펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2020-03-19

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	917	0	917	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	0	1,727	-1,727	장내
합계			917	1,727	-809	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

66

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

190

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

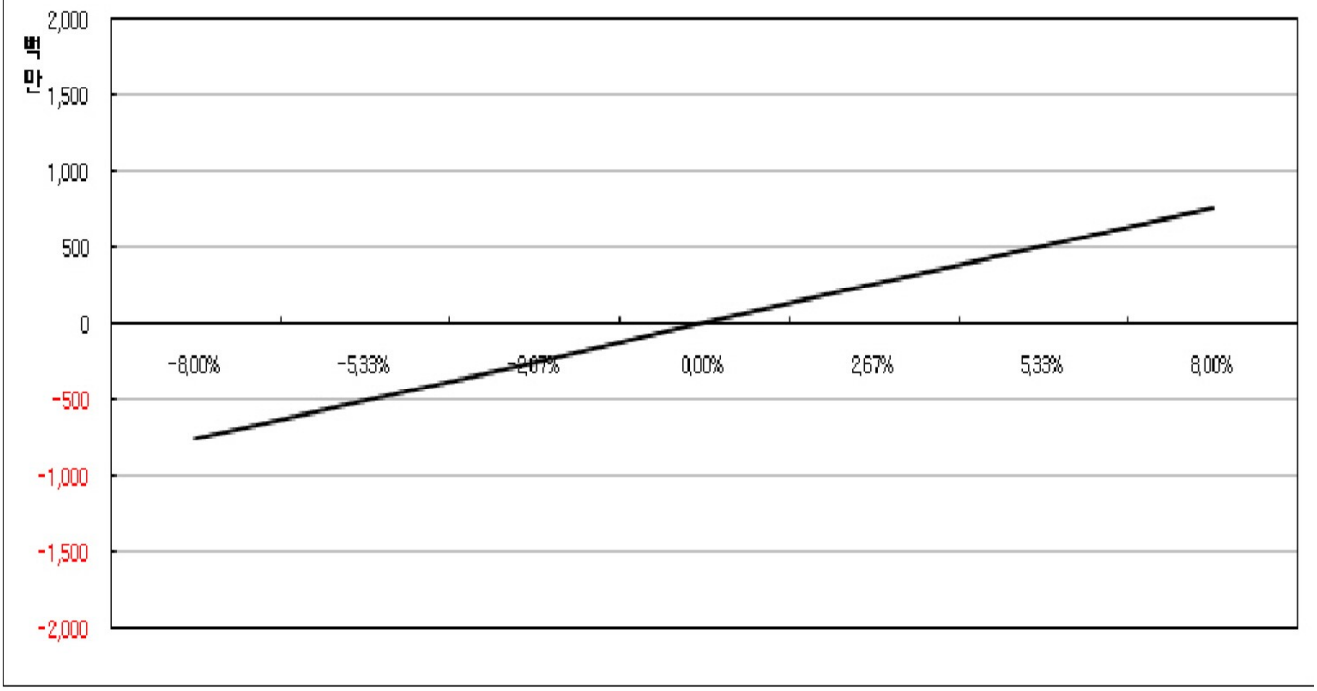
공시일: 2020-03-19

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	540	0	540	장내
누계	주가지수	선물	863	0	863	장내
합계			863	0	863	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

