펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2020-02-27

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	1,260	0	1,260	장내
신규	주가지수	옵션	0	70	-70	장내
누계	주가지수	옵션	38	0	38	장내
합계			1,297	0	1,297	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	42

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	246

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

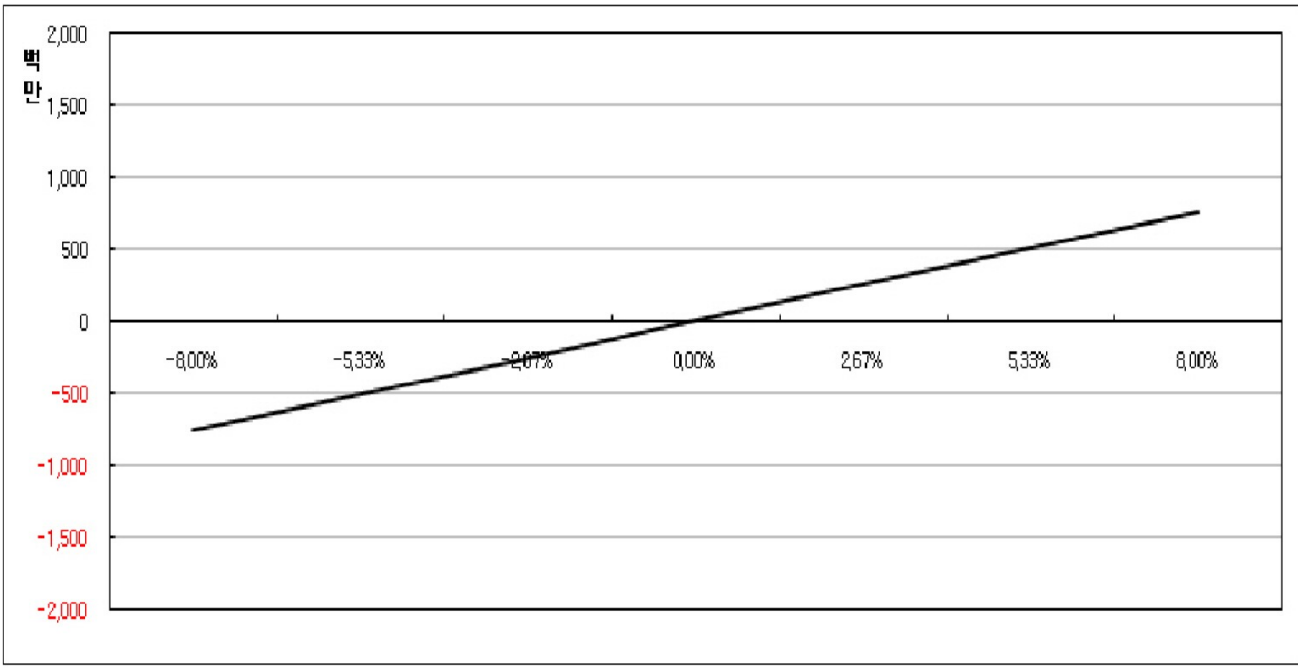
공시일: 2020-02-27

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	420	0	420	장내
합계			420	0	420	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

