펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2019-10-16

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	1,509	0	1,509	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	2	2,675	-2,673	장내
합계			1,511	2,675	-1,164	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

60

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

502

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

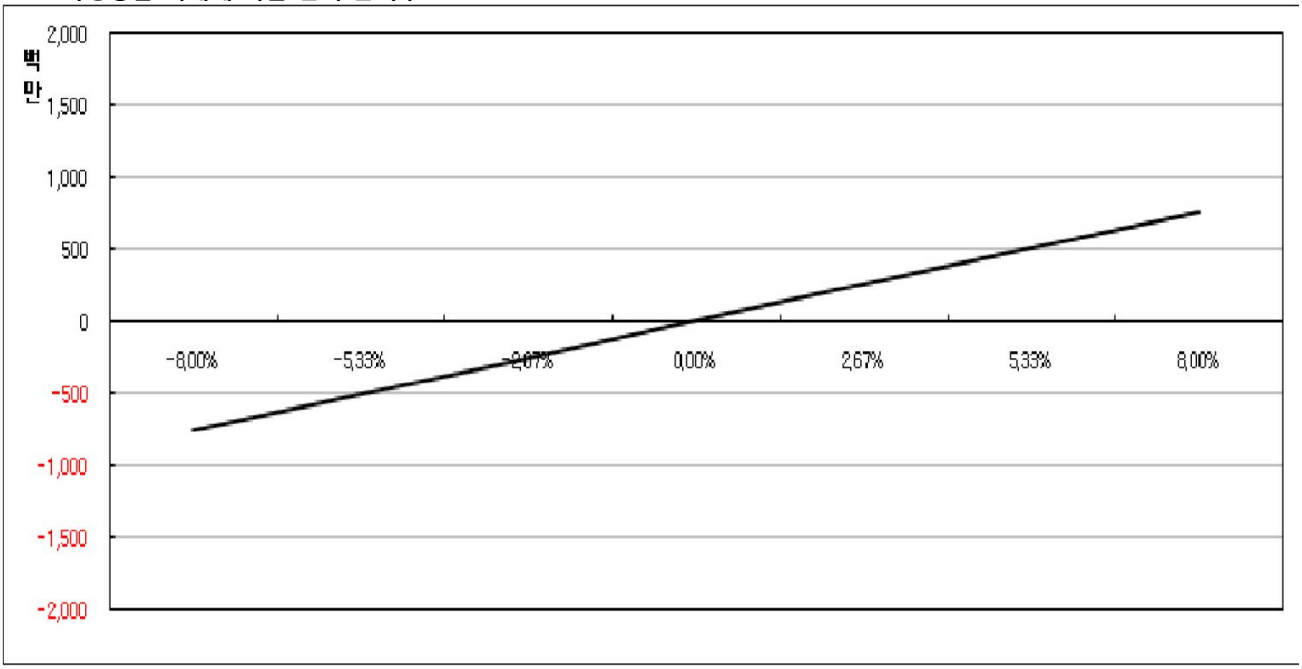
공시일: 2019-10-16

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	137	0	137	장내
합계			137	0	137	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

