펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2020-03-12

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	1,157	0	1,157	장내
신규	주가지수	옵션	0	64	-64	장내
누계	주가지수	옵션	89	0	89	장내
합계			1,246	0	1,246	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

41

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

128

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

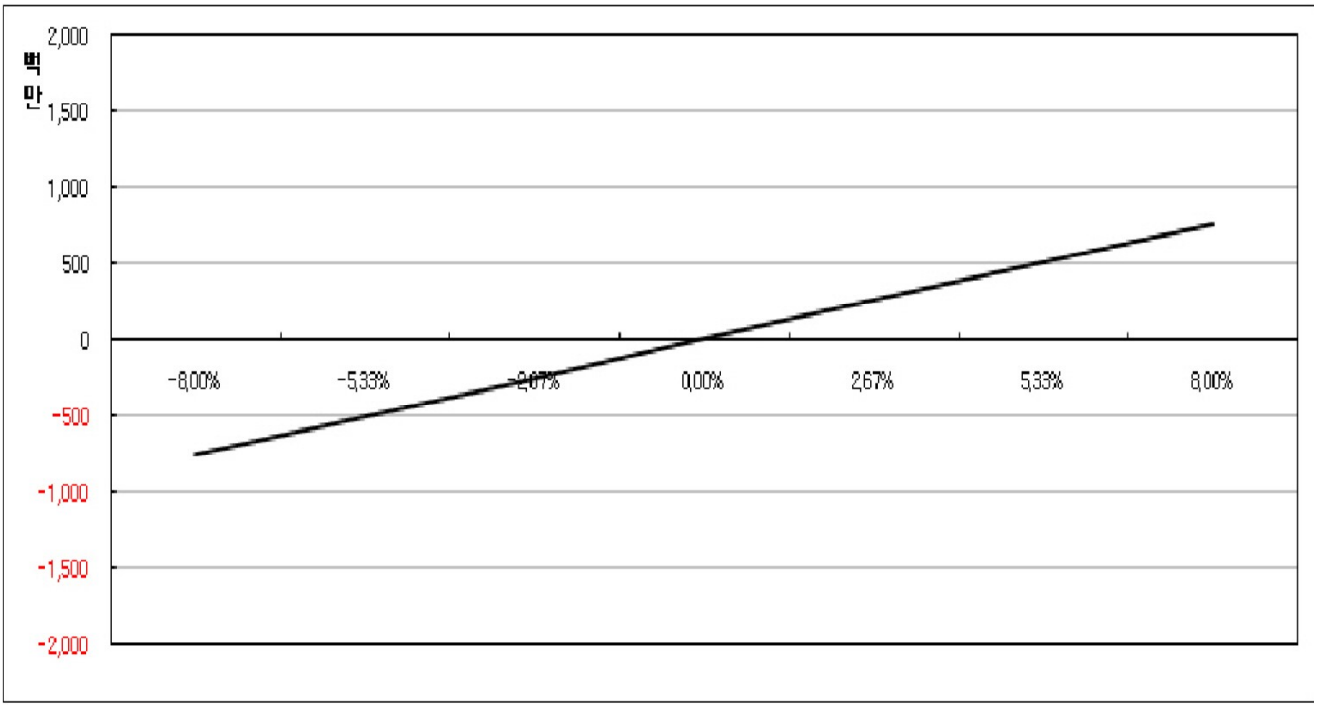
공시일: 2020-03-12

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	386	386	0	장내
누계	주가지수	선물	386	0	386	장내
합계			386	0	386	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

