펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2020-02-24

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	1,316	0	1,316	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	16	2,412	-2,396	장내
합계			1,332	2,412	-1,080	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	43

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	126

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

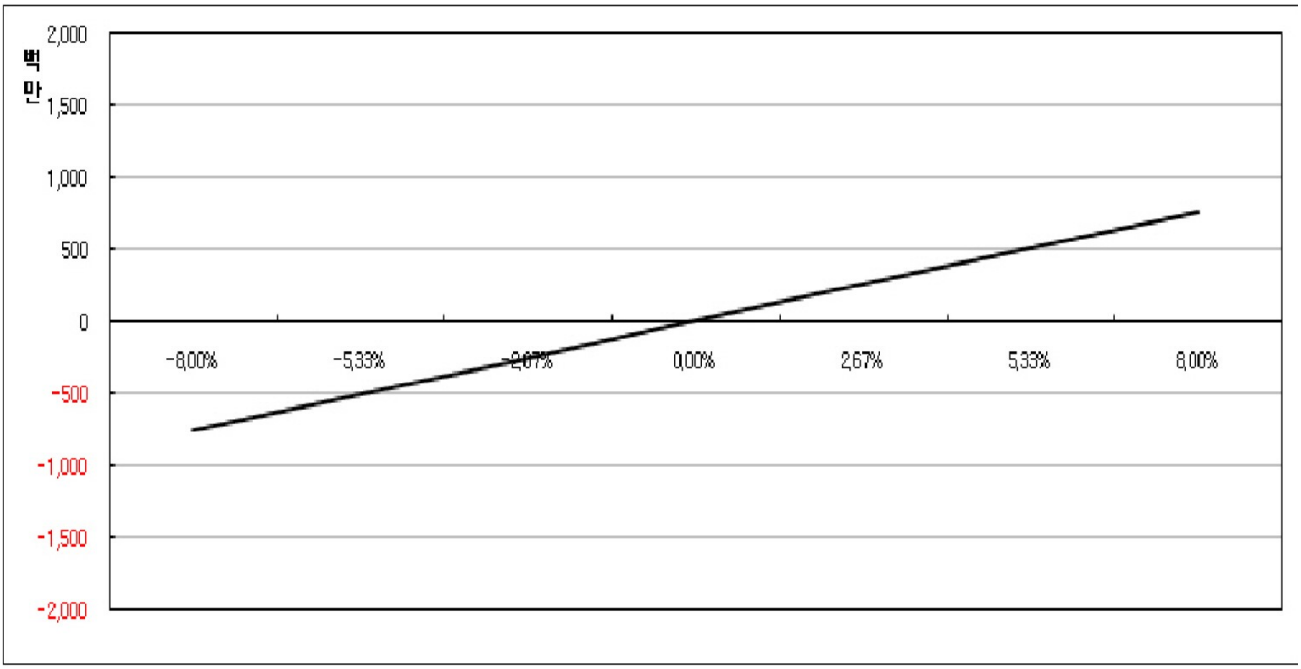
공시일: 2020-02-24

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	439	0	439	장내
합계			439	0	439	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

