펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2019-11-28

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	1,485	0	1,485	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	4	2,758	-2,754	장내
합계			1,489	2,758	-1,269	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	72

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	144

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

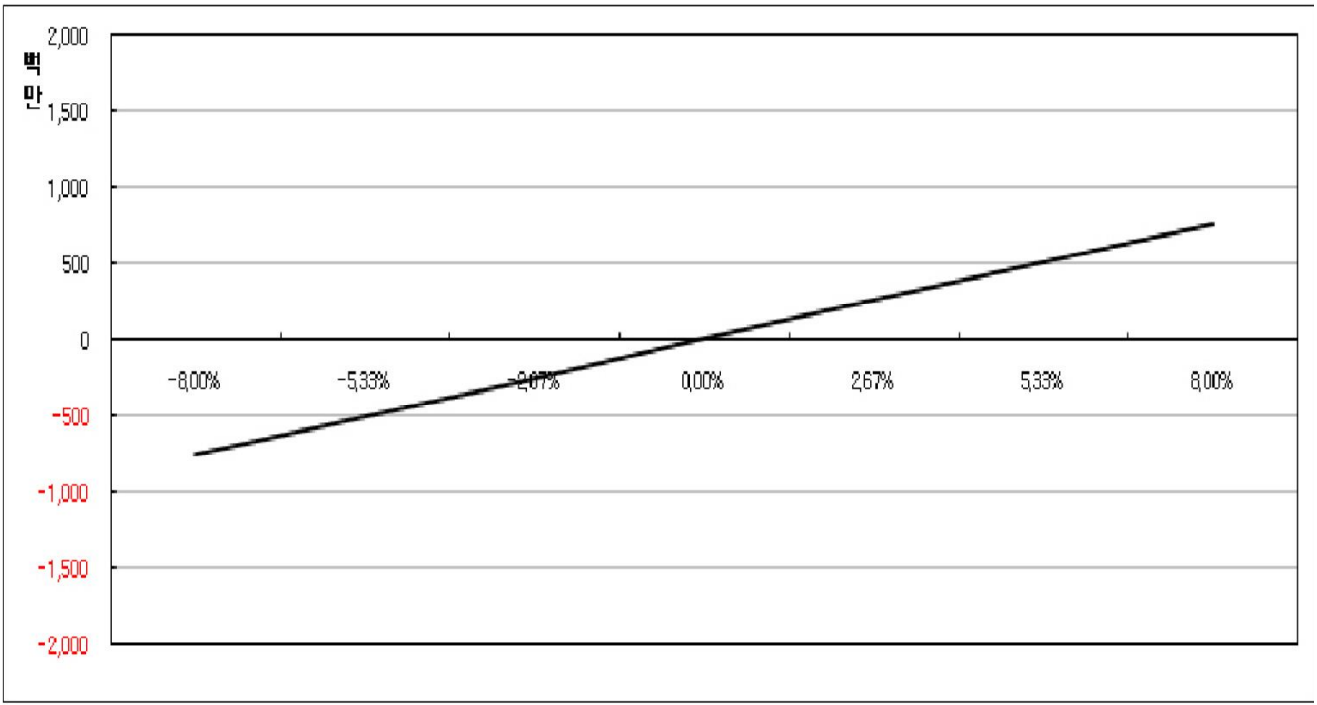
공시일: 2019-11-28

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	354	0	354	장내
합계			354	0	354	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

