펀드명 : KRX300인덱스증권모[주식-파생형]

공시일: 2020-11-02

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	139	0	139	장내
신규	주가지수	스왑	0	0	0	장외
누계	주가지수	스왑	1	0	1	장외
합계			140	0	140	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	11

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	273

펀드명 : 코스닥벤처기업&공모주[주식혼합-파생형]

공시일: 2020-11-02

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	0	21,077	-21,077	장내
합계			0	21,077	-21,077	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	1,664

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	1,878

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

공시일: 2020-11-02

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	1,131	0	1,131	장내
합계			1,131	0	1,131	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	91

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	1,000

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

공시일: 2020-11-02

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	754	151	603	장내
누계	주가지수	선물	3,544	0	3,544	장내
합계			3,544	0	3,544	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

284

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

1,469

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

공시일: 2020-11-02

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	75	-75	장내
누계	주가지수	선물	0	1,885	-1,885	장내
합계			0	1,885	-1,885	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

151

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

248

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

공시일: 2020-11-02

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	55,193	0	55,193	장내
합계			55,193	0	55,193	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

4,418

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

11,727