31

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

364

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

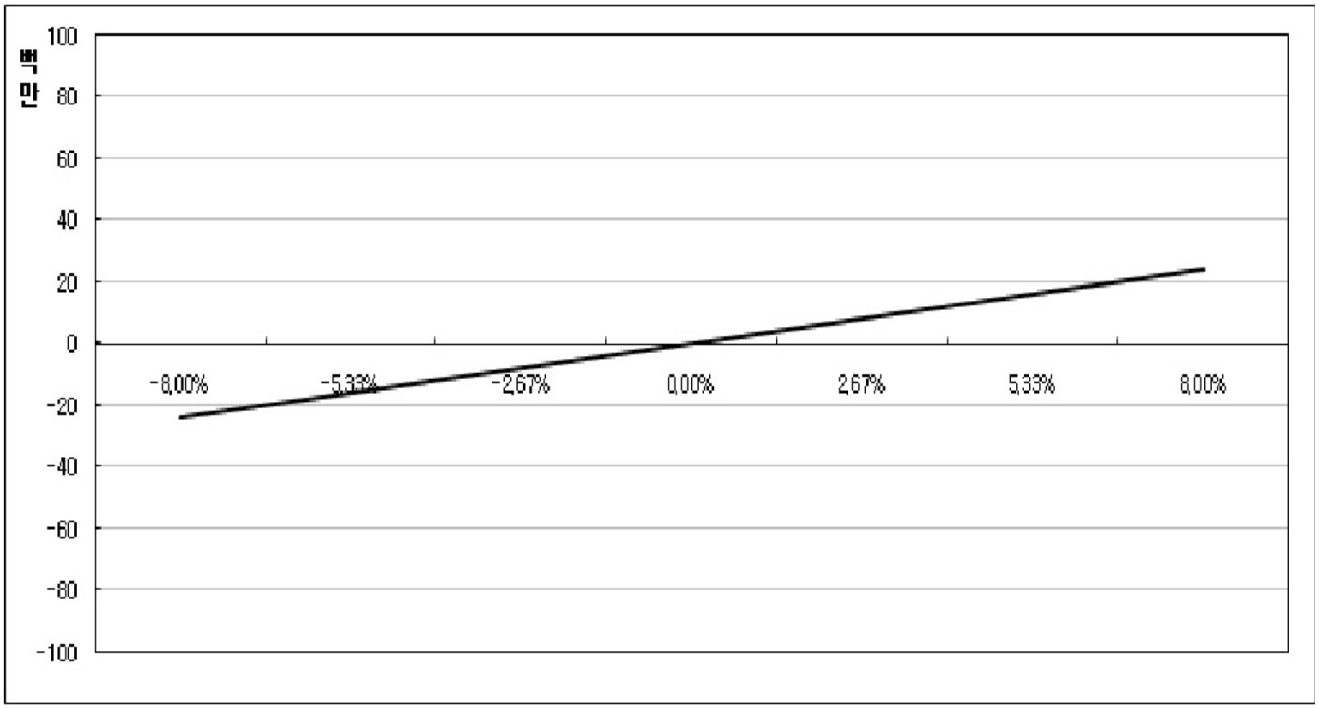
공시일: 2020-03-12

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	1,092	1,028	64	장내
누계	주가지수	선물	1,542	0	1,542	장내
합계			1,542	0	1,542	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