68

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

326

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

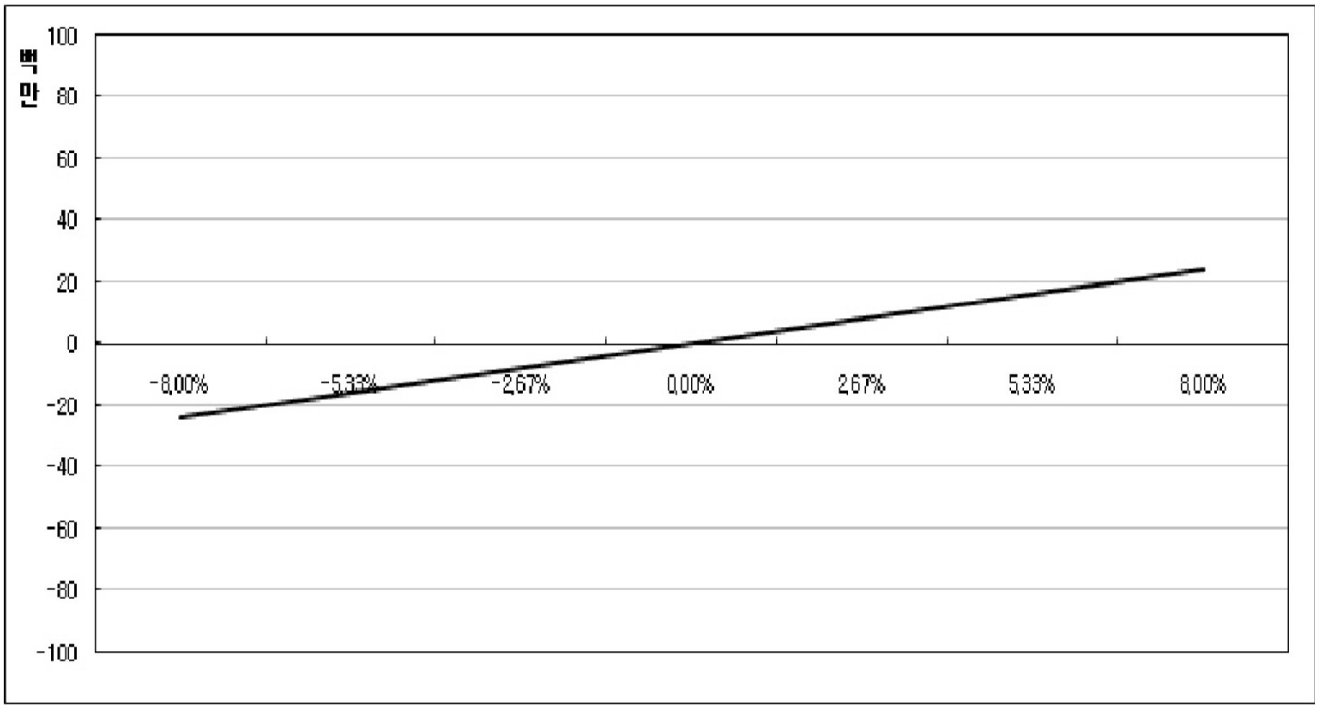
공시일: 2020-03-19

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	1,457	0	1,457	장내
합계			1,457	0	1,457	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

114

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

503

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

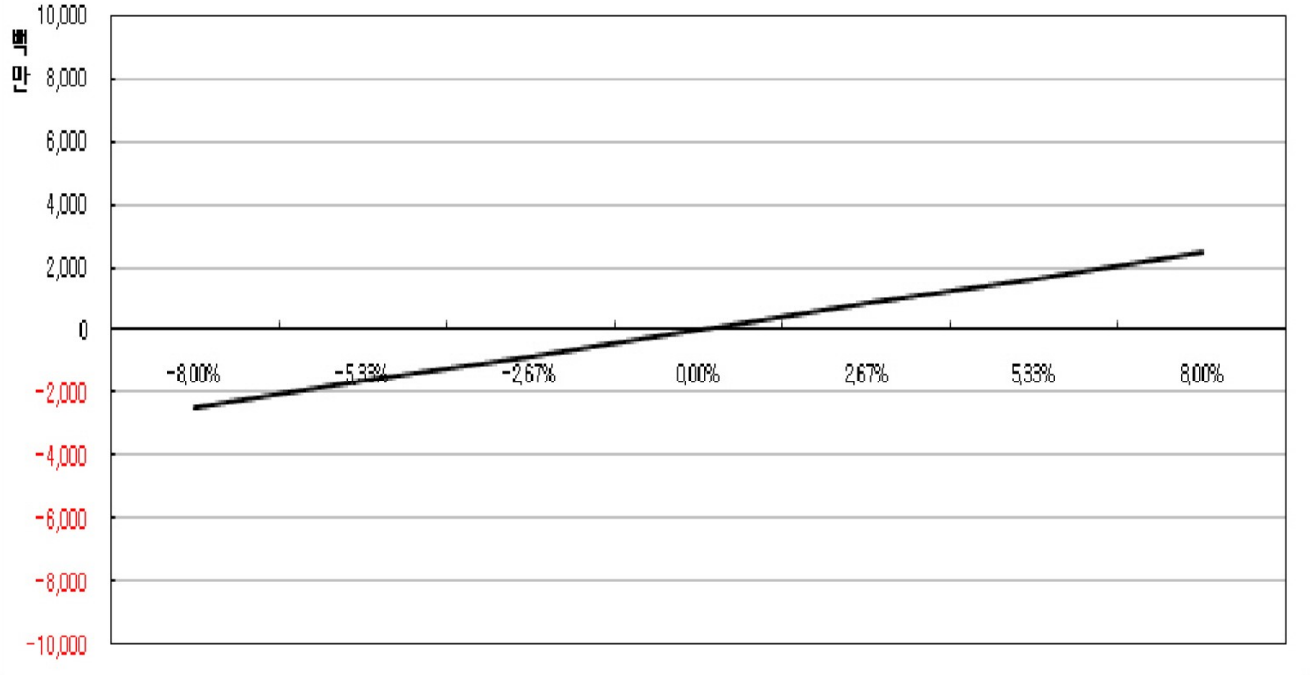
공시일: 2020-03-19

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	1,457	324	1,133	장내
누계	주가지수	선물	6,583	0	6,583	장내
합계			6,583	0	6,583	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

