펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2020-02-14

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	1,429	0	1,429	장내
신규	주가지수	옵션	64	3,839	-3,774	장내
누계	주가지수	옵션	7	2,710	-2,703	장내
합계			1,436	2,710	-1,274	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

59

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

243

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

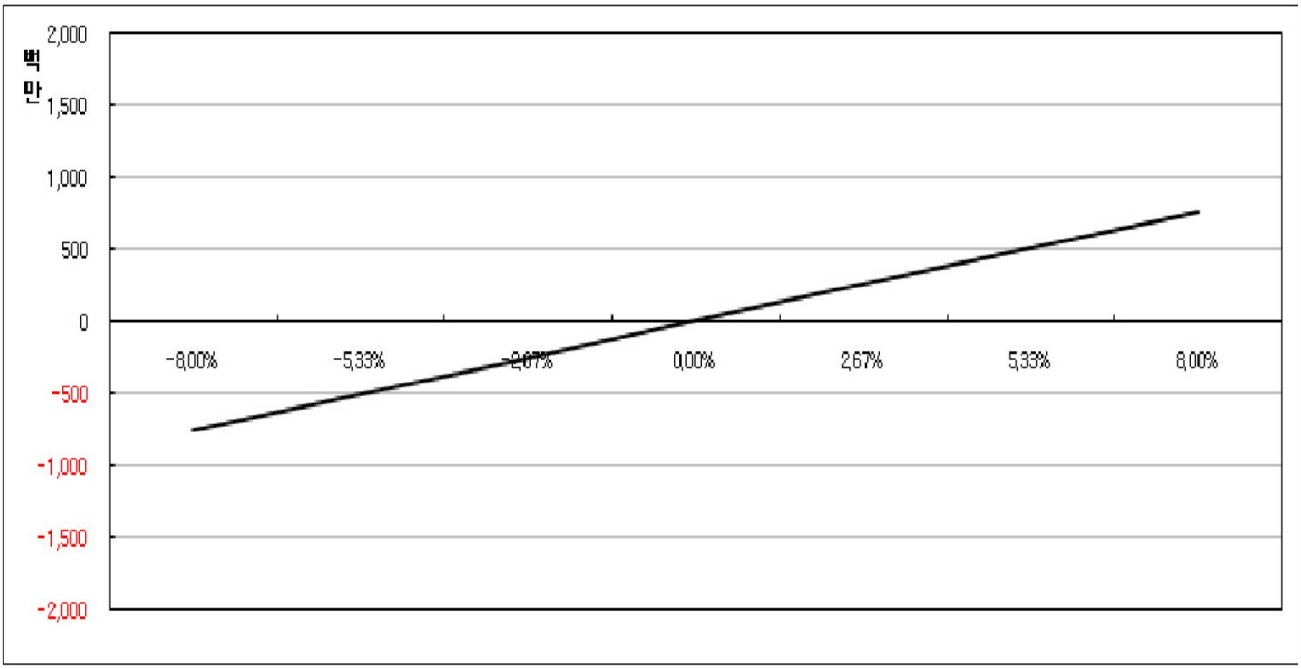
공시일: 2020-02-14

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)

