펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2020-03-30

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	994	0	994	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	22	1,870	-1,849	장내
합계			1,015	1,870	-855	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

35

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

130

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

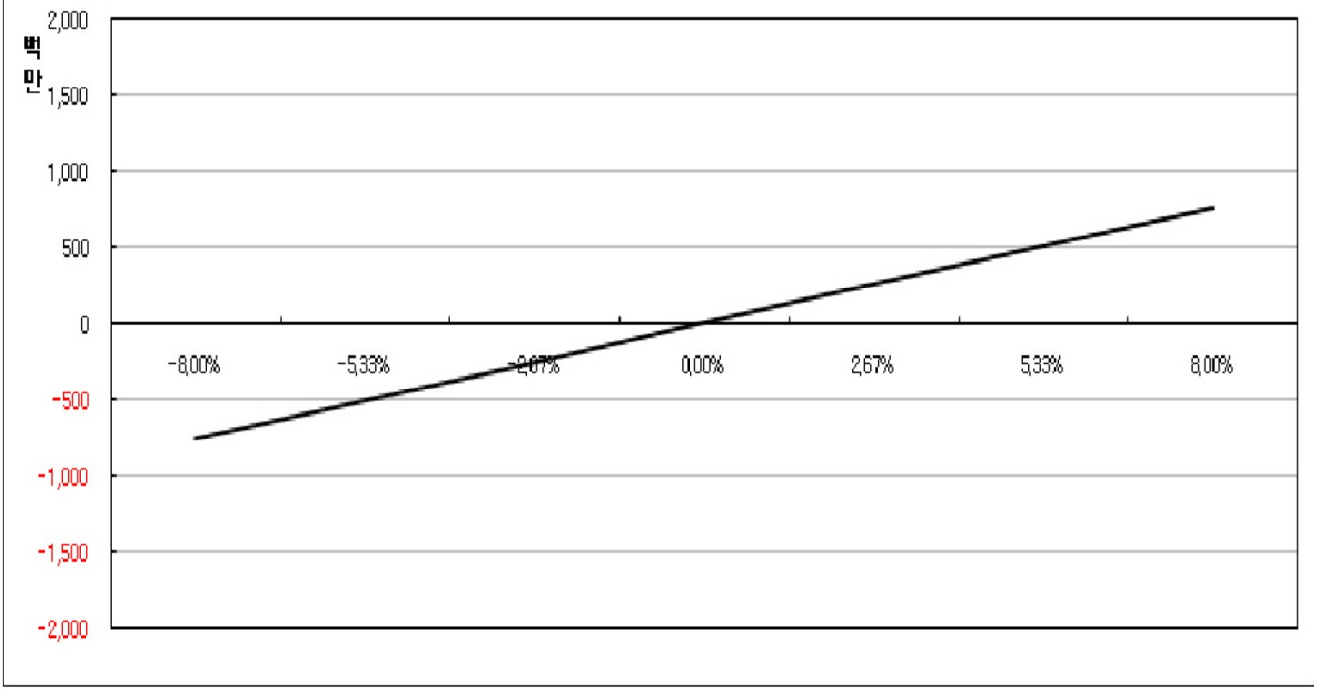
공시일: 2020-03-30

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	935	0	935	장내
합계			935	0	935	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

