펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2020-02-05

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	1,453	0	1,453	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	6	2,616	-2,610	장내
합계			1,460	2,616	-1,157	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	53

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	90

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

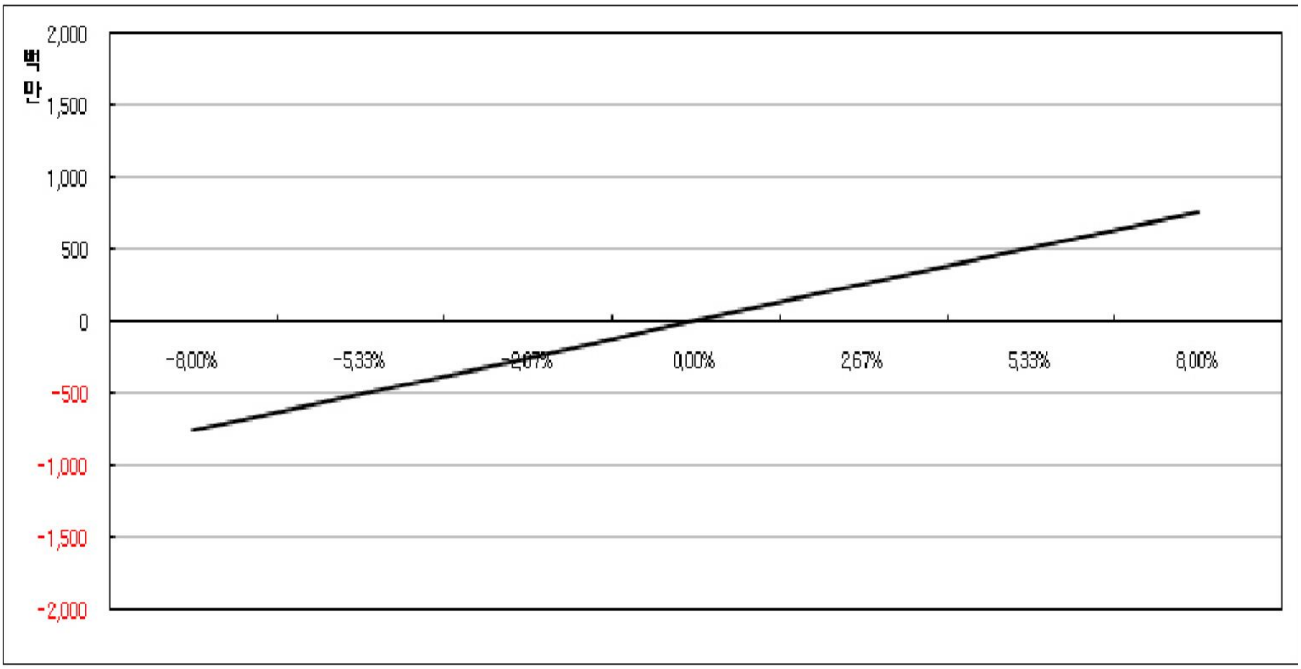
공시일: 2020-02-05

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	436	0	436	장내
합계			436	0	436	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

