펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2020-02-25

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	1,265	0	1,265	장내
신규	주가지수	옵션	1	0	1	장내
누계	주가지수	옵션	39	1,194	-1,155	장내
합계			1,303	1,194	109	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	37

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	265

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

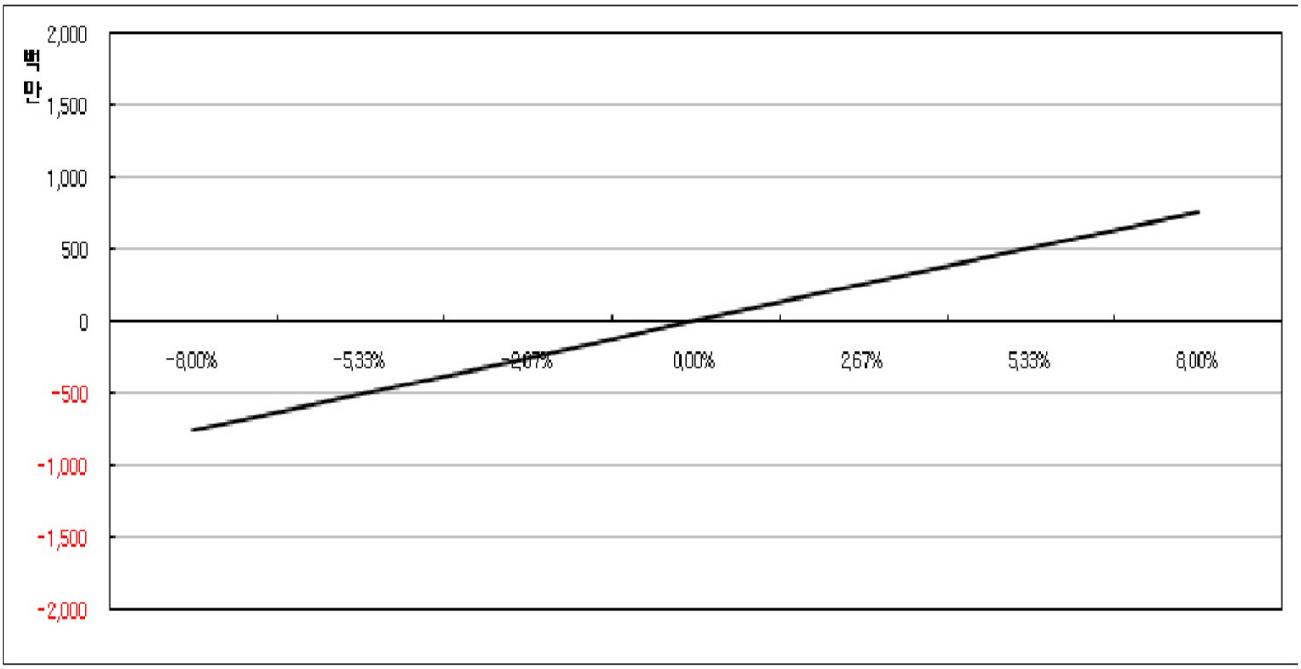
공시일: 2020-02-25

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	422	0	422	장내
합계			422	0	422	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

