펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2020-02-17

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	1,439	0	1,439	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	6	2,727	-2,722	장내
합계			1,445	2,727	-1,282	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	65

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	327

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

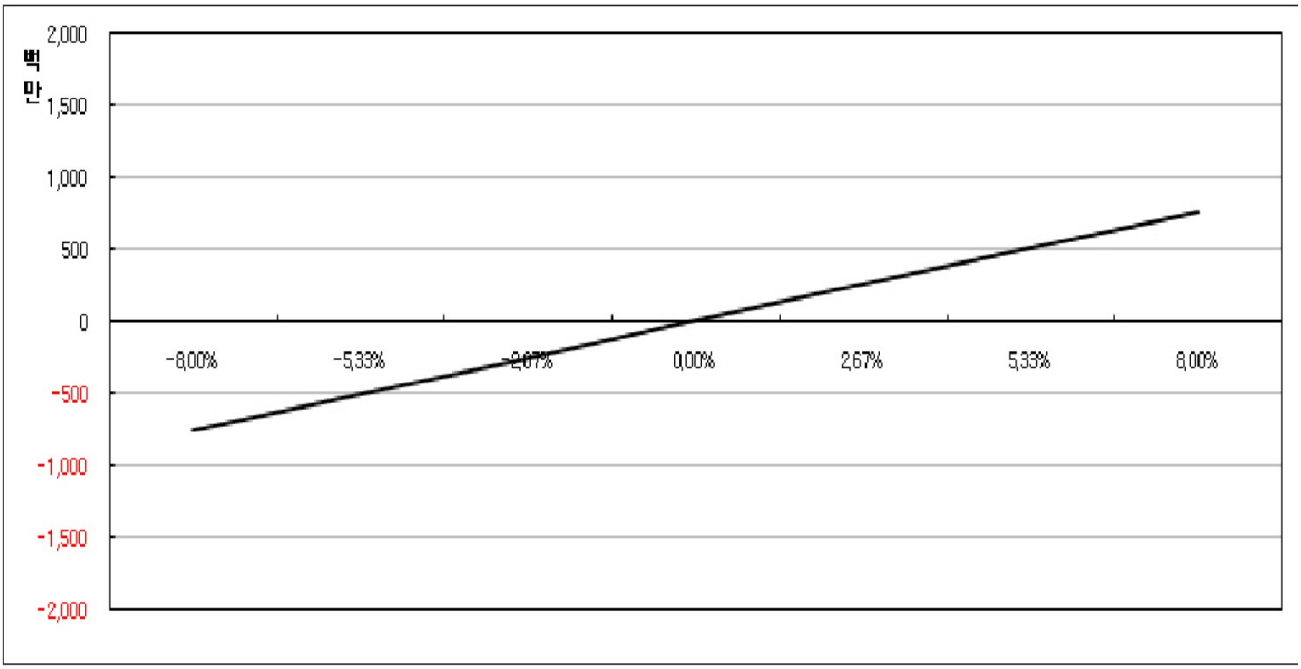
공시일: 2020-02-17

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	455	0	455	장내
합계			455	0	455	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