516

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

1,031

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

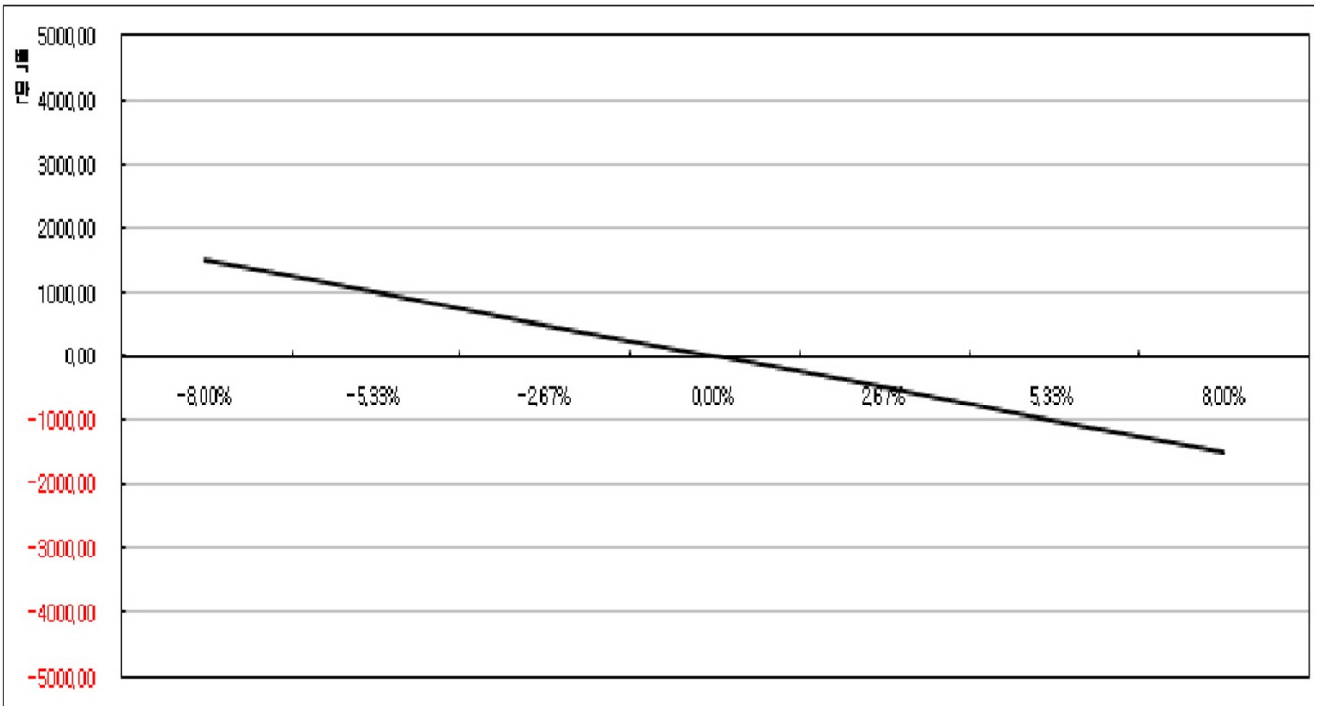
공시일: 2020-03-19

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	108	-108	장내
누계	주가지수	선물	0	1,565	-1,565	장내
합계			0	1,565	-1,565	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

123

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

130

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

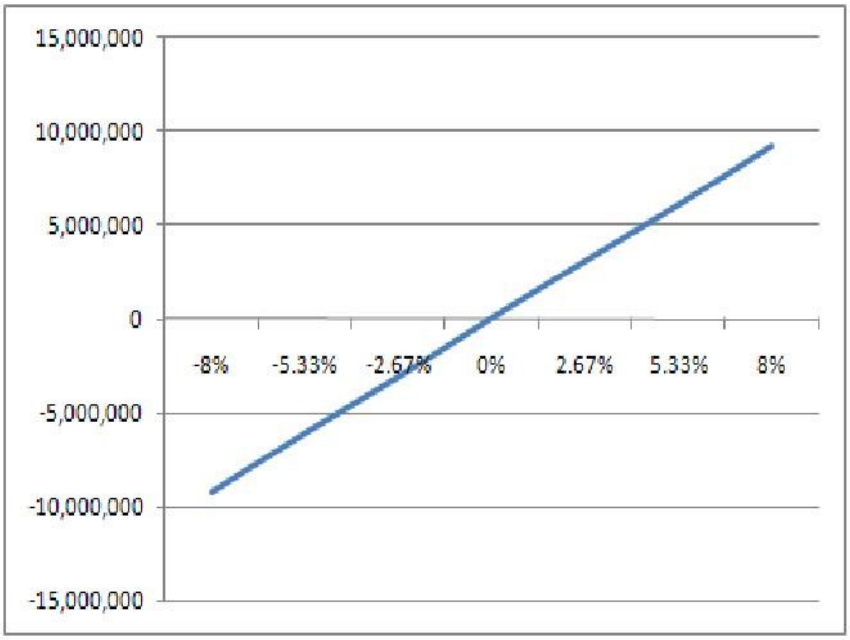
공시일: 2020-03-19

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	162	0	162	장내
누계	주가지수	선물	59,030	0	59,030	장내
합계			59,030	0	59,030	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

4,630

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

8,546