펀드명 : KRX300인덱스증권모[주식-파생형]

공시일: 2021-02-23

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	190	0	190	장내
합계			190	0	190	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	15

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	243

펀드명 : 코스닥벤처기업&공모주[주식혼합-파생형]

공시일: 2021-02-23

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	1,528	-1,528	장내
누계	주가지수	선물	0	30,526	-30,526	장내
합계			0	30,526	-30,526	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

2,421

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

2,846

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

공시일: 2021-02-23

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	1,876	0	1,876	장내
합계			1,876	0	1,876	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	150

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	1,156

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

공시일: 2021-02-23

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	208	0	208	장내
누계	주가지수	선물	3,960	0	3,960	장내
합계			3,960	0	3,960	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

317

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

1,399

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

공시일: 2021-02-23

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	104	-104	장내
누계	주가지수	선물	0	2,606	-2,606	장내
합계			0	2,606	-2,606	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	208

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	357

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

공시일: 2021-02-23

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	31,058	0	31,058	장내
합계			31,058	0	31,058	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	2,485

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	7,238