펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2019-10-18

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	1,516	0	1,516	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	2	2,687	-2,685	장내
합계			1,517	2,687	-1,170	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

69

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

472

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

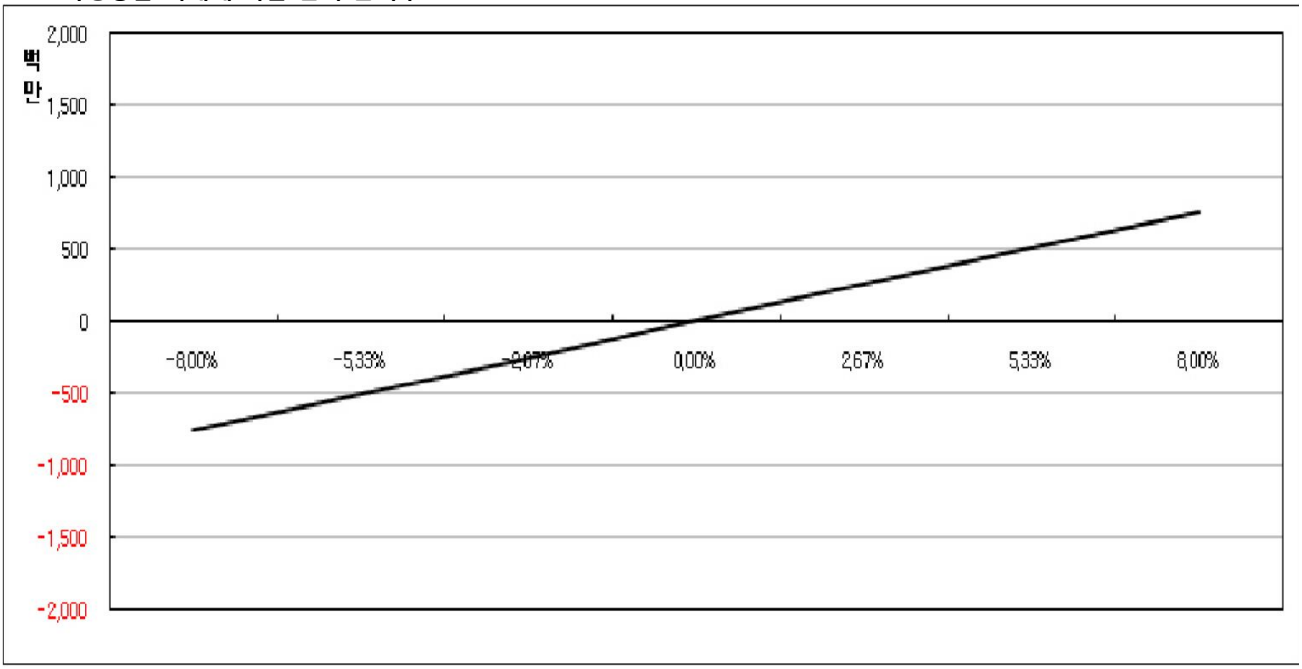
공시일: 2019-10-18

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	276	0	276	장내
누계	주가지수	선물	413	0	413	장내
합계			413	0	413	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