11

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

373

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

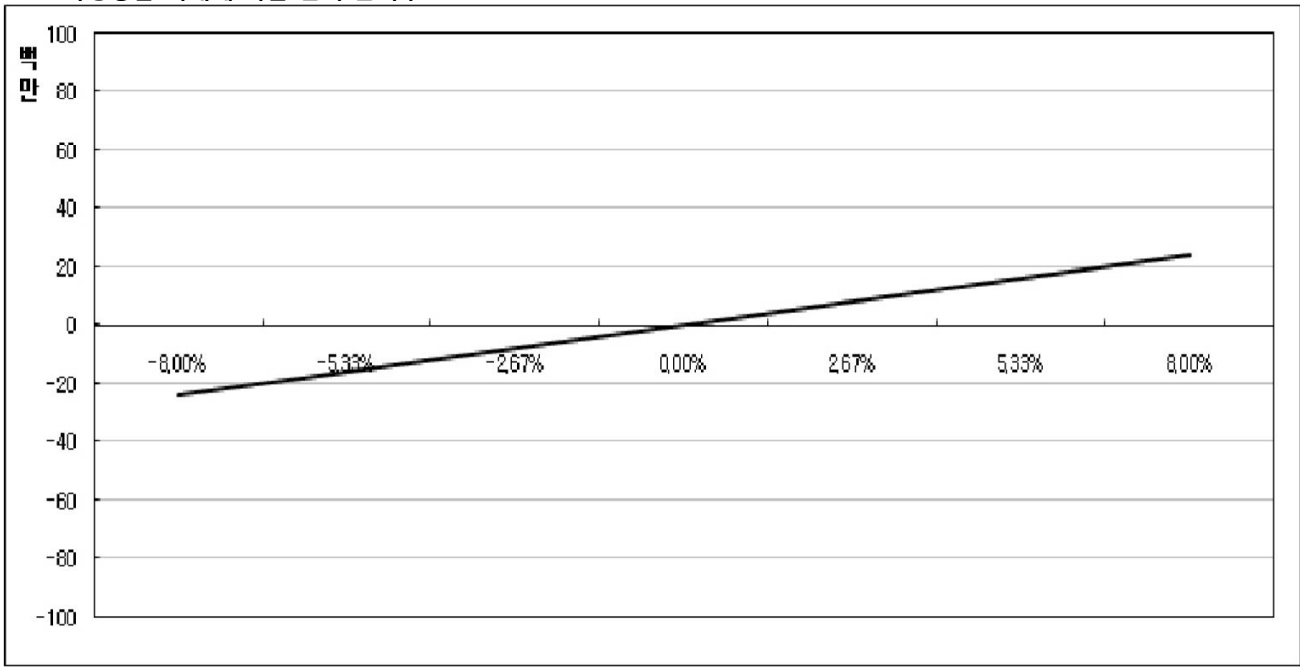
공시일: 2019-10-16

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	1,097	0	1,097	장내
합계			1,097	0	1,097	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

88

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

464

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

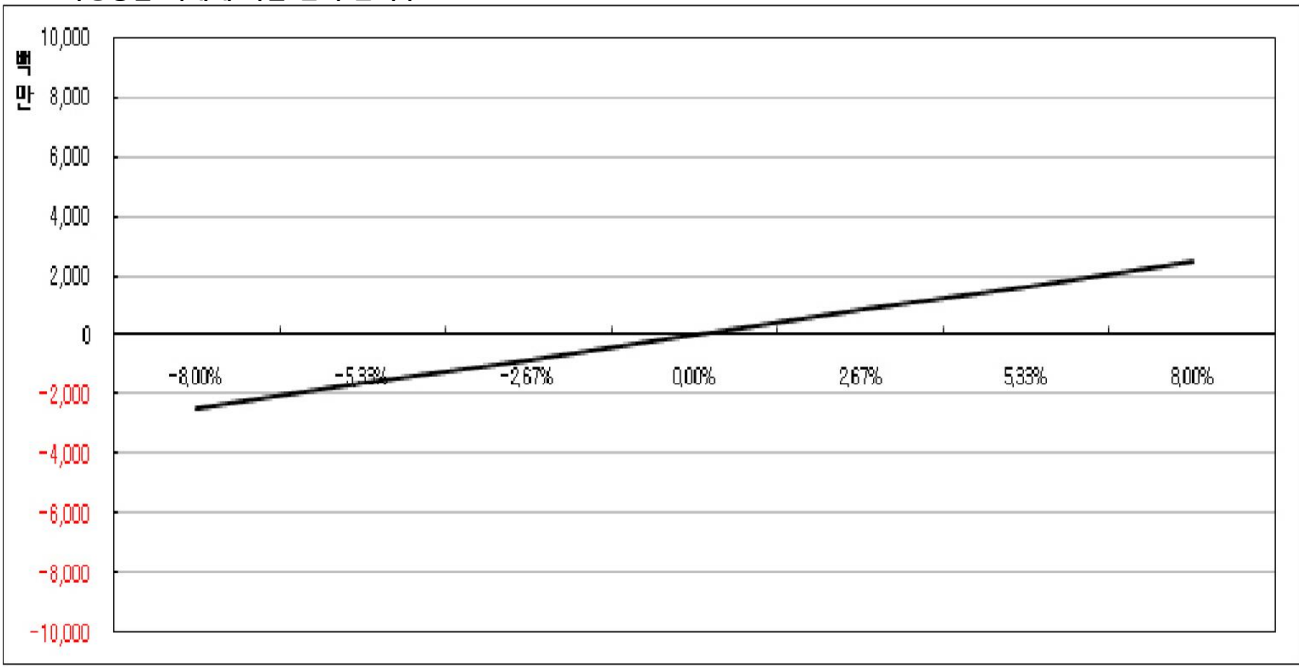
공시일: 2019-10-16

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	5,212	0	5,212	장내
합계			5,212	0	5,212	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

