펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2020-01-14

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	1,576	0	1,576	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	2	2,701	-2,699	장내
합계			1,578	2,701	-1,123	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

76

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

749

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

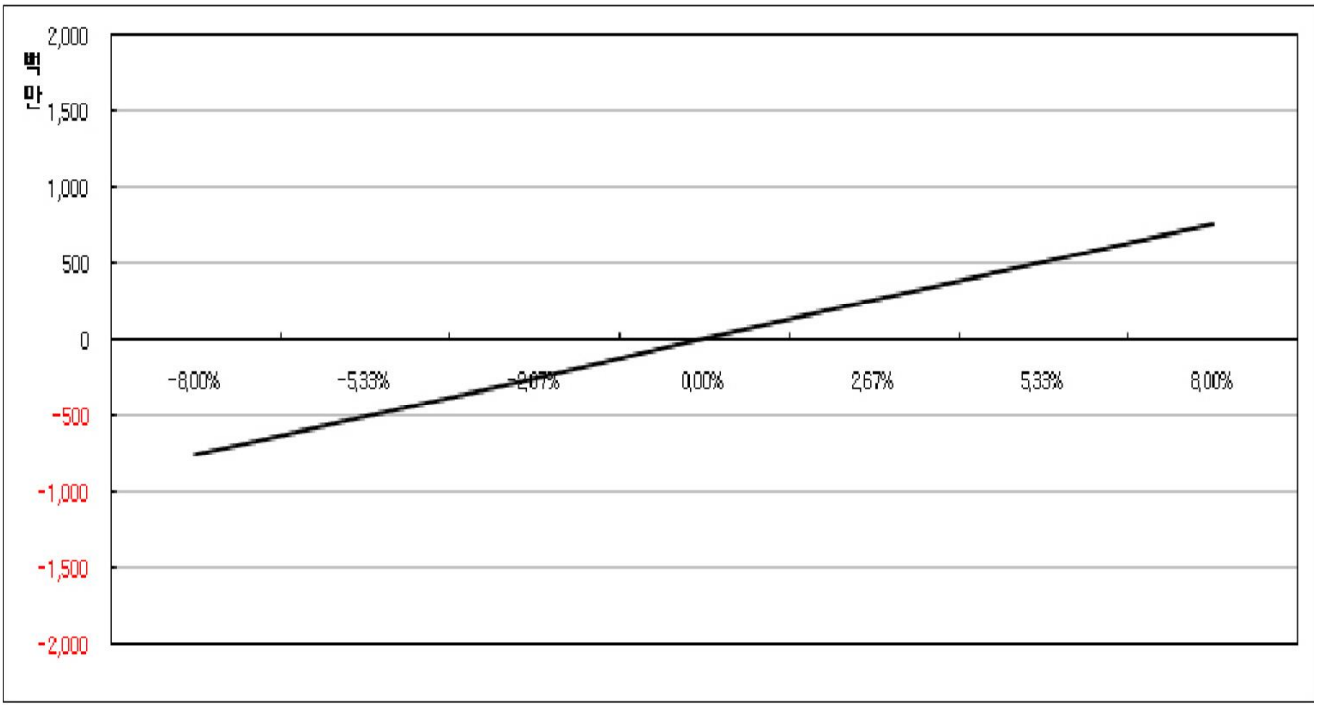
공시일: 2020-01-14

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	300	0	300	장내
합계			300	0	300	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

