펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2020-02-07

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	1,503	0	1,503	장내
신규	주가지수	옵션	4	0	4	장내
누계	주가지수	옵션	1	2,556	-2,554	장내
합계			1,505	2,556	-1,051	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

74

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

156

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

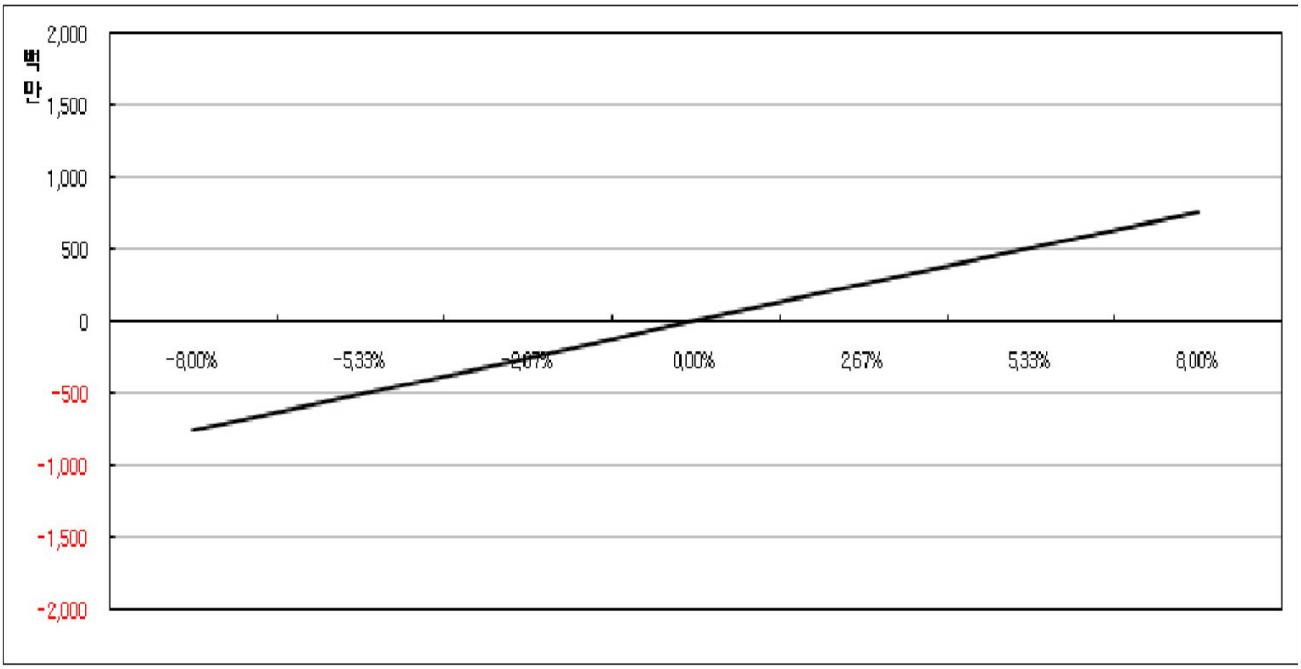
공시일: 2020-02-07

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	451	0	451	장내
합계			451	0	451	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

