펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2020-02-11

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	1,407	0	1,407	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	1	2,518	-2,517	장내
합계			1,408	2,518	-1,110	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

79

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

67

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

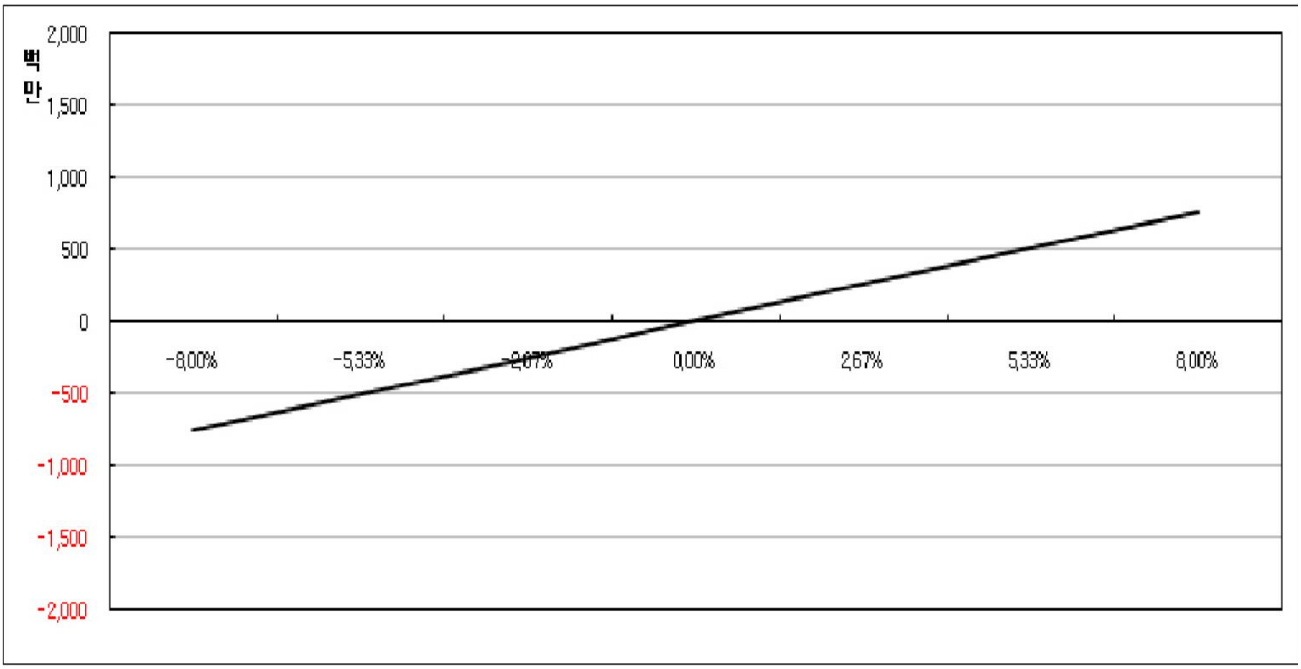
공시일: 2020-02-11

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	444	0	444	장내
합계			444	0	444	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

