펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2020-01-15

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	1,508	0	1,508	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	2	2,714	-2,712	장내
합계			1,509	2,714	-1,204	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	85

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	820

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

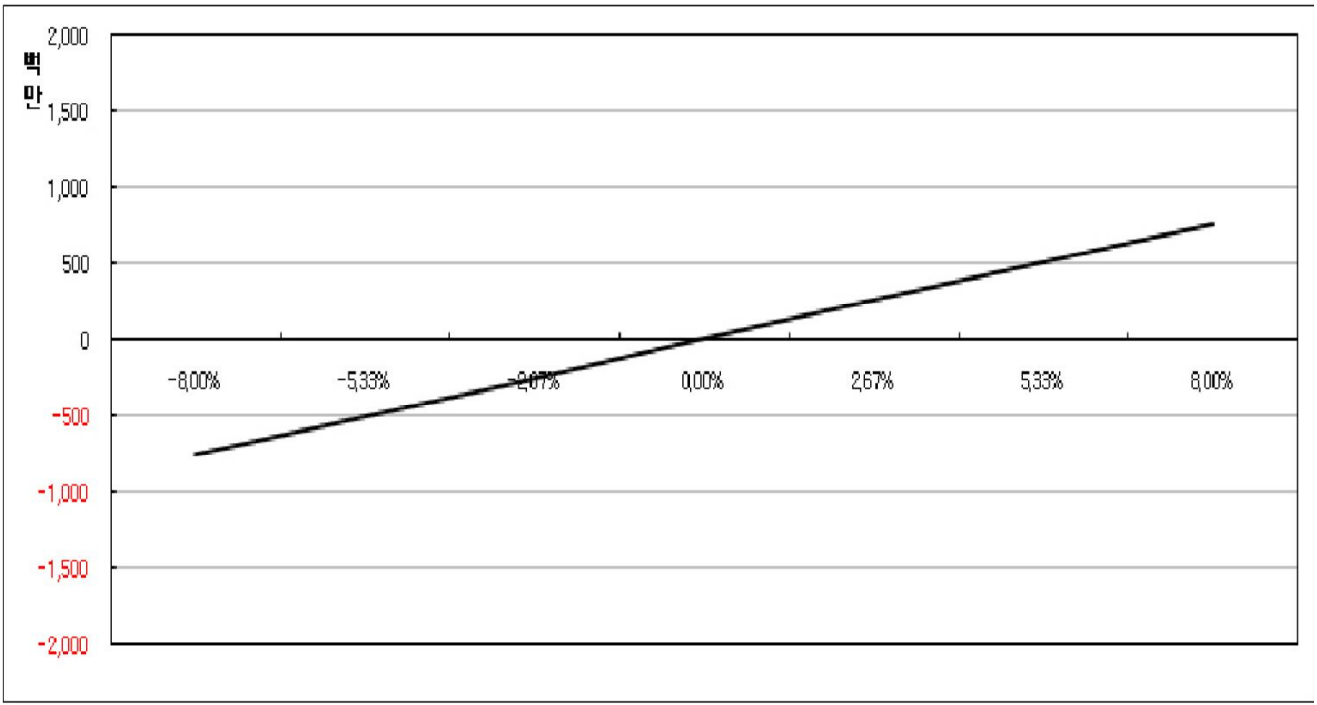
공시일: 2020-01-15

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	302	0	302	장내
합계			302	0	302	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	24

