펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2020-01-16

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	899	899	0	장내
누계	주가지수	선물	1,499	0	1,499	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	2	2,698	-2,696	장내
합계			1,501	2,698	-1,197	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

82

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

655

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

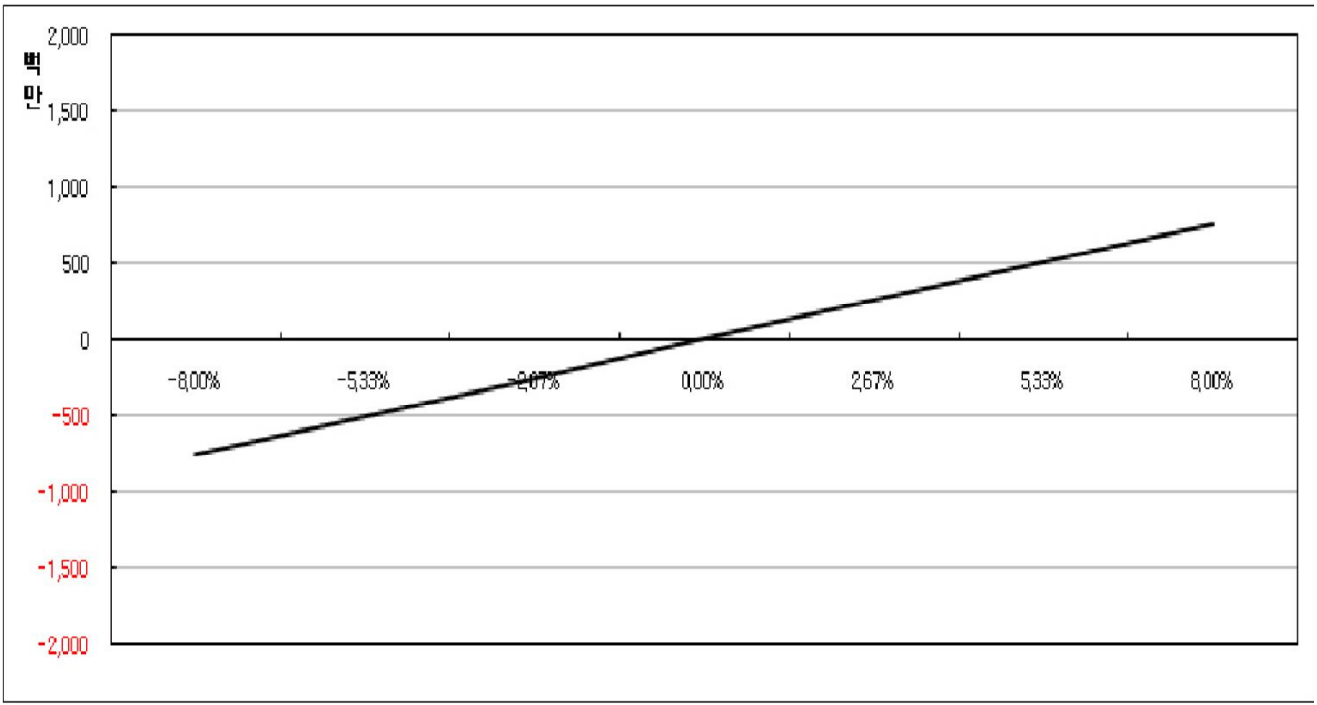
공시일: 2020-01-16

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)