36

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

386

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

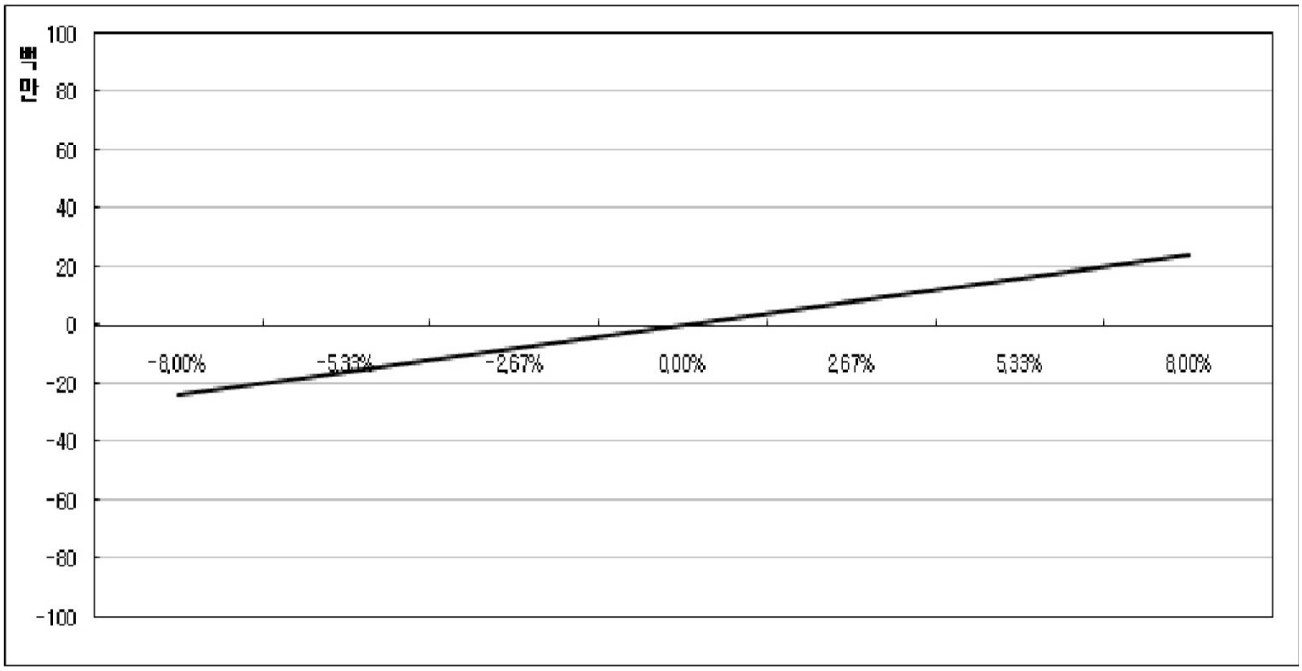
공시일: 2020-02-11

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	1,333	0	1,333	장내
합계			1,333	0	1,333	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

107

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

513

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

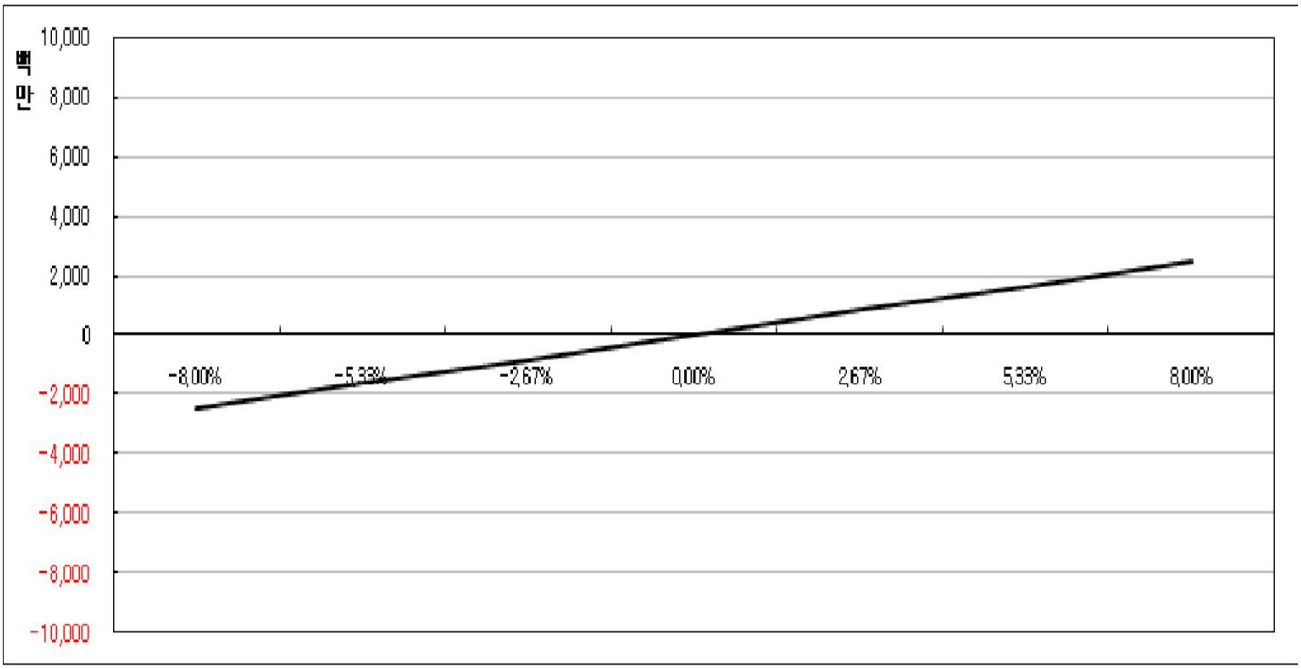
공시일: 2020-02-11

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	3,111	0	3,111	장내
합계			3,111	0	3,111	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