123

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

528

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

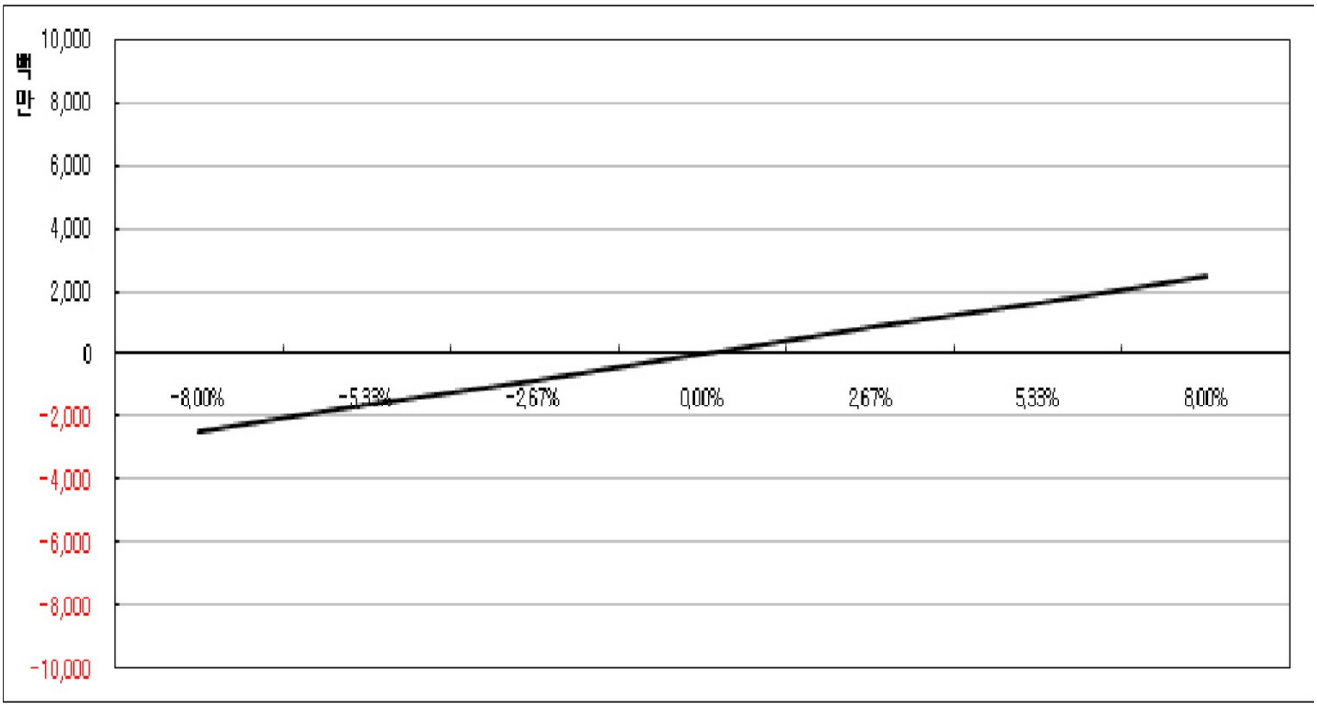
공시일: 2020-03-12

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	2,956	2,570	386	장내
누계	주가지수	선물	5,140	0	5,140	장내
합계			5,140	0	5,140	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

