펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2019-11-12

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	1,545	0	1,545	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	0	2,738	-2,738	장내
합계			1,545	2,738	-1,194	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

95

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

109

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

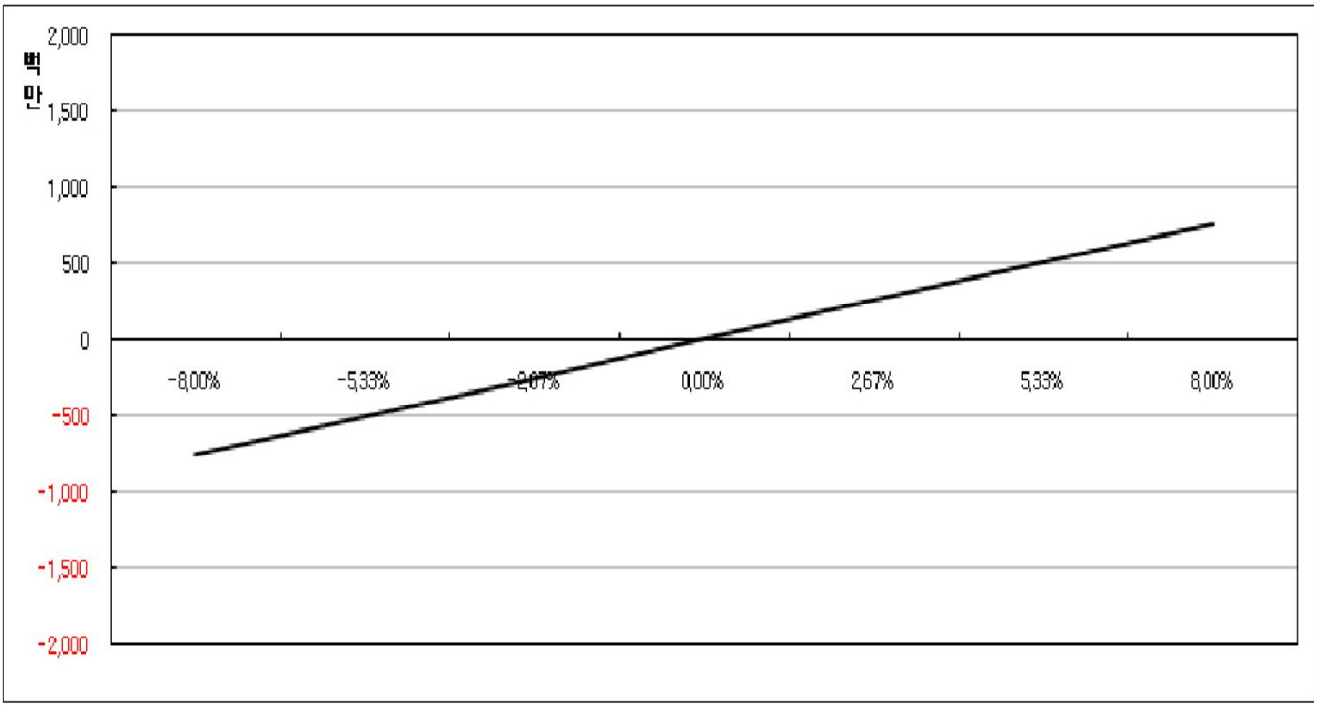
공시일: 2019-11-12

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	421	0	421	장내
합계			421	0	421	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