33

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

354

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

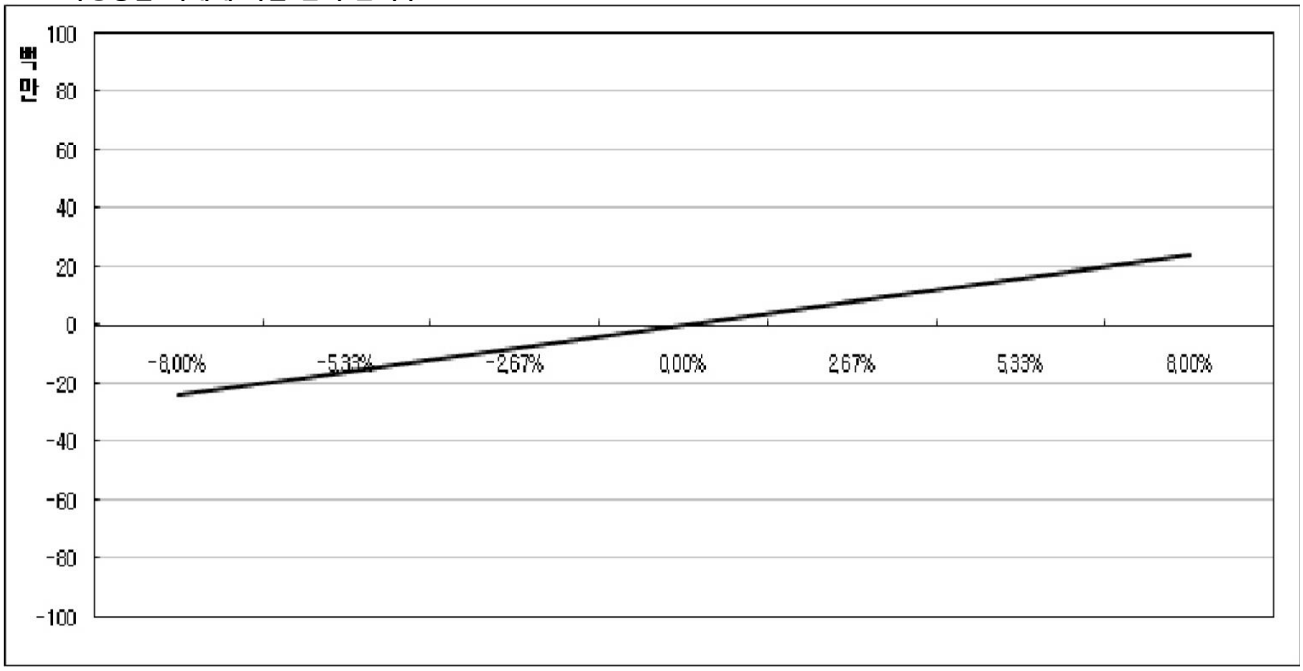
공시일: 2019-10-18

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	1,102	0	1,102	장내
합계			1,102	0	1,102	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

88

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

465

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

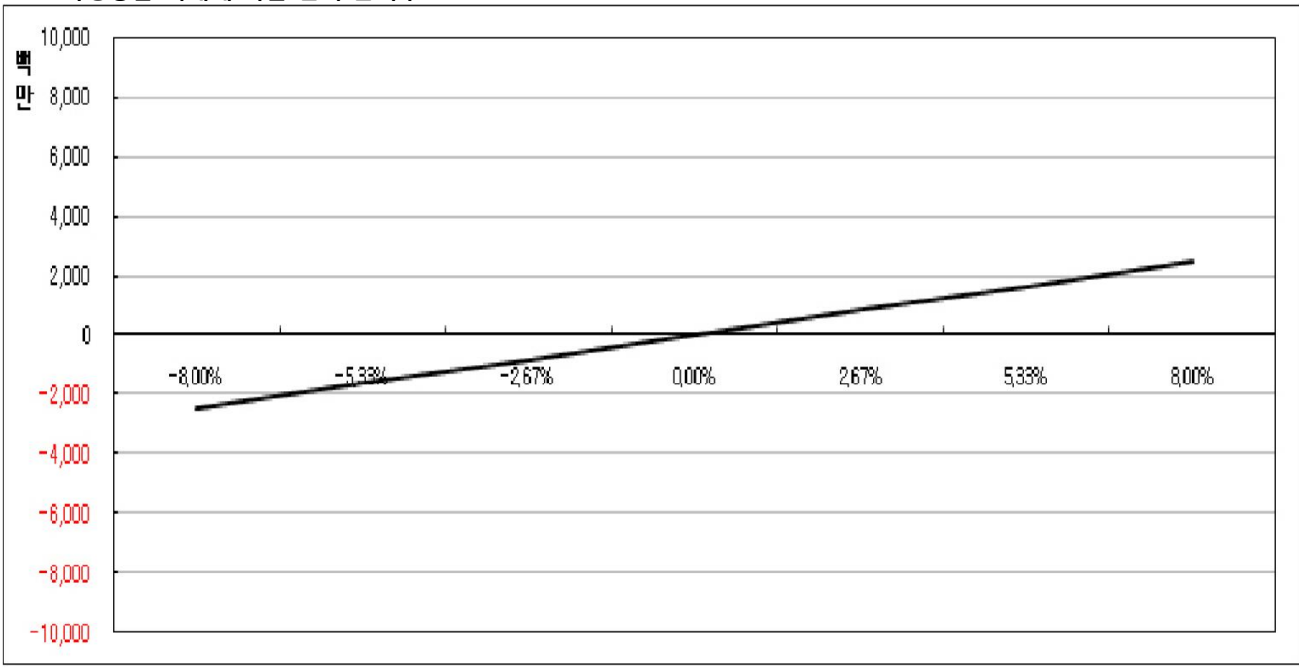
공시일: 2019-10-18

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	138	207	-69	장내
누계	주가지수	선물	5,167	0	5,167	장내
합계			5,167	0	5,167	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

