펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2020-02-13

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	1,432	0	1,432	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	0	2,563	-2,563	장내
합계			1,432	2,563	-1,131	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

90

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

72

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

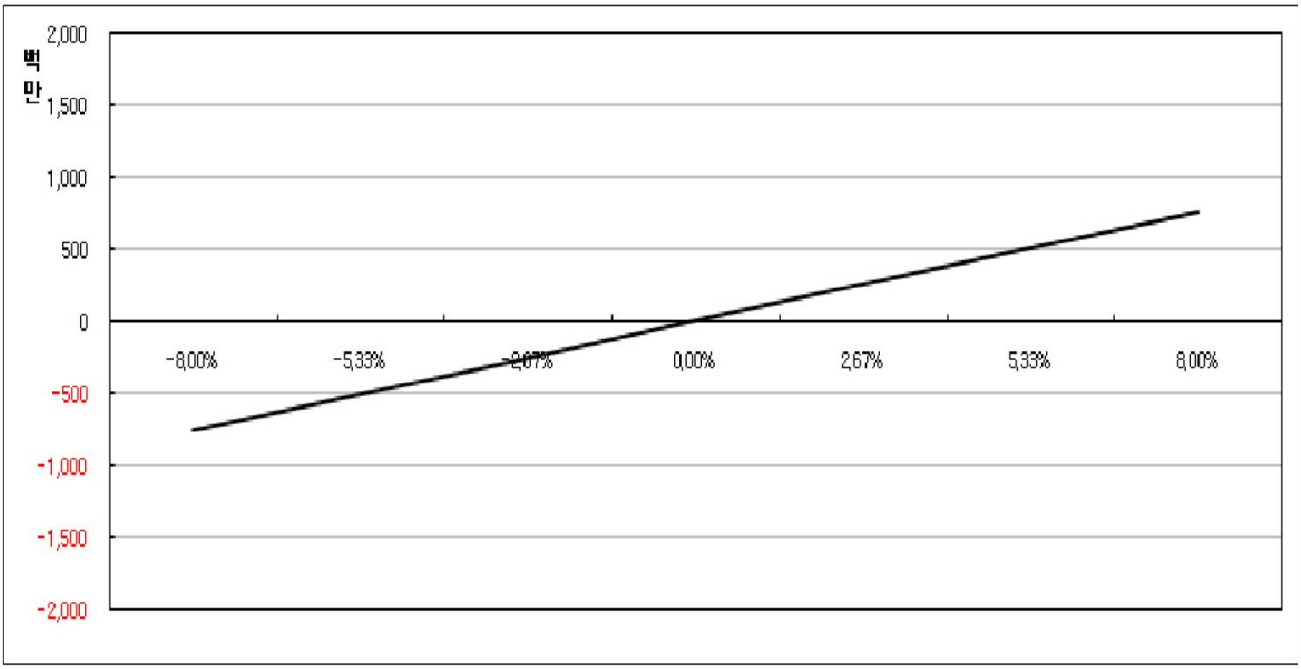
공시일: 2020-02-13

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	452	0	452	장내
합계			452	0	452	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	36

