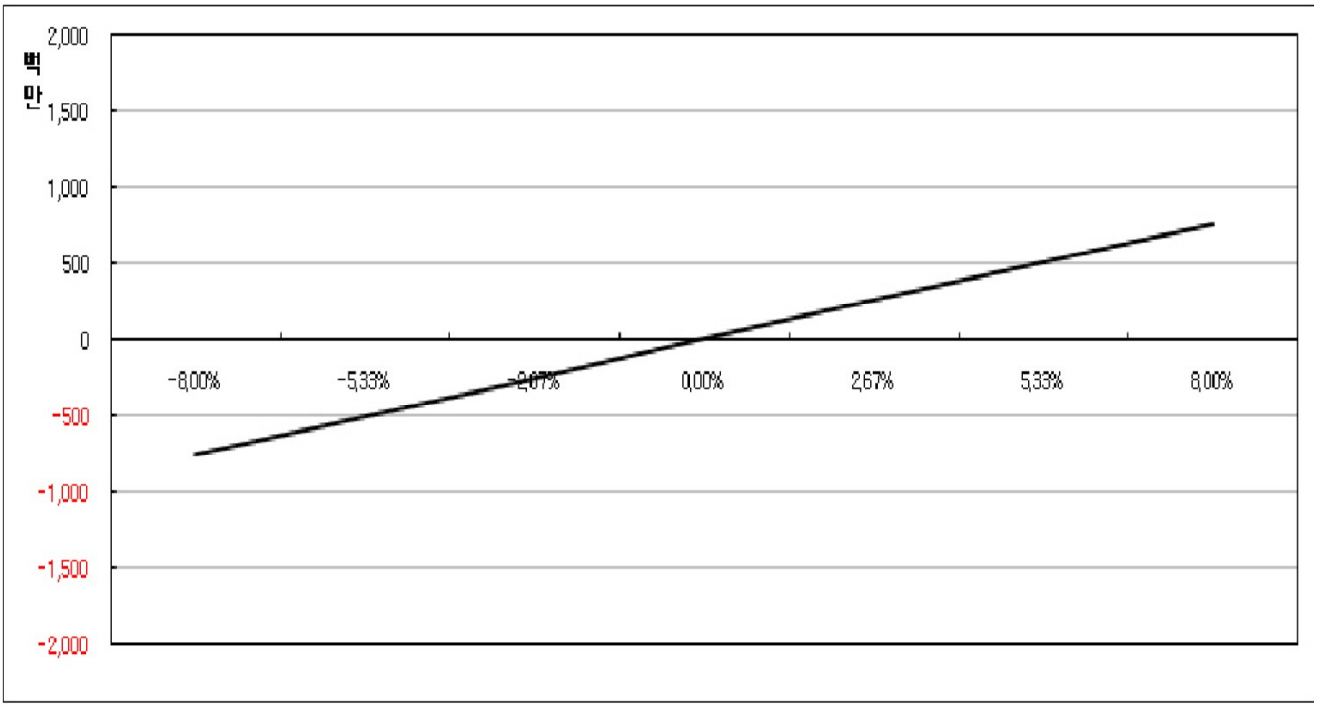
공시일: 2020-03-06

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	422	0	422	장내
합계			422	0	422	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

