펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2020-03-16

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	1,083	0	1,083	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	0	1,925	-1,925	장내
합계			1,083	1,925	-842	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	56

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	767

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

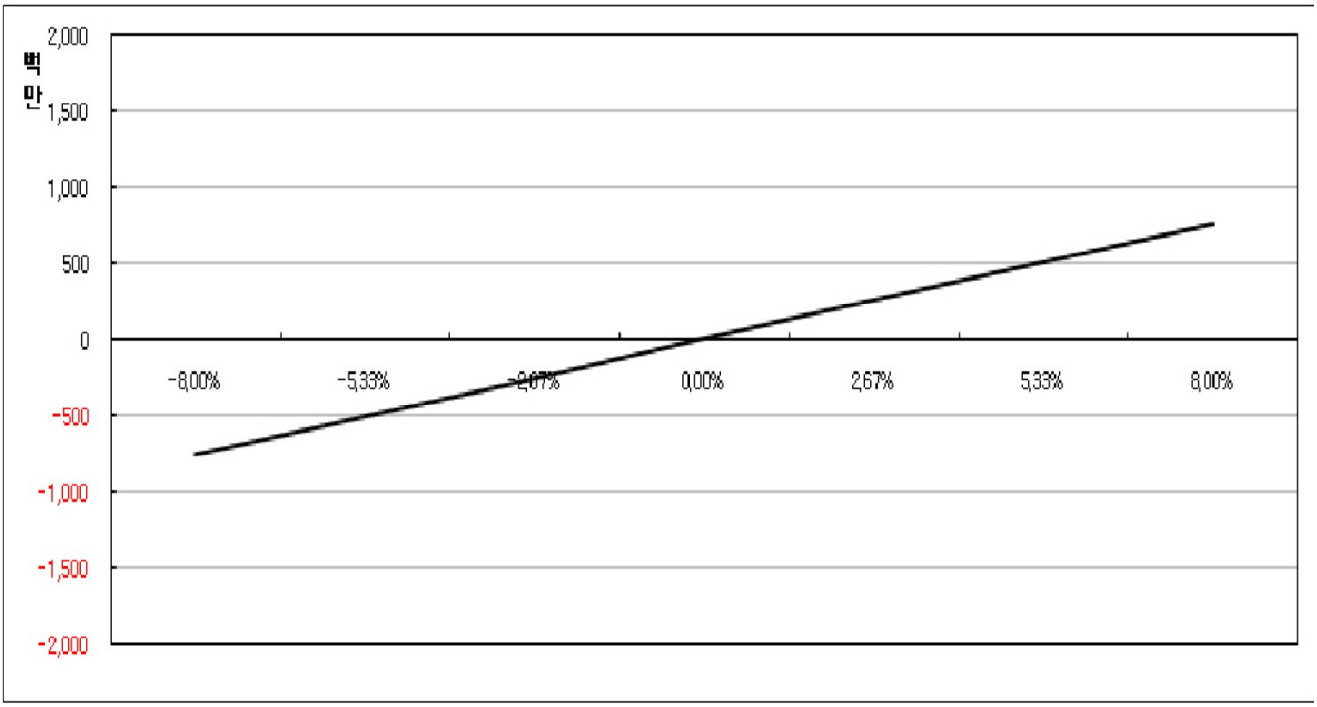
공시일: 2020-03-16

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	361	0	361	장내
합계			361	0	361	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

