펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2020-03-31

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	988	0	988	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	24	1,860	-1,836	장내
합계			1,011	1,860	-848	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

39

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

143

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

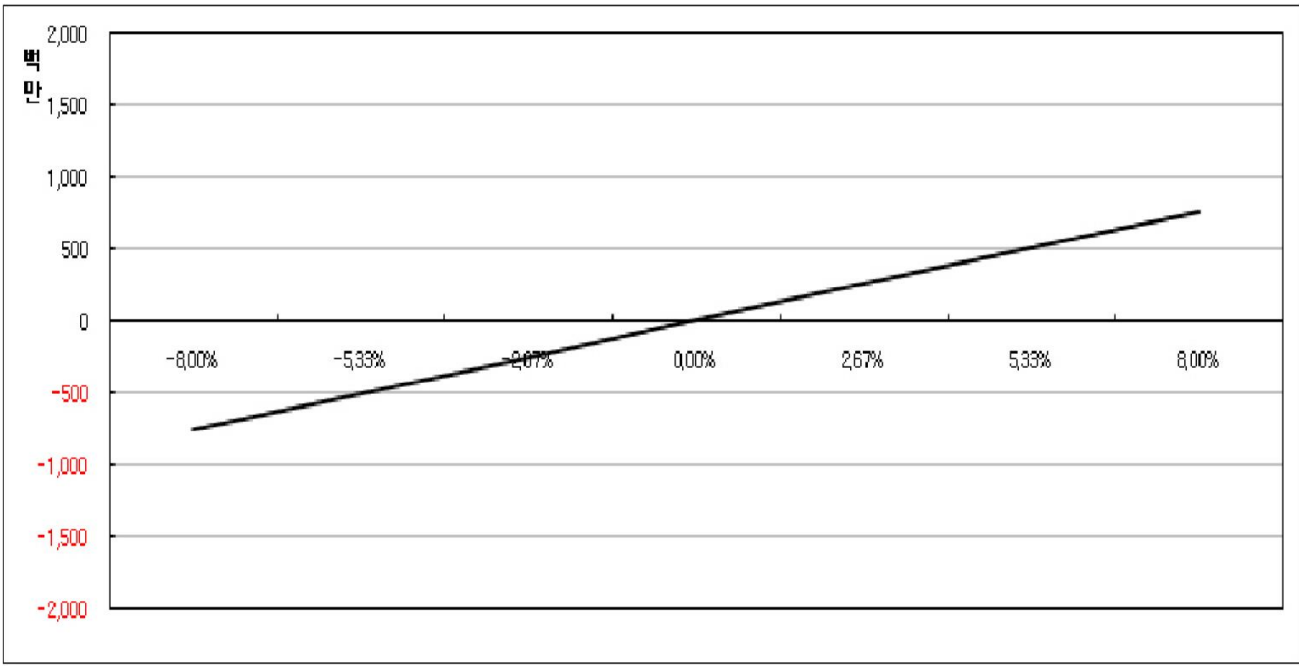
공시일: 2020-03-31

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	930	0	930	장내
합계			930	0	930	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	74

