펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2020-01-03

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	73	0	73	장내
누계	주가지수	선물	1,524	0	1,524	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	0	2,758	-2,758	장내
합계			1,524	2,758	-1,234	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	96

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	123

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

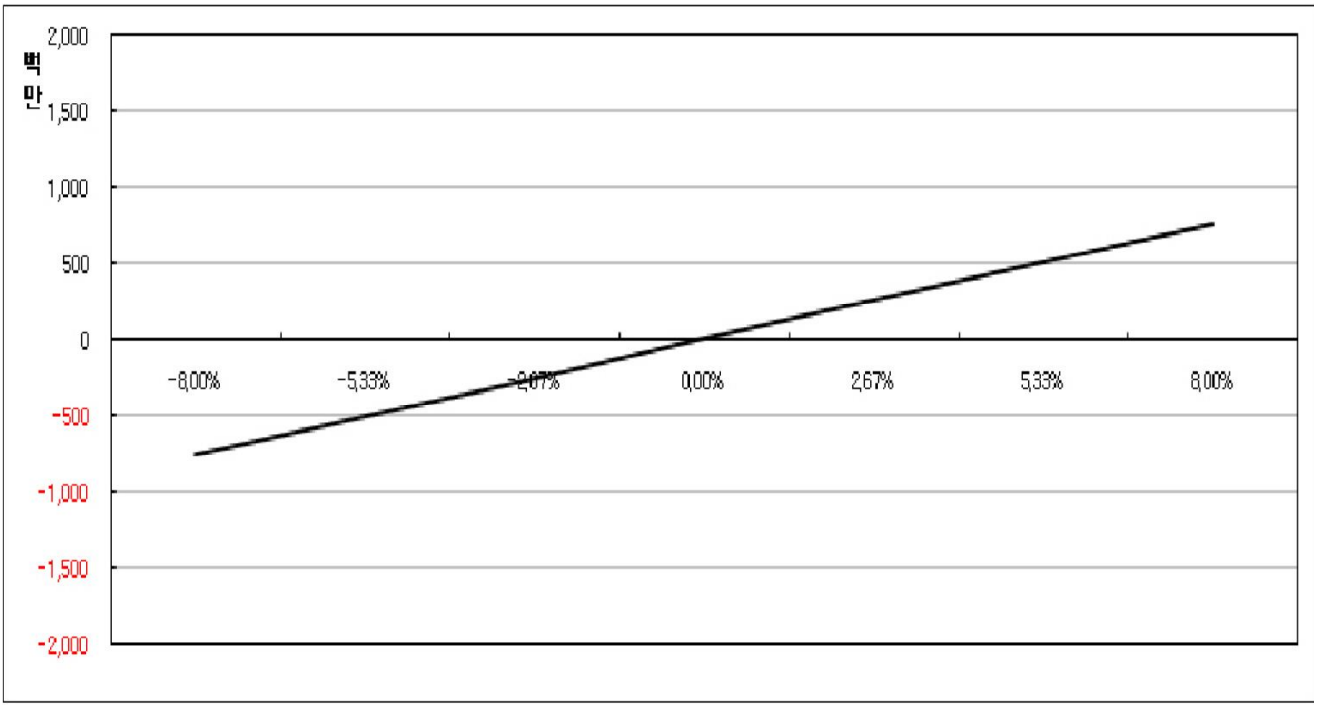
공시일: 2020-01-03

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	290	0	290	장내
합계			290	0	290	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

