펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2020-01-31

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	1,442	0	1,442	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	11	2,595	-2,584	장내
합계			1,453	2,595	-1,142	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

45

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

91

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

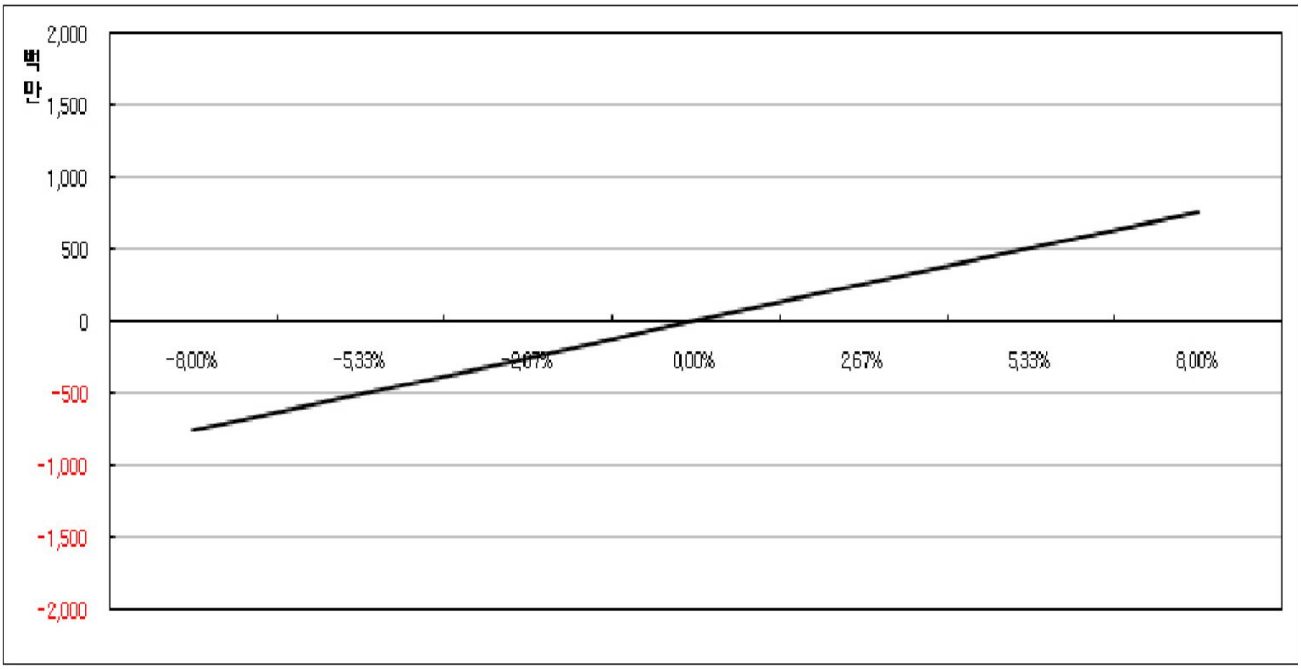
공시일: 2020-01-31

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	144	0	144	장내
누계	주가지수	선물	433	0	433	장내
합계			433	0	433	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