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	380

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

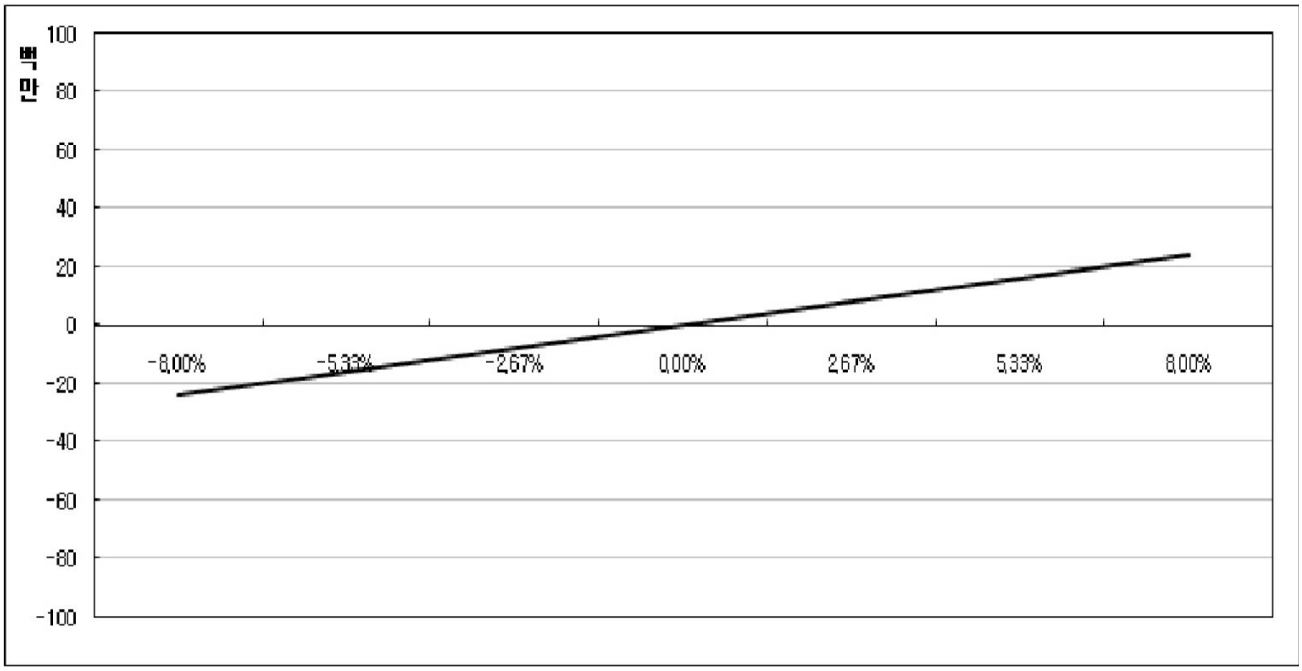
공시일: 2020-02-13

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	1,357	0	1,357	장내
합계			1,357	0	1,357	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

109

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

524

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

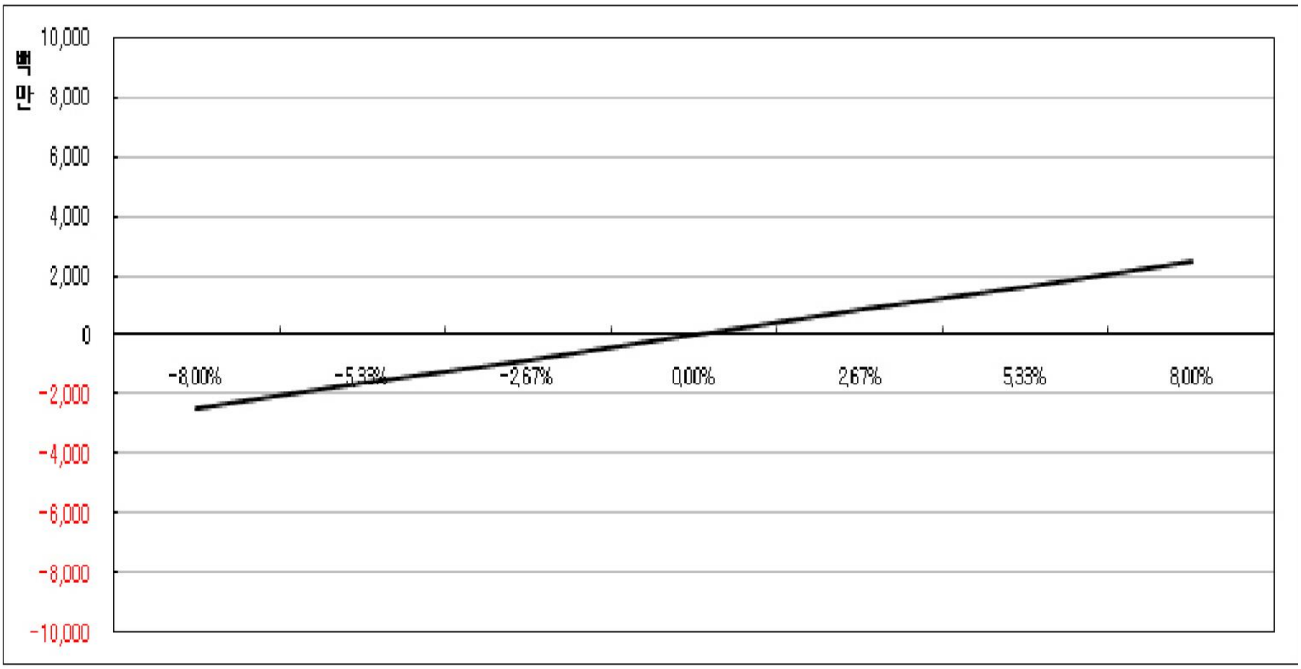
공시일: 2020-02-13

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	226	0	226	장내
누계	주가지수	선물	3,392	0	3,392	장내
합계			3,392	0	3,392	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