23

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

344

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

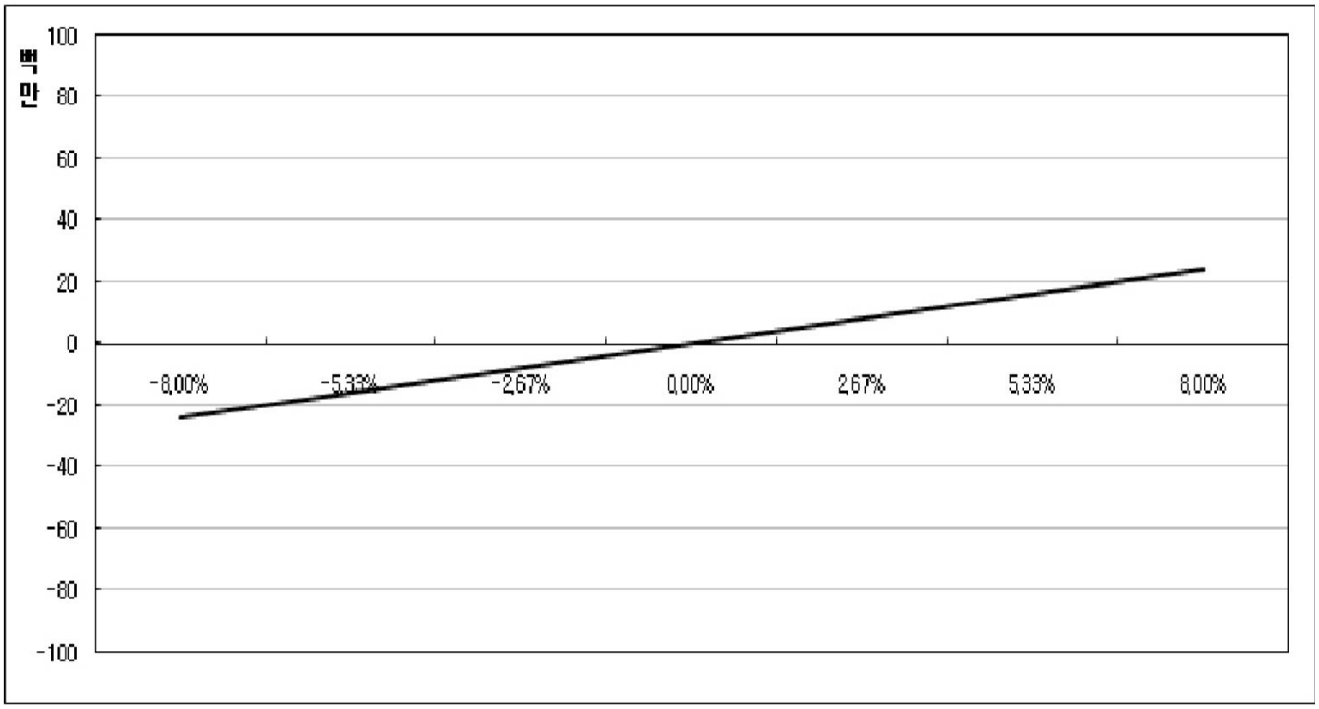
공시일: 2020-01-03

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	1,307	0	1,307	장내
합계			1,307	0	1,307	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

105

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

462

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

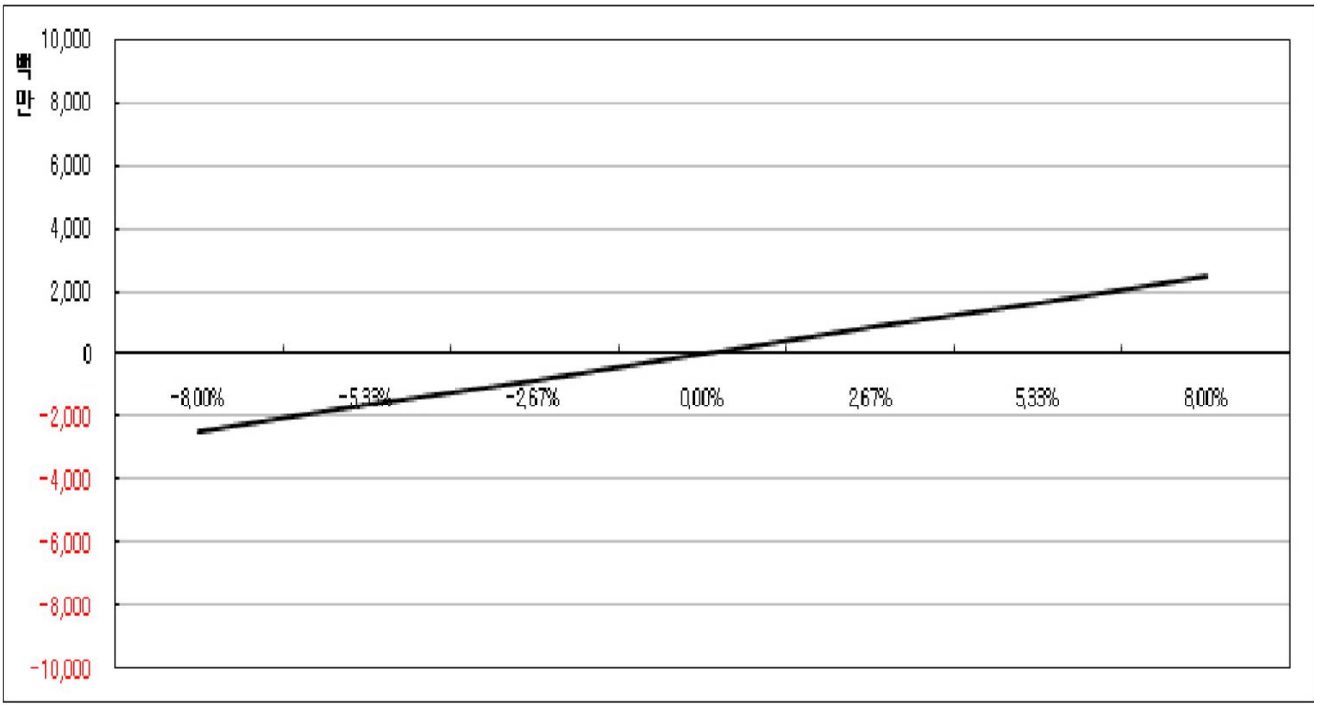
공시일: 2020-01-03

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	436	-436	장내
누계	주가지수	선물	3,412	0	3,412	장내
합계			3,412	0	3,412	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