36

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

381

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

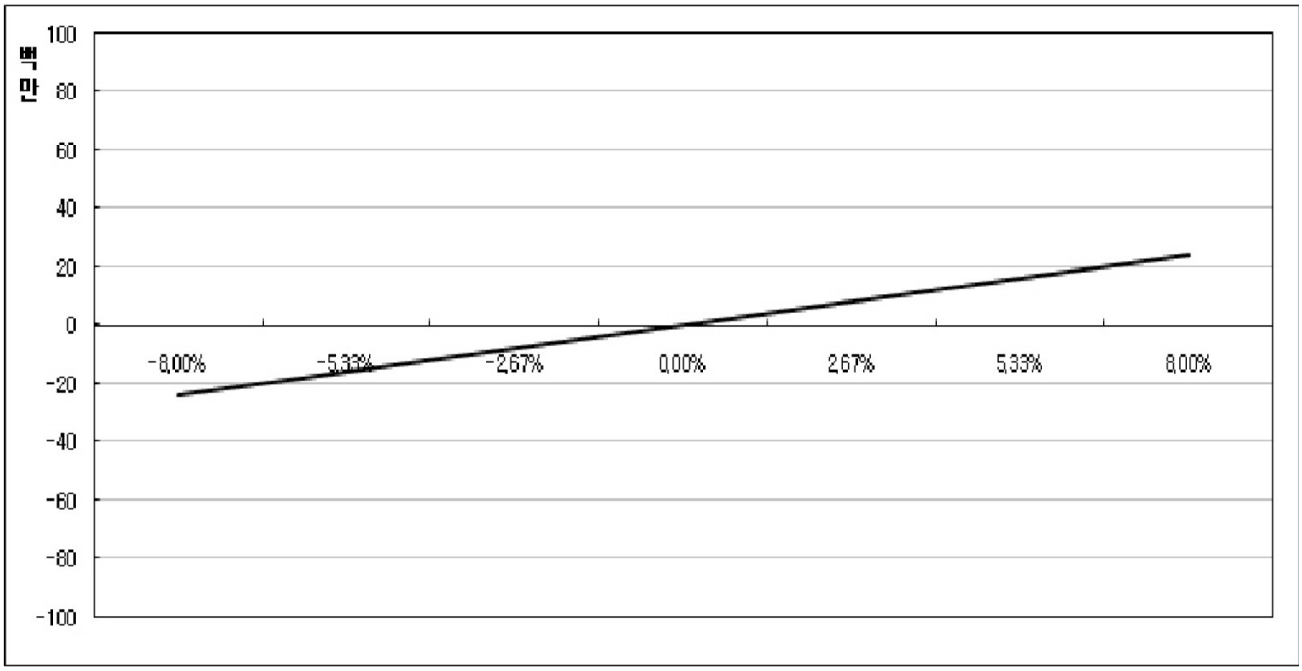
공시일: 2020-02-17

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	1,364	0	1,364	장내
합계			1,364	0	1,364	

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]

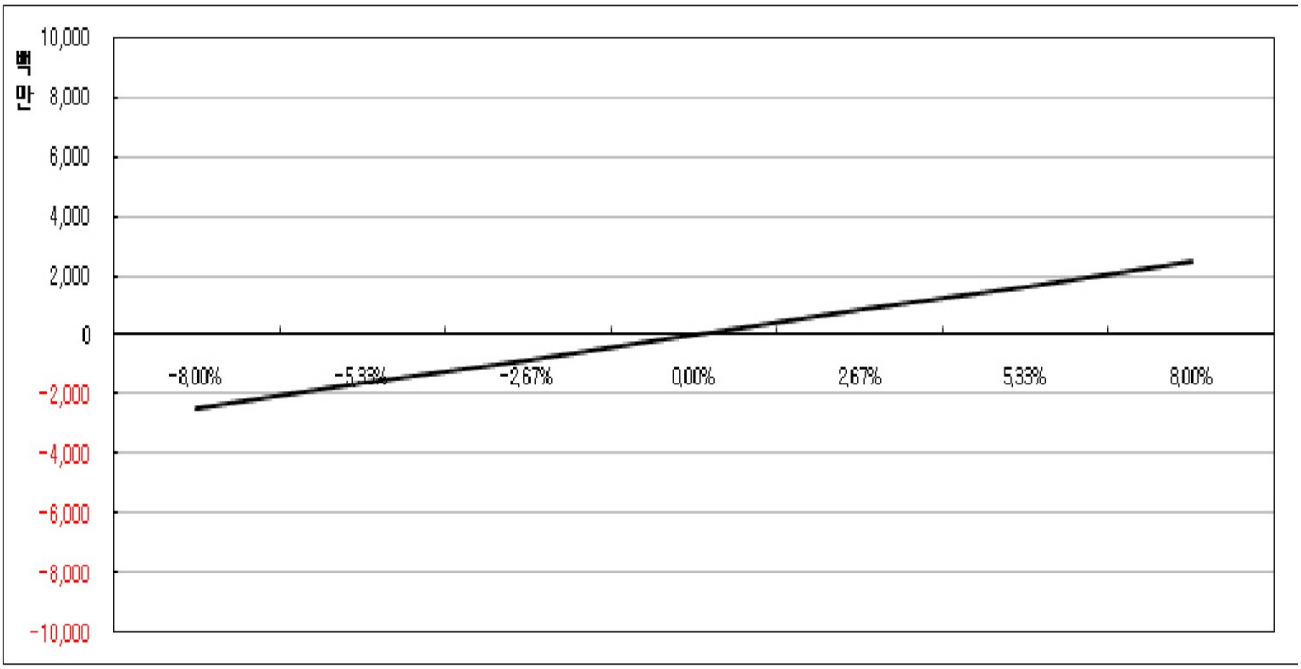
공시일: 2020-02-17

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	3,409	0	3,409	장내
합계			3,409	0	3,409	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

