펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2020-02-06

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	1,460	0	1,460	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	5	2,628	-2,623	장내
합계			1,465	2,628	-1,163	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

61

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

86

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

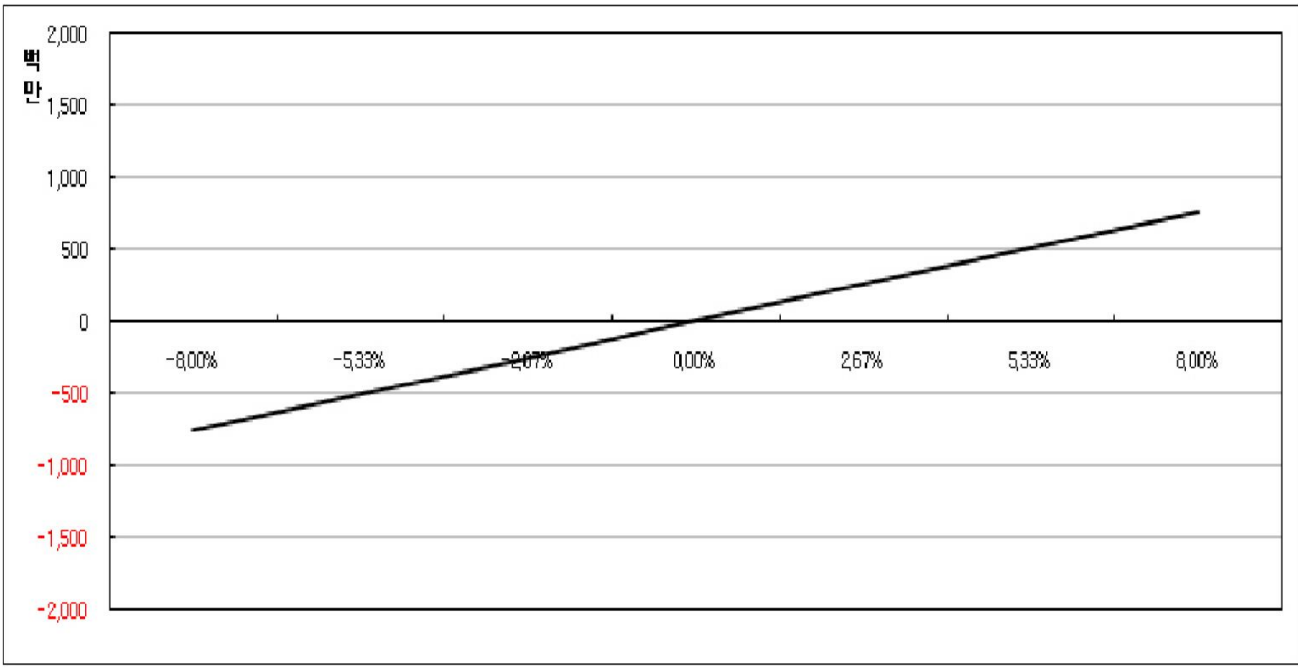
공시일: 2020-02-06

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	438	0	438	장내
합계			438	0	438	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