273

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

822

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

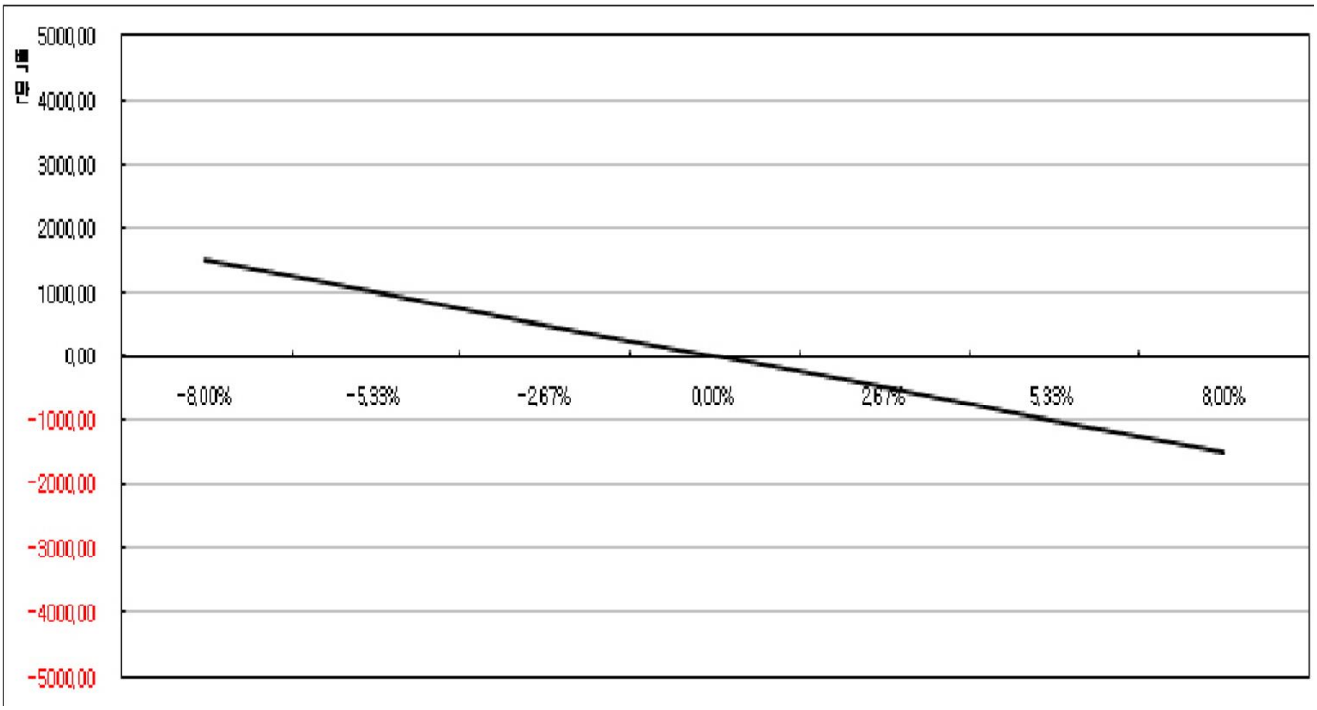
공시일: 2020-01-03

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	218	-218	장내
누계	주가지수	선물	0	2,395	-2,395	장내
합계			0	2,395	-2,395	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

192

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

150

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

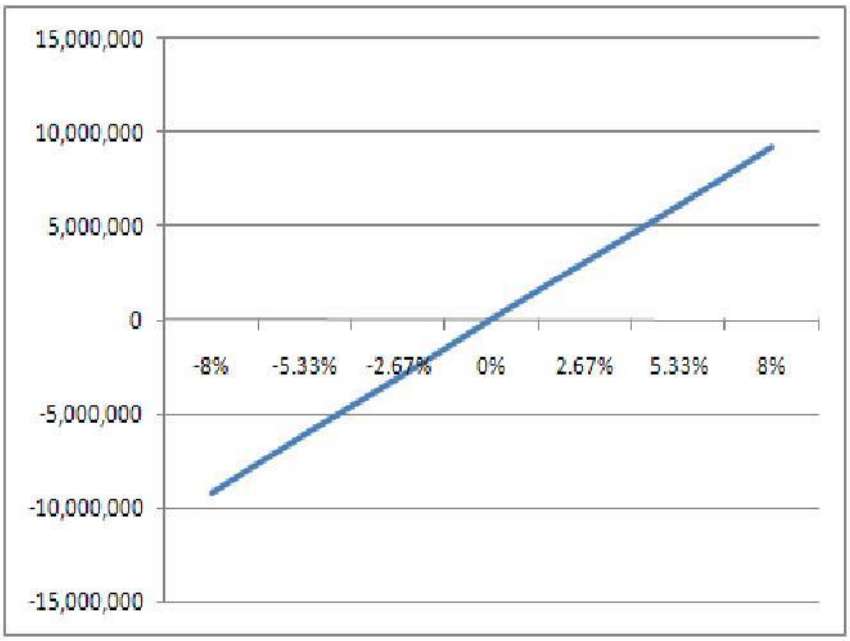
공시일: 2020-01-03

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	1,234	-1,234	장내
누계	주가지수	선물	53,642	0	53,642	장내
합계			53,642	0	53,642	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

4,297

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

7,970