272

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

921

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

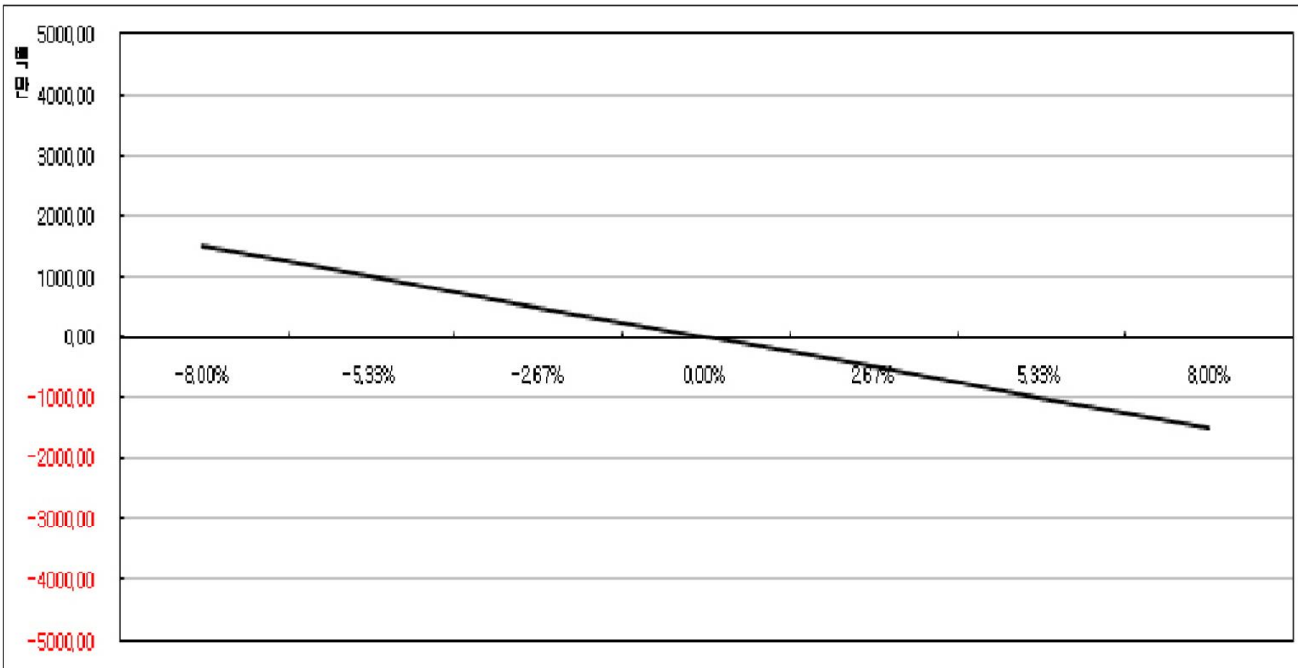
공시일: 2020-02-13

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	151	0	151	장내
누계	주가지수	선물	0	1,658	-1,658	장내
합계			0	1,658	-1,658	

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]

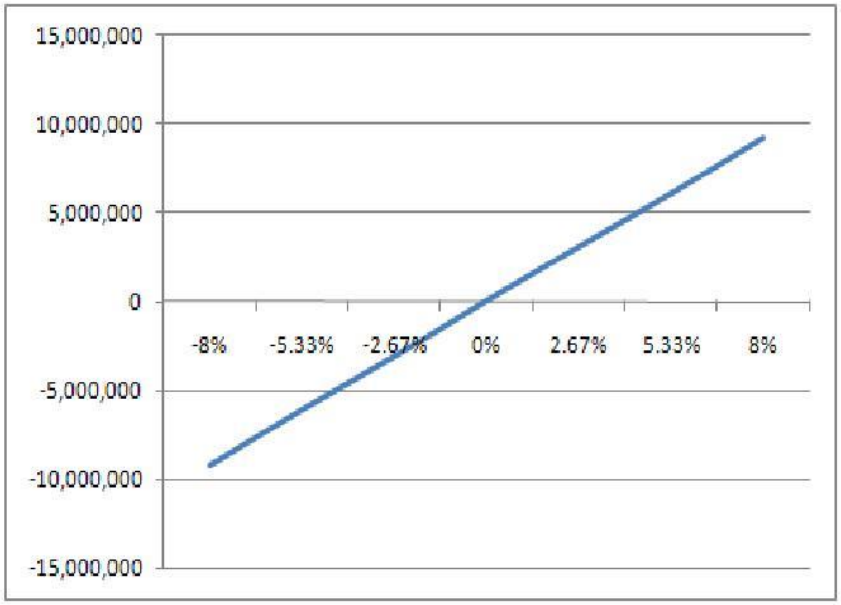
공시일: 2020-02-13

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	377	0	377	장내
누계	주가지수	선물	65,359	0	65,359	장내
합계			65,359	0	65,359	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,234

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

8,515