펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2020-03-11

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	1,191	0	1,191	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	77	0	77	장내
합계			1,268	0	1,268	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

37

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

137

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

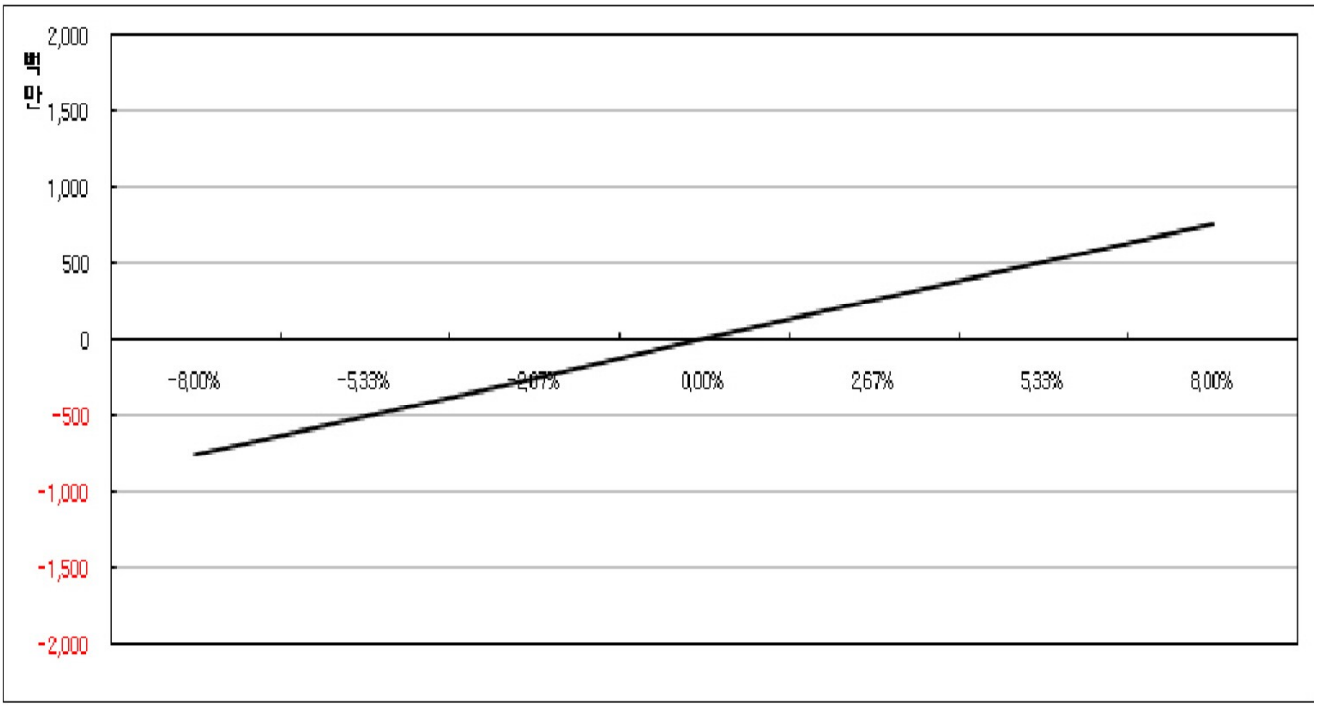
공시일: 2020-03-11

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	397	0	397	장내
합계			397	0	397	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

