펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2019-10-21

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	1,500	0	1,500	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	2	2,660	-2,658	장내
합계			1,503	2,660	-1,157	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

56

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

320

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

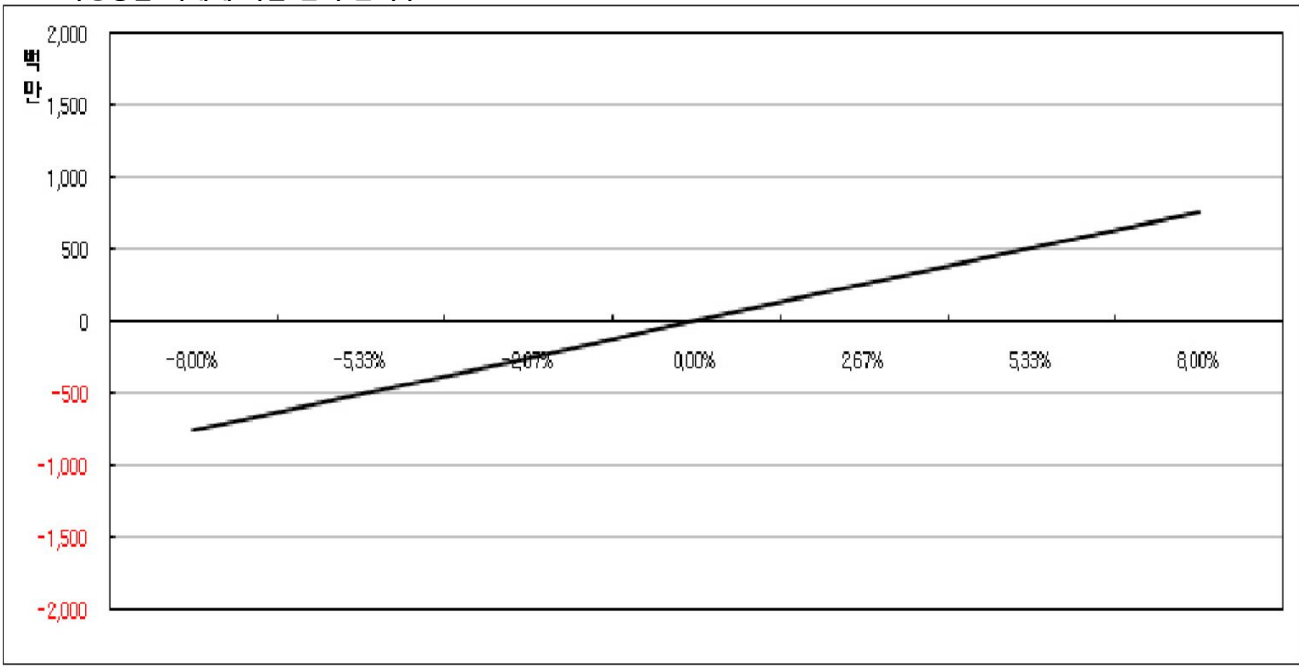
공시일: 2019-10-21

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	409	0	409	장내
합계			409	0	409	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

