펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2020-02-28

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	1,247	0	1,247	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	44	0	44	장내
합계			1,290	0	1,290	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

41

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

263

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

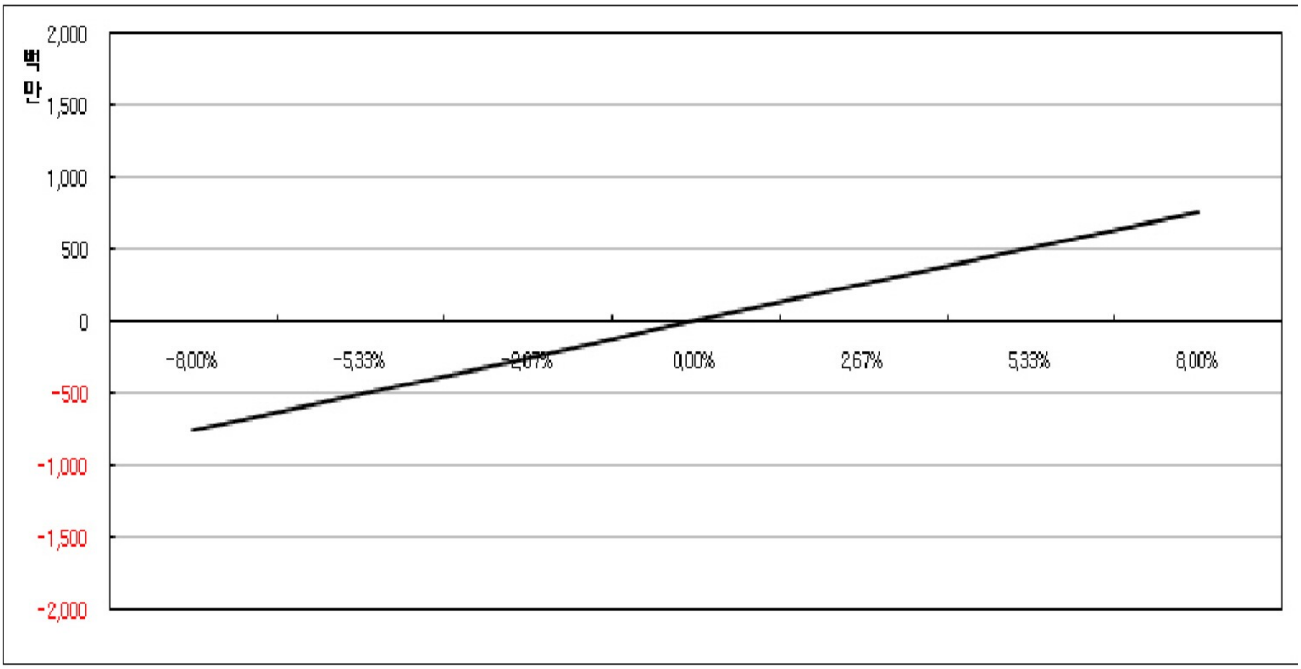
공시일: 2020-02-28

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	416	0	416	장내
합계			416	0	416	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