34

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

381

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

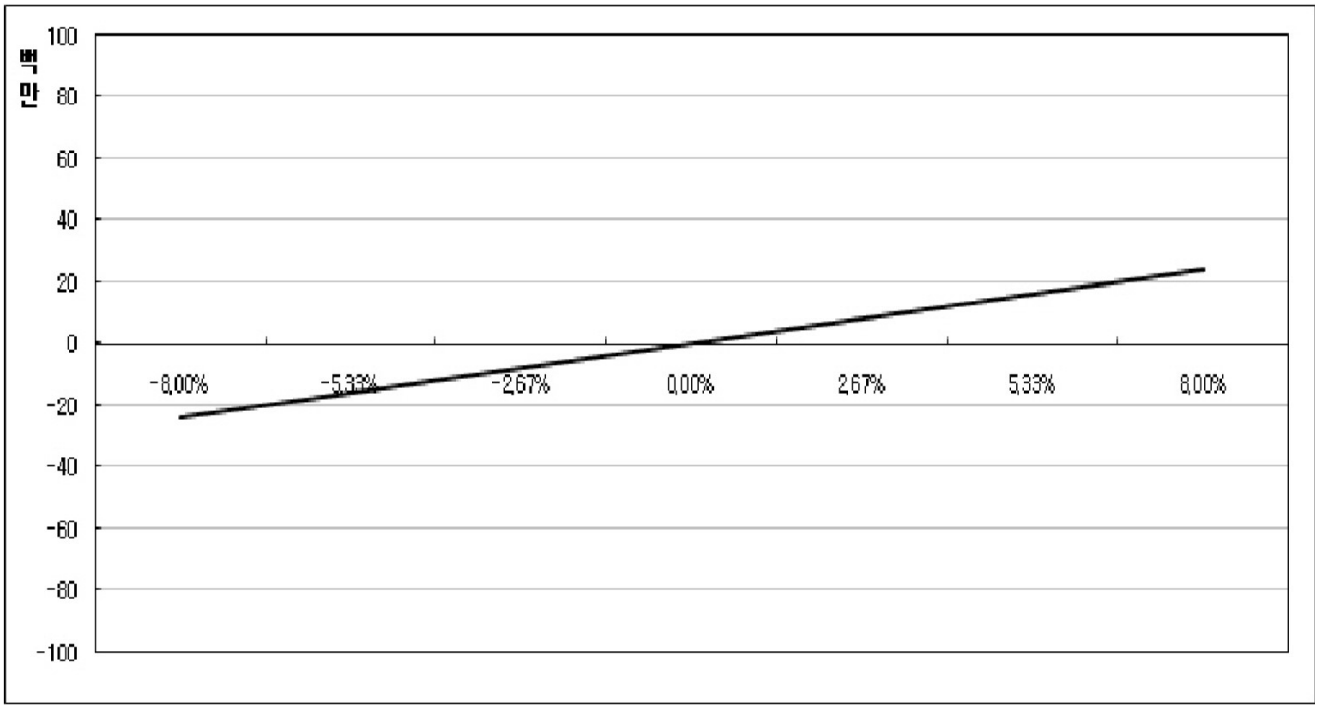
공시일: 2020-03-06

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	1,337	0	1,337	장내
합계			1,337	0	1,337	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

107

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

531

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

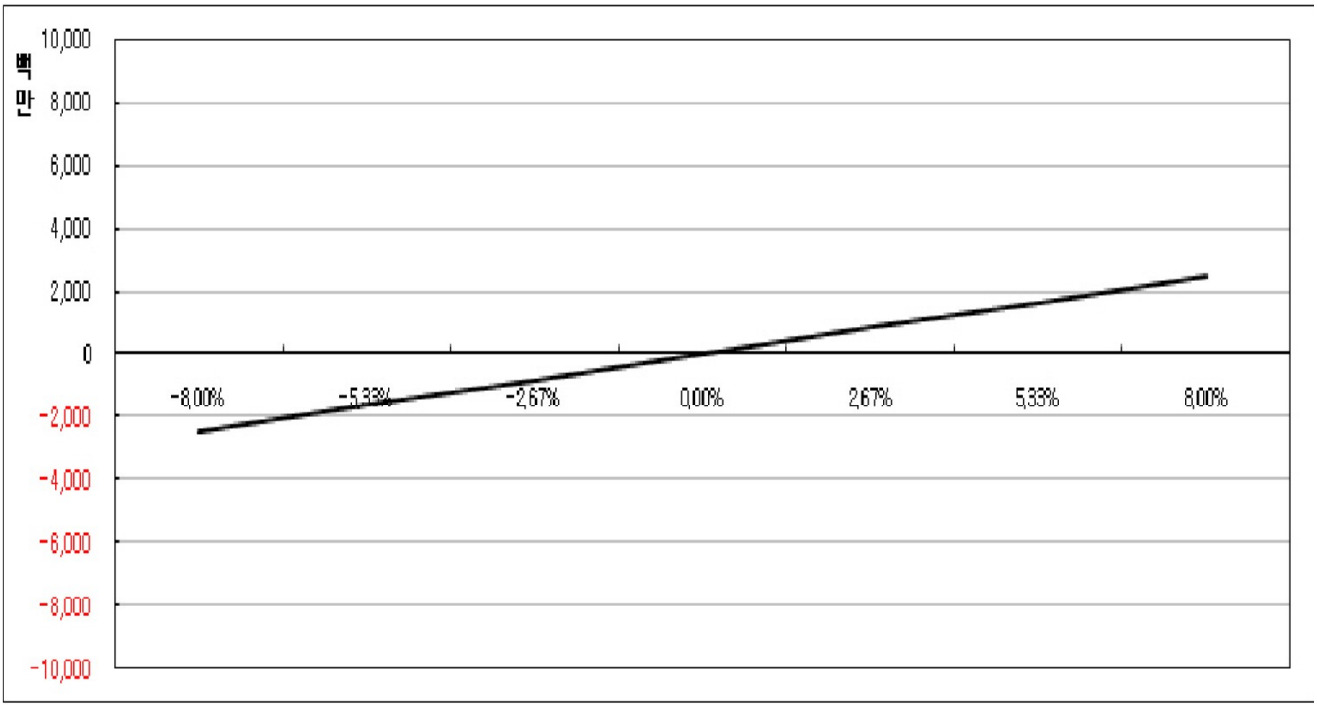
공시일: 2020-03-06

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	281	-281	장내
누계	주가지수	선물	3,939	0	3,939	장내
합계			3,939	0	3,939	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