34

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

371

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

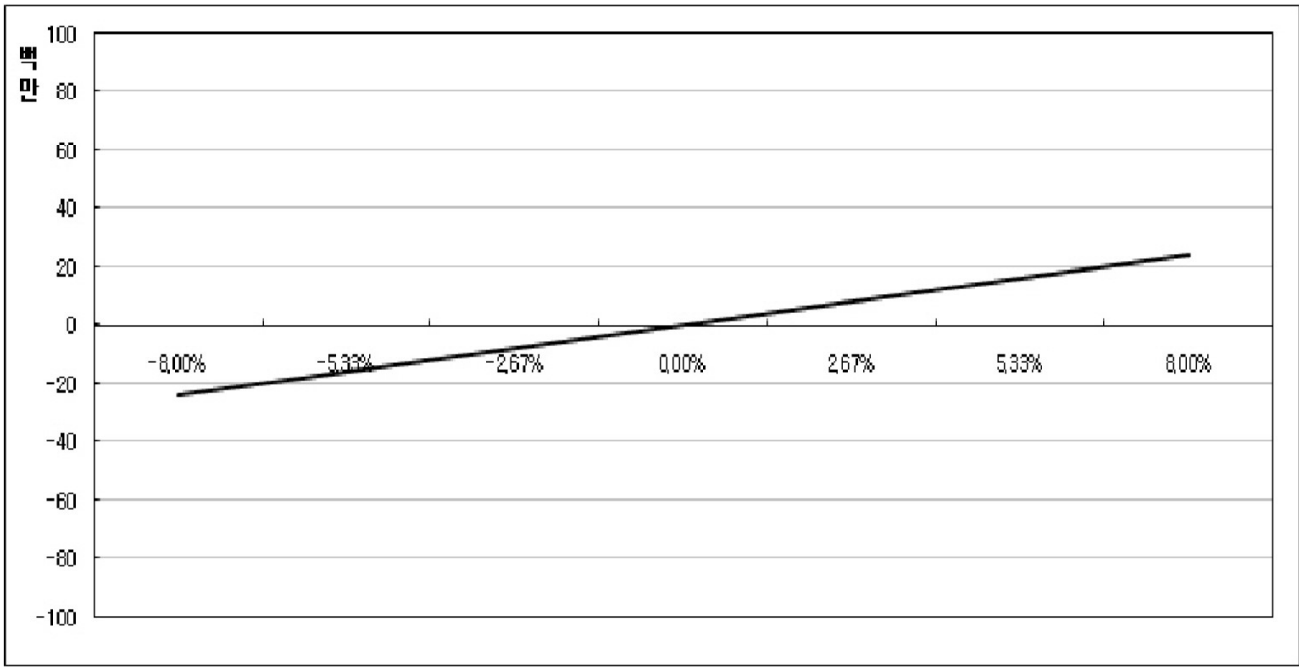
공시일: 2020-02-25

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	1,265	0	1,265	장내
합계			1,265	0	1,265	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

101

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

511

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

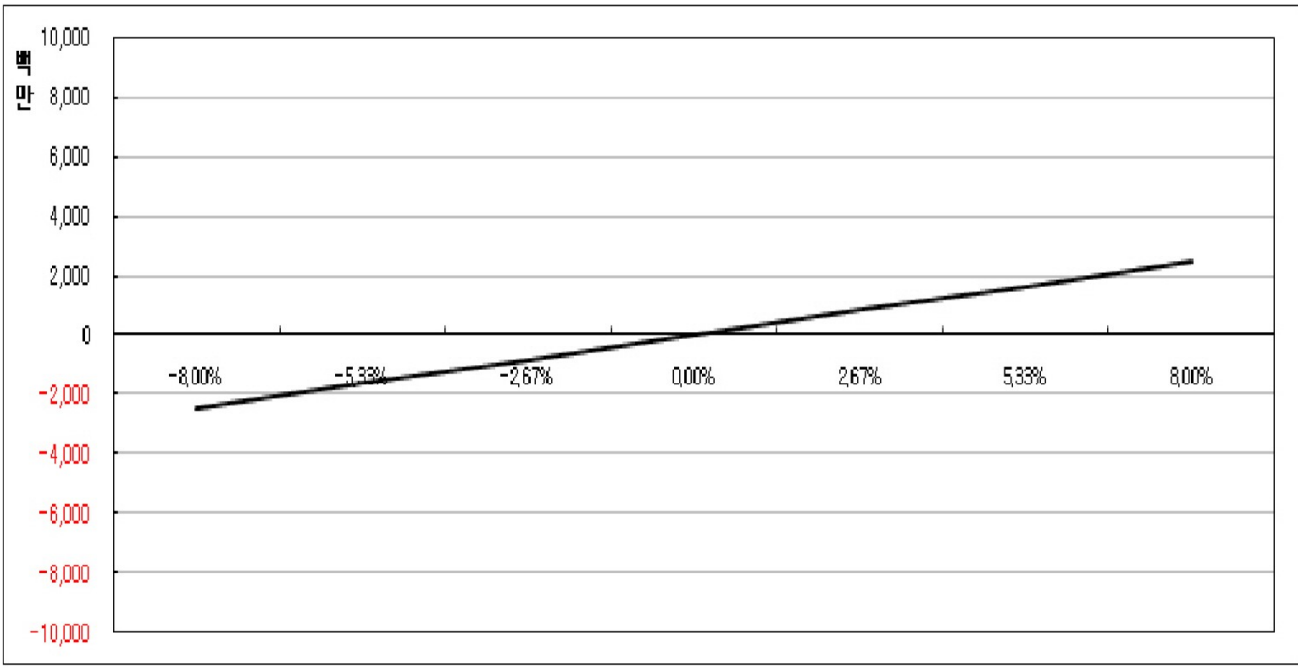
공시일: 2020-02-25

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	3,091	0	3,091	장내
합계			3,091	0	3,091	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

