펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2020-02-04

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	1,425	0	1,425	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	15	2,565	-2,550	장내
합계			1,441	2,565	-1,125	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	37

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	113

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

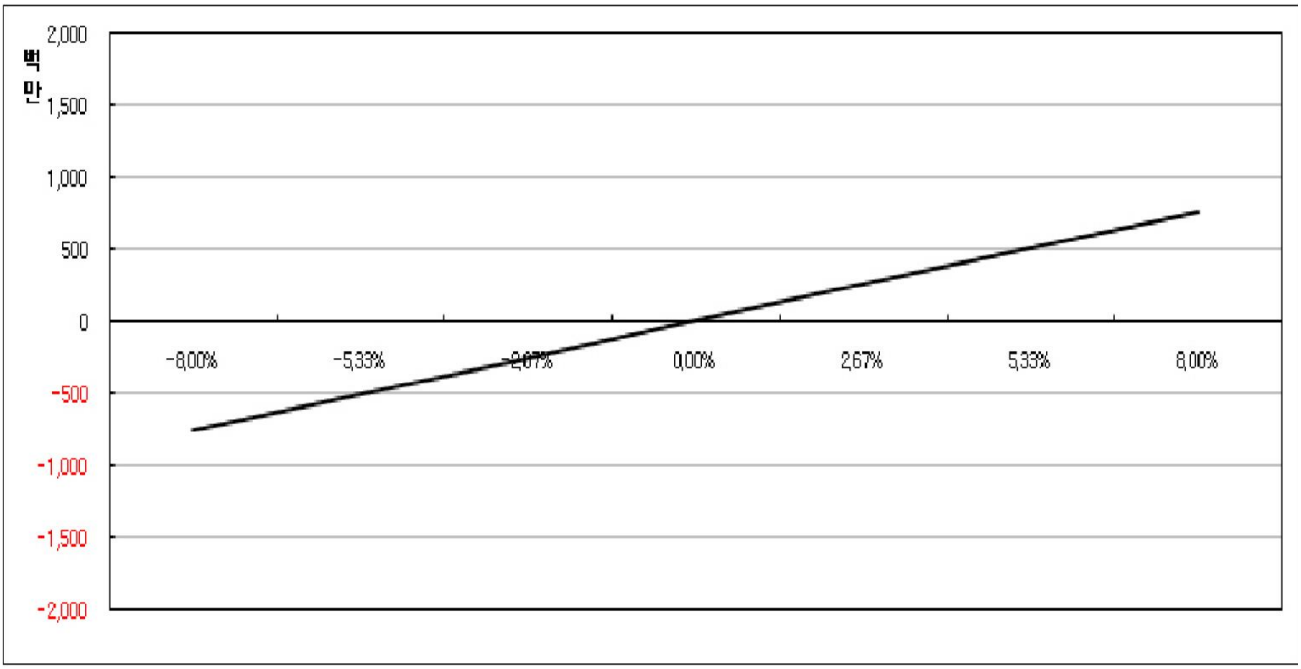
공시일: 2020-02-04

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	428	0	428	장내
합계			428	0	428	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