34

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

369

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

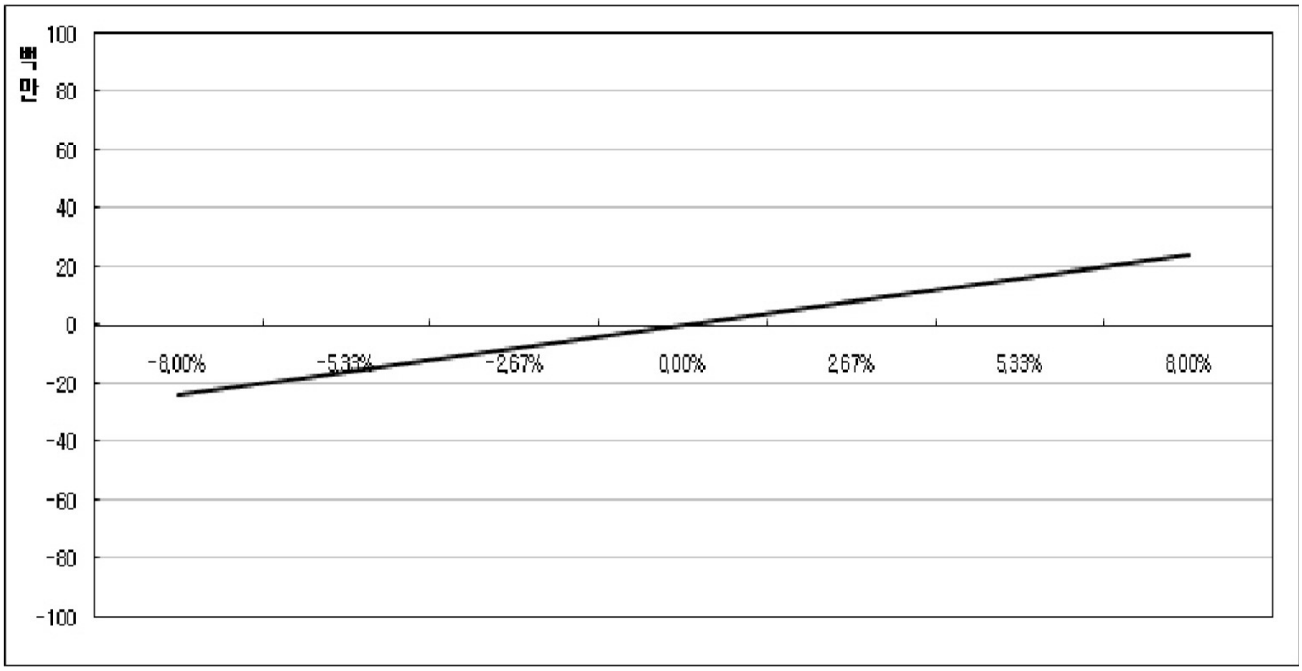
공시일: 2020-02-27

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	70	-70	장내
누계	주가지수	선물	1,330	0	1,330	장내
합계			1,330	0	1,330	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

106

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

512

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

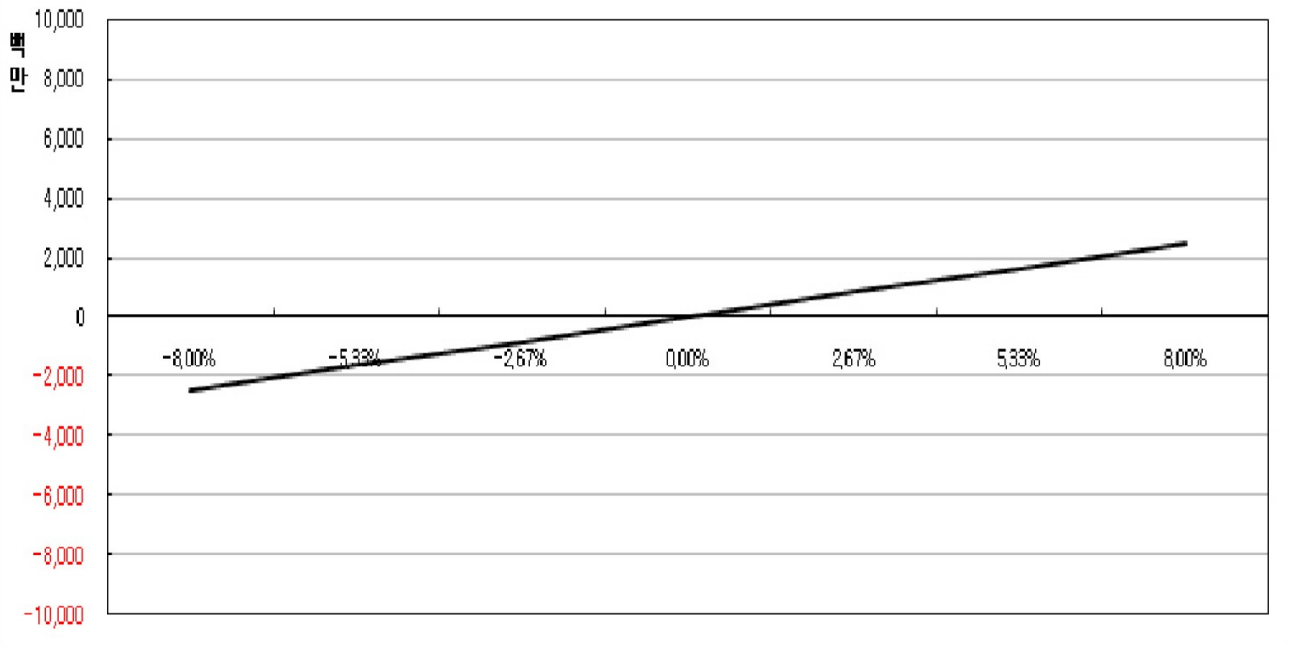
공시일: 2020-02-27

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	280	140	140	장내
누계	주가지수	선물	3,779	0	3,779	장내
합계			3,779	0	3,779	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

