펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2020-03-09

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	1,238	0	1,238	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	48	0	48	장내
합계			1,286	0	1,286	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

39

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

172

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

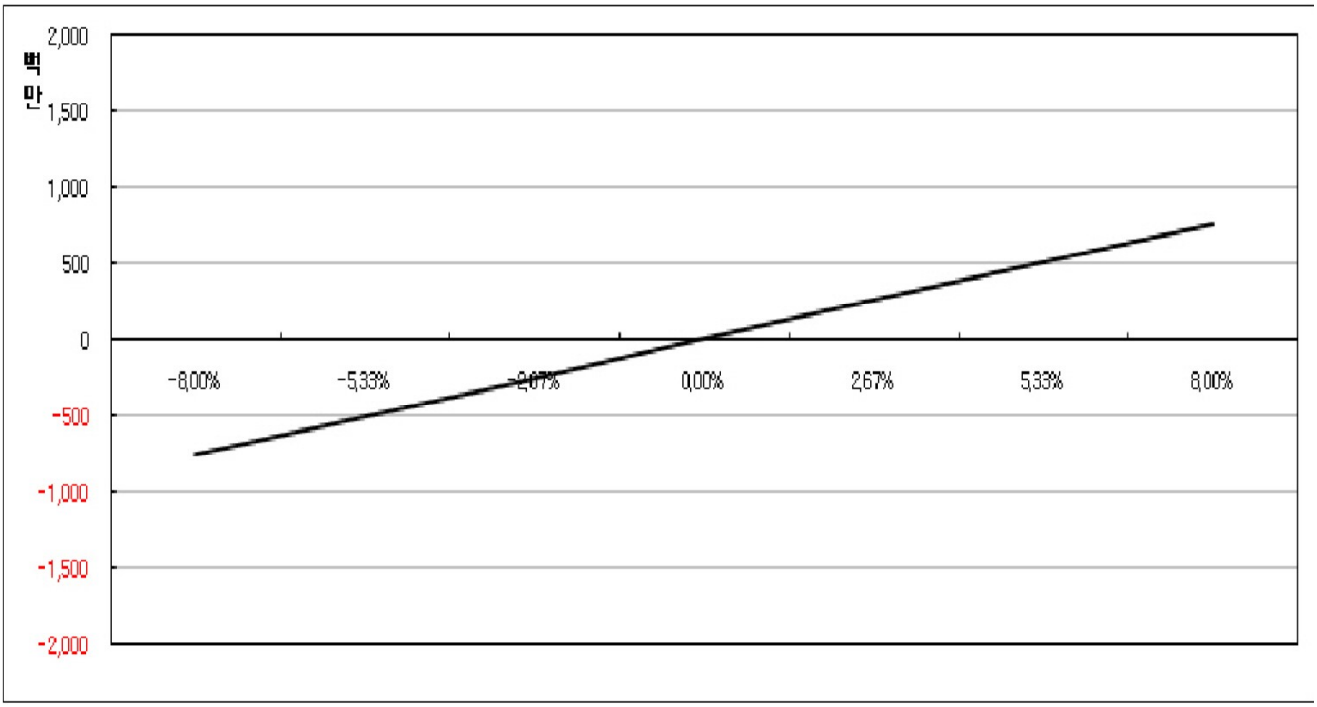
공시일: 2020-03-09

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	413	0	413	장내
합계			413	0	413	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

