펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2020-02-10

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	75	-75	장내
누계	주가지수	선물	1,416	0	1,416	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	1	2,535	-2,534	장내
합계			1,418	2,535	-1,117	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	84

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	92

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

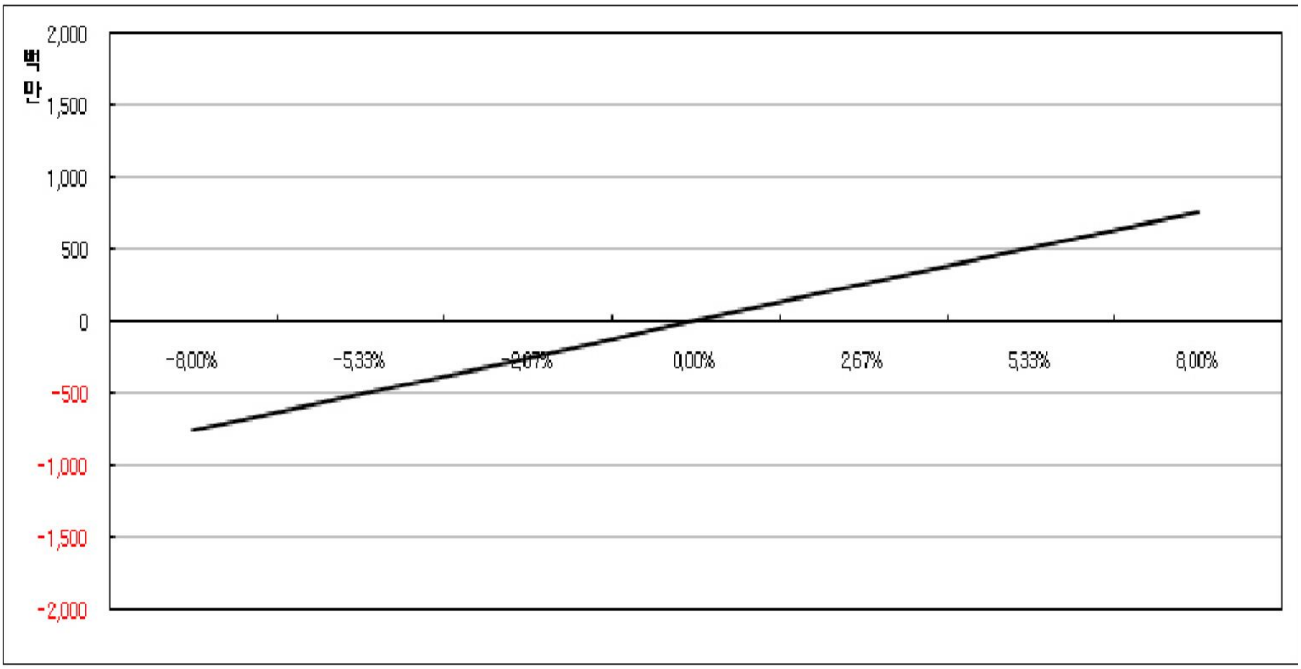
공시일: 2020-02-10

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	447	0	447	장내
합계			447	0	447	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

