펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2020-02-18

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	1,438	0	1,438	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	5	2,725	-2,719	장내
합계			1,443	2,725	-1,281	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	64

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	270

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

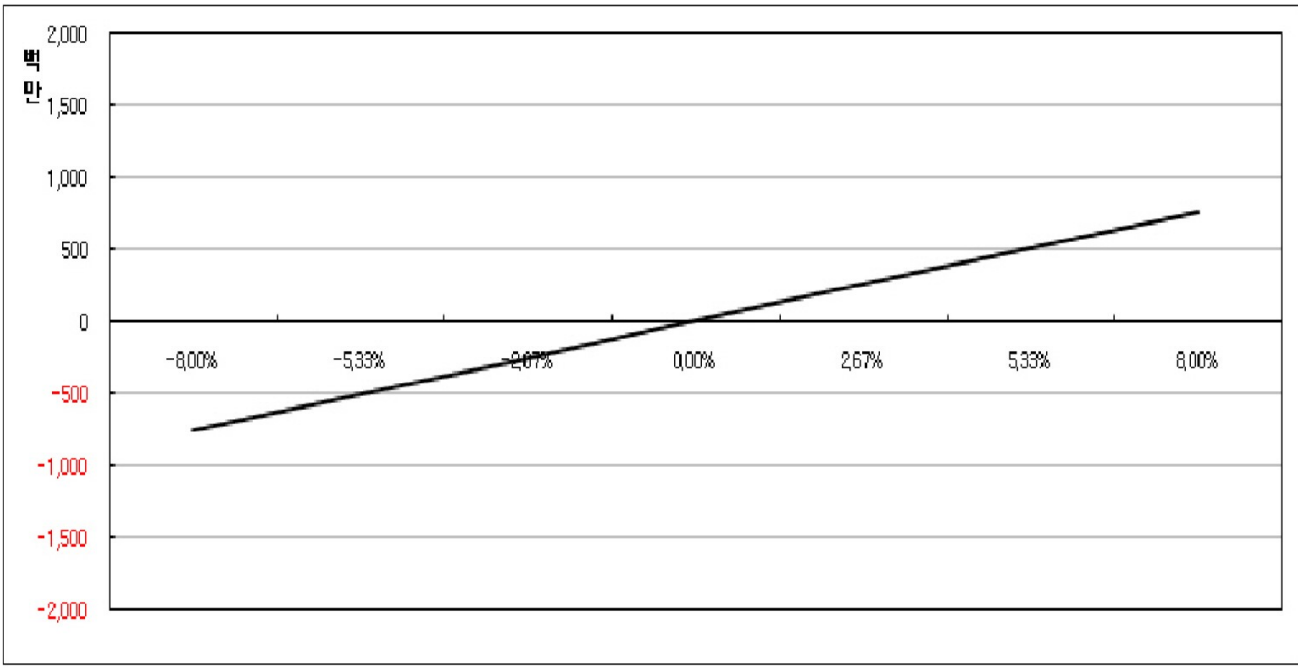
공시일: 2020-02-18

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	454	0	454	장내
합계			454	0	454	

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]