33

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

364

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

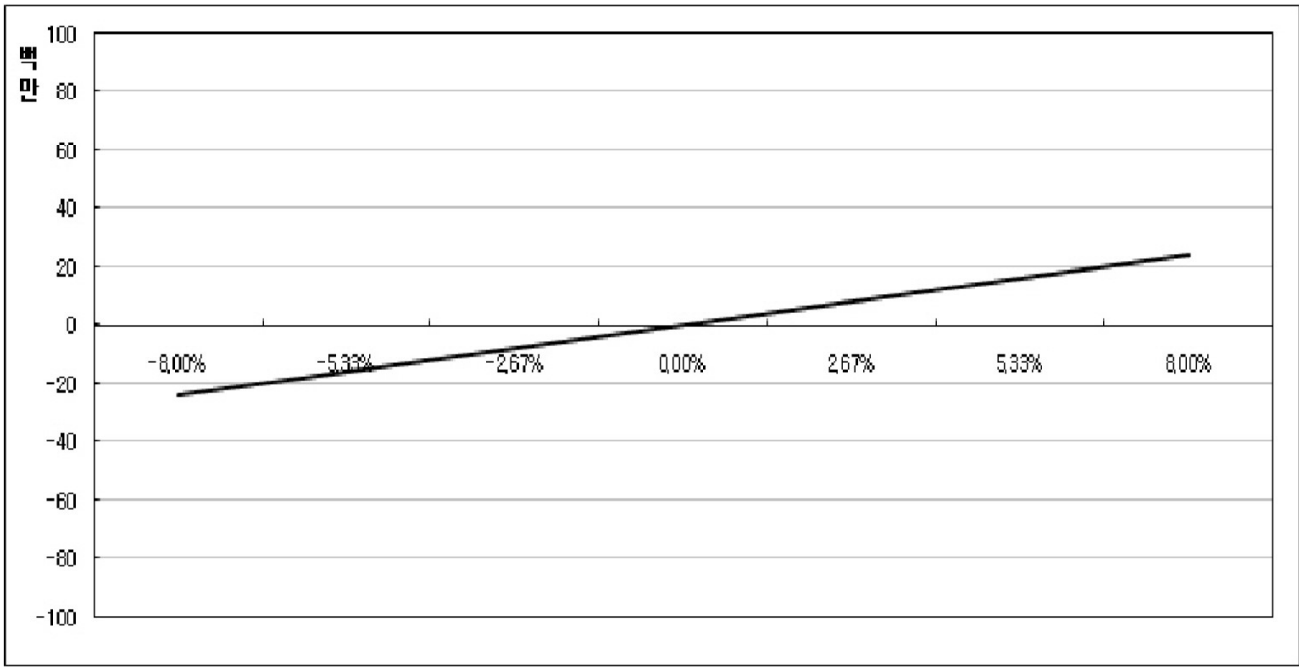
공시일: 2020-02-28

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

106

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

506

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

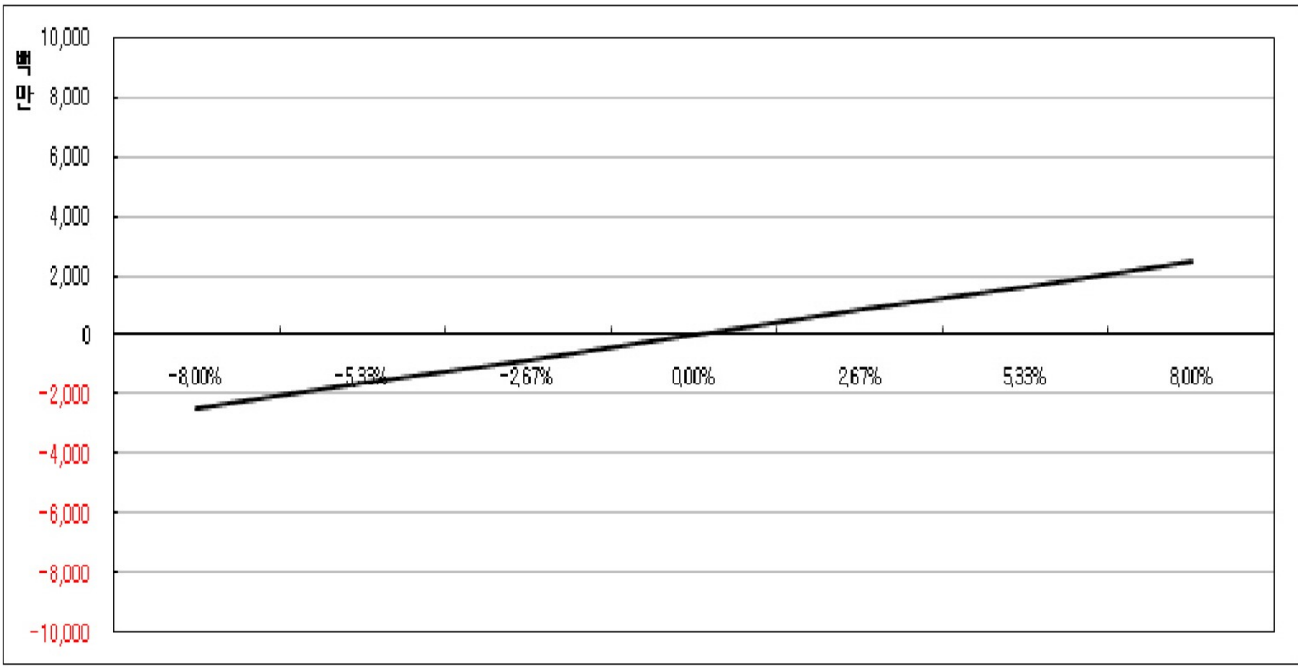
공시일: 2020-02-28

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	277	69	208	장내
누계	주가지수	선물	3,949	0	3,949	장내
합계			3,949	0	3,949	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

