펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2020-01-28

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	76	-76	장내
누계	주가지수	선물	1,436	0	1,436	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	2	2,721	-2,719	장내
합계			1,438	2,721	-1,283	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

92

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

606

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

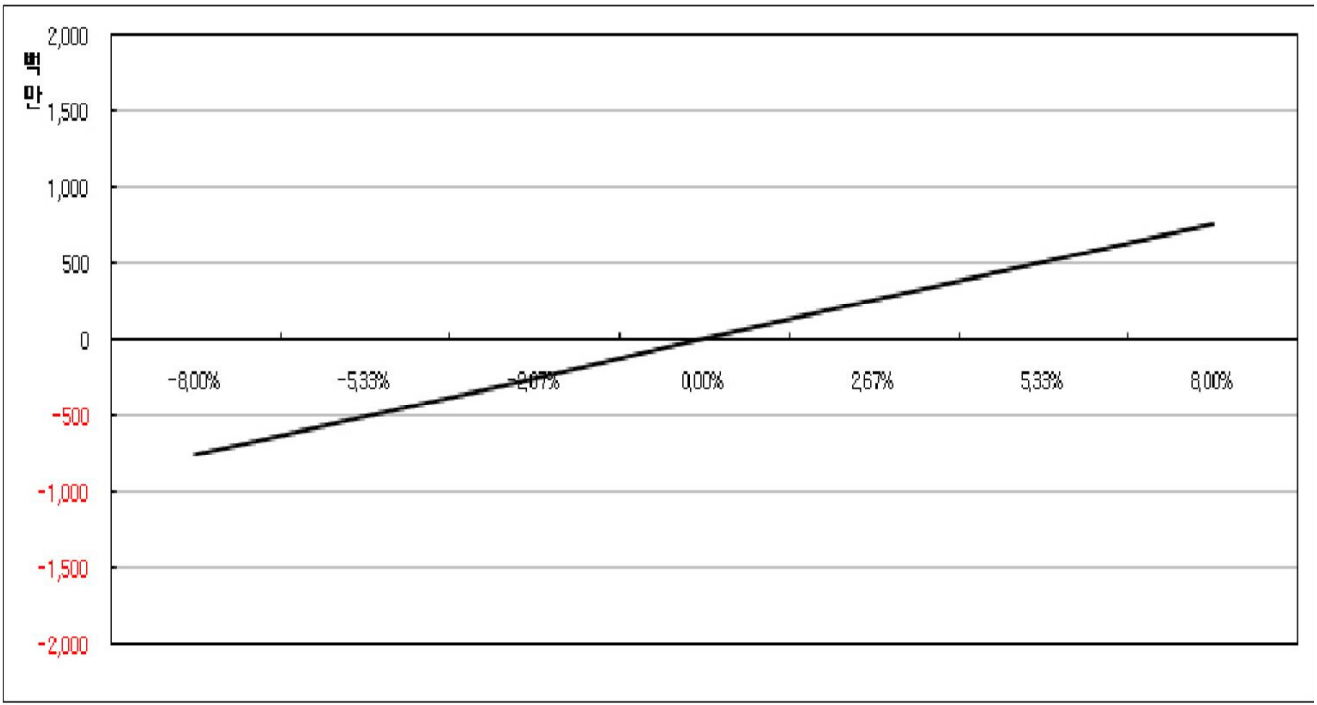
공시일: 2020-01-28

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)

