펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2020-02-20

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	1,417	0	1,417	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	9	2,685	-2,676	장내
합계			1,426	2,685	-1,259	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

46

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

135

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

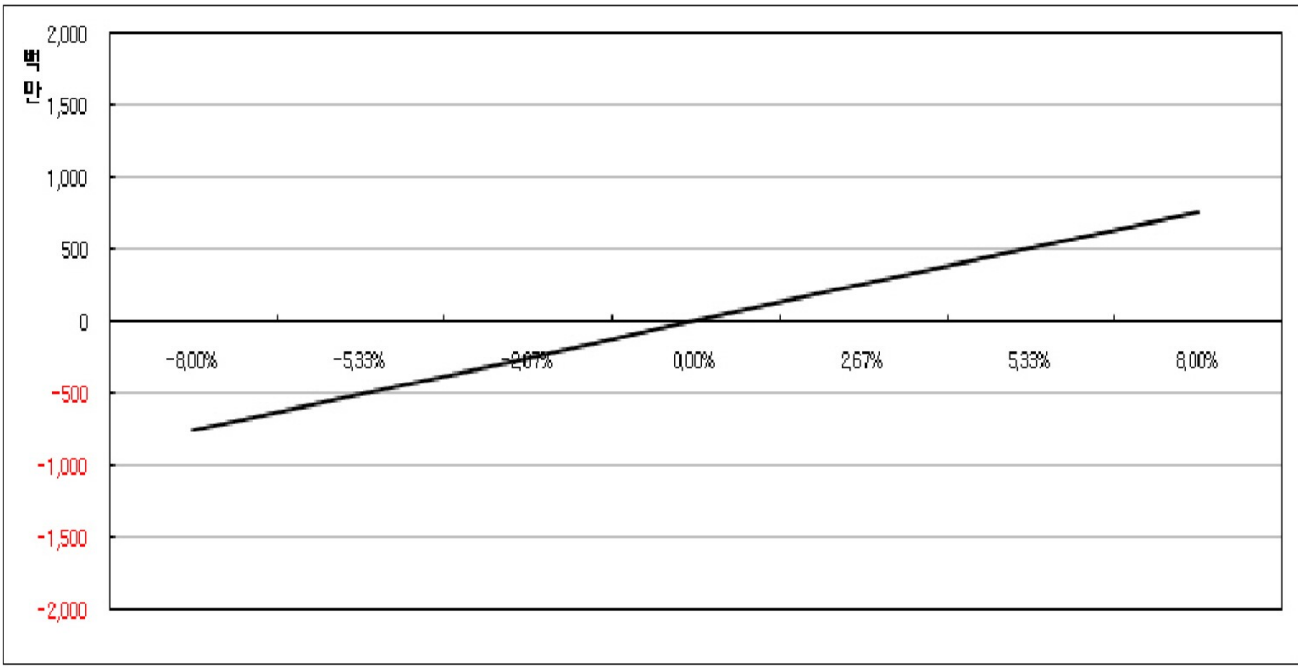
공시일: 2020-02-20

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)