24

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

362

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

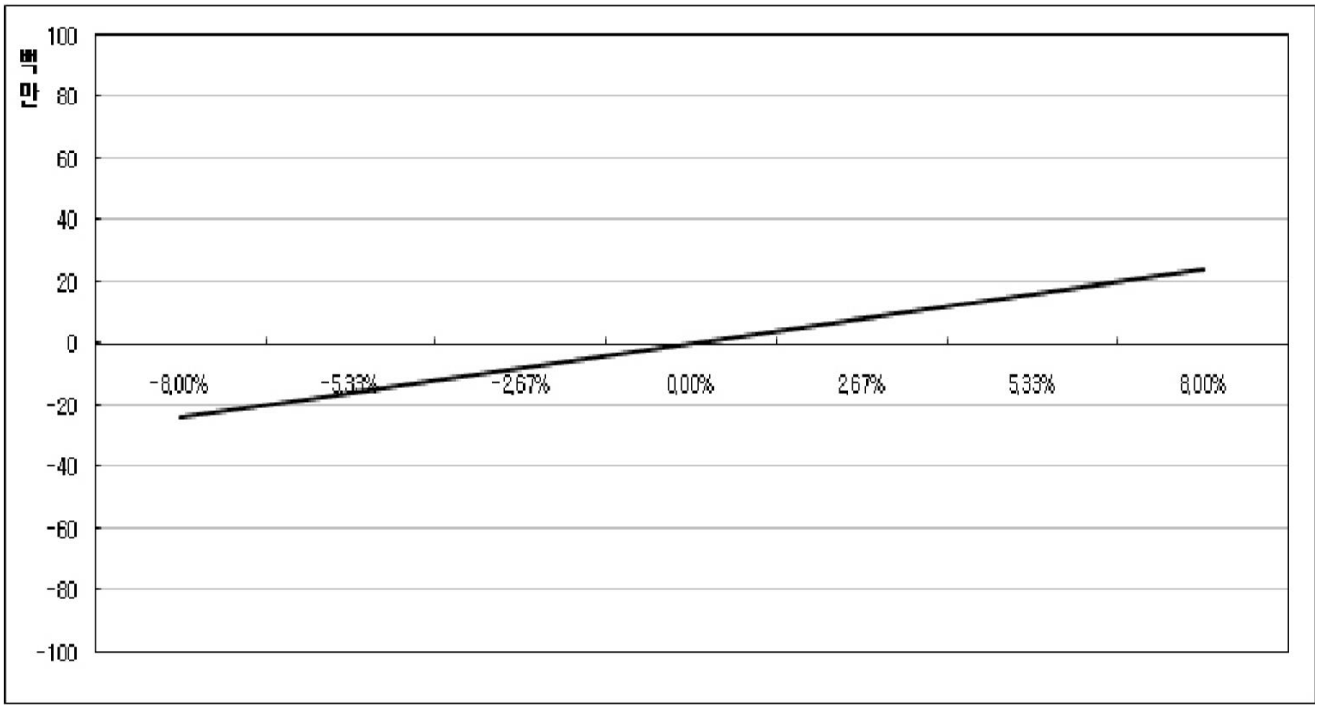
공시일: 2020-01-14

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	1,351	0	1,351	장내
합계			1,351	0	1,351	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

108

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

486

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

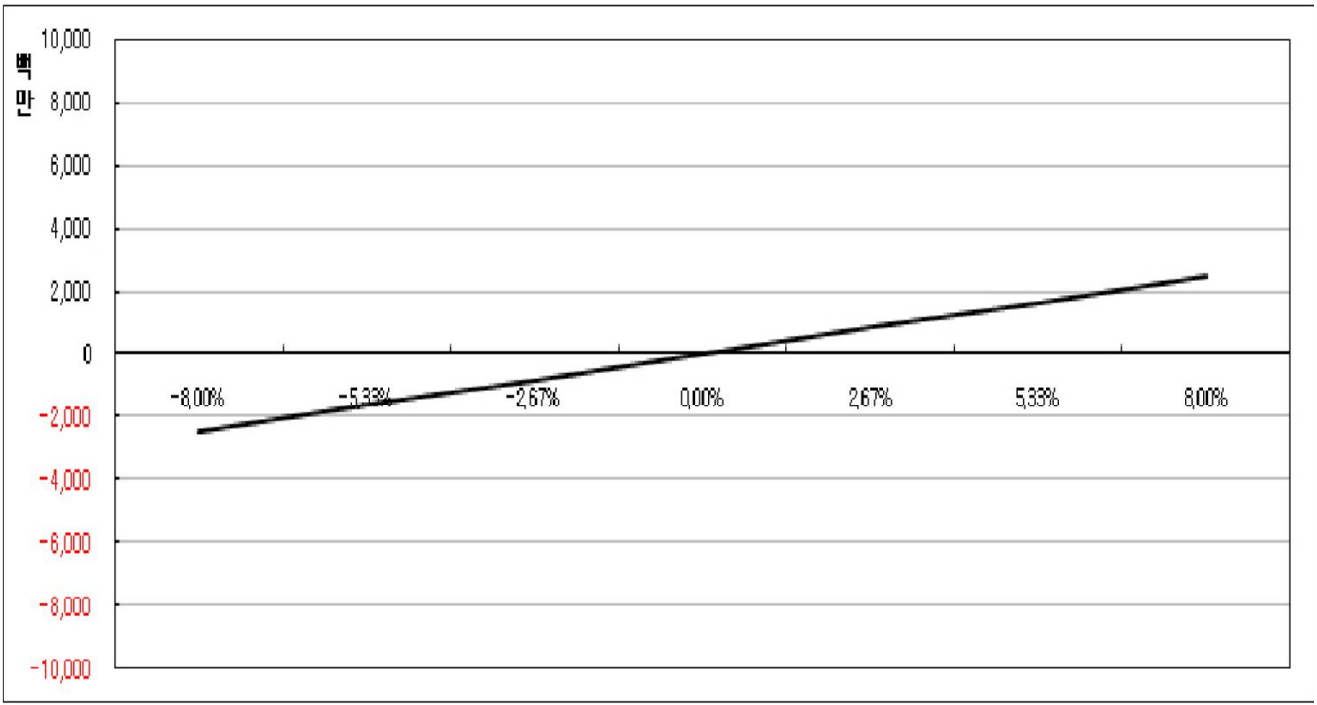
공시일: 2020-01-14

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	300	-300	장내
누계	주가지수	선물	3,226	0	3,226	장내
합계			3,226	0	3,226	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