36

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

392

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

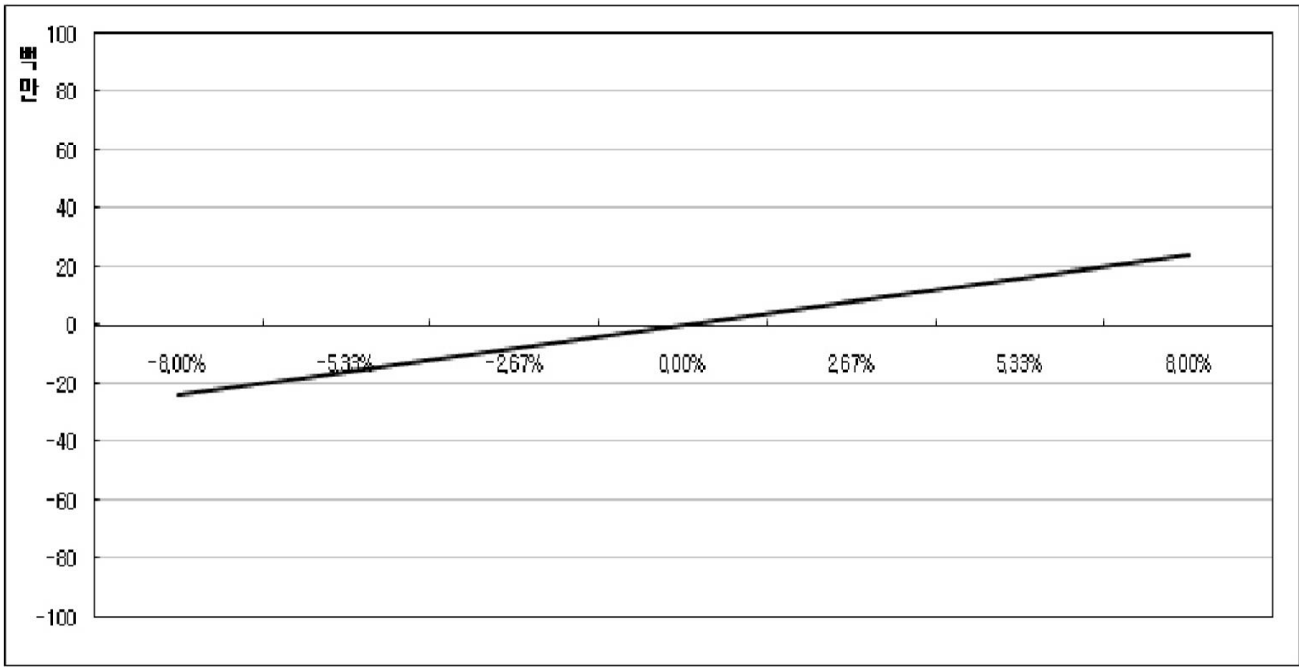
공시일: 2020-02-07

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	1,353	0	1,353	장내
합계			1,353	0	1,353	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

109

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

521

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

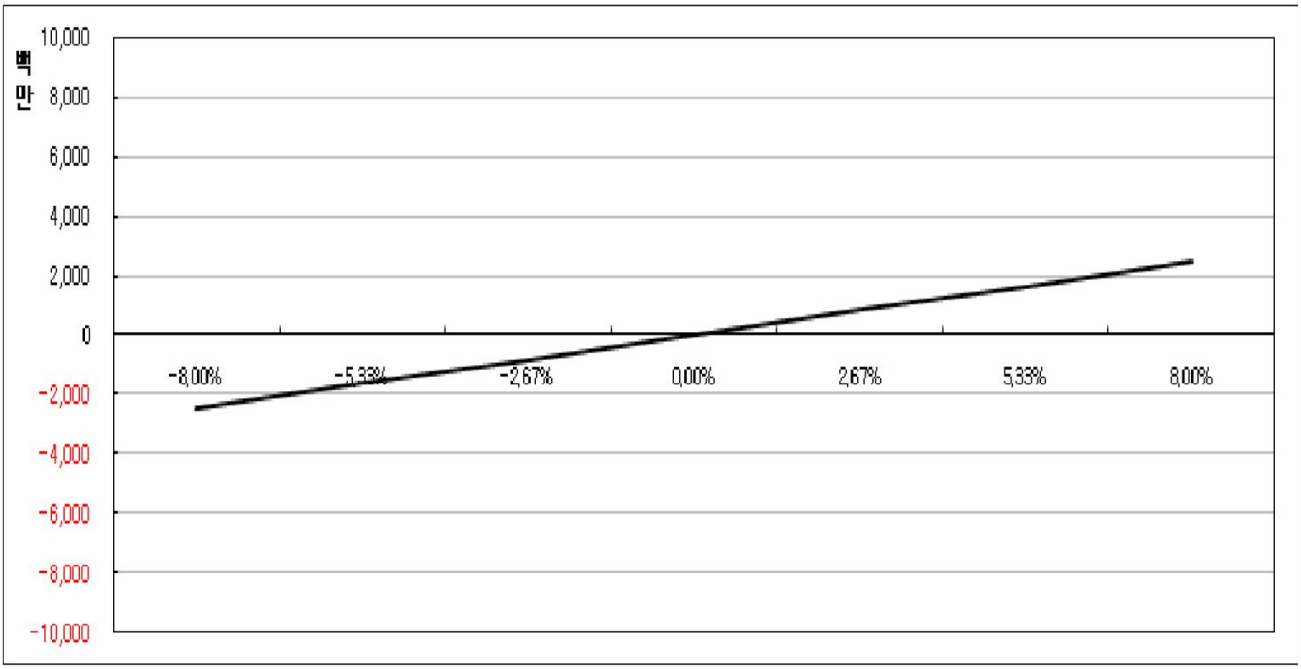
공시일: 2020-02-07

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	2,480	0	2,480	장내
합계			2,480	0	2,480	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

