펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2020-03-13

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	1,114	0	1,114	장내
신규	주가지수	옵션	0	619	-619	장내
누계	주가지수	옵션	0	0	0	장내
합계			1,114	0	1,114	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	88

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	157

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

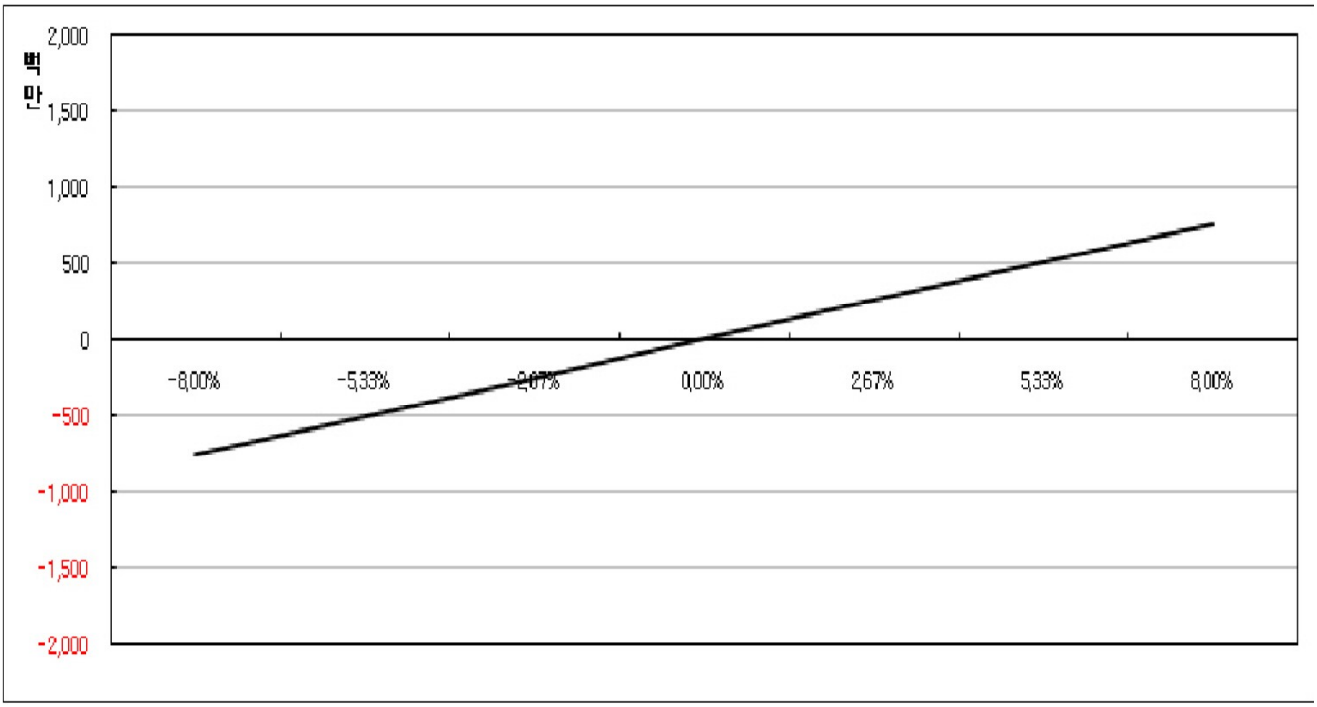
공시일: 2020-03-13

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	371	0	371	장내
합계			371	0	371	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

