펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2020-03-10

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	1,184	1,184	0	장내
누계	주가지수	선물	1,184	0	1,184	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	81	0	81	장내
합계			1,265	0	1,265	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

37

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

157

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

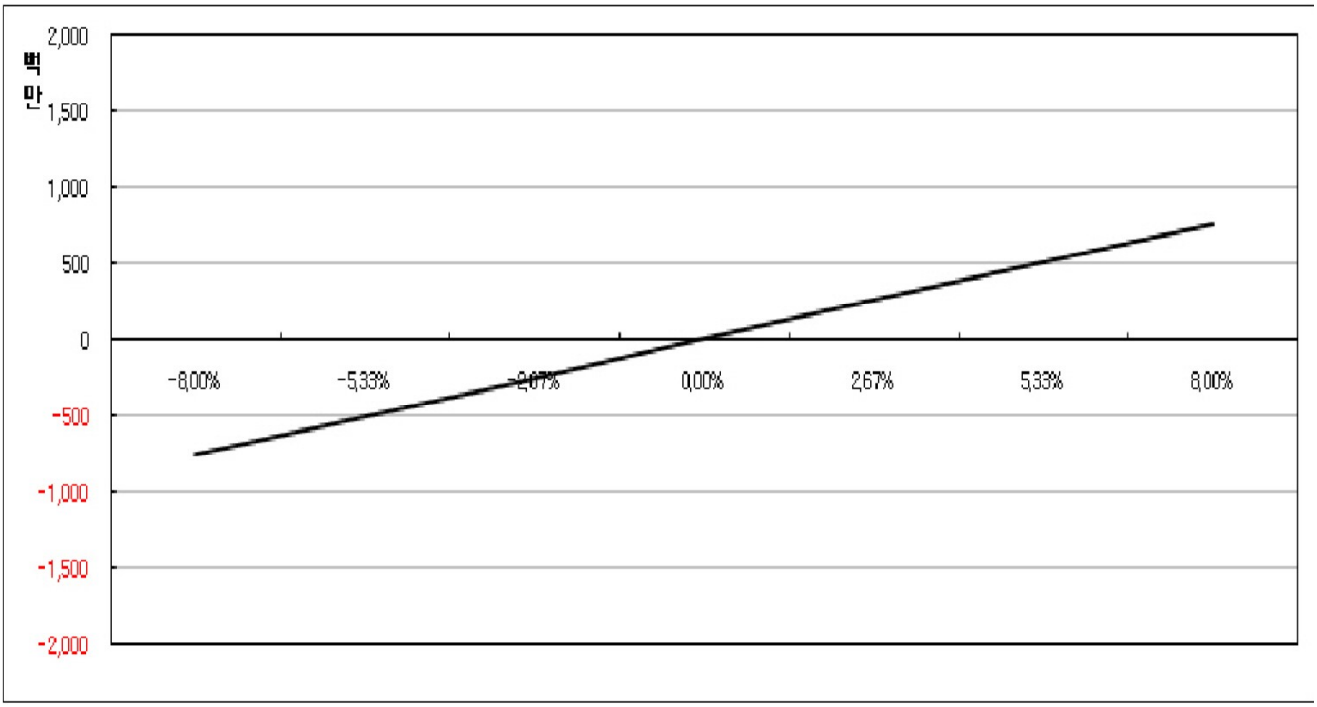
공시일: 2020-03-10

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	395	0	395	장내
합계			395	0	395	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

