펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2020-02-26

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	1,279	0	1,279	장내
신규	주가지수	옵션	2	0	2	장내
누계	주가지수	옵션	30	0	30	장내
합계			1,309	0	1,309	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	40

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	227

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

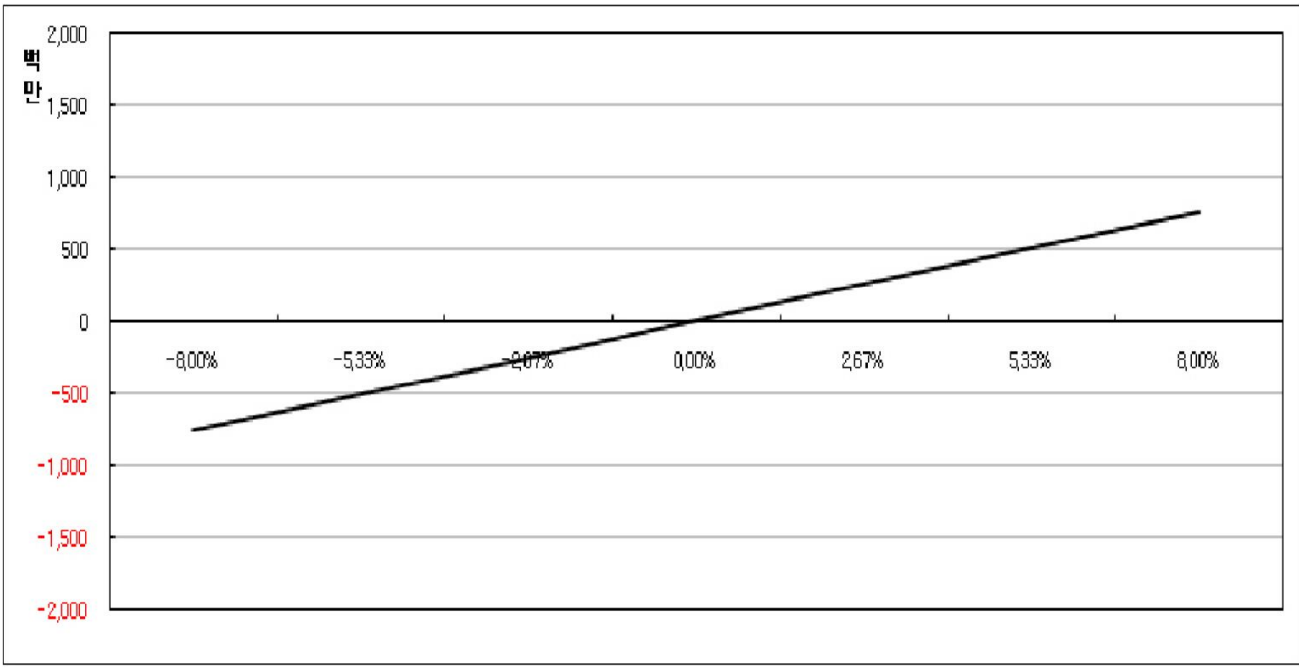
공시일: 2020-02-26

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	426	0	426	장내
합계			426	0	426	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