29

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

363

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

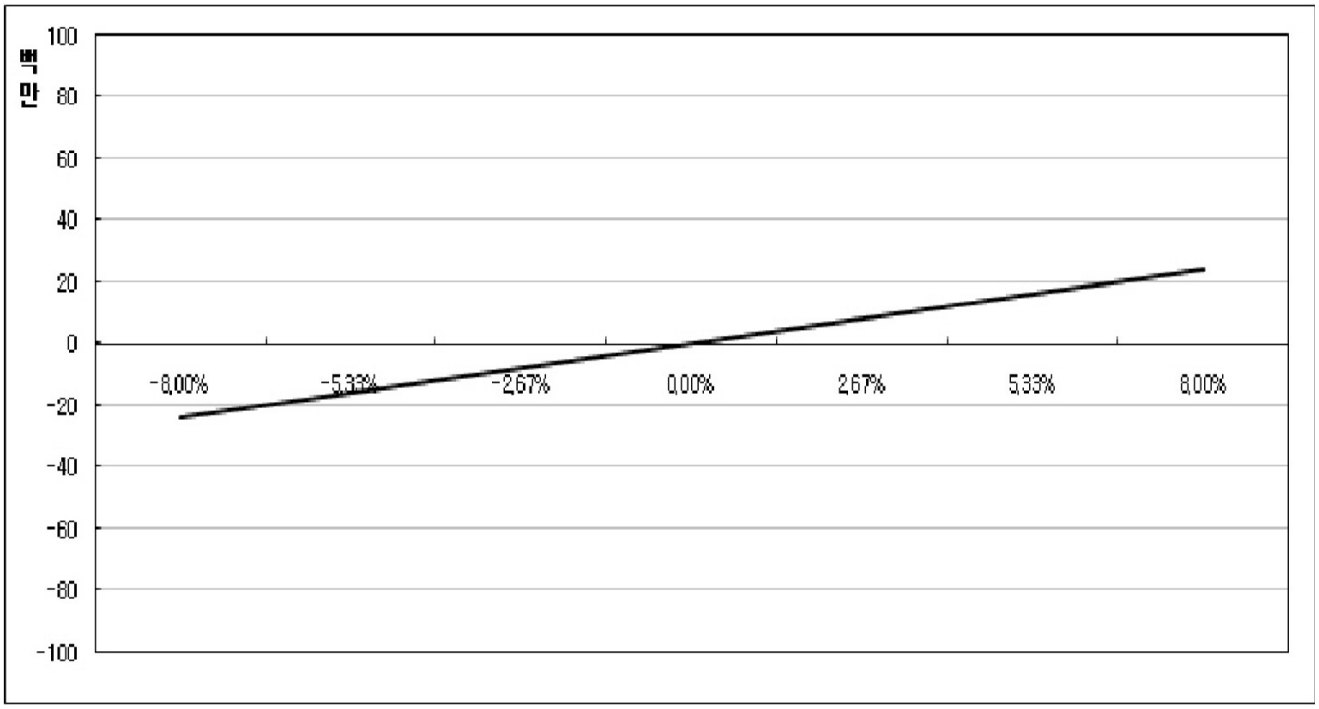
공시일: 2020-03-13

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	62	0	62	장내
누계	주가지수	선물	1,548	0	1,548	장내
합계			1,548	0	1,548	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