34

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

365

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

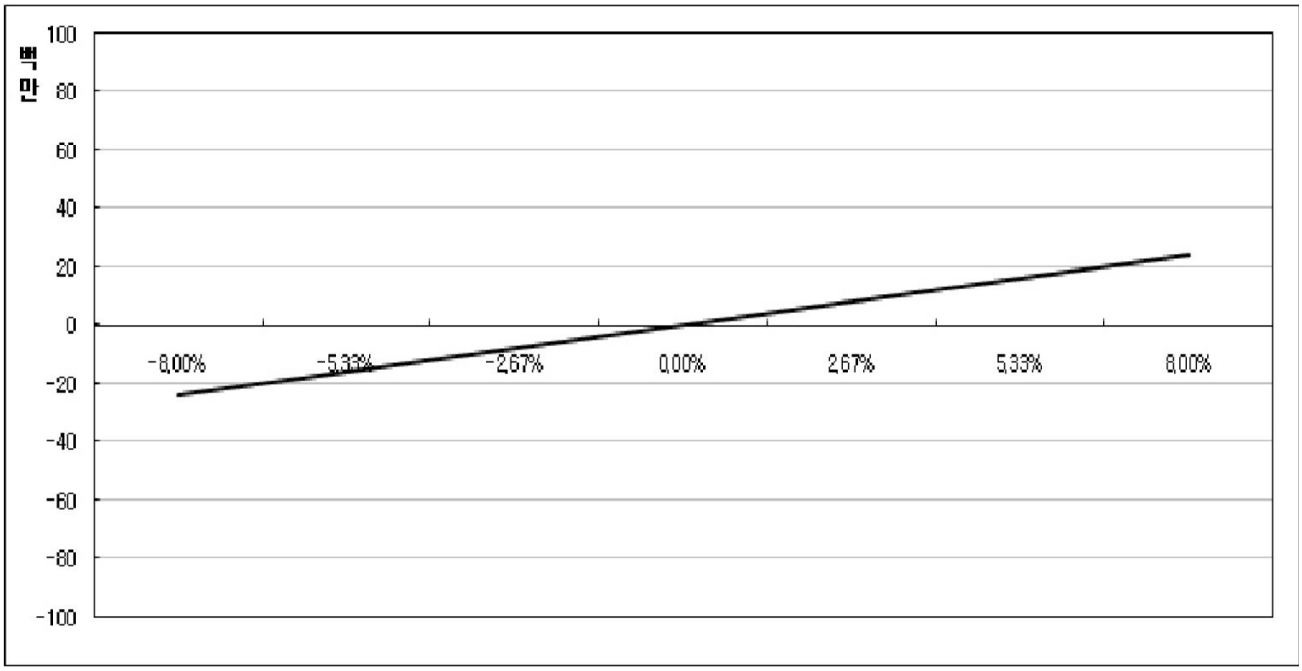
공시일: 2020-02-04

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	1,283	0	1,283	장내
합계			1,283	0	1,283	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

103

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

484

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

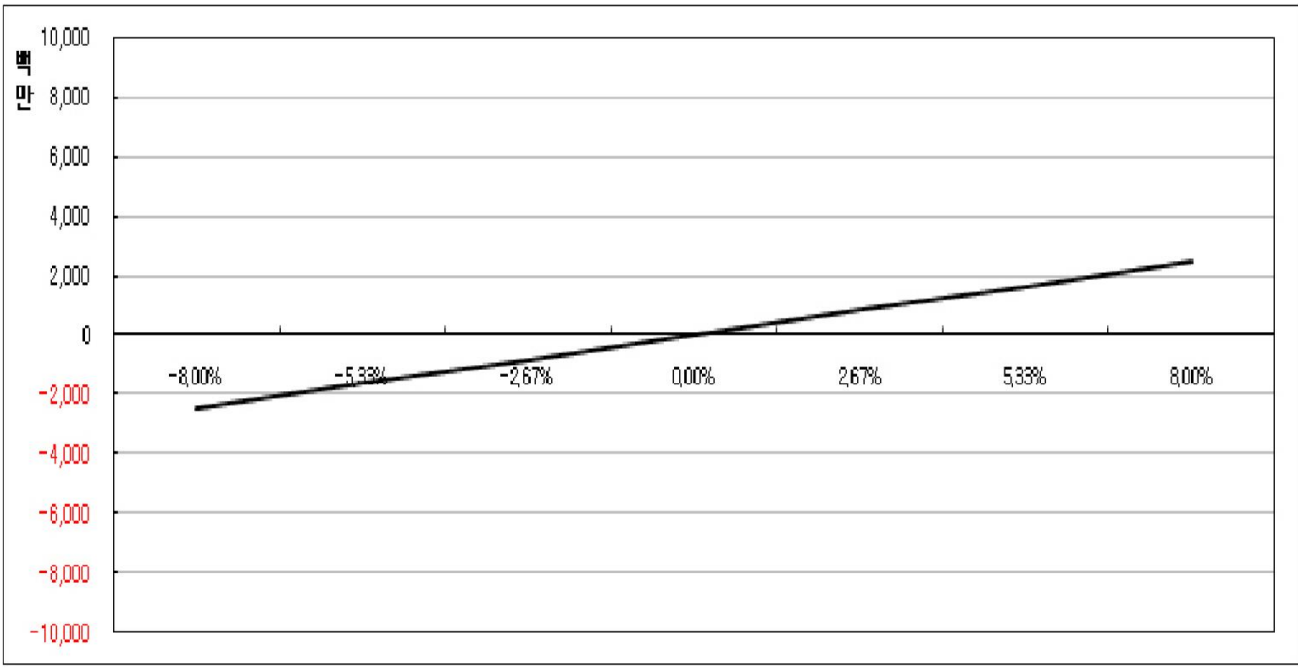
공시일: 2020-02-04

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	2,565	0	2,565	장내
합계			2,565	0	2,565	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