419

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

924

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

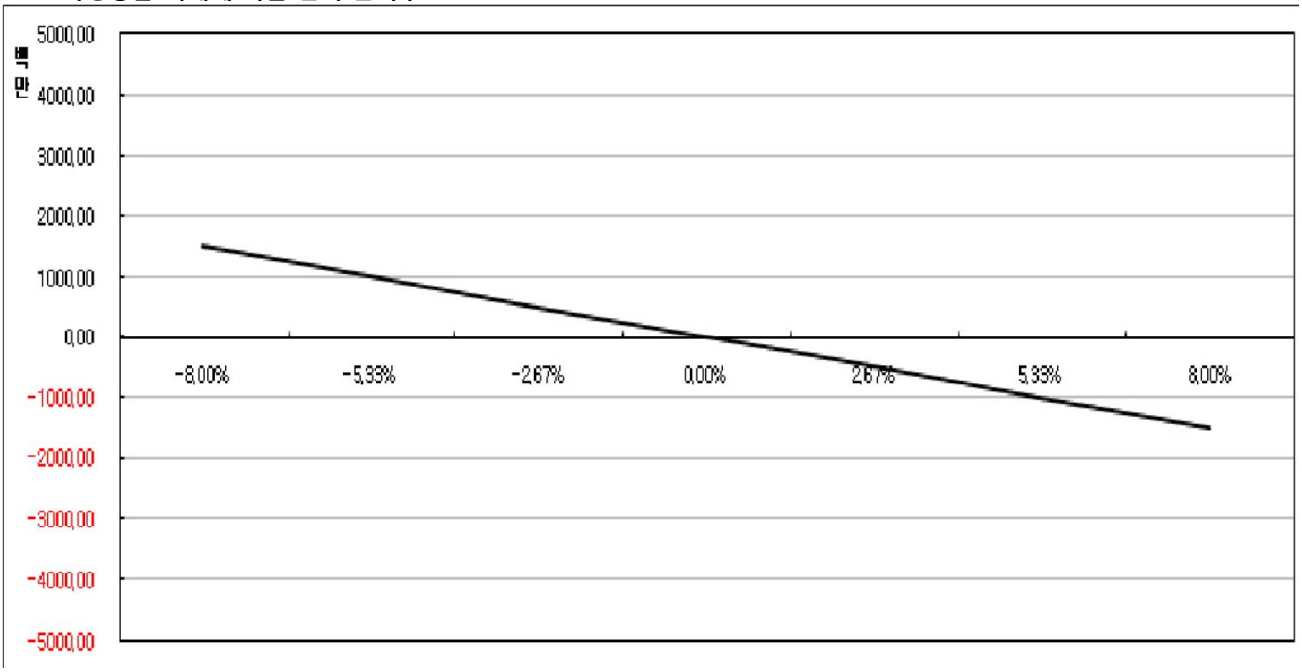
공시일: 2019-10-16

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	1,920	-1,920	장내
합계			0	1,920	-1,920	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

154

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

128

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

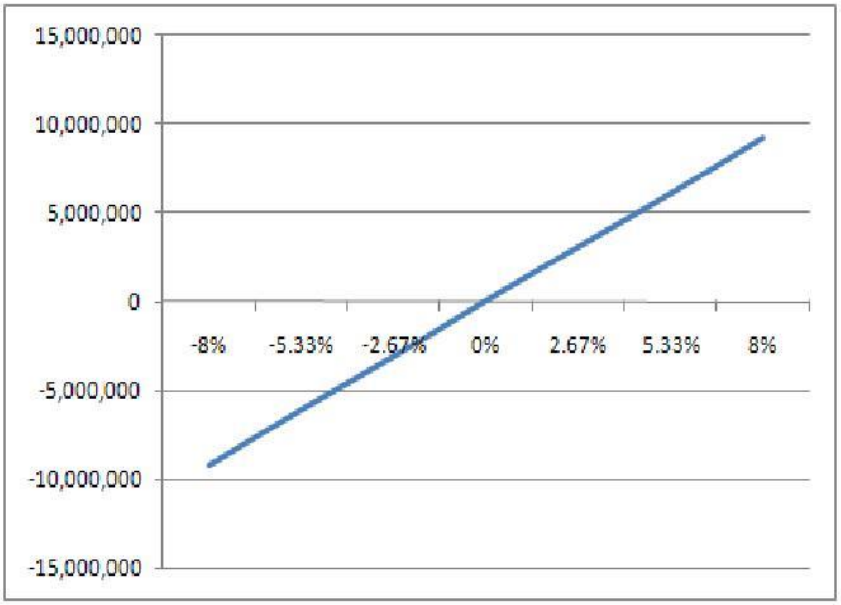
공시일: 2019-10-16

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	412	-412	장내
누계	주가지수	선물	66,459	0	66,459	장내
합계			66,459	0	66,459	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,336

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

8,720