367

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

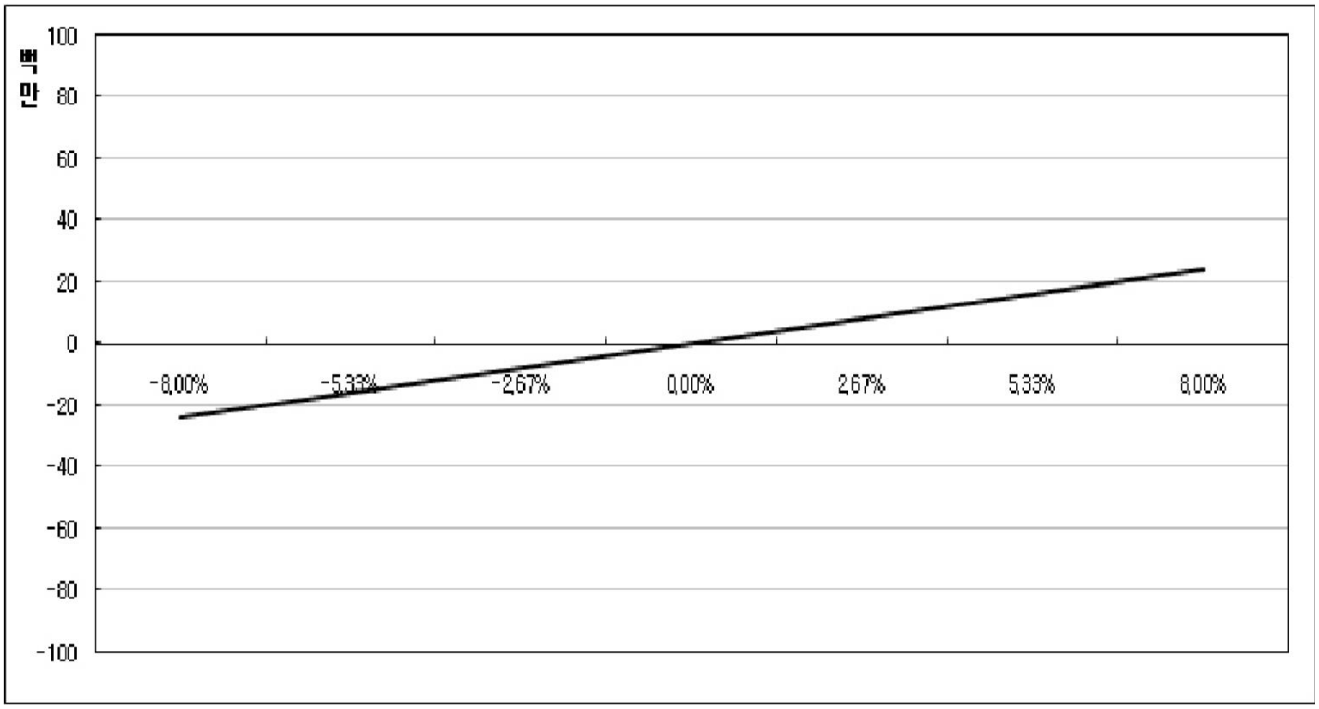
공시일: 2020-01-28

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	151	0	151	장내
누계	주가지수	선물	1,360	0	1,360	장내
합계			1,360	0	1,360	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

109

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

493

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

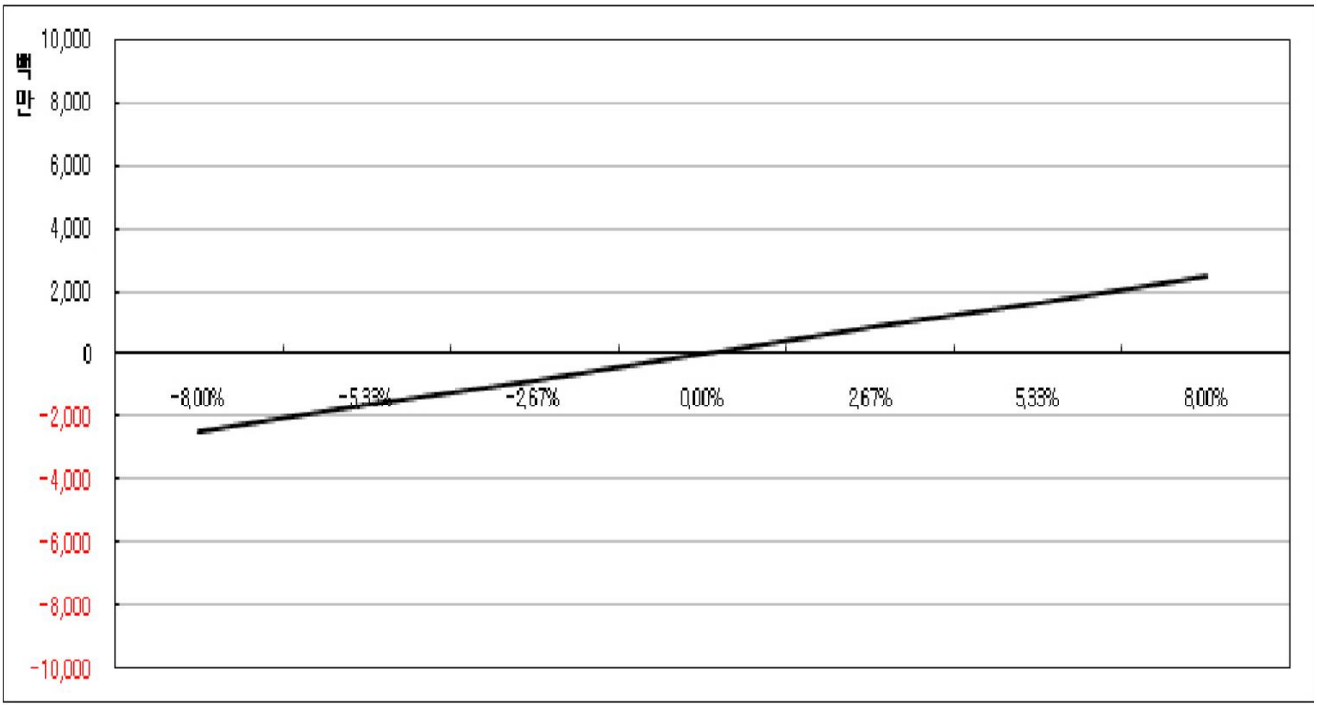
공시일: 2020-01-28

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	3,099	0	3,099	장내
합계			3,099	0	3,099	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