36

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

389

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

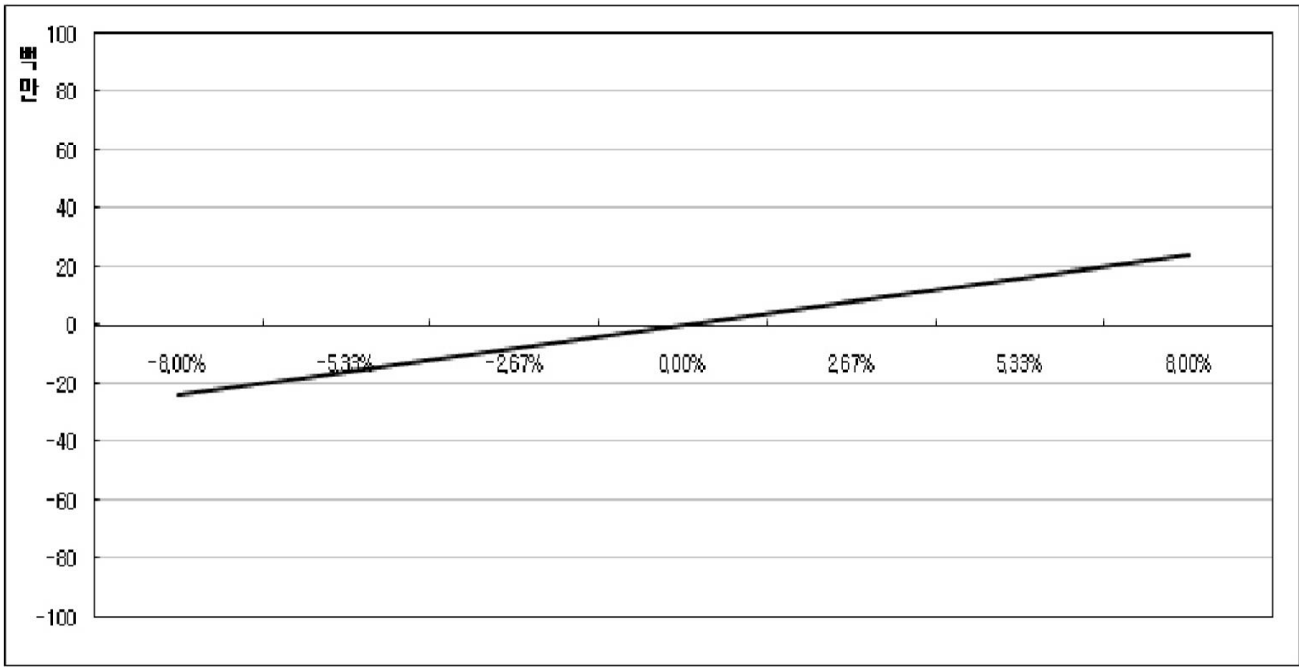
공시일: 2020-02-10

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	1,342	0	1,342	장내
합계			1,342	0	1,342	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

107

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

517

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

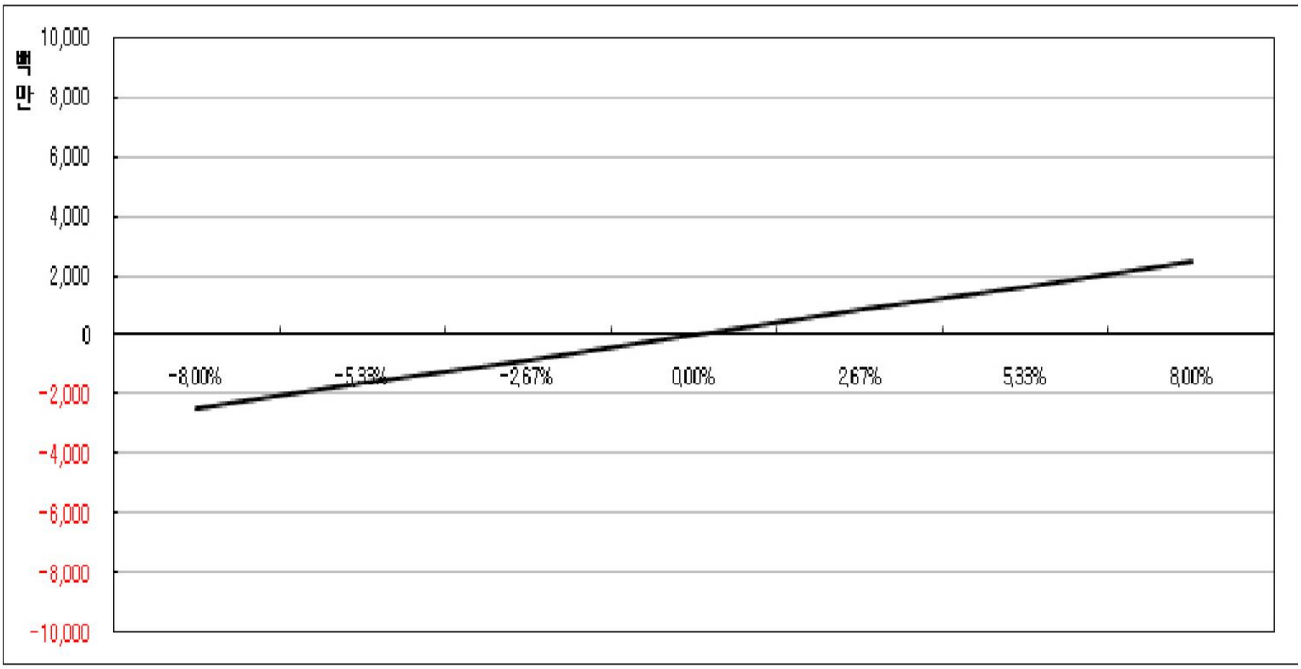
공시일: 2020-02-10

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	671	0	671	장내
누계	주가지수	선물	3,131	0	3,131	장내
합계			3,131	0	3,131	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