33

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

349

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

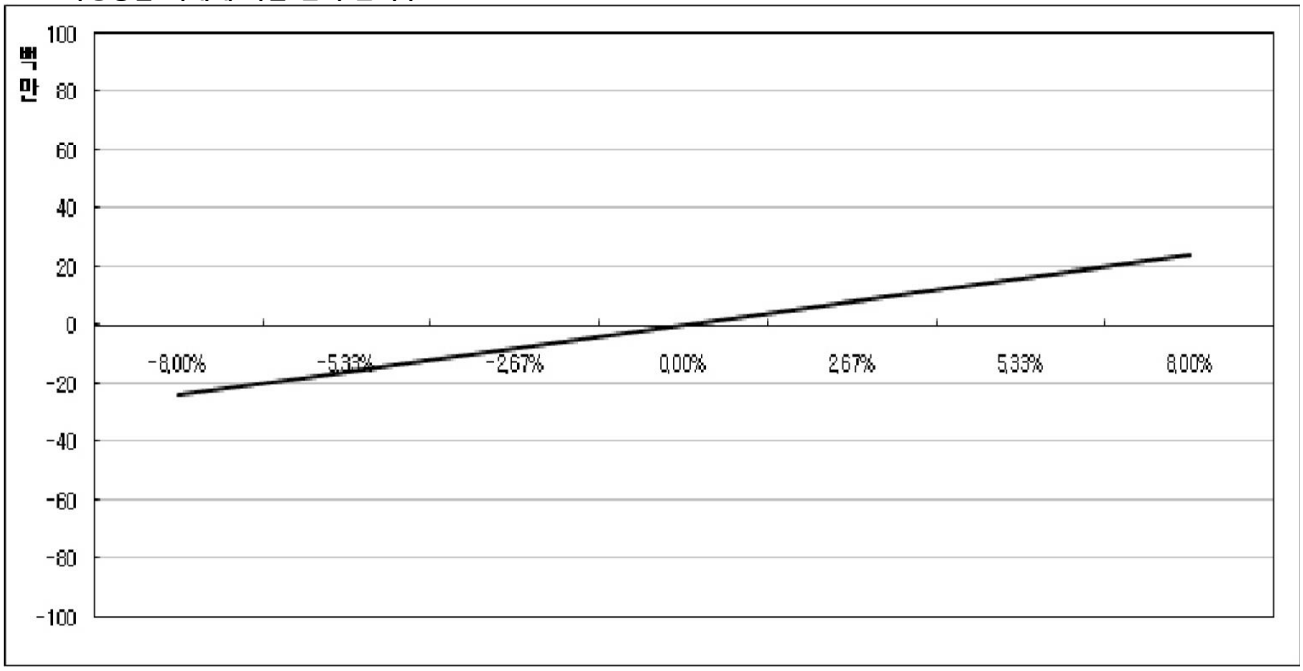
공시일: 2019-10-21

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	1,091	0	1,091	장내
합계			1,091	0	1,091	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

87

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

459

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

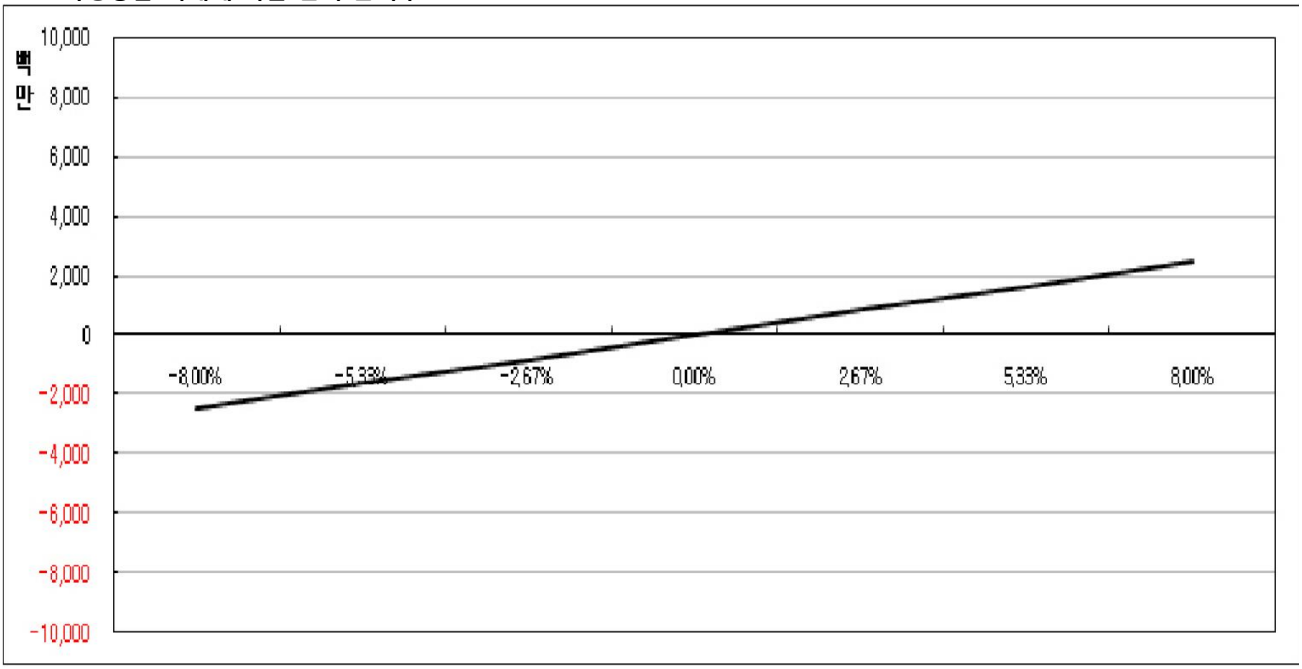
공시일: 2019-10-21

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	5,115	0	5,115	장내
합계			5,115	0	5,115	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