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	486

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

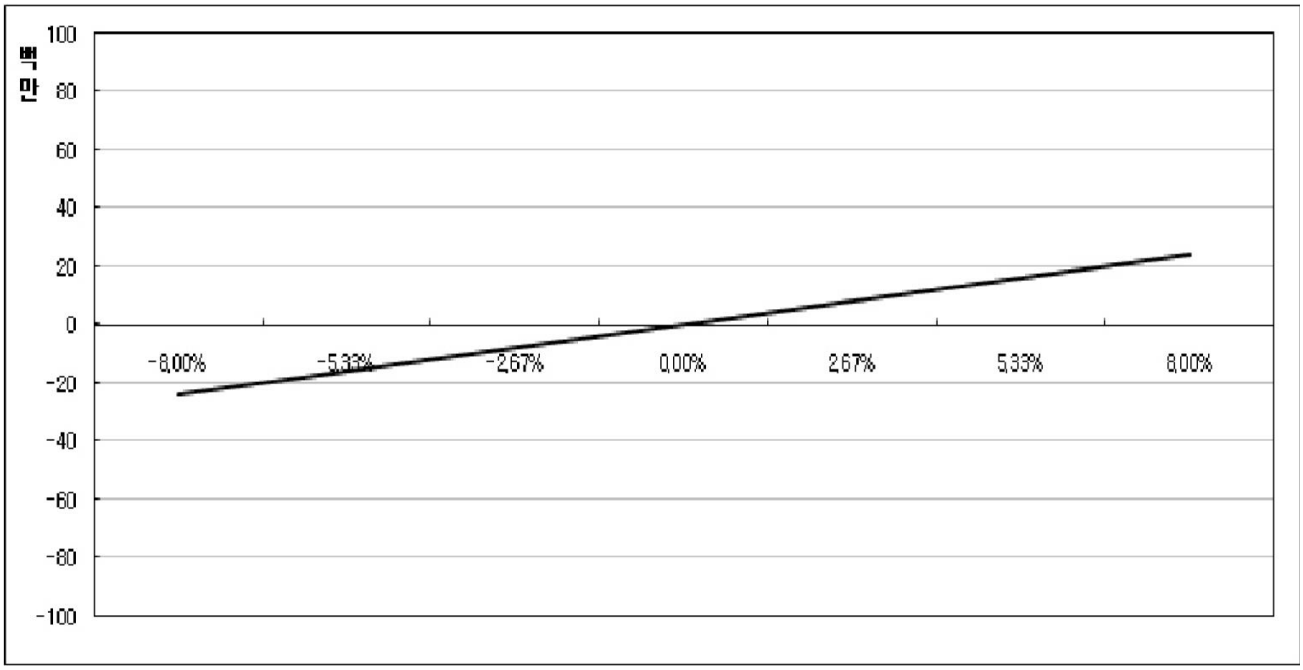
공시일: 2020-03-31

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	2,325	0	2,325	장내
합계			2,325	0	2,325	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	184

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	755

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

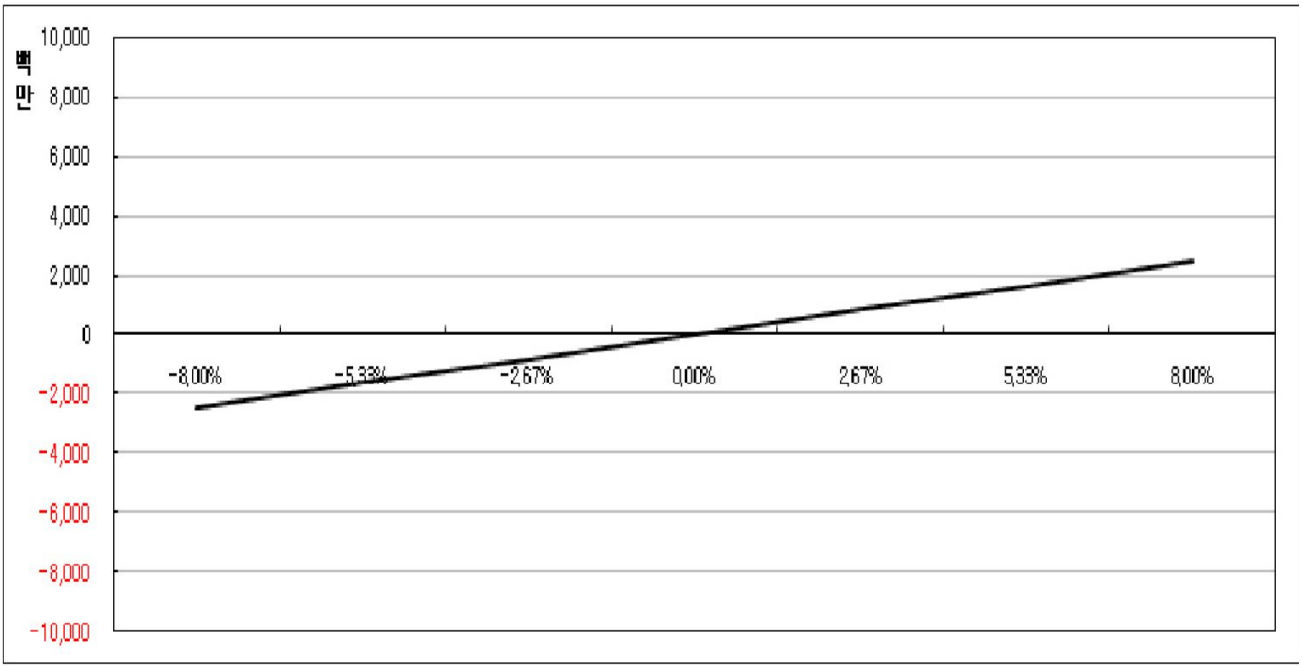
공시일: 2020-03-31

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	232	0	232	장내
누계	주가지수	선물	8,601	0	8,601	장내
합계			8,601	0	8,601	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