35

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

374

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

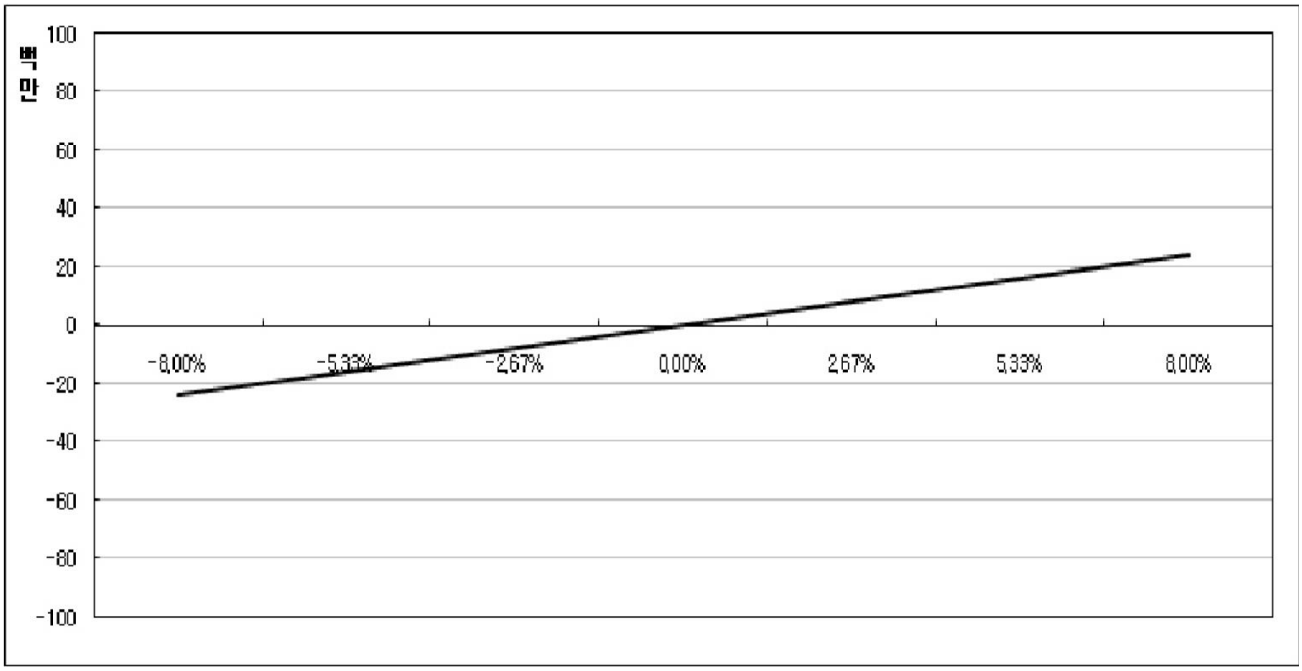
공시일: 2020-02-05

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	1,308	0	1,308	장내
합계			1,308	0	1,308	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

105

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

497

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

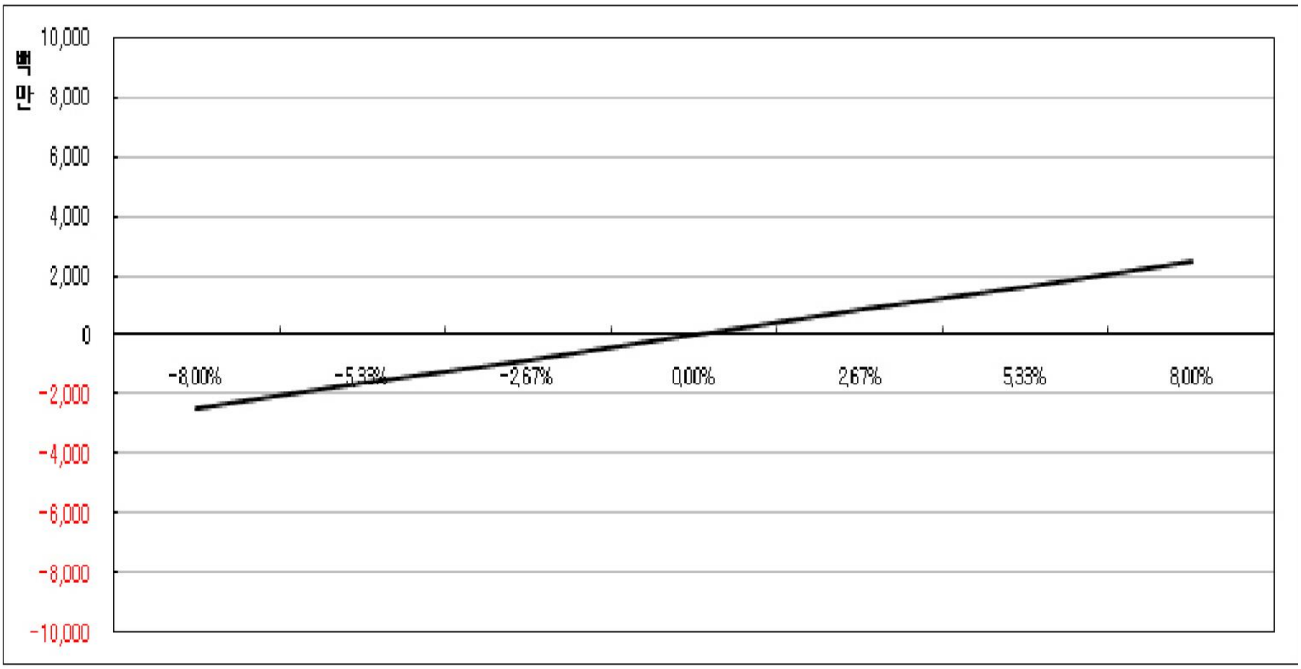
공시일: 2020-02-05

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	218	0	218	장내
누계	주가지수	선물	2,834	0	2,834	장내
합계			2,834	0	2,834	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