34

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

376

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

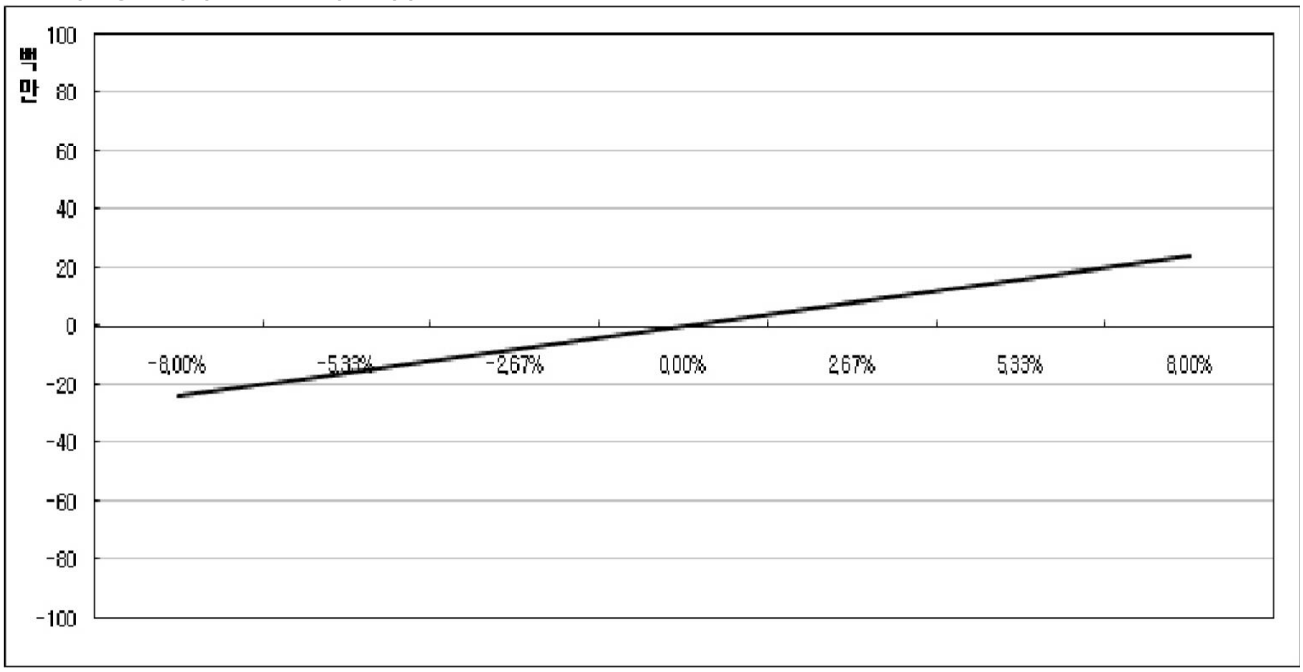
공시일: 2020-02-26

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	142	0	142	장내
누계	주가지수	선물	1,421	0	1,421	장내
합계			1,421	0	1,421	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

114

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

527

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

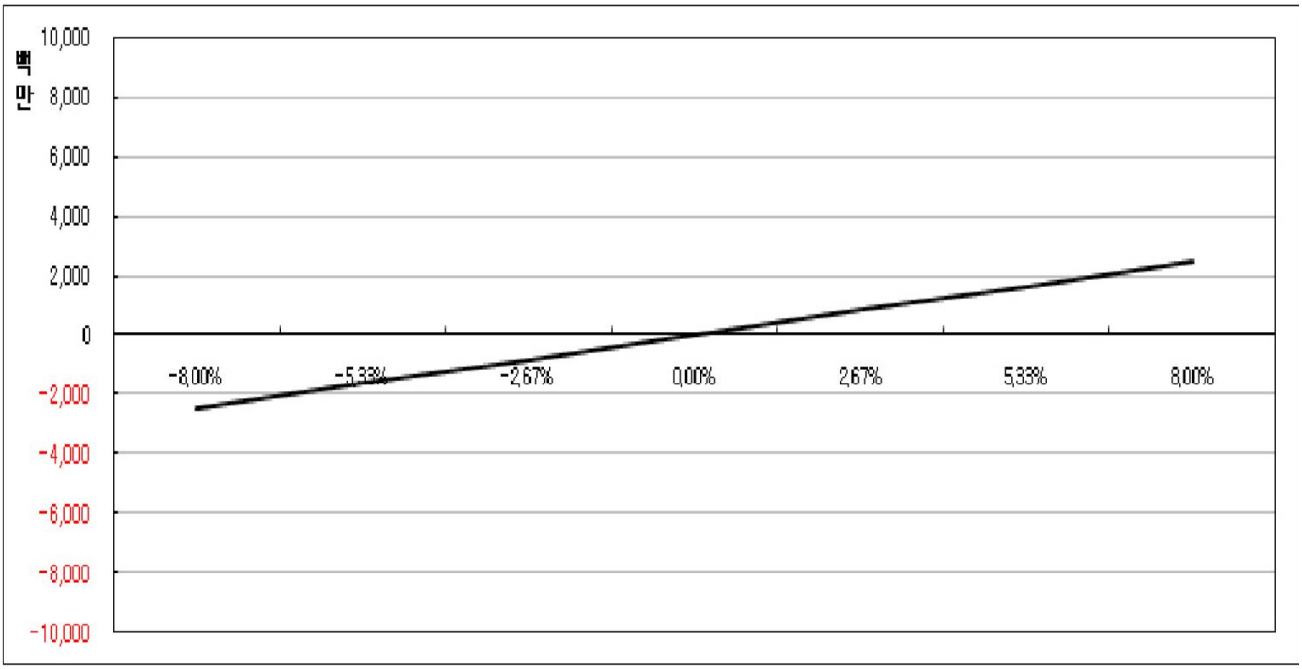
공시일: 2020-02-26

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	568	0	568	장내
누계	주가지수	선물	3,695	0	3,695	장내
합계			3,695	0	3,695	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

