펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2020-03-18

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	964	0	964	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	0	1,815	-1,815	장내
합계			964	1,815	-851	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

61

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

504

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

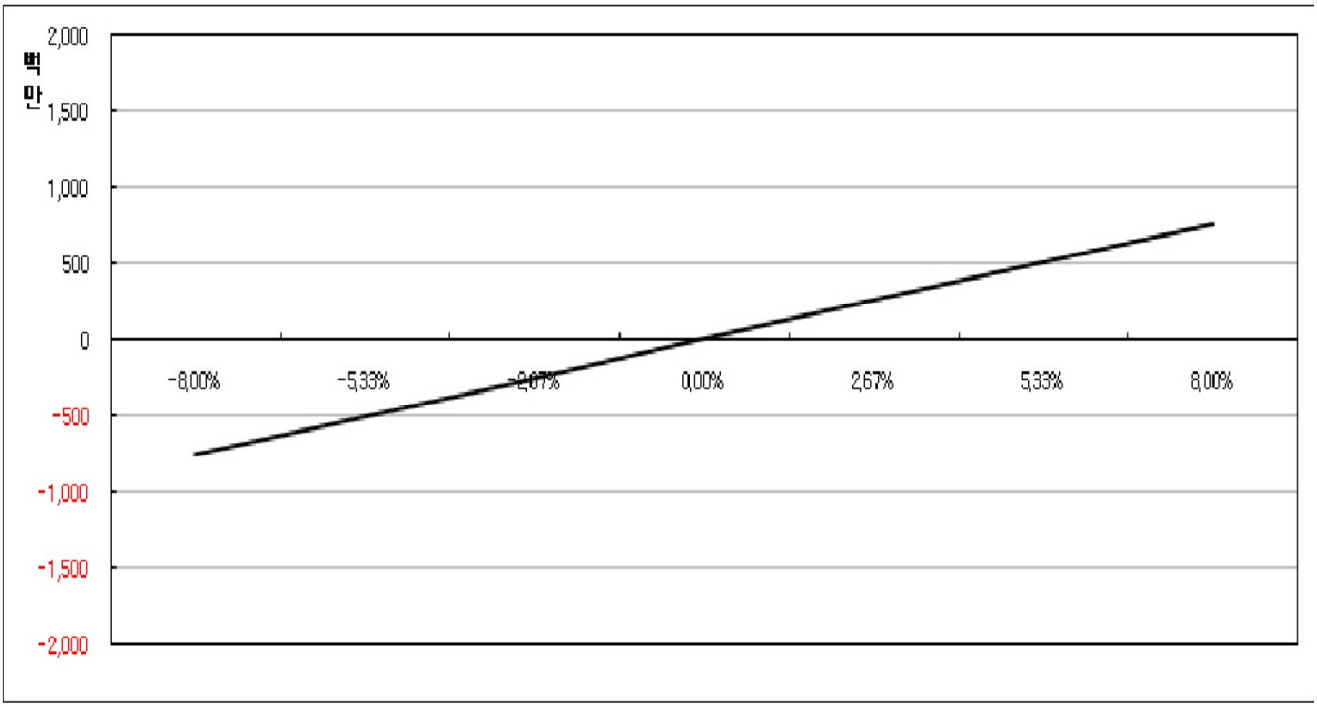
공시일: 2020-03-18

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	340	0	340	장내
합계			340	0	340	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