29

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

360

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

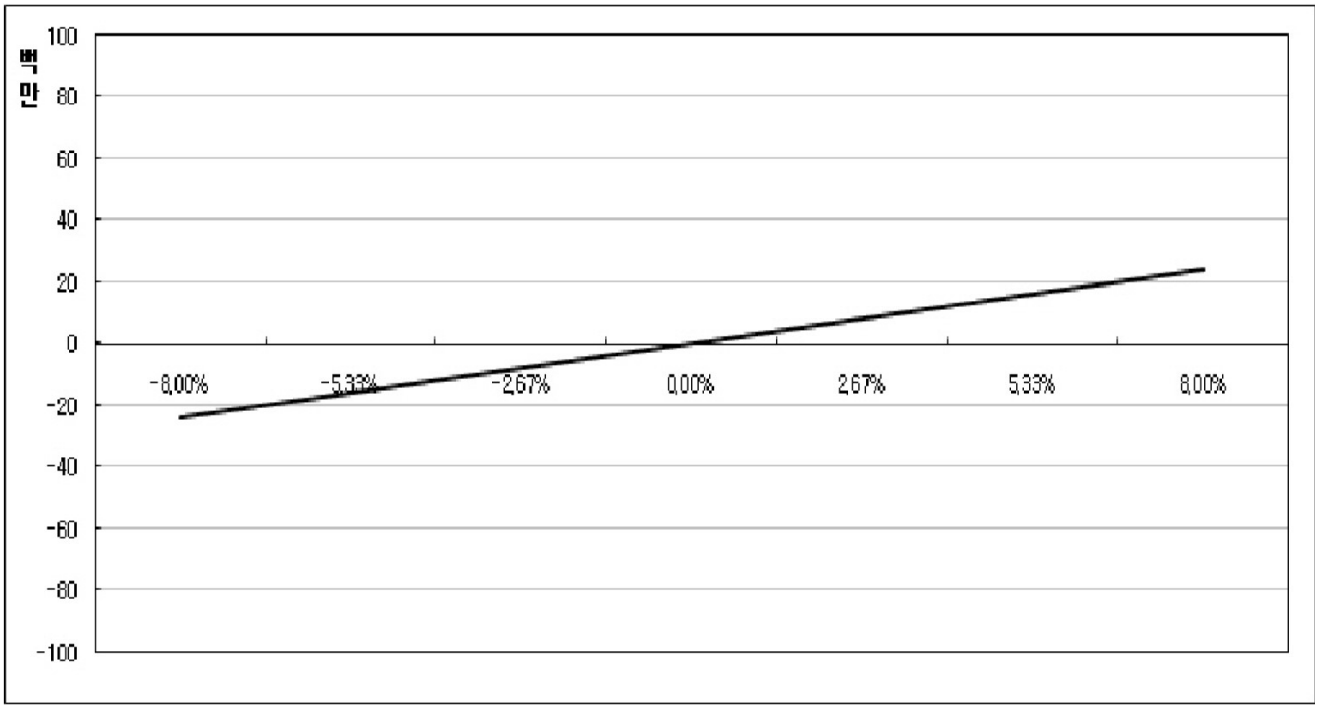
공시일: 2020-03-16

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	60	0	60	장내
누계	주가지수	선물	1,564	0	1,564	장내
합계			1,564	0	1,564	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

125

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

531

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

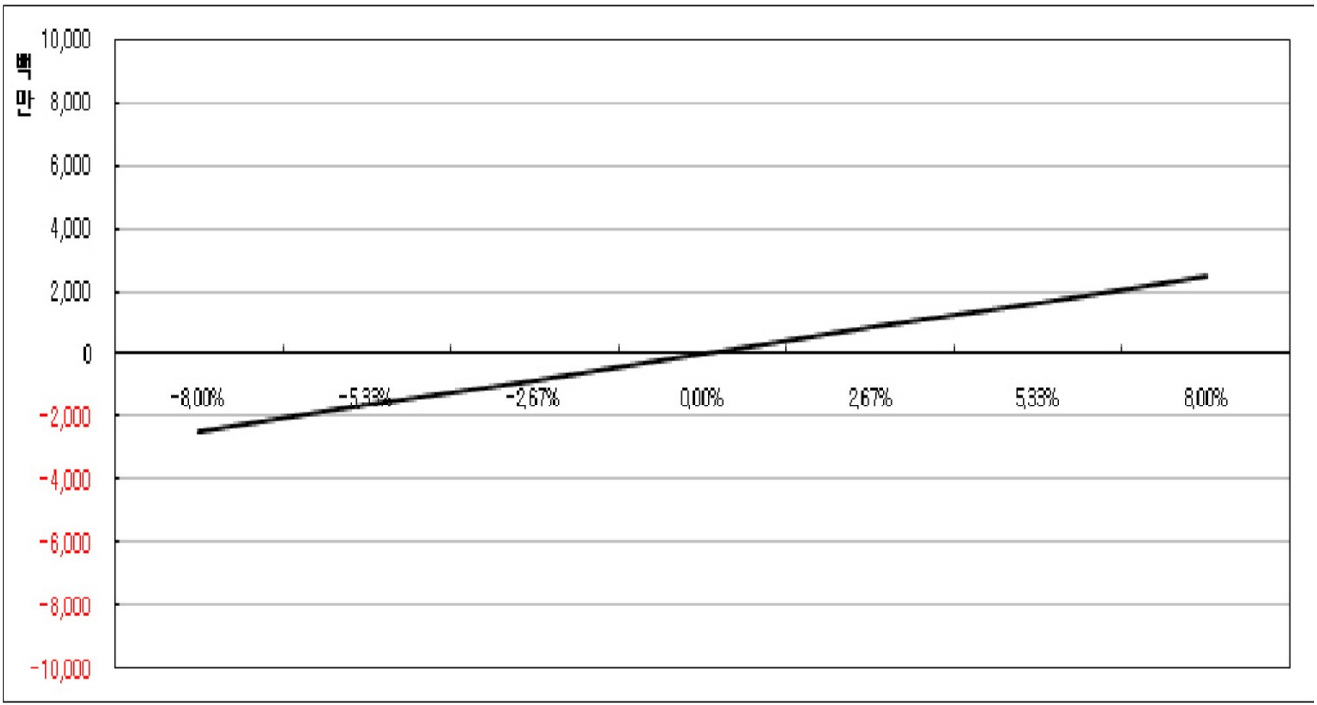
공시일: 2020-03-16

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	481	120	361	장내
누계	주가지수	선물	5,294	0	5,294	장내
합계			5,294	0	5,294	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