296

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

938

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

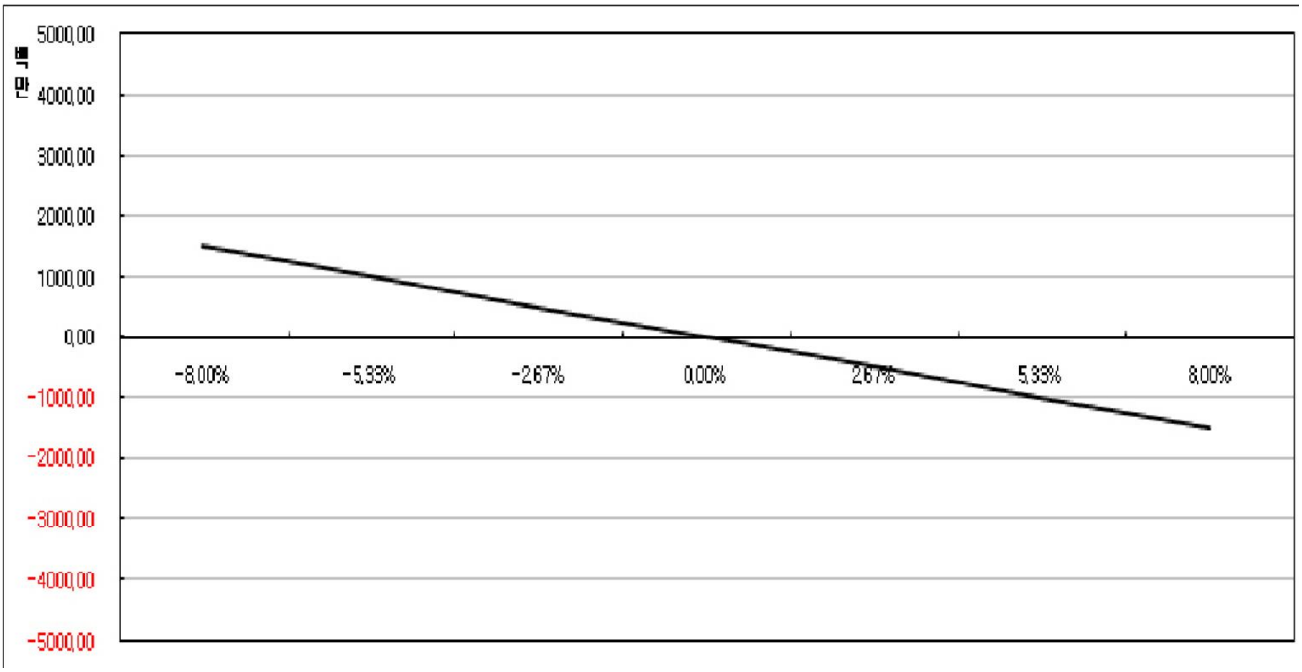
공시일: 2020-02-26

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	142	0	142	장내
누계	주가지수	선물	0	1,705	-1,705	장내
합계			0	1,705	-1,705	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

137

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

118

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

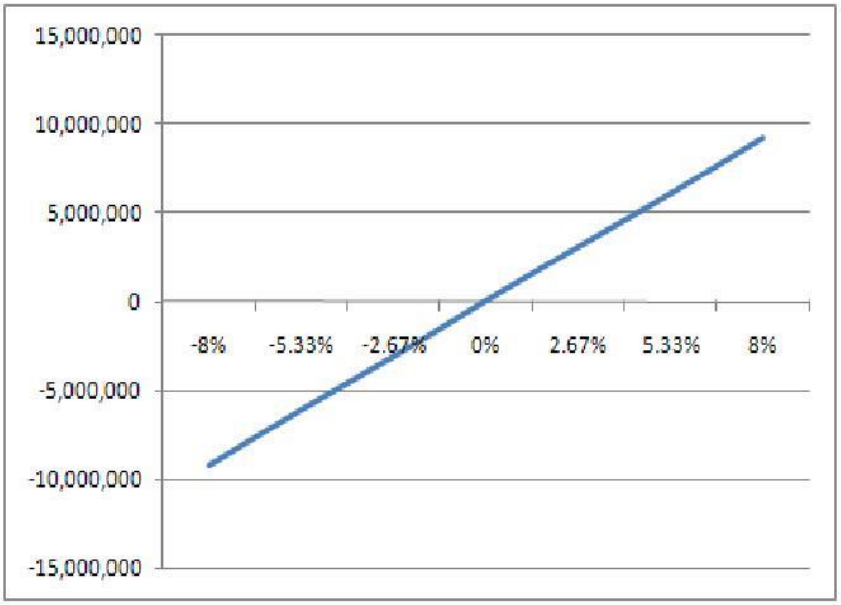
공시일: 2020-02-26

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	6,040	0	6,040	장내
누계	주가지수	선물	74,684	0	74,684	장내
합계			74,684	0	74,684	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,984

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

9,025