34

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

337

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

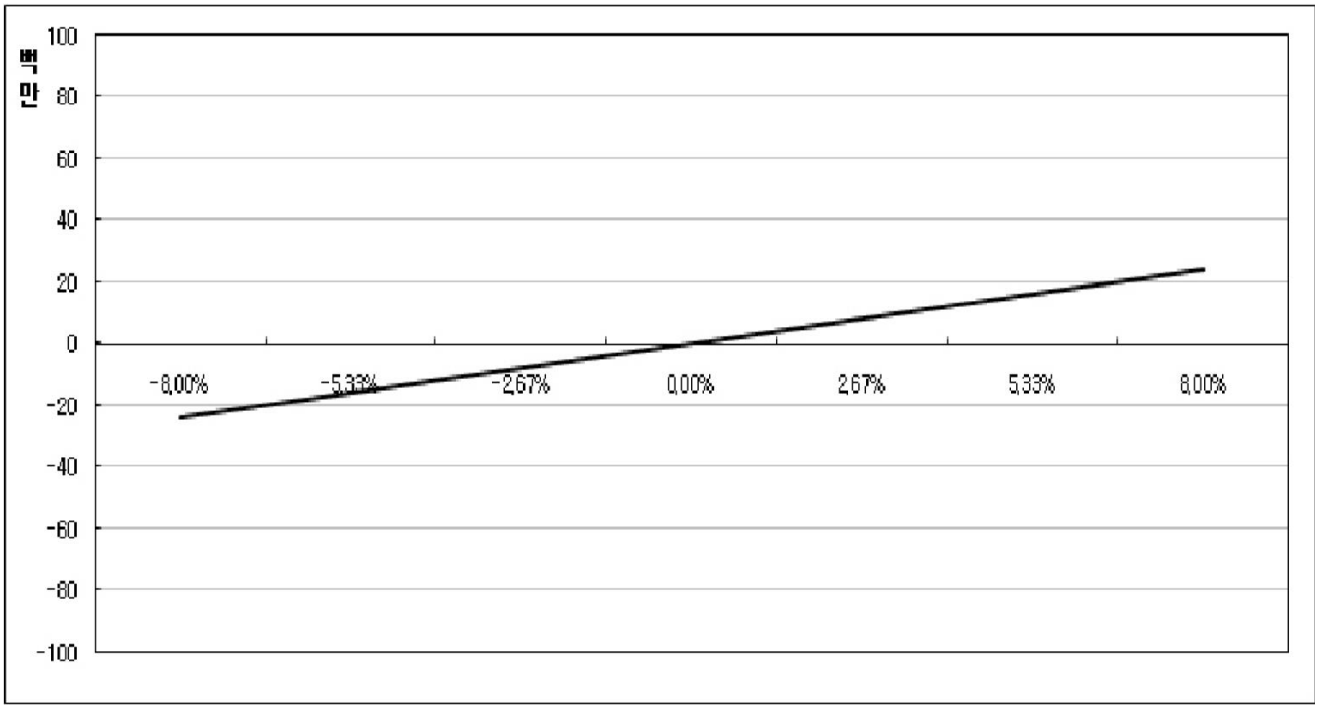
공시일: 2019-11-12

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	1,123	0	1,123	장내
합계			1,123	0	1,123	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

90

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

443

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

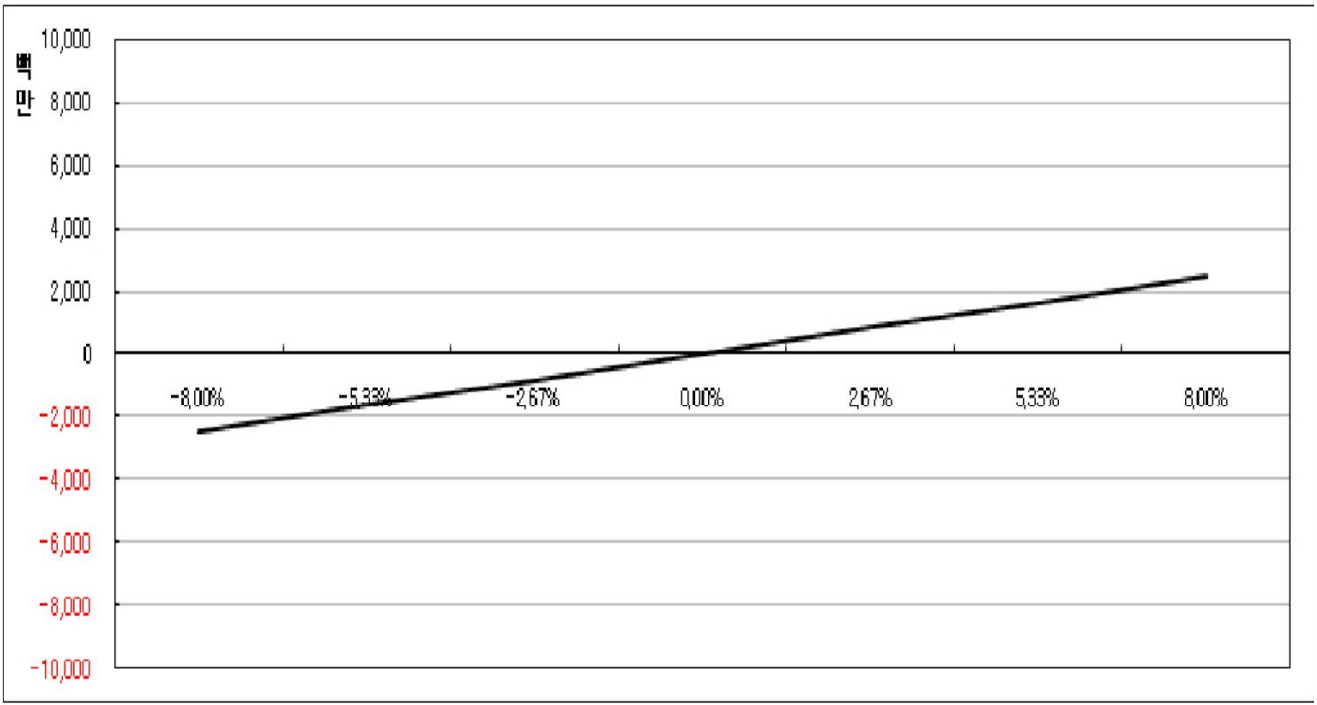
공시일: 2019-11-12

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	211	0	211	장내
누계	주가지수	선물	4,704	0	4,704	장내
합계			4,704	0	4,704	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