122

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

531

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

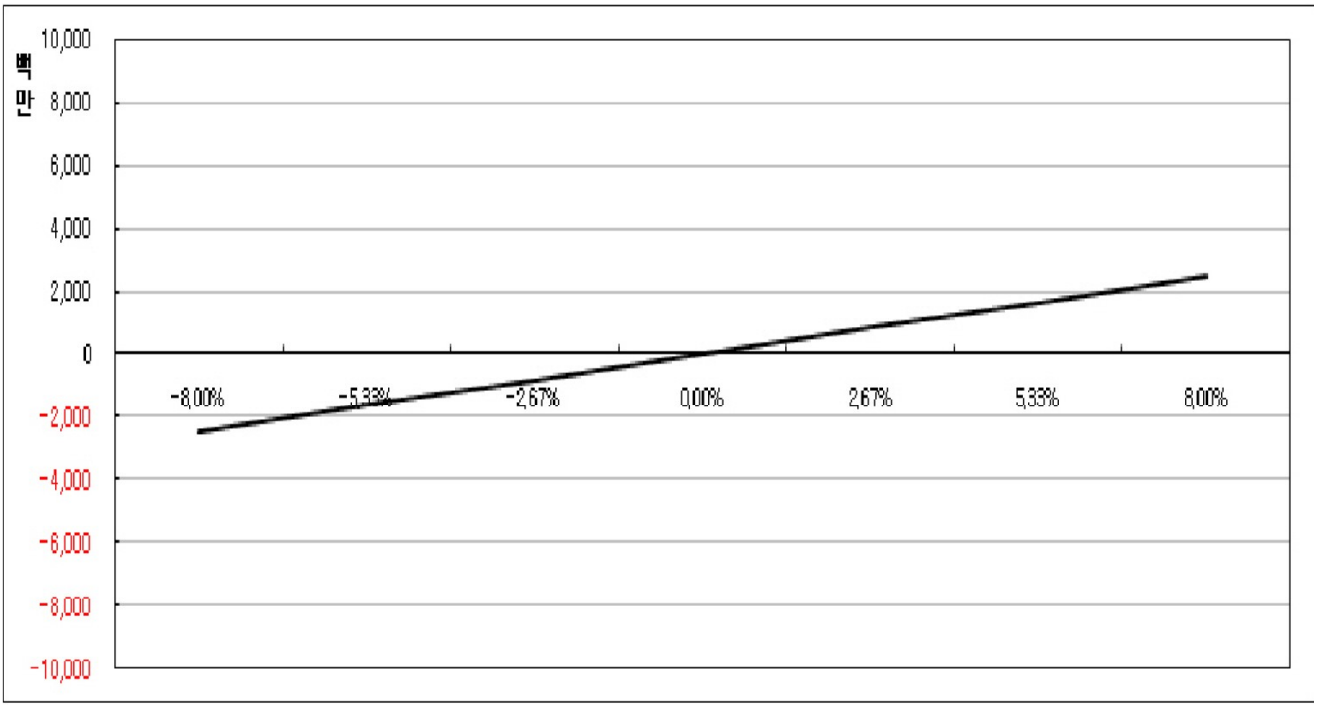
공시일: 2020-03-13

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	1,300	1,176	124	장내
누계	주가지수	선물	5,076	0	5,076	장내
합계			5,076	0	5,076	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