377

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

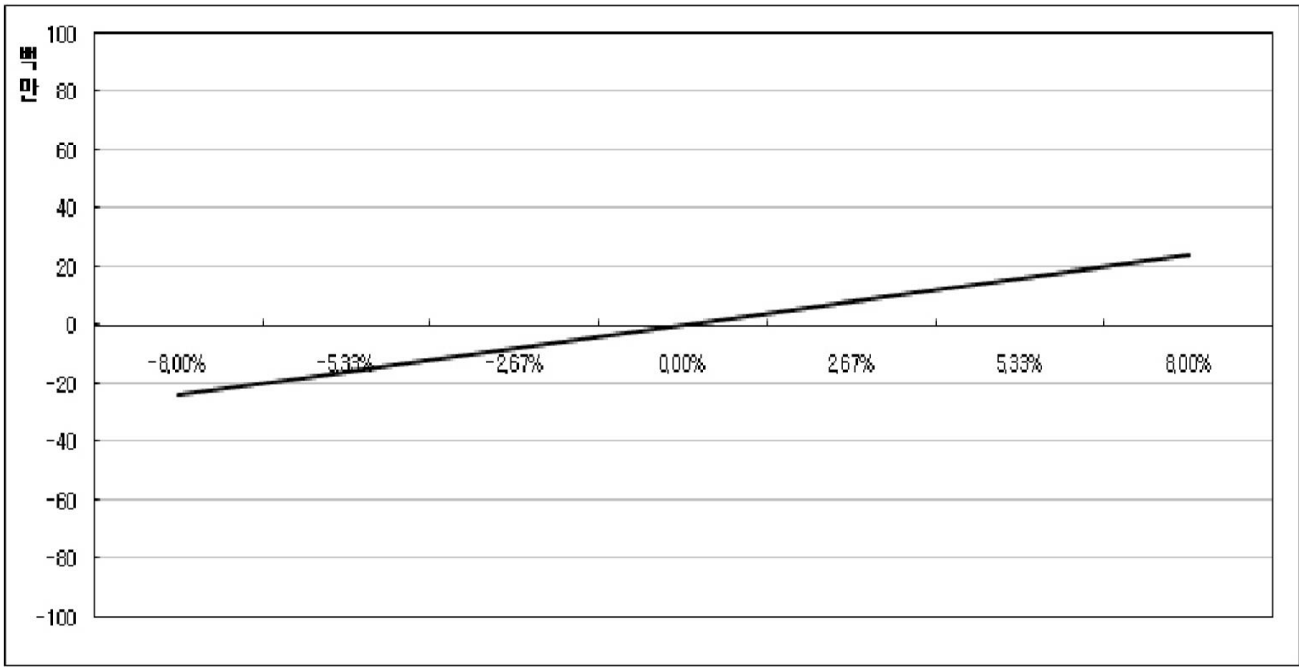
공시일: 2020-02-14

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	1,354	0	1,354	장내
합계			1,354	0	1,354	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

108

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

518

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

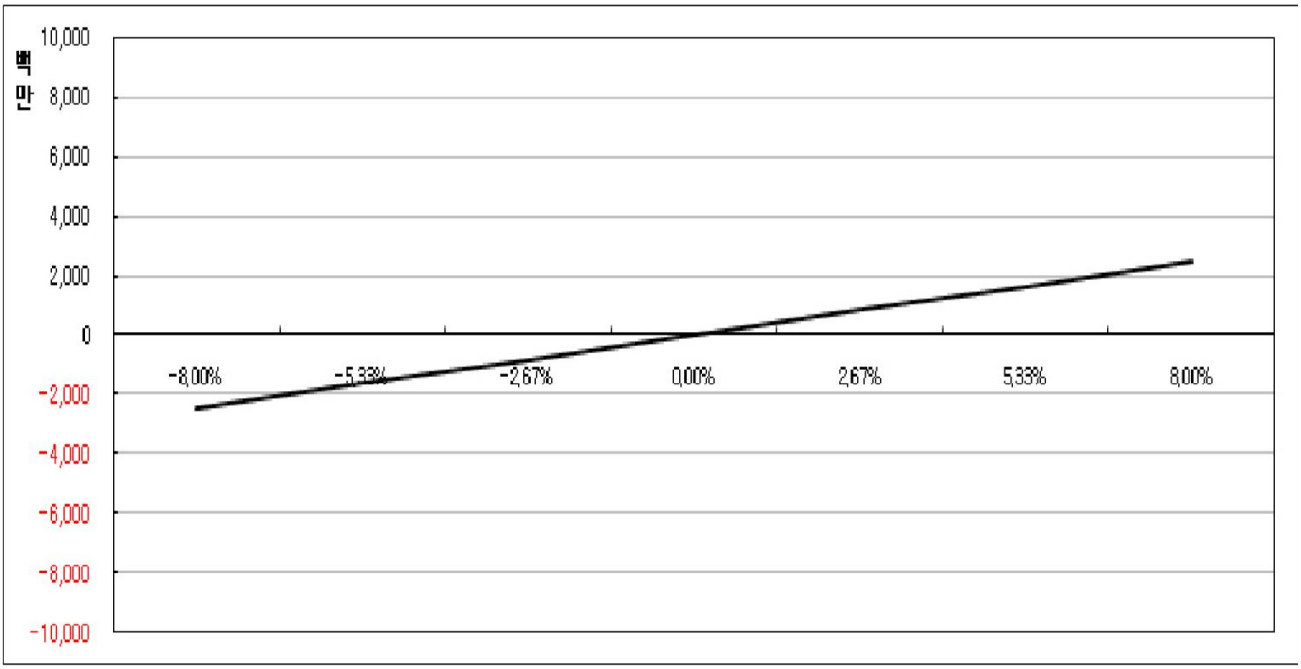
공시일: 2020-02-14

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	3,385	0	3,385	장내
합계			3,385	0	3,385	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