361

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

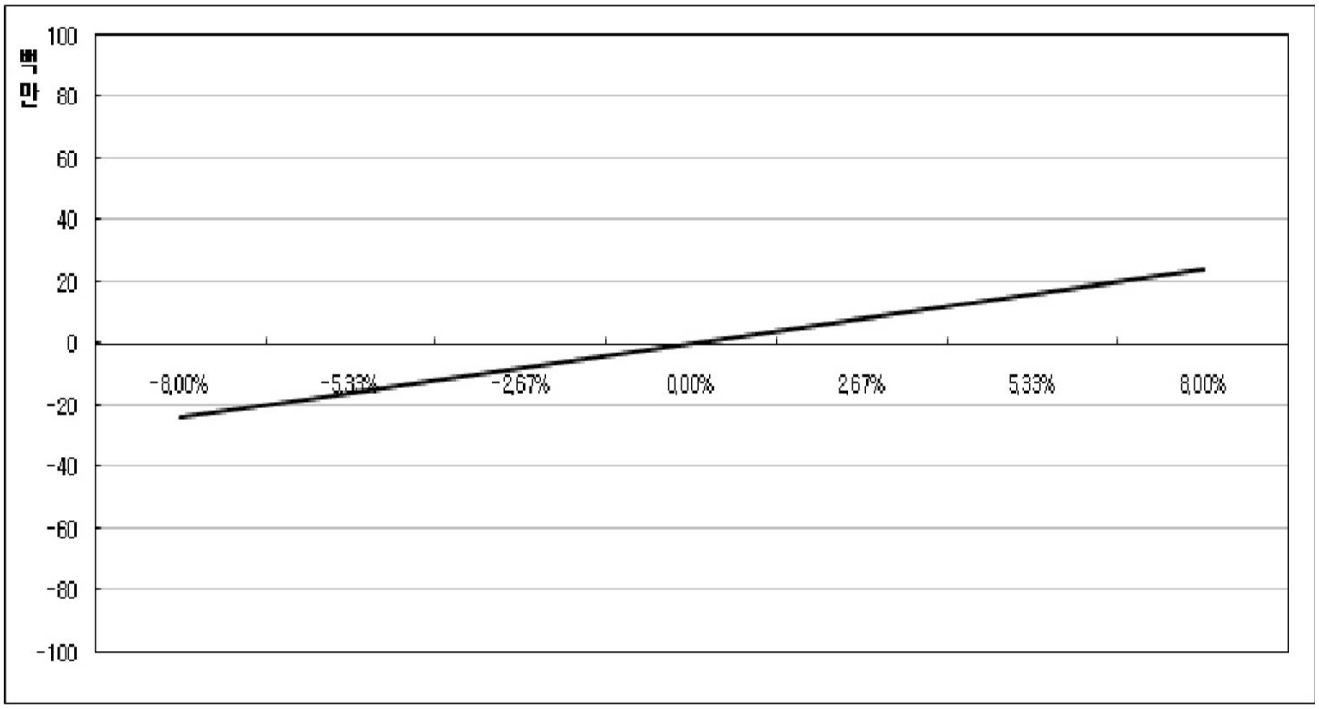
공시일: 2020-01-16

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	1,349	0	1,349	장내
합계			1,349	0	1,349	

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]

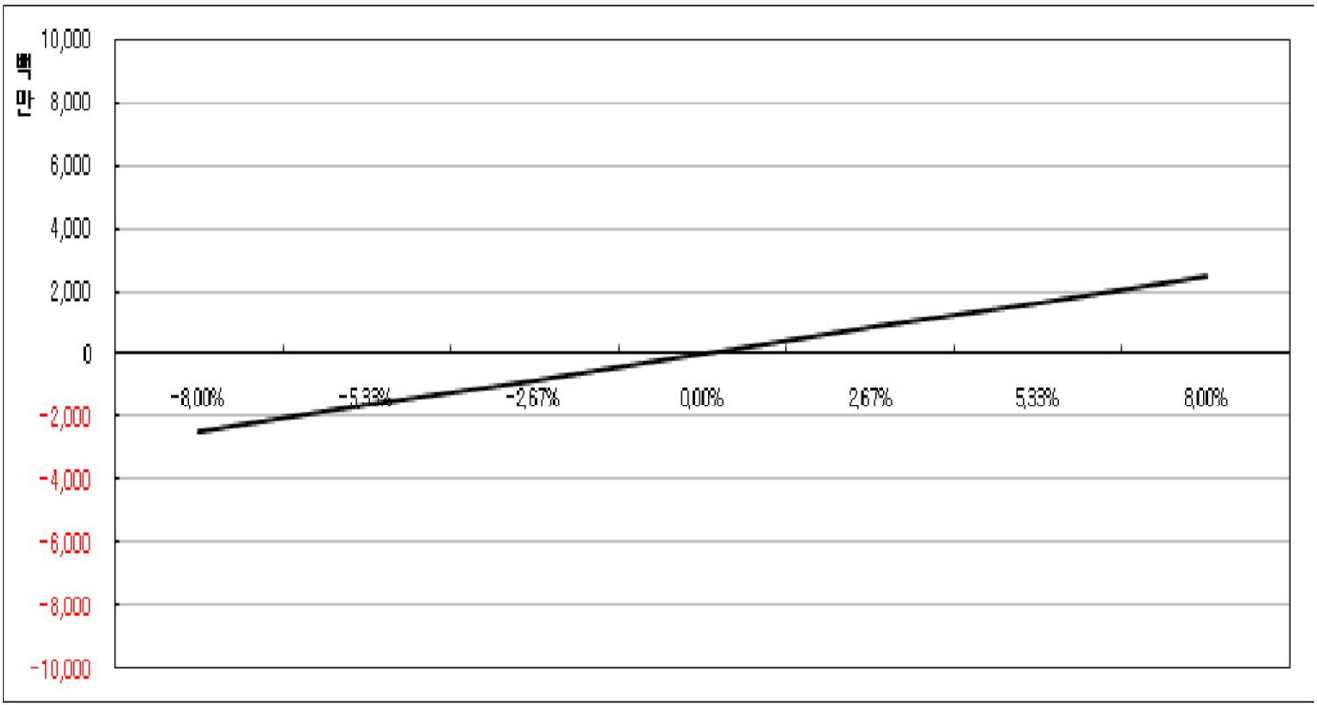
공시일: 2020-01-16

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	150	150	0	장내
누계	주가지수	선물	3,072	0	3,072	장내
합계			3,072	0	3,072	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