28

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

342

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

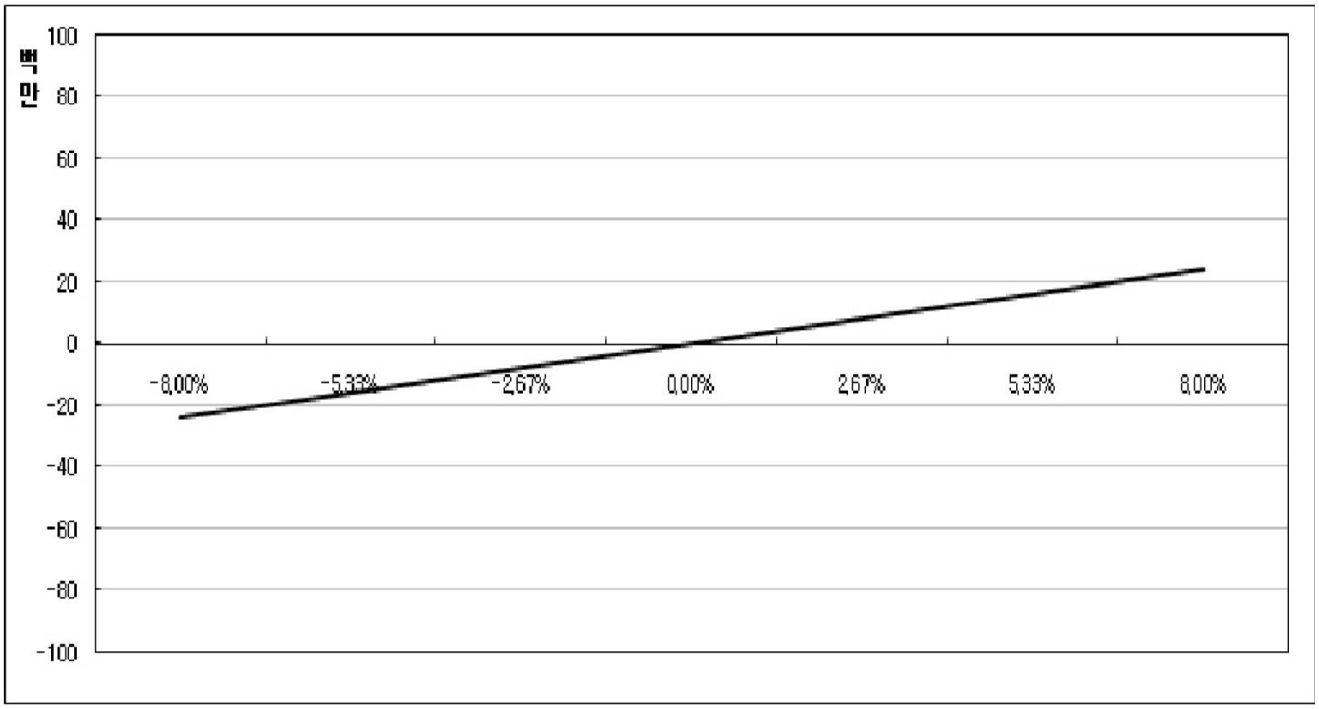
공시일: 2019-11-28

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	1,131	0	1,131	장내
합계			1,131	0	1,131	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

91

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

449

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

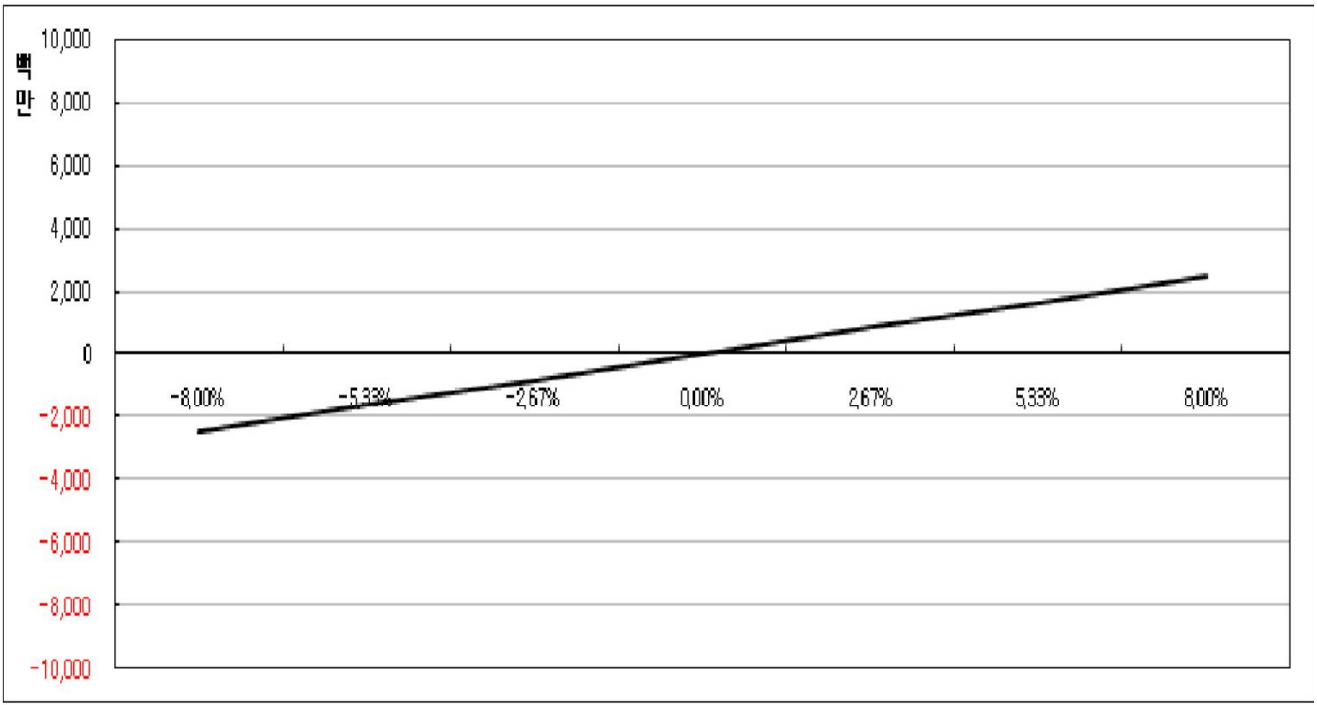
공시일: 2019-11-28

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	4,313	0	4,313	장내
합계			4,313	0	4,313	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