377

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

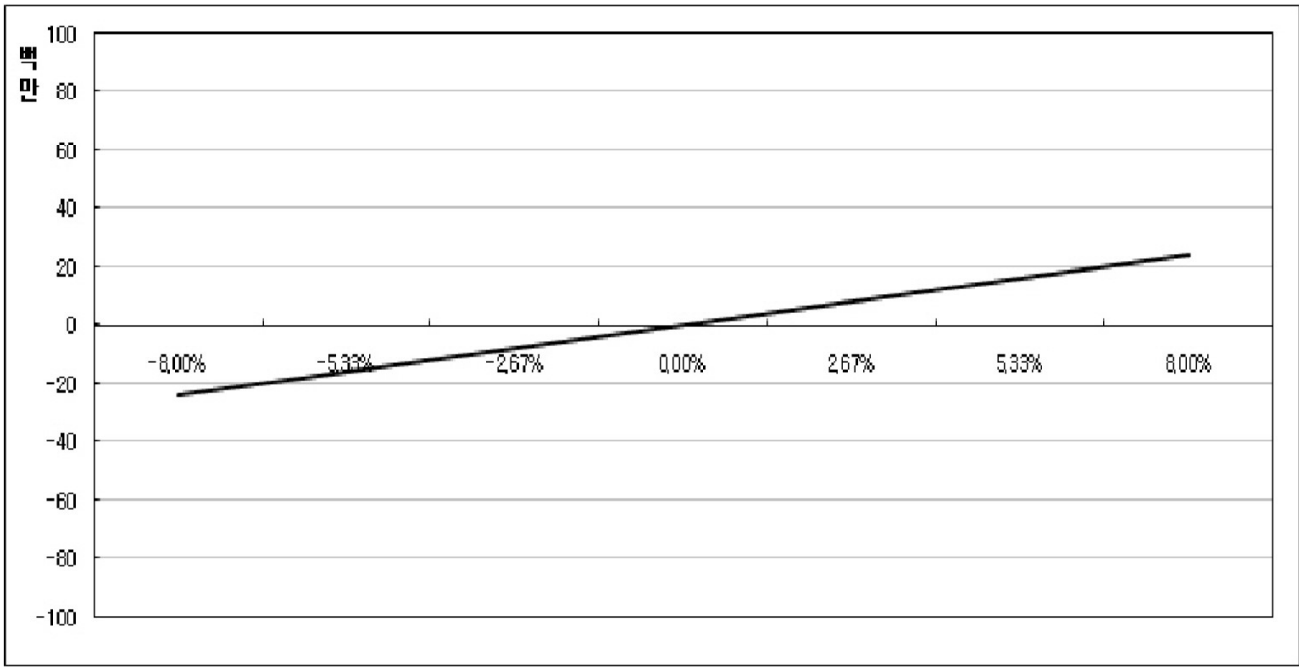
공시일: 2020-02-20

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	1,342	0	1,342	장내
합계			1,342	0	1,342	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

108

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

516

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

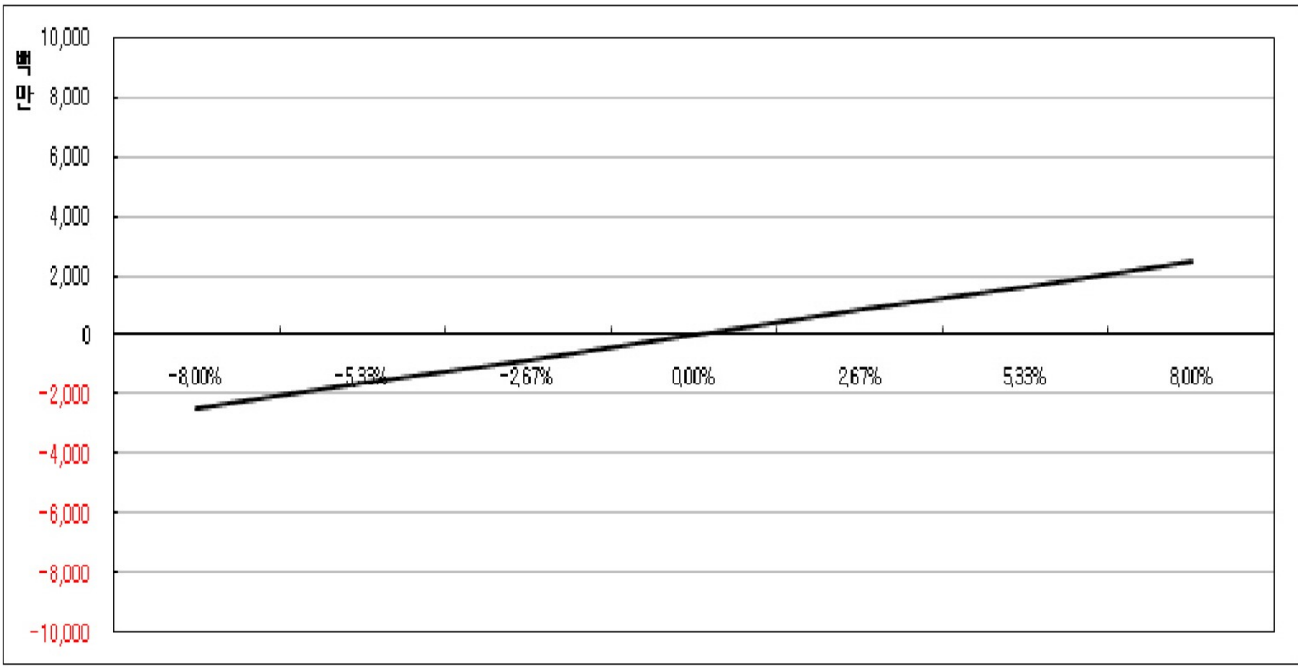
공시일: 2020-02-20

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	149	0	149	장내
누계	주가지수	선물	3,505	0	3,505	장내
합계			3,505	0	3,505	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