75

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

490

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

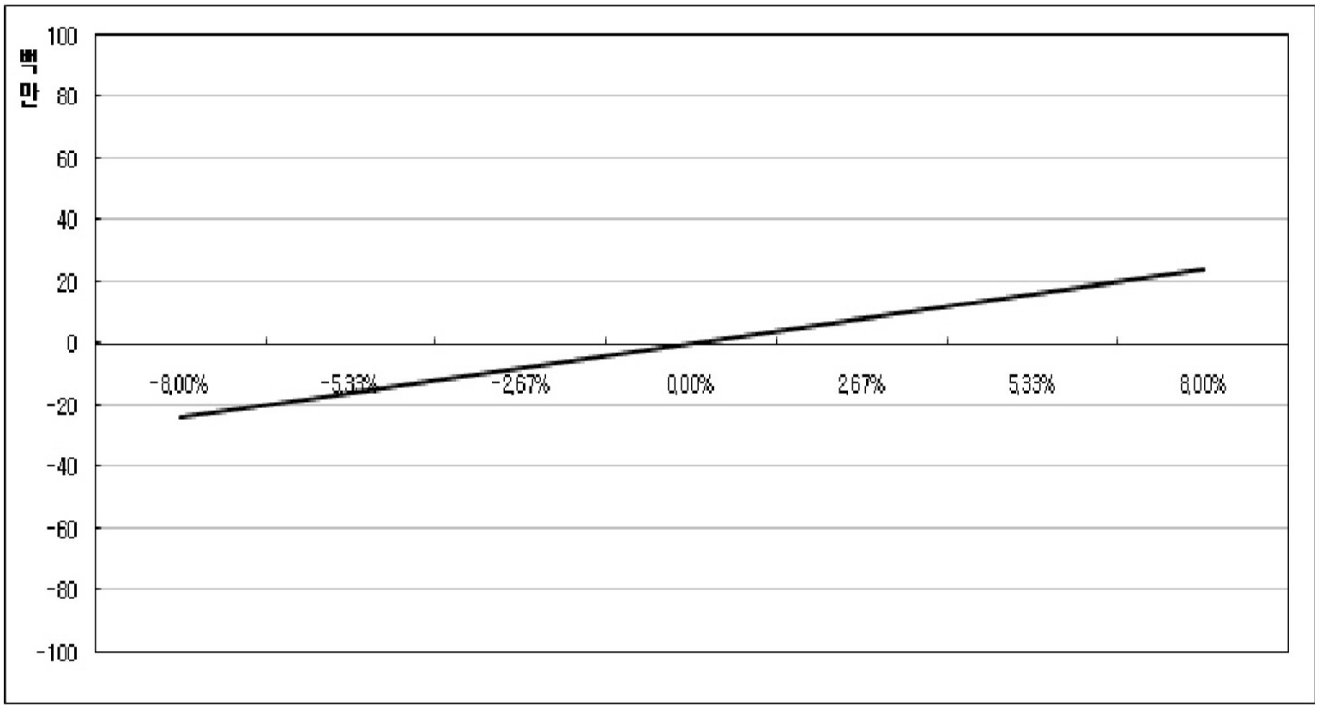
공시일: 2020-03-30

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	2,338	0	2,338	장내
합계			2,338	0	2,338	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

187

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

762

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

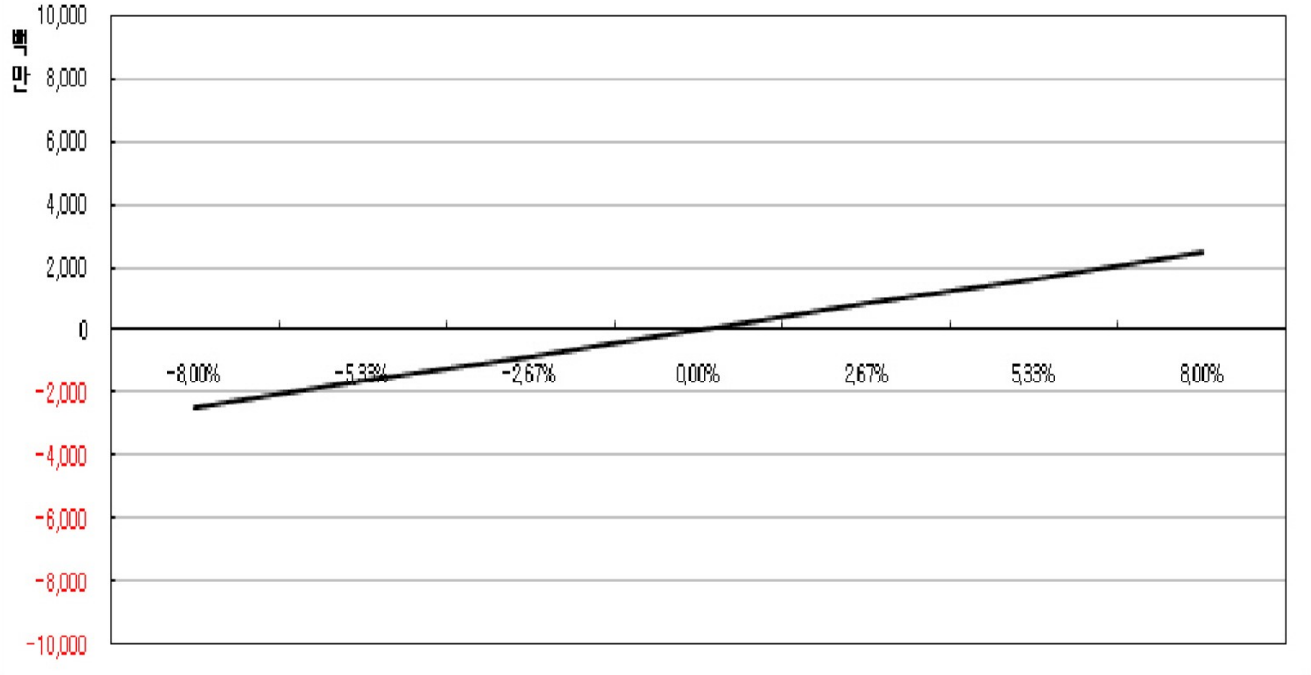
공시일: 2020-03-30

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	468	0	468	장내
누계	주가지수	선물	8,416	0	8,416	장내
합계			8,416	0	8,416	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