345

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

859

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

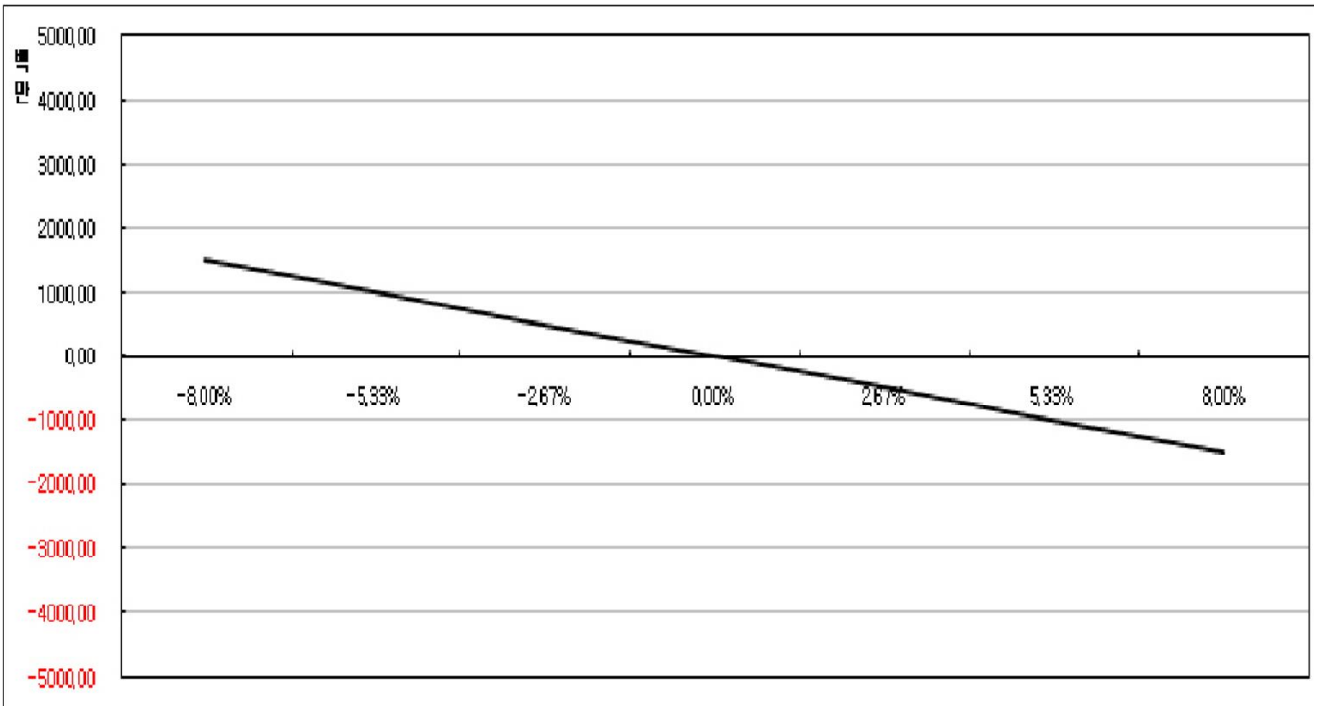
공시일: 2019-11-28

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	212	-212	장내
누계	주가지수	선물	0	1,980	-1,980	장내
합계			0	1,980	-1,980	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

159

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

126

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

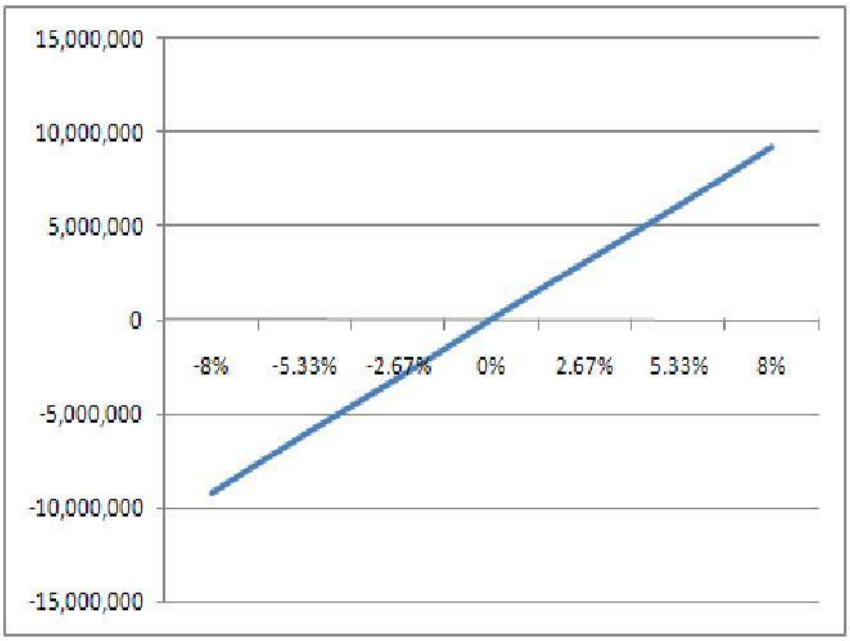
공시일: 2019-11-28

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	354	-354	장내
누계	주가지수	선물	69,723	0	69,723	장내
합계			69,723	0	69,723	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,582

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

8,390