377

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

862

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

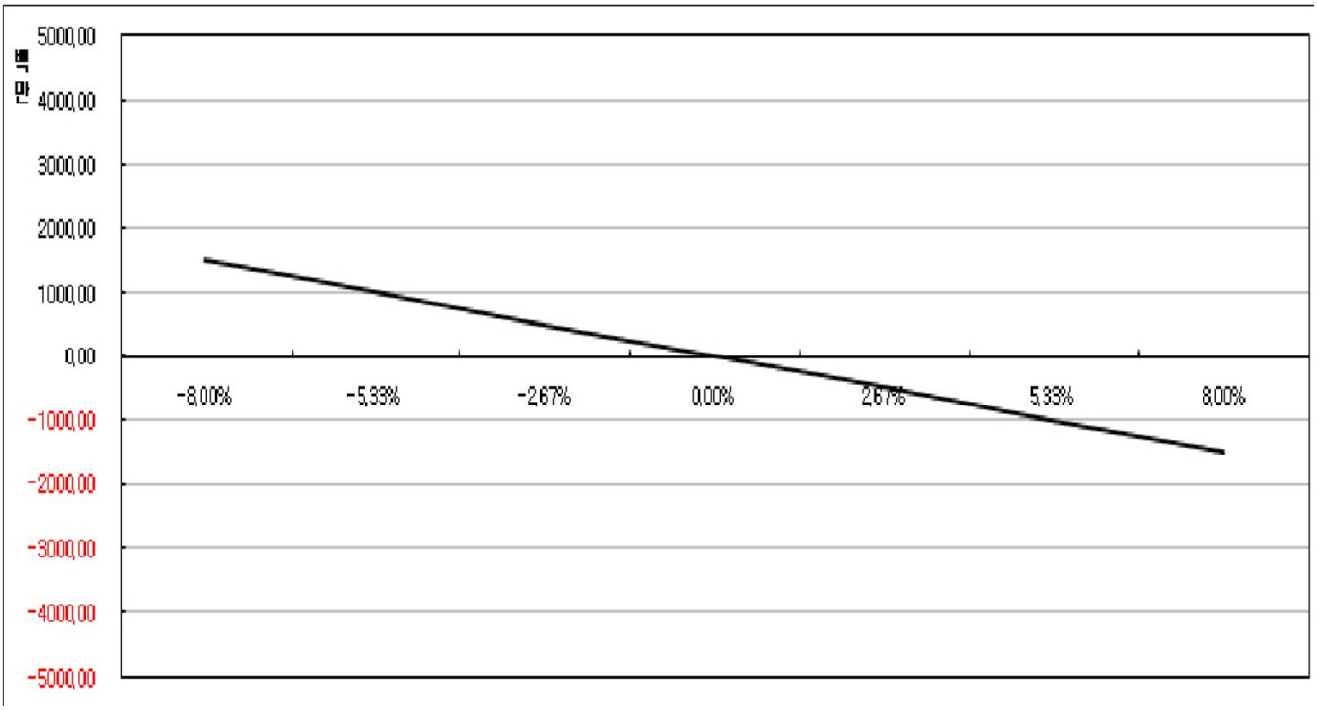
공시일: 2019-11-12

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	0	1,966	-1,966	장내
합계			0	1,966	-1,966	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

157

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

124

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

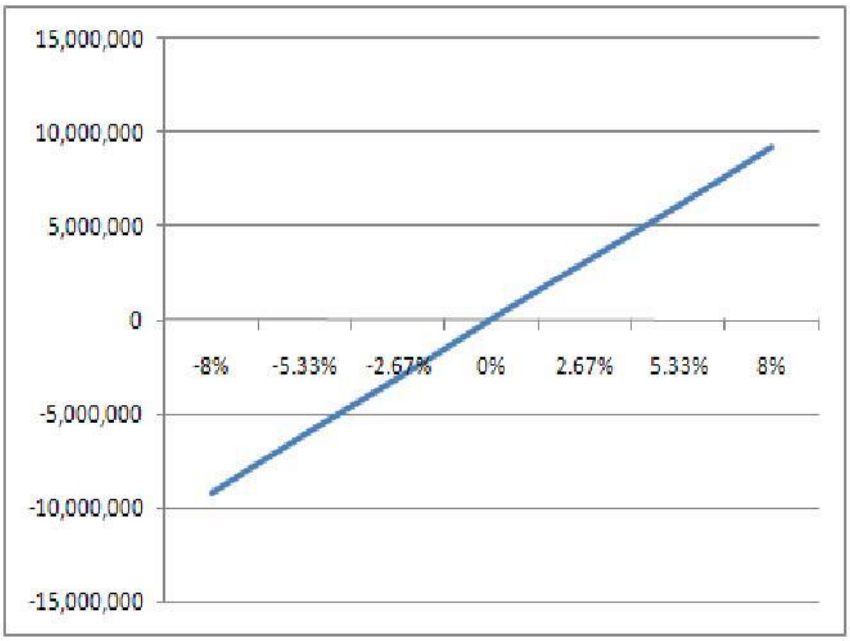
공시일: 2019-11-12

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	702	0	702	장내
누계	주가지수	선물	63,893	0	63,893	장내
합계			63,893	0	63,893	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,118

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

7,940