27

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

344

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

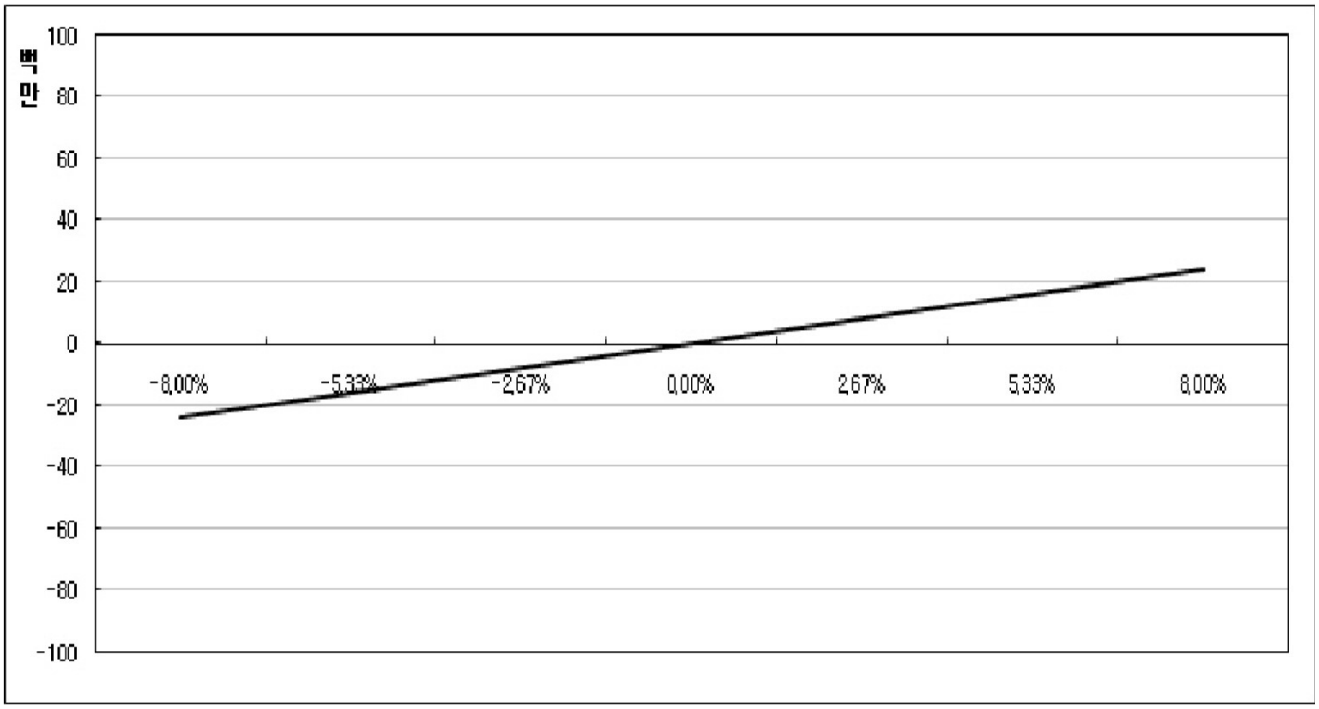
공시일: 2020-03-18

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	57	0	57	장내
누계	주가지수	선물	1,532	0	1,532	장내
합계			1,532	0	1,532	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

121

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

508

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

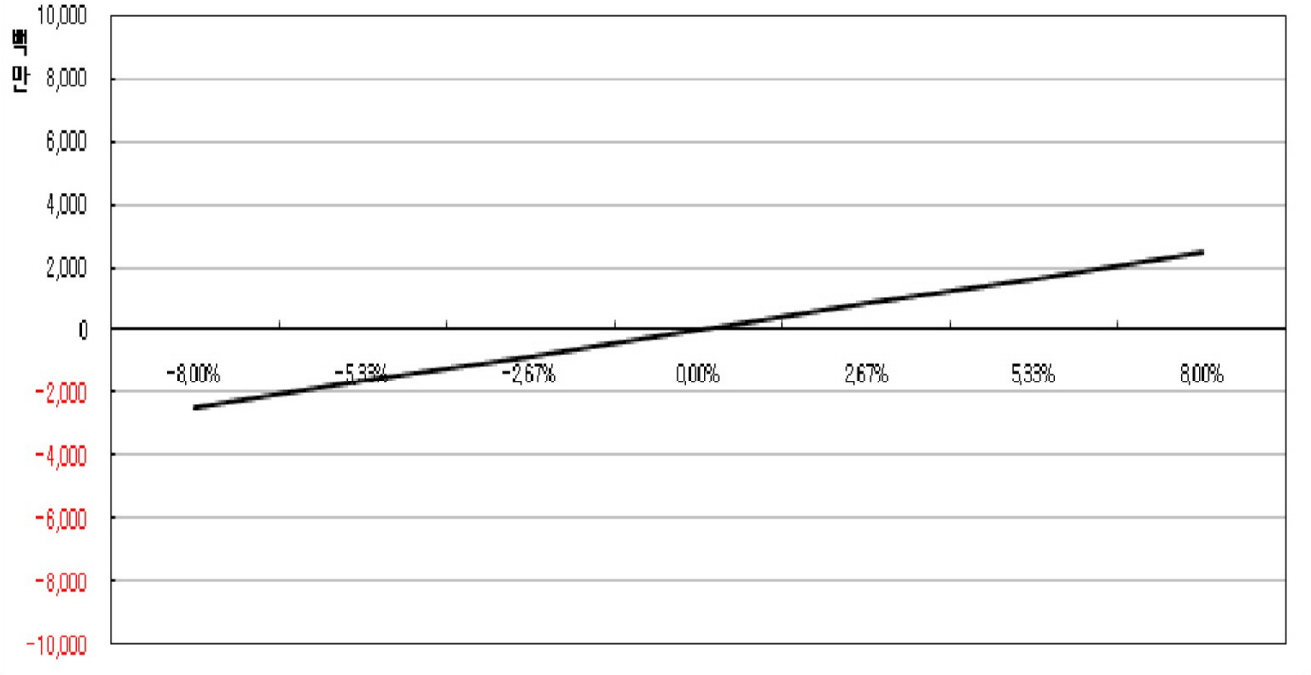
공시일: 2020-03-18

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	113	0	113	장내
누계	주가지수	선물	5,729	0	5,729	장내
합계			5,729	0	5,729	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