410

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

912

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

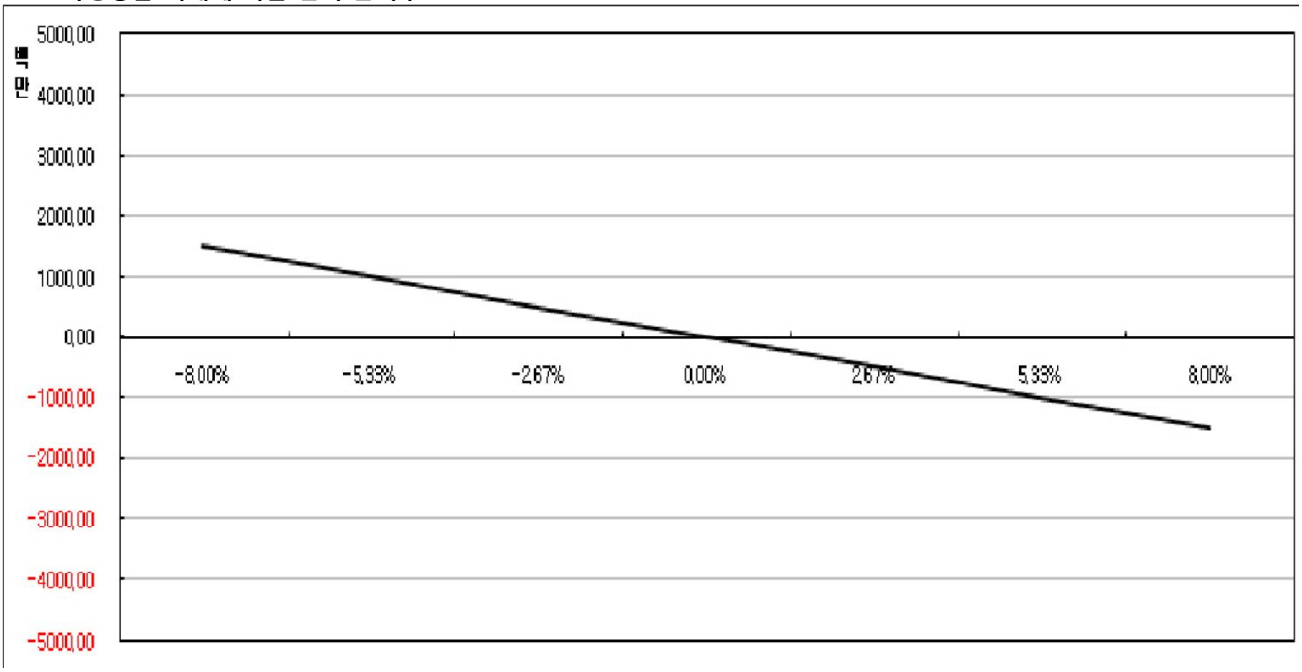
공시일: 2019-10-21

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	136	-136	장내
누계	주가지수	선물	0	1,910	-1,910	장내
합계			0	1,910	-1,910	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

153

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

128

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

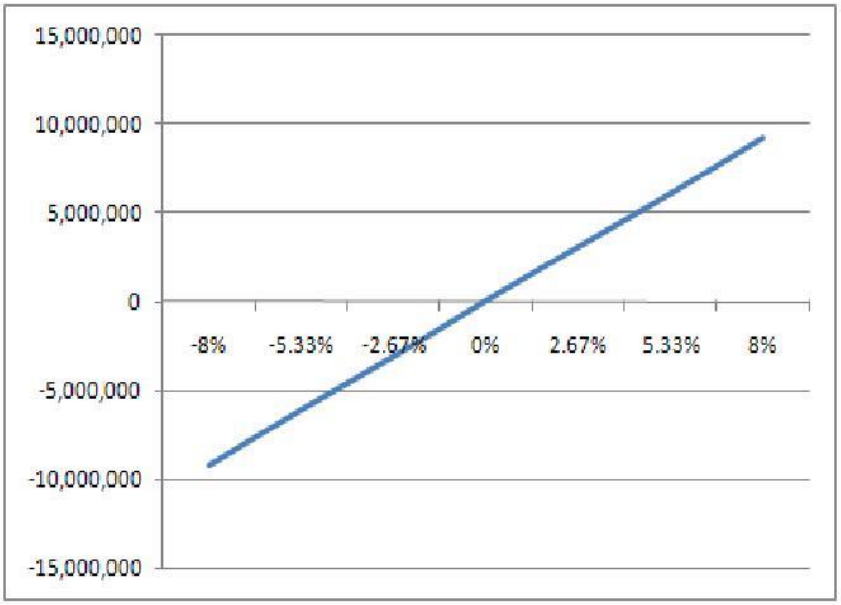
공시일: 2019-10-21

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	750	0	750	장내
누계	주가지수	선물	65,679	0	65,679	장내
합계			65,679	0	65,679	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,266

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

8,616