410

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

1,030

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

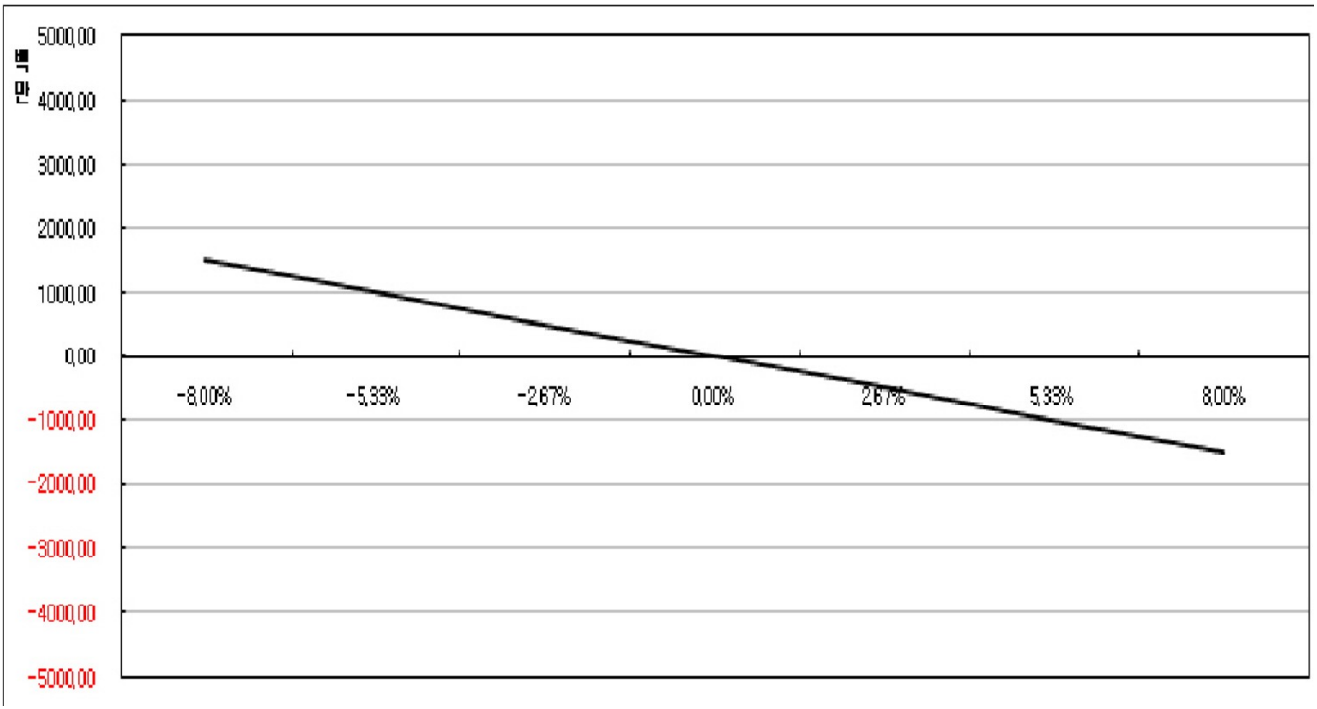
공시일: 2020-03-12

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	0	1,414	-1,414	장내
합계			0	1,414	-1,414	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

113

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

108

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

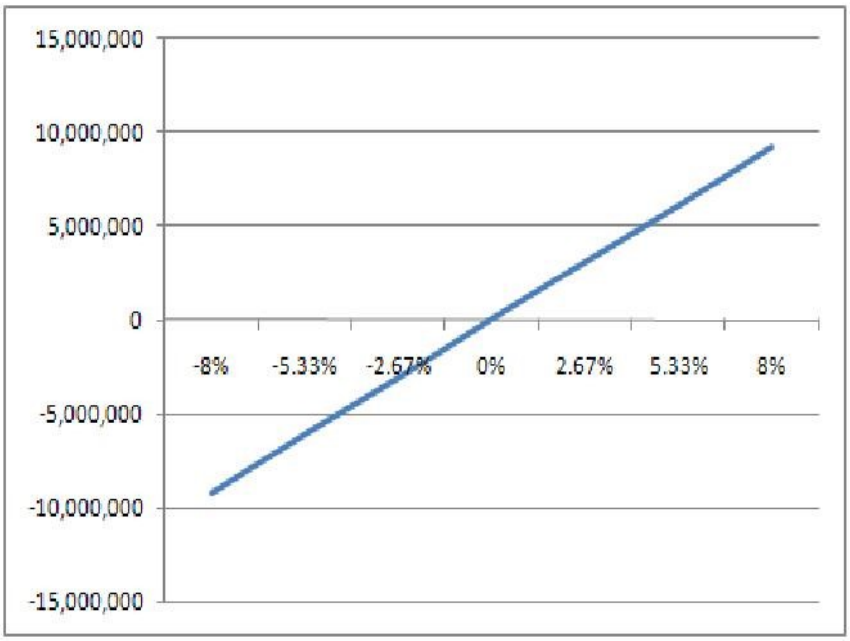
공시일: 2020-03-12

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	17,991	18,826	-835	장내
누계	주가지수	선물	70,871	0	70,871	장내
합계			70,871	0	70,871	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,657

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

9,688