펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2020-01-08

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	1,529	0	1,529	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	0	2,767	-2,767	장내
합계			1,529	2,767	-1,238	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

96

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

66

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

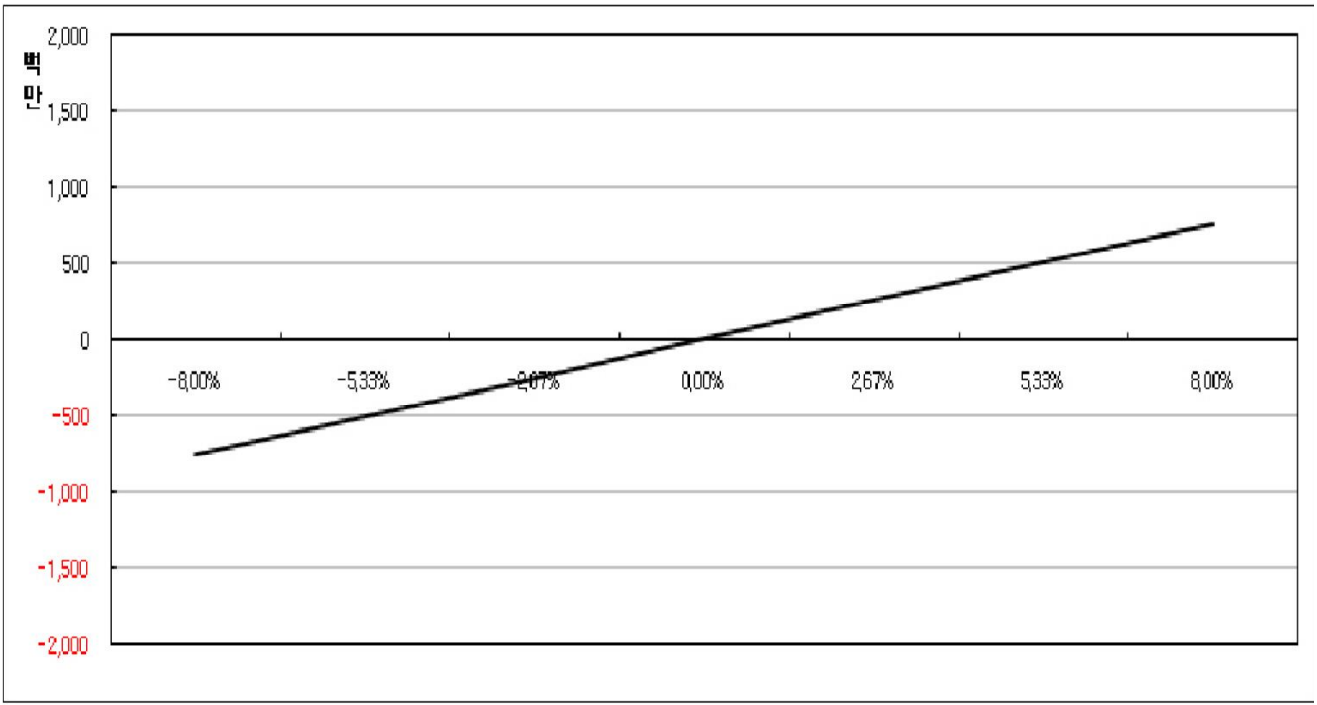
공시일: 2020-01-08

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	291	0	291	장내
합계			291	0	291	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	23