205

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

820

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

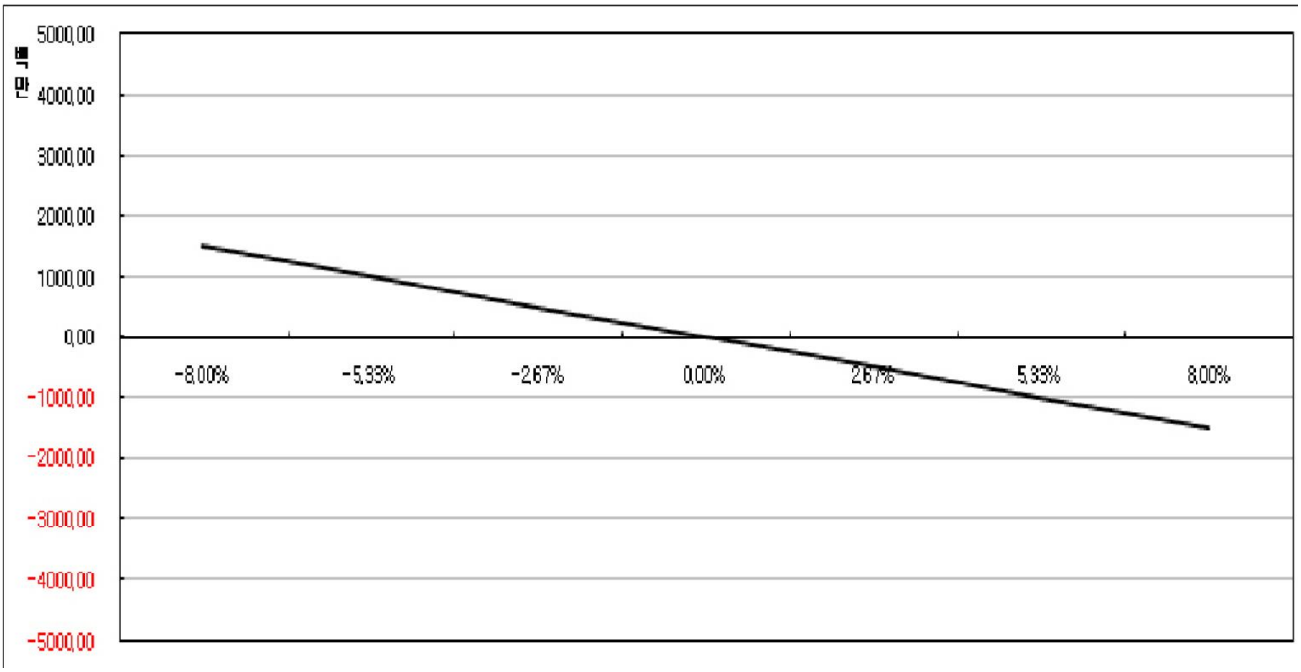
공시일: 2020-02-04

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	285	143	143	장내
누계	주가지수	선물	0	2,280	-2,280	장내
합계			0	2,280	-2,280	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

183

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

148

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

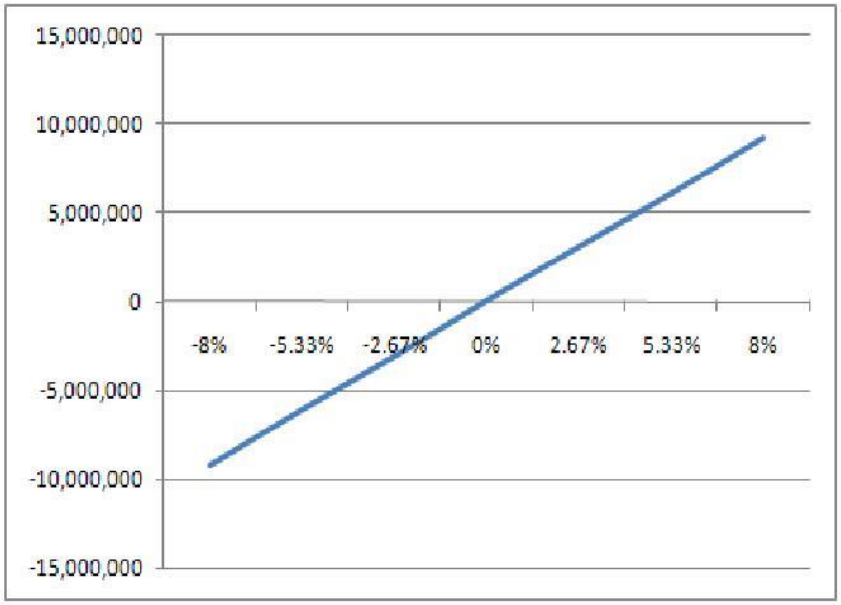
공시일: 2020-02-04

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	4,988	0	4,988	장내
누계	주가지수	선물	62,711	0	62,711	장내
합계			62,711	0	62,711	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,020

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

7,893