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	364

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

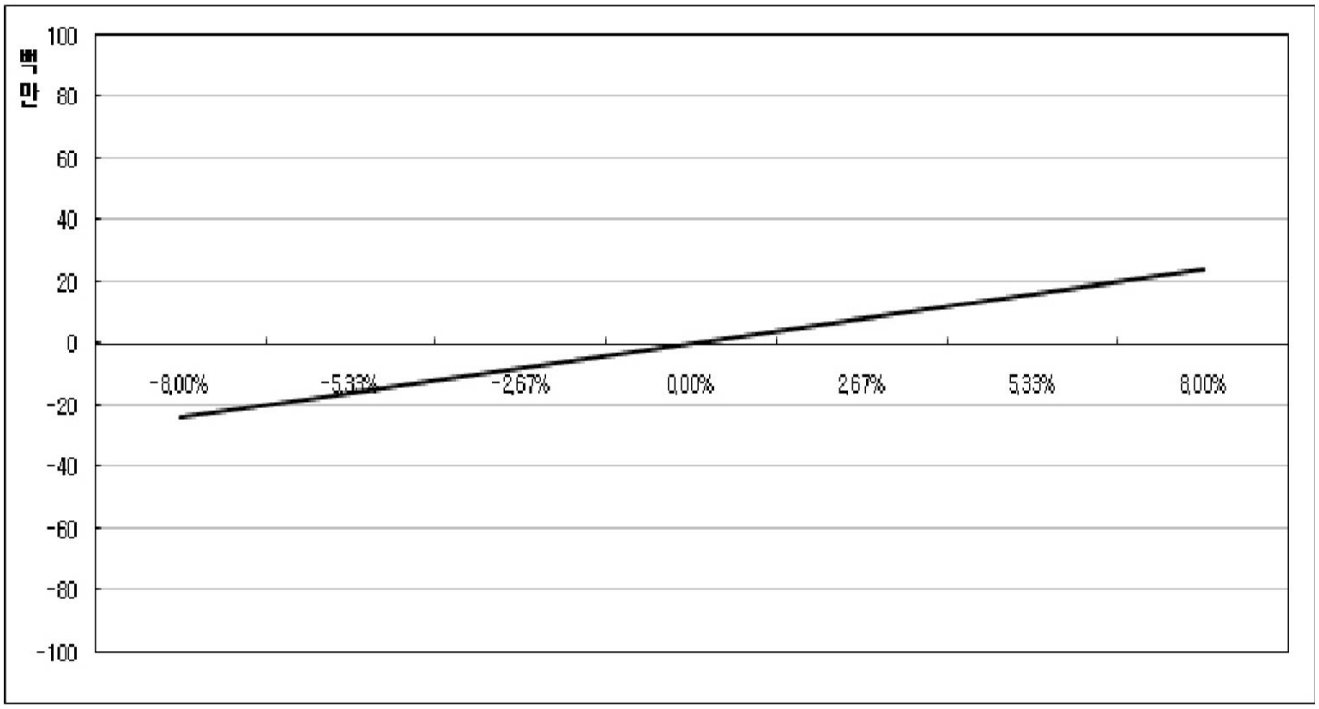
공시일: 2020-01-15

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	1,357	0	1,357	장내
합계			1,357	0	1,357	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

109

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

489

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

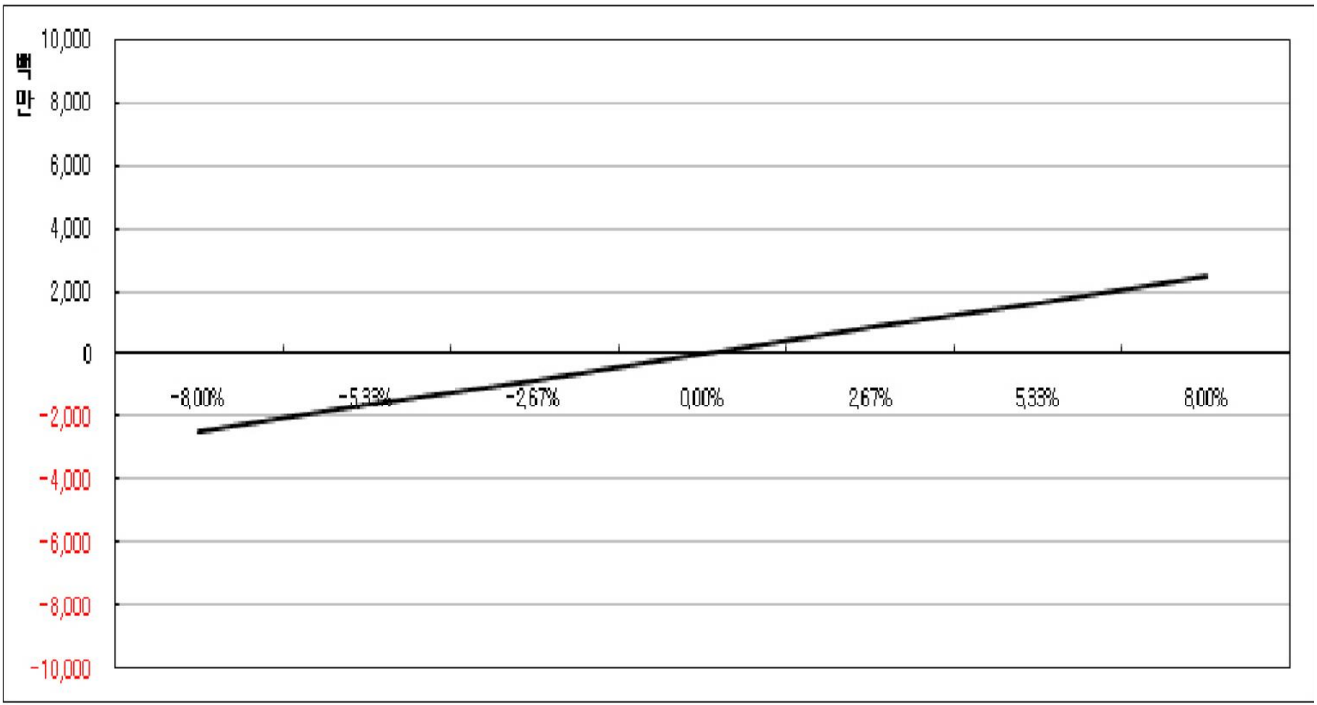
공시일: 2020-01-15

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	151	-151	장내
누계	주가지수	선물	3,091	0	3,091	장내
합계			3,091	0	3,091	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