35

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

365

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

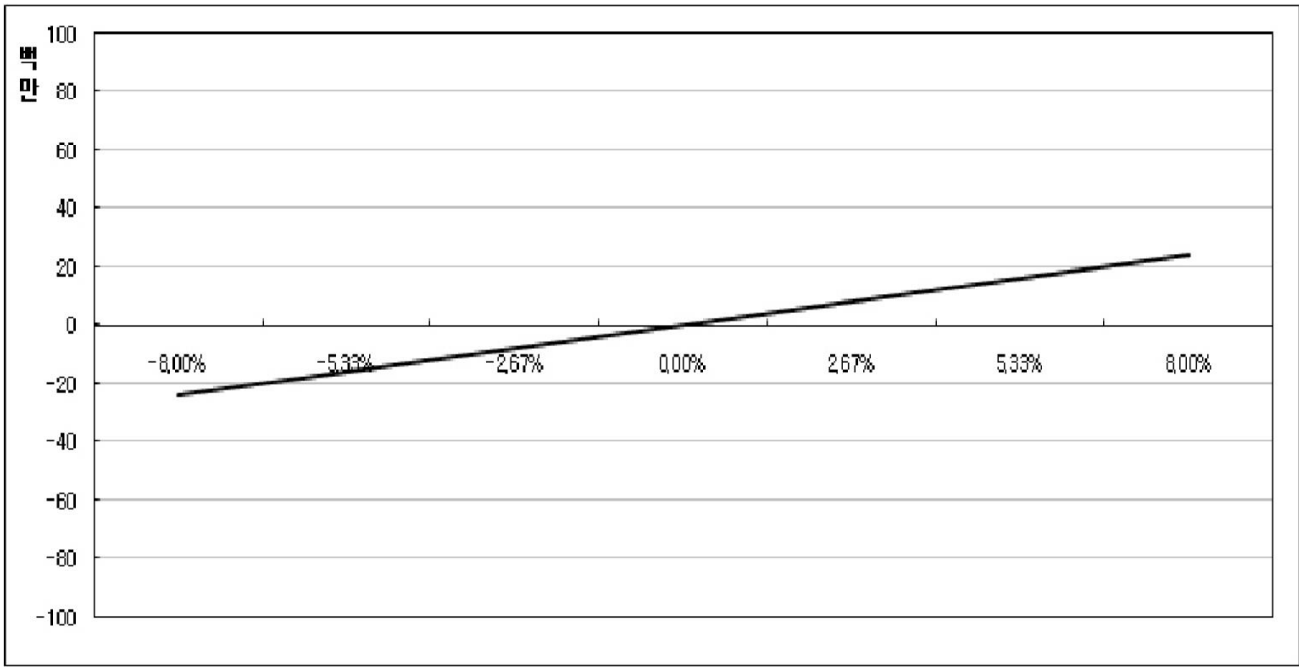
공시일: 2020-01-31

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	1,298	0	1,298	장내
합계			1,298	0	1,298	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

104

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

485

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

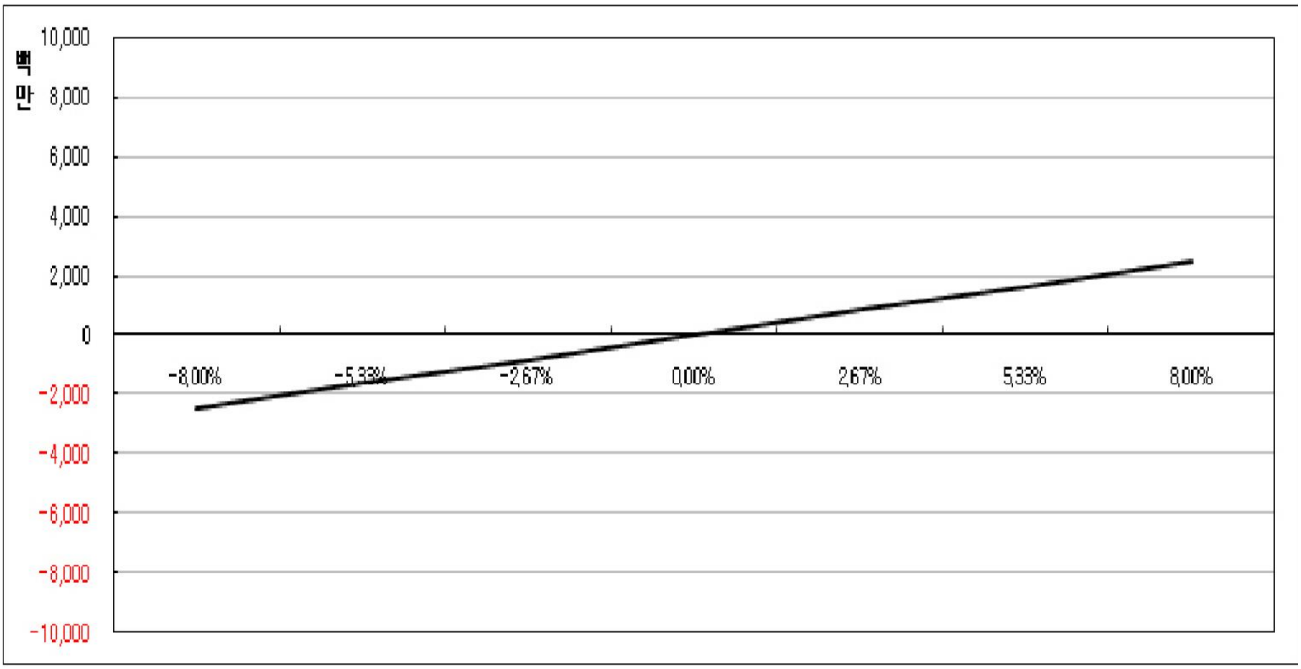
공시일: 2020-01-31

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	144	288	-144	장내
누계	주가지수	선물	3,028	0	3,028	장내
합계			3,028	0	3,028	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