270

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

914

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

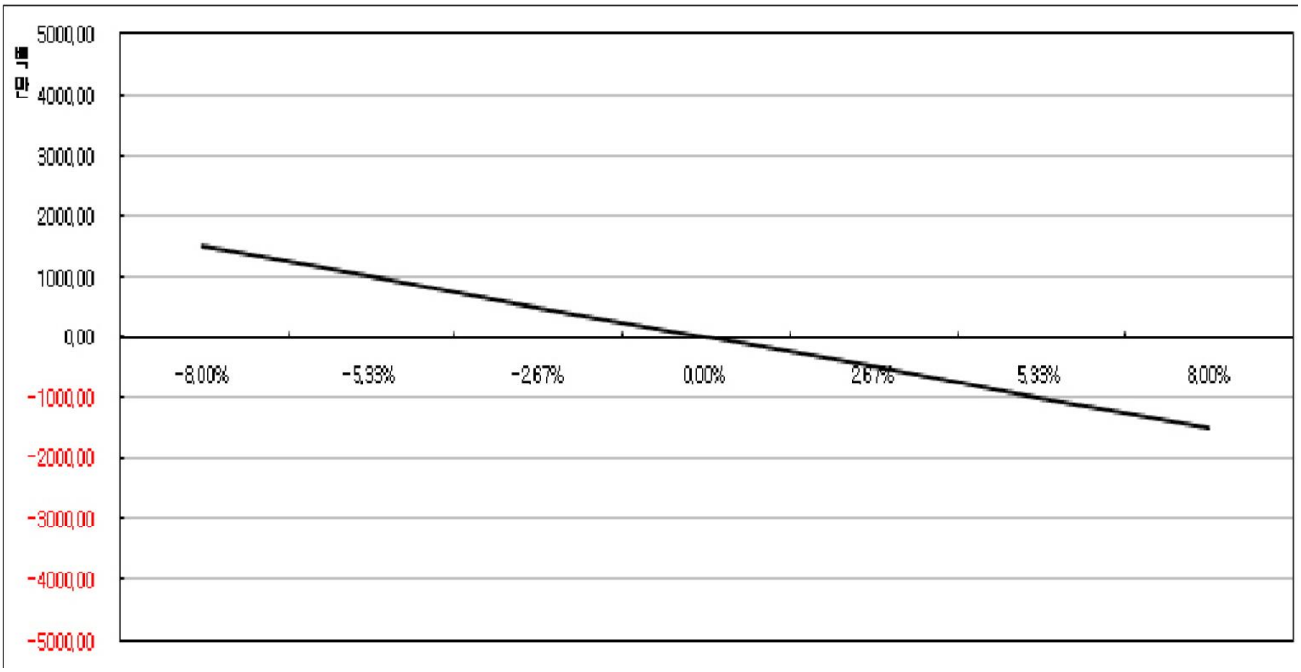
공시일: 2020-02-14

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	1,655	-1,655	장내
합계			0	1,655	-1,655	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

132

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

109

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

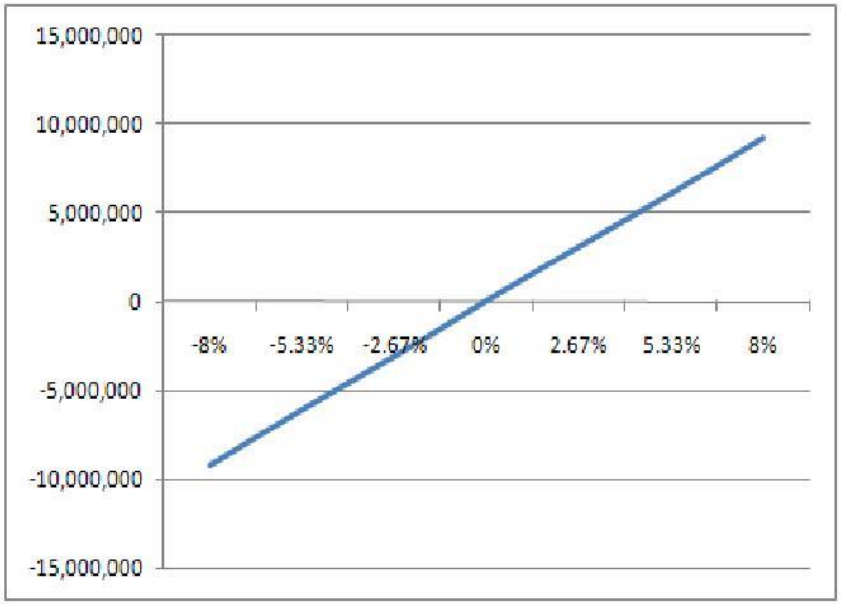
공시일: 2020-02-14

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	3,536	-3,536	장내
누계	주가지수	선물	61,691	0	61,691	장내
합계			61,691	0	61,691	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

4,927

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

8,001