317

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

928

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

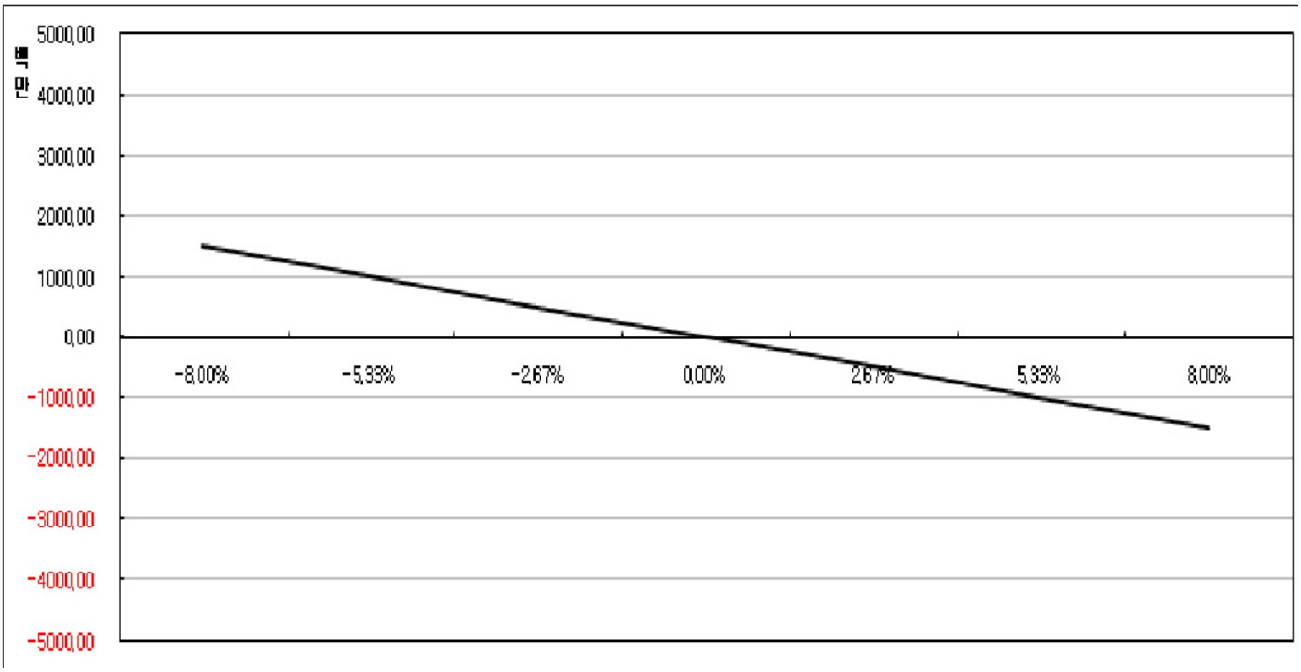
공시일: 2020-02-28

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	139	-139	장내
누계	주가지수	선물	0	1,801	-1,801	장내
합계			0	1,801	-1,801	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

144

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

125

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

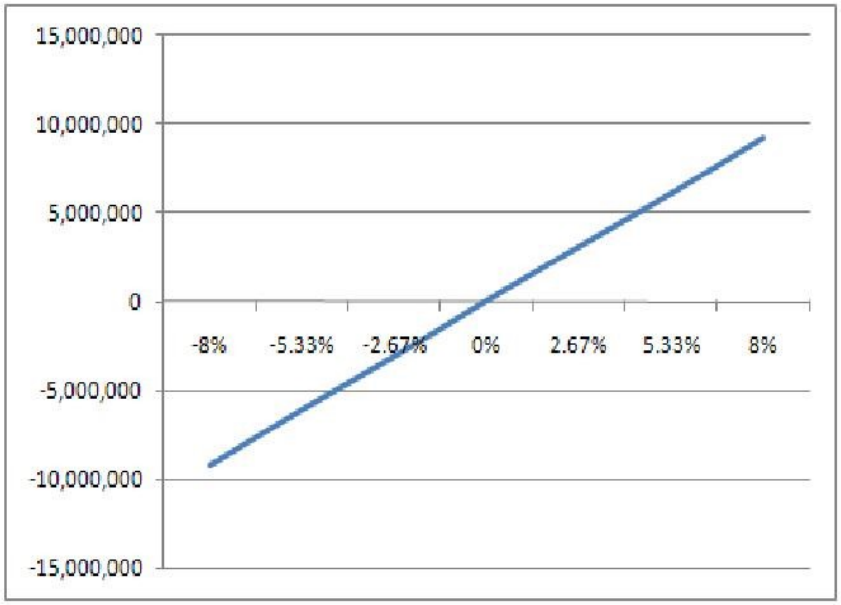
공시일: 2020-02-28

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	72,805	0	72,805	장내
합계			72,805	0	72,805	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,838

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

8,873