펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2020-02-19

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	1,414	0	1,414	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	10	2,680	-2,670	장내
합계			1,424	2,680	-1,256	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	44

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	125

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

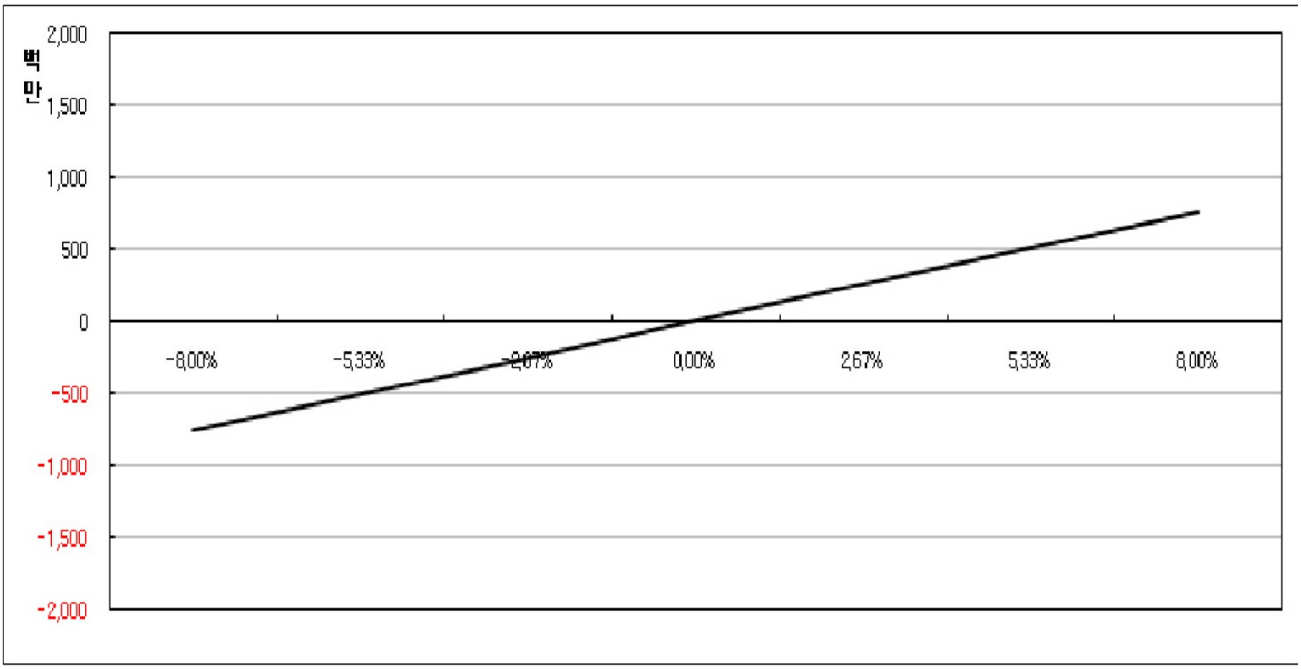
공시일: 2020-02-19

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	447	0	447	장내
합계			447	0	447	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