35

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

373

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

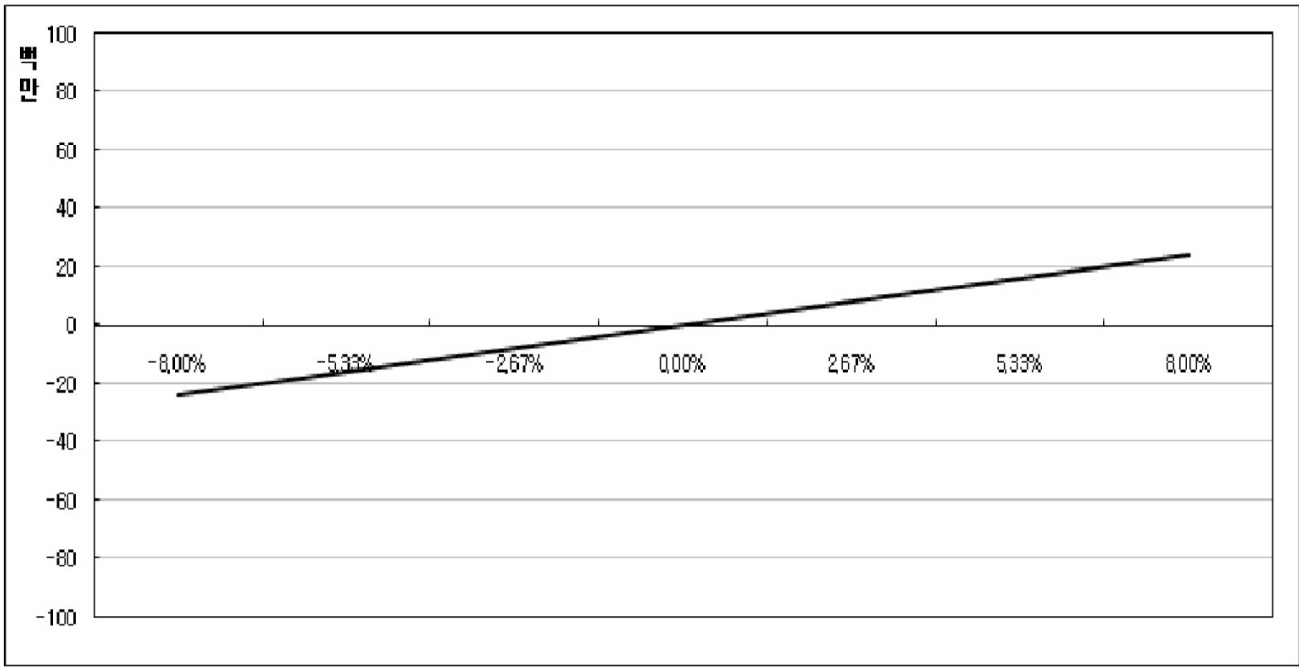
공시일: 2020-02-24

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	1,316	0	1,316	장내
합계			1,316	0	1,316	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

105

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

513

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

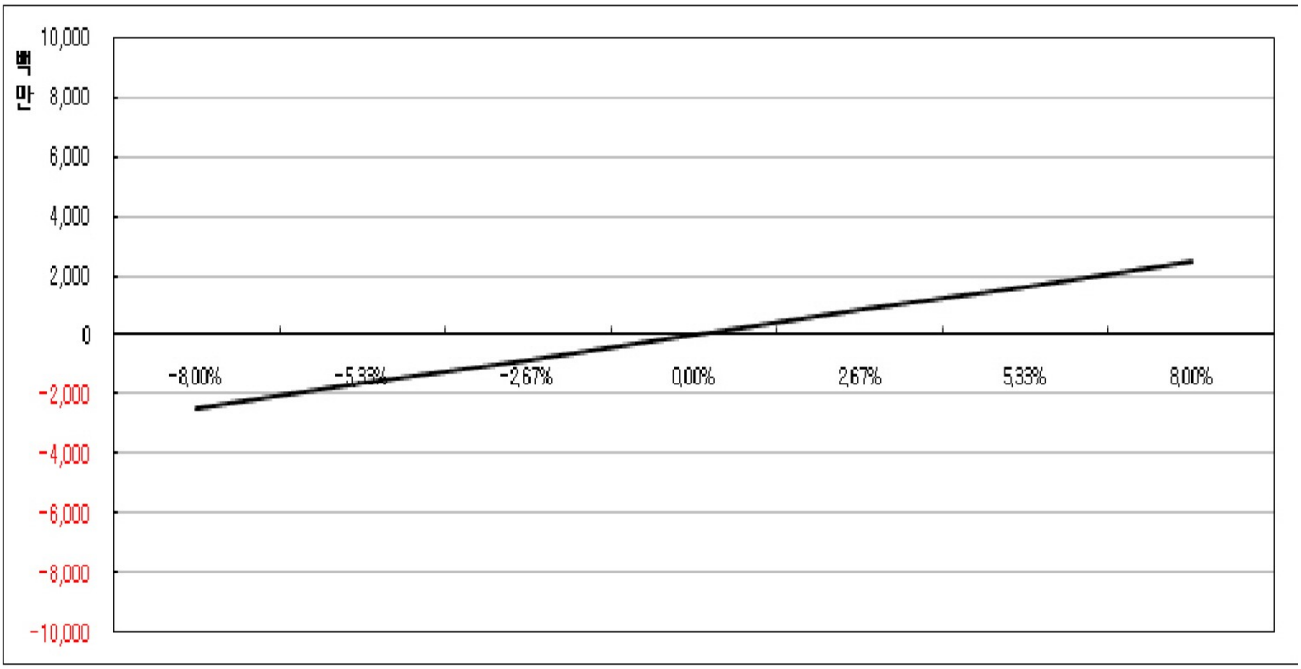
공시일: 2020-02-24

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	292	-292	장내
누계	주가지수	선물	3,217	0	3,217	장내
합계			3,217	0	3,217	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