249

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

892

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

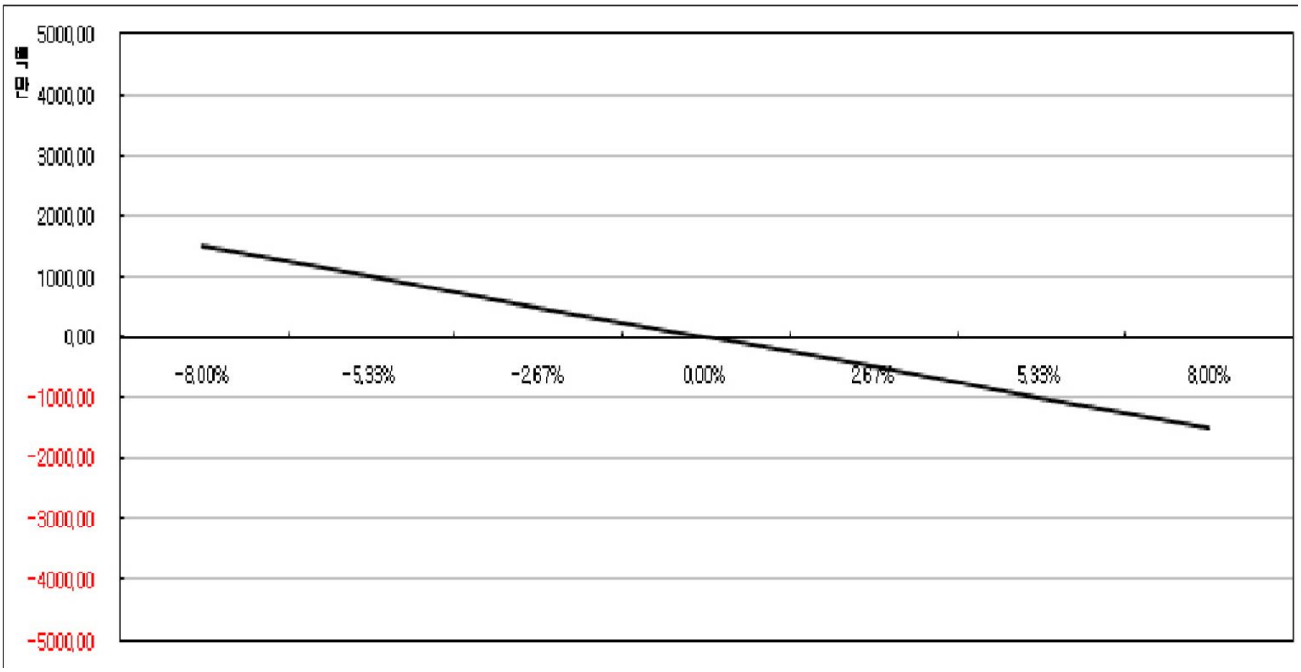
공시일: 2020-02-11

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	148	-148	장내
누계	주가지수	선물	0	1,777	-1,777	장내
합계			0	1,777	-1,777	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

142

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

118

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

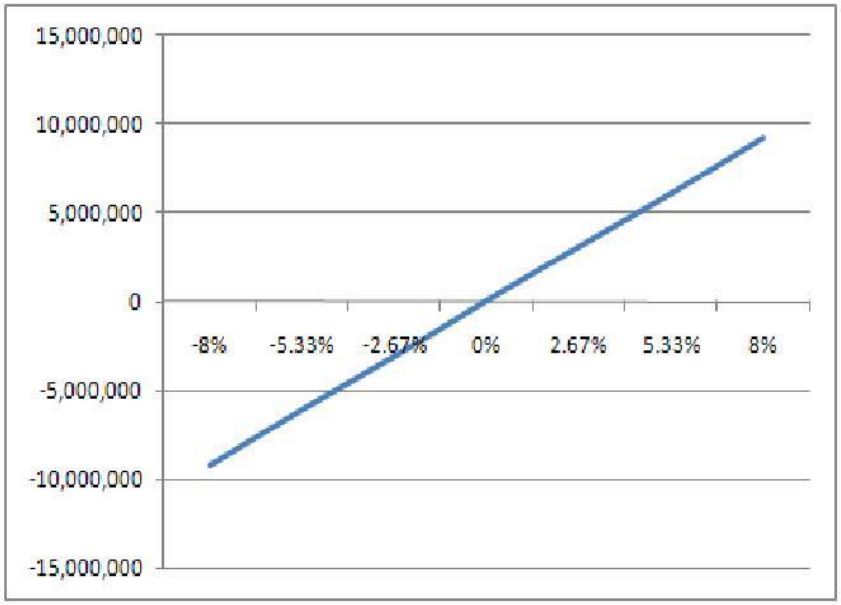
공시일: 2020-02-11

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	1,481	0	1,481	장내
누계	주가지수	선물	64,580	0	64,580	장내
합계			64,580	0	64,580	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,170

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

8,367