248

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

848

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

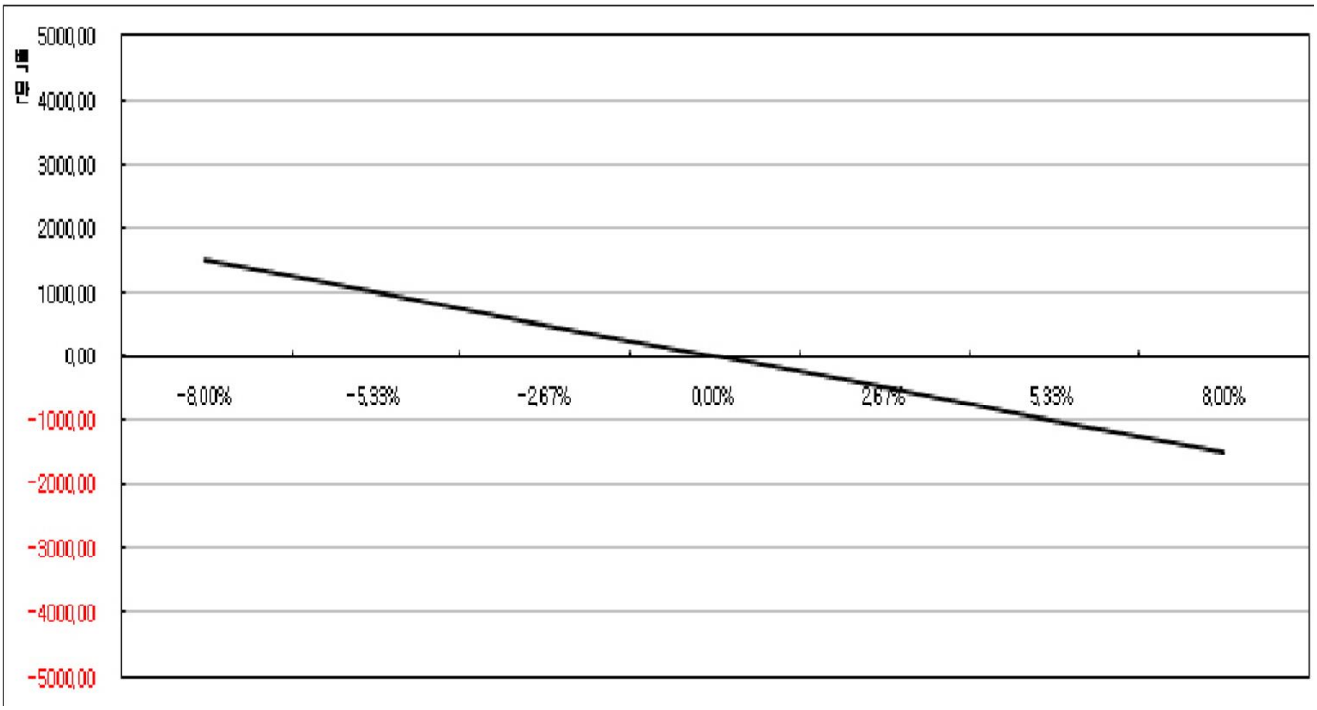
공시일: 2020-01-15

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	2,337	-2,337	장내
합계			0	2,337	-2,337	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

187

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

144

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

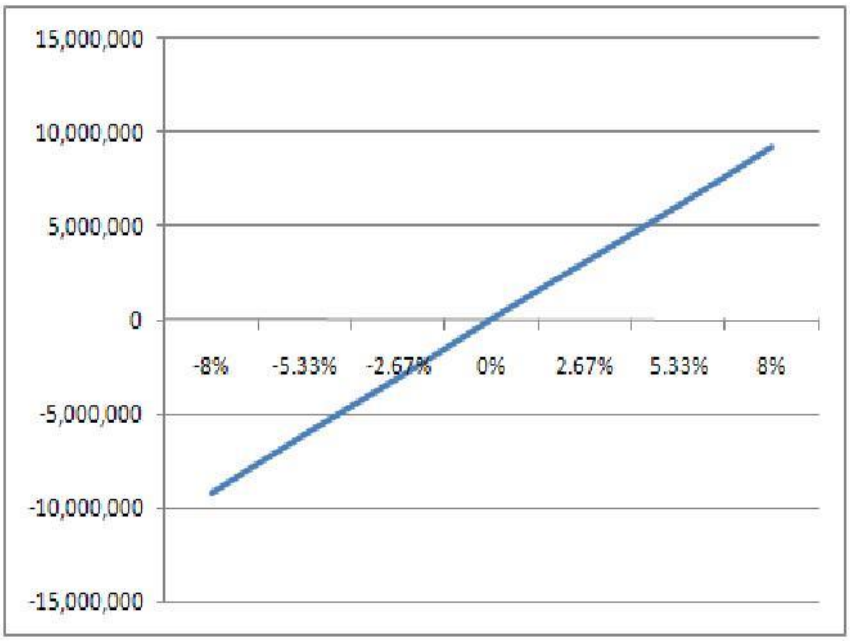
공시일: 2020-01-15

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	58,874	0	58,874	장내
합계			58,874	0	58,874	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

4,717

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

8,069