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	342

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

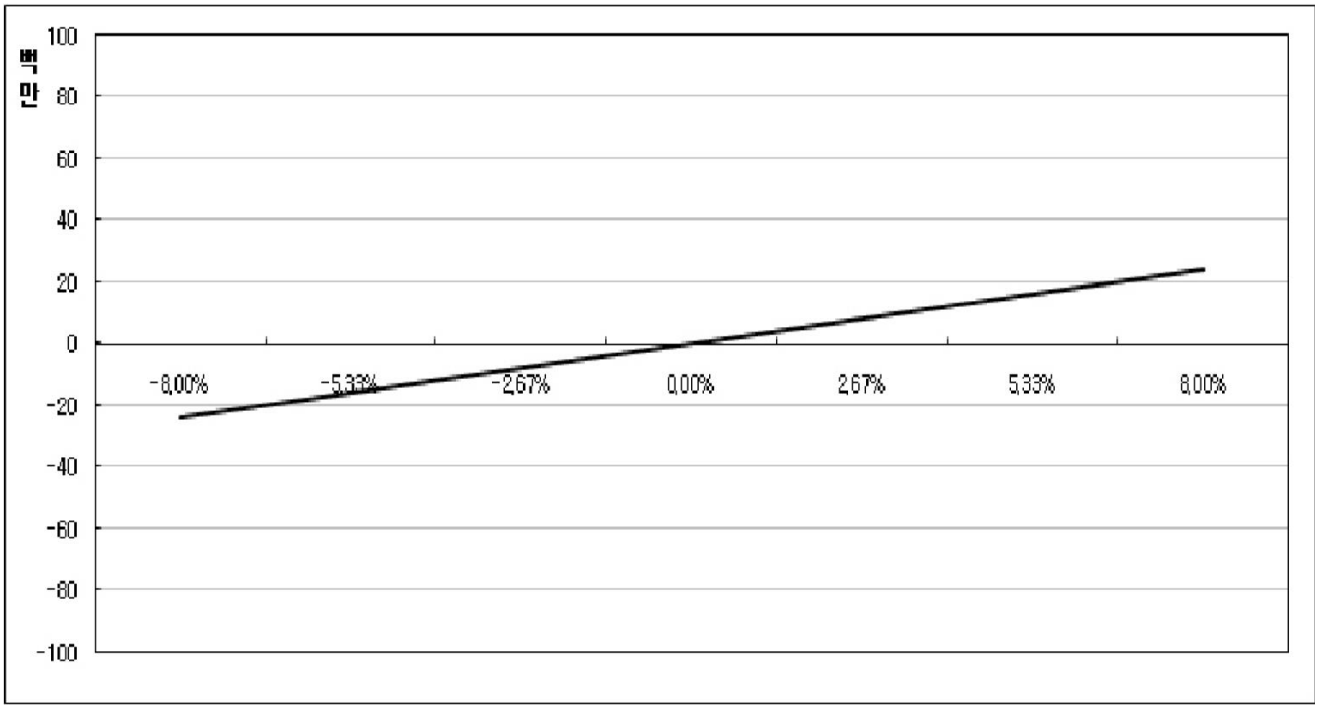
공시일: 2020-01-08

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	1,311	0	1,311	장내
합계			1,311	0	1,311	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

105

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

459

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

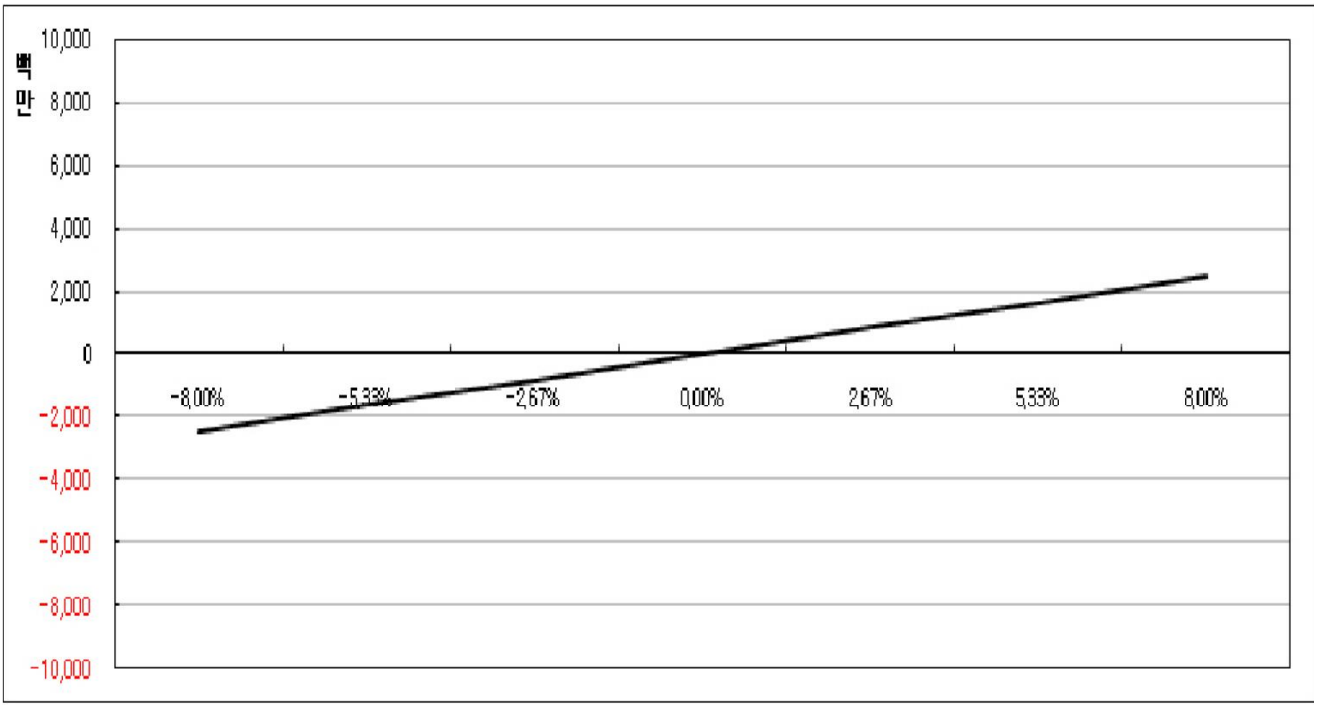
공시일: 2020-01-08

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	3,422	0	3,422	장내
합계			3,422	0	3,422	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