36

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

376

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

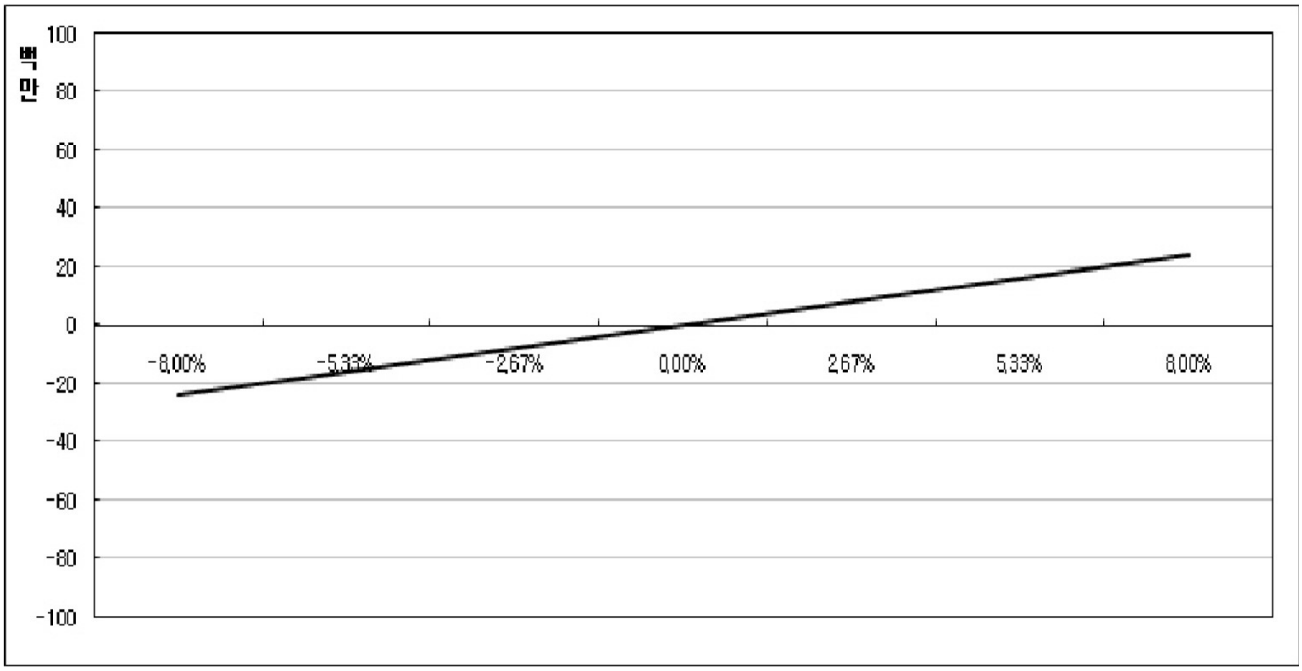
공시일: 2020-02-19

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	1,340	0	1,340	장내
합계			1,340	0	1,340	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

107

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

514

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

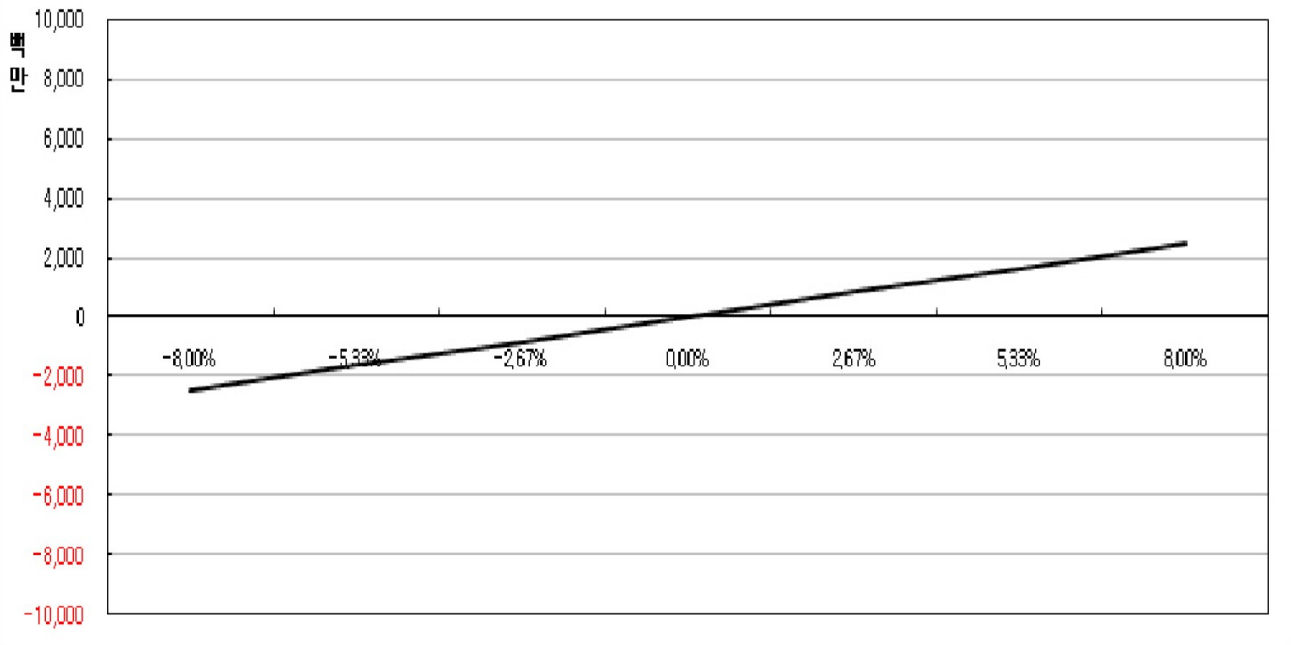
공시일: 2020-02-19

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	3,350	0	3,350	장내
합계			3,350	0	3,350	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