35

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

376

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

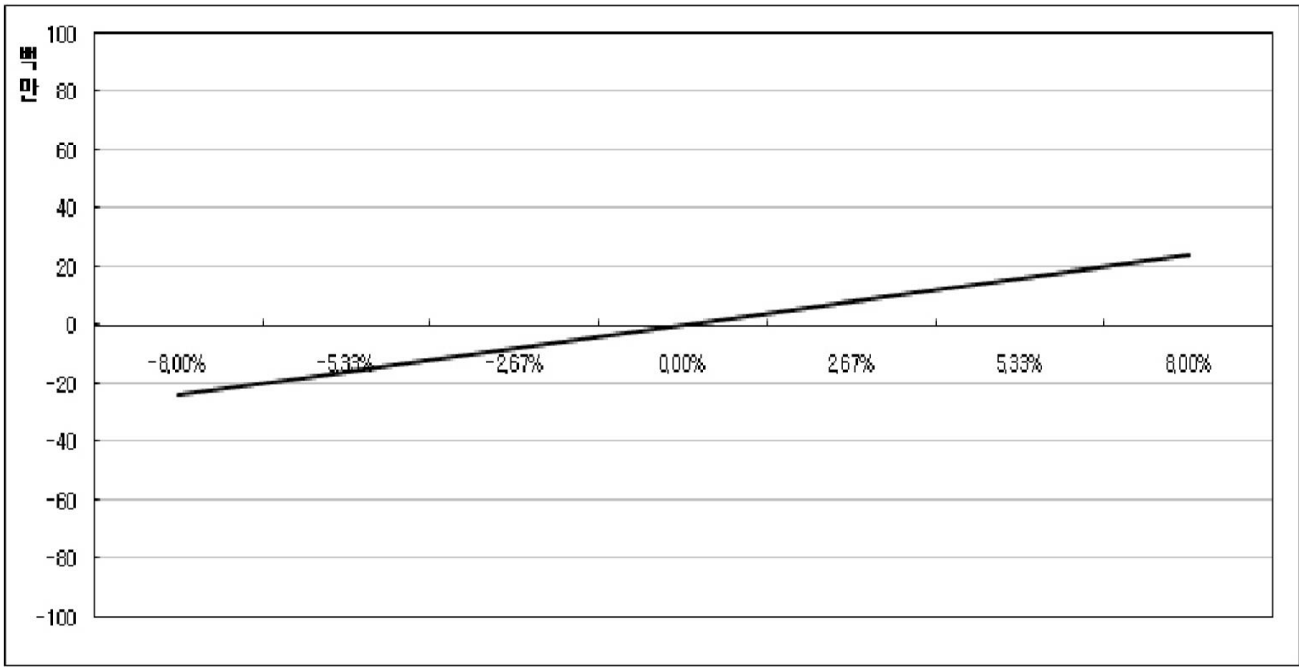
공시일: 2020-02-06

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	1,314	0	1,314	장내
합계			1,314	0	1,314	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

105

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

499

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

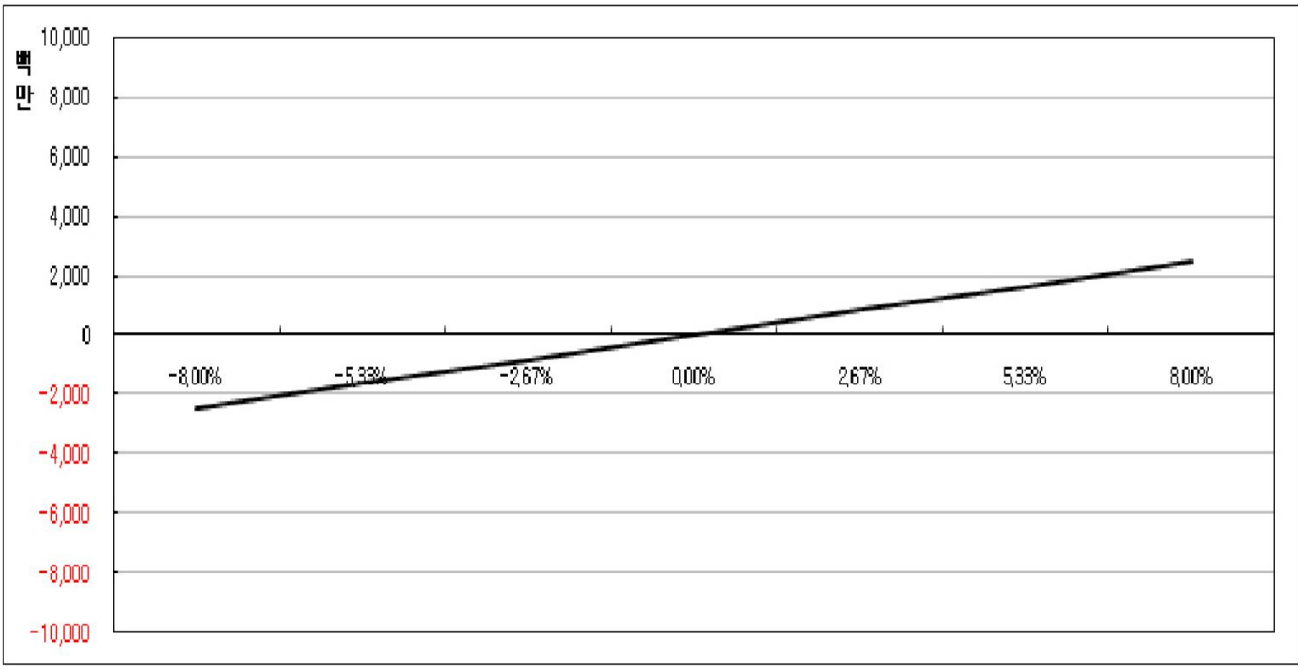
공시일: 2020-02-06

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	438	-438	장내
누계	주가지수	선물	2,409	0	2,409	장내
합계			2,409	0	2,409	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