315

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

971

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

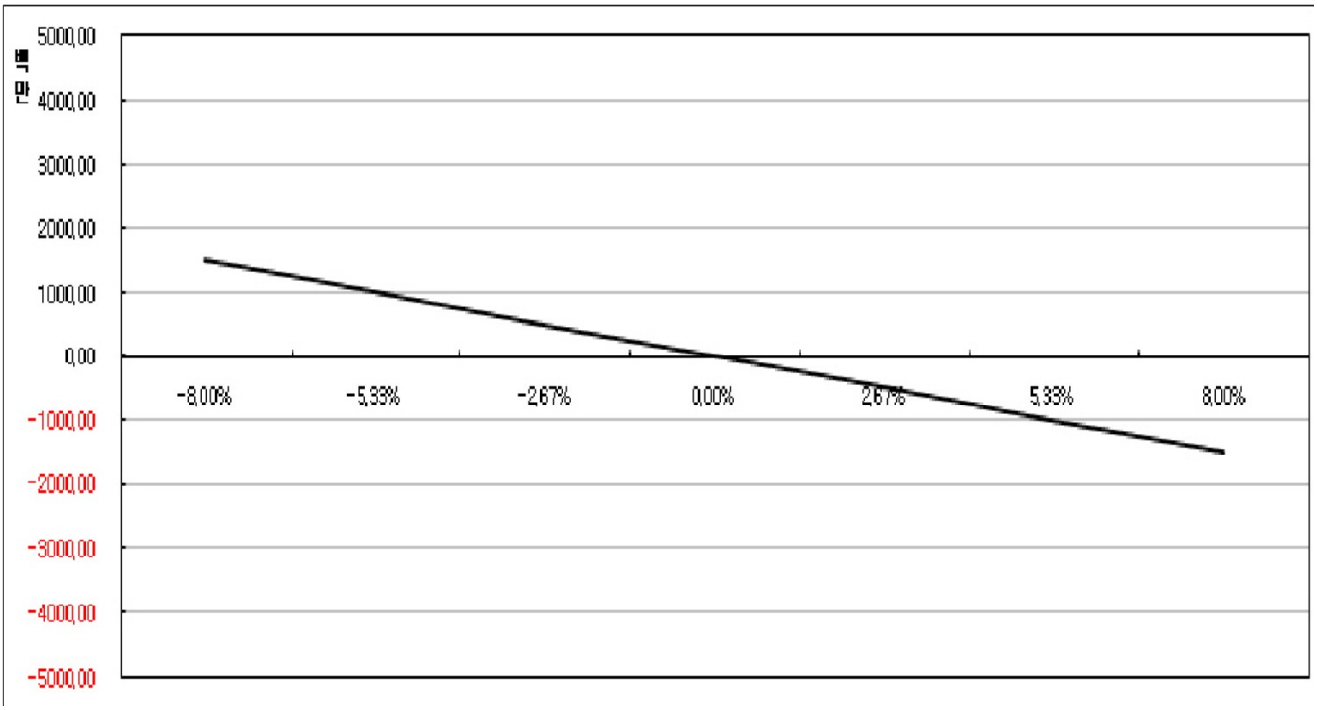
공시일: 2020-03-06

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	211	141	70	장내
누계	주가지수	선물	0	1,477	-1,477	장내
합계			0	1,477	-1,477	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

118

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

106

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

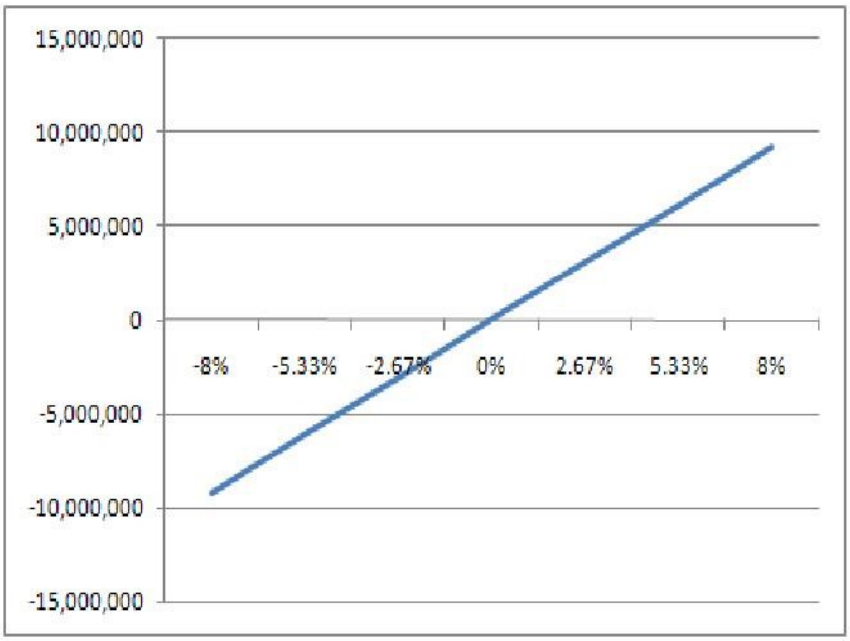
공시일: 2020-03-06

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	73,651	0	73,651	장내
합계			73,651	0	73,651	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,889

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

9,793