31

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

370

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

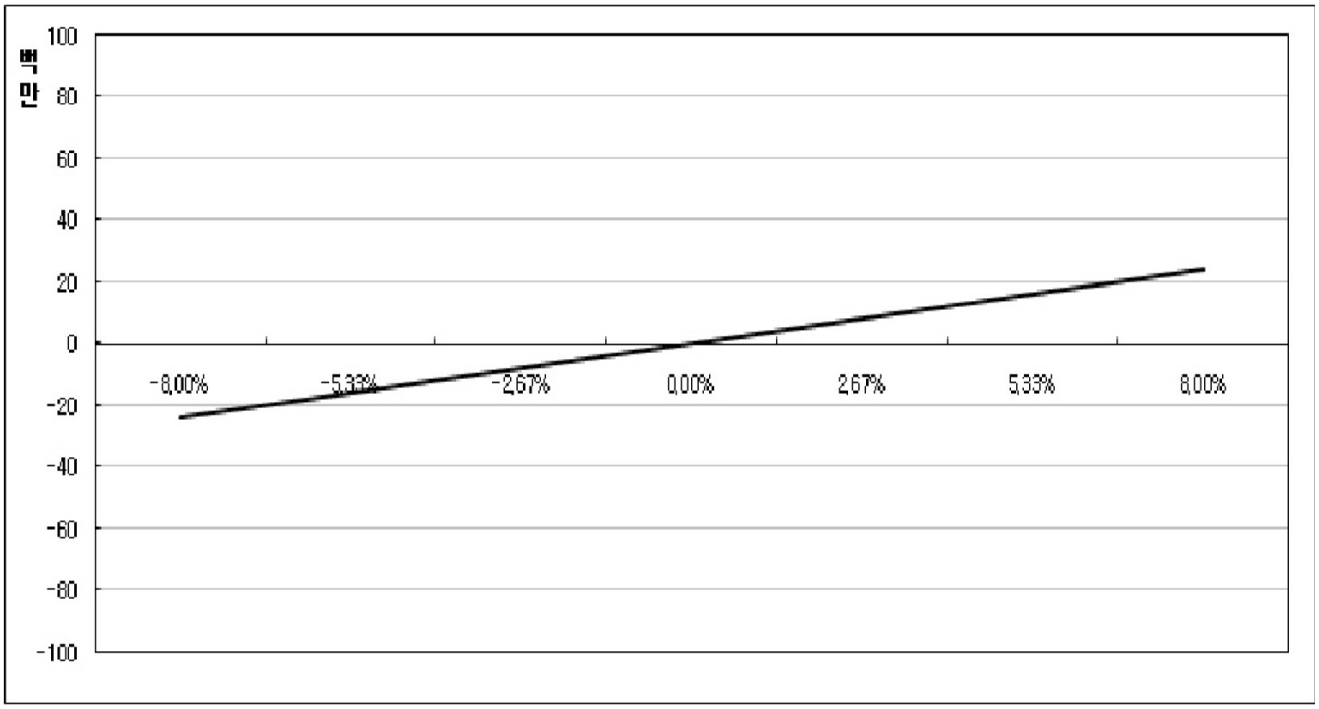
공시일: 2020-03-10

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	1,381	0	1,381	장내
합계			1,381	0	1,381	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

110

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

524

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

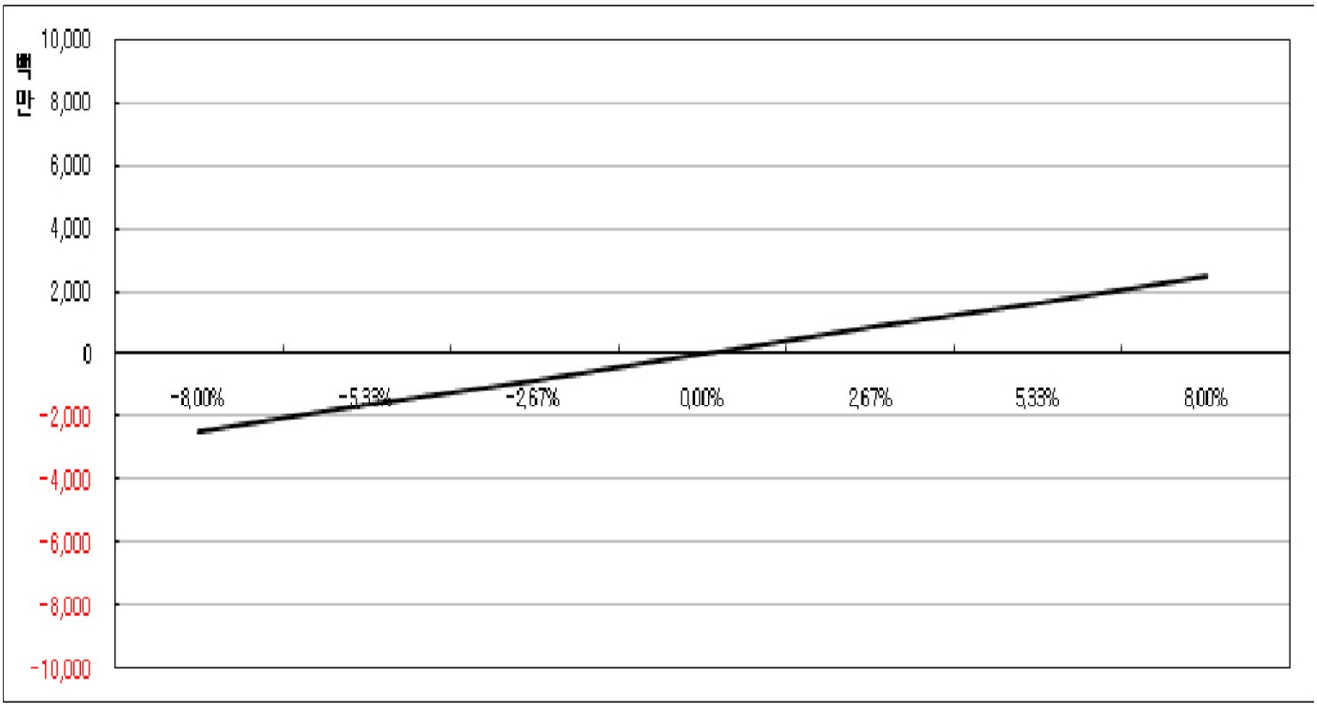
공시일: 2020-03-10

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	197	263	-66	장내
누계	주가지수	선물	4,012	0	4,012	장내
합계			4,012	0	4,012	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

