펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2020-04-02

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	962	0	962	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	25	1,698	-1,673	장내
합계			987	1,698	-711	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

44

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

186

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

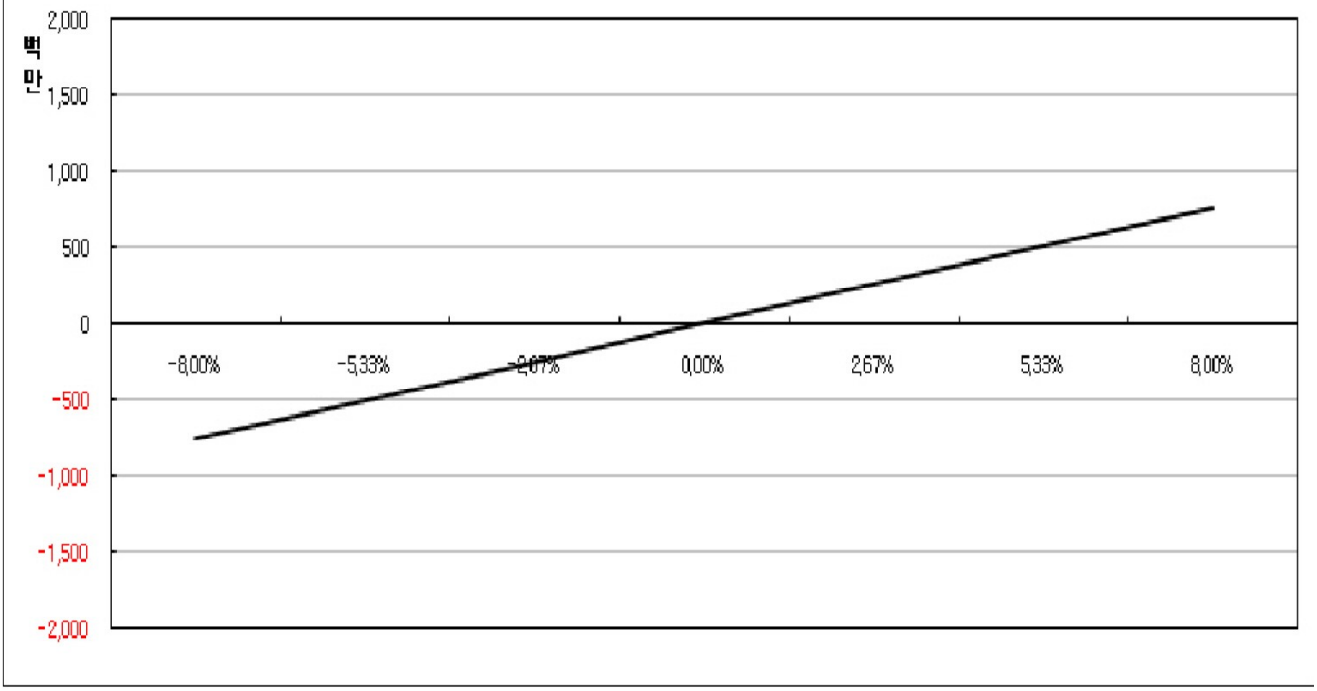
공시일: 2020-04-02

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	905	0	905	장내
합계			905	0	905	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