246

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

842

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

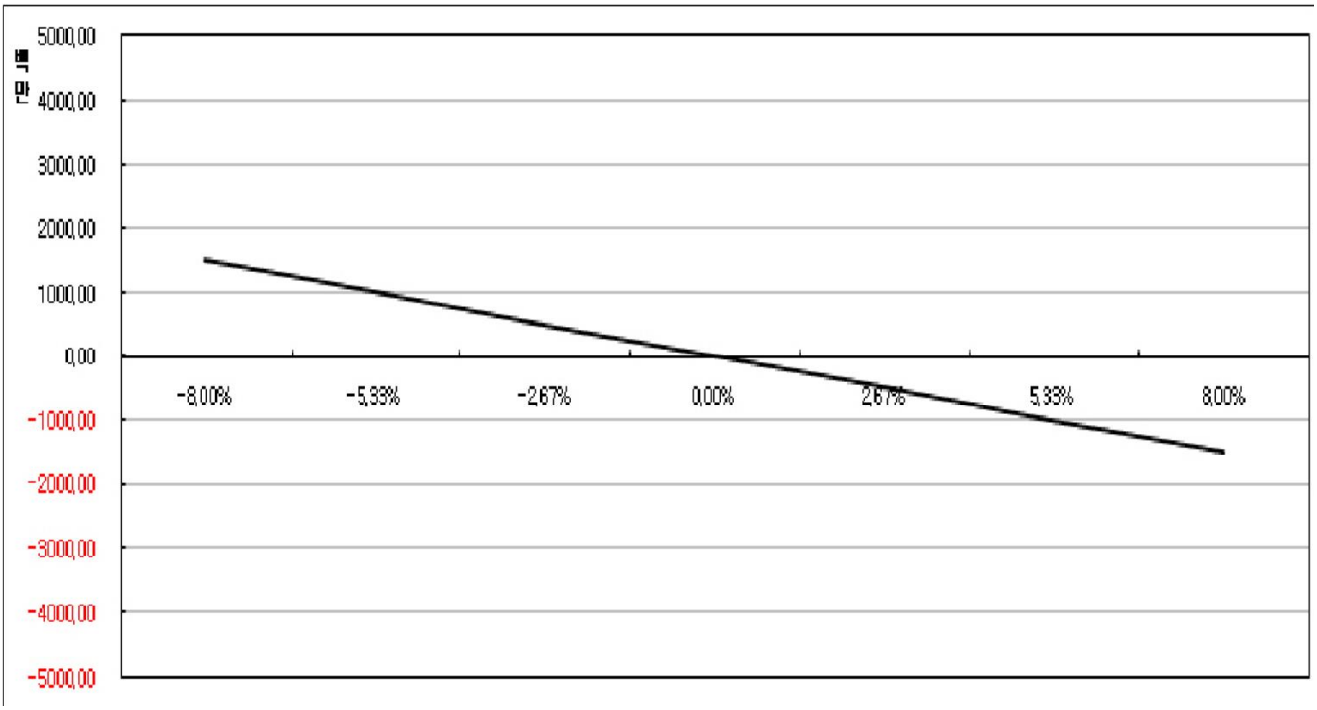
공시일: 2020-01-16

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	2,248	-2,248	장내
합계			0	2,248	-2,248	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

180

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

139

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

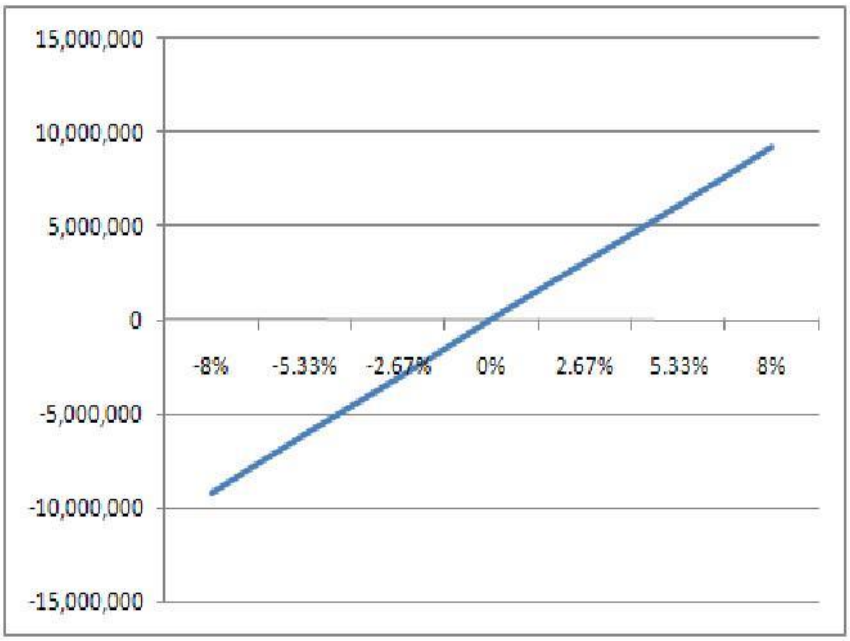
공시일: 2020-01-16

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	58,524	0	58,524	장내
합계			58,524	0	58,524	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

4,689

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

7,743