268

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

907

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

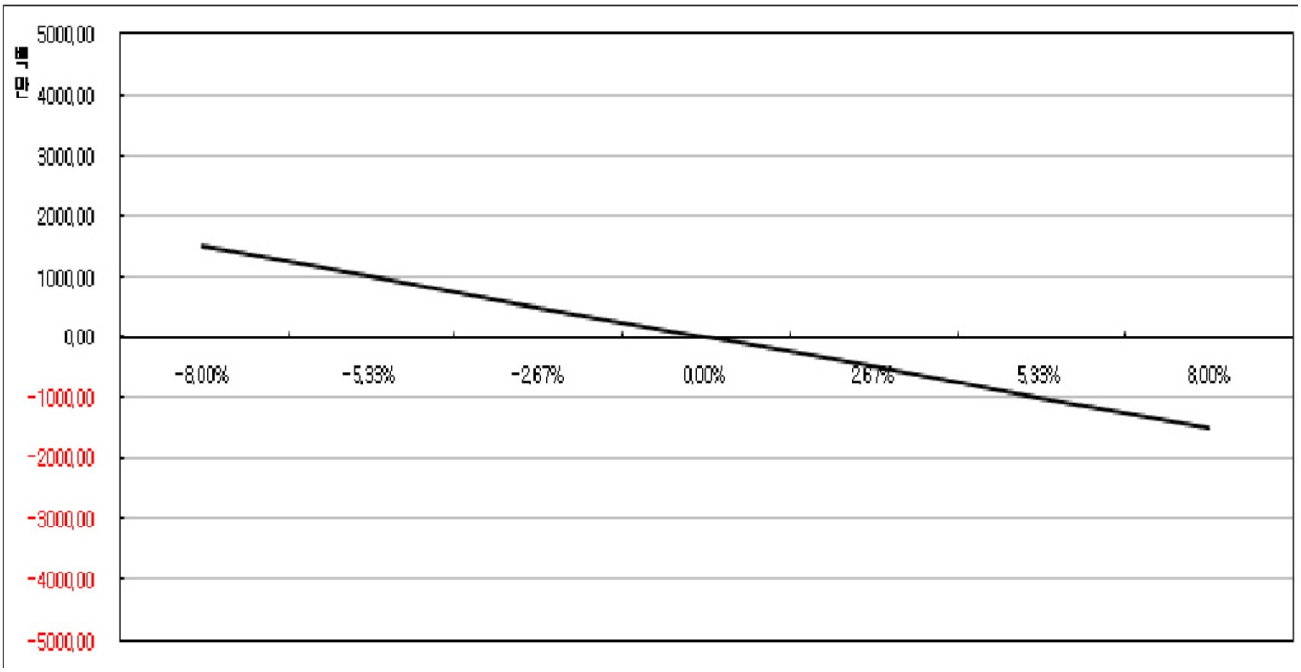
공시일: 2020-02-19

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	74	-74	장내
누계	주가지수	선물	0	1,935	-1,935	장내
합계			0	1,935	-1,935	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

155

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

128

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

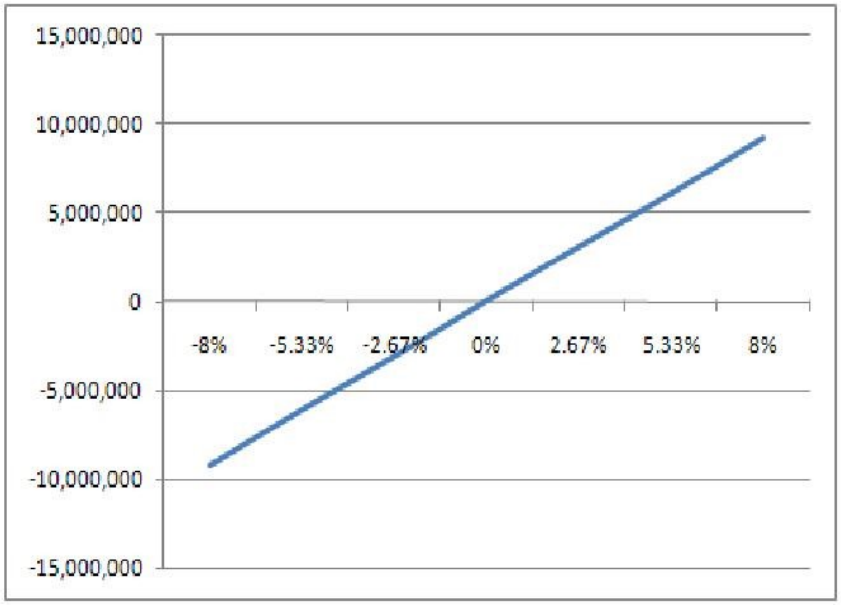
공시일: 2020-02-19

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	1,265	0	1,265	장내
누계	주가지수	선물	62,823	0	62,823	장내
합계			62,823	0	62,823	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,027

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

8,050