펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2020-02-12

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	1,422	0	1,422	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	0	2,544	-2,544	장내
합계			1,422	2,544	-1,122	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

86

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

64

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

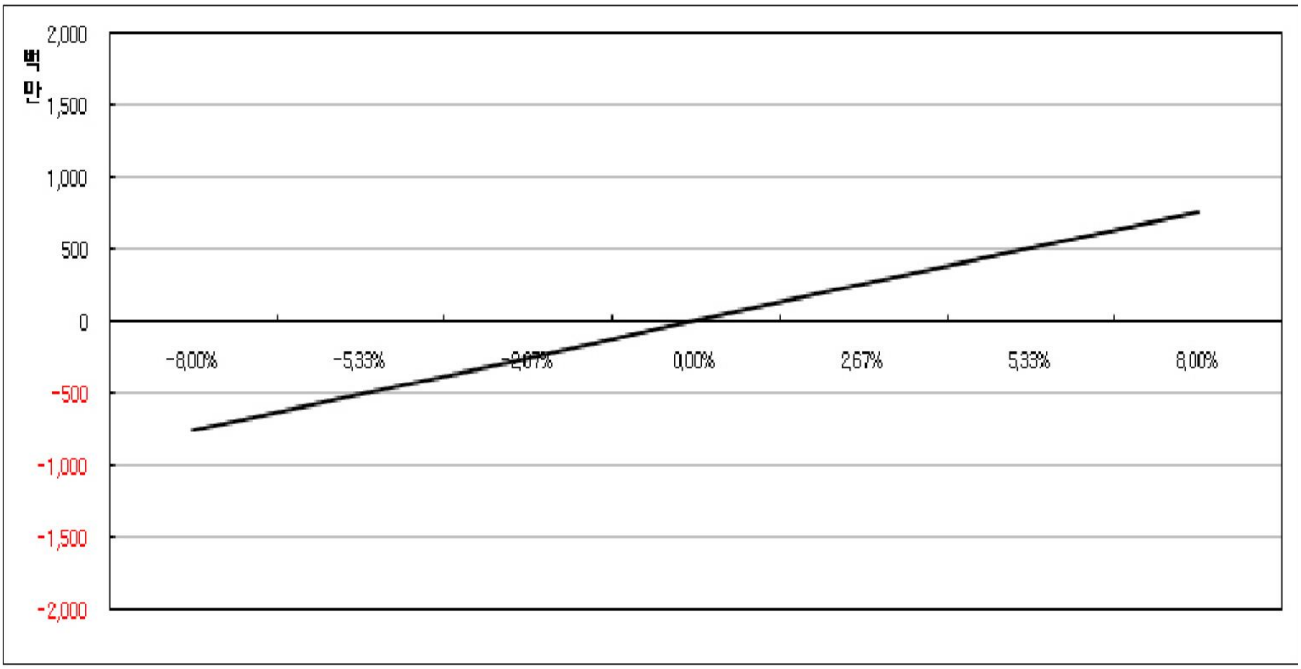
공시일: 2020-02-12

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	449	0	449	장내
합계			449	0	449	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