320

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

965

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

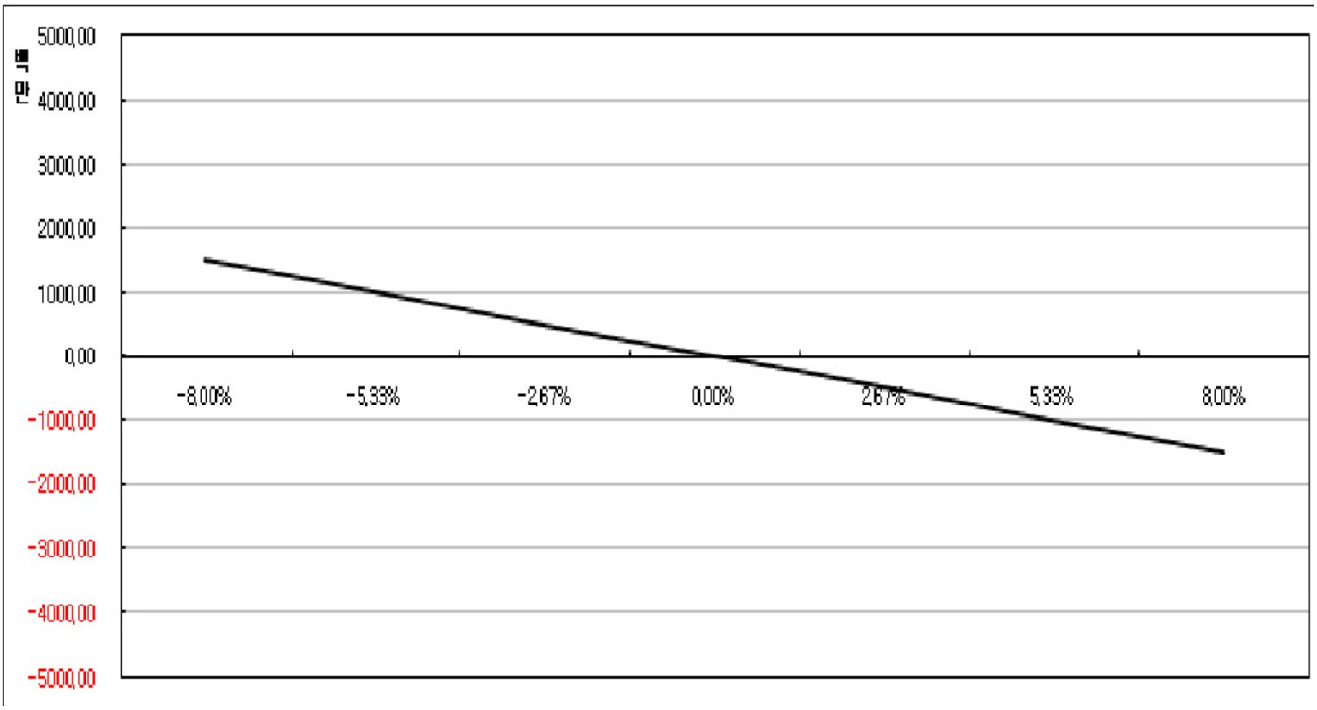
공시일: 2020-03-10

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	197	-197	장내
누계	주가지수	선물	0	1,973	-1,973	장내
합계			0	1,973	-1,973	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

157

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

148

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

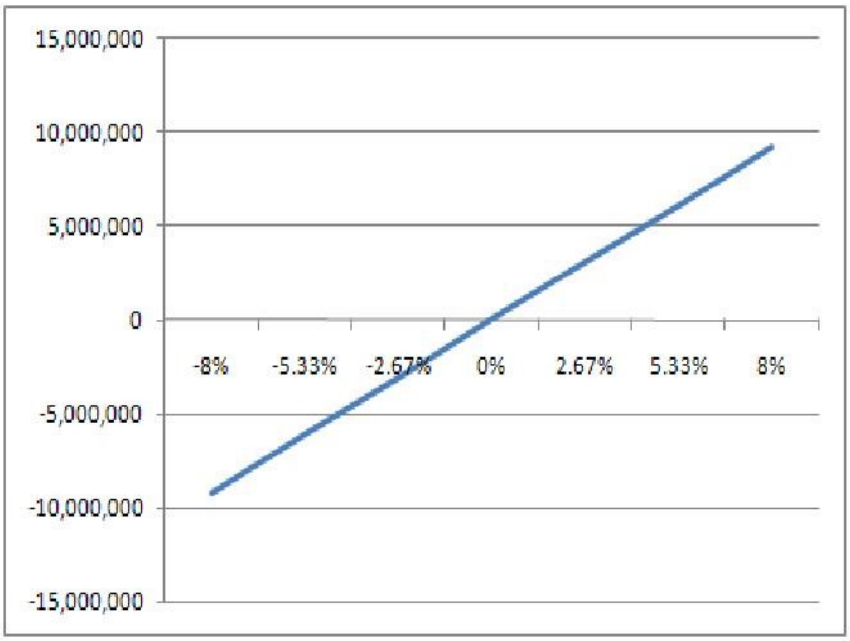
공시일: 2020-03-10

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	29,731	28,284	1,447	장내
누계	주가지수	선물	70,513	0	70,513	장내
합계			70,513	0	70,513	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,622

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

9,659