72

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

479

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

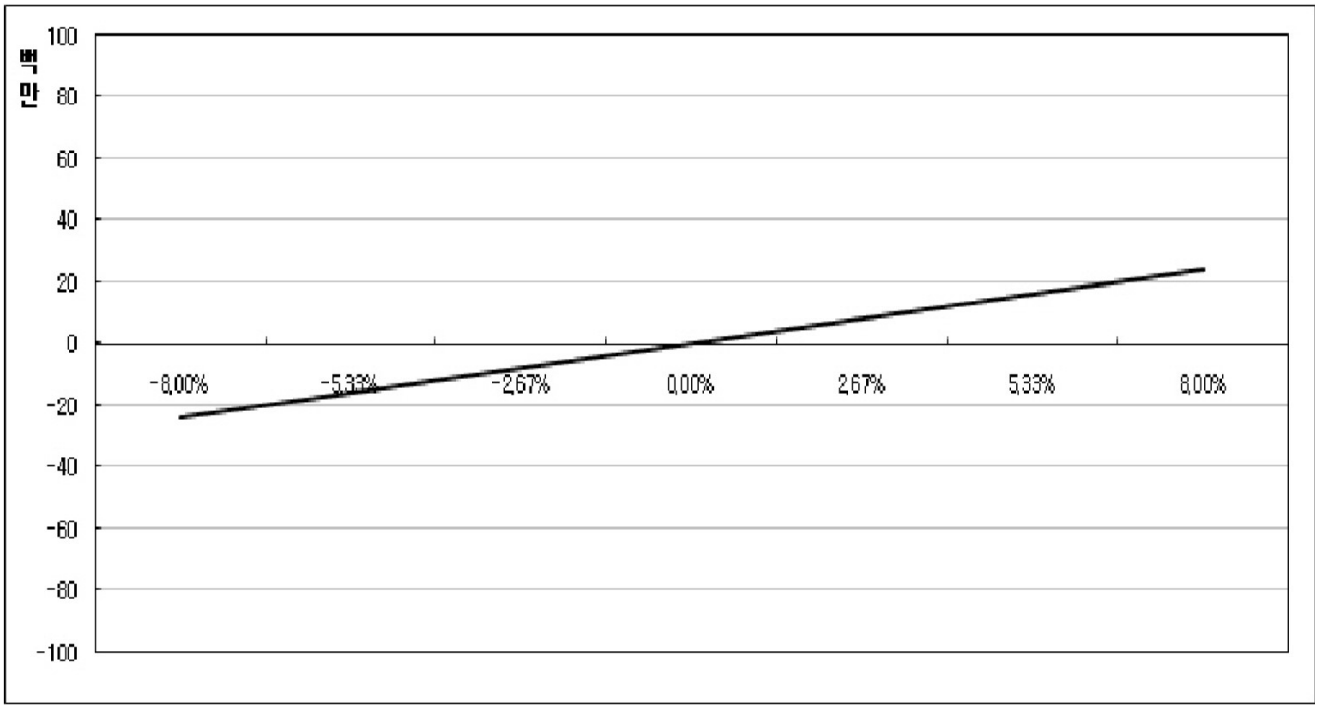
공시일: 2020-04-02

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	2,433	0	2,433	장내
합계			2,433	0	2,433	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

194

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

762

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

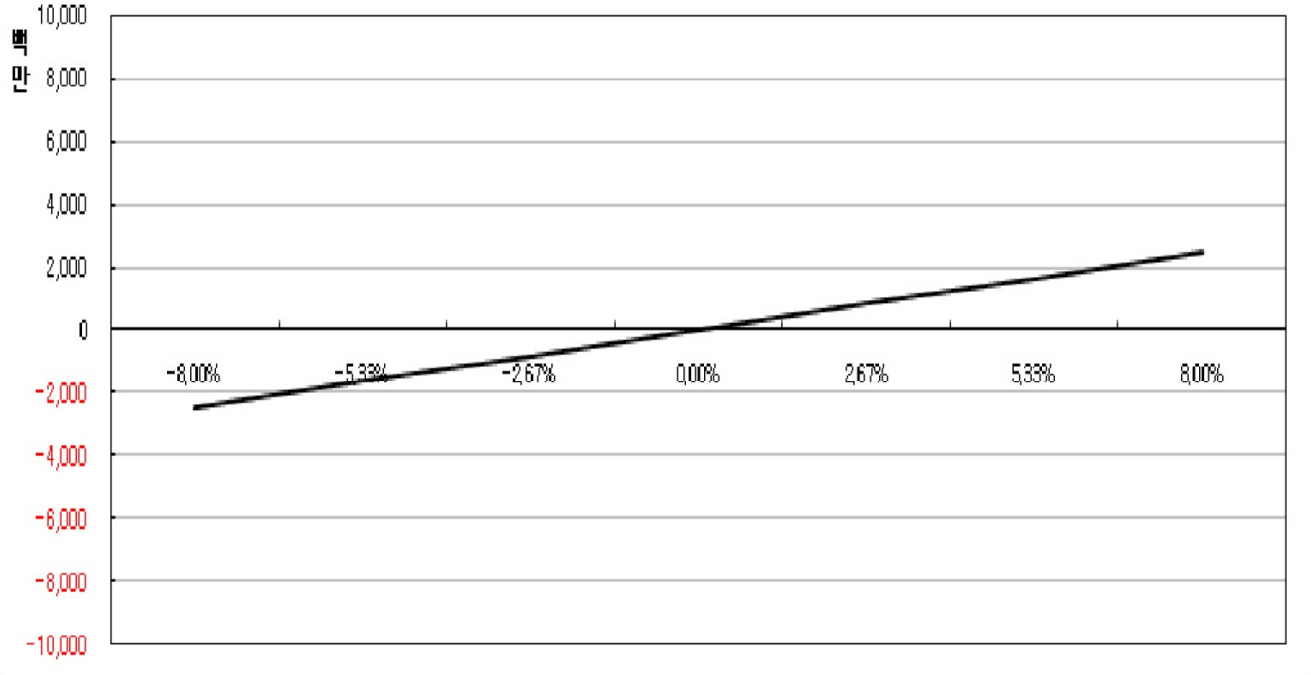
공시일: 2020-04-02

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	170	113	57	장내
누계	주가지수	선물	8,149	0	8,149	장내
합계			8,149	0	8,149	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