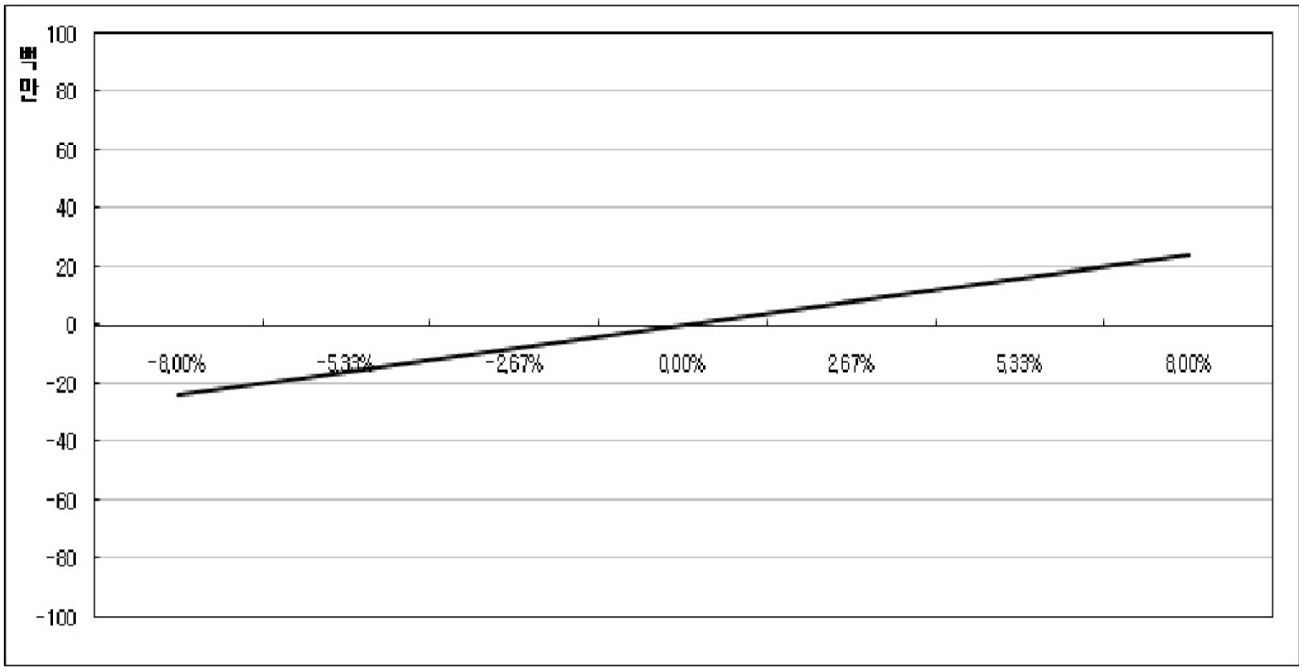
공시일: 2020-02-18

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	1,362	0	1,362	장내
합계			1,362	0	1,362	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

109

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

523

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

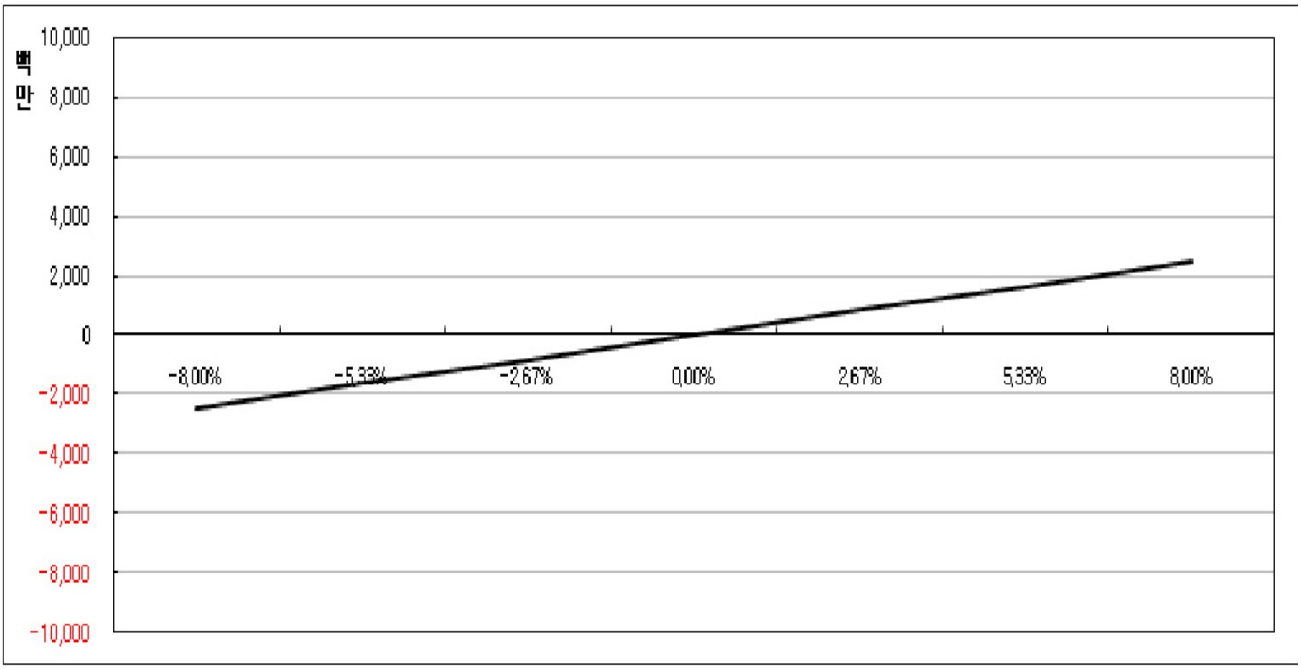
공시일: 2020-02-18

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	3,406	0	3,406	장내
합계			3,406	0	3,406	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