281

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

917

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

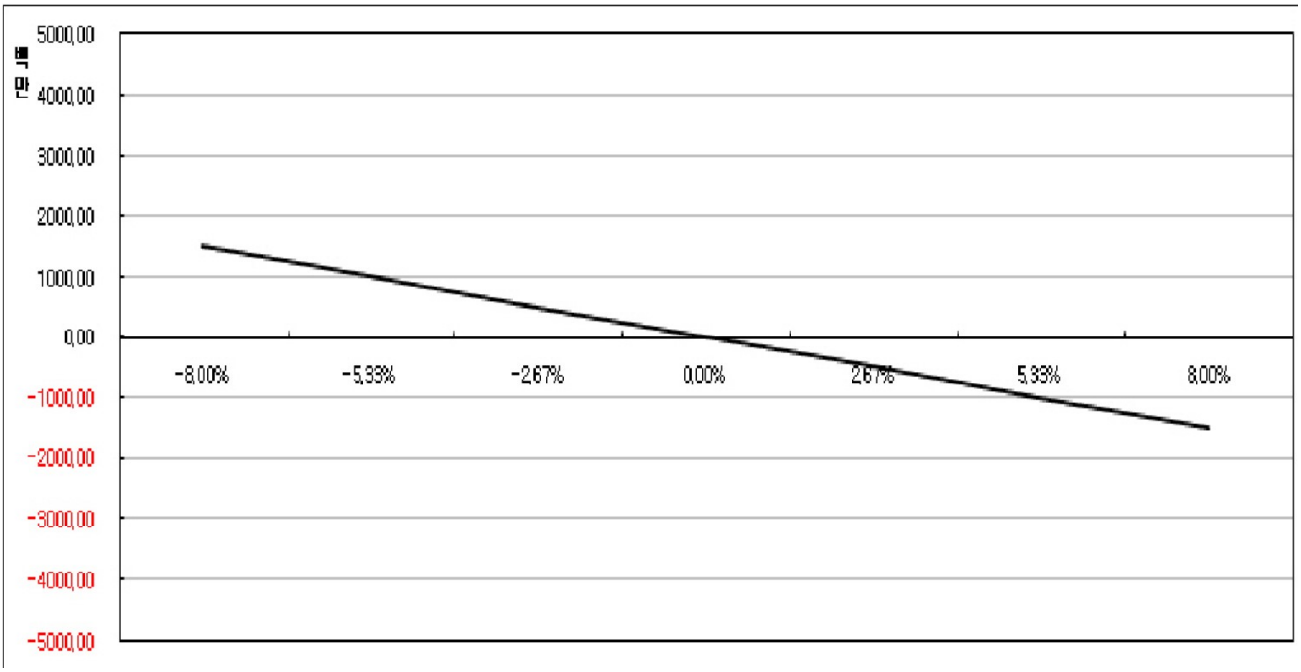
공시일: 2020-02-20

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	149	0	149	장내
누계	주가지수	선물	0	1,790	-1,790	장내
합계			0	1,790	-1,790	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

143

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

118

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

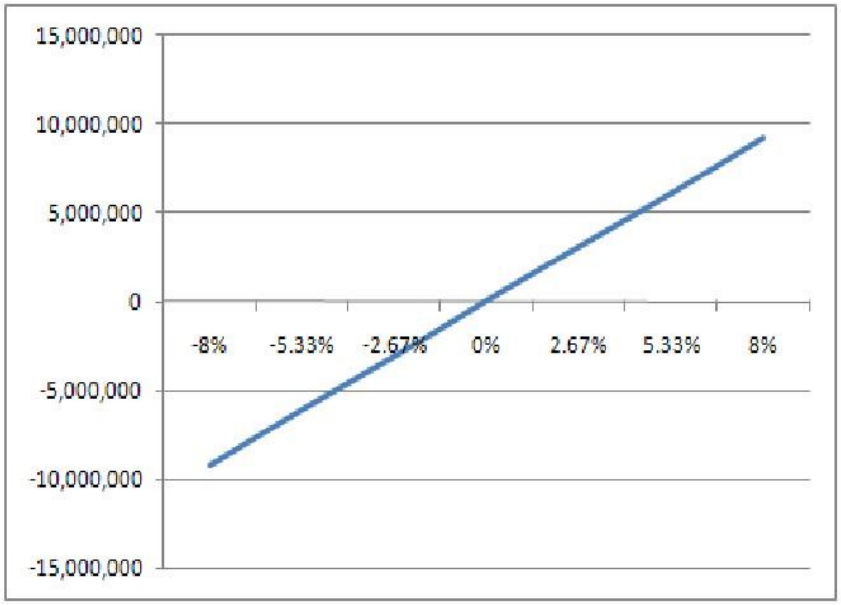
공시일: 2020-02-20

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	4,475	0	4,475	장내
누계	주가지수	선물	67,423	0	67,423	장내
합계			67,423	0	67,423	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,401

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

8,340