259

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

849

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

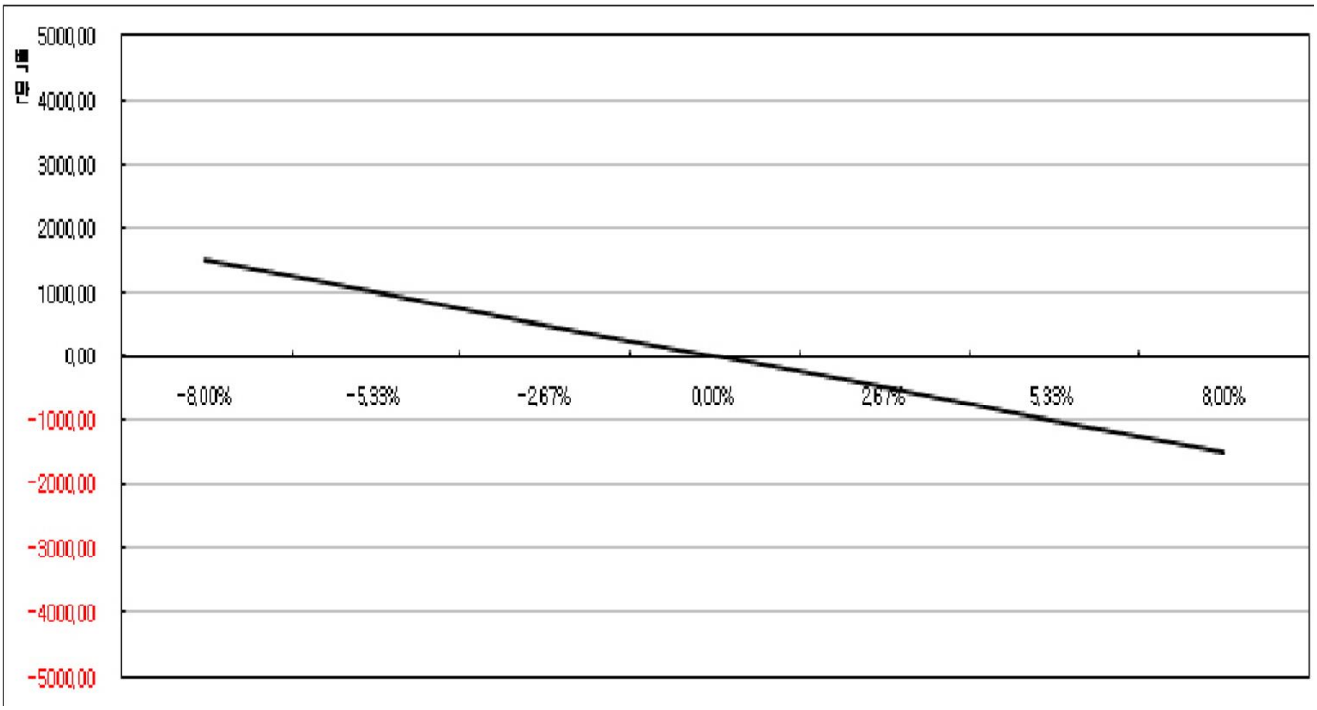
공시일: 2020-01-14

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	75	0	75	장내
누계	주가지수	선물	0	2,401	-2,401	장내
합계			0	2,401	-2,401	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

192

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

149

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

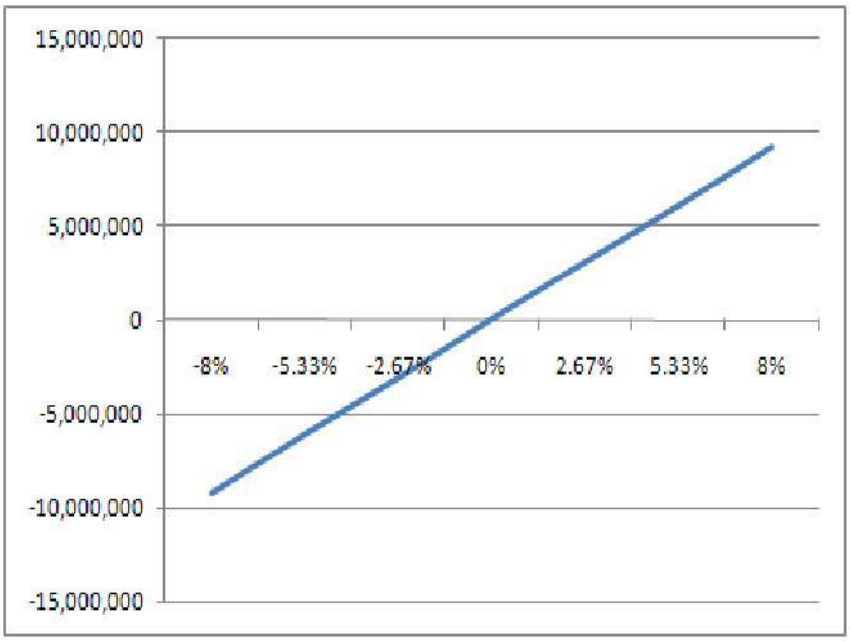
공시일: 2020-01-14

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	58,600	0	58,600	장내
합계			58,600	0	58,600	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

4,696

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

8,212