248

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

855

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

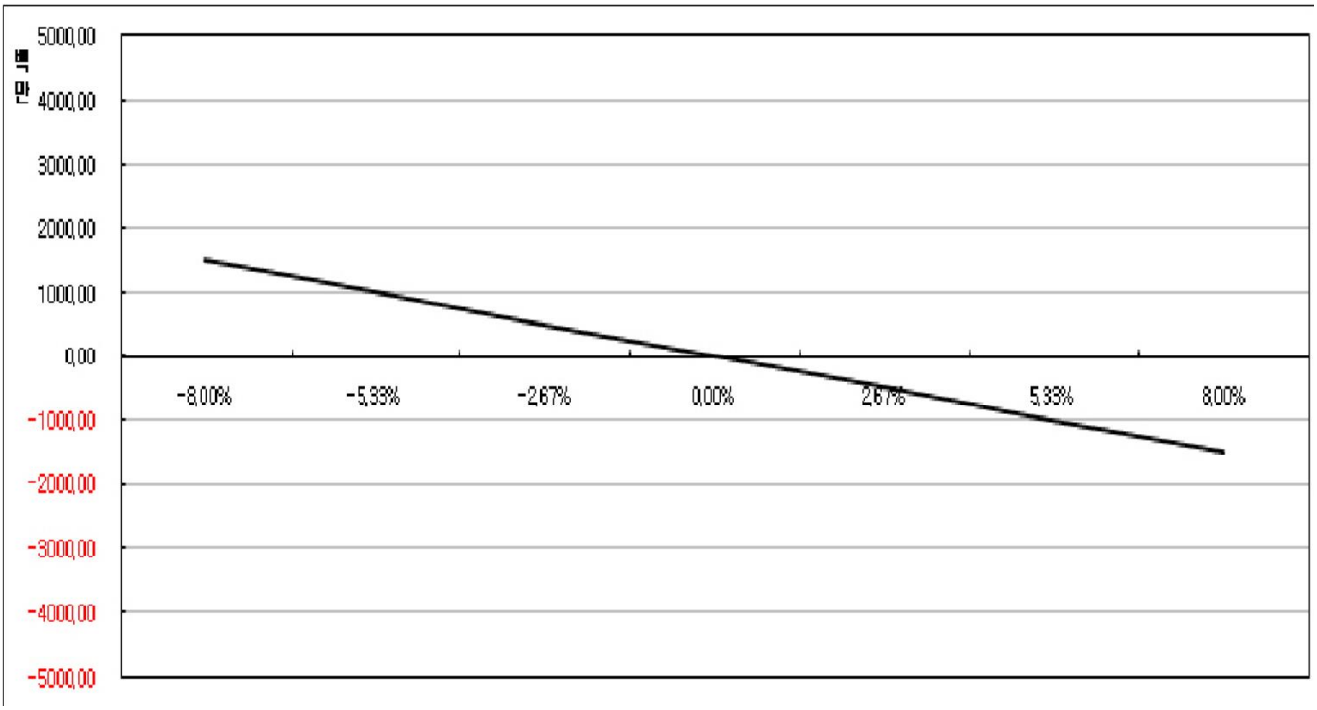
공시일: 2020-01-28

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	151	0	151	장내
누계	주가지수	선물	0	2,343	-2,343	장내
합계			0	2,343	-2,343	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

188

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

146

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

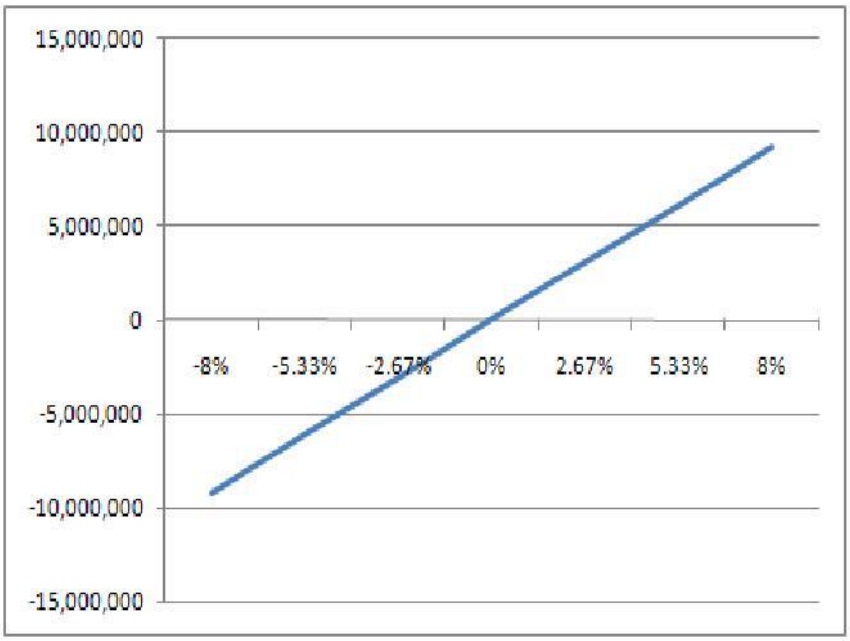
공시일: 2020-01-28

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	907	0	907	장내
누계	주가지수	선물	59,559	0	59,559	장내
합계			59,559	0	59,559	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

4,773

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

7,648