227

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

853

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

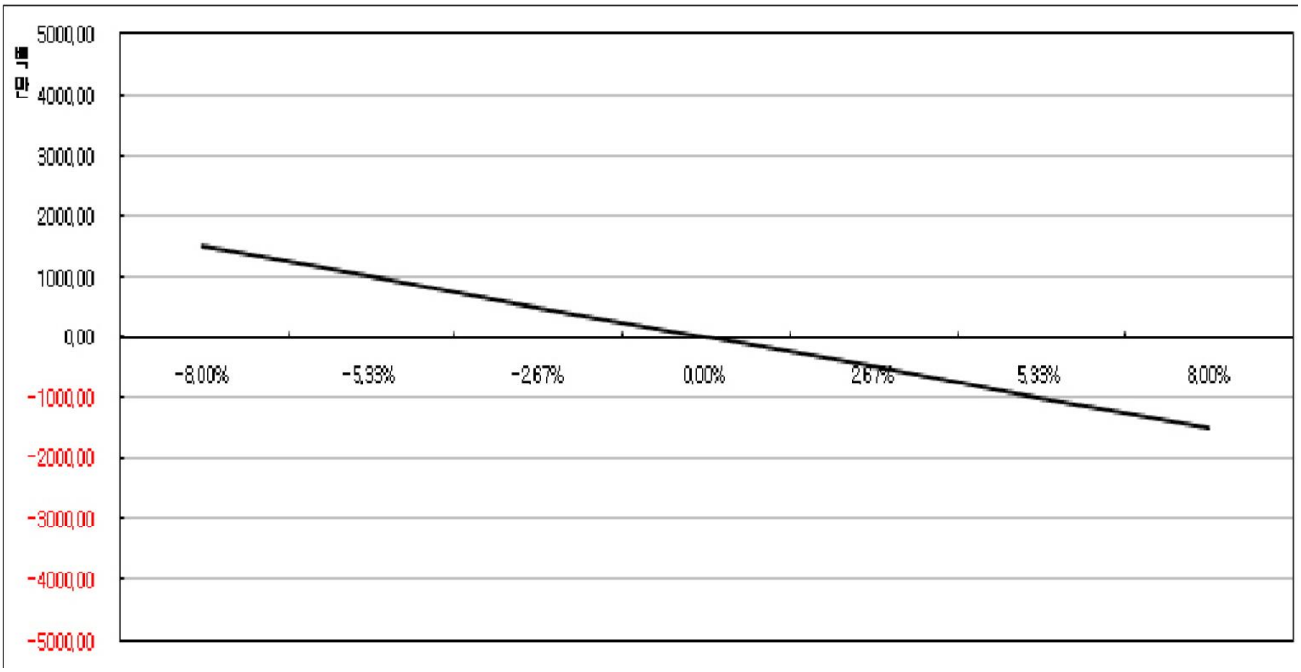
공시일: 2020-02-05

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	145	0	145	장내
누계	주가지수	선물	0	2,180	-2,180	장내
합계			0	2,180	-2,180	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

175

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

142

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

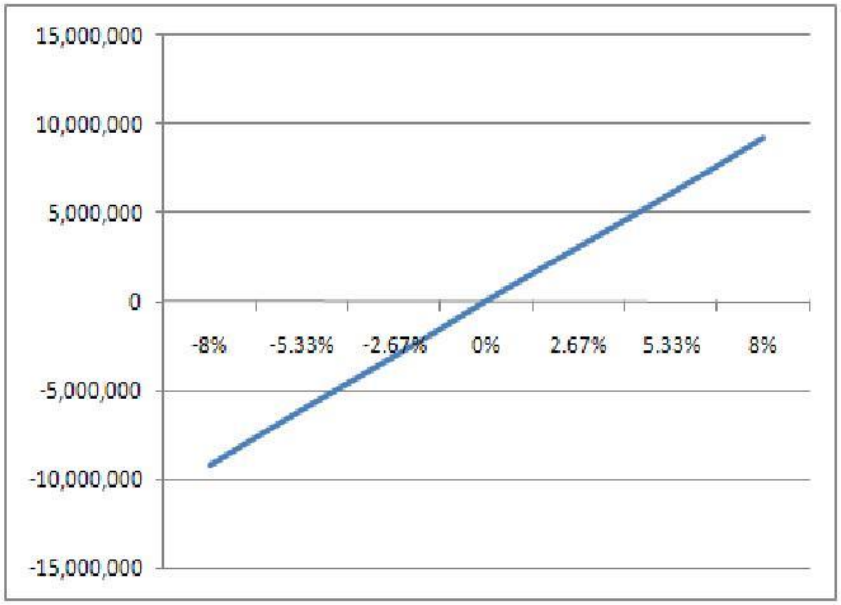
공시일: 2020-02-05

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	1,671	0	1,671	장내
누계	주가지수	선물	65,621	0	65,621	장내
합계			65,621	0	65,621	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,263

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

8,212