32

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

371

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

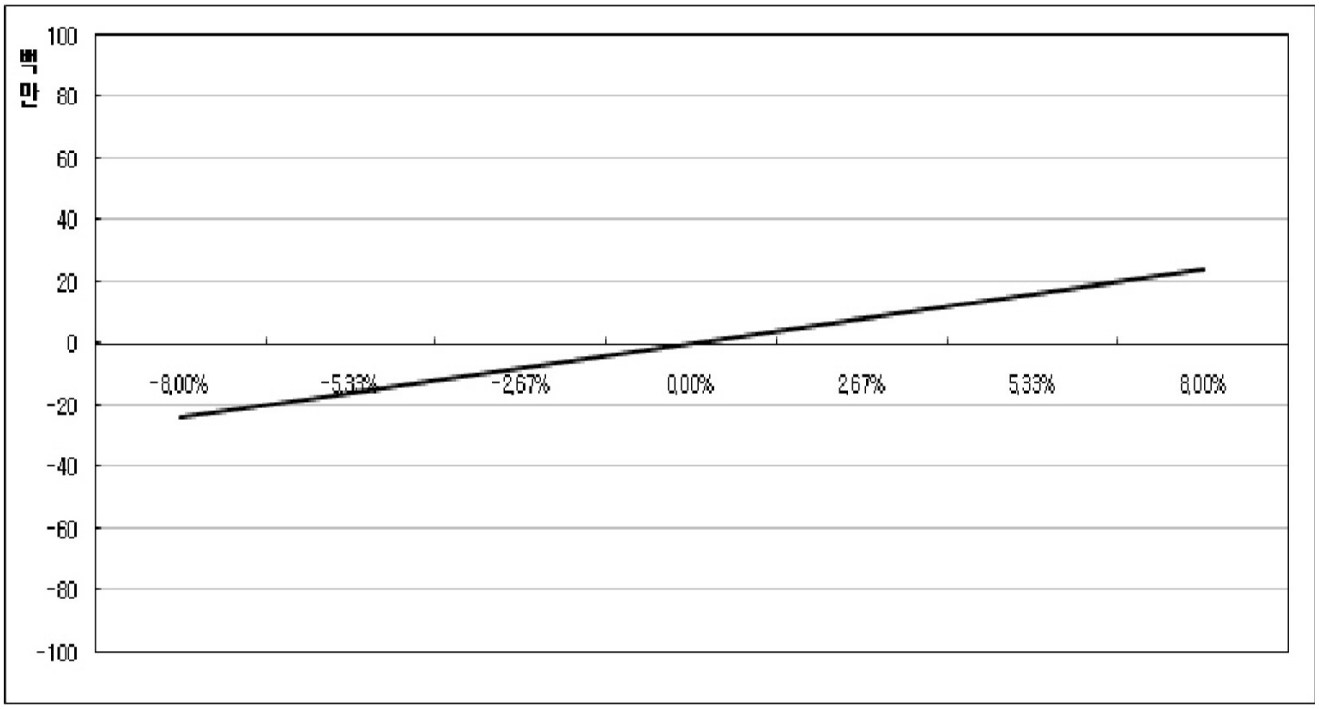
공시일: 2020-03-11

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	662	529	132	장내
누계	주가지수	선물	1,522	0	1,522	장내
합계			1,522	0	1,522	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

122

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

534

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

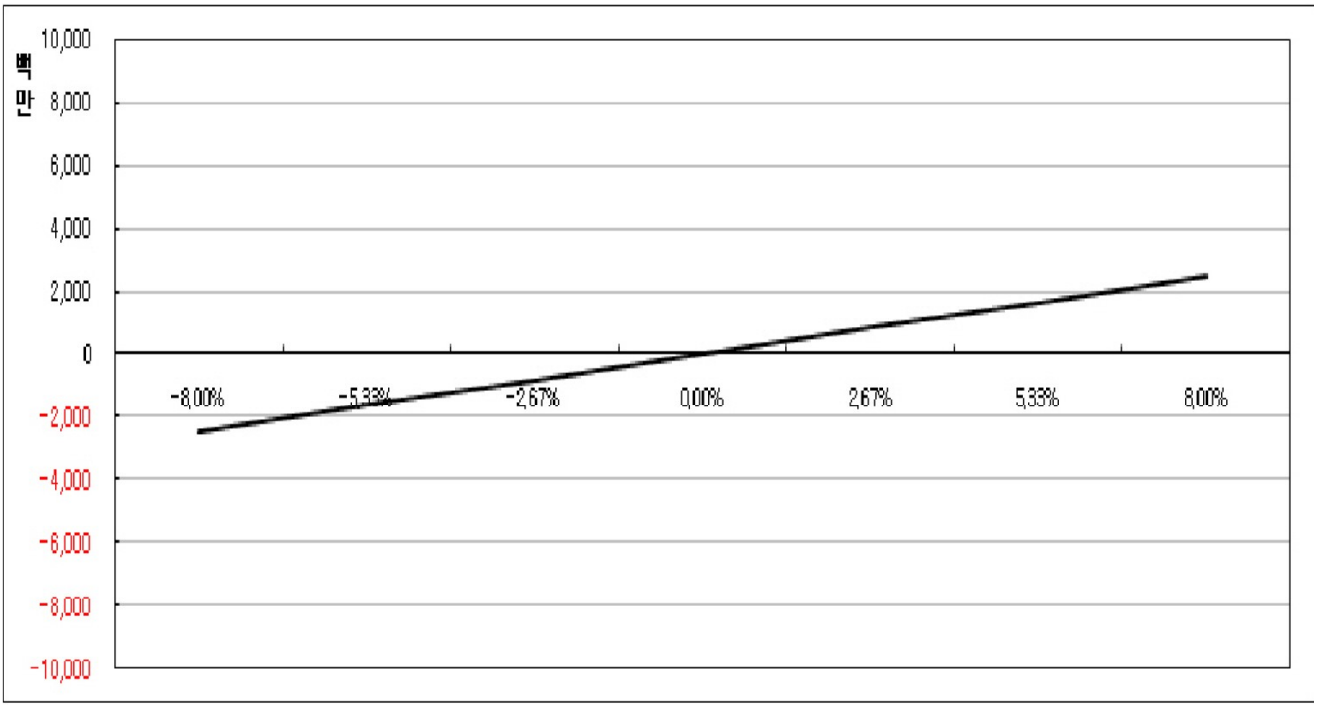
공시일: 2020-03-11

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	2,647	1,787	860	장내
누계	주가지수	선물	4,896	0	4,896	장내
합계			4,896	0	4,896	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