193

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

834

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

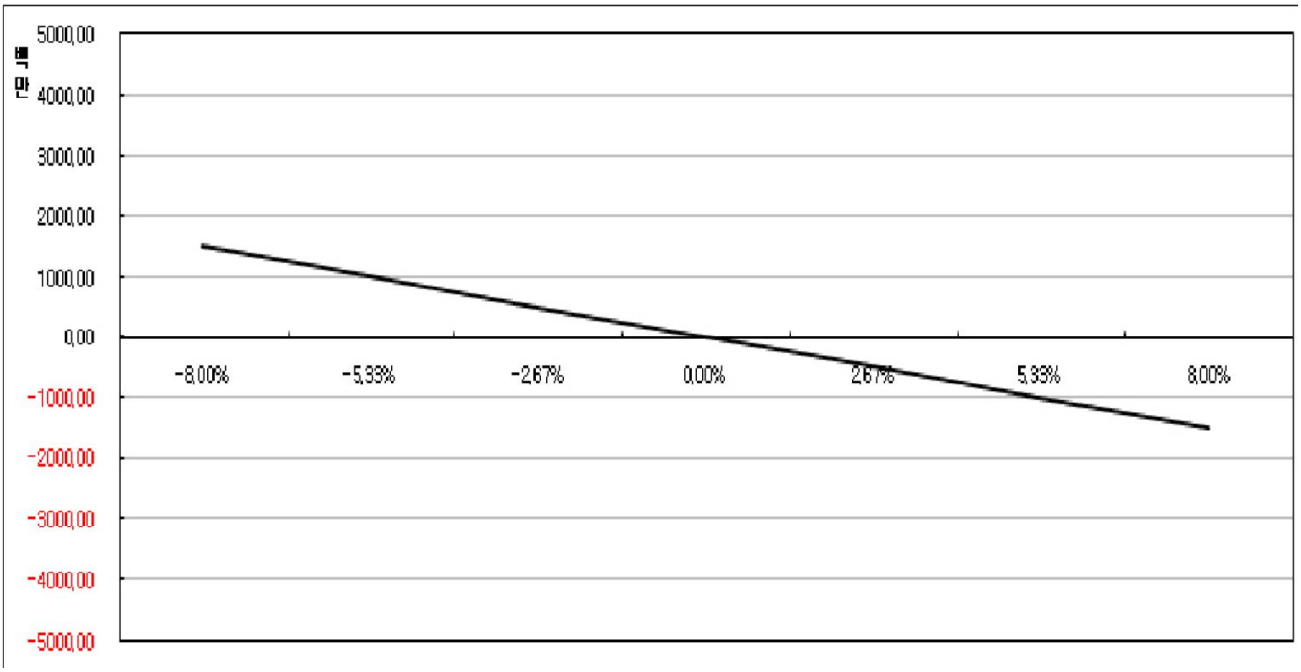
공시일: 2020-02-06

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	2,190	-2,190	장내
합계			0	2,190	-2,190	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

175

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

143

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

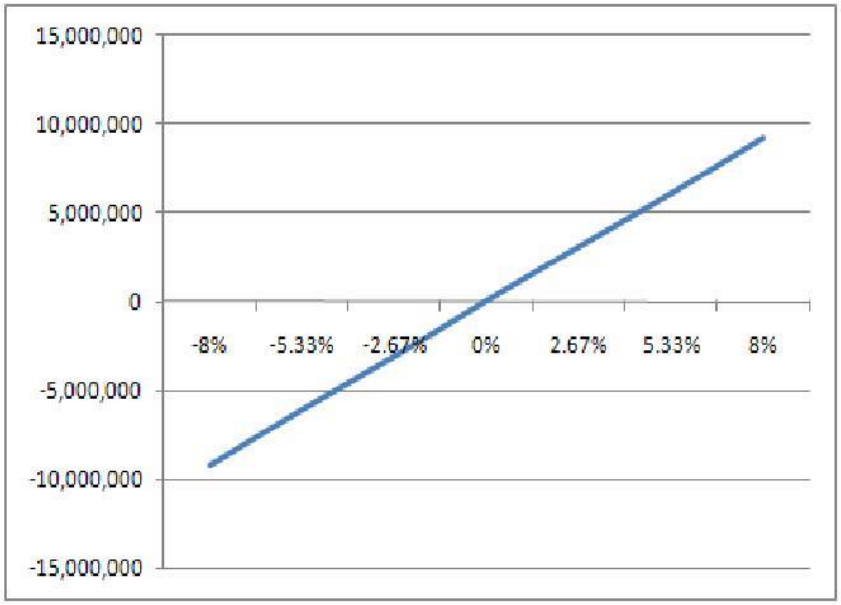
공시일: 2020-02-06

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	803	-803	장내
누계	주가지수	선물	65,120	0	65,120	장내
합계			65,120	0	65,120	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,215

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

8,187