250

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

898

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

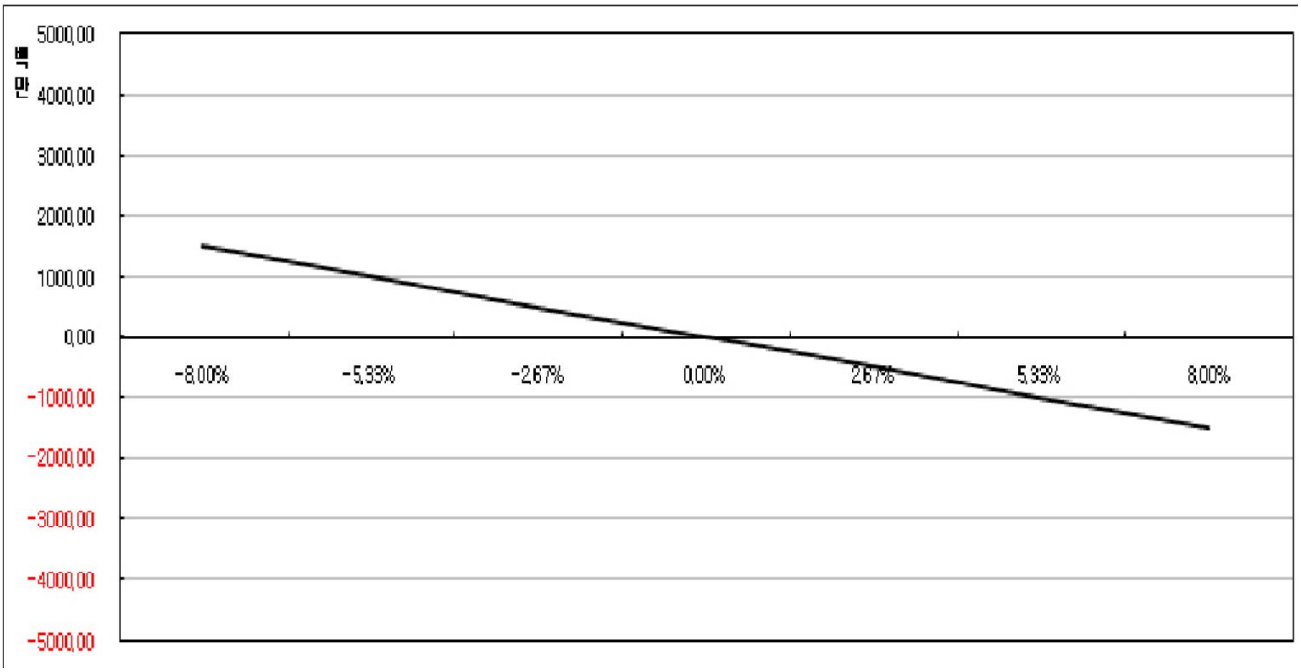
공시일: 2020-02-10

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	1,640	-1,640	장내
합계			0	1,640	-1,640	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

131

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

109

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

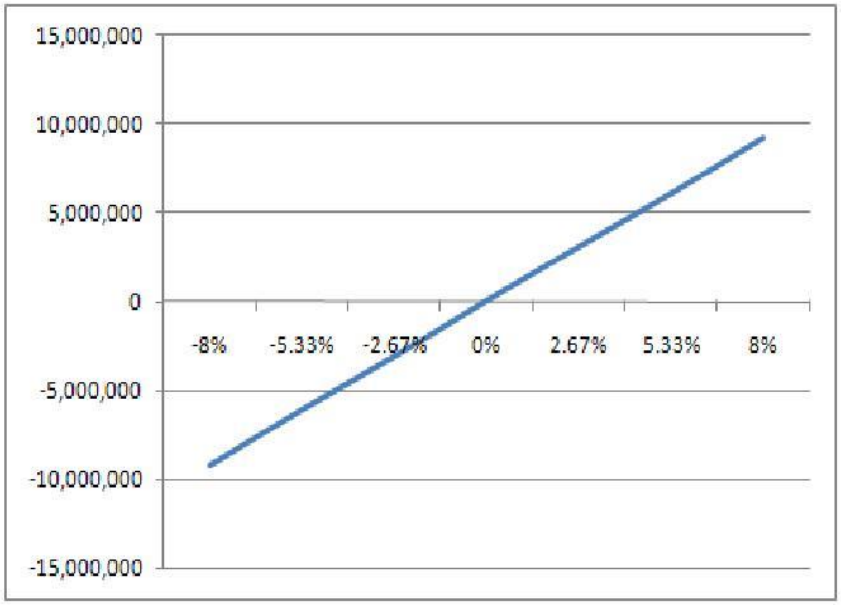
공시일: 2020-02-10

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	2,982	-2,982	장내
누계	주가지수	선물	63,519	0	63,519	장내
합계			63,519	0	63,519	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,078

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

8,333