36

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

377

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

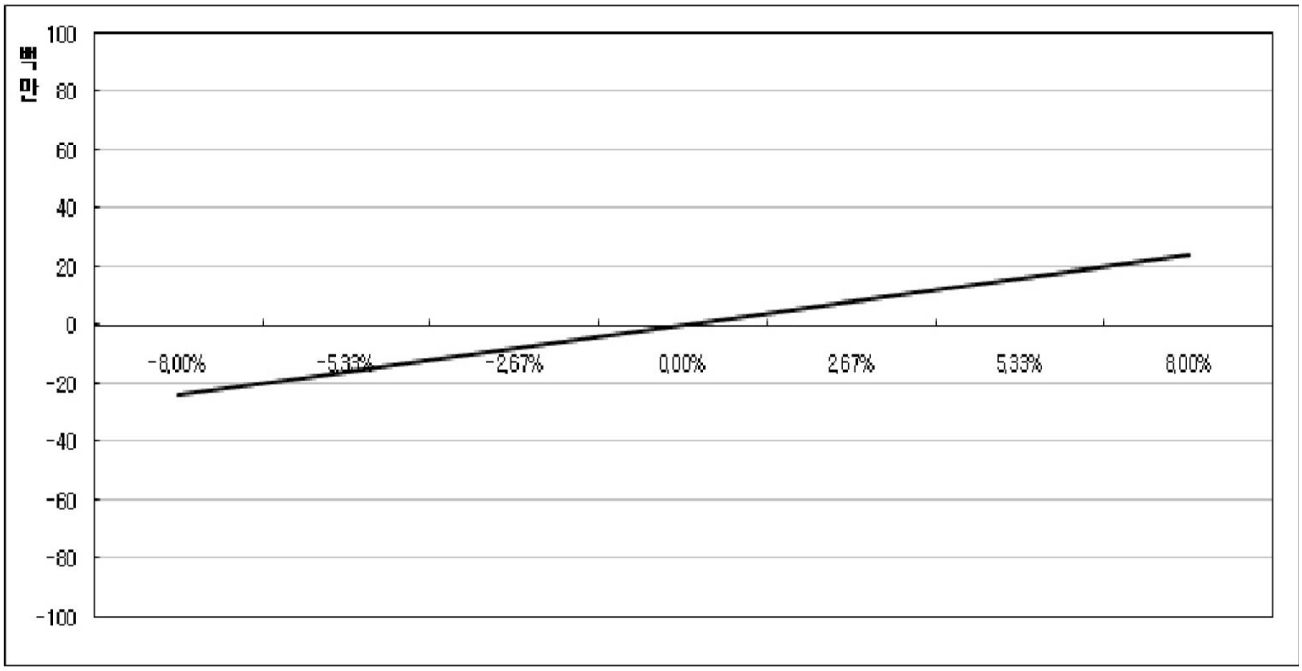
공시일: 2020-02-12

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	1,347	0	1,347	장내
합계			1,347	0	1,347	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

108

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

520

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

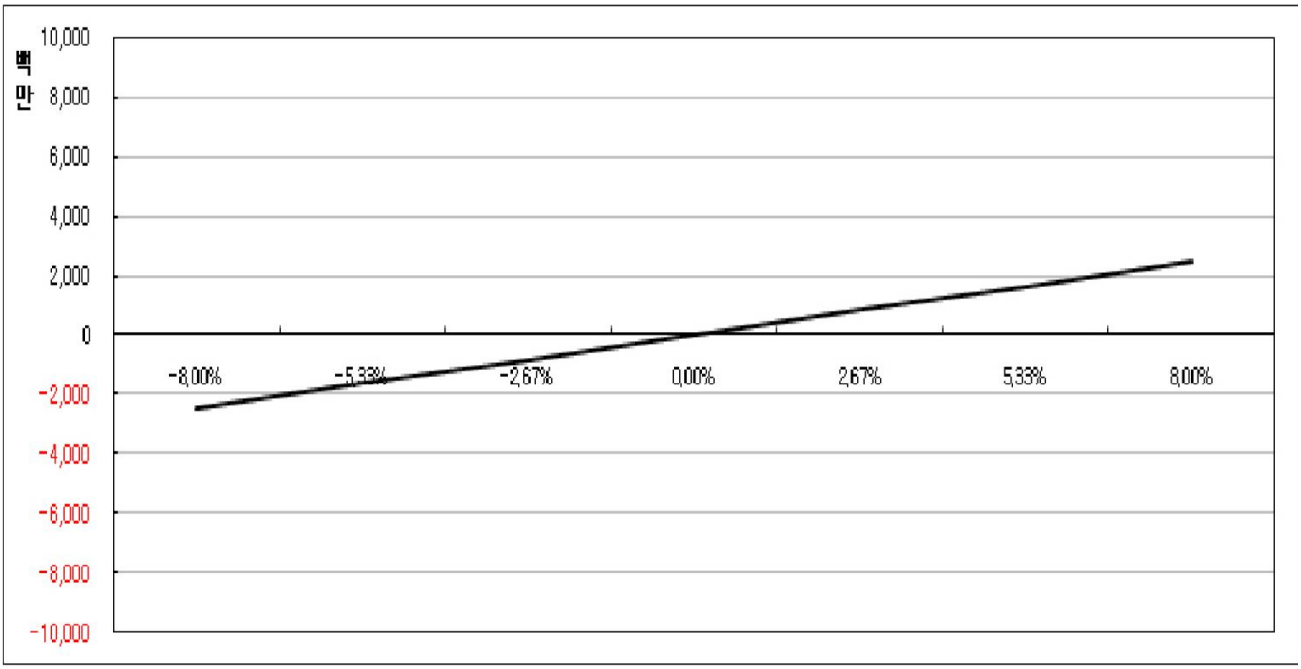
공시일: 2020-02-12

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	3,142	0	3,142	장내
합계			3,142	0	3,142	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