400

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

1,033

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

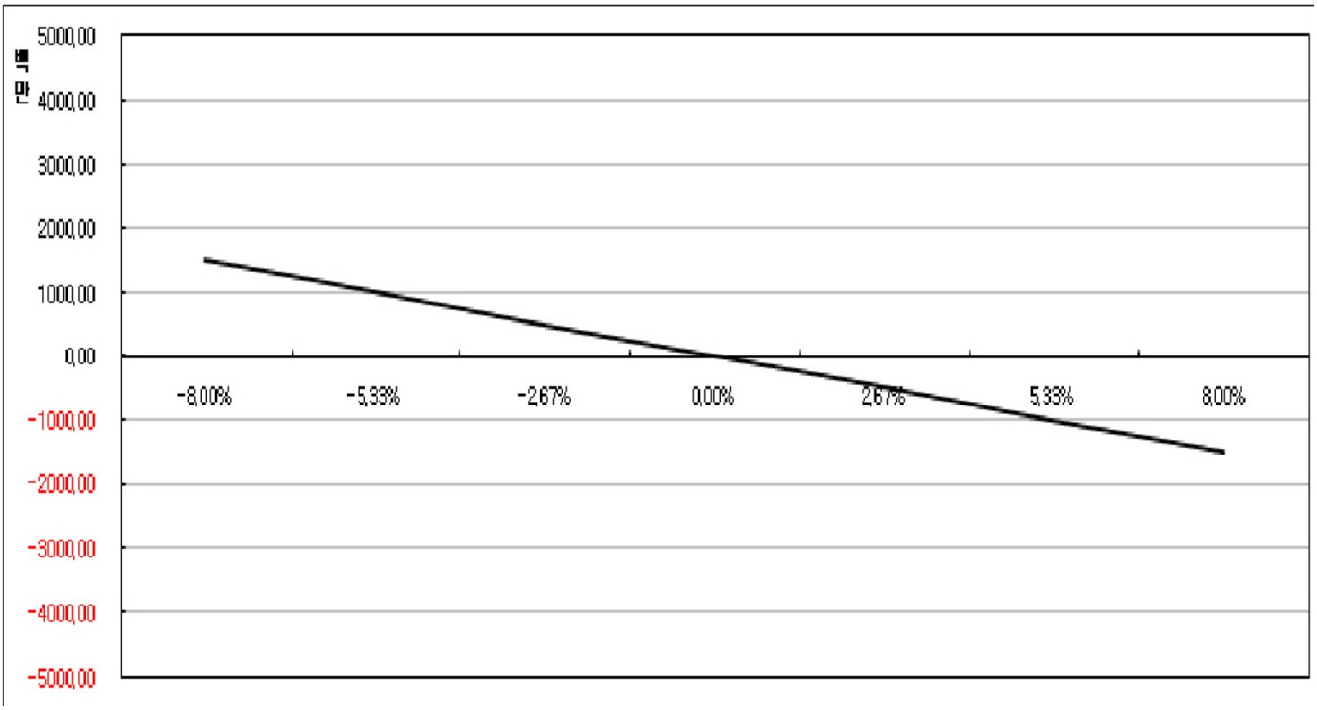
공시일: 2020-03-13

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	1,362	1,424	-62	장내
누계	주가지수	선물	0	1,424	-1,424	장내
합계			0	1,424	-1,424	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

112

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

110

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

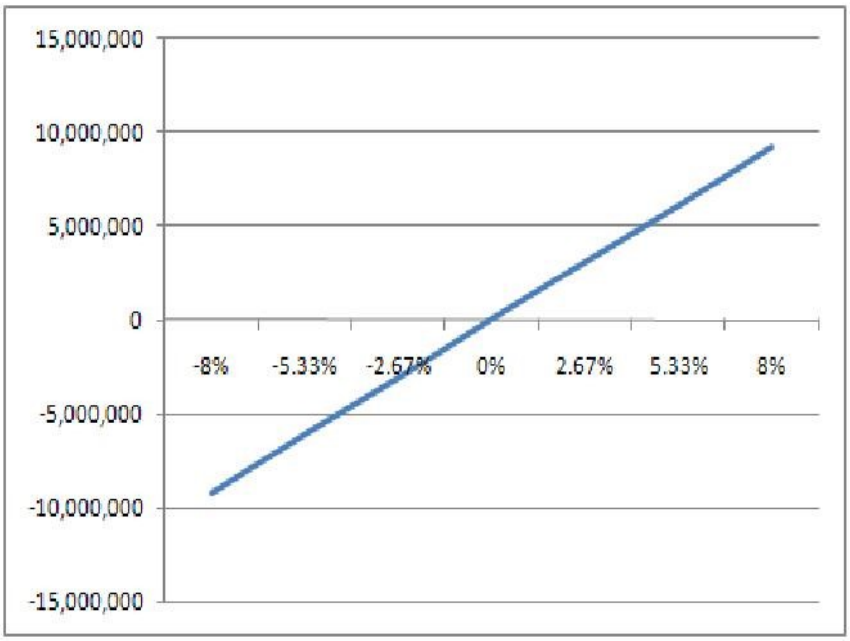
공시일: 2020-03-13

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	19,252	20,676	-1,424	장내
누계	주가지수	선물	66,857	0	66,857	장내
합계			66,857	0	66,857	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,266

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

9,507