199

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

871

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

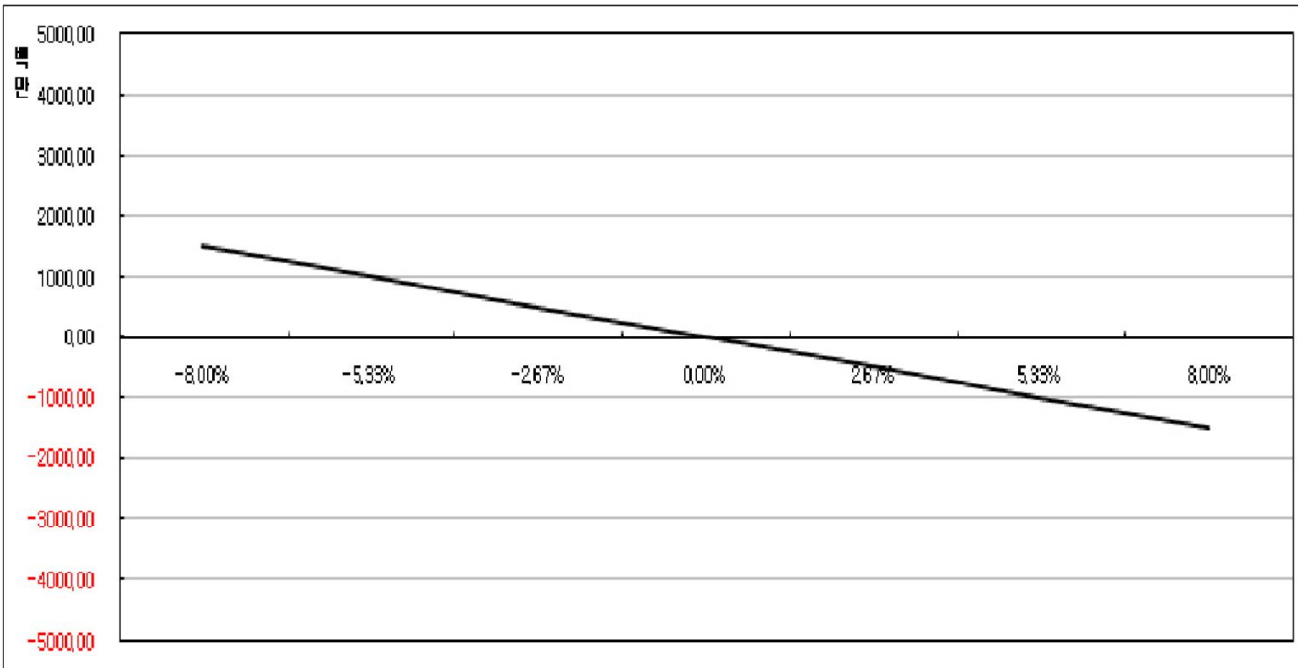
공시일: 2020-02-07

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	601	0	601	장내
누계	주가지수	선물	0	1,654	-1,654	장내
합계			0	1,654	-1,654	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

133

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

110

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

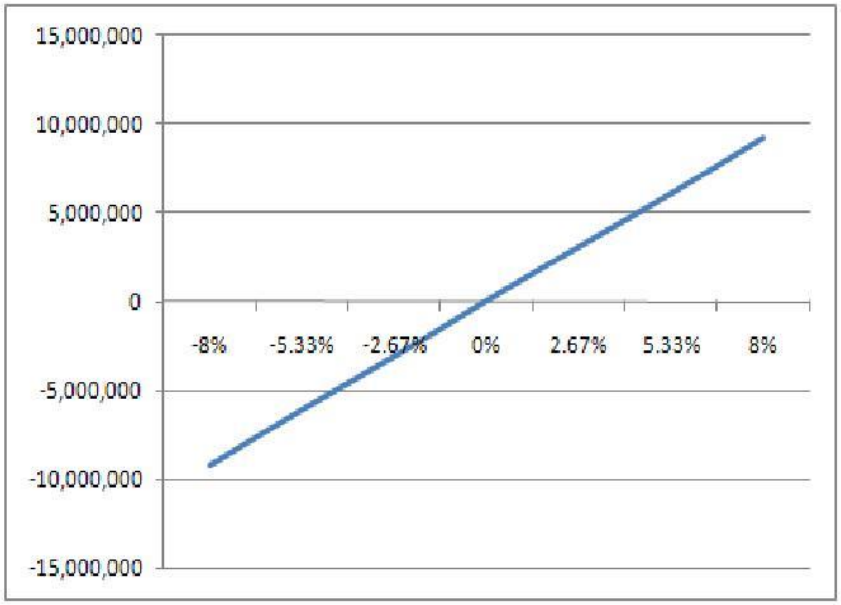
공시일: 2020-02-07

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	67,045	0	67,045	장내
합계			67,045	0	67,045	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,377

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

8,573