302

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

927

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

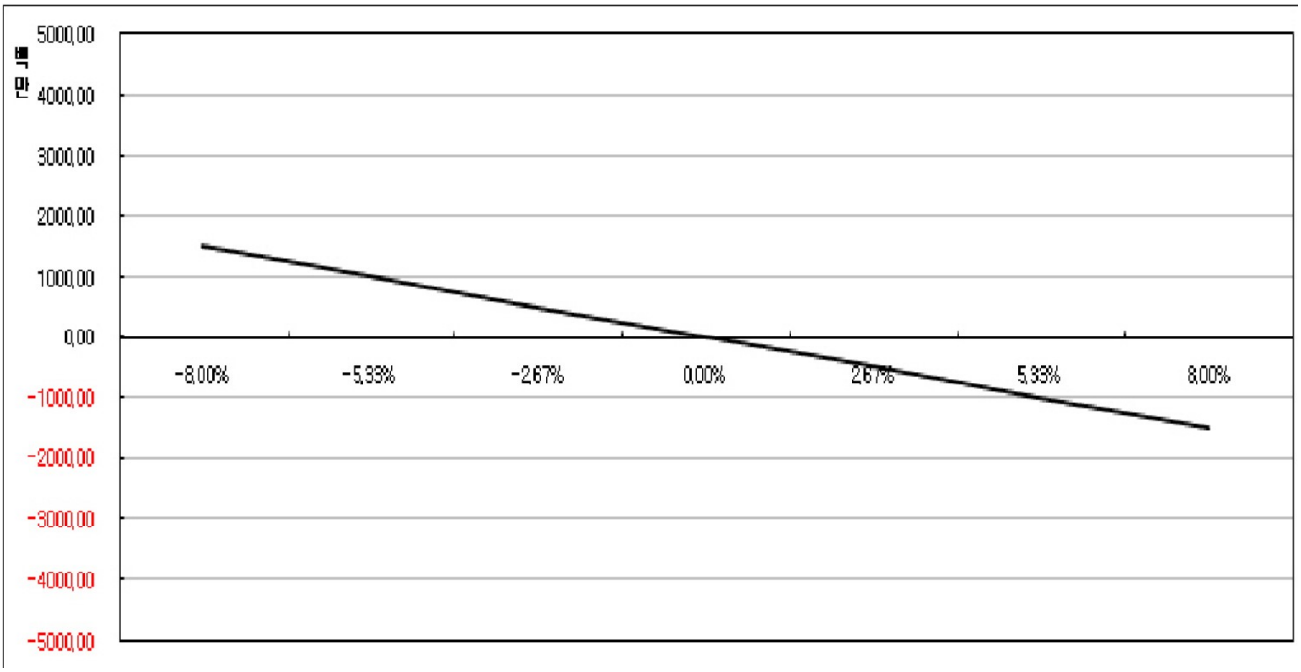
공시일: 2020-02-27

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	1,680	-1,680	장내
합계			0	1,680	-1,680	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

134

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

116

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

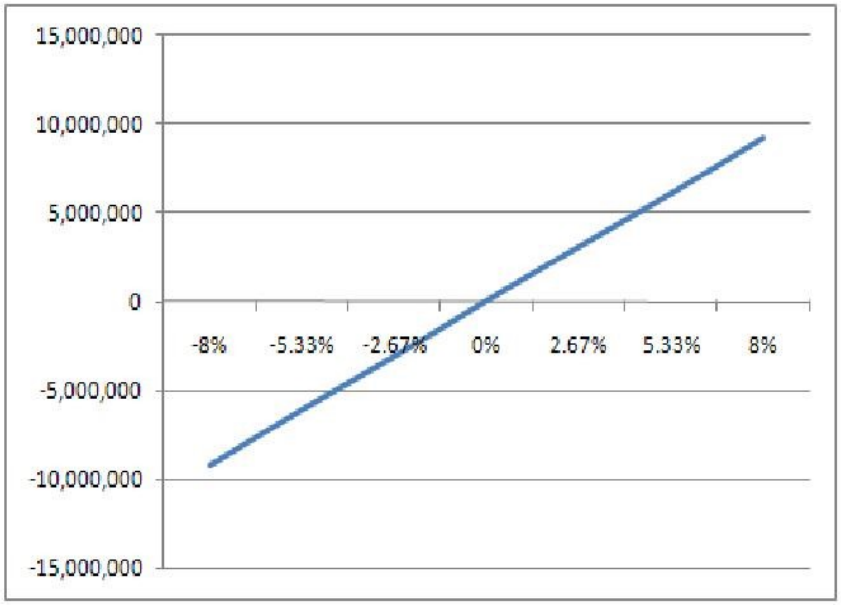
공시일: 2020-02-27

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	73,554	0	73,554	장내
합계			73,554	0	73,554	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,886

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

8,918