257

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

896

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

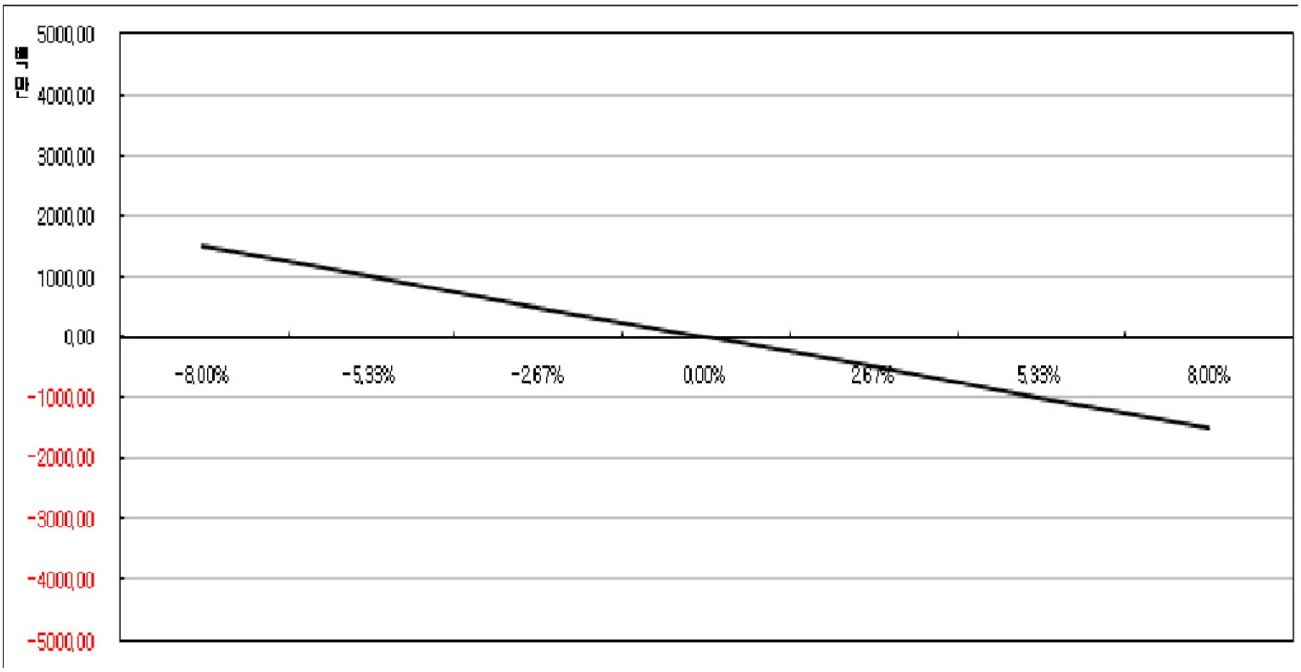
공시일: 2020-02-24

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	146	-146	장내
누계	주가지수	선물	0	1,901	-1,901	장내
합계			0	1,901	-1,901	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

152

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

126

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

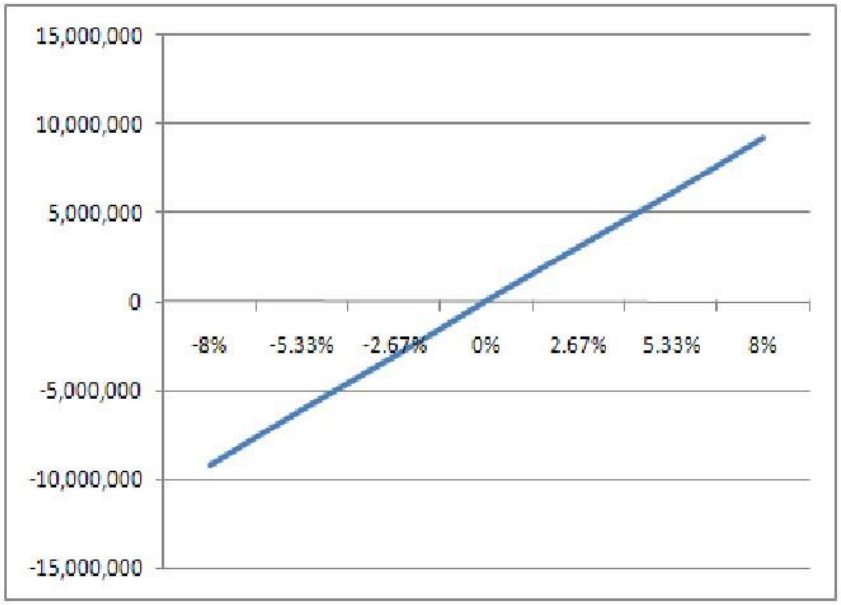
공시일: 2020-02-24

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	2,486	0	2,486	장내
누계	주가지수	선물	69,742	0	69,742	장내
합계			69,742	0	69,742	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,569

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

8,462