682

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

1,525

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

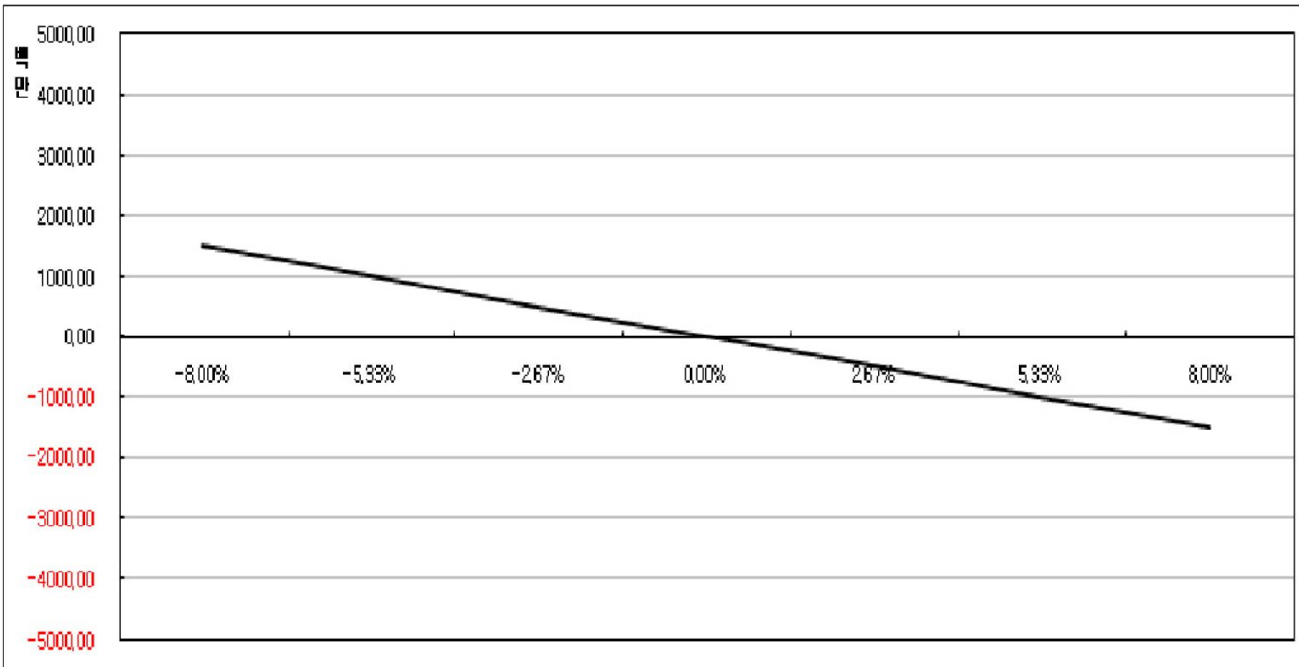
공시일: 2020-03-31

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	116	116	0	장내
누계	주가지수	선물	0	1,337	-1,337	장내
합계			0	1,337	-1,337	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

106

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

149

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

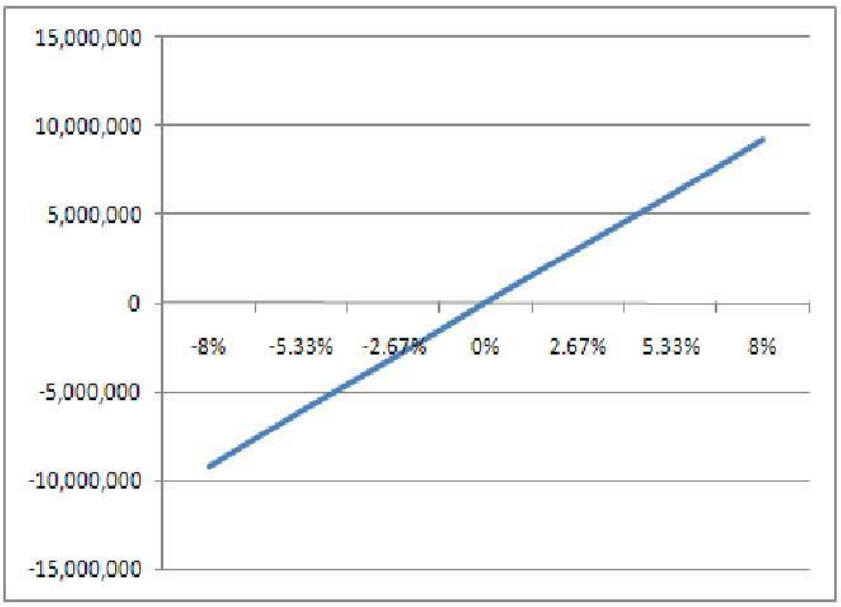
공시일: 2020-03-31

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	71,072	0	71,072	장내
합계			71,072	0	71,072	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,633

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

13,252