672

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

1,518

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

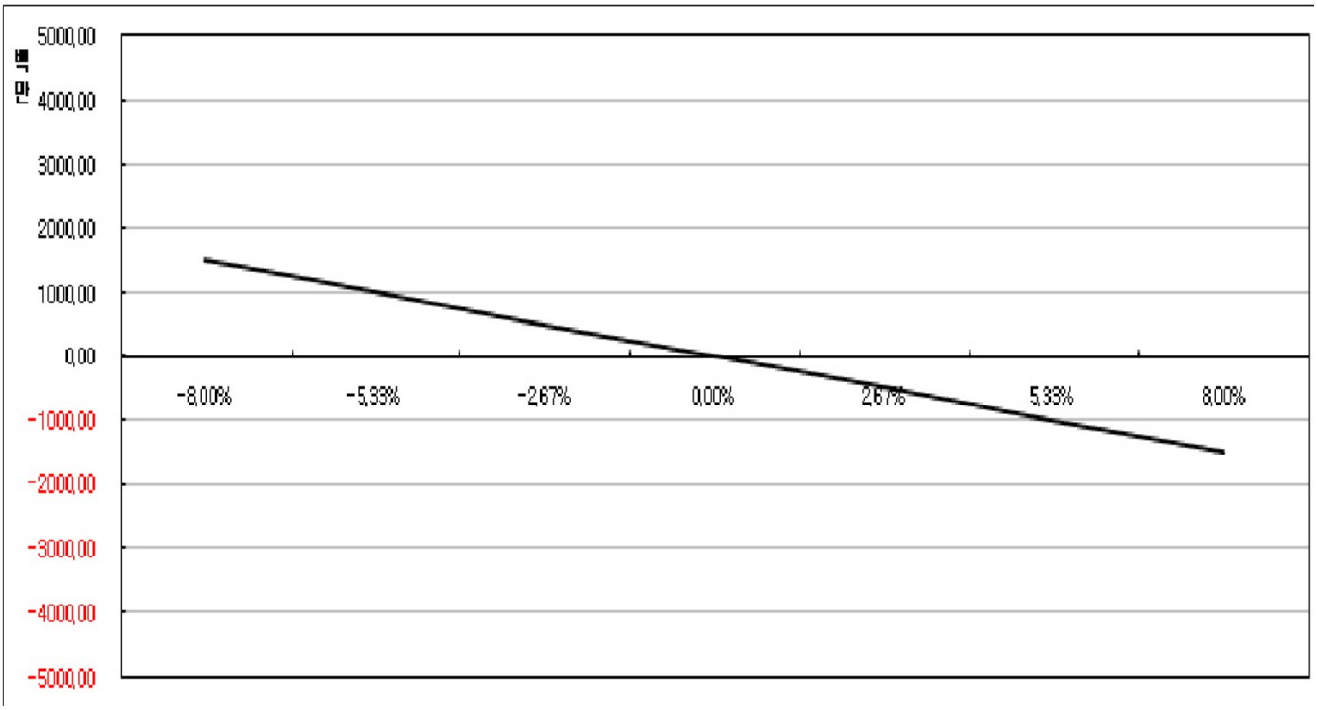
공시일: 2020-03-30

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	351	175	175	장내
누계	주가지수	선물	0	1,344	-1,344	장내
합계			0	1,344	-1,344	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

107

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

151

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

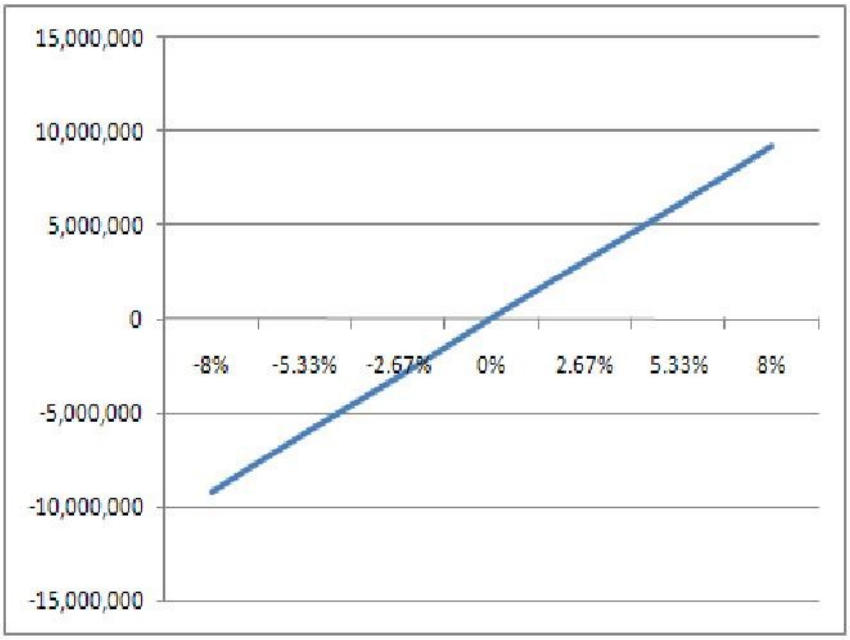
공시일: 2020-03-30

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	935	0	935	장내
누계	주가지수	선물	71,481	0	71,481	장내
합계			71,481	0	71,481	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,709

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

13,414