392

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

1,024

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

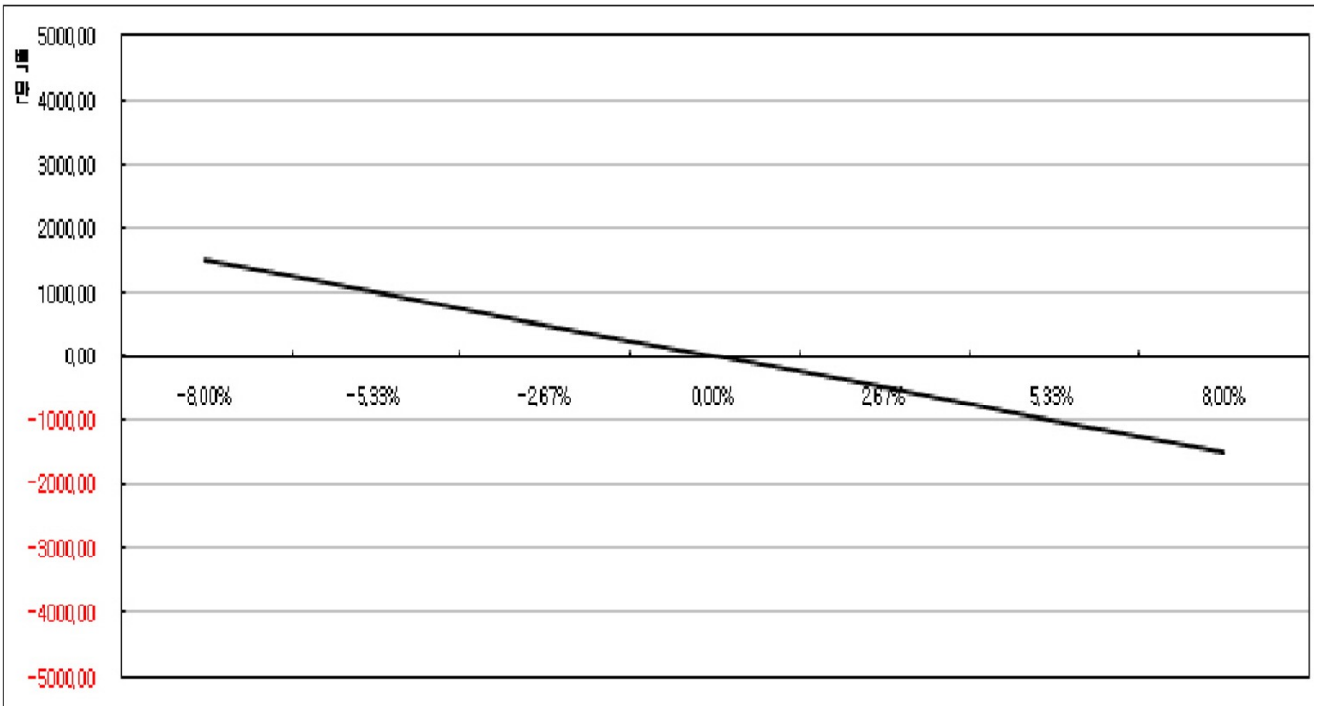
공시일: 2020-03-11

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	596	66	529	장내
누계	주가지수	선물	0	1,456	-1,456	장내
합계			0	1,456	-1,456	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

117

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

109

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

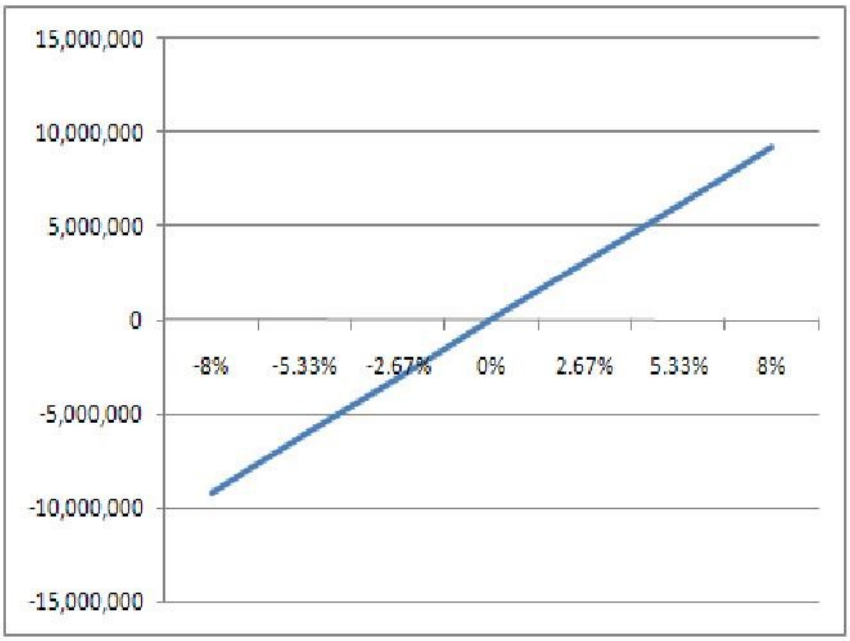
공시일: 2020-03-11

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	16,542	13,631	2,911	장내
누계	주가지수	선물	73,843	0	73,843	장내
합계			73,843	0	73,843	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,910

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

9,922