273

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

923

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

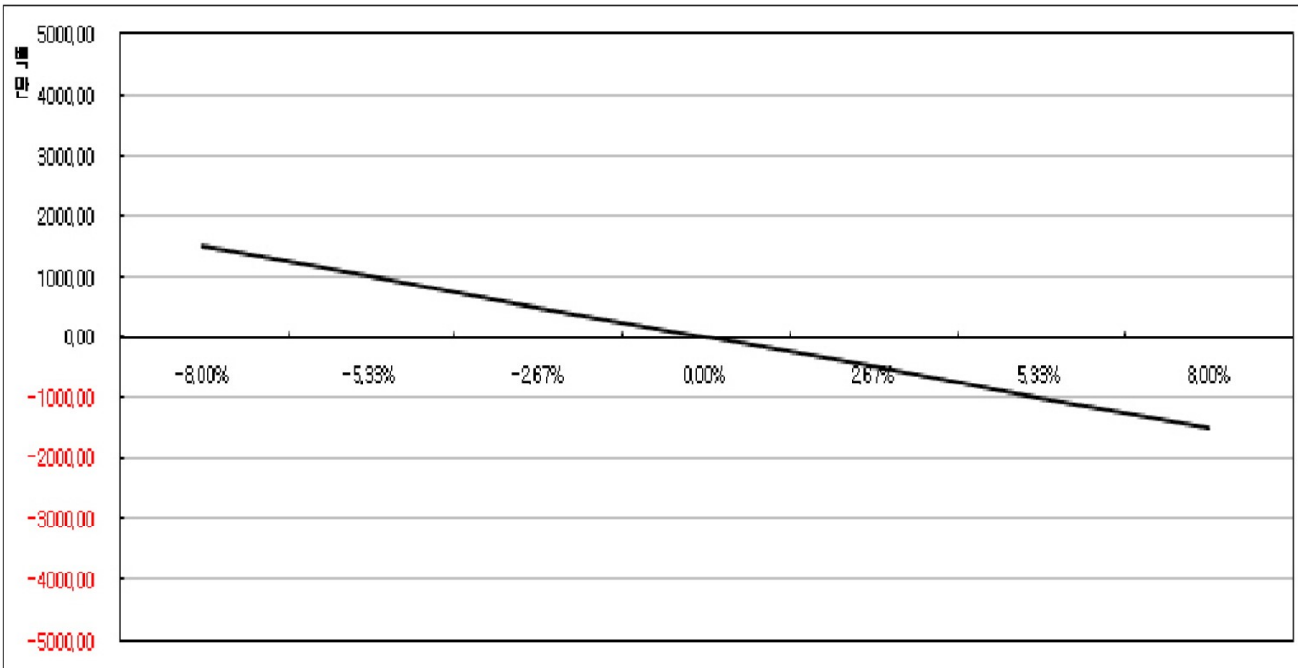
공시일: 2020-02-17

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	227	-227	장내
누계	주가지수	선물	0	1,894	-1,894	장내
합계			0	1,894	-1,894	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

152

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

125

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

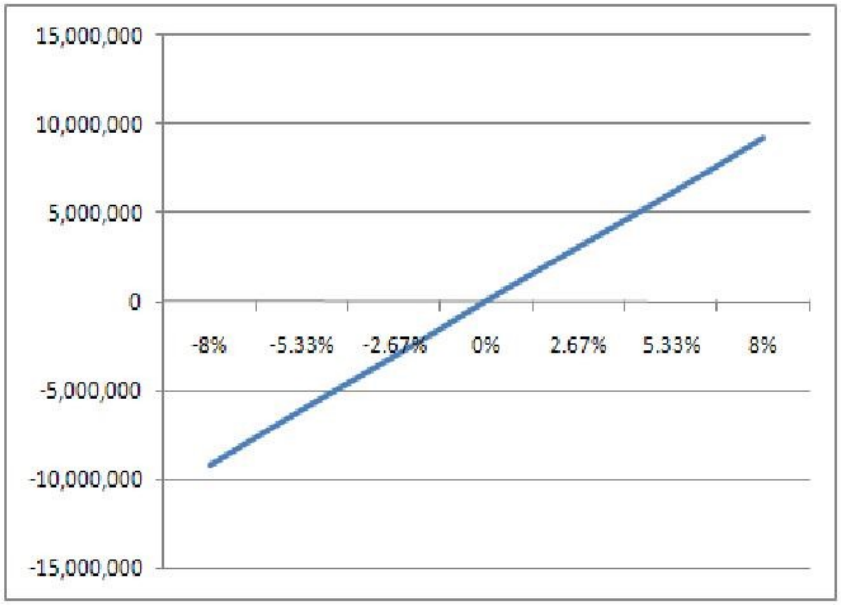
공시일: 2020-02-17

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	455	-455	장내
누계	주가지수	선물	61,663	0	61,663	장내
합계			61,663	0	61,663	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

4,939

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

8,048