453

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

1,050

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

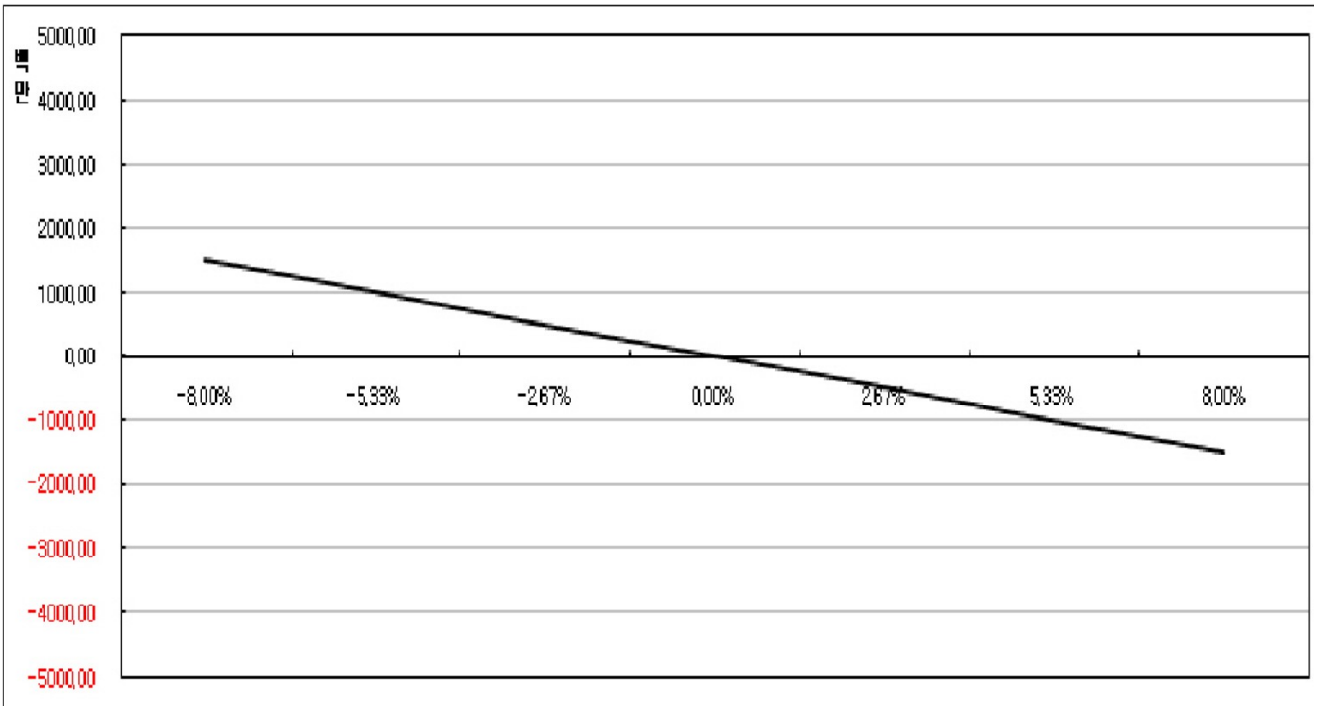
공시일: 2020-03-18

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	113	454	-340	장내
누계	주가지수	선물	0	1,532	-1,532	장내
합계			0	1,532	-1,532	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

121

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

123

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

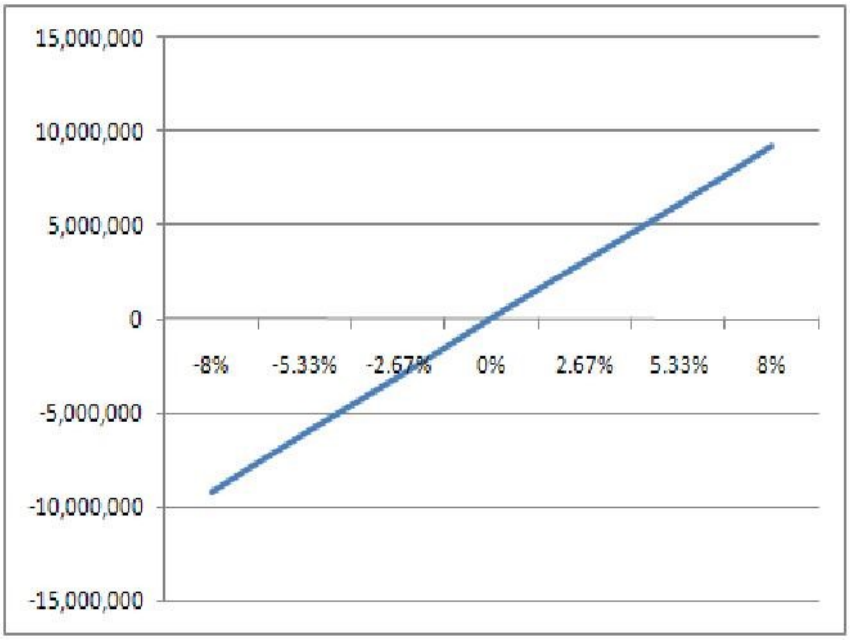
공시일: 2020-03-18

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	397	0	397	장내
누계	주가지수	선물	61,884	0	61,884	장내
합계			61,884	0	61,884	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	4,896

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	8,867