33

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

376

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

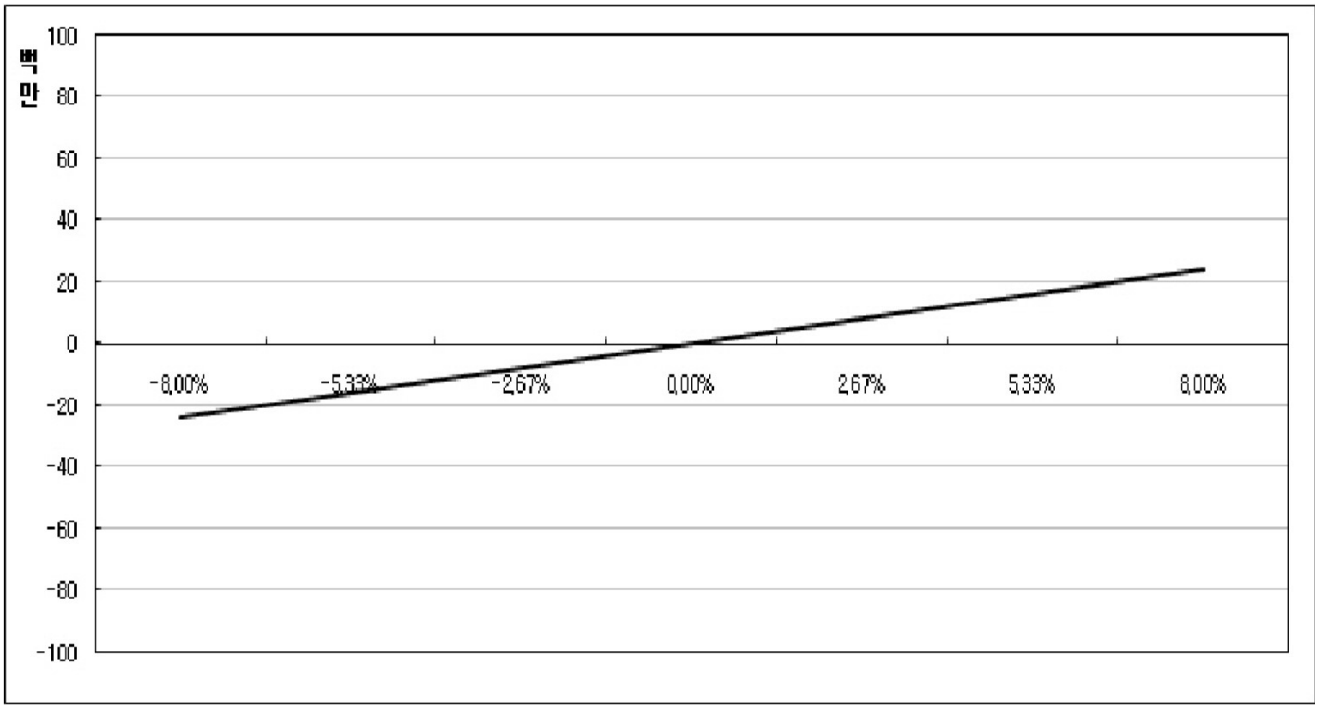
공시일: 2020-03-09

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	138	0	138	장내
누계	주가지수	선물	1,444	0	1,444	장내
합계			1,444	0	1,444	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

115

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

531

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

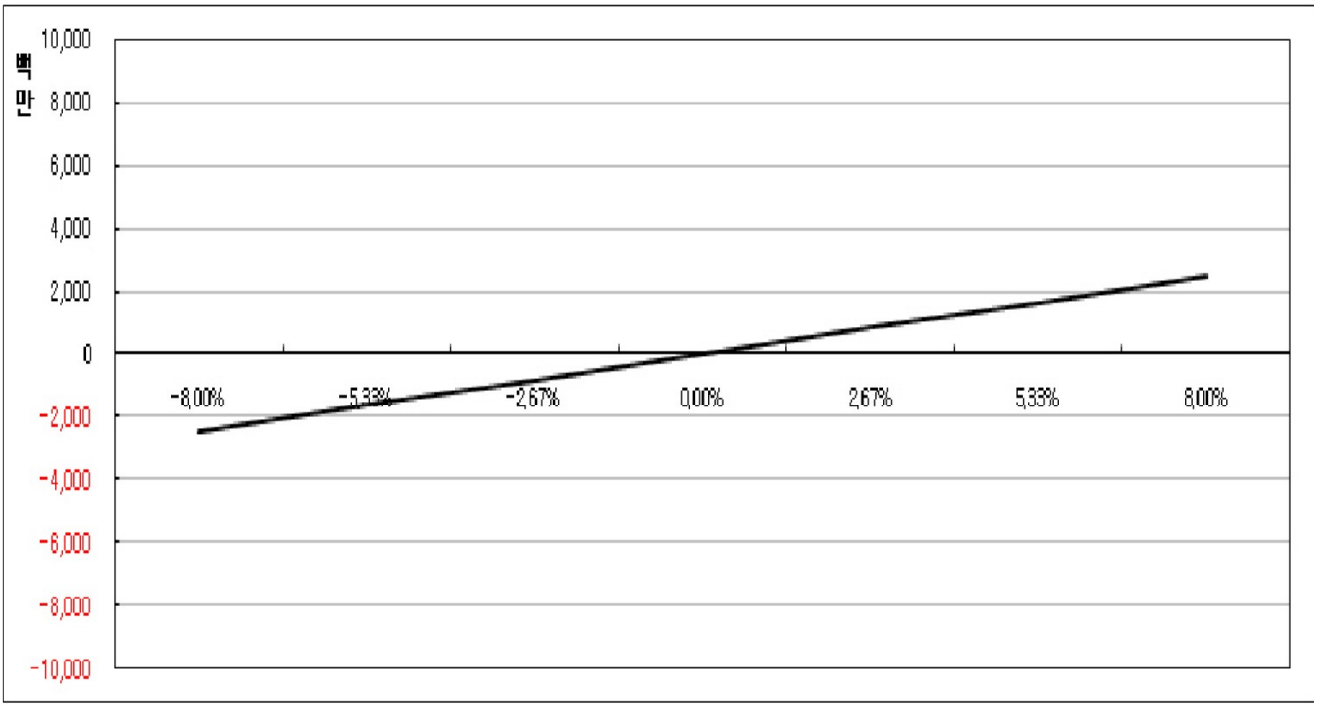
공시일: 2020-03-09

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	413	0	413	장내
누계	주가지수	선물	4,264	0	4,264	장내
합계			4,264	0	4,264	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