247

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

893

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

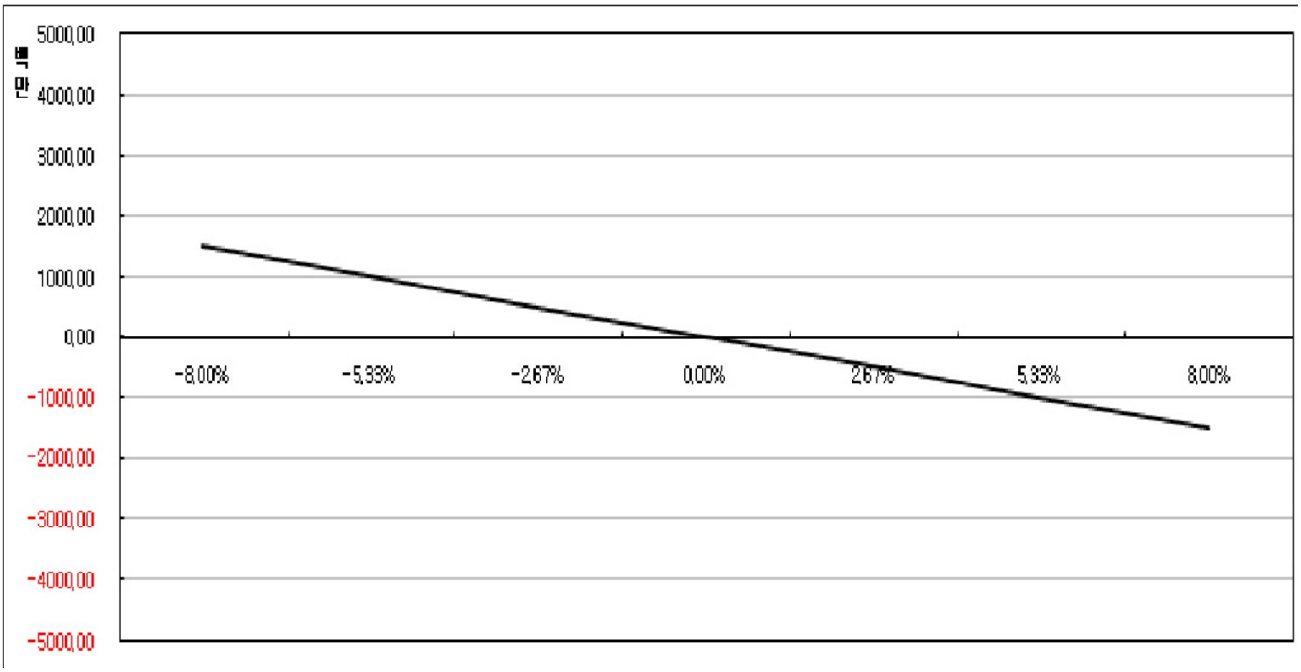
공시일: 2020-02-25

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	1,827	-1,827	장내
합계			0	1,827	-1,827	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

146

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

126

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

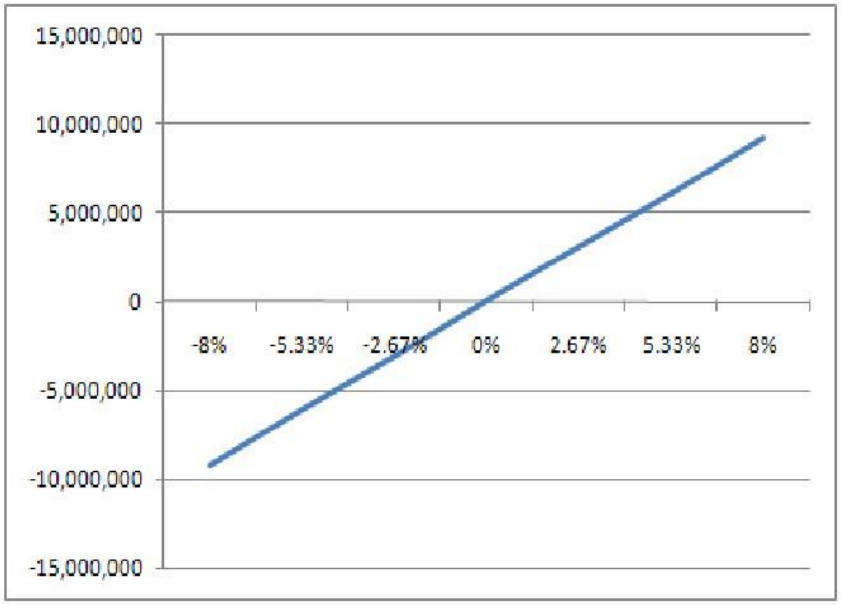
공시일: 2020-02-25

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	843	0	843	장내
누계	주가지수	선물	67,866	0	67,866	장내
합계			67,866	0	67,866	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,432

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

8,508