273

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

921

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

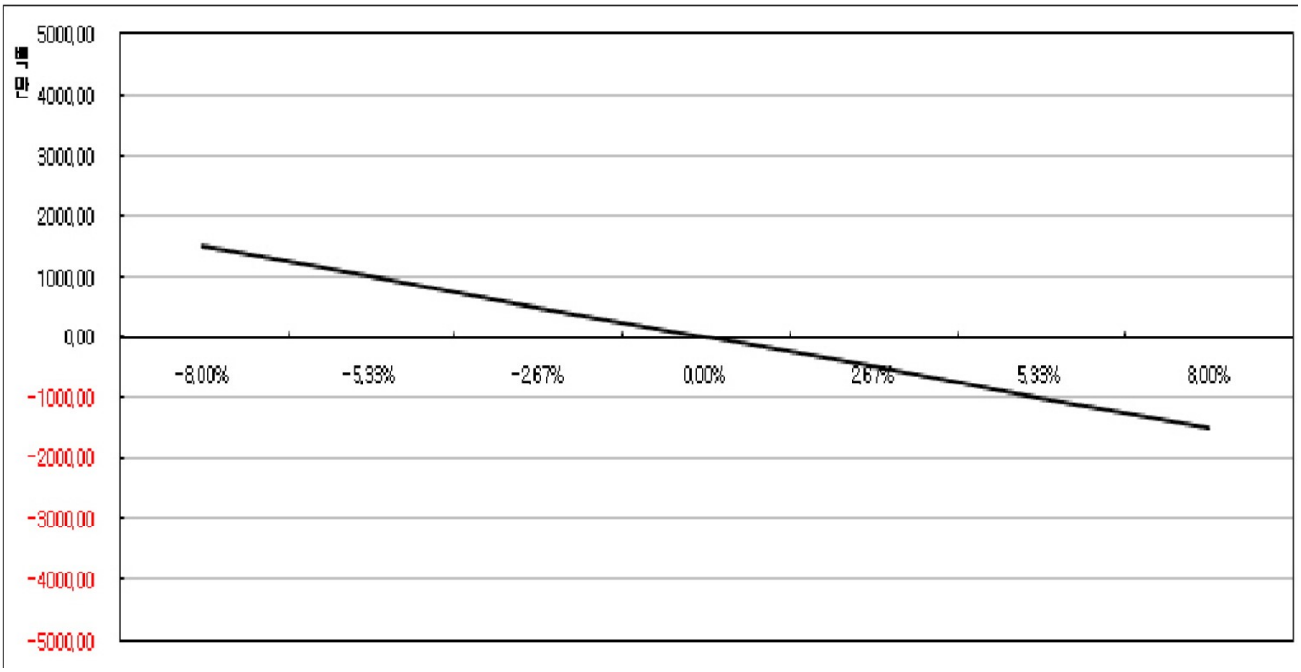
공시일: 2020-02-18

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	1,892	-1,892	장내
합계			0	1,892	-1,892	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

151

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

124

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

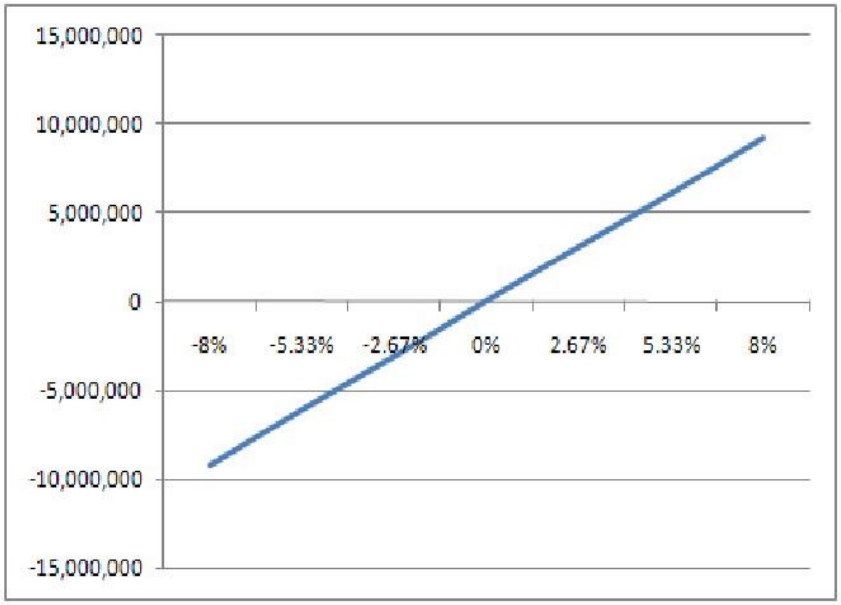
공시일: 2020-02-18

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	984	0	984	장내
누계	주가지수	선물	62,596	0	62,596	장내
합계			62,596	0	62,596	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,011

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

8,095