340

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

982

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

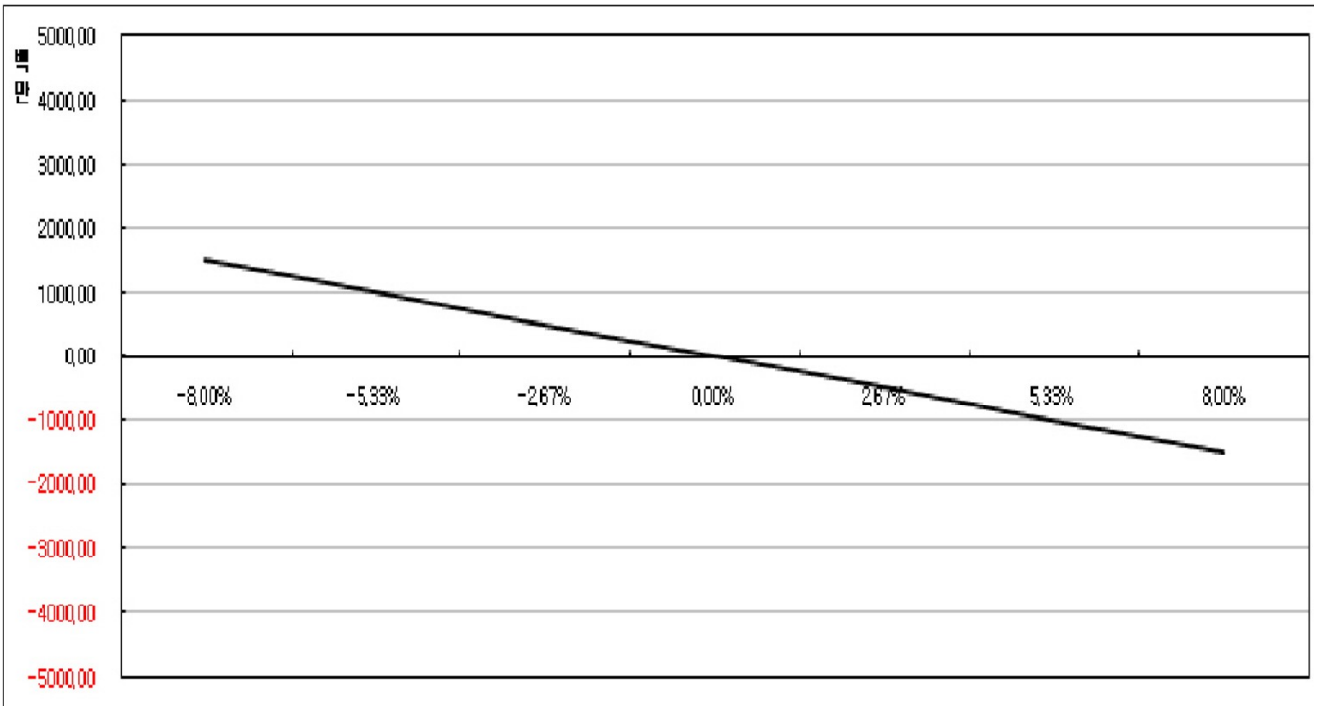
공시일: 2020-03-09

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	413	-413	장내
누계	주가지수	선물	0	1,857	-1,857	장내
합계			0	1,857	-1,857	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

148

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

134

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

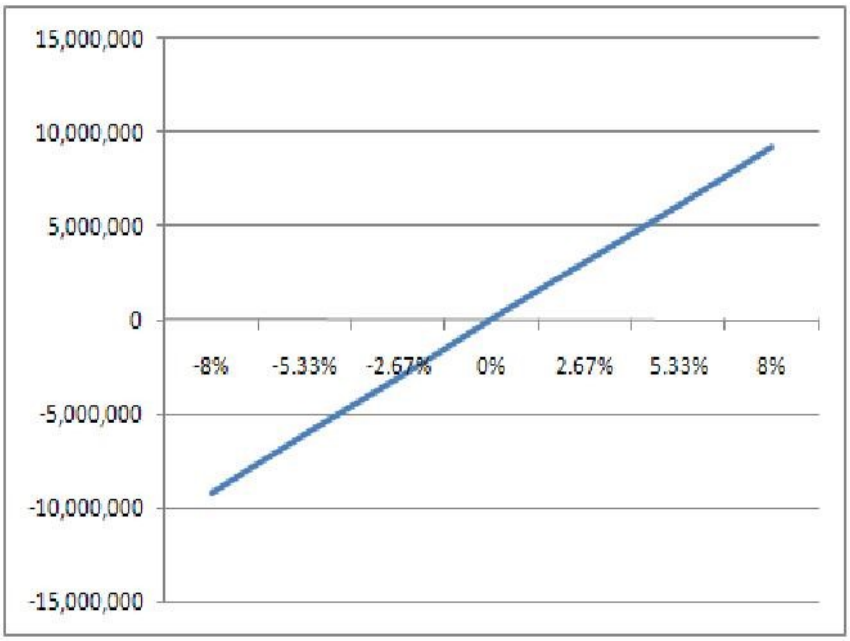
공시일: 2020-03-09

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	206	0	206	장내
누계	주가지수	선물	72,214	0	72,214	장내
합계			72,214	0	72,214	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,758

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

9,666