275

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

815

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

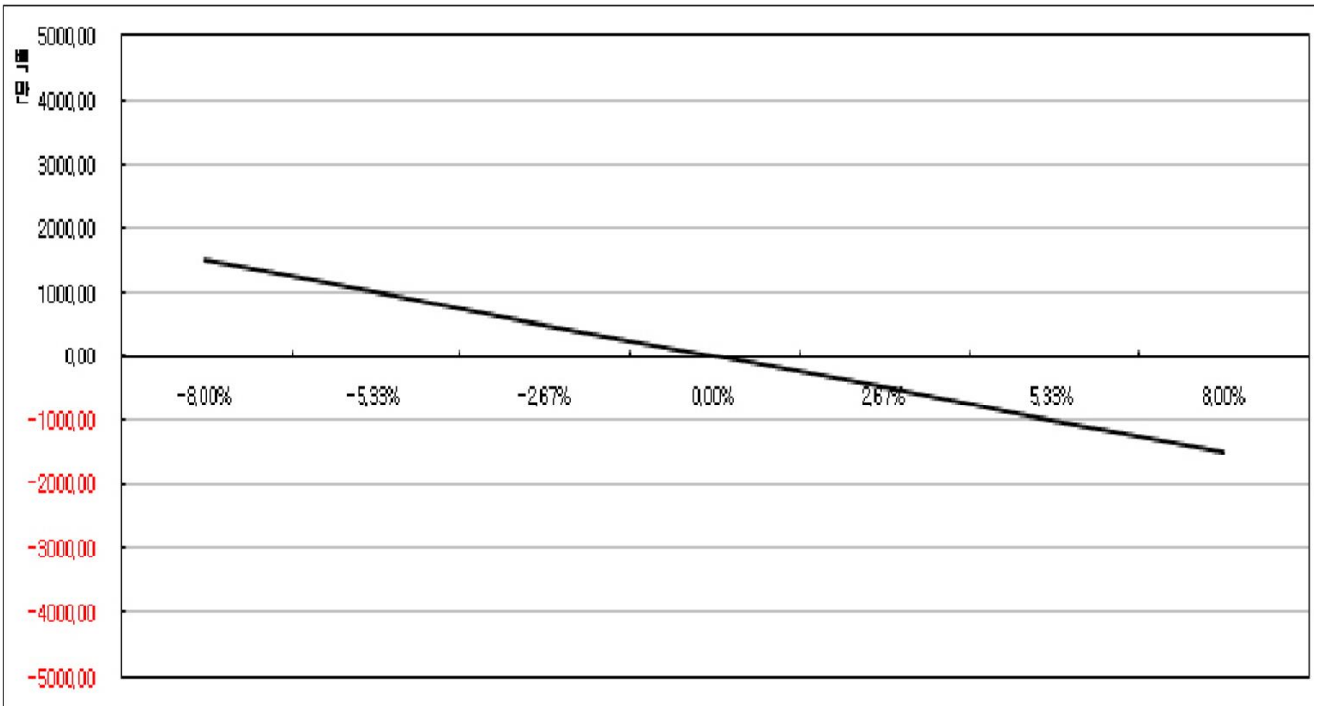
공시일: 2020-01-08

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	73	-73	장내
누계	주가지수	선물	0	2,548	-2,548	장내
합계			0	2,548	-2,548	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

205

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

158

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

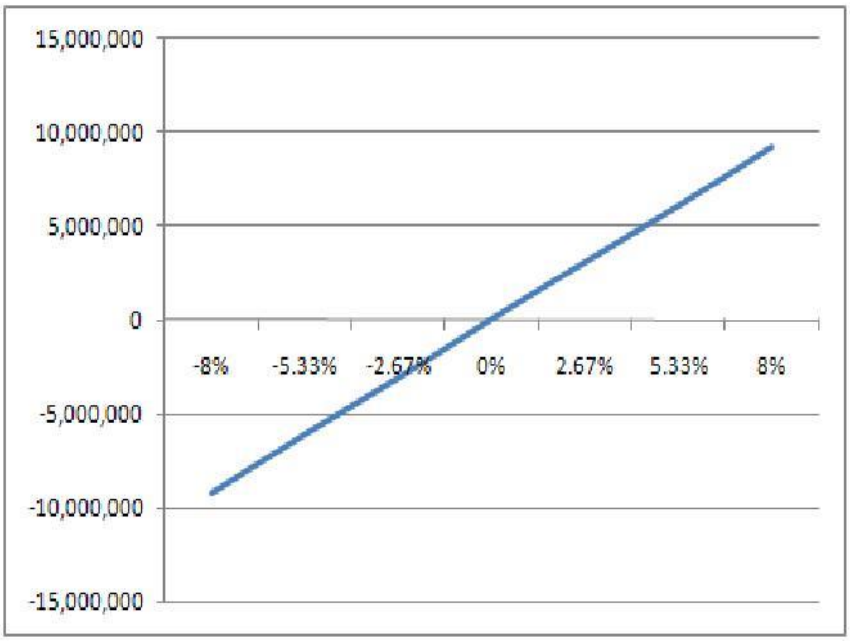
공시일: 2020-01-08

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	1,747	0	1,747	장내
누계	주가지수	선물	55,916	0	55,916	장내
합계			55,916	0	55,916	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

4,491

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

7,956