242

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

844

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

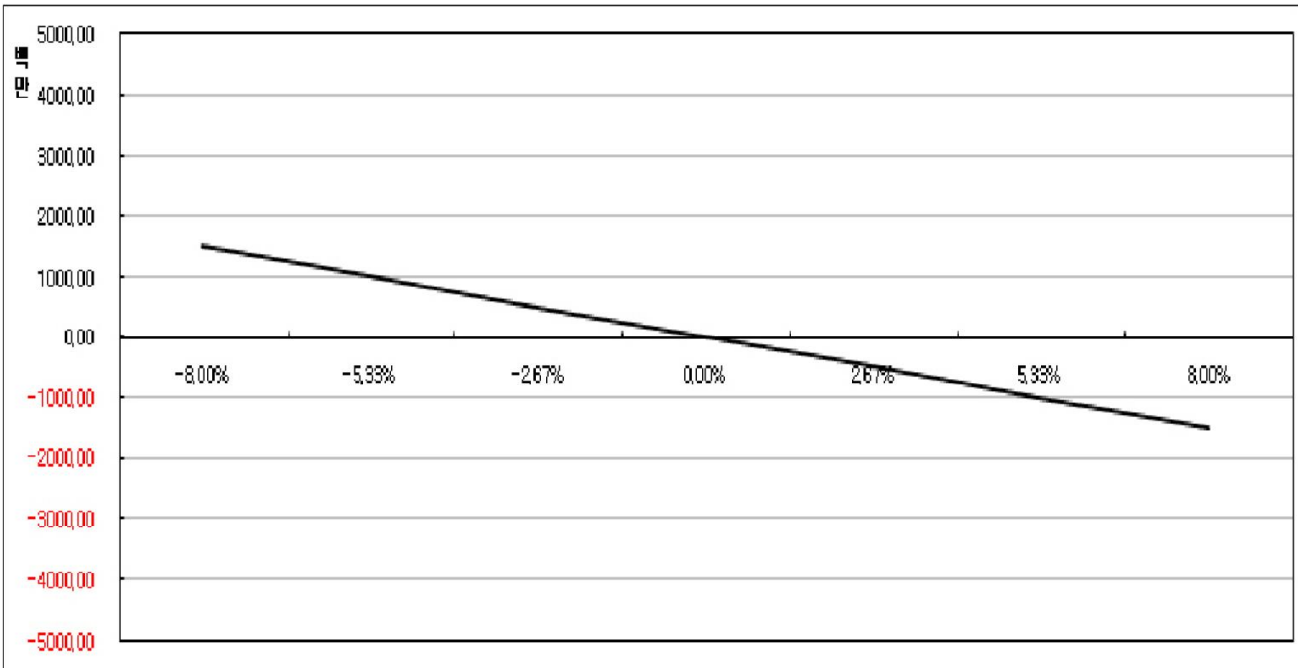
공시일: 2020-01-31

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	0	2,235	-2,235	장내
합계			0	2,235	-2,235	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

179

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

144

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

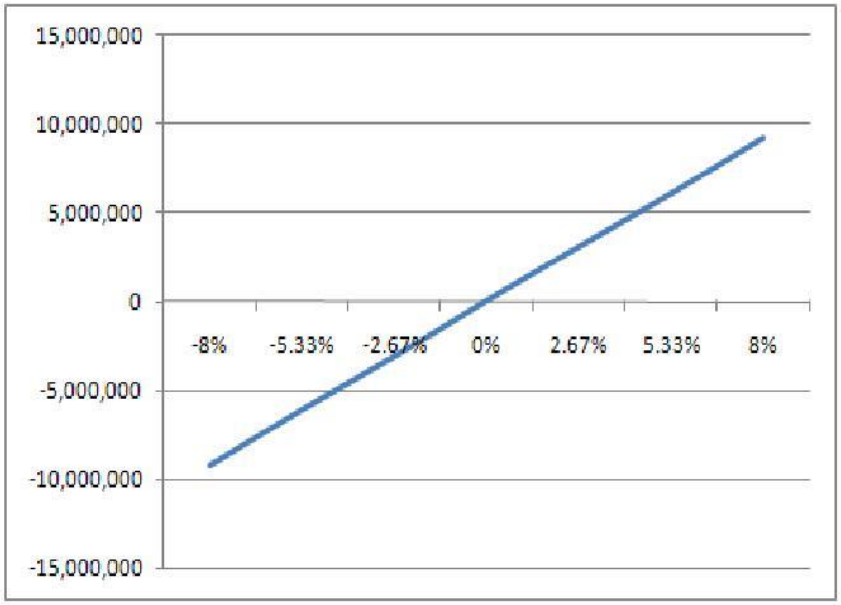
공시일: 2020-01-31

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	288	0	288	장내
누계	주가지수	선물	58,395	0	58,395	장내
합계			58,395	0	58,395	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

4,666

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

7,644