414

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

922

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

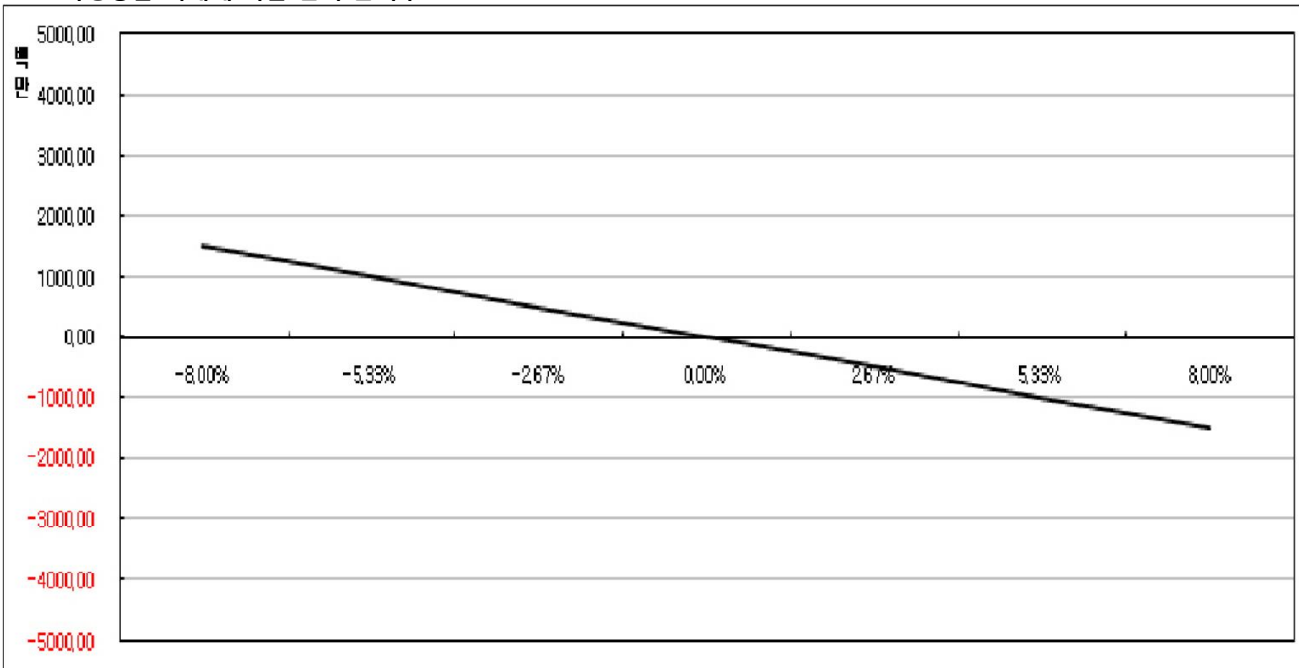
공시일: 2019-10-18

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	1,791	-1,791	장내
합계			0	1,791	-1,791	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

143

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

119

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

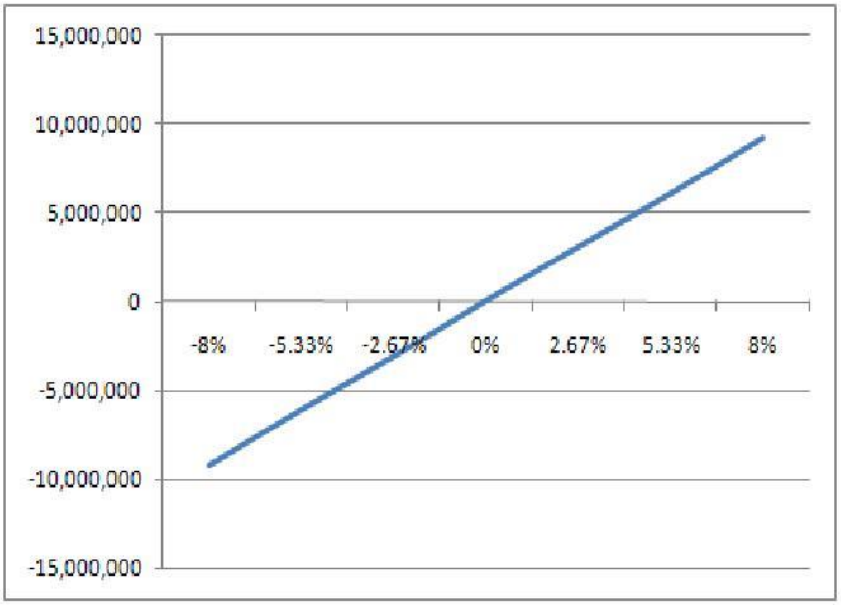
공시일: 2019-10-18

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	482	-482	장내
누계	주가지수	선물	65,586	0	65,586	장내
합계			65,586	0	65,586	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,251

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

8,664