648

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

1,484

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

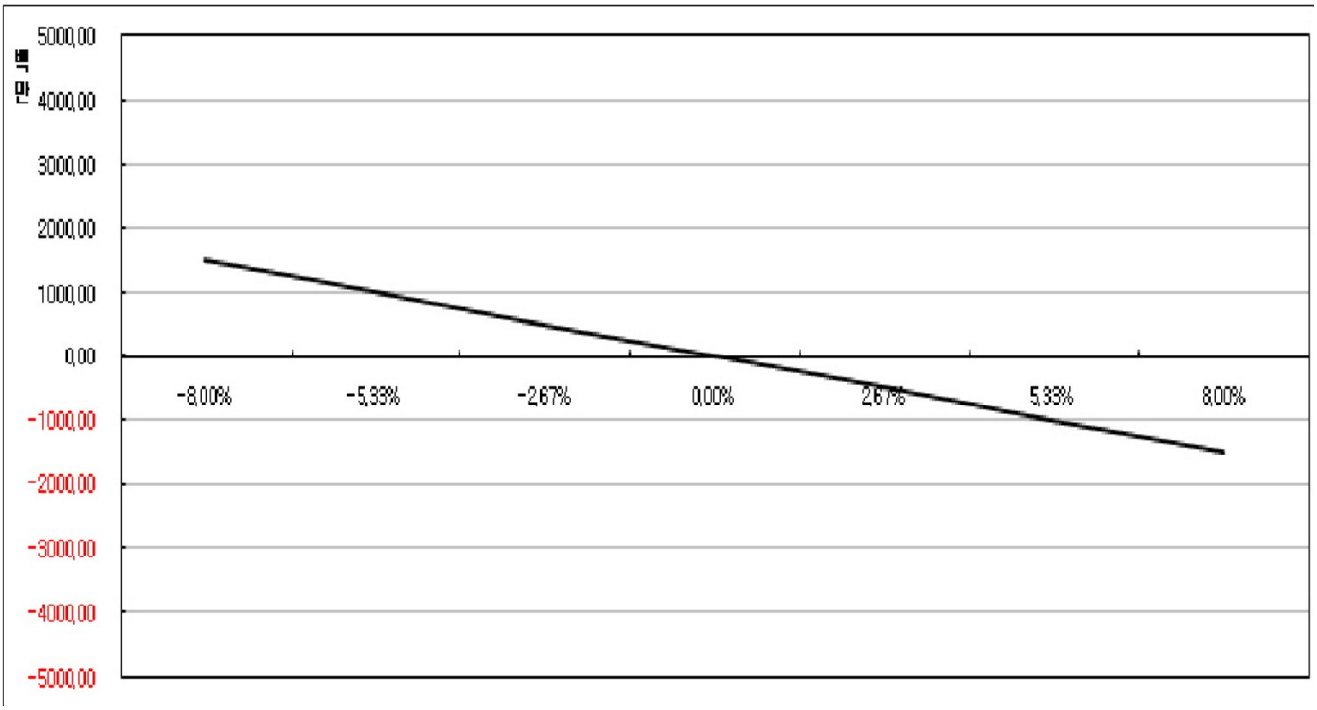
공시일: 2020-04-02

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	340	-340	장내
누계	주가지수	선물	0	1,584	-1,584	장내
합계			0	1,584	-1,584	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

126

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

181

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

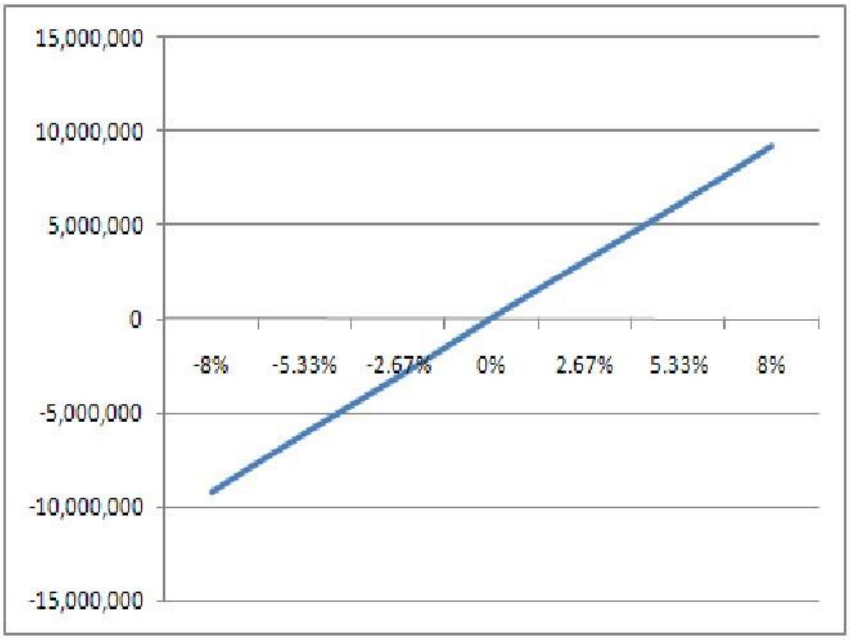
공시일: 2020-04-02

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	453	-453	장내
누계	주가지수	선물	69,886	0	69,886	장내
합계			69,886	0	69,886	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,561

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

12,968