252

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

904

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

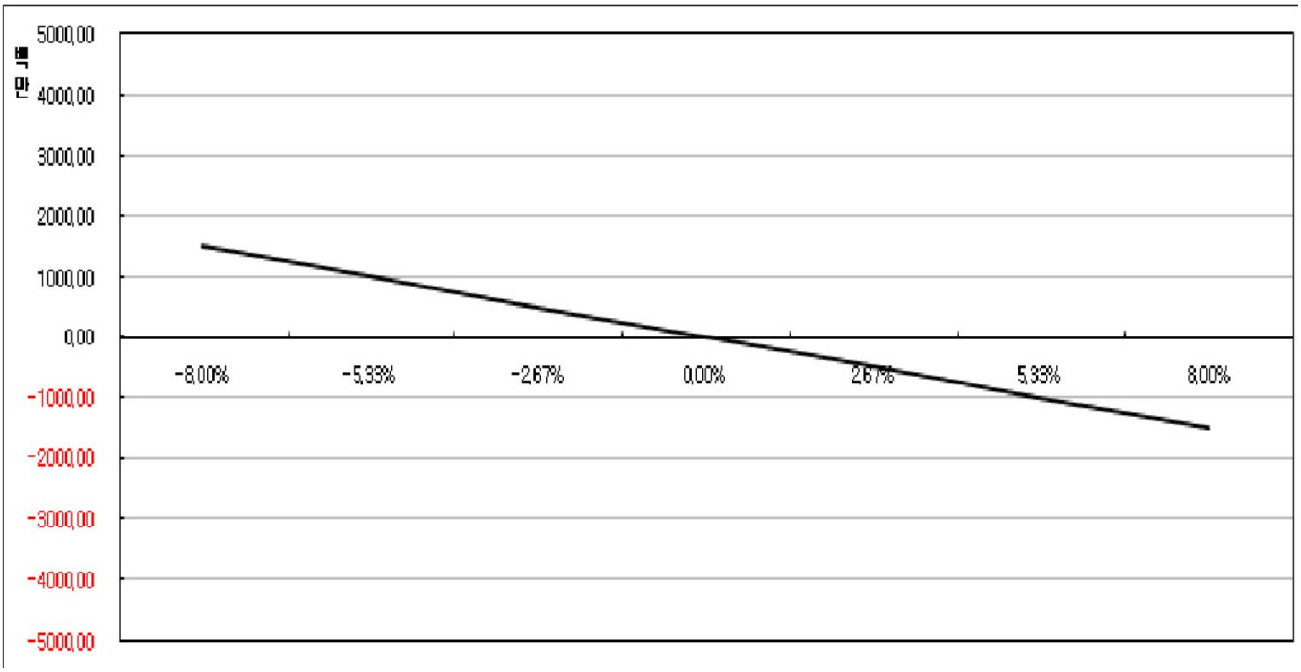
공시일: 2020-02-12

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	1,796	-1,796	장내
합계			0	1,796	-1,796	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

144

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

119

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

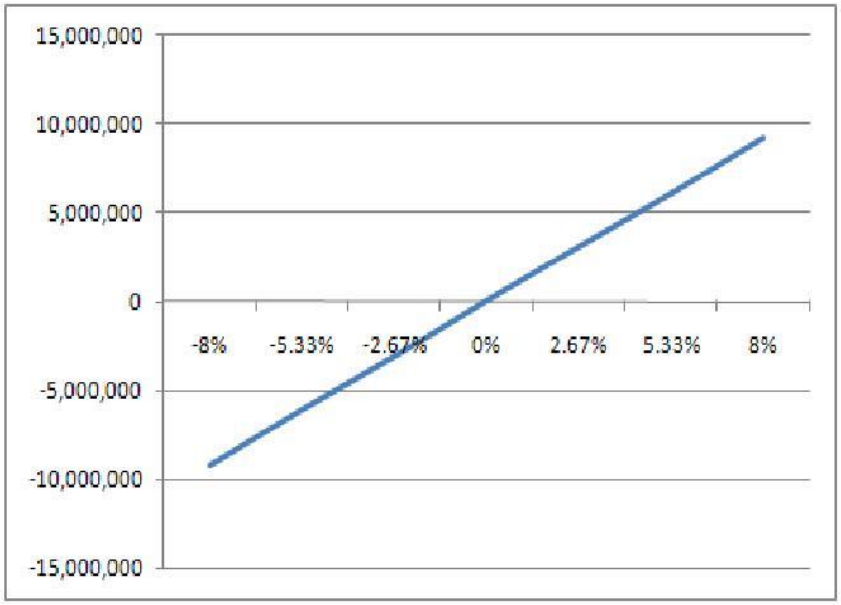
공시일: 2020-02-12

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	748	-748	장내
누계	주가지수	선물	64,495	0	64,495	장내
합계			64,495	0	64,495	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,169

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

8,446