423

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

1,057

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

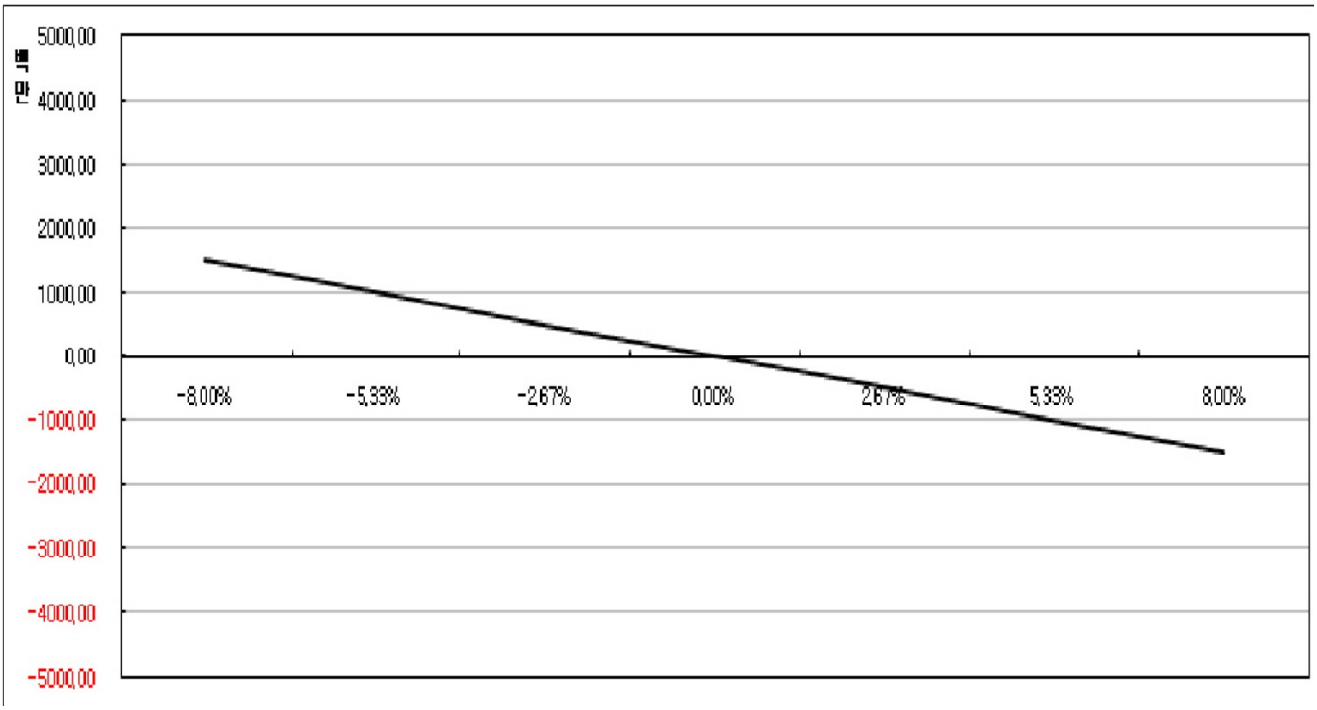
공시일: 2020-03-16

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	241	0	241	장내
누계	주가지수	선물	0	1,143	-1,143	장내
합계			0	1,143	-1,143	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

91

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

91

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

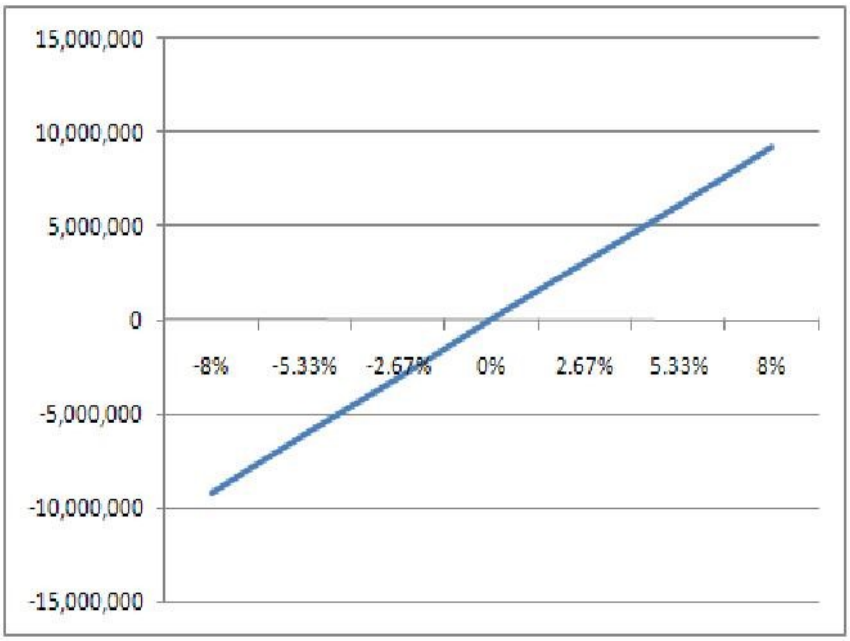
공시일: 2020-03-16

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	120	0	120	장내
누계	주가지수	선물	65,096	0	65,096	장내
합계			65,096	0	65,096	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,206

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

9,531